コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）

愛称「コアラップ（切替型ワイド）」

追加型投信／内外／資産複合

投資信託説明書
（請求目論見書）

2025年4月11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。

コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）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 4月10日に関東財務局長に提出しており、2025年 4月11日にその届出の効力が生じております。

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

目次

第一部【証券情報】 1
（１）【ファンドの名称】 1
（２）【内国投資信託受益証券の形態等】 1
（３）【発行（売出）価額の総額】 1
（４）【発行（売出）価格】 1
（５）【申込手数料】 1
（６）【申込単位】 1
（７）【申込期間】 2
（８）【申込取扱場所】 2
（９）【払込期日】 2
（１０）【払込取扱場所】 2
（１１）【振替機関に関する事項】 2
（１２）【その他】 2
第二部【ファンド情報】 4
第１【ファンドの状況】 4
１【ファンドの性格】 4
２【投資方針】 14
３【投資リスク】 79
４【手数料等及び税金】 83
５【運用状況】 91
第２【管理及び運営】 133
１【申込（販売）手続等】 133
２【換金（解約）手続等】 134
３【資産管理等の概要】 136
４【受益者の権利等】 140
第３【ファンドの経理状況】 141
１【財務諸表】 144
２【ファンドの現況】 536
第４【内国投資信託受益証券事務の概要】 542
第三部【委託会社等の情報】 543
第１【委託会社等の概況】 543
１【委託会社等の概況】 543
２【事業の内容及び営業の概況】 544
３【委託会社等の経理状況】 545
４【利害関係人との取引制限】 580
５【その他】 580
約款

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

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

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

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

（5）【申込手数料】

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

（6）【申込単位】

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

（7）【申込期間】

2025年 4月11日から2025年10月10日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（8）【申込取扱場所】

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

（9）【払込期日】

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

（10）【払込取扱場所】

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

（11）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（12）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申

込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜申込みコース＞

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

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

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

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

＜スイッチング＞

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

＜受付不可日＞に該当する場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　１兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

一般社団法人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	ＭＲＦ	特殊型
	内外	不動産投信	ＥＴＦ	
		その他資産 (　　)		
		資産複合		

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人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ないファンドをいう。
(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

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

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

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

［補足分類］

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

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

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

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

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

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

［特殊型］

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

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

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

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

◆ESG 分類：当ファンドは ESG 投信ではありません。

＜ファンドの特色＞

1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

●投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。

●今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

●保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。

●市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド※1等に投資し、オルタナティブ運用※2を行います。

※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。

※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性（相関性）が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

●各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係（相関関係）、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた機動的な調整を行います。

●投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。
従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

●「株式」、「リート」、「コモディティ」を実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90％未満とします。

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

●市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

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。

投資割合の決定・見直し(年1回)

STEP1	各資産の中長期的な期待リターン、リスク(標準偏差)、相関係数(各資産間の値動きの関係性を示す係数)を推定
STEP2	資産間の分散を徹底するため、資産毎の投資割合の制約条件(上限値または下限値)を設定
STEP3	資産毎の期待リターン・リスク・相関係数や制約条件をもとに、中長期的な見通しから「安定型ポートフォリオ」「積極成長型ポートフォリオ」を決定
STEP4	【切替機能(*)】2つのポートフォリオの範囲内で、短期的な市場動向等に応じて、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合を調整

投資対象ファンドの決定・見直し(随時)

STEP1	各資産の投資対象ファンドの特徴や運用パフォーマンス等を分析
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、各資産や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資産の売却や値下がりした資産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。

<(*)「コアラップ(切替型ワイド)」の切替機能のイメージ>

短期的な市場環境等の変化に対応して、リスク水準の異なる2つのポートフォリオの範囲内で、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合を機動的に調整します。

安定型ポートフォリオ
債券や下値抵抗力が期待できるヘッジファンドの組入比率が高く、安定性を重視したポートフォリオ

市場環境等の変化に対応して、リスク水準の異なる2つのポートフォリオの範囲内で投資割合を調整

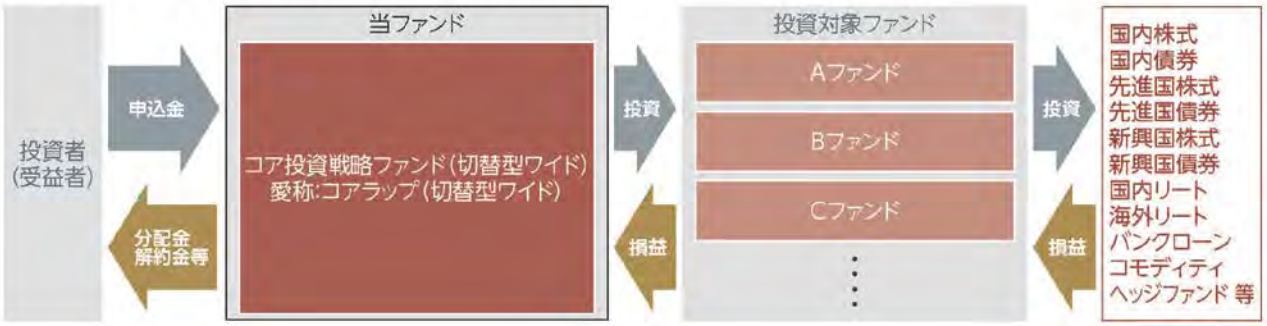
積極成長型ポートフォリオ
債券や高い収益が期待できる株式・新興国の資産などをバランスよく組み入れ、収益性を重視したポートフォリオ

コアラップ(切替型ワイド)
市場環境の変化を捉えた機動的な運用を行います。

※各ポートフォリオは適宜見直しを行います。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



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

ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

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

主な投資制限

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

〈ご参考情報〉

バンクローン

銀行などの金融機関が、事業拡大などのために資金調達を希望する企業などに対して行う融資(ローン)を指します。一般的に、バンクローンは投資適格未満の格付を有する企業への変動金利のローンです。

コモディティ

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

ヘッジファンド

ヘッジとは元々"回避する"という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド※などがあります。
※特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

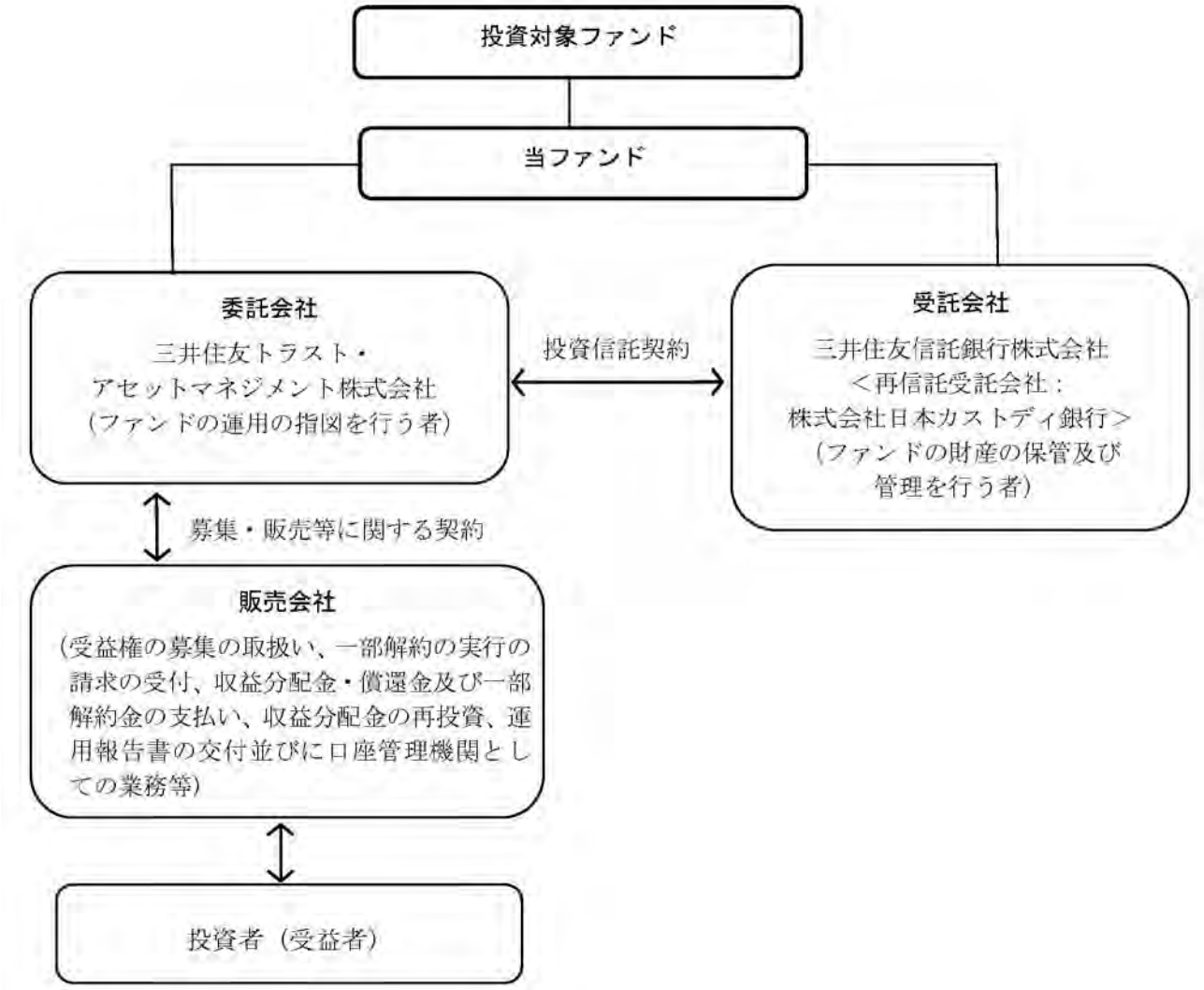
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2018 年 10 月 26 日　　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（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場合があります。

③投資態度

イ．主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ[*1]、ヘッジファンド[*2]及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

＊1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。

＊2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。

ロ．各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じても機動的に調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

※投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90％未満とします。

なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

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

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

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

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 1 項で定めるも

のをいいます。以下同じ。）

1．有価証券

2．金銭債権

3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1．為替手形

②有価証券の指図範囲

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

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等

2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの

3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）

4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

③金融商品の指図範囲

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要
・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。
以下の内容は、2025 年 1 月 31 日（(★）のファンドに関しては 2025 年 4 月 10 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. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している株式
投資態度	①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。 ③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は、行いません。 ③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。 ⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の５%以下とします。

	⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人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。
ベンチマーク	ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)
決算日	年 1 回：5 月 29 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000 年 5 月 30 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX（東証株価指数)」とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

①TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みＴＯＰＩＸ」という。）の指数値及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。

②ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みＴＯＰＩＸに係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。

③ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の配当込みＴＯＰＩＸの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。

④ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではない。

⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。

⑦ＪＰＸは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みＴＯＰＩＸの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。

⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

2.日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）（※）に連動する投資成果を目指します。 ②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の 50%以下とします。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人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。
ベンチマーク	MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）
決算日	年 1 回：4 月 5 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	2021年4月23日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

3.日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	①個別企業分析に、市場動向分析を積極的に付加し、投資銘柄を厳選することにより、ベンチマークであるＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）（※）に対する超過リターンを目指します。 ②株式の組入比率は、原則として信託財産総額の90%以上とします。 ③信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対

	象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑤信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑥信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ⑦信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ④投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ⑤同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ⑦同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ⑧一般社団法人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、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。 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、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年 1 回：11 月 30 日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2002 年 12 月 20 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

4. 国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	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、長期的な観点からわが国の株式市場全体（ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）（※））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の 50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の 5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行ないません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージ

	ャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人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なうこととします。 ⑤デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜　0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

5.日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。 ②信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。

	③事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。 ④投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。 ⑤ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。 ⑥市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②デリバティブ取引(法人税法第 61 条の 5 に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 20%以下とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑤投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑥外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 30%以下とします。 ⑦株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の 50%以下とします。 ⑧デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑨一般社団法人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およびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 2 回：6 月および 12 月の 15 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。 ②分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。

	③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜　0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

6.FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本株 EVI ハイアルファマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）（※）をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ・日本の株式を主要投資対象とします。 ・運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュー指標（ＰＢＲ、ＰＥＲ、配当利回り）等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。 ④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑤信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑥信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ⑦信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことができます。 ⑧安定した収益の確保および効率的な運用を行うためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第 61 条の５第１項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行いません。 イ．投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的 ロ．信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利

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

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

7. ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友 DS アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本グロース株マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本の株式を主要投資対象とし、ＧＡＲＰ（Growth at a Reasonable Price）戦略に基づき、アクティブ運用することにより信託財産の成長を目指して運用を行います。 ②銘柄選定に関しては、ボトムアップ・アプローチによる定性分析とバリュエーション分析を重視し、組織運用による銘柄選定を行います。 ③ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)（※）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ④株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の 50%以下とします。 ⑤デリバティブ取引（法人税法第 61 条の 5 で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑥資金動向、市況動向、残存期間等およびやむを得ない事情が発生した場合は上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの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。
ベンチマーク	TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
決算日	年 1 回：11 月 16 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ②収益分配金額は、運用会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、運用会社の判断により分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については特に制限を定めず、運用会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対して以下に定める率とします。 ・純資産総額 200 億円未満の部分 年率 0.495%（税抜　0.45%） ・純資産総額 200 億円以上 400 億円未満の部分

	年率0.44%（税抜　0.4%） ・純資産総額400億円以上の部分 年率0.385%（税抜　0.35%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2024年3月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

8.国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI 総合（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債
投資態度	①NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。
主な投資制限	①同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

	②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は、行いません。 ④一般社団法人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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年 1 回：5 月 29 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000 年 5 月 30 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

運用会社	マニュライフ・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてマニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。
投資態度	①マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 ②NOMURA-BPI 総合（※）を参考指数として、ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 ③マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ④大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、

	上記の運用が行われないことがあります。
主な投資制限	①債券への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。 ⑤一般社団法人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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑥デリバティブ取引等について、一般社団法人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。 ⑦同一銘柄の株式、転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑧信用取引、空売り、有価証券の借入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年１回：3 月 5 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。 ③留保益（収益分配に充てず信託財産内に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。
信託報酬	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発 10 年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の 21 日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発 10 年固定利付国債の利回り　　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率 0.264%（税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率 0.297%（税抜　0.27%） １%以上の場合 ・・・・・・・・純資産総額に対し、年率 0.33%（税抜　0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019 年 10 月 10 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI 総合」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポー

トフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。
同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

運用会社	明治安田アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として、邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等に実質的に投資し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	明治安田日本債券アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」ということがあります）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等へ分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②NOMURA-BPI 総合（※）をベンチマークとしてこれを中長期的に上回る投資成果を目指します。 ③信用リスクの低減を図るため、原則として取得時に信用ある格付会社による BBB 格相当以上の格付を有する公社債およびそれと同等の信用度を有すると判断した公社債に投資します。 ④債券市場は、長期的には経済のファンダメンタルズによって変動するという考えを基本としファンダメンタルズ分析を重視したアクティブ運用を行います。 ⑤マクロ経済分析をベースとした金利の方向性予測等に基づき、市況動向やリスク分散等を勘案して、デュレーションの調整、イールドカーブポジショニングのコントロールを行います。 ⑥公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。 ⑦資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑦外貨建資産への投資は行いません。 ⑧デリバティブ取引等は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。

	⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年 1 回：5 月 15 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③収益分配金にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.264%以内（税抜　0.24%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021 年 9 月 30 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI 総合」は、日本国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社の知的財産です。野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。

11.ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドを主要投資対象とします。 なお直接、公社債等への投資、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を行う場合があります。 ＜ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンドの主要投資対象＞ わが国の公社債を主要投資対象とします。 ＜ニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの主要投資対象＞ 主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用します。
投資態度	①ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドを通じて、主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用することで、安定したインカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行います。 ②NOMURA-BPI（総合）指数（※）をベンチマークとし、ベンチマークを中長

	期的に上回る投資成果の獲得をめざします。 ③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。 ④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンドの投資態度＞ ①NOMURA-BPI（総合）指数をベンチマークとします。 ②主としてわが国の公社債に投資し、債券種類別構成比の調整や社債の個別銘柄選択等、信用リスクの適切な管理を主な超過収益源として、上記ベンチマークを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。 ③公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜ニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの投資態度＞ ①主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用することで、安定したインカム収益の確保と信託財産の成長をめざした運用を行います。 ②組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。 ③資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債の転換及び新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の 10%以下とします。なお、ここでいう新株予約権とは、新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権をいいます。 ②同一銘柄の転換社債及び転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ③投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑤外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。 ⑥デリバティブ取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦デリバティブ取引等について、一般社団法人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。 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。
ベンチマーク	NOMURA-BPI（総合）指数
決算日	年１回：６月 10 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。ただし、ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます。）等の全額とします。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。 ・純資産総額 100 億円以下の部分　年率 0.275％（税抜　0.25％） ・純資産総額 100 億円超の部分　　年率 0.253％（税抜　0.23％）
信託財産留保額	取得申込受付日及び解約請求受付日の翌営業日の基準価額に 0.03％の率を乗じて得た額
設定日	2023 年４月５日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI（総合）指数」とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

12. ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド(適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友 DS アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「年金日本債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債へ投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として次のような運用を行います。 ・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数（※）をベンチマークとし、デュレーション・コントロールを重視したアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価

	証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。ただし、マザーファンド受益証券への投資には、制限を設けません。 ②株式への実質投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ⑤デリバティブ取引等については、一般社団法人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こととします。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの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。
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合指数
決算日	年１回：１月 27 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づいて分配金額を決定します。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の範囲内とします。 ②収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、運用会社が決定します。ただし、運用会社の判断により分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、運用会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	信託報酬率は、毎計算期間において、計算期間の開始日の属する月の前月最終営業日における日本相互証券株式会社が発表する新発 10 年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下に定める率とします。 新発 10 年固定利付国債の利回り（終値）　　信託報酬率 2%未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率 0.2035% （税抜　0.185%）

	2%以上3%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.2475% （税抜　0.225%） 3%以上4%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.2915% （税抜　0.265%） 4%以上5%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.3355% （税抜　0.305%） 5%以上の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.3795% （税抜　0.345%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2023年4月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI 総合指数」とは野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する日本の債券市場の動向を的確に表すための市場指数です。日本の債券市場のベンチマークに多く利用されています。NOMURA-BPI 総合指数に関する一切の知的財産権その他の一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しております。また、同社は、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

13.外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	原則として、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)を構成している国の株式
投資態度	①原則としてＭＳＣＩコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。 ③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通

	貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑧一般社団法人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。 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。
ベンチマーク	ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
決算日	年 1 回：5 月 29 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000 年 5 月 30 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

14.外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

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

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

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

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

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

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

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

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

15.ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

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

主要投資対象	「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	①「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）（※）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ⑤デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。 ⑥資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資を行います。 ②MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③マクロ分析に基づくトップダウンの投資判断と、ボトムアップの個別銘柄分析に基づく銘柄選択を合わせて、本源的価値に比べて割安と判断される銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。 ④外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ⑤デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。 ⑥資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑦運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシーに委託します。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 20%以内とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約券証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。 ⑤同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。 ⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以内とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧デリバティブ取引（法人税法第 61 条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

	⑨外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑩一般社団法人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。
ベンチマーク	MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)
決算日	年 1 回：9 月 15 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則、毎決算時に分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。 ※分配金は、決算日から起算して５営業日以内に支払われます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.671%（税抜　0.61%） このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の 0.05%を上限）をファンドから支弁します。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021 年 9 月 24 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式 マザーファンドへの投資を通じて、実質的に日本を除く世界各国の株式等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長をめざします。 ②上記マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位に保ちます。

	③MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）（※）をベンチマークとします。 ④実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として日本を除く世界各国の企業が発行する株式等を中心に投資を行います。 ②徹底的なリサーチと行動ファイナンスのアプローチに基づき、市場の懸念によりファンダメンタルズよりも割安に評価されている銘柄を選定します。 ③運用にあたっては、Sanders Capital, LLC に運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の指図に関する権限を除きます。）を委託します。 ④MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）をベンチマークとします。 ⑤外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑥資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 20%以下とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ⑥投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧デリバティブ取引（法人税法第 61 条の５に定めるものをいいます。）及び外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的並びに価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人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。 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

	一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。
ベンチマーク	MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）
決算日	年１回：３月５日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.7381%（税抜　0.671%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022 年 3 月 7 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

17.世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

運用会社	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なわないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。 ・純資産総額 100 億円以下の部分 年率 0.704%（税抜　0.64%） ・純資産総額 100 億円超、200 億円以下の部分 年率 0.649%（税抜　0.59%） ・純資産総額 200 億円超の部分 年率 0.594%（税抜　0.54%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022 年 12 月 16 日
信託期間	2022 年 12 月 16 日から 2038 年 5 月 20 日まで
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

18. ＧＩＭグローバル・セレクト株式ファンドＦＢ（適格機関投資家専用）

運用会社	ＪＰモルガン・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、この投資信託にかかる信託財産（以下「信託財産」といいます。）の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。
主要投資対象	ＧＩＭグローバル・セレクト株式マザーファンド（適格機関投資家専用）（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの主要投資対象＞ 日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、マザーファンドの受益証券に投資します。 ②外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）およびみなし保有外貨建資産については、為替ヘッジを行いませ

	ん。 ③MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）（※）をベンチマークとします。 ④資金動向、市況動向、経済情勢、投資環境等の変化に対応するために、やむを得ない事情がある場合には、上記①～③にしたがった運用が行えない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を除く世界各国の株式に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行います。 ②外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。 ③MSCI コクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）をベンチマークとします。 ④資金動向、市況動向、経済情勢、投資環境等の変化に対応するために、やむを得ない事情がある場合には、上記①～③にしたがった運用が行えない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ③外貨建資産への投資割合は、制限を設けません。 ④有価証券についての有価証券関連デリバティブ取引および有価証券関連デリバティブ取引以外のデリバティブ取引の利用は、ヘッジ目的に限定します。
ベンチマーク	MSCI コクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）
決算日	年１回：10 月 9 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	運用による収益は、期中に分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.55％（税抜　0.5％） その他の費用 ・ファンド監査にかかる費用として、信託財産の純資産総額に年 0.022％（税抜 0.02％）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。

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

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

	・保管受託銀行 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店）

20.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	①主として世界各国の株式に投資することで、ベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ②フィッシャーグループのグローバルなリサーチ・プラットフォームを活用し、トップダウンの視点で投資対象にアプローチします。 ③主に国、セクター、その他マクロ要因が株式リターンを左右するという見解に基づき、マクロ見通しを最大限に活用して投資銘柄を選定します。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ②デリバティブの利用は行いません。 ③投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります。）の空売りは行いません。 ④投資信託財産の純資産総額の 10%を超える借り入れは行いません。 ⑤一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ⑥流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の 15%以下とします。
ベンチマーク	MSCI ワールド・インデックス※
決算日	年1回：9月30日
収益の分配	無分配とします。
信託報酬	年率0.7%（上限）
信託財産留保額	該当事項はありません。
その他の費用	投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
設定日	2016年5月27日
信託期間	原則として無期限
関係法人	・管理会社（マネージャー） Carne Global Fund Managers (Ireland) Limited ・投資顧問会社（インベストメントアドバイザー） Fisher Asset Management, LLC ・受託会社（トラスティ） State Street Fund Services (Ireland) Limited ・管理事務代行会社（アドミニストレーター）

	State Street Fund Services (Ireland) Limited ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） State Street Fund Services (Ireland) Limited ・保管受託銀行（カストディ） State Street Custodial Services (Ireland) Limited

※「MSCI ワールド・インデックス」は、先進市場の大型株および中型株の株式市場のパフォーマンスを測定するために設計された、浮動株調整時価総額加重指数です。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。

21.世界債券総合インデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（※）（以下「ベンチマーク」ということがあります。）を構成する通貨建ての債券等（ベンチマークを構成する債券以外の証券等や上場投資信託証券を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてベンチマークを構成する通貨建ての債券等に投資し、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。 ②債券等への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人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。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	年 1 回：4 月 26 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に 0.1%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2023 年 4 月 21 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス」とは、Bloomberg Finance L.P.及び、その関係会社が開発、算出、公表を行なうインデックスであり、円建て債券を除く世界の投資適格債券市場を示すインデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。Bloomberg ® 及びブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスは、Bloomberg Finance L.P.及び、同インデックスの管理者である Bloomberg Index Services Limited をはじめとする関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。

22.フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フィデリティ投信株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行ないます。
主要投資対象	フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。
投資態度	①フィデリティ・外国債券・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、世界各国の投資適格債券（除く日本円）を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的として運用を行ないます。 ②実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行ないません。 ③資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
主な投資制限	①株式への実質的な直接投資は、原則として行ないません。ただし、転換社債の転換ならびに新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものを除きます。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

	③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以内とします。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以内とします。 ⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 10%、合計で 20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 1 回：4 月 30 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。 ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行なうものではありません。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.451%（税抜 0.41%）
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に 0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2021 年 7 月 16 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱 UFJ 信託銀行株式会社

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

運用会社	大和アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	L&G グローバル総合債券（除く日本）マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、日本を除く世界の債券（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）に投資し、中長期的にベンチマーク（ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）（※））を上回る投資成果をめざします。 ＊マザーファンドにおいて、ETF（上場投資信託証券）を通じて債券に投資する場合があります。 ②マザーファンドの運用にあたっては、以下の方針を基本とします。 イ．原則として、投資する債券の格付けは、取得時において BBB 格相当以上（格付けがない債券のうち、リーガル＆ジェネラル・インベストメント・マネジメント・リミテッドが同等の信用力があると判断するものを含みます。）とします。

	ロ．投資成果の向上を図るため、債券および通貨にかかるデリバティブ取引ならびに為替取引をヘッジ目的以外でも行ないます。 ③マザーファンドの外貨建資産の運用にあたっては、リーガル＆ジェネラル・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。 ④マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ⑤為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 ⑥当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。 ⑦当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみに取得させることを目的とします。
主な投資制限	①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。 ②株式への実質投資割合には制限を設けません。 ③投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：4月15日（休業日の場合翌営業日）（第1期決算日は2026年4月15日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。 ②分配金額は、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.3498%（税抜0.318%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2025年4月11日
信託期間	原則として無期限
運用の委託先	名称：リーガル＆ジェネラル・インベストメント・マネジメント・リミテッド 所在の場所：英国　ロンドン 委託の内容：外貨建資産の運用に関する権限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「Bloomberg ㈹」および「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」は、Bloomberg Finance L.P.、および同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、大和アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。
当ファンドについて、ブルームバーグは後援、支持、販売、または宣伝するものではありません。ブルームバーグは、一般的な証券への投資の推奨可能性または特に当ファンドへの投資の推奨可能性について、当ファンドの所有者もしくは相手先に、あるいは一般の人々に、明示、黙示を問わずいかなる表明、保証も行いません。大和アセットマネジメント株式会社とブルームバーグの唯一の関係は、特定の商標、商号、サービスマークの使用許諾、および「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」の使

用許諾であり、これは、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドを考慮せずに、BISL が決定、構成、計算します。ブルームバーグは「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース)」を決定、構成、もしくは計算する際に、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドの所有者のニーズを考慮する義務はありません。ブルームバーグは当ファンドの発行時期、発行価格、発行数について責任を負わず、それに関与していません。ブルームバーグは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、当ファンドの顧客（これらに限定されません）に対し、いかなる義務、法的責任も負いません。

ブルームバーグは、「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース)」もしくはそれらに関連するデータの正確性および／または完全性を保証するものではなく、それに関連する過誤、不作為、または中断に対して一切の責任を負いません。ブルームバーグは、大和アセットマネジメント株式会社、当ファンドの所有者、もしくはその他の個人または法人が「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース)」、またはそれに関連するデータを使用したことで、獲得する結果について、明示的にも黙示的にもいかなる保証も行いません。ブルームバーグは、「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース)」もしくはそれらに関連するデータについて、特定の目的もしくは使用に対する商品性または適合性に関する明示的、黙示的な保証を行わず、あらゆる保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、法律で最大限に許される限り、ブルームバーグ、そのライセンサー、およびそれぞれの従業員、請負業者、エージェント、サプライヤー、ベンダーは、当ファンド、「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース)」またはそれらに関するデータまたは値について、過失、その他によるかにかかわらずその可能性について知らされていた場合でも、直接的、間接的、結果的、偶発的、懲罰的、またはそれ以外の被害または損害について法的責任もしくは責任を負いません。

24. Global Aggregate Bond Strategy Fund JPY W Class（★）

投資運用会社	BNY Mellon Investment Management Japan Limited
運用の基本方針	安定したインカムの確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	世界各国の政府および非政府機関（民間企業等）が発行する債券等を主要投資対象とします。
投資態度	①主として世界各国の政府および非政府機関（民間企業等）が発行する債券等に投資します。投資適格の社債、新興国債券、資産担保証券、転換社債等を中心とし、ハイイールド債券やバンクローンなど非投資適格の資産にも一部投資します。また、債券先物等のデリバティブにも投資します。 ②金利戦略、クレジット戦略および通貨戦略を組み合わせることにより、ポートフォリオを構築します。 ③債券等への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります。）の空売りは行いません。 ②投資信託財産の純資産総額の 10%を超える借り入れは行いません。 ③一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の 50%を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ④流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の 15%以下とします。

ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：1月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	・管理会社報酬および運用会社報酬：年率0.24%（上限） ・受託会社報酬：年率0.01%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00） ・管理事務代行会社報酬：年率0.07%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD25,000.00） ・保管受託銀行報酬：年率0.05%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00）
信託財産留保額	該当事項はありません。
その他の費用	投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等、デリバティブ取引に要する費用等、法律および税務顧問および監査人の報酬および費用、ファンドの財務およびその他の報告書、目論見書および類似書類の作成並びに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
設定日	2025年4月11日
信託期間	原則として無期限
関係法人	・管理会社 BNY Mellon International Management Limited ・投資運用会社 BNY Mellon Investment Management Japan Limited ・副投資運用会社 Insight Investment Management (Global) Limited ・受託会社 CIBC Caribbean Bank and Trust Company (Cayman) Limited ・管理事務代行会社 Nomura Bank (Luxembourg) S.A. ・保管受託銀行 Nomura Bank (Luxembourg) S.A.

25.新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）
投資態度	①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格

	が概ね連動する債券を活用することがあります。 ②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ④一般社団法人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。 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。
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）
決算日	年 1 回：11 月 10 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に 0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008 年 12 月 12 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

MSCI エマージング・マーケット・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利は

MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIエマージング・マーケット・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

26.ウエスタン・グローバル債券ファンド（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	当ファンドは、主に「ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本を除く世界の公社債に実質的に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。
主要投資対象	「ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」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＞ 主に日本を除く世界の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	①ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。 ②ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（※）をベンチマークとします。 ③ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 ④資金動向、市場動向等によっては、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主に、日本を除く世界の公社債に投資します。 ②ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）をベンチマークとします。 ③原則として、取得時において１社以上の格付機関から投資適格（ＢＢＢ－／Ｂａａ３）以上の長期格付けが付与された、あるいはこれに相当する信用力をもつと運用者が判断する公社債を主要な投資対象としますが、取得時において信託財産の20%を上限としてこれを下回る信用力の公社債に投資することがあります。 ④外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、通貨見通しに基づいて相対的に魅力があると判断される通貨に、為替予約取引等を通じて資産配分することがあります。 ⑤資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑥運用の指図に関する権限を下記投資顧問会社に委託します。 ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー（在米国） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティーブイエム・リミターダ（在ブラジル） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーイー・リミテッド（在シンガポール） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド（在オーストラリア）

	ウエスタン・アセット・マネジメント株式会社
主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 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5%以内とします。 ③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。 ④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。 ⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑥為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの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。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	毎年10月9日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則、毎決算時に分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。 ＊分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.33%（税抜　0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「Bloomberg(R)」およびブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスは、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはフランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社とは提携しておらず、また、フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社が運用するファンドを承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社が運用するファンドに関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。

27.J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（※）の

	動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証 REIT 指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証 REIT 指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下当マザーファンドにおいて「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。ただし、東証 REIT 指数(配当込み)における時価の構成割合が 10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証 REIT 指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。 ⑥一般社団法人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。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人

	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。
ベンチマーク	東証 REIT 指数（配当込み）
決算日	年 1 回：11 月 10 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008 年 1 月 9 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「東証 REIT 指数」とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場している REIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

①同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。

②ＪＰＸは、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

③ＪＰＸは、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④ＪＰＸは、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではありません。

⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。

⑦ＪＰＸは、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。

⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

28. グローバル REIT インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円ベース）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

	④投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）のうち不動産投信指数を対象とする先物取引並びに外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下当マザーファンドにおいて「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑤一般社団法人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およびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑥デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人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。
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「S&P先進国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要

国に上場する REIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P 先進国 REIT 指数（以下「当インデックス」）は、S&P Global の一部門である S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's ® 及び S&P ® は、S&P Global の一部門である Standard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones ® は Dow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが SPDJI に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P 又はそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indices は、当ファンドの所有者又はいかなる一般人に対して、株式全般又は具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追随する S&P 先進国 REIT 指数の能力に関して、明示又は黙示を問わず、いかなる表明又は保証もしません。S&P 先進国 REIT 指数に関して、S&P Dow Jones Indices と当社との間にある唯一の関係は、当インデックスと S&P Dow Jones Indices 又はそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、及び商標名のライセンス供与です。S&P 先進国 REIT 指数は当社又は当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indices によって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indices は、S&P 先進国 REIT 指数の決定、構成又は計算において当社又は当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indices は、当ファンドの価格又は数量、あるいは当ファンドの新規設定又は販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、又は償還される計算式の決定又は計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indices は、当ファンドの管理、マーケティング、又は取引に関して、いかなる義務又は責任も負いません。S&P 先進国 REIT 指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追随する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJI は投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indices がかかる証券の売り、買い、又はホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indices は、当インデックス又はその関連データ、あるいは口頭又は書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、又は完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indices は、これに含まれる誤り、欠落又は中断に対して、いかなる義務又は責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indices は、明示的又は黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックス又はそれに関連するデータの商品性、特定の目的又は使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、又はその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indices は、利益の逸失、営業損失、時間又は信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、又は派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、又は厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indices のライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indices と当社との間の契約又は取り決めの第三者受益者は存在しません。

29.グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（※）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	米ドル建て債券

投資態度	①ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。 ②米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。 ③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ③同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ④同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑥投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 1 回：5 月 26 日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。
ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）及び「ブルームバーグ（Bloomberg (R)）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー及びその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグ及びUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューし又は推奨するものではありません。ブルームバーグ及びUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）に関連するいかなるデータ又は情報の適時性、正確性又は完全性も保証するものではありません。

30.ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 ＜別に定める金現物に投資する上場投資信託証券＞（2025年1月31日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	①主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 ②投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 ③投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に

	関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人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。
ベンチマーク	LBMA金価格（円ヘッジベース）（※）（2025年1月31日現在） ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※LBMA金価格の正式名称はLBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会（London

Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

ICE ベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）は、LBMA 金価格及び LBMA 金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

ICE ベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

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

管理会社	BlueBay Funds Management Company S.A.
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。
主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	①主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ②ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 ③債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 50%以上とします。 ②投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年 6 月 30 日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率 0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011 年 5 月 24 日
関係法人	・管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A. ・投資顧問会社 RBC Global Asset Management (UK) Limited ・副投資顧問会社 RBC Global Asset Management (U.S.) Inc.

	・管理事務代行会社／名義書換事務受託会社／保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

32.FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。 ※Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。 ②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

33.米国株式LS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	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券（以下「米ドル建債券」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	①米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用※を行います。 ※米ドル建債券への投資額のうち、マーケット・ニュートラル戦略による運用に用いられない余剰資金は、原則として米ドル建MMFもしくはそれに類するもの又は米ドル建公社債、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券もしくは短期金融商品等により運用されます。 ②米ドル建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※運用にあたっては、三井住友信託銀行（委託者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、米ドル建債券に係るマーケット・ニュートラル戦略の運用会社等に係る有用な情報の提供等の投資助言を受けます。ただし、今後変更となることがあります。

34. コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてブルームバーグ商品指数（※）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」※1といいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※1 この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。 ※2 運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乗じる一定数は同値とします。
投資態度	①円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。 ②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社

	債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。
ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）及び「ブルームバーグ（Bloomberg ®）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー及びその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグ及びUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューし又は推奨するものではありません。ブルームバーグ及びUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）に関連するいかなるデータ又は情報の適時性、正確性又は完全性も保証するものではありません。

35.米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略※1 に基づいて償還価格が決定される円建債券（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※1）この投資信託において米国株式イントラデイ・トレンド戦略とは、米国株式市場の 1 日の取引時間中の値動き※2 を捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までに解消する戦略です。なお、株式市場の値動きによっては、同一日に買い建てポジションと売り建てポジションを同時に構築することや、買い建てポジションの合計額あるいは売り建てポジションの合計額が一時的に投資信託財産の純資産総額の 2 倍程度になることがあります。 ※2）当該戦略の参照対象は、S&P500 のほかダウ・ジョーンズ工業株価平均（NY ダウ）やナスダック総合指数等の株価指数、あるいはこれらの株価指数先物も含みます。
投資態度	①円建債券への投資を通じて、米国株式市場の 1 日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。 ②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券

	もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年10月6日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

36. ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の円建短期公社債等を主要投資対象とし、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	①主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。 ②債券先物取引及び為替予約取引等は、原則として定量的手法に基づいた複数の運用戦略を組み合わせることで行います。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑤為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑥一般社団法人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。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 1 回：2 月 20 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020 年 3 月 25 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

運用会社	野村アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、TOPIX（東証株価指数）を対象とした株価指数先物取引（以下、「株価指数先物取引」といいます。）を主要取引対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。
投資態度	各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。 ①各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。 ②各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の 70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。 ③非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の 50%以下とすることを基本とします。 ④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜日本成長株投資マザーファンドの投資態度＞ ①わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。

	②ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。 ③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。 ④非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。 ⑤資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度＞ ①株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。 ②ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。 ③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の 50%以下とすることを基本とします。 ④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。 ④デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑤新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 20%以内とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。 ⑦同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。 ⑧投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以内とします。 ⑨一般社団法人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デリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。 ⑩一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 1 回：12 月 20 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。

信託報酬	純資産総額に対し、年率0.506%（税抜　0.46%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2019年4月10日
信託期間	無期限
受託会社	野村信託銀行株式会社

38.ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）

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「ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本の公社債に投資を行うとともに、為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。
主要投資対象	「ウエスタン・カレンシー・アルファ・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＞ 主に日本の公社債を主要投資対象とし、為替予約取引等を積極的に活用します。
投資態度	①ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。 ②ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市場動向等によっては、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主に、日本の公社債に投資するとともに、主要先進国通貨を中心とした為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。 ②モデルによる定量分析とポートフォリオマネージャーによる定性分析を組み合わせた独自のアプローチにより、ポートフォリオを構築します。 ③リスク管理を運用プロセスに組み込み、ポジション・リスクの分散化を図ります。 ④資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑤運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるウエスタン・アセット・マネジメント株式会社及びウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）に委託します。
主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。 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５%以内とします。 ③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。 ④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。 ⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

	⑥為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 1 回：11 月 16 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.418%（税抜　0.38%） 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。 投資顧問会社の報酬は、委託者が収受する委託者報酬から支弁されます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022 年 4 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

39.MA Hedge Fund Strategies Limited

運用会社	UBS Asset Management (Americas) LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。
投資態度	①公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。 ②ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。 ③為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。
主な投資制限	①投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 ②投資法人財産の 10%を超える借り入れは行いません。 ③一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の 50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ④流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の 15%以下とします。 ⑤外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

	⑥一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦投資信託証券への投資は行いません。 ⑧デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 1 回：12 月 31 日（決算日が休日の場合は、前営業日となります。）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	運用報酬：年率 0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の 1 口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の 15%。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019 年 10 月 10 日
関係法人	・運用会社 UBS Asset Management (Americas) LLC ・保管銀行・管理事務代行会社 MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited

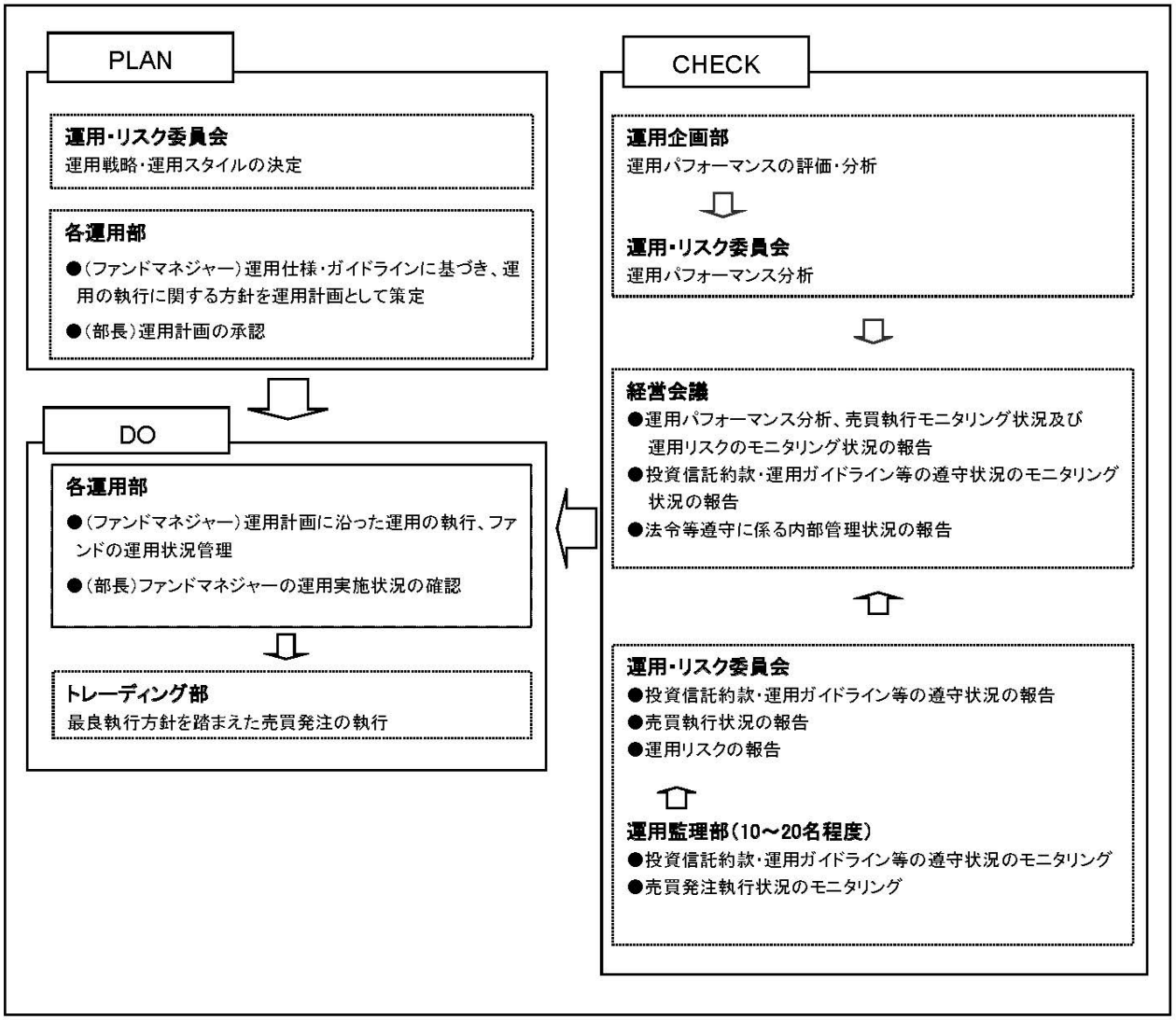
40.MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR

投資顧問会社	Graham Capital Management, L.P.
運用の基本方針	オルタナティブ運用手法を活用して投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物に投資します。
投資態度	・主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物で運用します。 ・トレーディング・アドバイザーの支援を受けて、各先物の市場の非効率性やトレンド等を収益機会として捕捉します。 ・各先物の収益機会の度合、ボラティリティ、流動性及び他先物との相関に係る評価等を鑑みて、各先物のロング・ショート戦略等によりポートフォリオを構築します。 ・資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	・先物での運用割合（想定元本ベース）は、投資信託財産の純資産総額の 90%以上とします。 ・現物の空売りは行いません。 ・発行体の法的支配や経営権の取得を企図した有価証券の取得を行いません。 ・投資信託財産の純資産総額の 10%を超える借り入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年 1 回：5 月の最終ファンド営業日
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	固定報酬：年率0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の12%
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年12月19日
信託期間	原則として無期限
関係法人	・管理会社（マネージャー） SG Kleinwort Hambros Corporate Services (CI) Limited ・投資顧問会社（トレーディング・アドバイザー） Graham Capital Management, L.P. ・副管理会社（サブ・マネージャー） Amundi Asset Management S.A.S ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） Societe Generale Securities Services France S.A. ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） CACEIS Bank, Luxembourg Branch ・保管受託銀行（カストディ） SG Kleinwort Hambros Trust Company (CI) Limited

（3）【運用体制】

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



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

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

（4）【分配方針】

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

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ヘ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

チ．外国為替予約取引の指図

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

リ．資金の借入れ

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

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還

金の合計額を限度とします。

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

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

②金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

③リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

④商品（コモディティ）の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国（産出国）の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

⑤為替変動リスク

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

⑥信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受ける可能性があり、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクがより高いものになると想定されます。

⑦流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下し

ている市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑧カントリーリスク

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

⑨資産等の選定・配分に係るリスク

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。

また、投資対象とする資産やファンドの追加に伴い、新たな投資リスクが生じる可能性があります。

⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

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

⑪仕組み債券に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1 社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。

なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

⑫ブローカーの信用リスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部又は相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があり、ファンドが大きな影響を被る可能性があります。

⑬有価証券の貸付等に係るリスク

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

⑭ESG の投資リスク

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

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

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

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

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

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

(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

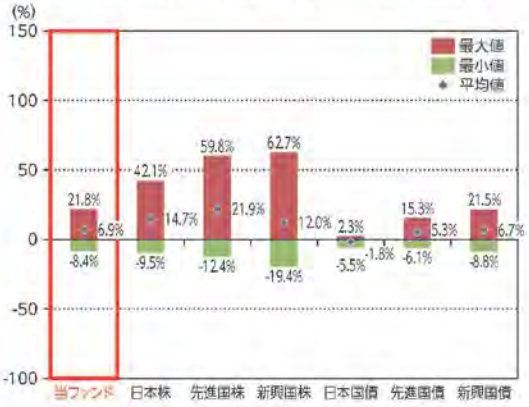
〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※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、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての適格性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数値の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他一切の権利は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築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により算出されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganにその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数には許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしには本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

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

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

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

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

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

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

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

（2）【換金（解約）手数料】

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法
①信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。
イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率　1.518%（税抜　1.38%）を乗じて得た額（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）
その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.968%　　（税抜　0.88%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.495%　　（税抜　0.45%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社	年率　0.055%　　（税抜　0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

※2025年4月10日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.517%　　（税抜　0.47%）
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.7095%　　（税抜　0.645%）
FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.495%　　（税抜　0.45%）
ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	・純資産総額200億円未満の部分 年率0.495%（税抜　0.45%） ・純資産総額200億円以上400億円未満の部分 年率0.44%（税抜　0.4%） ・純資産総額400億円以上の部分 年率0.385%（税抜　0.35%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り　　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・・年率　0.264%

	（税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・・年率　0.297% （税抜　0.27%） １%以上の場合　・・・・・・・・・年率　0.33% （税抜　0.3%）
明治安田 FOFs 用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.264%以内　　（税抜　0.24%以内）
ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	・純資産総額 100 億円以下の部分 年率 0.275%（税抜　0.25%） ・純資産総額 100 億円超の部分 年率 0.253%（税抜　0.23%）
ＳMDAM日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	信託報酬率は、毎計算期間において、計算期間の開始日の属する月の前月最終営業日における日本相互証券株式会社が発表する新発 10 年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下に定める率とします。 新発 10 年固定利付国債の利回り（終値）　信託報酬率 2%未満の場合・・・・・・・・年率 0.2035% （税抜　0.185%） 2%以上 3%未満の場合・・・・年率 0.2475% （税抜　0.225%） 3%以上 4%未満の場合・・・・年率 0.2915% （税抜　0.265%） 4%以上 5%未満の場合・・・・年率 0.3355% （税抜　0.305%） 5%以上の場合・・・・・・・・年率 0.3795% （税抜　0.345%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.671%　　（税抜　0.61%）
ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	年率　0.7381%　　（税抜　0.671%）
世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	・純資産総額 100 億円以下の部分 年率 0.704%（税抜　0.64%） ・純資産総額 100 億円超、200 億円以下の部分 年率 0.649%（税抜　0.59%） ・純資産総額 200 億円超の部分 年率 0.594%（税抜　0.54%）
ＧＩＭグローバル・セレクト株式ファンドＦＢ（適格機関投資家専用）	年率　0.55%　　（税抜　0.5%）
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率　0.525%

Fisher Investments Institutional Global Developed Concentrated Equity Fund JPY Class Shares (unhedged)	年率　0.7%（上限）
世界債券総合インデックスマザーファンド	ありません。
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.451%　　（税抜　0.41%）
L&G グローバル総合債券ファンド（除く日本）（FOFs 用）（適格機関投資家専用）	年率　0.3498%　　（税抜　0.318%）
Global Aggregate Bond Strategy Fund JPY W Class	・管理会社報酬および運用会社報酬：年率　0.24%（上限） ・受託会社報酬：年率 0.01%（上限） （ただし、最低報酬額年間 USD15,000.00） ・管理事務代行会社報酬：年率 0.07%（上限） （ただし、最低報酬額年間 USD25,000.00） ・保管受託銀行報酬：年率 0.05%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00）
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.33%　　（税抜　0.3%）
J-REIT インデックス マザーファンド	ありません。
グローバル REIT インデックス マザーファンド	ありません。
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラス S-JPY	年率　0.74%
FOFs 用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.066%　　（税抜　0.06%）
米国株式 LS マザーファンド	ありません。
コモディティ LS アルファ・マザーファンド	ありません。
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ありません。
ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	ありません。
ノムラ FOFs 用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.506%　　（税抜　0.46%）
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンド S（適格機関投資家専用）	年率　0.418%　　（税抜　0.38%）
MA Hedge Fund Strategies Limited	運用報酬：年率　0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の 1 口当たり純資産価格がハ

	イ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の 15%。
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	固定報酬：年率　0.85% 成功報酬：12% 1 口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の 12%

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況等により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては、別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。

◎実質的な信託報酬率：年率 1.518%～2.00946%程度（税抜　1.38%～1.8445%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率 0.0%～0.49146%程度（税抜　0.0%～0.4645%程度））

品貸料の額は運用状況等によって変動するため、品貸料及び品貸料に対する信託報酬の額については、上記「実質的な信託報酬率」及び「投資対象とする投資信託証券」では考慮しておりません。

（4）【その他の手数料等】

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

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

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

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

⑤ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（※）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

⑥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

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産

総額に年率0.495%（税抜0.45%）を乗じて得たものとします。
手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。
また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

（ご参考）
《　仕組み債券の費用にかかる記載　》
・FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）
実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
・円建債券の連動対象となるPictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。
これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・米国株式LSマザーファンド
主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
・米ドル建債券の評価額に対して年率 0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかります。
・マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率 2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかります。
・米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド
主要投資対象である米ドル建て債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
・米ドル建て債券の評価額に対して年率上限1%程度（投資比率による加重平均）の発行・管理手数料等がかかります。
・ETF、ETN、米ドル建て MMF もしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・コモディティＬＳアルファ・マザーファンド
主要投資対象である円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
・円建債券の評価額に対して年率上限1%程度（投資比率による加重平均）の発行・管理手数料等がかかります。
・円建 MMF もしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

主要投資対象である円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

・円建債券の評価額に対して年率上限 0.5%程度（投資比率による加重平均）の発行・管理手数料等がかかります。

・円建 MMF もしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

（5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

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

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

③個別元本について

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

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

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

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

ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

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

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

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

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

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの経費率は以下の通りです。

経費率（1＋2）	運用管理費用の比率 1	その他費用の比率 2
1.78%	1.51%	0.27%

※対象期間は2023年7月11日～2024年7月10日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した値（年率）です。
※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。
※投資先ファンドにかかる運用管理費用は、その他費用に含まれています。なお、運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれていません。
※ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。
※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。

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（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	9,673,419,623	46.66
投資証券	ルクセンブルク	1,561,668,348	7.53
	ジャージー	139,375,382	0.67
	ケイマン	134,761,463	0.65
	小計	1,835,805,193	8.85
親投資信託受益証券	日本	8,861,549,976	42.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	361,767,097	1.74
合計(純資産総額)		20,732,541,889	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	世界債券総合インデックスマザーファンド	1,253,625,766	1.2270	1,538,310,549	1.1922	1,494,572,638	7.21
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス　マザーファンド	503,973,750	2.9293	1,476,297,875	2.9322	1,477,751,829	7.13
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	505,763.259	2,562.48	1,296,008,235	2,819	1,425,746,627	6.88
日本	投資信託受益証券	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	694,569,019	1.8471	1,282,991,916	1.9587	1,360,452,337	6.56
日本	親投資信託受益証券	グローバルＲＥＩＴインデックスマザーファンド	375,695,734	3.1433	1,180,951,731	3.1960	1,200,723,565	5.79
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	639,091,028	1.4301	913,964,080	1.6370	1,046,192,012	5.05
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	491,628,476	1.9376	952,626,039	1.9268	947,269,747	4.57
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	461,479,914	1.9552	902,303,525	2.0319	937,681,037	4.52
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）	587,927,224	1.5405	905,757,479	1.5618	918,224,738	4.43
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	122,686,151	6.9386	851,270,128	7.3806	905,497,406	4.37
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）	533,100,002	1.5878	846,466,845	1.6912	901,578,723	4.35
日本	投資信託受益証券	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	611,862,643	1.2645	773,750,355	1.2224	747,940,894	3.61

日本	投資信託受益証券	ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	510,411,537	1.4971	764,175,392	1.45	740,096,728	3.57
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	223,536,756	3.1316	700,041,564	3.168	708,164,443	3.42
日本	親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	299,327,569	2.0368	609,670,393	2.0810	622,900,671	3.00
日本	投資信託受益証券	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	590,710,684	0.9356	552,669,506	0.9265	547,293,448	2.64
日本	投資信託受益証券	明治安田 FOFs 用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	491,092,625	0.9363	459,823,284	0.9313	457,354,561	2.21
日本	投資信託受益証券	ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド（適格機関投資家専用）	475,961,724	0.9687	461,066,501	0.9571	455,542,966	2.20
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	596,057,664	0.6823	406,690,145	0.6812	406,034,480	1.96
日本	投資信託受益証券	ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	379,568,877	0.9695	368,012,902	0.9608	364,689,777	1.76
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	160,478,334	1.8399	295,264,833	1.9027	305,342,126	1.47
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス　マザーファンド	64,535,900	4.7796	308,461,618	4.7146	304,260,954	1.47
日本	親投資信託受益証券	日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	151,461,746	1.6282	246,613,138	1.6418	248,669,894	1.20
日本	親投資信託受益証券	日本株式エクセレント・フォーカスマザーファンド	37,842,119	6.4979	245,895,859	6.5172	246,624,657	1.19
日本	投資信託受益証券	ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	208,329,647	1.101	229,375,941	1.117	232,704,215	1.12
日本	親投資信託受益証券	米国株式ＬＳマザーファンド	168,932,799	1.2532	211,706,584	1.2694	214,443,295	1.03
日本	親投資信託受益証券	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	148,167,167	1.2679	187,861,152	1.2535	185,727,543	0.90
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	153,339,331	1.0528	161,437,947	1.0809	165,744,482	0.80
ジャージー	投資証券	MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	13,714	10,564.22	144,877,713	10,163	139,375,382	0.67
日本	親投資信託受益証券	ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	122,012,406	1.1244	137,190,750	1.1193	136,568,486	0.66

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	46.66
投資証券	8.85
親投資信託受益証券	42.74
合計	98.26

(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	(2019年 7月 10日)	8,980,843,249	8,980,843,249	10,284	10,284
第2期計算期間末	(2020年 7月 10日)	11,787,026,676	11,787,026,676	9,951	9,951
第3期計算期間末	(2021年 7月 12日)	12,831,760,694	12,831,760,694	11,807	11,807
第4期計算期間末	(2022年 7月 11日)	15,193,556,526	15,193,556,526	11,599	11,599
第5期計算期間末	(2023年 7月 10日)	17,712,843,519	17,712,843,519	12,391	12,391
第6期計算期間末	(2024年 7月 10日)	21,004,506,030	21,004,506,030	14,786	14,786
	2024年 1月末日	19,031,217,125	—	13,289	—
	2月末日	19,413,683,009	—	13,640	—
	3月末日	19,952,798,537	—	14,094	—
	4月末日	19,988,937,885	—	14,069	—
	5月末日	20,151,413,299	—	14,213	—
	6月末日	20,671,470,555	—	14,570	—
	7月末日	20,254,579,050	—	14,276	—
	8月末日	20,019,002,489	—	14,057	—
	9月末日	20,287,573,785	—	14,230	—
	10月末日	20,716,463,004	—	14,526	—
	11月末日	20,445,749,696	—	14,361	—
	12月末日	20,773,625,036	—	14,718	—
	2025年 1月末日	20,732,541,889	—	14,721	—

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	2018年10月26日～2019年 7月10日	0
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0
第5期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0
第6期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）

第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	2.8
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	△3.2
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	18.7
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	△1.8
第5期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	6.8
第6期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	19.3
第7期中間計算期間	2024年 7月11日～2025年 1月10日	△1.3

(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	2018年10月26日～2019年 7月10日	9,362,328,441	629,077,416	8,733,251,025
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	6,207,727,771	3,096,276,176	11,844,702,620
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	1,926,137,065	2,903,204,631	10,867,635,054
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	3,838,843,288	1,607,580,740	13,098,897,602
第5期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	2,620,317,864	1,424,480,125	14,294,735,341
第6期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	2,119,254,715	2,207,885,264	14,206,104,792
第7期中間計算期間	2024年 7月11日～2025年 1月10日	712,322,043	807,542,789	14,110,884,046

(注 1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注 2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	729,804,799,860	99.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	4,768,357,173	0.65
合計(純資産総額)		734,573,157,033	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	日本	4,186,500,000	0.57

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,746,400	3,315.20	32,311,271,721	2,973.50	28,980,920,400	3.95
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,583,400	1,635.78	18,947,907,132	1,978.50	22,917,756,900	3.12
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,324,600	2,530.88	16,006,803,648	3,440.00	21,756,624,000	2.96
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,768,400	3,259.75	15,543,799,902	3,946.00	18,816,106,400	2.56
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,470,500	8,011.06	11,780,265,238	10,930.00	16,072,565,000	2.19
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,767,000	3,347.75	12,610,993,146	3,868.00	14,570,756,000	1.98
日本	株式	キーエンス	電気機器	183,400	69,459.98	12,738,961,637	67,250.00	12,333,650,000	1.68
日本	株式	任天堂	その他製品	1,157,500	8,286.02	9,591,072,622	10,230.00	11,841,225,000	1.61
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,437,300	3,150.60	7,678,977,232	4,307.00	10,497,451,100	1.43
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	388,000	34,399.57	13,347,036,519	26,205.00	10,167,540,000	1.38
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,304,000	7,273.91	9,485,189,622	7,183.00	9,366,632,000	1.28
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,763,000	5,358.56	9,447,147,894	5,160.00	9,097,080,000	1.24
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,585,200	3,304.91	11,848,764,257	2,489.50	8,925,355,400	1.22
日本	株式	三井物産	卸売業	2,850,100	3,946.45	11,247,802,776	3,086.00	8,795,408,600	1.20
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	907,100	8,923.60	8,094,598,480	9,411.00	8,536,718,100	1.16
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	54,696,600	151.96	8,311,726,823	152.70	8,352,170,820	1.14
日本	株式	信越化学工業	化学	1,633,100	5,875.05	9,594,544,155	4,877.00	7,964,628,700	1.08
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	358,200	18,705.68	6,700,377,226	20,975.00	7,513,245,000	1.02
日本	株式	三菱重工業	機械	3,238,300	1,375.60	4,454,631,940	2,296.00	7,435,136,800	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	1,735,400	5,388.05	9,350,432,908	4,277.00	7,422,305,800	1.01
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,352,500	4,320.09	5,842,929,979	5,186.00	7,014,065,000	0.95
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,636,200	4,110.34	6,725,339,454	4,209.00	6,886,765,800	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,344,100	1,706.08	7,411,403,305	1,478.50	6,422,751,850	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	29,435,000	187.87	5,530,109,684	200.20	5,892,887,000	0.80
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	109,100	40,919.34	4,464,300,892	51,030.00	5,567,373,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,142,900	2,050.64	4,394,330,880	2,469.50	5,291,891,550	0.72
日本	株式	富士通	電気機器	1,704,000	2,291.12	3,904,074,248	3,018.00	5,142,672,000	0.70
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	577,800	6,036.23	3,487,735,299	8,659.00	5,003,170,200	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,883,500	2,665.94	5,021,307,459	2,571.50	4,843,420,250	0.66
日本	株式	キヤノン	電気機器	914,500	4,507.45	4,122,072,060	5,018.00	4,588,961,000	0.62

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.23
		建設業	2.12
		食料品	2.93
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.14
		化学	4.92
		医薬品	4.23
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.63
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.83
		金属製品	0.50
		機械	5.58
		電気機器	17.69
		輸送用機器	7.53
		精密機器	2.42
		その他製品	2.84
		電気・ガス業	1.19
		陸運業	2.26
		海運業	0.64
		空運業	0.34
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	7.51
		卸売業	6.45
		小売業	4.55
		銀行業	9.03
		証券、商品先物取引業	0.95
		保険業	3.13
		その他金融業	1.15
		不動産業	1.84
		サービス業	5.15
		小計	99.35
合計			99.35

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	150	円	4,091,132,500	4,186,500,000	0.57

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

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

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	17,812,502,180	98.35
投資証券	日本	104,784,500	0.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	193,939,697	1.07
合計(純資産総額)		18,111,226,377	100.00

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	189,788,000	1.05

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	452,600	3,422.81	1,549,163,806	2,973.50	1,345,806,100	7.43
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	275,200	2,579.72	709,938,944	3,440.00	946,688,000	5.23
日本	株式	日立製作所	電気機器	204,400	2,938.44	600,617,136	3,946.00	806,562,400	4.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	61,800	7,099.49	438,748,482	10,930.00	675,474,000	3.73
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	164,400	2,939.72	483,289,968	3,868.00	635,899,200	3.51

日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	19,800	34,981.21	692,627,958	26,205.00	518,859,000	2.86
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	106,300	2,938.04	312,313,652	4,307.00	457,834,100	2.53
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	8,400	44,492.45	373,736,580	51,030.00	428,652,000	2.37
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	82,800	4,876.13	403,743,564	5,160.00	427,248,000	2.36
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	42,100	8,875.24	373,647,604	9,411.00	396,203,100	2.19
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	52,400	6,894.88	361,291,712	7,183.00	376,389,200	2.08
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	67,600	4,453.40	301,049,840	5,186.00	350,573,600	1.94
日本	株式	第一三共	医薬品	77,300	4,764.46	368,292,758	4,277.00	330,612,100	1.83
日本	株式	三菱重工業	機械	141,300	1,441.84	203,731,992	2,296.00	324,424,800	1.79
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	15,400	17,823.71	274,485,134	20,975.00	323,015,000	1.78
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	33,800	6,180.51	208,901,238	8,659.00	292,674,200	1.62
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,261,100	191.59	241,614,149	200.20	252,472,220	1.39
日本	株式	富士通	電気機器	73,000	2,445.08	178,490,840	3,018.00	220,314,000	1.22
日本	株式	ダイキン工業	機械	11,600	20,072.96	232,846,336	18,370.00	213,092,000	1.18
日本	株式	キヤノン	電気機器	41,200	5,054.05	208,226,860	5,018.00	206,741,600	1.14
日本	株式	中外製薬	医薬品	29,600	6,500.48	192,414,208	6,734.00	199,326,400	1.10
日本	株式	ファナック	電気機器	41,700	4,209.86	175,551,162	4,659.00	194,280,300	1.07
日本	株式	ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	保険業	56,700	2,846.69	161,407,323	3,249.00	184,218,300	1.02
日本	株式	小松製作所	機械	38,600	4,370.88	168,715,968	4,736.00	182,809,600	1.01
日本	株式	ＳＯＭＰＯホールディングス	保険業	39,300	3,185.45	125,188,185	4,352.00	171,033,600	0.94
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	49,400	3,375.44	166,746,736	3,445.00	170,183,000	0.94
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	48,100	4,522.12	217,513,972	3,501.00	168,398,100	0.93
日本	株式	オリックス	その他金融業	50,900	3,211.93	163,487,237	3,297.00	167,817,300	0.93
日本	株式	日本電気	電気機器	10,800	11,375.37	122,853,996	15,525.00	167,670,000	0.93
日本	株式	三井不動産	不動産業	117,800	1,549.02	182,474,556	1,409.50	166,039,100	0.92

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	鉱業	0.40
		建設業	1.87
		食料品	2.76
		繊維製品	0.44
		化学	5.51
		医薬品	4.43
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.78
		ガラス・土石製品	0.47

		鉄鋼	0.44
		非鉄金属	0.49
		金属製品	0.12
		機械	5.83
		電気機器	22.67
		輸送用機器	7.72
		精密機器	2.20
		その他製品	1.04
		電気・ガス業	0.98
		陸運業	1.72
		海運業	0.52
		空運業	0.11
		情報・通信業	7.29
		卸売業	3.53
		小売業	4.65
		銀行業	6.65
		証券、商品先物取引業	1.11
		保険業	4.67
		その他金融業	0.98
		不動産業	2.44
		サービス業	5.98
		小計	98.35
投資証券	—	—	0.58
合計			98.93

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	ミニＴＯＰＩＸ先物	買建	68	円	186,772,734	189,788,000	1.05

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

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

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	49,348,755,650	99.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	410,933,488	0.83
合計(純資産総額)		49,759,689,138	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(％)
日本	株式	三越伊勢丹ホールディングス	小売業	962,500	2,172.41	2,090,944,625	2,697.00	2,595,862,500	5.22
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,213,000	1,826.56	2,215,617,280	1,978.50	2,399,920,500	4.82
日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	325,700	5,588.98	1,820,330,786	7,066.00	2,301,396,200	4.63
日本	株式	ＭＡＲＵＷＡ	ガラス・土石製品	57,400	43,490.84	2,496,374,216	38,320.00	2,199,568,000	4.42
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	535,800	3,823.13	2,048,433,054	3,868.00	2,072,474,400	4.16
日本	株式	日立製作所	電気機器	513,800	3,946.16	2,027,537,008	3,946.00	2,027,454,800	4.07
日本	株式	三菱重工業	機械	878,500	2,246.14	1,973,233,990	2,296.00	2,017,036,000	4.05
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	582,100	3,014.20	1,754,565,820	3,440.00	2,002,424,000	4.02
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	181,700	10,620.13	1,929,677,621	10,930.00	1,985,981,000	3.99
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	66,600	23,644.07	1,574,695,062	26,205.00	1,745,253,000	3.51
日本	株式	ディスコ	機械	34,300	41,348.35	1,418,248,405	44,740.00	1,534,582,000	3.08
日本	株式	信越化学工業	化学	287,000	5,546.13	1,591,739,310	4,877.00	1,399,699,000	2.81
日本	株式	キーエンス	電気機器	20,800	65,260.00	1,357,408,000	67,250.00	1,398,800,000	2.81
日本	株式	第一三共	医薬品	294,600	4,871.13	1,435,034,898	4,277.00	1,260,004,200	2.53
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	145,000	8,422.48	1,221,259,600	8,659.00	1,255,555,000	2.52
日本	株式	荏原製作所	機械	466,000	2,264.73	1,055,364,180	2,579.50	1,202,047,000	2.42
日本	株式	野村総合研究所	情報・通信業	225,100	4,570.08	1,028,725,008	5,293.00	1,191,454,300	2.39
日本	株式	三菱商事	卸売業	476,600	2,565.22	1,222,583,852	2,489.50	1,186,495,700	2.38
日本	株式	マツキヨココカラ&カンパニー	小売業	478,500	2,124.65	1,016,645,025	2,301.50	1,101,267,750	2.21
日本	株式	ＮＴＴデータグループ	情報・通信業	348,000	2,879.62	1,002,107,760	3,029.00	1,054,092,000	2.12
日本	株式	Ｊ．フロント　リテイリング	小売業	464,400	1,825.97	847,980,468	2,184.50	1,014,481,800	2.04
日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	308,600	2,949.22	910,129,292	2,912.50	898,797,500	1.81
日本	株式	西武ホールディングス	陸運業	250,300	3,042.06	761,427,618	3,356.00	840,006,800	1.69
日本	株式	ＳＨＩＦＴ	情報・通信業	646,500	1,162.35	751,463,154	1,292.00	835,278,000	1.68
日本	株式	ダイフク	機械	259,100	3,221.34	834,649,194	3,217.00	833,524,700	1.68
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	272,800	2,611.06	712,297,168	2,973.50	811,170,800	1.63

日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	36,500	19,527.81	712,765,065	20,975.00	765,587,500	1.54
日本	株式	富士電機	電気機器	101,100	8,693.00	878,862,300	7,435.00	751,678,500	1.51
日本	株式	ＳＭＣ	機械	12,500	64,590.00	807,375,000	58,880.00	736,000,000	1.48
日本	株式	ニデック	電気機器	255,400	2,748.81	702,046,074	2,689.50	686,898,300	1.38

(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	国内	建設業	0.82
		化学	3.72
		医薬品	3.19
		ガラス・土石製品	4.42
		鉄鋼	0.52
		非鉄金属	2.24
		機械	13.60
		電気機器	21.57
		輸送用機器	8.18
		精密機器	1.54
		陸運業	2.75
		情報・通信業	6.76
		卸売業	2.38
		小売業	12.28
		銀行業	8.99
		保険業	0.33
		不動産業	1.89
		サービス業	3.99
		小計	99.17
合計			99.17

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	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	756,235	28,129.14	21,272,245,840	36,235.45	27,402,519,463	3.18

			財・サービス流通・小売り						
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・サービス	76,537	41,628.15	3,186,093,778	53,057.51	4,060,863,033	0.47
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	141,776	24,218.20	3,433,560,534	27,125.62	3,845,763,248	0.45

			ンス						
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 STOX	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	1.76
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	8,750	26,120.29	228,552,539	25,853.12	226,214,855	1.09

			ソナル用品						
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・ライフサイエンス	7,339	16,375.61	120,180,605	15,907.54	116,745,451	0.56
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	6,027	24,588.34	148,193,953	18,355.54	110,628,899	0.53

			造装置						
イギリス	株式	HSBC 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 STOX	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。

世界債券総合インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	25,904,250,124	20.03
	中国	7,565,225,170	5.85
	フランス	3,845,675,960	2.97
	イタリア	3,771,634,631	2.92
	イギリス	3,768,039,259	2.91
	ドイツ	2,757,041,041	2.13
	スペイン	2,541,549,384	1.97
	韓国	1,597,778,425	1.24
	カナダ	1,320,472,326	1.02
	オーストラリア	909,393,090	0.70
	ベルギー	822,712,163	0.64
	スイス	746,801,492	0.58
	オランダ	705,883,650	0.55
	インドネシア	702,589,953	0.54
	メキシコ	602,545,420	0.47
	オーストリア	591,024,937	0.46
	マレーシア	552,800,446	0.43
	タイ	508,475,935	0.39

	ポーランド	434,696,031	0.34
	ポルトガル	357,607,949	0.28
	デンマーク	300,905,672	0.23
	シンガポール	287,155,630	0.22
	アイルランド	250,704,328	0.19
	フィンランド	247,699,924	0.19
	イスラエル	245,421,775	0.19
	ニュージーランド	234,875,221	0.18
	チェコ	205,093,464	0.16
	サウジアラビア	172,451,857	0.13
	ギリシャ	170,039,535	0.13
	ルーマニア	169,036,742	0.13
	ハンガリー	164,399,884	0.13
	コロンビア	146,933,784	0.11
	チリ	145,509,644	0.11
	フィリピン	115,777,133	0.09
	ノルウェー	109,127,876	0.08
	スウェーデン	101,831,252	0.08
	アラブ首長国連邦	86,906,340	0.07
	香港	61,997,078	0.05
	カタール	57,594,298	0.04
	パナマ	50,706,402	0.04
	ウルグアイ	47,102,057	0.04
	ブルガリア	45,971,451	0.04
	ペルー	22,477,287	0.02
	アイスランド	14,704,486	0.01
	カザフスタン	13,617,010	0.01
	小計	63,474,237,516	49.08
地方債証券	カナダ	1,866,218,734	1.44
	ドイツ	636,049,879	0.49
	オーストラリア	551,580,374	0.43
	スウェーデン	96,370,922	0.07
	デンマーク	76,990,840	0.06
	スペイン	64,015,085	0.05
	ニュージーランド	38,620,655	0.03
	小計	3,329,846,489	2.57
特殊債券	中国	6,334,680,121	4.90
	国際機関	3,632,230,054	2.81
	ドイツ	1,113,830,584	0.86
	フランス	642,077,177	0.50
	カナダ	528,864,140	0.41

	オランダ	413,533,469	0.32
	アメリカ	296,369,289	0.23
	日本	289,795,034	0.22
	韓国	262,810,642	0.20
	スウェーデン	108,312,092	0.08
	オーストリア	90,227,493	0.07
	ノルウェー	39,709,998	0.03
	インド	30,884,686	0.02
	小計	13,783,324,779	10.66
社債券	アメリカ	14,967,873,296	11.57
	フランス	2,588,413,231	2.00
	カナダ	2,062,779,341	1.59
	イギリス	1,603,393,342	1.24
	オランダ	1,427,073,580	1.10
	ドイツ	1,155,982,064	0.89
	日本	961,757,930	0.74
	スウェーデン	667,495,900	0.52
	オーストラリア	602,661,575	0.47
	スペイン	574,797,116	0.44
	イタリア	553,715,691	0.43
	ノルウェー	272,047,564	0.21
	ルクセンブルク	269,349,853	0.21
	スイス	250,959,850	0.19
	シンガポール	196,142,827	0.15
	アイルランド	190,891,657	0.15
	ケイマン	169,888,479	0.13
	フィンランド	155,065,469	0.12
	デンマーク	137,210,472	0.11
	インド	132,647,612	0.10
	ベルギー	124,618,791	0.10
	韓国	123,206,916	0.10
	オーストリア	113,322,679	0.09
	ニュージーランド	98,473,430	0.08
	チリ	91,911,672	0.07
	インドネシア	91,207,123	0.07
	メキシコ	73,228,791	0.06
	バミューダ	38,183,499	0.03
	香港	31,712,004	0.02
	タイ	28,126,813	0.02
	マレーシア	26,320,252	0.02
	ジャージー	15,988,719	0.01

	小計	29,796,447,538	23.04
投資信託受益証券	アメリカ	16,226,383,282	12.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,720,270,367	2.10
合計(純資産総額)		129,330,509,971	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	438,595,697	0.34
	買建	ドイツ	169,211,872	0.13

(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	―	816,744,705	0.63

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MBS ETF	1,138,013	13,849.26	15,760,641,831	14,258.52	16,226,383,282	―	―	12.55
アメリカ	国債証券	T 4.875% 10/31/28	3,400,000	15,845.36	538,742,327	15,752.16	535,573,494	4.875	2028/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	3,000,000	15,559.56	466,786,876	15,544.64	466,339,389	4.625	2026/10/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 4.625% 06/30/26	3,000,000	15,681.70	470,451,240	15,527.45	465,823,617	4.625	2026/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.75% 07/31/27	3,000,000	14,999.76	449,993,011	14,908.22	447,246,772	2.750	2027/7/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.875% 09/30/26	3,000,000	14,031.41	420,942,399	14,624.70	438,741,060	0.875	2026/9/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/29	2,920,000	14,720.43	429,836,847	14,589.71	426,019,645	2.875	2029/4/30	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	3,300,000	12,619.70	416,450,197	12,627.06	416,693,160	0.625	2030/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	T 4.375% 11/30/28	2,500,000	15,590.52	389,763,117	15,486.13	387,153,295	4.375	2028/11/30	0.30
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/26	2,460,000	14,941.99	367,573,043	14,956.48	367,929,534	1.875	2026/6/30	0.28
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	2,300,000	15,400.50	354,211,694	15,452.35	355,404,056	4.500	2033/11/15	0.27
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/29	2,450,000	14,312.32	350,652,015	14,385.21	352,437,763	2.625	2029/7/31	0.27
中国	国債証券	CGB 2.67% 05/25/33	15,000,000	2,175.00	326,250,236	2,282.53	342,379,952	2.670	2033/5/25	0.26
アメリカ	国債証券	T 1% 07/31/28	2,470,000	13,222.16	326,587,449	13,814.84	341,226,777	1.000	2028/7/31	0.26

中国	国債証券	CGB 2.52% 08/25/33	15,000,000	2,152.90	322,935,374	2,262.43	339,364,825	2.520	2033/8/25	0.26
アメリカ	国債証券	T 3.75% 08/31/31	2,200,000	14,900.18	327,803,973	14,859.96	326,919,259	3.750	2031/8/31	0.25
アメリカ	国債証券	T 4.125% 09/30/27	2,100,000	15,105.78	317,221,538	15,406.80	323,542,914	4.125	2027/9/30	0.25
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/29	2,300,000	13,491.20	310,297,827	14,006.37	322,146,711	1.750	2029/1/31	0.25
アメリカ	国債証券	T 4.5% 04/15/27	2,000,000	15,371.21	307,424,284	15,533.48	310,669,728	4.500	2027/4/15	0.24
アメリカ	国債証券	T 4.375% 05/15/34	2,000,000	16,177.33	323,546,691	15,282.53	305,650,753	4.375	2034/5/15	0.24
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/26	2,000,000	14,813.81	296,276,367	15,199.07	303,981,590	2.625	2026/1/31	0.24
中国	国債証券	CGB 4.08% 10/22/48	10,200,000	2,691.32	274,515,424	2,978.66	303,823,976	4.080	2048/10/22	0.23
アメリカ	国債証券	T 4% 02/15/34	2,000,000	15,384.48	307,689,711	14,865.09	297,301,878	4.000	2034/2/15	0.23
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	2,000,000	14,369.83	287,396,642	14,825.58	296,511,632	2.375	2027/5/15	0.23
アメリカ	国債証券	T 3.25% 06/30/29	2,000,000	14,398.18	287,963,691	14,786.67	295,733,450	3.250	2029/6/30	0.23
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	2,000,000	14,159.68	283,193,734	14,644.30	292,886,147	2.250	2027/11/15	0.23
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	2,000,000	14,051.92	281,038,472	14,612.33	292,246,711	1.250	2026/12/31	0.23
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/54	2,030,000	14,774.60	299,924,487	14,156.88	287,384,818	4.250	2054/8/15	0.22
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	2,000,000	13,824.80	276,496,055	14,286.28	285,725,663	2.375	2029/5/15	0.22
中国	特殊債券	SDBC 3.43% 01/14/27	13,000,000	2,194.38	285,269,568	2,193.49	285,154,888	3.430	2027/1/14	0.22

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	49.08
地方債証券	2.57
特殊債券	10.66
社債券	23.04
投資信託受益証券	12.55
合計	97.90

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額（現地通貨）	帳簿価額（円）	評価金額（現地通貨）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	26	アメリカドル	2,821,197.8	435,677,575	2,840,093.88	438,595,697	0.34
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	8	ユーロ	1,057,786.8	169,626,691	1,055,200	169,211,872	0.13

(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	数量	簿価	時価	投資

		／ 売建		(円)	(円)	比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,740,000.00	426,970,630	422,412,100	0.33
	カナダドル	買建	240,000.00	25,978,344	25,528,800	0.02
	ユーロ	買建	1,210,000.00	195,280,641	193,817,800	0.15
	イギリスポンド	買建	190,000.00	36,307,468	36,355,550	0.03
	オーストラリアドル	買建	130,000.00	12,646,921	12,442,300	0.01
	オフショア人民元	買建	5,969,000.00	127,487,603	126,188,155	0.10

(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	1,194,800	8,329.42	9,951,997,206	7,951.78	9,500,791,523	4.12

			ア・娯楽						
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2,995,288	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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	96,714,000,100	96.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,601,677,395	3.59
合計(純資産総額)		100,315,677,495	100.00

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,581,964,000	3.57

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	57,100	129,536.46	7,396,531,866	123,500	7,051,850,000	7.03
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	50,278	112,512.88	5,656,922,580	109,400	5,500,413,200	5.48
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	50,761	92,142.82	4,677,261,686	94,500	4,796,914,500	4.78
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	31,336	141,016.19	4,418,883,329	149,500	4,684,732,000	4.67
日本	投資証券	ＫＤＸ不動産投資法人	27,387	146,676.96	4,017,041,903	155,100	4,247,723,700	4.23
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	32,882	128,933.59	4,239,594,306	127,200	4,182,590,400	4.17
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	17,053	245,039.28	4,178,654,841	236,900	4,039,855,700	4.03
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	53,935	63,397.51	3,419,344,701	67,800	3,656,793,000	3.65
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,599	231,983.1	3,386,721,276	244,300	3,566,535,700	3.56
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	19,505	160,450.34	3,129,583,881	172,400	3,362,662,000	3.35
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	21,740	138,967.39	3,021,151,058	150,400	3,269,696,000	3.26
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	19,242	151,447.56	2,914,153,949	142,900	2,749,681,800	2.74
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,963	68,573.01	2,466,091,158	72,000	2,589,336,000	2.58
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	29,416	73,573.84	2,164,248,077	79,400	2,335,630,400	2.33
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,695	336,333.67	2,251,753,920	342,000	2,289,690,000	2.28
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	21,339	99,419.91	2,121,521,459	102,100	2,178,711,900	2.17
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	17,924	114,498.74	2,052,275,415	116,000	2,079,184,000	2.07
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,380	590,317.23	1,995,272,237	584,000	1,973,920,000	1.97
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,533	144,060.41	1,805,509,118	143,400	1,797,232,200	1.79
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	19,731	91,250.31	1,800,459,866	89,900	1,773,816,900	1.77
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,758	324,400.66	1,543,498,340	338,000	1,608,204,000	1.60
日本	投資証券	イオンリート投資法人	12,008	126,506.46	1,519,089,571	125,400	1,505,803,200	1.50
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	18,161	80,879.52	1,468,852,962	81,000	1,471,041,000	1.47
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,511	127,300.46	1,465,355,595	125,600	1,445,781,600	1.44
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,957	289,661.71	1,435,853,096	271,600	1,346,321,200	1.34
日本	投資証券	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	9,950	109,399.57	1,088,525,721	132,200	1,315,390,000	1.31
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	14,458	91,371.88	1,321,054,641	89,400	1,292,545,200	1.29
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,650	131,914.44	1,141,059,906	141,800	1,226,570,000	1.22
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,380	353,990.83	1,196,489,005	356,000	1,203,280,000	1.20
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	18,869	61,382.56	1,158,227,524	63,300	1,194,407,700	1.19

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	96.41
合計	96.41

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	2,117	円	3,429,199,220	3,581,964,000	3.57

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

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

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	110,403,920,892	79.75
	オーストラリア	9,900,819,837	7.15
	イギリス	5,548,836,011	4.01
	シンガポール	4,162,452,732	3.01
	フランス	2,469,553,870	1.78
	カナダ	1,668,399,515	1.21
	ベルギー	1,192,519,628	0.86
	香港	1,079,913,261	0.78
	スペイン	608,644,669	0.44
	韓国	219,522,561	0.16
	ガーンジー	201,312,559	0.15
	イスラエル	196,981,364	0.14
	オランダ	188,588,110	0.14
	ニュージーランド	128,735,815	0.09
	ドイツ	58,104,748	0.04
	アイルランド	53,641,607	0.04
	イタリア	14,928,145	0.01
	小計	138,096,875,324	99.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	344,861,870	0.25
合計(純資産総額)		138,441,737,194	100.00

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	24,165,266	0.02

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	570,142	17,867.11	10,186,792,236	18,631.97	10,622,874,056	7.67
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	59,476	142,277.31	8,462,085,473	142,404.53	8,469,652,177	6.12
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	365,100	21,274.25	7,767,229,213	21,184.70	7,734,536,672	5.59
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	189,458	27,626.88	5,234,135,146	27,147.24	5,143,263,634	3.72
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	192,652	28,088.22	5,411,252,497	25,362.03	4,886,047,518	3.53
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	537,917	8,866.59	4,769,490,906	8,388.63	4,512,390,772	3.26
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	96,867	52,225.11	5,058,890,096	46,027.86	4,458,580,860	3.22
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,173,398	3,437.38	4,033,422,178	3,445.56	4,043,022,365	2.92
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	130,459	25,811.66	3,367,363,591	23,891.86	3,116,908,855	2.25
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	648,867	4,841.04	3,141,193,053	4,608.19	2,990,103,199	2.16
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	87,434	36,033.63	3,150,564,691	33,956.06	2,968,914,885	2.14
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	180,596	18,429.38	3,328,273,767	15,751.86	2,844,722,909	2.05
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	258,499	10,026.21	2,591,766,897	9,290.50	2,401,587,234	1.73
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	210,403	11,336.16	2,385,163,554	10,769.94	2,266,029,411	1.64
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	39,672	46,951.11	1,862,644,707	43,419.53	1,722,539,943	1.24
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	72,168	24,535.25	1,770,660,515	23,448.65	1,692,242,260	1.22
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	351,763	5,192.10	1,826,391,389	4,785.78	1,683,462,335	1.22
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	416,735	3,837.66	1,599,289,878	3,502.47	1,459,602,836	1.05
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	74,323	19,338.73	1,437,312,615	19,458.17	1,446,190,312	1.04
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	96,129	17,540.03	1,686,105,860	14,802.11	1,422,912,561	1.03
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	434,297	3,499.95	1,520,021,549	3,167.35	1,375,574,642	0.99
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	170,524	7,673.64	1,308,539,938	7,479.04	1,275,356,653	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	119,043	10,987.77	1,308,017,245	10,062.65	1,197,889,092	0.87
アメリカ	投資証券	UDR INC	186,776	6,848.68	1,279,170,668	6,398.03	1,194,999,367	0.86
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	838,383	1,487.50	1,247,097,540	1,382.85	1,159,359,323	0.84
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	134,542	8,749.23	1,177,139,345	8,597.11	1,156,673,463	0.84
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	66,094	18,748.96	1,239,194,214	17,481.47	1,155,420,675	0.83
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,223,709	330.36	1,064,984,867	352.80	1,137,329,693	0.82
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	99,651	11,442.88	1,140,294,839	11,112.78	1,107,399,919	0.80
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	426,270	2,776.62	1,183,593,207	2,569.71	1,095,392,498	0.79

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	99.75
合計	99.75

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	58,000.00	8,951,140	8,952,549	0.01
	オーストラリアドル	買建	50,000.00	4,824,450	4,791,785	0.00
	ニュージーランドドル	買建	120,000.00	10,509,480	10,420,932	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。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	14,524,141,500	44.94
	ルクセンブルク	14,505,100,281	44.88
	イギリス	1,200,353,504	3.71
	アメリカ	780,991,117	2.42
	ジャージー	715,937,480	2.22
	小計	31,726,523,882	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	595,167,126	1.84
合計(純資産総額)		32,321,691,008	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率

										(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 008 10/24/25	55,000,000	25,837.03	14,210,370,626	26,407.53	14,524,141,500	0.000	2025/10/24	44.94
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 040 07/31/25	25,000,000	15,202.76	3,800,692,173	16,222.87	4,055,717,875	0.000	2025/7/31	12.55
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 042 11/28/25	25,000,000	15,377.39	3,844,349,534	15,796.64	3,949,161,175	0.000	2025/11/28	12.22
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 041 09/30/25	22,000,000	15,132.87	3,329,232,826	15,487.78	3,407,312,634	0.000	2025/9/30	10.54
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 038 02/28/25	19,000,000	15,936.11	3,027,862,681	16,278.46	3,092,908,597	0.000	2025/2/28	9.57
イギリス	社債券	BAR USD COM 042 04/30/25	8,000,000	14,797.48	1,183,798,608	15,004.41	1,200,353,504	0.000	2025/4/30	3.71
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	5,164.64	774,697,322	5,206.60	780,991,117	0.000	2036/6/12	2.42
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	1,779.03	711,613,440	1,789.84	715,937,480	0.000	9999/99/99	2.22

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	98.16
合計	98.16

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	41,311,940,648	97.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	901,393,186	2.14
合計(純資産総額)		42,213,333,834	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	40,558,731,991	△96.08

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	5,070,364	7,034.28	35,666,393,035	8,147.72	41,311,940,648	97.86

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	97.86
合計	97.86

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	263,658,928.00	40,558,916,553	40,558,731,991	△96.08

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

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

米国株式ＬＳマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	14,133,155,626	97.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	390,234,989	2.69
合計(純資産総額)		14,523,390,615	100.00

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	14,137,962,000	△97.35

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/27	58,000,000	23,629.60	13,705,170,640	24,367.50	14,133,155,626	0.000	2027/10/18	97.31

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	97.31
合計	97.31

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	売建	92,000,000.00	14,105,164,000	14,137,962,000	△97.35

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

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

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	9,241,664,000	70.05
	イギリス	3,774,920,000	28.61

	小計	13,016,584,000	98.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	176,244,398	1.34
合計(純資産総額)		13,192,828,398	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　０７／１６／２５	7,330,000,000	126.13	9,245,329,000	126.08	9,241,664,000	0.000	2025/7/16	70.05
イギリス	社債券	ソシエテ・ジェネラル　０％　２０２５／０４／３０	3,800,000,000	99.06	3,764,560,000	99.34	3,774,920,000	0.000	2025/4/30	28.61

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	98.66
合計	98.66

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	6,094,418,400	99.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	48,537,321	0.79
合計(純資産総額)		6,142,955,721	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　１０／２０／２５	7,113,000,000	89.68	6,379,048,200	85.68	6,094,418,400	0.000	2025/10/20	99.21

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	99.21
合計	99.21

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	11,689,577,000	51.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	11,154,234,328	48.83
合計(純資産総額)		22,843,811,328	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率(%)
債券先物取引	買建	イギリス	9,338,776,422	40.88
	売建	日本	11,112,930,000	△48.65
	売建	アメリカ	4,588,385,762	△20.09
	売建	ドイツ	2,834,298,856	△12.41

(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	—	11,274,834,200	49.36
	売建	—	12,951,092,320	△56.69

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１２２６回国庫短期証券	7,000,000,000	99.87	6,990,949,000	99.93	6,995,128,000	—	2025/4/21	30.62
日本	国債証券	第１２４４回国庫短期証券	3,000,000,000	99.84	2,995,428,000	99.83	2,995,146,000	—	2025/7/22	13.11
日本	国債証券	第１２２０回国庫短期証券	1,700,000,000	99.90	1,698,429,200	99.95	1,699,303,000	—	2025/3/21	7.44

(注 1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	51.17
合計	51.17

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	日本	大阪取引所	長期国債標準物先物	売建	79	円	11,199,853,930	11,199,853,930	11,112,930,000	11,112,930,000	△48.65
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	売建	272	アメリカドル	29,579,457.63	4,567,955,641	29,711,751.36	4,588,385,762	△20.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	売建	134	ユーロ	17,631,238.6	2,827,345,422	17,674,600	2,834,298,856	△12.41
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	LONG GILT FU	買建	526	イギリスポンド	47,986,545	9,198,540,810	48,718,120	9,338,776,422	40.88

(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	41,697,000.00	6,544,344,316	6,428,218,005	28.14
	イギリスポンド	買建	3,369,000.00	650,688,647	644,641,305	2.82
	ノルウェークローネ	買建	192,554,000.00	2,654,375,934	2,619,697,170	11.47
	オーストラリアドル	買建	16,532,000.00	1,606,669,915	1,582,277,720	6.93
	カナダドル	売建	20,627,000.00	2,238,679,432	2,194,093,990	△9.60
	ユーロ	売建	6,897,000.00	1,116,575,419	1,104,761,460	△4.84
	スイスフラン	売建	15,429,000.00	2,667,106,755	2,616,218,385	△11.45
	スウェーデンクローナ	売建	234,557,000.00	3,314,936,979	3,269,724,580	△14.31
	ニュージーランドドル	売建	43,423,000.00	3,819,548,859	3,766,293,905	△16.49

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

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

≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2018年10月26日
作成基準日：2025年 1 月31日

基準価額・純資産の推移

※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。

基準価額	14,721円
純資産総額	207.33億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年 7 月	0円
2021年 7 月	0円
2022年 7 月	0円
2023年 7 月	0円
2024年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
世界債券総合インデックスマザーファンド	7.2%
国内株式インデックス マザーファンド	7.1%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	6.9%
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	6.6%
グローバルREITインデックス マザーファンド	5.8%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	5.0%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	4.6%
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	4.5%
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	4.4%
外国株式インデックス マザーファンド	4.4%

※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)

※2018年は当初設定日から年末までの収益率です。また、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、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

＜申込手数料＞

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

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

＜申込受付の中止等＞

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売

買又は金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

＜その他＞

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

＜スイッチング＞

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

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

＜問い合わせ先＞

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

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

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞

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

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

＜一部解約代金の支払い＞

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

＜一部解約受付の中止等＞

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

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人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内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

②外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法

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

③外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

④マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

⑤マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

・公社債等（仕組債を含みます。）

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

・市場デリバティブ取引

金融商品取引所が発表する計算日の清算値段又は帳入値段で評価します。

・店頭デリバティブ取引

計算日における次のa.又はb.のいずれかの価額で評価します。

a. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）
b. 価格情報会社の提供する価額

⑥外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2018年10月26日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2018年10月26日から2019年7月10日までとします。

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

（5）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

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

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則

として、ファンドを繰上償還させます。

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき
・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

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

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

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

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

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

ることがあります。

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 6 期計算期間(2023 年 7 月 11 日から 2024 年 7 月 10 日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年9月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2023年7月11日から2024年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2024年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

1 【財務諸表】

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド)】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2023年 7月10日現在)	第6期 (2024年 7月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	778,855,595	525,313,706
投資信託受益証券	6,162,093,059	9,769,257,774
投資証券	1,256,041,447	1,311,284,824
親投資信託受益証券	8,842,340,311	9,564,389,005
未収入金	1,017,650,000	10,460,000
未収利息	－	968
流動資産合計	18,056,980,412	21,180,706,277
資産合計	18,056,980,412	21,180,706,277
負債の部		
流動負債		
未払金	167,507,011	－
未払解約金	50,401,861	26,336,633
未払受託者報酬	4,556,950	5,410,252
未払委託者報酬	121,214,787	143,912,397
未払利息	649	－
その他未払費用	455,635	540,965
流動負債合計	344,136,893	176,200,247
負債合計	344,136,893	176,200,247
純資産の部		
元本等		
元本	14,294,735,341	14,206,104,792
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,418,108,178	6,798,401,238
（分配準備積立金）	2,030,051,856	4,997,939,558
元本等合計	17,712,843,519	21,004,506,030
純資産合計	17,712,843,519	21,004,506,030
負債純資産合計	18,056,980,412	21,180,706,277

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第５期 自　2022年７月12日 至　2023年７月10日	第６期 自　2023年７月11日 至　2024年７月10日
営業収益		
受取配当金	6,666,754	9,889,342
受取利息	2,548	108,729
有価証券売買等損益	1,365,844,194	3,702,168,895
その他収益	117,518	－
営業収益合計	1,372,631,014	3,712,166,966
営業費用		
支払利息	510,371	239,636
受託者報酬	8,943,449	10,452,303
委託者報酬	237,895,697	278,030,785
その他費用	894,224	1,045,149
営業費用合計	248,243,741	289,767,873
営業利益又は営業損失（△）	1,124,387,273	3,422,399,093
経常利益又は経常損失（△）	1,124,387,273	3,422,399,093
当期純利益又は当期純損失（△）	1,124,387,273	3,422,399,093
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（△）	34,256,066	165,153,557
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,094,658,924	3,418,108,178
剰余金増加額又は欠損金減少額	462,062,845	656,500,969
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	462,062,845	656,500,969
剰余金減少額又は欠損金増加額	228,744,798	533,453,445
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	228,744,798	533,453,445
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,418,108,178	6,798,401,238

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第５期 (2023年 7月 10日現在)	第６期 (2024年 7月 10日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	14,294,735,341口	14,206,104,792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 1.2391円 (１万口当たり純資産額) (12,391円)	１口当たり純資産額 1.4786円 (１万口当たり純資産額) (14,786円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第５期
自 2022年 7月 12日
至 2023年 7月 10日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	174,343,378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	642,165,001円
収益調整金額	C	1,388,056,322円
分配準備積立金額	D	1,213,543,477円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,418,108,178円
当ファンドの期末残存口数	F	14,294,735,341口
１万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,391円
１万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第６期
自 2023年 7月 11日
至 2024年 7月 10日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	203,919,948円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,053,325,588円
収益調整金額	C	1,800,461,680円
分配準備積立金額	D	1,740,694,022円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,798,401,238円
当ファンドの期末残存口数	F	14,206,104,792口
１万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,785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６期 自 2023年 7月 11日 至 2024年 7月 10日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第6期 (2024年 7月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第5期 自 2022年 7月12日 至 2023年 7月10日	第6期 自 2023年 7月11日 至 2024年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	13,098,897,602円	14,294,735,341円
期中追加設定元本額	2,620,317,864円	2,119,254,715円
期中一部解約元本額	1,424,480,125円	2,207,885,264円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期 (2023年 7月10日現在)	第6期 (2024年 7月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	410,793,555	1,525,090,275
投資証券	54,388,956	287,526,469
親投資信託受益証券	607,532,354	1,518,057,201

合計	1,072,714,865	3,330,673,945

（デリバティブ取引に関する注記）
該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ノムラＦＯＦｓ用　日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	308,977,873	249,067,063	
	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	485,470,522	969,921,555	
	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	504,860,090	815,601,475	
	明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	413,894,769	383,349,335	
	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）	415,358,589	803,885,013	
	ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	315,831,996	303,988,296	
	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）	325,452,923	765,888,363	
	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	598,864,846	760,678,127	
	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	235,437,566	747,420,097	
	ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	511,261,897	768,528,883	
	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）	474,234,917	750,002,521	
	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	221,505,886	188,235,701	
	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	222,796,127	236,097,055	
	ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド（適格機関投資家専用）	377,557,589	361,813,437	
	ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	220,671,725	247,792,280	
	FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	488,447,848	967,517,497	
	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	485,442,355	449,471,076	
投資信託受益証券合計		6,606,067,518	9,769,257,774	

投資証券	MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	8,916	99,984,024	
	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	17,705.017	195,440,902	
	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	308,018.976	825,490,855	
	MA Hedge Fund Strategies Limited	18,953	190,369,043	
投資証券合計		353,592.993	1,311,284,824	
親投資信託受益証券	ＪｰＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	567,911,425	1,154,450,344	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	423,012,432	1,317,345,315	
	新興国株式インデックス　マザーファンド	57,500,179	285,471,138	
	国内株式インデックス　マザーファンド	492,281,238	1,488,510,779	
	外国株式インデックス　マザーファンド	114,572,329	813,222,934	
	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	614,929,065	421,041,930	
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	705,405,213	1,008,870,535	
	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	215,030,778	272,121,449	
	日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	148,948,821	250,397,862	
	外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	144,422,799	273,464,569	
	米国株式ＬＳマザーファンド	247,342,593	312,072,149	
	ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	82,859,039	94,782,454	
	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	106,915,299	94,801,795	
	世界債券総合インデックスマザーファンド	1,240,327,906	1,530,440,603	
	日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド	36,968,791	247,395,149	
親投資信託受益証券合計		5,198,427,907	9,564,389,005	
合計			20,644,931,603	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,120,105,328
株式	702,510,886,870
派生商品評価勘定	90,103,200
未収入金	2,204,100
未収配当金	799,483,080
未収利息	5,753
差入委託証拠金	116,930,735
流動資産合計	706,639,719,066
資産合計	706,639,719,066
負債の部	
流動負債	
前受金	90,145,000
未払解約金	1,716,747,362
流動負債合計	1,806,892,362
負債合計	1,806,892,362
純資産の部	
元本等	
元本	233,103,107,390
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	471,729,719,314
元本等合計	704,832,826,704
純資産合計	704,832,826,704
負債純資産合計	706,639,719,066

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	233,103,107,390口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0237円 (1万口当たり純資産額) (30,237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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	246,129,288,443円
期中追加設定元本額	25,203,711,018円
期中一部解約元本額	38,229,892,071円
期末元本額	233,103,107,390円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	251,704,554円
ＳＢＩ資産設計オープン(資産成長型)	3,262,317,893円
ＳＢＩ資産設計オープン(分配型)	12,096,364円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	10,410,886,693円
世界経済インデックスファンド	6,270,149,824円
日本株式インデックス・オープン	2,786,680,982円
ＤＣマイセレクション２５	4,572,414,308円
ＤＣマイセレクション５０	15,470,417,440円
ＤＣマイセレクション７５	17,985,859,651円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,955,580,709円
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,871,052,637円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,174,836,830円
ＤＣマイセレクションＳ７５	8,781,050,262円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	9,521,381,965円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	56,801,771円

ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	553,966,363 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	455,862,763 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,607,252,257 円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	396,995,695 円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,478,977 円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	8,989,944 円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	12,612,773 円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	94,832,782 円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,841,719 円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,895,303 円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	52,573,693 円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	14,011,961 円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	41,036,039 円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	377,928,953 円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	280,000,362 円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,890,068,572 円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	25,025,238 円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	9,354,700 円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	266,374,471 円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	152,490,143 円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	202,123,064 円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	15,798,344 円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	361,258,673 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	2,351,453,409 円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,895,030,762 円
コア投資戦略ファンド（安定型）	526,088,837 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,284,647,733 円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,695,277,593 円
分散投資コア戦略ファンドＳ	5,988,441,971 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	676,039,211 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	418,469,348 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	573,424,327 円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,354,519 円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,663,117 円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	50,153,724 円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	15,601,643,604 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	189,957,492 円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	54,138,030 円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	250,628,196 円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	40,744,795 円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	12,318,461 円
グローバル経済コア	305,139,310 円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	34,088,381 円
Ｍｙ　ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	2,244,235,540 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	31,323,456 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	492,281,238 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	127,899,661 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	64,461,359 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	69,332,891 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	30,091,869 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	37,117,996 円
１０資産分散投資ファンド	113,308,158 円
グローバル１０資産バランスファンド	38,663,647 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	564,790 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	31,734 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	34,978 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	37,585 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	37,585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	34,970円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０６０	22,495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	17,859円
ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型）	14,076円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	41,723,106,605円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	225,854,987円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	295,813,754円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,992,461円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	101,811,260円
ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用）	48,901,512,552円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,059,452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）	201,736,940円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	40,274,436,218
合計	40,274,436,218

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2024年 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,125,635,000	－	2,215,780,000	90,145,000
合計		2,125,635,000	－	2,215,780,000	90,145,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	10,000	4,020.00	40,200,000	
ニッスイ	240,800	845.70	203,644,560	
マルハニチロ	35,700	3,160.00	112,812,000	

雪国まいたけ	20,500	1,011.00	20,725,500	
カネコ種苗	6,800	1,476.00	10,036,800	
サカタのタネ	27,400	3,470.00	95,078,000	
ホクト	19,300	1,824.00	35,203,200	
ホクリヨウ	1,300	998.00	1,297,400	
住石ホールディングス	30,600	1,309.00	40,055,400	
日鉄鉱業	9,700	5,040.00	48,888,000	
三井松島ホールディングス	14,300	5,510.00	78,793,000	
ＩＮＰＥＸ	808,900	2,415.00	1,953,493,500	
石油資源開発	27,900	6,350.00	177,165,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	10,900	3,585.00	39,076,500	
ショーボンドホールディングス	32,800	5,669.00	185,943,200	
ミライト・ワン	72,700	2,070.50	150,525,350	
タマホーム	15,100	3,840.00	57,984,000	
サンヨーホームズ	900	735.00	661,500	
日本アクア	3,300	912.00	3,009,600	
ファーストコーポレーション	2,300	770.00	1,771,000	
ベステラ	1,900	973.00	1,848,700	
キャンディル	1,400	643.00	900,200	
ダイセキ環境ソリューション	1,600	1,053.00	1,684,800	
第一カッター興業	6,900	1,610.00	11,109,000	
安藤・間	139,500	1,197.00	166,981,500	
東急建設	75,400	775.00	58,435,000	
コムシスホールディングス	76,900	3,189.00	245,234,100	
ビーアールホールディングス	35,300	361.00	12,743,300	
高松コンストラクショングループ	17,900	2,999.00	53,682,100	
東建コーポレーション	6,100	11,520.00	70,272,000	
ソネック	800	943.00	754,400	
ヤマウラ	12,200	1,309.00	15,969,800	
オリエンタル白石	89,200	349.00	31,130,800	
大成建設	154,300	6,200.00	956,660,000	
大林組	602,600	1,982.00	1,194,353,200	
清水建設	477,700	925.60	442,159,120	
飛島建設	17,400	1,518.00	26,413,200	
長谷工コーポレーション	154,600	1,760.50	272,173,300	
松井建設	15,700	828.00	12,999,600	

錢高組	800	4,180.00	3,344,000	
鹿島建設	373,600	2,800.00	1,046,080,000	
不動テトラ	11,700	2,490.00	29,133,000	
大末建設	2,200	1,699.00	3,737,800	
鉄建建設	12,100	2,606.00	31,532,600	
西松建設	32,100	4,695.00	150,709,500	
三井住友建設	125,400	389.00	48,780,600	
大豊建設	5,800	3,430.00	19,894,000	
佐田建設	3,500	796.00	2,786,000	
ナカノフドー建設	3,900	514.00	2,004,600	
奥村組	27,300	5,120.00	139,776,000	
東鉄工業	20,900	3,185.00	66,566,500	
イチケン	1,400	2,550.00	3,570,000	
富士ピー・エス	2,400	454.00	1,089,600	
淺沼組	12,500	3,865.00	48,312,500	
戸田建設	228,000	1,053.00	240,084,000	
熊谷組	27,800	3,550.00	98,690,000	
北野建設	1,000	3,670.00	3,670,000	
植木組	1,600	1,625.00	2,600,000	
矢作建設工業	22,900	1,642.00	37,601,800	
ピーエス・コンストラクション	21,400	1,004.00	21,485,600	
日本ハウスホールディングス	36,000	341.00	12,276,000	
新日本建設	23,700	1,588.00	37,635,600	
東亜道路工業	33,000	1,298.00	42,834,000	
日本道路	19,800	1,820.00	36,036,000	
東亜建設工業	50,900	1,014.00	51,612,600	
日本国土開発	47,900	467.00	22,369,300	
若築建設	5,800	3,240.00	18,792,000	
東洋建設	42,400	1,479.00	62,709,600	
五洋建設	238,900	652.40	155,858,360	
世紀東急工業	21,600	1,759.00	37,994,400	
福田組	6,400	6,090.00	38,976,000	
住友林業	145,600	5,255.00	765,128,000	
日本基礎技術	3,300	579.00	1,910,700	
巴コーポレーション	6,900	815.00	5,623,500	
大和ハウス工業	465,900	4,085.00	1,903,201,500	

ライト工業	33,100	2,142.00	70,900,200	
積水ハウス	511,000	3,586.00	1,832,446,000	
日特建設	16,100	1,144.00	18,418,400	
北陸電気工事	11,500	1,137.00	13,075,500	
ユアテック	37,100	1,457.00	54,054,700	
日本リーテック	13,200	1,230.00	16,236,000	
四電工	7,000	3,650.00	25,550,000	
中電工	26,100	3,210.00	83,781,000	
関電工	105,500	1,709.00	180,299,500	
きんでん	117,200	3,232.00	378,790,400	
東京エネシス	15,700	1,339.00	21,022,300	
トーエネック	5,600	4,985.00	27,916,000	
住友電設	16,000	3,885.00	62,160,000	
日本電設工業	31,600	1,929.00	60,956,400	
エクシオグループ	164,700	1,612.50	265,578,750	
新日本空調	10,900	4,020.00	43,818,000	
九電工	36,400	5,633.00	205,041,200	
三機工業	36,400	2,156.00	78,478,400	
日揮ホールディングス	166,700	1,238.00	206,374,600	
中外炉工業	5,500	3,230.00	17,765,000	
ヤマト	4,600	937.00	4,310,200	
太平電業	10,700	5,430.00	58,101,000	
高砂熱学工業	45,100	5,750.00	259,325,000	
三晃金属工業	700	4,450.00	3,115,000	
朝日工業社	15,700	1,351.00	21,210,700	
明星工業	32,600	1,305.00	42,543,000	
大氣社	19,400	5,230.00	101,462,000	
ダイダン	22,100	3,160.00	69,836,000	
日比谷総合設備	12,200	3,320.00	40,504,000	
フィル・カンパニー	2,600	669.00	1,739,400	
テスホールディングス	36,300	408.00	14,810,400	
インフロニア・ホールディングス	194,200	1,271.50	246,925,300	
東洋エンジニアリング	24,800	830.00	20,584,000	
レイズネクスト	24,400	1,873.00	45,701,200	
ニップン	50,600	2,321.00	117,442,600	
日清製粉グループ本社	156,400	1,810.50	283,162,200	

日東富士製粉	3,000	7,150.00	21,450,000	
昭和産業	16,200	3,120.00	50,544,000	
鳥越製粉	4,900	686.00	3,361,400	
中部飼料	23,400	1,565.00	36,621,000	
フィード・ワン	24,700	928.00	22,921,600	
東洋精糖	1,000	1,615.00	1,615,000	
日本甜菜製糖	9,800	2,706.00	26,518,800	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	16,800	3,370.00	56,616,000	
塩水港精糖	7,200	271.00	1,951,200	
ウェルネオシュガー	8,400	2,332.00	19,588,800	
森永製菓	71,500	2,566.00	183,469,000	
中村屋	4,200	3,260.00	13,692,000	
江崎グリコ	48,400	4,364.00	211,217,600	
名糖産業	6,700	1,951.00	13,071,700	
井村屋グループ	10,100	2,472.00	24,967,200	
不二家	11,600	2,627.00	30,473,200	
山崎製パン	113,200	3,256.00	368,579,200	
第一屋製パン	1,000	636.00	636,000	
モロゾフ	5,500	4,800.00	26,400,000	
亀田製菓	9,700	4,220.00	40,934,000	
寿スピリッツ	80,000	1,939.00	155,120,000	
カルビー	77,400	3,036.00	234,986,400	
森永乳業	59,100	3,460.00	204,486,000	
六甲バター	12,400	1,509.00	18,711,600	
ヤクルト本社	241,700	2,901.00	701,171,700	
明治ホールディングス	207,400	3,594.00	745,395,600	
雪印メグミルク	40,900	2,693.00	110,143,700	
プリマハム	22,700	2,357.00	53,503,900	
日本ハム	72,800	4,808.00	350,022,400	
林兼産業	1,800	517.00	930,600	
丸大食品	17,000	1,674.00	28,458,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	18,700	2,853.00	53,351,100	
柿安本店	6,600	2,610.00	17,226,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	25,800	4,255.00	109,779,000	
サッポロホールディングス	55,700	6,242.00	347,679,400	
アサヒグループホールディングス	390,800	5,692.00	2,224,433,600	

キリンホールディングス	704,600	2,126.50	1,498,331,900	
宝ホールディングス	114,000	1,103.50	125,799,000	
オエノンホールディングス	50,600	404.00	20,442,400	
養命酒製造	5,600	2,354.00	13,182,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	132,500	2,157.00	285,802,500	
ライフドリンク　カンパニー	3,400	6,730.00	22,882,000	
サントリー食品インターナショナル	119,100	5,640.00	671,724,000	
ダイドーグループホールディングス	19,200	2,623.00	50,361,600	
伊藤園	57,300	3,488.00	199,862,400	
キーコーヒー	18,900	2,060.00	38,934,000	
ユニカフェ	1,800	923.00	1,661,400	
日清オイリオグループ	23,800	4,890.00	116,382,000	
不二製油グループ本社	39,400	3,012.00	118,672,800	
かどや製油	700	3,650.00	2,555,000	
Ｊ－オイルミルズ	19,400	1,925.00	37,345,000	
キッコーマン	560,500	1,923.50	1,078,121,750	
味の素	397,600	6,030.00	2,397,528,000	
ブルドックソース	9,000	2,010.00	18,090,000	
キユーピー	90,900	3,635.00	330,421,500	
ハウス食品グループ本社	58,300	2,845.00	165,863,500	
カゴメ	72,700	3,384.00	246,016,800	
アリアケジャパン	16,900	5,260.00	88,894,000	
ピエトロ	800	1,796.00	1,436,800	
エバラ食品工業	4,000	2,887.00	11,548,000	
やまみ	800	3,305.00	2,644,000	
ニチレイ	77,500	3,446.00	267,065,000	
東洋水産	85,500	9,847.00	841,918,500	
イートアンドホールディングス	8,000	2,040.00	16,320,000	
大冷	800	1,945.00	1,556,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,700	1,498.00	11,534,600	
日清食品ホールディングス	178,400	4,232.00	754,988,800	
永谷園ホールディングス	8,200	3,095.00	25,379,000	
一正蒲鉾	2,400	759.00	1,821,600	
フジッコ	17,400	1,861.00	32,381,400	
ロック・フィールド	20,700	1,488.00	30,801,600	

日本たばこ産業	1,027,900	4,450.00	4,574,155,000	
ケンコーマヨネーズ	11,600	2,027.00	23,513,200	
わらべや日洋ホールディングス	11,300	2,528.00	28,566,400	
なとり	10,600	2,133.00	22,609,800	
イフジ産業	1,100	1,365.00	1,501,500	
ファーマフーズ	22,400	995.00	22,288,000	
ユーグレナ	105,300	512.00	53,913,600	
紀文食品	14,700	1,247.00	18,330,900	
ピックルスホールディングス	9,900	1,118.00	11,068,200	
ミヨシ油脂	2,100	1,515.00	3,181,500	
理研ビタミン	14,600	2,704.00	39,478,400	
片倉工業	16,100	2,034.00	32,747,400	
グンゼ	12,300	5,600.00	68,880,000	
東洋紡	74,900	1,036.00	77,596,400	
ユニチカ	57,300	278.00	15,929,400	
富士紡ホールディングス	7,600	4,775.00	36,290,000	
倉敷紡績	12,300	4,790.00	58,917,000	
シキボウ	11,100	1,141.00	12,665,100	
日本毛織	44,500	1,321.00	58,784,500	
トーア紡コーポレーション	2,200	425.00	935,000	
帝国繊維	19,600	2,410.00	47,236,000	
帝人	165,700	1,316.00	218,061,200	
東レ	1,153,600	763.90	881,235,040	
住江織物	1,200	2,404.00	2,884,800	
日本フエルト	4,000	497.00	1,988,000	
イチカワ	900	1,726.00	1,553,400	
日東製網	600	1,473.00	883,800	
アツギ	4,000	577.00	2,308,000	
ダイニック	1,800	803.00	1,445,400	
セーレン	33,400	2,336.00	78,022,400	
ソトー	1,900	743.00	1,411,700	
東海染工	600	844.00	506,400	
小松マテーレ	25,000	736.00	18,400,000	
ワコールホールディングス	32,100	4,490.00	144,129,000	
ホギメディカル	22,700	4,145.00	94,091,500	
ＴＳＩホールディングス	51,700	930.00	48,081,000	

マツオカコーポレーション	1,800	1,678.00	3,020,400	
ワールド	24,300	2,280.00	55,404,000	
三陽商会	7,300	2,530.00	18,469,000	
ナイガイ	2,100	260.00	546,000	
オンワードホールディングス	101,600	576.00	58,521,600	
ルックホールディングス	5,400	2,851.00	15,395,400	
ゴールドウイン	30,500	8,905.00	271,602,500	
デサント	29,700	3,770.00	111,969,000	
キング	2,200	750.00	1,650,000	
ヤマトインターナショナル	4,600	363.00	1,669,800	
特種東海製紙	9,300	3,675.00	34,177,500	
王子ホールディングス	716,800	611.70	438,466,560	
日本製紙	97,100	934.00	90,691,400	
三菱製紙	7,600	737.00	5,601,200	
北越コーポレーション	84,600	1,058.00	89,506,800	
中越パルプ工業	2,300	1,464.00	3,367,200	
大王製紙	76,000	886.20	67,351,200	
阿波製紙	1,500	525.00	787,500	
レンゴー	156,700	994.00	155,759,800	
トーモク	9,900	2,679.00	26,522,100	
ザ・パック	12,800	3,880.00	49,664,000	
北の達人コーポレーション	72,500	179.00	12,977,500	
クラレ	250,800	1,878.00	471,002,400	
旭化成	1,164,100	1,051.00	1,223,469,100	
共和レザー	3,200	788.00	2,521,600	
巴川コーポレーション	1,600	1,011.00	1,617,600	
レゾナック・ホールディングス	166,300	3,783.00	629,112,900	
住友化学	1,276,900	362.90	463,387,010	
住友精化	8,100	5,440.00	44,064,000	
日産化学	80,200	4,929.00	395,305,800	
ラサ工業	6,600	3,165.00	20,889,000	
クレハ	37,600	2,847.00	107,047,200	
多木化学	6,700	4,355.00	29,178,500	
テイカ	14,100	1,618.00	22,813,800	
石原産業	28,500	1,635.00	46,597,500	
片倉コープアグリ	1,300	1,178.00	1,531,400	

日本曹達	20,100	5,390.00	108,339,000	
東ソー	229,700	2,063.50	473,985,950	
トクヤマ	55,600	2,960.50	164,603,800	
セントラル硝子	18,400	3,790.00	69,736,000	
東亞合成	82,700	1,530.00	126,531,000	
大阪ソーダ	12,000	10,850.00	130,200,000	
関東電化工業	33,300	986.00	32,833,800	
デンカ	62,600	2,136.00	133,713,600	
信越化学工業	1,543,100	6,716.00	10,363,459,600	
日本カーバイド工業	8,200	2,038.00	16,711,600	
堺化学工業	13,100	2,995.00	39,234,500	
第一稀元素化学工業	18,800	841.00	15,810,800	
エア・ウォーター	162,400	2,160.00	350,784,000	
日本酸素ホールディングス	166,900	4,934.00	823,484,600	
日本化学工業	6,300	2,775.00	17,482,500	
東邦アセチレン	5,900	369.00	2,177,100	
日本パーカライジング	76,700	1,307.00	100,246,900	
高圧ガス工業	25,000	987.00	24,675,000	
チタン工業	700	1,039.00	727,300	
四国化成ホールディングス	19,500	2,200.00	42,900,000	
戸田工業	3,900	2,073.00	8,084,700	
ステラ　ケミファ	9,300	4,335.00	40,315,500	
保土谷化学工業	5,400	5,440.00	29,376,000	
日本触媒	100,200	1,641.00	164,428,200	
大日精化工業	12,000	3,300.00	39,600,000	
カネカ	42,400	4,207.00	178,376,800	
三菱瓦斯化学	125,600	3,113.00	390,992,800	
三井化学	141,900	4,361.00	618,825,900	
東京応化工業	82,100	4,593.00	377,085,300	
大阪有機化学工業	14,400	4,045.00	58,248,000	
三菱ケミカルグループ	1,257,900	922.50	1,160,412,750	
ＫＨネオケム	26,300	2,228.00	58,596,400	
ダイセル	218,300	1,529.50	333,889,850	
住友ベークライト	48,200	4,676.00	225,383,200	
積水化学工業	342,700	2,215.00	759,080,500	
日本ゼオン	118,000	1,377.00	162,486,000	

アイカ工業	43,400	3,508.00	152,247,200	
ＵＢＥ	81,900	2,766.50	226,576,350	
積水樹脂	25,700	2,438.00	62,656,600	
タキロンシーアイ	43,900	753.00	33,056,700	
旭有機材	11,400	5,140.00	58,596,000	
ニチバン	9,300	1,902.00	17,688,600	
リケンテクノス	32,200	1,010.00	32,522,000	
大倉工業	8,000	2,912.00	23,296,000	
積水化成品工業	24,100	452.00	10,893,200	
群栄化学工業	4,000	3,220.00	12,880,000	
タイガースポリマー	2,600	862.00	2,241,200	
ミライアル	1,900	1,501.00	2,851,900	
ダイキアクシス	2,300	716.00	1,646,800	
ダイキョーニシカワ	38,000	689.00	26,182,000	
竹本容器	2,100	838.00	1,759,800	
森六ホールディングス	8,900	2,741.00	24,394,900	
恵和	12,400	1,713.00	21,241,200	
日本化薬	131,400	1,259.00	165,432,600	
カーリット	18,500	1,472.00	27,232,000	
日本精化	11,400	2,964.00	33,789,600	
扶桑化学工業	18,300	4,010.00	73,383,000	
トリケミカル研究所	20,900	4,335.00	90,601,500	
ＡＤＥＫＡ	60,000	3,241.00	194,460,000	
日油	155,800	2,284.50	355,925,100	
新日本理化	7,700	214.00	1,647,800	
ハリマ化成グループ	12,100	951.00	11,507,100	
花王	389,100	6,748.00	2,625,646,800	
第一工業製薬	6,900	3,745.00	25,840,500	
石原ケミカル	7,700	2,343.00	18,041,100	
日華化学	2,200	1,003.00	2,206,600	
ニイタカ	1,100	1,886.00	2,074,600	
三洋化成工業	10,600	4,060.00	43,036,000	
有機合成薬品工業	4,500	300.00	1,350,000	
大日本塗料	19,100	1,288.00	24,600,800	
日本ペイントホールディングス	913,700	1,018.50	930,603,450	
関西ペイント	148,700	2,541.00	377,846,700	

神東塗料	4,700	134.00	629,800	
中国塗料	35,300	2,119.00	74,800,700	
日本特殊塗料	4,000	1,206.00	4,824,000	
藤倉化成	19,800	534.00	10,573,200	
太陽ホールディングス	30,000	3,360.00	100,800,000	
ＤＩＣ	67,200	3,017.00	202,742,400	
サカタインクス	38,300	1,767.00	67,676,100	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	37,000	3,325.00	123,025,000	
富士フイルムホールディングス	958,900	3,982.00	3,818,339,800	
資生堂	359,700	4,550.00	1,636,635,000	
ライオン	219,300	1,288.00	282,458,400	
高砂香料工業	12,900	3,745.00	48,310,500	
マンダム	37,200	1,222.00	45,458,400	
ミルボン	23,400	3,337.00	78,085,800	
ファンケル	75,400	2,728.50	205,728,900	
コーセー	35,000	10,265.00	359,275,000	
コタ	17,500	1,610.00	28,175,000	
シーボン	800	1,394.00	1,115,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	88,300	1,345.50	118,807,650	
ノエビアホールディングス	15,400	5,790.00	89,166,000	
アジュバンホールディングス	1,400	875.00	1,225,000	
新日本製薬	9,800	1,735.00	17,003,000	
Ｉ－ｎｅ	4,600	1,652.00	7,599,200	
アクシージア	11,300	1,071.00	12,102,300	
エステー	13,300	1,568.00	20,854,400	
アグロ　カネショウ	6,900	1,169.00	8,066,100	
コニシ	49,800	1,249.00	62,200,200	
長谷川香料	32,900	3,285.00	108,076,500	
小林製薬	50,100	5,464.00	273,746,400	
荒川化学工業	14,600	1,201.00	17,534,600	
メック	14,200	4,440.00	63,048,000	
日本高純度化学	3,900	3,380.00	13,182,000	
タカラバイオ	46,400	1,143.00	53,035,200	
ＪＣＵ	19,000	4,005.00	76,095,000	
新田ゼラチン	3,800	755.00	2,869,000	
ＯＡＴアグリオ	6,400	1,754.00	11,225,600	

デクセリアルズ	42,600	8,181.00	348,510,600	
アース製薬	15,600	4,895.00	76,362,000	
北興化学工業	17,300	1,476.00	25,534,800	
大成ラミック	5,000	2,812.00	14,060,000	
クミアイ化学工業	68,400	790.00	54,036,000	
日本農薬	31,600	731.00	23,099,600	
アキレス	10,900	1,585.00	17,276,500	
有沢製作所	30,200	1,670.00	50,434,000	
日東電工	110,700	13,180.00	1,459,026,000	
レック	22,100	1,140.00	25,194,000	
三光合成	21,700	703.00	15,255,100	
きもと	9,300	214.00	1,990,200	
藤森工業	13,600	4,250.00	57,800,000	
前澤化成工業	11,100	1,897.00	21,056,700	
未来工業	6,200	3,830.00	23,746,000	
ウェーブロックホールディングス	2,100	642.00	1,348,200	
ＪＳＰ	12,100	2,271.00	27,479,100	
エフピコ	32,600	2,359.00	76,903,400	
天馬	12,300	2,849.00	35,042,700	
信越ポリマー	37,200	1,571.00	58,441,200	
東リ	12,400	398.00	4,935,200	
ニフコ	51,500	3,940.00	202,910,000	
バルカー	14,400	3,710.00	53,424,000	
ユニ・チャーム	358,900	5,273.00	1,892,479,700	
ショーエイコーポレーション	1,800	592.00	1,065,600	
協和キリン	208,100	3,102.00	645,526,200	
武田薬品工業	1,524,800	4,250.00	6,480,400,000	
アステラス製薬	1,511,300	1,630.00	2,463,419,000	
住友ファーマ	127,800	405.00	51,759,000	
塩野義製薬	209,600	6,462.00	1,354,435,200	
わかもと製薬	5,900	240.00	1,416,000	
日本新薬	45,100	3,452.00	155,685,200	
中外製薬	539,300	6,395.00	3,448,823,500	
科研製薬	29,500	3,960.00	116,820,000	
エーザイ	209,600	6,634.00	1,390,486,400	
ロート製薬	166,900	3,369.00	562,286,100	

小野薬品工業	352,400	2,171.00	765,060,400	
久光製薬	38,300	3,830.00	146,689,000	
持田製薬	19,300	3,300.00	63,690,000	
参天製薬	304,000	1,735.00	527,440,000	
扶桑薬品工業	6,100	2,351.00	14,341,100	
日本ケミファ	600	1,582.00	949,200	
ツムラ	54,200	4,208.00	228,073,600	
キッセイ薬品工業	28,500	3,220.00	91,770,000	
生化学工業	29,200	878.00	25,637,600	
栄研化学	29,700	2,300.00	68,310,000	
鳥居薬品	9,300	3,735.00	34,735,500	
ＪＣＲファーマ	58,300	606.00	35,329,800	
東和薬品	26,500	2,998.00	79,447,000	
富士製薬工業	12,700	1,498.00	19,024,600	
ゼリア新薬工業	23,900	2,089.00	49,927,100	
ネクセラファーマ	75,400	1,667.00	125,691,800	
第一三共	1,501,000	5,877.00	8,821,377,000	
杏林製薬	37,400	1,700.00	63,580,000	
大幸薬品	35,800	443.00	15,859,400	
ダイト	13,100	2,306.00	30,208,600	
大塚ホールディングス	358,400	7,052.00	2,527,436,800	
ペプチドリーム	83,500	2,743.50	229,082,250	
セルソース	6,400	1,404.00	8,985,600	
あすか製薬ホールディングス	17,700	2,400.00	42,480,000	
サワイグループホールディングス	39,400	6,709.00	264,334,600	
日本コークス工業	174,800	117.00	20,451,600	
ニチレキ	22,400	2,316.00	51,878,400	
ユシロ化学工業	8,900	1,825.00	16,242,500	
ビーピー・カストロール	2,200	938.00	2,063,600	
富士石油	50,200	479.00	24,045,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,000	1,339.00	2,678,000	
出光興産	894,600	1,023.50	915,623,100	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,727,700	828.40	2,259,626,680	
コスモエネルギーホールディングス	51,100	7,956.00	406,551,600	
横浜ゴム	87,100	3,318.00	288,997,800	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	99,000	2,531.00	250,569,000	

ブリヂストン	504,300	6,242.00	3,147,840,600	
住友ゴム工業	169,000	1,573.50	265,921,500	
藤倉コンポジット	14,900	1,381.00	20,576,900	
オカモト	8,000	4,995.00	39,960,000	
フコク	9,000	2,218.00	19,962,000	
ニッタ	17,500	4,050.00	70,875,000	
住友理工	26,700	1,506.00	40,210,200	
三ツ星ベルト	20,000	4,560.00	91,200,000	
バンドー化学	25,600	1,968.00	50,380,800	
日東紡績	21,800	6,660.00	145,188,000	
ＡＧＣ	153,700	5,249.00	806,771,300	
日本板硝子	82,200	414.00	34,030,800	
石塚硝子	1,000	2,820.00	2,820,000	
日本山村硝子	2,200	1,532.00	3,370,400	
日本電気硝子	70,400	3,650.00	256,960,000	
オハラ	8,200	1,335.00	10,947,000	
住友大阪セメント	28,700	3,999.00	114,771,300	
太平洋セメント	100,600	4,066.00	409,039,600	
日本ヒューム	15,200	1,252.00	19,030,400	
日本コンクリート工業	33,700	386.00	13,008,200	
三谷セキサン	7,200	5,580.00	40,176,000	
アジアパイルホールディングス	24,600	986.00	24,255,600	
東海カーボン	159,100	930.00	147,963,000	
日本カーボン	9,100	5,170.00	47,047,000	
東洋炭素	12,200	7,300.00	89,060,000	
ノリタケカンパニーリミテド	19,100	4,170.00	79,647,000	
ＴＯＴＯ	113,700	3,914.00	445,021,800	
日本碍子	200,500	2,084.00	417,842,000	
日本特殊陶業	144,300	4,894.00	706,204,200	
ＭＡＲＵＷＡ	6,400	40,700.00	260,480,000	
品川リフラクトリーズ	21,200	1,935.00	41,022,000	
黒崎播磨	14,100	2,690.00	37,929,000	
ヨータイ	10,100	1,822.00	18,402,200	
東京窯業	6,200	421.00	2,610,200	
ニッカトー	2,700	560.00	1,512,000	
フジミインコーポレーテッド	46,300	3,130.00	144,919,000	

クニミネ工業	1,700	1,077.00	1,830,900	
エーアンドエーマテリアル	1,200	1,356.00	1,627,200	
ニチアス	43,600	4,835.00	210,806,000	
ニチハ	21,600	3,555.00	76,788,000	
日本製鉄	803,400	3,439.00	2,762,892,600	
神戸製鋼所	356,500	1,971.00	702,661,500	
中山製鋼所	40,600	925.00	37,555,000	
合同製鐵	9,900	4,985.00	49,351,500	
ＪＦＥホールディングス	493,000	2,319.00	1,143,267,000	
東京製鐵	49,800	1,570.00	78,186,000	
共英製鋼	20,200	2,104.00	42,500,800	
大和工業	33,400	7,918.00	264,461,200	
東京鐵鋼	7,800	4,995.00	38,961,000	
大阪製鐵	8,200	2,350.00	19,270,000	
淀川製鋼所	19,900	5,700.00	113,430,000	
中部鋼鈑	11,700	2,716.00	31,777,200	
丸一鋼管	54,000	3,747.00	202,338,000	
モリ工業	4,000	5,530.00	22,120,000	
大同特殊鋼	111,700	1,426.50	159,340,050	
日本高周波鋼業	2,300	473.00	1,087,900	
日本冶金工業	13,000	5,210.00	67,730,000	
山陽特殊製鋼	17,500	2,077.00	36,347,500	
愛知製鋼	10,200	3,410.00	34,782,000	
日本金属	1,500	771.00	1,156,500	
大平洋金属	15,100	1,281.00	19,343,100	
新日本電工	88,300	290.00	25,607,000	
栗本鐵工所	8,200	4,770.00	39,114,000	
虹技	800	1,141.00	912,800	
三菱製鋼	13,100	1,479.00	19,374,900	
日亜鋼業	5,900	313.00	1,846,700	
日本精線	14,100	1,238.00	17,455,800	
エンビプロ・ホールディングス	15,800	474.00	7,489,200	
シンニッタン	7,300	231.00	1,686,300	
新家工業	1,300	5,300.00	6,890,000	
大紀アルミニウム工業所	22,800	1,259.00	28,705,200	
日本軽金属ホールディングス	52,000	1,772.00	92,144,000	

三井金属鉱業	51,700	5,369.00	277,577,300	
三菱マテリアル	126,900	3,013.00	382,349,700	
住友金属鉱山	205,600	5,226.00	1,074,465,600	
ＤＯＷＡホールディングス	43,900	5,678.00	249,264,200	
古河機械金属	23,600	1,836.00	43,329,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	30,900	2,646.00	81,761,400	
東邦チタニウム	37,000	1,450.00	53,650,000	
ＵＡＣＪ	25,000	3,815.00	95,375,000	
ＣＫサンエツ	4,400	3,635.00	15,994,000	
古河電気工業	59,100	4,230.00	249,993,000	
住友電気工業	663,200	2,501.00	1,658,663,200	
フジクラ	209,200	3,503.00	732,827,600	
ＳＷＣＣ	19,900	4,750.00	94,525,000	
タツタ電線	32,200	730.00	23,506,000	
カナレ電気	1,000	1,565.00	1,565,000	
平河ヒューテック	11,700	1,453.00	17,000,100	
リョービ	19,100	2,197.00	41,962,700	
アーレスティ	6,300	787.00	4,958,100	
ＡＲＥホールディングス	66,800	2,070.00	138,276,000	
稲葉製作所	9,800	1,849.00	18,120,200	
宮地エンジニアリンググループ	8,900	4,885.00	43,476,500	
トーカロ	51,100	2,022.00	103,324,200	
アルファＣｏ	2,100	1,371.00	2,879,100	
ＳＵＭＣＯ	314,900	2,496.50	786,147,850	
川田テクノロジーズ	12,600	2,706.00	34,095,600	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	11,900	3,470.00	41,293,000	
ジェイテックコーポレーション	1,000	1,591.00	1,591,000	
信和	3,700	755.00	2,793,500	
東洋製罐グループホールディングス	101,700	2,457.00	249,876,900	
ホッカンホールディングス	8,700	1,716.00	14,929,200	
コロナ	9,900	958.00	9,484,200	
横河ブリッジホールディングス	27,700	2,780.00	77,006,000	
駒井ハルテック	1,000	1,793.00	1,793,000	
高田機工	400	3,605.00	1,442,000	
三和ホールディングス	176,500	3,059.00	539,913,500	
文化シヤッター	46,400	1,761.00	81,710,400	

三協立山	22,300	800.00	17,840,000	
アルインコ	13,500	1,081.00	14,593,500	
東洋シヤッター	1,300	908.00	1,180,400	
ＬＩＸＩＬ	276,800	1,759.50	487,029,600	
日本フイルコン	3,800	530.00	2,014,000	
ノーリツ	28,100	1,800.00	50,580,000	
長府製作所	17,600	2,189.00	38,526,400	
リンナイ	84,800	3,654.00	309,859,200	
ダイニチ工業	2,900	680.00	1,972,000	
日東精工	25,700	703.00	18,067,100	
三洋工業	700	3,125.00	2,187,500	
岡部	31,700	775.00	24,567,500	
ジーテクト	22,600	1,895.00	42,827,000	
東プレ	31,200	2,183.00	68,109,600	
高周波熱錬	26,200	1,131.00	29,632,200	
東京製綱	11,500	1,318.00	15,157,000	
サンコール	17,700	485.00	8,584,500	
モリテック　スチール	5,100	225.00	1,147,500	
パイオラックス	22,000	2,440.00	53,680,000	
エイチワン	18,200	1,085.00	19,747,000	
日本発條	156,800	1,736.00	272,204,800	
中央発條	13,100	1,246.00	16,322,600	
アドバネクス	700	1,048.00	733,600	
立川ブラインド工業	8,000	1,334.00	10,672,000	
三益半導体工業	16,000	3,690.00	59,040,000	
日本ドライケミカル	1,400	2,704.00	3,785,600	
日本製鋼所	47,800	4,478.00	214,048,400	
三浦工業	72,500	3,594.00	260,565,000	
タクマ	58,700	1,746.00	102,490,200	
ツガミ	38,100	1,515.00	57,721,500	
オークマ	15,200	7,834.00	119,076,800	
芝浦機械	17,100	3,795.00	64,894,500	
アマダ	263,000	1,832.50	481,947,500	
アイダエンジニアリング	40,200	879.00	35,335,800	
ＦＵＪＩ	81,700	2,660.50	217,362,850	
牧野フライス製作所	19,200	6,810.00	130,752,000	

オーエスジー	76,500	1,908.00	145,962,000	
ダイジェット工業	600	863.00	517,800	
旭ダイヤモンド工業	40,100	968.00	38,816,800	
ＤＭＧ森精機	118,600	4,172.00	494,799,200	
ソディック	42,300	742.00	31,386,600	
ディスコ	83,500	66,270.00	5,533,545,000	
日東工器	8,300	2,185.00	18,135,500	
日進工具	16,100	969.00	15,600,900	
パンチ工業	5,600	450.00	2,520,000	
冨士ダイス	11,600	863.00	10,010,800	
豊和工業	3,100	871.00	2,700,100	
リケンＮＰＲ	18,800	2,828.00	53,166,400	
東洋機械金属	4,700	735.00	3,454,500	
エンシュウ	1,400	714.00	999,600	
島精機製作所	27,600	1,706.00	47,085,600	
オプトラン	28,500	2,197.00	62,614,500	
ＮＣホールディングス	1,300	2,204.00	2,865,200	
イワキポンプ	11,600	2,970.00	34,452,000	
フリュー	16,400	1,050.00	17,220,000	
ヤマシンフィルタ	41,300	418.00	17,263,400	
日阪製作所	19,000	1,035.00	19,665,000	
やまびこ	28,400	2,267.00	64,382,800	
野村マイクロ・サイエンス	23,500	3,995.00	93,882,500	
平田機工	8,300	6,650.00	55,195,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	19,200	584.00	11,212,800	
マルマエ	7,600	2,139.00	16,256,400	
タツモ	10,500	3,585.00	37,642,500	
ナブテスコ	108,900	2,794.00	304,266,600	
三井海洋開発	22,000	2,777.00	61,094,000	
レオン自動機	20,100	1,658.00	33,325,800	
ＳＭＣ	51,900	81,800.00	4,245,420,000	
ホソカワミクロン	12,100	4,005.00	48,460,500	
ユニオンツール	7,600	6,050.00	45,980,000	
瑞光	12,500	1,049.00	13,112,500	
オイレス工業	23,500	2,305.00	54,167,500	
日精エー・エス・ビー機械	6,000	5,480.00	32,880,000	

サトーホールディングス	24,700	2,203.00	54,414,100	
技研製作所	16,300	1,951.00	31,801,300	
日本エアーテック	8,100	1,240.00	10,044,000	
カワタ	1,800	875.00	1,575,000	
日精樹脂工業	12,900	1,021.00	13,170,900	
オカダアイヨン	1,900	2,397.00	4,554,300	
ワイエイシイホールディングス	7,400	2,667.00	19,735,800	
小松製作所	813,300	4,785.00	3,891,640,500	
住友重機械工業	102,700	4,154.00	426,615,800	
日立建機	69,100	4,398.00	303,901,800	
日工	25,800	772.00	19,917,600	
巴工業	6,800	4,715.00	32,062,000	
井関農機	16,300	1,026.00	16,723,800	
ＴＯＷＡ	19,300	11,220.00	216,546,000	
丸山製作所	1,000	2,381.00	2,381,000	
北川鉄工所	6,900	1,562.00	10,777,800	
ローツェ	9,100	34,450.00	313,495,000	
タカキタ	1,900	469.00	891,100	
クボタ	907,100	2,185.00	1,982,013,500	
荏原実業	9,200	4,460.00	41,032,000	
三菱化工機	6,100	4,240.00	25,864,000	
月島ホールディングス	23,500	1,479.00	34,756,500	
帝国電機製作所	11,900	2,571.00	30,594,900	
新東工業	35,100	1,131.00	39,698,100	
澁谷工業	16,300	3,475.00	56,642,500	
アイチ　コーポレーション	24,000	1,238.00	29,712,000	
小森コーポレーション	42,800	1,361.00	58,250,800	
鶴見製作所	13,300	4,190.00	55,727,000	
日本ギア工業	2,200	564.00	1,240,800	
酒井重工業	3,100	5,860.00	18,166,000	
荏原製作所	356,000	2,468.50	878,786,000	
石井鐵工所	700	3,040.00	2,128,000	
酉島製作所	14,900	3,140.00	46,786,000	
北越工業	17,500	2,271.00	39,742,500	
ダイキン工業	207,100	23,025.00	4,768,477,500	
オルガノ	20,900	7,830.00	163,647,000	

トーヨーカネツ	5,900	3,880.00	22,892,000	
栗田工業	97,100	7,057.00	685,234,700	
椿本チエイン	23,800	6,400.00	152,320,000	
大同工業	2,500	905.00	2,262,500	
木村化工機	13,300	720.00	9,576,000	
アネスト岩田	26,800	1,594.00	42,719,200	
ダイフク	292,800	2,990.00	875,472,000	
サムコ	4,100	4,890.00	20,049,000	
加藤製作所	2,900	1,264.00	3,665,600	
油研工業	1,000	2,346.00	2,346,000	
タダノ	99,900	1,132.50	113,136,750	
フジテック	40,600	4,408.00	178,964,800	
ＣＫＤ	48,000	3,375.00	162,000,000	
平和	51,300	2,063.00	105,831,900	
理想科学工業	13,900	3,120.00	43,368,000	
ＳＡＮＫＹＯ	167,000	1,801.50	300,850,500	
日本金銭機械	21,000	1,079.00	22,659,000	
マースグループホールディングス	8,800	3,810.00	33,528,000	
フクシマガリレイ	11,300	6,580.00	74,354,000	
オーイズミ	2,200	354.00	778,800	
ダイコク電機	8,600	3,995.00	34,357,000	
竹内製作所	31,500	5,720.00	180,180,000	
アマノ	49,300	4,167.00	205,433,100	
ＪＵＫＩ	26,900	522.00	14,041,800	
ジャノメ	17,600	682.00	12,003,200	
マックス	24,400	3,750.00	91,500,000	
グローリー	41,700	2,699.00	112,548,300	
新晃工業	17,500	4,200.00	73,500,000	
大和冷機工業	26,600	1,568.00	41,708,800	
セガサミーホールディングス	155,000	2,510.50	389,127,500	
ＴＰＲ	22,100	2,476.00	54,719,600	
ツバキ・ナカシマ	34,800	824.00	28,675,200	
ホシザキ	102,400	4,843.00	495,923,200	
大豊工業	15,000	779.00	11,685,000	
日本精工	321,300	808.80	259,867,440	
ＮＴＮ	376,400	320.90	120,786,760	

ジェイテクト	154,400	1,118.50	172,696,400	
不二越	12,800	3,340.00	42,752,000	
日本トムソン	47,300	627.00	29,657,100	
ＴＨＫ	100,100	2,958.00	296,095,800	
ユーシン精機	13,800	745.00	10,281,000	
前澤給装工業	12,500	1,430.00	17,875,000	
イーグル工業	19,200	1,848.00	35,481,600	
前澤工業	3,600	1,557.00	5,605,200	
ＰＩＬＬＡＲ	16,100	5,470.00	88,067,000	
キッツ	58,100	1,127.00	65,478,700	
マキタ	197,900	4,567.00	903,809,300	
三井Ｅ＆Ｓ	86,100	1,404.00	120,884,400	
日立造船	153,200	1,069.00	163,770,800	
三菱重工業	3,034,200	1,875.00	5,689,125,000	
ＩＨＩ	129,200	5,457.00	705,044,400	
スター精密	31,900	2,125.00	67,787,500	
日清紡ホールディングス	130,400	1,062.00	138,484,800	
イビデン	90,500	6,805.00	615,852,500	
コニカミノルタ	388,000	463.20	179,721,600	
ブラザー工業	231,900	3,053.00	707,990,700	
ミネベアミツミ	301,900	3,567.00	1,076,877,300	
日立製作所	4,169,400	3,818.00	15,918,769,200	
三菱電機	1,900,600	2,810.50	5,341,636,300	
富士電機	105,500	9,431.00	994,970,500	
東洋電機製造	2,000	1,047.00	2,094,000	
安川電機	188,500	5,713.00	1,076,900,500	
シンフォニアテクノロジー	19,100	3,490.00	66,659,000	
明電舎	32,200	3,610.00	116,242,000	
オリジン	1,300	1,330.00	1,729,000	
山洋電気	7,500	7,110.00	53,325,000	
デンヨー	13,200	2,744.00	36,220,800	
ＰＨＣホールディングス	32,600	1,123.00	36,609,800	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	90,600	5,400.00	489,240,000	
ソシオネクスト	126,500	3,811.00	482,091,500	
東芝テック	22,200	3,555.00	78,921,000	
芝浦メカトロニクス	9,900	9,590.00	94,941,000	

マブチモーター	85,400	2,343.00	200,092,200	
ニデック	383,100	6,949.00	2,662,161,900	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,400	418.00	4,765,200	
トレックス・セミコンダクター	9,000	1,875.00	16,875,000	
東光高岳	10,600	1,999.00	21,189,400	
ダブル・スコープ	49,700	507.00	25,197,900	
ダイヘン	16,400	8,450.00	138,580,000	
ヤーマン	34,000	814.00	27,676,000	
ＪＶＣケンウッド	137,200	873.00	119,775,600	
ミマキエンジニアリング	16,600	2,082.00	34,561,200	
Ｉ－ＰＥＸ	12,100	2,206.00	26,692,600	
大崎電気工業	37,500	673.00	25,237,500	
オムロン	132,500	5,782.00	766,115,000	
日東工業	23,400	3,530.00	82,602,000	
ＩＤＥＣ	25,600	3,050.00	78,080,000	
正興電機製作所	2,000	1,386.00	2,772,000	
不二電機工業	1,300	1,155.00	1,501,500	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	67,800	2,938.00	199,196,400	
サクサ	1,300	2,590.00	3,367,000	
メルコホールディングス	5,500	3,385.00	18,617,500	
テクノメディカ	4,300	1,796.00	7,722,800	
日本電気	227,900	13,760.00	3,135,904,000	
富士通	1,596,600	2,658.00	4,243,762,800	
沖電気工業	78,400	1,064.00	83,417,600	
岩崎通信機	2,700	1,350.00	3,645,000	
電気興業	7,000	2,110.00	14,770,000	
サンケン電気	16,100	7,540.00	121,394,000	
ナカヨ	900	1,147.00	1,032,300	
アイホン	9,400	3,100.00	29,140,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,081,600	3,293.00	3,561,708,800	
セイコーエプソン	222,600	2,671.50	594,675,900	
ワコム	125,500	824.00	103,412,000	
アルバック	38,000	10,790.00	410,020,000	
アクセル	7,900	1,472.00	11,628,800	
ＥＩＺＯ	12,700	4,940.00	62,738,000	
日本信号	39,500	1,032.00	40,764,000	

京三製作所	36,300	682.00	24,756,600	
能美防災	23,500	2,440.00	57,340,000	
ホーチキ	13,100	2,302.00	30,156,200	
星和電機	2,800	565.00	1,582,000	
エレコム	41,600	1,667.00	69,347,200	
パナソニック　ホールディングス	2,049,600	1,315.50	2,696,248,800	
シャープ	292,500	937.80	274,306,500	
アンリツ	122,200	1,230.50	150,367,100	
富士通ゼネラル	49,200	2,044.50	100,589,400	
ソニーグループ	1,203,000	14,845.00	17,858,535,000	
ＴＤＫ	274,700	11,005.00	3,023,073,500	
帝国通信工業	7,700	2,088.00	16,077,600	
タムラ製作所	69,100	725.00	50,097,500	
アルプスアルパイン	155,100	1,561.50	242,188,650	
池上通信機	1,800	799.00	1,438,200	
日本電波工業	20,900	1,460.00	30,514,000	
鈴木	9,400	1,430.00	13,442,000	
メイコー	17,200	7,450.00	128,140,000	
日本トリム	4,000	3,510.00	14,040,000	
ローランド　ディー．ジー．	6,600	5,350.00	35,310,000	
フォスター電機	12,800	1,769.00	22,643,200	
ＳＭＫ	4,600	2,444.00	11,242,400	
ヨコオ	15,400	2,049.00	31,554,600	
ホシデン	39,500	2,142.00	84,609,000	
ヒロセ電機	25,600	18,820.00	481,792,000	
日本航空電子工業	41,500	2,648.00	109,892,000	
ＴＯＡ	19,700	1,055.00	20,783,500	
マクセル	38,400	1,853.00	71,155,200	
古野電気	22,600	2,373.00	53,629,800	
スミダコーポレーション	23,500	1,102.00	25,897,000	
アイコム	6,700	3,145.00	21,071,500	
リオン	7,200	2,837.00	20,426,400	
横河電機	189,800	4,108.00	779,698,400	
新電元工業	6,600	2,889.00	19,067,400	
アズビル	118,200	4,501.00	532,018,200	
東亜ディーケーケー	2,900	850.00	2,465,000	

日本光電工業	147,500	2,354.00	347,215,000	
チノー	7,100	2,493.00	17,700,300	
共和電業	5,200	443.00	2,303,600	
日本電子材料	10,600	3,990.00	42,294,000	
堀場製作所	32,800	13,235.00	434,108,000	
アドバンテスト	492,200	6,924.00	3,407,992,800	
小野測器	2,600	650.00	1,690,000	
エスペック	13,800	3,085.00	42,573,000	
キーエンス	171,900	75,830.00	13,035,177,000	
日置電機	8,100	7,030.00	56,943,000	
シスメックス	444,800	2,531.50	1,126,011,200	
日本マイクロニクス	30,900	7,440.00	229,896,000	
メガチップス	13,600	4,155.00	56,508,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	10,800	4,205.00	45,414,000	
澤藤電機	800	1,260.00	1,008,000	
原田工業	2,800	579.00	1,621,200	
コーセル	18,500	1,217.00	22,514,500	
イリソ電子工業	15,900	3,120.00	49,608,000	
オプテックスグループ	31,600	1,707.00	53,941,200	
千代田インテグレ	6,800	3,285.00	22,338,000	
レーザーテック	78,700	33,610.00	2,645,107,000	
スタンレー電気	110,100	2,878.00	316,867,800	
ウシオ電機	76,100	2,145.00	163,234,500	
岡谷電機産業	5,100	251.00	1,280,100	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	6,000	850.00	5,100,000	
エノモト	1,700	1,532.00	2,604,400	
日本セラミック	14,100	2,550.00	35,955,000	
遠藤照明	2,600	1,530.00	3,978,000	
古河電池	12,800	1,232.00	15,769,600	
山一電機	15,500	3,275.00	50,762,500	
図研	14,300	4,070.00	58,201,000	
日本電子	43,100	7,049.00	303,811,900	
カシオ計算機	124,100	1,198.00	148,671,800	
ファナック	831,300	4,535.00	3,769,945,500	
日本シイエムケイ	40,600	577.00	23,426,200	
エンプラス	5,000	8,270.00	41,350,000	

大真空	25,900	753.00	19,502,700	
ローム	317,700	2,293.00	728,486,100	
浜松ホトニクス	137,900	4,358.00	600,968,200	
三井ハイテック	15,200	6,120.00	93,024,000	
新光電気工業	60,800	5,687.00	345,769,600	
京セラ	1,067,500	1,950.50	2,082,158,750	
太陽誘電	83,700	4,764.00	398,746,800	
村田製作所	1,534,600	3,597.00	5,519,956,200	
双葉電子工業	33,000	652.00	21,516,000	
北陸電気工業	2,200	1,362.00	2,996,400	
ニチコン	45,300	1,179.00	53,408,700	
日本ケミコン	18,400	1,604.00	29,513,600	
ＫＯＡ	26,100	1,533.00	40,011,300	
市光工業	31,300	519.00	16,244,700	
小糸製作所	178,100	2,259.50	402,416,950	
ミツバ	32,200	1,162.00	37,416,400	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	58,700	16,540.00	970,898,000	
キヤノン電子	19,100	2,281.00	43,567,100	
キヤノン	856,800	4,525.00	3,877,020,000	
リコー	430,700	1,417.50	610,517,250	
象印マホービン	46,800	1,499.00	70,153,200	
ＭＵＴＯＨホールディングス	800	2,446.00	1,956,800	
東京エレクトロン	363,600	37,820.00	13,751,352,000	
イノテック	11,600	1,738.00	20,160,800	
トヨタ紡織	72,400	2,126.00	153,922,400	
芦森工業	1,200	2,365.00	2,838,000	
ユニプレス	30,900	1,361.00	42,054,900	
豊田自動織機	146,500	13,605.00	1,993,132,500	
モリタホールディングス	30,200	1,772.00	53,514,400	
三櫻工業	26,300	1,024.00	26,931,200	
デンソー	1,417,300	2,538.50	3,597,816,050	
東海理化電機製作所	48,500	2,105.00	102,092,500	
川崎重工業	140,200	5,942.00	833,068,400	
名村造船所	48,100	2,356.00	113,323,600	
日本車輌製造	5,700	2,679.00	15,270,300	
三菱ロジスネクスト	27,400	1,455.00	39,867,000	

近畿車輛	800	1,841.00	1,472,800	
日産自動車	2,260,300	550.90	1,245,199,270	
いすゞ自動車	482,400	2,185.50	1,054,285,200	
トヨタ自動車	9,132,200	3,291.00	30,054,070,200	
日野自動車	258,400	419.10	108,295,440	
三菱自動車工業	670,200	493.30	330,609,660	
エフテック	4,000	634.00	2,536,000	
レシップホールディングス	2,400	645.00	1,548,000	
ＧＭＢ	1,100	1,538.00	1,691,800	
ファルテック	1,200	551.00	661,200	
武蔵精密工業	42,000	1,936.00	81,312,000	
日産車体	17,400	979.00	17,034,600	
新明和工業	49,500	1,438.00	71,181,000	
極東開発工業	28,400	2,538.00	72,079,200	
トピー工業	13,900	2,391.00	33,234,900	
ティラド	3,800	3,625.00	13,775,000	
曙ブレーキ工業	104,800	162.00	16,977,600	
タチエス	31,700	2,036.00	64,541,200	
ＮＯＫ	66,800	2,177.00	145,423,600	
フタバ産業	46,100	859.00	39,599,900	
カヤバ	16,200	5,190.00	84,078,000	
大同メタル工業	33,700	614.00	20,691,800	
プレス工業	68,700	643.00	44,174,100	
ミクニ	7,200	398.00	2,865,600	
太平洋工業	39,400	1,527.00	60,163,800	
アイシン	132,500	5,429.00	719,342,500	
マツダ	568,200	1,516.50	861,675,300	
今仙電機製作所	3,600	618.00	2,224,800	
本田技研工業	4,070,300	1,703.00	6,931,720,900	
スズキ	1,262,100	1,919.50	2,422,600,950	
ＳＵＢＡＲＵ	532,700	3,447.00	1,836,216,900	
安永	2,500	577.00	1,442,500	
ヤマハ発動機	742,400	1,574.50	1,168,908,800	
ＴＢＫ	6,200	301.00	1,866,200	
エクセディ	28,100	3,110.00	87,391,000	
豊田合成	49,200	2,766.50	136,111,800	

愛三工業	28,500	1,401.00	39,928,500	
盟和産業	800	1,020.00	816,000	
日本プラスト	4,900	422.00	2,067,800	
ヨロズ	16,100	1,158.00	18,643,800	
エフ・シー・シー	30,500	2,373.00	72,376,500	
シマノ	69,200	24,750.00	1,712,700,000	
テイ・エス　テック	61,200	1,954.50	119,615,400	
ジャムコ	9,400	1,597.00	15,011,800	
テルモ	957,600	2,820.50	2,700,910,800	
クリエートメディック	1,800	947.00	1,704,600	
日機装	40,000	1,173.00	46,920,000	
日本エム・ディ・エム	13,600	667.00	9,071,200	
島津製作所	228,200	4,255.00	970,991,000	
ＪＭＳ	15,900	525.00	8,347,500	
長野計器	12,400	3,460.00	42,904,000	
ブイ・テクノロジー	9,000	3,255.00	29,295,000	
東京計器	13,200	3,695.00	48,774,000	
愛知時計電機	7,400	2,218.00	16,413,200	
インターアクション	10,400	1,659.00	17,253,600	
オーバル	4,900	461.00	2,258,900	
東京精密	35,200	13,515.00	475,728,000	
マニー	68,700	2,081.00	142,964,700	
ニコン	248,400	1,700.50	422,404,200	
トプコン	83,500	1,825.50	152,429,250	
オリンパス	983,500	2,689.50	2,645,123,250	
理研計器	24,300	4,170.00	101,331,000	
タムロン	20,800	4,310.00	89,648,000	
ＨＯＹＡ	338,200	20,640.00	6,980,448,000	
シード	3,400	565.00	1,921,000	
ノーリツ鋼機	16,300	4,410.00	71,883,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	25,000	3,415.00	85,375,000	
朝日インテック	209,400	2,345.00	491,043,000	
シチズン時計	158,000	1,084.00	171,272,000	
リズム	1,300	3,755.00	4,881,500	
大研医器	4,800	537.00	2,577,600	
メニコン	59,100	1,309.50	77,391,450	

シンシア	700	451.00	315,700	
松風	7,800	4,855.00	37,869,000	
セイコーグループ	23,900	4,930.00	117,827,000	
ニプロ	143,200	1,283.00	183,725,600	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	8,300	169.00	1,402,700	
中本パックス	1,800	1,642.00	2,955,600	
パラマウントベッドホールディングス	35,700	2,661.00	94,997,700	
トランザクション	11,300	1,792.00	20,249,600	
粧美堂	1,500	556.00	834,000	
ニホンフラッシュ	16,100	912.00	14,683,200	
前田工繊	30,600	1,604.00	49,082,400	
永大産業	6,600	243.00	1,603,800	
アートネイチャー	15,500	820.00	12,710,000	
フルヤ金属	16,300	4,735.00	77,180,500	
バンダイナムコホールディングス	466,400	3,151.00	1,469,626,400	
アイフィスジャパン	1,500	616.00	924,000	
ＳＨＯＥＩ	48,300	1,974.00	95,344,200	
フランスベッドホールディングス	22,200	1,214.00	26,950,800	
パイロットコーポレーション	24,200	4,361.00	105,536,200	
萩原工業	11,500	1,533.00	17,629,500	
フジシールインターナショナル	34,800	2,360.00	82,128,000	
タカラトミー	78,200	3,166.00	247,581,200	
広済堂ホールディングス	50,000	556.00	27,800,000	
エステールホールディングス	1,300	651.00	846,300	
タカノ	2,100	868.00	1,822,800	
プロネクサス	17,800	1,287.00	22,908,600	
ホクシン	4,300	119.00	511,700	
ウッドワン	2,000	913.00	1,826,000	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	204,700	4,607.00	943,052,900	
大日本印刷	178,100	5,450.00	970,645,000	
共同印刷	4,800	3,975.00	19,080,000	
ＮＩＳＳＨＡ	29,400	2,032.00	59,740,800	
光村印刷	500	1,626.00	813,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	10,100	3,015.00	30,451,500	
アシックス	585,500	2,588.50	1,515,566,750	
ツツミ	4,000	2,163.00	8,652,000	

ローランド	12,700	3,930.00	49,911,000	
小松ウオール工業	7,000	3,310.00	23,170,000	
ヤマハ	108,300	3,685.00	399,085,500	
河合楽器製作所	5,200	3,225.00	16,770,000	
クリナップ	16,800	733.00	12,314,400	
ピジョン	109,400	1,467.00	160,489,800	
キングジム	15,200	868.00	13,193,600	
リンテック	34,500	3,530.00	121,785,000	
イトーキ	32,800	1,613.00	52,906,400	
任天堂	1,084,600	9,000.00	9,761,400,000	
三菱鉛筆	24,100	2,635.00	63,503,500	
タカラスタンダード	35,100	1,753.00	61,530,300	
コクヨ	70,300	2,619.00	184,115,700	
ナカバヤシ	18,500	548.00	10,138,000	
グローブライド	15,400	2,086.00	32,124,400	
オカムラ	51,700	2,188.00	113,119,600	
美津濃	17,100	7,450.00	127,395,000	
東京電力ホールディングス	1,548,500	826.90	1,280,454,650	
中部電力	633,000	1,867.00	1,181,811,000	
関西電力	663,400	2,624.00	1,740,761,600	
中国電力	298,500	1,015.00	302,977,500	
北陸電力	175,700	986.20	173,275,340	
東北電力	452,300	1,363.00	616,484,900	
四国電力	160,000	1,343.00	214,880,000	
九州電力	396,000	1,540.50	610,038,000	
北海道電力	166,000	1,082.00	179,612,000	
沖縄電力	43,900	1,062.00	46,621,800	
電源開発	141,100	2,464.00	347,670,400	
エフオン	12,500	401.00	5,012,500	
イーレックス	30,600	689.00	21,083,400	
レノバ	45,800	963.00	44,105,400	
東京瓦斯	334,400	3,411.00	1,140,638,400	
大阪瓦斯	342,300	3,410.00	1,167,243,000	
東邦瓦斯	74,400	3,840.00	285,696,000	
北海道瓦斯	10,300	3,160.00	32,548,000	
広島ガス	36,300	387.00	14,048,100	

西部ガスホールディングス	17,900	1,953.00	34,958,700	
静岡ガス	34,300	924.00	31,693,200	
メタウォーター	20,600	1,922.00	39,593,200	
ＳＢＳホールディングス	15,300	2,568.00	39,290,400	
東武鉄道	188,700	2,635.00	497,224,500	
相鉄ホールディングス	61,500	2,372.00	145,878,000	
東急	481,700	1,734.00	835,267,800	
京浜急行電鉄	212,600	1,170.00	248,742,000	
小田急電鉄	284,100	1,532.00	435,241,200	
京王電鉄	82,600	3,690.00	304,794,000	
京成電鉄	110,800	5,157.00	571,395,600	
富士急行	21,200	3,035.00	64,342,000	
東日本旅客鉄道	946,800	2,647.00	2,506,179,600	
西日本旅客鉄道	407,500	2,912.50	1,186,843,750	
東海旅客鉄道	661,700	3,499.00	2,315,288,300	
西武ホールディングス	207,800	2,240.00	465,472,000	
鴻池運輸	29,300	2,327.00	68,181,100	
西日本鉄道	45,900	2,462.50	113,028,750	
ハマキョウレックス	14,700	4,540.00	66,738,000	
サカイ引越センター	19,000	2,592.00	49,248,000	
近鉄グループホールディングス	171,500	3,418.00	586,187,000	
阪急阪神ホールディングス	228,700	4,298.00	982,952,600	
南海電気鉄道	76,500	2,639.50	201,921,750	
京阪ホールディングス	94,500	2,819.00	266,395,500	
神戸電鉄	4,700	2,755.00	12,948,500	
名古屋鉄道	176,900	1,752.50	310,017,250	
山陽電気鉄道	12,900	2,032.00	26,212,800	
アルプス物流	13,700	5,720.00	78,364,000	
ヤマトホールディングス	208,400	1,787.50	372,515,000	
山九	41,400	5,347.00	221,365,800	
丸運	3,300	397.00	1,310,100	
丸全昭和運輸	10,600	5,300.00	56,180,000	
センコーグループホールディングス	90,800	1,092.00	99,153,600	
トナミホールディングス	3,800	5,990.00	22,762,000	
ニッコンホールディングス	52,800	3,627.00	191,505,600	
日本石油輸送	600	2,995.00	1,797,000	

福山通運	15,700	3,875.00	60,837,500	
セイノーホールディングス	96,500	2,199.50	212,251,750	
神奈川中央交通	4,900	3,160.00	15,484,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	43,800	1,114.00	48,793,200	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	16,500	5,740.00	94,710,000	
九州旅客鉄道	121,300	3,554.00	431,100,200	
ＳＧホールディングス	288,000	1,377.50	396,720,000	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	58,200	7,240.00	421,368,000	
日本郵船	444,400	4,801.00	2,133,564,400	
商船三井	372,600	4,943.00	1,841,761,800	
川崎汽船	413,500	2,529.50	1,045,948,250	
ＮＳユナイテッド海運	9,400	5,070.00	47,658,000	
飯野海運	63,500	1,317.00	83,629,500	
共栄タンカー	1,600	1,264.00	2,022,400	
乾汽船	20,700	1,171.00	24,239,700	
日本航空	421,200	2,563.50	1,079,746,200	
ＡＮＡホールディングス	466,700	3,021.00	1,409,900,700	
パスコ	1,100	1,836.00	2,019,600	
トランコム	5,000	6,080.00	30,400,000	
日新	13,000	4,615.00	59,995,000	
三菱倉庫	40,900	5,340.00	218,406,000	
三井倉庫ホールディングス	16,000	4,745.00	75,920,000	
住友倉庫	45,800	2,689.00	123,156,200	
澁澤倉庫	7,800	3,050.00	23,790,000	
東陽倉庫	1,500	1,493.00	2,239,500	
日本トランスシティ	34,500	998.00	34,431,000	
ケイヒン	1,000	2,123.00	2,123,000	
中央倉庫	9,200	1,271.00	11,693,200	
川西倉庫	1,000	1,200.00	1,200,000	
安田倉庫	11,700	1,604.00	18,766,800	
ファイズホールディングス	800	1,115.00	892,000	
東洋埠頭	1,600	1,352.00	2,163,200	
上組	79,200	3,437.00	272,210,400	
サンリツ	1,400	875.00	1,225,000	
キムラユニティー	2,700	1,620.00	4,374,000	

キユーソー流通システム	8,800	1,783.00	15,690,400	
東海運	3,300	293.00	966,900	
エーアイテイー	10,800	1,863.00	20,120,400	
内外トランスライン	6,900	2,736.00	18,878,400	
日本コンセプト	6,200	1,801.00	11,166,200	
ＮＥＣネッツエスアイ	67,200	2,439.00	163,900,800	
クロスキャット	10,900	1,315.00	14,333,500	
システナ	260,700	354.00	92,287,800	
デジタルアーツ	10,900	4,805.00	52,374,500	
日鉄ソリューションズ	58,800	2,834.00	166,639,200	
キューブシステム	9,100	1,148.00	10,446,800	
コア	7,600	1,935.00	14,706,000	
手間いらず	2,900	3,545.00	10,280,500	
ラクーンホールディングス	12,900	561.00	7,236,900	
ソリトンシステムズ	8,900	1,277.00	11,365,300	
ソフトクリエイトホールディングス	14,200	1,924.00	27,320,800	
ＴＩＳ	182,100	3,100.00	564,510,000	
テクミラホールディングス	2,600	398.00	1,034,800	
グリー	57,800	542.00	31,327,600	
ＧＭＯペパボ	2,100	1,481.00	3,110,100	
コーエーテクモホールディングス	108,000	1,397.50	150,930,000	
三菱総合研究所	8,400	5,210.00	43,764,000	
電算	700	1,492.00	1,044,400	
ＡＧＳ	2,300	1,008.00	2,318,400	
ファインデックス	13,700	1,076.00	14,741,200	
ブレインパッド	14,300	1,010.00	14,443,000	
ＫＬａｂ	33,600	230.00	7,728,000	
ポールトゥウィンホールディングス	29,500	487.00	14,366,500	
ネクソン	378,200	3,272.00	1,237,470,400	
アイスタイル	57,600	471.00	27,129,600	
エムアップホールディングス	21,100	1,360.00	28,696,000	
エイチーム	11,500	750.00	8,625,000	
エニグモ	22,000	333.00	7,326,000	
テクノスジャパン	5,000	756.00	3,780,000	
コロプラ	58,600	633.00	37,093,800	
ブロードリーフ	81,800	583.00	47,689,400	

クロス・マーケティンググループ	2,700	583.00	1,574,100	
デジタルハーツホールディングス	10,800	1,129.00	12,193,200	
メディアドゥ	7,800	1,465.00	11,427,000	
じげん	50,300	577.00	29,023,100	
ブイキューブ	20,700	265.00	5,485,500	
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	642.00	834,600	
サイバーリンクス	2,200	826.00	1,817,200	
フィックスターズ	17,300	1,890.00	32,697,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	8,100	1,510.00	12,231,000	
オプティム	17,700	664.00	11,752,800	
セレス	7,000	1,614.00	11,298,000	
ＳＨＩＦＴ	11,500	15,255.00	175,432,500	
ティーガイア	18,000	3,250.00	58,500,000	
セック	2,400	4,570.00	10,968,000	
テクマトリックス	31,500	2,008.00	63,252,000	
プロシップ	8,300	1,438.00	11,935,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,900	2,920.00	131,108,000	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	39,300	9,013.00	354,210,900	
ザッパラス	1,300	429.00	557,700	
システムリサーチ	11,800	1,593.00	18,797,400	
インターネットイニシアティブ	82,400	2,554.50	210,490,800	
さくらインターネット	21,500	4,045.00	86,967,500	
ＧＭＯグローバルサイン・ホールディングス	5,300	2,997.00	15,884,100	
ＳＲＡホールディングス	8,800	4,440.00	39,072,000	
システムインテグレータ	1,700	369.00	627,300	
朝日ネット	18,500	683.00	12,635,500	
ｅＢＡＳＥ	24,300	710.00	17,253,000	
アバントグループ	21,800	1,411.00	30,759,800	
アドソル日進	7,300	1,934.00	14,118,200	
ＯＤＫソリューションズ	1,100	583.00	641,300	
フリービット	7,500	1,348.00	10,110,000	
コムチュア	24,900	1,837.00	45,741,300	
アステリア	13,500	547.00	7,384,500	
アイル	9,700	2,398.00	23,260,600	
マークラインズ	9,300	2,906.00	27,025,800	
メディカル・データ・ビジョン	20,600	575.00	11,845,000	

ｇｕｍｉ	28,000	341.00	9,548,000	
ショーケース	1,300	301.00	391,300	
モバイルファクトリー	1,200	645.00	774,000	
テラスカイ	7,500	2,000.00	15,000,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,000	1,945.00	17,505,000	
ＰＣＩホールディングス	2,300	957.00	2,201,100	
アイビーシー	900	483.00	434,700	
ネオジャパン	5,800	1,802.00	10,451,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,500	1,816.00	6,356,000	
ラクス	81,500	1,947.00	158,680,500	
ランドコンピュータ	2,700	800.00	2,160,000	
ダブルスタンダード	5,200	1,778.00	9,245,600	
オープンドア	10,100	647.00	6,534,700	
アカツキ	8,400	2,534.00	21,285,600	
ベネフィットジャパン	400	1,279.00	511,600	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	5,500	1,415.00	7,782,500	
カナミックネットワーク	21,700	556.00	12,065,200	
ノムラシステムコーポレーション	6,200	140.00	868,000	
チェンジホールディングス	37,600	1,242.00	46,699,200	
シンクロ・フード	3,600	514.00	1,850,400	
オークネット	6,400	2,720.00	17,408,000	
キャピタル・アセット・プランニング	1,100	842.00	926,200	
セグエグループ	5,200	617.00	3,208,400	
エイトレッド	900	1,641.00	1,476,900	
マクロミル	33,800	855.00	28,899,000	
ビーグリー	1,200	1,185.00	1,422,000	
オロ	6,200	2,660.00	16,492,000	
ユーザーローカル	7,300	2,075.00	15,147,500	
テモナ	1,400	207.00	289,800	
ニーズウェル	6,200	384.00	2,380,800	
マネーフォワード	38,500	5,350.00	205,975,000	
サインポスト	2,200	586.00	1,289,200	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	12,300	850.00	10,455,000	
プラスアルファ・コンサルティング	21,800	1,810.00	39,458,000	
電算システムホールディングス	7,600	2,776.00	21,097,600	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	59,000	1,252.00	73,868,000	

ビジョナル	20,400	7,730.00	157,692,000	
ソルクシーズ	4,600	316.00	1,453,600	
フェイス	1,600	441.00	705,600	
プロトコーポレーション	18,900	1,450.00	27,405,000	
ハイマックス	5,400	1,399.00	7,554,600	
野村総合研究所	373,100	4,664.00	1,740,138,400	
ＣＥホールディングス	2,700	551.00	1,487,700	
日本システム技術	14,400	1,667.00	24,004,800	
インテージホールディングス	19,500	1,534.00	29,913,000	
東邦システムサイエンス	7,200	1,720.00	12,384,000	
ソースネクスト	78,900	220.00	17,358,000	
インフォコム	22,200	6,040.00	134,088,000	
シンプレクス・ホールディングス	26,200	2,691.00	70,504,200	
ＨＥＲＯＺ	6,800	1,260.00	8,568,000	
ラクスル	41,700	985.00	41,074,500	
メルカリ	84,100	2,396.50	201,545,650	
ＩＰＳ	5,000	2,350.00	11,750,000	
ＦＩＧ	6,500	336.00	2,184,000	
システムサポート	6,700	1,964.00	13,158,800	
イーソル	12,400	968.00	12,003,200	
東海ソフト	900	1,289.00	1,160,100	
ウイングアーク１ｓｔ	17,900	2,638.00	47,220,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,800	962.00	5,579,600	
サーバーワークス	3,500	3,260.00	11,410,000	
東名	600	2,401.00	1,440,600	
ヴィッツ	600	781.00	468,600	
トビラシステムズ	1,600	801.00	1,281,600	
Ｓａｎｓａｎ	56,600	1,783.00	100,917,800	
Ｌｉｎｋ－Ｕグループ	1,100	575.00	632,500	
ギフティ	15,100	1,031.00	15,568,100	
メドレー	23,100	3,745.00	86,509,500	
ベース	6,000	2,831.00	16,986,000	
ＪＭＤＣ	29,400	3,388.00	99,607,200	
フォーカスシステムズ	11,500	1,223.00	14,064,500	
クレスコ	28,300	1,354.00	38,318,200	

フジ・メディア・ホールディングス	165,500	1,865.50	308,740,250	
オービック	57,600	21,390.00	1,232,064,000	
ジャストシステム	24,800	3,110.00	77,128,000	
ＴＤＣソフト	32,300	1,236.00	39,922,800	
ＬＩＮＥヤフー	2,453,200	404.50	992,319,400	
トレンドマイクロ	81,500	6,860.00	559,090,000	
ＩＤホールディングス	11,600	1,433.00	16,622,800	
日本オラクル	33,000	11,635.00	383,955,000	
アルファシステムズ	4,500	3,085.00	13,882,500	
フューチャー	36,800	1,542.00	56,745,600	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,200	1,942.00	17,866,400	
トーセ	1,600	684.00	1,094,400	
オービックビジネスコンサルタント	24,200	7,086.00	171,481,200	
アイティフォー	22,100	1,502.00	33,194,200	
東計電算	4,800	4,315.00	20,712,000	
エックスネット	800	1,449.00	1,159,200	
大塚商会	170,900	3,248.00	555,083,200	
サイボウズ	23,700	1,855.00	43,963,500	
電通総研	20,900	5,020.00	104,918,000	
ＡＣＣＥＳＳ	17,900	1,276.00	22,840,400	
デジタルガレージ	27,500	2,556.00	70,290,000	
ＥＭシステムズ	28,800	587.00	16,905,600	
ウェザーニューズ	5,300	5,430.00	28,779,000	
ＣＩＪ	43,000	481.00	20,683,000	
ビジネスエンジニアリング	3,600	4,045.00	14,562,000	
日本エンタープライズ	5,900	134.00	790,600	
ＷＯＷＯＷ	13,000	1,100.00	14,300,000	
スカラ	16,000	667.00	10,672,000	
インテリジェント　ウェイブ	3,000	1,113.00	3,339,000	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	24,400	2,452.00	59,828,800	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	17,300	546.00	9,445,800	
ネットワンシステムズ	67,100	2,936.50	197,039,150	
システムソフト	60,200	71.00	4,274,200	
アルゴグラフィックス	15,800	4,785.00	75,603,000	
マーベラス	28,000	653.00	18,284,000	
エイベックス	29,300	1,466.00	42,953,800	

ＢＩＰＲＯＧＹ	56,400	4,547.00	256,450,800	
都築電気	9,100	2,426.00	22,076,600	
ＴＢＳホールディングス	86,600	4,404.00	381,386,400	
日本テレビホールディングス	152,500	2,457.00	374,692,500	
朝日放送グループホールディングス	16,200	680.00	11,016,000	
テレビ朝日ホールディングス	41,800	2,162.00	90,371,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	133,800	893.00	119,483,400	
テレビ東京ホールディングス	12,400	3,780.00	46,872,000	
日本ＢＳ放送	2,000	924.00	1,848,000	
ビジョン	25,800	1,304.00	33,643,200	
スマートバリュー	1,600	382.00	611,200	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	19,300	4,315.00	83,279,500	
ワイヤレスゲート	2,500	250.00	625,000	
日本通信	169,700	199.00	33,770,300	
クロップス	700	1,055.00	738,500	
日本電信電話	51,249,600	158.30	8,112,811,680	
ＫＤＤＩ	1,267,300	4,503.00	5,706,651,900	
ソフトバンク	2,751,800	2,088.50	5,747,134,300	
光通信	17,100	29,895.00	511,204,500	
エムティーアイ	11,800	921.00	10,867,800	
ＧＭＯインターネットグループ	63,100	2,528.00	159,516,800	
ファイバーゲート	9,300	1,220.00	11,346,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,600	231.00	369,600	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	91,100	2,807.50	255,763,250	
学研ホールディングス	31,600	1,035.00	32,706,000	
ゼンリン	29,500	930.00	27,435,000	
昭文社ホールディングス	2,400	366.00	878,400	
インプレスホールディングス	5,700	161.00	917,700	
アイネット	10,400	2,060.00	21,424,000	
松竹	9,000	9,051.00	81,459,000	
東宝	95,800	4,503.00	431,387,400	
東映	28,500	3,800.00	108,300,000	
ＮＴＴデータグループ	450,500	2,361.50	1,063,855,750	
ピー・シー・エー	9,900	2,293.00	22,700,700	
ビジネスブレイン太田昭和	6,800	2,233.00	15,184,400	
ＤＴＳ	35,600	4,190.00	149,164,000	

スクウェア・エニックス・ホールディングス	78,700	4,842.00	381,065,400	
シーイーシー	21,700	2,073.00	44,984,100	
カプコン	308,200	3,218.00	991,787,600	
アイ・エス・ビー	8,800	1,500.00	13,200,000	
ＳＣＳＫ	120,600	3,176.00	383,025,600	
ＮＳＷ	7,700	3,245.00	24,986,500	
アイネス	13,400	1,785.00	23,919,000	
ＴＫＣ	30,700	3,470.00	106,529,000	
富士ソフト	34,600	7,350.00	254,310,000	
ＮＳＤ	60,800	3,070.00	186,656,000	
コナミグループ	64,500	11,940.00	770,130,000	
福井コンピュータホールディングス	10,600	2,584.00	27,390,400	
ＪＢＣＣホールディングス	11,400	3,705.00	42,237,000	
ミロク情報サービス	15,700	1,957.00	30,724,900	
ソフトバンクグループ	849,900	11,825.00	10,050,067,500	
リョーサン菱洋ホールディングス	34,200	3,020.00	103,284,000	
高千穂交易	6,500	4,040.00	26,260,000	
オルバヘルスケアホールディングス	1,000	1,992.00	1,992,000	
伊藤忠食品	4,100	7,020.00	28,782,000	
エレマテック	16,300	2,081.00	33,920,300	
あらた	27,800	3,475.00	96,605,000	
トーメンデバイス	2,600	7,710.00	20,046,000	
東京エレクトロン　デバイス	18,100	4,215.00	76,291,500	
円谷フィールズホールディングス	30,800	1,717.00	52,883,600	
双日	202,400	3,871.00	783,490,400	
アルフレッサ　ホールディングス	182,400	2,238.50	408,302,400	
横浜冷凍	45,700	1,025.00	46,842,500	
ラサ商事	8,300	1,768.00	14,674,400	
アルコニックス	23,900	1,525.00	36,447,500	
神戸物産	140,600	3,600.00	506,160,000	
ハイパー	1,400	313.00	438,200	
あい　ホールディングス	29,100	2,313.00	67,308,300	
ディーブイエックス	1,600	999.00	1,598,400	
ダイワボウホールディングス	80,500	2,917.50	234,858,750	
マクニカホールディングス	43,000	6,595.00	283,585,000	
ラクト・ジャパン	7,100	2,761.00	19,603,100	

グリムス	7,700	2,387.00	18,379,900	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,500	1,284.00	35,310,000	
八洲電機	14,700	1,712.00	25,166,400	
メディアスホールディングス	10,600	902.00	9,561,200	
レスター	15,500	3,170.00	49,135,000	
ジオリーブグループ	1,400	1,210.00	1,694,000	
大光	3,100	607.00	1,881,700	
ＯＣＨＩホールディングス	1,400	1,451.00	2,031,400	
ＴＯＫＡＩホールディングス	98,700	975.00	96,232,500	
黒谷	1,600	714.00	1,142,400	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,200	906.00	1,087,200	
三洋貿易	18,600	1,566.00	29,127,600	
ビューティガレージ	5,700	1,543.00	8,795,100	
ウイン・パートナーズ	11,800	1,210.00	14,278,000	
ミタチ産業	1,700	1,163.00	1,977,100	
シップヘルスケアホールディングス	65,300	2,265.00	147,904,500	
明治電機工業	6,800	1,831.00	12,450,800	
デリカフーズホールディングス	2,600	570.00	1,482,000	
スターティアホールディングス	1,600	2,141.00	3,425,600	
コメダホールディングス	44,600	2,669.00	119,037,400	
ピーバンドットコム	800	381.00	304,800	
アセンテック	7,000	619.00	4,333,000	
富士興産	1,700	1,731.00	2,942,700	
協栄産業	600	2,759.00	1,655,400	
フルサト・マルカホールディングス	16,200	2,257.00	36,563,400	
ヤマエグループホールディングス	16,000	2,436.00	38,976,000	
小野建	18,200	1,633.00	29,720,600	
南陽	2,400	1,083.00	2,599,200	
佐鳥電機	11,400	2,080.00	23,712,000	
エコートレーディング	1,200	1,232.00	1,478,400	
伯東	10,400	5,140.00	53,456,000	
コンドーテック	14,000	1,360.00	19,040,000	
中山福	3,200	373.00	1,193,600	
ナガイレーベン	23,000	2,524.00	58,052,000	
三菱食品	16,800	5,520.00	92,736,000	
松田産業	13,800	2,871.00	39,619,800	

第一興商	70,300	1,666.00	117,119,800	
メディパルホールディングス	184,800	2,579.00	476,599,200	
ＳＰＫ	8,100	2,259.00	18,297,900	
萩原電気ホールディングス	7,800	3,985.00	31,083,000	
アズワン	56,400	3,107.00	175,234,800	
スズデン	6,400	1,972.00	12,620,800	
尾家産業	1,400	2,026.00	2,836,400	
シモジマ	12,200	1,349.00	16,457,800	
ドウシシャ	16,800	2,215.00	37,212,000	
小津産業	1,300	1,623.00	2,109,900	
高速	10,800	2,328.00	25,142,400	
たけびし	6,900	2,349.00	16,208,100	
リックス	4,100	3,125.00	12,812,500	
丸文	16,200	1,231.00	19,942,200	
ハピネット	15,500	3,330.00	51,615,000	
橋本総業ホールディングス	7,200	1,310.00	9,432,000	
日本ライフライン	48,700	1,160.00	56,492,000	
タカショー	15,900	573.00	9,110,700	
ＩＤＯＭ	48,100	1,427.00	68,638,700	
進和	11,100	2,800.00	31,080,000	
エスケイジャパン	1,500	822.00	1,233,000	
ダイトロン	7,200	2,941.00	21,175,200	
シークス	25,900	1,274.00	32,996,600	
田中商事	1,700	790.00	1,343,000	
オーハシテクニカ	9,500	1,781.00	16,919,500	
白銅	5,100	2,791.00	14,234,100	
ダイコー通産	600	1,211.00	726,600	
伊藤忠商事	1,221,800	8,138.00	9,943,008,400	
丸紅	1,507,600	3,033.00	4,572,550,800	
高島	4,000	1,004.00	4,016,000	
長瀬産業	82,200	3,261.00	268,054,200	
蝶理	11,400	3,540.00	40,356,000	
豊田通商	477,700	3,217.00	1,536,760,900	
三共生興	25,200	730.00	18,396,000	
兼松	76,000	2,675.00	203,300,000	
ツカモトコーポレーション	800	1,222.00	977,600	

三井物産	2,722,800	3,732.00	10,161,489,600	
日本紙パルプ商事	8,700	6,160.00	53,592,000	
カメイ	19,300	2,241.00	43,251,300	
東都水産	500	6,830.00	3,415,000	
ＯＵＧホールディングス	900	2,678.00	2,410,200	
スターゼン	12,500	3,135.00	39,187,500	
山善	55,100	1,438.00	79,233,800	
椿本興業	11,300	2,107.00	23,809,100	
住友商事	1,100,000	4,048.00	4,452,800,000	
内田洋行	7,400	7,980.00	59,052,000	
三菱商事	3,490,000	3,337.00	11,646,130,000	
第一実業	17,100	2,384.00	40,766,400	
キヤノンマーケティングジャパン	42,100	4,579.00	192,775,900	
西華産業	7,100	4,205.00	29,855,500	
佐藤商事	12,600	1,657.00	20,878,200	
東京産業	16,600	722.00	11,985,200	
ユアサ商事	14,200	5,500.00	78,100,000	
神鋼商事	4,600	8,340.00	38,364,000	
トルク	4,300	224.00	963,200	
阪和興業	32,600	5,880.00	191,688,000	
正栄食品工業	12,100	4,775.00	57,777,500	
カナデン	13,700	1,636.00	22,413,200	
ＲＹＯＤＥＮ	14,700	2,843.00	41,792,100	
岩谷産業	41,400	10,290.00	426,006,000	
ナイス	1,800	1,895.00	3,411,000	
ニチモウ	1,900	2,173.00	4,128,700	
極東貿易	10,900	1,775.00	19,347,500	
アステナホールディングス	34,200	535.00	18,297,000	
三愛オブリ	42,400	2,113.00	89,591,200	
稲畑産業	35,900	3,525.00	126,547,500	
ＧＳＩクレオス	9,700	2,259.00	21,912,300	
明和産業	21,500	725.00	15,587,500	
クワザワホールディングス	2,100	757.00	1,589,700	
ワキタ	30,100	1,699.00	51,139,900	
東邦ホールディングス	49,100	4,490.00	220,459,000	
サンゲツ	41,800	2,924.00	122,223,200	

ミツウロコグループホールディングス	23,200	1,691.00	39,231,200	
シナネンホールディングス	5,000	4,530.00	22,650,000	
伊藤忠エネクス	45,100	1,500.00	67,650,000	
サンリオ	147,600	3,232.00	477,043,200	
サンワテクノス	9,300	2,263.00	21,045,900	
新光商事	24,400	939.00	22,911,600	
トーホー	7,100	3,740.00	26,554,000	
三信電気	7,300	2,173.00	15,862,900	
東陽テクニカ	16,800	1,636.00	27,484,800	
モスフードサービス	26,700	3,535.00	94,384,500	
加賀電子	16,600	5,650.00	93,790,000	
ソーダニッカ	17,300	1,166.00	20,171,800	
立花エレテック	12,100	3,130.00	37,873,000	
フォーバル	7,100	1,573.00	11,168,300	
ＰＡＬＴＡＣ	24,500	4,234.00	103,733,000	
三谷産業	31,800	350.00	11,130,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	13,800	1,415.00	19,527,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	500	2,661.00	1,330,500	
コーア商事ホールディングス	13,500	720.00	9,720,000	
ＫＰＰグループホールディングス	47,100	746.00	35,136,600	
ヤマタネ	8,000	3,095.00	24,760,000	
丸紅建材リース	500	3,110.00	1,555,000	
泉州電業	11,300	5,100.00	57,630,000	
トラスコ中山	38,200	2,341.00	89,426,200	
オートバックスセブン	63,300	1,573.50	99,602,550	
モリト	13,000	1,460.00	18,980,000	
加藤産業	22,500	4,275.00	96,187,500	
北恵	1,500	865.00	1,297,500	
イエローハット	28,900	2,242.00	64,793,800	
ＪＫホールディングス	14,000	1,059.00	14,826,000	
日伝	11,900	3,480.00	41,412,000	
北沢産業	3,600	347.00	1,249,200	
杉本商事	8,800	2,476.00	21,788,800	
因幡電機産業	47,100	3,980.00	187,458,000	
東テク	18,200	2,389.00	43,479,800	
ミスミグループ本社	274,600	2,738.00	751,854,800	

アルテック	3,200	264.00	844,800	
タキヒヨー	1,400	1,190.00	1,666,000	
蔵王産業	1,100	2,528.00	2,780,800	
スズケン	64,900	5,235.00	339,751,500	
ジェコス	10,900	999.00	10,889,100	
サンエー	13,900	4,905.00	68,179,500	
カワチ薬品	14,300	2,870.00	41,041,000	
エービーシー・マート	79,700	2,715.50	216,425,350	
ハードオフコーポレーション	7,400	2,221.00	16,435,400	
アスクル	44,000	2,056.00	90,464,000	
ゲオホールディングス	20,600	1,645.00	33,887,000	
アダストリア	22,000	3,105.00	68,310,000	
くら寿司	21,400	3,945.00	84,423,000	
キャンドゥ	6,600	3,525.00	23,265,000	
ＩＫホールディングス	2,900	403.00	1,168,700	
パルグループホールディングス	35,900	1,610.00	57,799,000	
エディオン	72,200	1,661.00	119,924,200	
サーラコーポレーション	38,600	807.00	31,150,200	
ワッツ	3,000	691.00	2,073,000	
ハローズ	8,300	4,375.00	36,312,500	
あみやき亭	4,500	5,820.00	26,190,000	
大黒天物産	5,600	8,170.00	45,752,000	
ハニーズホールディングス	16,400	1,582.00	25,944,800	
ファーマライズホールディングス	1,900	621.00	1,179,900	
アルペン	15,200	2,050.00	31,160,000	
ハブ	2,400	842.00	2,020,800	
クオールホールディングス	25,200	1,510.00	38,052,000	
ジンズホールディングス	14,000	4,250.00	59,500,000	
ビックカメラ	109,000	1,524.00	166,116,000	
ＤＣＭホールディングス	94,400	1,390.00	131,216,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	257,900	1,844.00	475,567,600	
東京一番フーズ	2,400	515.00	1,236,000	
きちりホールディングス	1,700	870.00	1,479,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	208,800	1,994.00	416,347,200	
ドトール・日レスホールディングス	32,400	2,170.00	70,308,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	330,800	2,380.00	787,304,000	

ブロンコビリー	10,800	3,790.00	40,932,000	
ＺＯＺＯ	115,900	4,391.00	508,916,900	
トレジャー・ファクトリー	11,500	1,818.00	20,907,000	
物語コーポレーション	30,500	3,600.00	109,800,000	
三越伊勢丹ホールディングス	301,000	3,594.00	1,081,794,000	
Ｈａｍｅｅ	7,600	1,138.00	8,648,800	
マーケットエンタープライズ	1,000	914.00	914,000	
ウエルシアホールディングス	94,500	1,842.00	174,069,000	
クリエイトＳＤホールディングス	25,900	3,295.00	85,340,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	8,000	341.00	2,728,000	
ミサワ	1,800	630.00	1,134,000	
ティーライフ	1,100	1,417.00	1,558,700	
チムニー	1,800	1,325.00	2,385,000	
シュッピン	16,700	1,511.00	25,233,700	
オイシックス・ラ・大地	24,700	1,258.00	31,072,600	
ネクステージ	41,700	2,114.00	88,153,800	
ジョイフル本田	52,300	2,134.00	111,608,200	
エターナルホスピタリティグループ	6,800	3,905.00	26,554,000	
ホットランド	14,100	2,419.00	34,107,900	
すかいらーくホールディングス	248,600	2,097.00	521,314,200	
ＳＦＰホールディングス	8,800	2,148.00	18,902,400	
綿半ホールディングス	14,300	1,719.00	24,581,700	
ヨシックスホールディングス	4,300	3,025.00	13,007,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	51,200	854.00	43,724,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,900	540.00	4,806,000	
ＢＥＥＮＯＳ	11,000	2,329.00	25,619,000	
あさひ	17,100	1,499.00	25,632,900	
日本調剤	12,200	1,485.00	18,117,000	
コスモス薬品	15,400	12,635.00	194,579,000	
トーエル	3,100	792.00	2,455,200	
セブン&アイ・ホールディングス	1,860,800	1,934.50	3,599,717,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	123,000	1,093.00	134,439,000	
ツルハホールディングス	38,200	9,028.00	344,869,600	
サンマルクホールディングス	14,800	2,154.00	31,879,200	
フェリシモ	1,700	941.00	1,599,700	

トリドールホールディングス	51,100	3,770.00	192,647,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	20,600	284.00	5,850,400	
ウイルプラスホールディングス	1,500	1,128.00	1,692,000	
ＪＭホールディングス	13,800	2,861.00	39,481,800	
サツドラホールディングス	2,800	795.00	2,226,000	
アレンザホールディングス	13,900	1,123.00	15,609,700	
串カツ田中ホールディングス	5,100	1,698.00	8,659,800	
バロックジャパンリミテッド	14,600	798.00	11,650,800	
クスリのアオキホールディングス	54,800	2,860.50	156,755,400	
力の源ホールディングス	10,500	1,462.00	15,351,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	97,100	2,636.00	255,955,600	
メディカルシステムネットワーク	20,300	569.00	11,550,700	
はるやまホールディングス	3,400	595.00	2,023,000	
ノジマ	52,900	1,567.00	82,894,300	
カッパ・クリエイト	28,600	1,756.00	50,221,600	
ライトオン	4,500	379.00	1,705,500	
良品計画	216,600	2,690.00	582,654,000	
パリミキホールディングス	8,300	413.00	3,427,900	
アドヴァングループ	15,900	958.00	15,232,200	
アルビス	6,100	2,680.00	16,348,000	
コナカ	7,000	268.00	1,876,000	
ハウス　オブ　ローゼ	1,000	1,582.00	1,582,000	
Ｇ－７ホールディングス	20,000	1,594.00	31,880,000	
イオン北海道	53,800	888.00	47,774,400	
コジマ	35,400	965.00	34,161,000	
ヒマラヤ	2,500	912.00	2,280,000	
コーナン商事	22,400	4,020.00	90,048,000	
エコス	6,900	2,303.00	15,890,700	
ワタミ	19,200	950.00	18,240,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	367,200	4,010.00	1,472,472,000	
西松屋チェーン	35,900	2,168.00	77,831,200	
ゼンショーホールディングス	92,600	6,298.00	583,194,800	
幸楽苑ホールディングス	13,400	1,346.00	18,036,400	
ハークスレイ	2,200	790.00	1,738,000	
サイゼリヤ	26,900	5,750.00	154,675,000	

ＶＴホールディングス	71,600	504.00	36,086,400	
魚力	6,500	2,477.00	16,100,500	
フジ・コーポレーション	8,800	2,270.00	19,976,000	
ユナイテッドアローズ	21,500	2,133.00	45,859,500	
ハイデイ日高	27,100	2,749.00	74,497,900	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	5,700	128.00	729,600	
コロワイド	78,200	2,031.00	158,824,200	
壱番屋	72,100	1,097.00	79,093,700	
ＰＬＡＮＴ	1,500	1,459.00	2,188,500	
スギホールディングス	110,000	2,262.50	248,875,000	
薬王堂ホールディングス	9,000	2,743.00	24,687,000	
スクロール	27,400	1,050.00	28,770,000	
ヨンドシーホールディングス	17,400	1,912.00	33,268,800	
木曽路	27,600	2,592.00	71,539,200	
ＳＲＳホールディングス	30,200	1,311.00	39,592,200	
千趣会	33,400	303.00	10,120,200	
リテールパートナーズ	27,200	1,720.00	46,784,000	
上新電機	18,100	2,622.00	47,458,200	
日本瓦斯	96,500	2,346.00	226,389,000	
ロイヤルホールディングス	32,000	2,482.00	79,424,000	
いなげや	17,700	1,209.00	21,399,300	
チヨダ	17,800	992.00	17,657,600	
ライフコーポレーション	19,100	3,645.00	69,619,500	
リンガーハット	23,400	2,207.00	51,643,800	
ＭｒＭａｘＨＤ	23,400	671.00	15,701,400	
ＡＯＫＩホールディングス	39,200	1,344.00	52,684,800	
オークワ	26,300	899.00	23,643,700	
コメリ	28,100	3,510.00	98,631,000	
青山商事	39,100	1,502.00	58,728,200	
しまむら	42,700	7,095.00	302,956,500	
はせがわ	3,800	347.00	1,318,600	
高島屋	115,800	3,054.00	353,653,200	
松屋	30,900	1,167.00	36,060,300	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	80,500	2,700.00	217,350,000	
近鉄百貨店	8,000	2,247.00	17,976,000	

丸井グループ	120,700	2,350.00	283,645,000	
アクシアル　リテイリング	49,900	1,007.00	50,249,300	
イオン	616,200	3,345.00	2,061,189,000	
イズミ	32,300	3,278.00	105,879,400	
平和堂	30,400	2,376.00	72,230,400	
フジ	27,900	1,926.00	53,735,400	
ヤオコー	21,500	9,220.00	198,230,000	
ゼビオホールディングス	24,900	1,148.00	28,585,200	
ケーズホールディングス	122,300	1,573.00	192,377,900	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	3,300	546.00	1,801,800	
日産東京販売ホールディングス	9,400	504.00	4,737,600	
シルバーライフ	5,300	965.00	5,114,500	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	16,100	2,742.00	44,146,200	
ナルミヤ・インターナショナル	1,200	1,320.00	1,584,000	
ブックオフグループホールディングス	12,100	1,443.00	17,460,300	
ギフトホールディングス	7,800	2,535.00	19,773,000	
アインホールディングス	25,100	5,351.00	134,310,100	
元気寿司	10,400	3,470.00	36,088,000	
ヤマダホールディングス	559,900	436.80	244,564,320	
アークランズ	54,300	1,825.00	99,097,500	
ニトリホールディングス	66,200	16,460.00	1,089,652,000	
グルメ杵屋	15,000	1,092.00	16,380,000	
愛眼	4,400	180.00	792,000	
ケーユーホールディングス	8,800	1,273.00	11,202,400	
吉野家ホールディングス	67,100	3,124.00	209,620,400	
松屋フーズホールディングス	8,600	6,230.00	53,578,000	
サガミホールディングス	27,500	1,661.00	45,677,500	
関西フードマーケット	12,500	2,775.00	34,687,500	
王将フードサービス	13,500	8,660.00	116,910,000	
ミニストップ	13,300	1,710.00	22,743,000	
アークス	33,500	2,647.00	88,674,500	
バローホールディングス	34,800	2,408.00	83,798,400	
ベルク	9,100	7,340.00	66,794,000	
大庄	10,100	1,252.00	12,645,200	
ファーストリテイリング	102,200	44,200.00	4,517,240,000	
サンドラッグ	61,400	3,952.00	242,652,800	

サックスバー　ホールディングス	15,800	814.00	12,861,200	
ヤマザワ	1,500	1,275.00	1,912,500	
やまや	1,300	3,090.00	4,017,000	
ベルーナ	44,200	794.00	35,094,800	
いよぎんホールディングス	201,300	1,538.50	309,700,050	
しずおかフィナンシャルグループ	372,700	1,498.50	558,490,950	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	142,400	1,669.00	237,665,600	
楽天銀行	78,500	3,075.00	241,387,500	
京都フィナンシャルグループ	213,000	2,888.00	615,144,000	
島根銀行	1,600	549.00	878,400	
じもとホールディングス	4,900	327.00	1,602,300	
めぶきフィナンシャルグループ	784,000	611.70	479,572,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,700	4,585.00	99,494,500	
九州フィナンシャルグループ	327,400	939.00	307,428,600	
ゆうちょ銀行	1,859,200	1,533.00	2,850,153,600	
富山第一銀行	53,700	1,309.00	70,293,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	900,100	943.40	849,154,340	
西日本フィナンシャルホールディングス	94,700	1,980.00	187,506,000	
三十三フィナンシャルグループ	15,100	2,055.00	31,030,500	
第四北越フィナンシャルグループ	26,600	5,080.00	135,128,000	
ひろぎんホールディングス	240,800	1,207.50	290,766,000	
おきなわフィナンシャルグループ	14,400	2,496.00	35,942,400	
十六フィナンシャルグループ	21,900	4,645.00	101,725,500	
北國フィナンシャルホールディングス	17,600	5,200.00	91,520,000	
プロクレアホールディングス	19,300	1,864.00	35,975,200	
あいちフィナンシャルグループ	34,700	2,595.00	90,046,500	
あおぞら銀行	121,600	2,533.50	308,073,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	10,303,600	1,793.00	18,474,354,800	
りそなホールディングス	1,956,700	1,068.50	2,090,733,950	
三井住友トラスト・ホールディングス	602,400	3,791.00	2,283,698,400	
三井住友フィナンシャルグループ	1,184,800	11,095.00	13,145,356,000	
千葉銀行	471,500	1,384.50	652,791,750	
群馬銀行	328,300	1,017.00	333,881,100	
武蔵野銀行	23,600	3,210.00	75,756,000	
千葉興業銀行	36,000	1,032.00	37,152,000	
筑波銀行	74,200	301.00	22,334,200	

七十七銀行	49,200	4,435.00	218,202,000	
秋田銀行	11,300	2,472.00	27,933,600	
山形銀行	18,800	1,153.00	21,676,400	
岩手銀行	10,700	2,708.00	28,975,600	
東邦銀行	133,800	318.00	42,548,400	
東北銀行	2,700	1,212.00	3,272,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	147,300	4,273.00	629,412,900	
スルガ銀行	126,600	1,065.00	134,829,000	
八十二銀行	363,100	1,050.00	381,255,000	
山梨中央銀行	19,000	1,956.00	37,164,000	
大垣共立銀行	32,200	2,198.00	70,775,600	
福井銀行	15,100	2,082.00	31,438,200	
清水銀行	6,700	1,591.00	10,659,700	
富山銀行	900	1,746.00	1,571,400	
滋賀銀行	28,100	4,125.00	115,912,500	
南都銀行	25,500	3,505.00	89,377,500	
百五銀行	159,200	664.00	105,708,800	
紀陽銀行	60,500	1,915.00	115,857,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	104,700	1,992.50	208,614,750	
山陰合同銀行	105,900	1,426.00	151,013,400	
鳥取銀行	1,900	1,358.00	2,580,200	
百十四銀行	16,600	3,205.00	53,203,000	
四国銀行	24,800	1,149.00	28,495,200	
阿波銀行	23,700	2,699.00	63,966,300	
大分銀行	10,200	3,370.00	34,374,000	
宮崎銀行	10,200	3,270.00	33,354,000	
佐賀銀行	9,900	2,591.00	25,650,900	
琉球銀行	36,000	1,221.00	43,956,000	
セブン銀行	530,300	271.90	144,188,570	
みずほフィナンシャルグループ	2,283,700	3,468.00	7,919,871,600	
高知銀行	1,900	875.00	1,662,500	
山口フィナンシャルグループ	165,900	1,799.50	298,537,050	
名古屋銀行	10,800	7,690.00	83,052,000	
北洋銀行	256,400	526.00	134,866,400	
大光銀行	1,800	1,545.00	2,781,000	
愛媛銀行	22,800	1,228.00	27,998,400	

トマト銀行	2,000	1,292.00	2,584,000	
京葉銀行	69,700	829.00	57,781,300	
栃木銀行	84,500	351.00	29,659,500	
北日本銀行	5,500	2,686.00	14,773,000	
東和銀行	31,100	686.00	21,334,600	
福島銀行	5,800	269.00	1,560,200	
大東銀行	2,400	760.00	1,824,000	
トモニホールディングス	160,100	409.00	65,480,900	
フィデアホールディングス	17,500	1,612.00	28,210,000	
池田泉州ホールディングス	234,700	386.00	90,594,200	
ＦＰＧ	62,200	2,410.00	149,902,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	27,500	1,706.00	46,915,000	
マーキュリアホールディングス	2,900	925.00	2,682,500	
ＳＢＩホールディングス	271,700	4,187.00	1,137,607,900	
ジャフコ　グループ	50,500	1,955.00	98,727,500	
大和証券グループ本社	1,310,700	1,289.50	1,690,147,650	
野村ホールディングス	2,845,300	971.30	2,763,639,890	
岡三証券グループ	148,600	784.00	116,502,400	
丸三証券	56,400	1,117.00	62,998,800	
東洋証券	45,100	412.00	18,581,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	201,000	576.00	115,776,000	
光世証券	1,400	572.00	800,800	
水戸証券	49,400	571.00	28,207,400	
いちよし証券	31,800	847.00	26,934,600	
松井証券	83,400	842.00	70,222,800	
マネックスグループ	165,800	701.00	116,225,800	
極東証券	23,200	1,489.00	34,544,800	
岩井コスモホールディングス	19,300	2,255.00	43,521,500	
アイザワ証券グループ	24,500	2,870.00	70,315,000	
マネーパートナーズグループ	6,000	244.00	1,464,000	
スパークス・グループ	18,900	1,711.00	32,337,900	
かんぽ生命保険	172,300	3,228.00	556,184,400	
ＦＰパートナー	4,500	3,045.00	13,702,500	
ＳＯＭＰＯホールディングス	763,600	3,488.00	2,663,436,800	
アニコム　ホールディングス	57,500	677.00	38,927,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールデ	1,136,400	3,930.00	4,466,052,000	

ィングス				
第一生命ホールディングス	795,500	4,768.00	3,792,944,000	
東京海上ホールディングス	1,651,900	6,596.00	10,895,932,400	
Ｔ＆Ｄホールディングス	454,300	3,048.00	1,384,706,400	
アドバンスクリエイト	13,000	1,074.00	13,962,000	
ＮＥＸＹＺ．Ｇｒｏｕｐ	2,600	687.00	1,786,200	
全国保証	44,300	5,929.00	262,654,700	
あんしん保証	4,600	219.00	1,007,400	
イントラスト	2,700	813.00	2,195,100	
日本モーゲージサービス	4,100	420.00	1,722,000	
Ｃａｓａ	2,700	937.00	2,529,900	
ＳＢＩアルヒ	16,800	902.00	15,153,600	
プレミアグループ	28,900	2,116.00	61,152,400	
ネットプロテクションズホールディングス	59,200	203.00	12,017,600	
クレディセゾン	107,400	3,374.00	362,367,600	
芙蓉総合リース	15,600	12,090.00	188,604,000	
みずほリース	142,200	1,127.00	160,259,400	
東京センチュリー	126,800	1,491.00	189,058,800	
日本証券金融	62,500	1,618.00	101,125,000	
アイフル	250,600	375.00	93,975,000	
リコーリース	16,200	5,260.00	85,212,000	
イオンフィナンシャルサービス	97,600	1,288.00	125,708,800	
アコム	303,300	426.30	129,296,790	
ジャックス	18,200	4,605.00	83,811,000	
オリエントコーポレーション	55,800	1,014.00	56,581,200	
オリックス	1,014,800	3,669.00	3,723,301,200	
三菱ＨＣキャピタル	754,400	1,077.50	812,866,000	
九州リースサービス	2,600	1,084.00	2,818,400	
日本取引所グループ	436,300	3,915.00	1,708,114,500	
イー・ギャランティ	28,000	1,398.00	39,144,000	
アサックス	3,100	813.00	2,520,300	
ＮＥＣキャピタルソリューション	8,400	4,175.00	35,070,000	
ｒｏｂｏｔ　ｈｏｍｅ	50,600	177.00	8,956,200	
大東建託	62,000	16,710.00	1,036,020,000	
サムティホールディングス	27,200	2,552.00	69,414,400	
いちご	173,500	406.00	70,441,000	

日本駐車場開発	204,800	212.00	43,417,600	
スター・マイカ・ホールディングス	20,800	677.00	14,081,600	
ＳＲＥホールディングス	7,400	4,810.00	35,594,000	
ＡＤワークスグループ	14,000	227.00	3,178,000	
ヒューリック	395,100	1,441.00	569,339,100	
野村不動産ホールディングス	94,400	4,079.00	385,057,600	
三重交通グループホールディングス	37,300	557.00	20,776,100	
ディア・ライフ	29,600	980.00	29,008,000	
地主	13,200	2,766.00	36,511,200	
プレサンスコーポレーション	23,500	1,921.00	45,143,500	
ハウスコム	1,500	1,035.00	1,552,500	
ＪＰＭＣ	10,400	1,213.00	12,615,200	
サンセイランディック	2,100	991.00	2,081,100	
フージャースホールディングス	26,100	1,134.00	29,597,400	
オープンハウスグループ	62,100	5,173.00	321,243,300	
東急不動産ホールディングス	509,300	1,075.50	547,752,150	
飯田グループホールディングス	162,400	2,053.50	333,488,400	
イーグランド	1,200	1,559.00	1,870,800	
ムゲンエステート	4,100	1,320.00	5,412,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	10,200	1,073.00	10,944,600	
シーアールイー	8,700	1,648.00	14,337,600	
ケイアイスター不動産	8,400	3,420.00	28,728,000	
グッドコムアセット	16,500	809.00	13,348,500	
ジェイ・エス・ビー	8,600	2,957.00	25,430,200	
ロードスターキャピタル	11,300	2,770.00	31,301,000	
テンポイノベーション	2,300	882.00	2,028,600	
フェイスネットワーク	1,900	1,836.00	3,488,400	
霞ヶ関キャピタル	7,000	14,450.00	101,150,000	
パーク２４	110,300	1,605.00	177,031,500	
パラカ	5,900	2,044.00	12,059,600	
三井不動産	2,347,700	1,491.00	3,500,420,700	
三菱地所	1,062,000	2,588.00	2,748,456,000	
平和不動産	27,600	3,905.00	107,778,000	
東京建物	148,100	2,651.50	392,687,150	
京阪神ビルディング	32,000	1,747.00	55,904,000	
住友不動産	244,800	4,855.00	1,188,504,000	

テーオーシー	31,100	723.00	22,485,300	
レオパレス２１	169,300	514.00	87,020,200	
スターツコーポレーション	24,500	3,275.00	80,237,500	
フジ住宅	22,200	792.00	17,582,400	
空港施設	25,000	598.00	14,950,000	
明和地所	11,600	953.00	11,054,800	
ゴールドクレスト	14,100	2,655.00	37,435,500	
エスリード	8,100	4,775.00	38,677,500	
日神グループホールディングス	28,400	593.00	16,841,200	
日本エスコン	31,700	1,082.00	34,299,400	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	88,000	530.00	46,640,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	3,700	853.00	3,156,100	
イオンモール	88,100	1,880.50	165,672,050	
毎日コムネット	2,700	746.00	2,014,200	
ファースト住建	2,700	1,063.00	2,870,100	
カチタス	45,900	1,774.00	81,426,600	
トーセイ	28,400	2,536.00	72,022,400	
穴吹興産	1,600	2,061.00	3,297,600	
サンフロンティア不動産	25,400	2,018.00	51,257,200	
ＦＪネクストホールディングス	18,300	1,294.00	23,680,200	
インテリックス	1,300	575.00	747,500	
ランドビジネス	2,000	238.00	476,000	
サンネクスタグループ	2,300	984.00	2,263,200	
グランディハウス	15,400	604.00	9,301,600	
日本空港ビルデング	60,000	5,562.00	333,720,000	
明豊ファシリティワークス	3,200	867.00	2,774,400	
ＬＩＦＵＬＬ	44,500	157.00	6,986,500	
ＭＩＸＩ	38,000	3,020.00	114,760,000	
ジェイエイシーリクルートメント	64,100	695.00	44,549,500	
日本M&Aセンターホールディングス	281,600	870.00	244,992,000	
メンバーズ	6,300	907.00	5,714,100	
中広	1,400	532.00	744,800	
ＵＴグループ	23,100	3,240.00	74,844,000	
アイティメディア	6,900	1,928.00	13,303,200	
ケアネット	36,500	545.00	19,892,500	
Ｅ・Ｊホールディングス	10,400	1,799.00	18,709,600	

オープンアップグループ	53,200	2,159.00	114,858,800	
コシダカホールディングス	53,100	850.00	45,135,000	
アルトナー	2,500	2,015.00	5,037,500	
パソナグループ	21,500	1,979.00	42,548,500	
ＣＤＳ	1,600	1,779.00	2,846,400	
リンクアンドモチベーション	50,800	498.00	25,298,400	
エス・エム・エス	62,000	1,915.50	118,761,000	
サニーサイドアップグループ	2,400	630.00	1,512,000	
パーソルホールディングス	1,798,700	252.30	453,812,010	
リニカル	4,300	421.00	1,810,300	
クックパッド	49,500	210.00	10,395,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,100	785.00	2,433,500	
学情	9,100	1,924.00	17,508,400	
スタジオアリス	8,900	2,104.00	18,725,600	
エプコ	1,900	785.00	1,491,500	
ＮＪＳ	3,900	4,290.00	16,731,000	
綜合警備保障	295,200	945.40	279,082,080	
カカクコム	114,700	2,133.50	244,712,450	
アイロムグループ	7,200	2,768.00	19,929,600	
セントケア・ホールディング	13,100	861.00	11,279,100	
サイネックス	1,300	766.00	995,800	
ルネサンス	14,000	1,019.00	14,266,000	
ディップ	27,100	2,981.00	80,785,100	
デジタルホールディングス	9,400	1,050.00	9,870,000	
新日本科学	16,200	1,314.00	21,286,800	
キャリアデザインセンター	1,200	1,797.00	2,156,400	
エムスリー	349,100	1,519.50	530,457,450	
ツカダ・グローバルホールディング	3,700	485.00	1,794,500	
ウェルネット	5,500	674.00	3,707,000	
ワールドホールディングス	8,100	2,181.00	17,666,100	
ディー・エヌ・エー	62,900	1,585.50	99,727,950	
博報堂ＤＹホールディングス	225,400	1,177.50	265,408,500	
ぐるなび	33,600	317.00	10,651,200	
タカミヤ	24,400	472.00	11,516,800	
ファンコミュニケーションズ	25,200	414.00	10,432,800	
ライク	6,700	1,529.00	10,244,300	

Ａｏｂａ－ＢＢＴ	2,800	353.00	988,400	
エスプール	51,400	318.00	16,345,200	
ＷＤＢホールディングス	9,100	1,849.00	16,825,900	
ティア	4,400	461.00	2,028,400	
ＣＤＧ	800	1,270.00	1,016,000	
アドウェイズ	24,800	406.00	10,068,800	
バリューコマース	15,700	1,223.00	19,201,100	
インフォマート	184,000	325.00	59,800,000	
ＪＰホールディングス	45,500	553.00	25,161,500	
エコナックホールディングス	6,900	130.00	897,000	
ＣＬホールディングス	4,300	1,649.00	7,090,700	
プレステージ・インターナショナル	83,000	708.00	58,764,000	
アミューズ	10,900	1,608.00	17,527,200	
ドリームインキュベータ	6,100	2,331.00	14,219,100	
クイック	12,400	2,181.00	27,044,400	
ＴＡＣ	4,100	182.00	746,200	
電通グループ	173,600	4,034.00	700,302,400	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,800	999.00	7,792,200	
イオンファンタジー	6,400	2,154.00	13,785,600	
シーティーエス	22,300	811.00	18,085,300	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	51,800	2,391.00	123,853,800	
アルプス技研	16,800	2,581.00	43,360,800	
日本空調サービス	19,200	1,043.00	20,025,600	
オリエンタルランド	934,600	4,524.00	4,228,130,400	
ダスキン	38,600	3,732.00	144,055,200	
明光ネットワークジャパン	21,700	760.00	16,492,000	
ファルコホールディングス	7,900	2,353.00	18,588,700	
ラウンドワン	166,700	832.00	138,694,400	
リゾートトラスト	76,800	2,374.50	182,361,600	
ビー・エム・エル	21,800	2,945.00	64,201,000	
リソー教育	91,200	246.00	22,435,200	
早稲田アカデミー	9,900	1,635.00	16,186,500	
ユー・エス・エス	396,400	1,351.50	535,734,600	
東京個別指導学院	21,400	398.00	8,517,200	
サイバーエージェント	390,500	959.20	374,567,600	
楽天グループ	1,518,500	913.10	1,386,542,350	

クリーク・アンド・リバー社	9,000	1,568.00	14,112,000	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	34,900	659.00	22,999,100	
テー・オー・ダブリュー	35,200	354.00	12,460,800	
山田コンサルティンググループ	7,800	2,191.00	17,089,800	
セントラルスポーツ	6,700	2,488.00	16,669,600	
フルキャストホールディングス	17,000	1,496.00	25,432,000	
エン・ジャパン	28,800	2,587.00	74,505,600	
リソルホールディングス	600	4,615.00	2,769,000	
テクノプロ・ホールディングス	103,500	2,669.00	276,241,500	
アトラグループ	1,700	165.00	280,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,300	1,170.00	10,881,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	11,000	3,770.00	41,470,000	
ファーストロジック	2,300	538.00	1,237,400	
三機サービス	1,200	1,088.00	1,305,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	14,300	802.00	11,468,600	
デザインワン・ジャパン	3,400	167.00	567,800	
イー・ガーディアン	8,500	2,037.00	17,314,500	
リブセンス	3,700	222.00	821,400	
ジャパンマテリアル	54,100	2,277.00	123,185,700	
ベクトル	21,300	1,174.00	25,006,200	
ウチヤマホールディングス	3,200	342.00	1,094,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	14,800	1,516.00	22,436,800	
キャリアリンク	6,600	2,513.00	16,585,800	
ＩＢＪ	13,800	591.00	8,155,800	
アサンテ	8,800	1,729.00	15,215,200	
バリューＨＲ	15,600	1,461.00	22,791,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	14,400	2,228.00	32,083,200	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,200	1,033.00	7,437,600	
ＥＲＩホールディングス	1,700	2,113.00	3,592,100	
アビスト	1,000	3,315.00	3,315,000	
シグマクシス・ホールディングス	23,300	1,563.00	36,417,900	
ウィルグループ	15,000	1,011.00	15,165,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	8,600	144.00	1,238,400	
メドピア	14,500	588.00	8,526,000	
レアジョブ	1,500	411.00	616,500	
リクルートホールディングス	1,271,900	9,484.00	12,062,699,600	

エラン	23,600	931.00	21,971,600	
土木管理総合試験所	3,400	321.00	1,091,400	
日本郵政	1,846,100	1,666.50	3,076,525,650	
ベルシステム２４ホールディングス	19,100	1,550.00	29,605,000	
鎌倉新書	15,600	425.00	6,630,000	
ＳＭＮ	1,800	315.00	567,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,400	682.00	954,800	
エアトリ	13,100	1,294.00	16,951,400	
アトラエ	13,500	853.00	11,515,500	
ストライク	8,700	4,540.00	39,498,000	
ソラスト	49,100	465.00	22,831,500	
セラク	5,600	1,281.00	7,173,600	
インソース	38,600	836.00	32,269,600	
ベイカレント・コンサルティング	129,900	3,604.00	468,159,600	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	4,000	1,208.00	4,832,000	
アイモバイル	22,800	511.00	11,650,800	
キャリアインデックス	3,400	196.00	666,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	7,400	1,085.00	8,029,000	
船場	1,400	1,235.00	1,729,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	57,300	2,671.00	153,048,300	
フルテック	1,000	1,116.00	1,116,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	3,300	254.00	838,200	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,200	638.00	765,600	
エル・ティー・エス	2,200	2,092.00	4,602,400	
ミダックホールディングス	10,800	1,461.00	15,778,800	
キュービーネットホールディングス	10,300	1,291.00	13,297,300	
オープングループ	24,800	265.00	6,572,000	
スプリックス	2,000	802.00	1,604,000	
マネジメントソリューションズ	7,700	1,334.00	10,271,800	
プロレド・パートナーズ	4,700	573.00	2,693,100	
テノ．ホールディングス	1,300	414.00	538,200	
フロンティア・マネジメント	4,600	1,199.00	5,515,400	
コプロ・ホールディングス	2,000	1,735.00	3,470,000	
ギークス	1,300	458.00	595,400	
アンビスホールディングス	37,900	2,117.00	80,234,300	

カーブスホールディングス	48,500	780.00	37,830,000	
フォーラムエンジニアリング	24,300	1,000.00	24,300,000	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	6,200	1,371.00	8,500,200	
ダイレクトマーケティングミックス	19,100	248.00	4,736,800	
ポピンズ	2,800	1,235.00	3,458,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	13,900	1,652.00	22,962,800	
コンフィデンス・インターワークス	600	1,783.00	1,069,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	3,500	523.00	1,830,500	
リログループ	88,600	1,725.50	152,879,300	
東祥	12,600	719.00	9,059,400	
ＩＤ＆Ｅホールディングス	10,700	3,980.00	42,586,000	
ビーウィズ	3,700	1,880.00	6,956,000	
ＴＲＥホールディングス	34,000	1,296.00	44,064,000	
人・夢・技術グループ	7,400	1,803.00	13,342,200	
ＮＩＳＳＯホールディングス	15,600	825.00	12,870,000	
大栄環境	32,200	2,710.00	87,262,000	
日本管財ホールディングス	18,600	2,668.00	49,624,800	
M&A総研ホールディングス	18,900	3,765.00	71,158,500	
エイチ・アイ・エス	51,400	1,543.00	79,310,200	
ラックランド	8,000	2,110.00	16,880,000	
共立メンテナンス	55,500	2,919.50	162,032,250	
イチネンホールディングス	18,800	1,672.00	31,433,600	
建設技術研究所	9,100	4,965.00	45,181,500	
スペース	11,700	1,183.00	13,841,100	
燦ホールディングス	16,500	1,127.00	18,595,500	
スバル興業	6,200	2,990.00	18,538,000	
東京テアトル	2,100	1,111.00	2,333,100	
タナベコンサルティンググループ	7,000	1,466.00	10,262,000	
ナガワ	5,500	7,590.00	41,745,000	
東京都競馬	14,800	4,135.00	61,198,000	
カナモト	27,400	2,840.00	77,816,000	
ニシオホールディングス	15,400	3,925.00	60,445,000	
トランス・コスモス	21,700	3,450.00	74,865,000	
乃村工藝社	77,300	870.00	67,251,000	
藤田観光	7,100	9,270.00	65,817,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	10,500	1,364.00	14,322,000	

トーカイ	15,700	2,196.00	34,477,200	
セコム	179,900	9,369.00	1,685,483,100	
セントラル警備保障	9,600	2,952.00	28,339,200	
丹青社	34,400	982.00	33,780,800	
メイテックグループホールディングス	60,200	3,367.00	202,693,400	
応用地質	16,600	2,721.00	45,168,600	
船井総研ホールディングス	35,400	2,265.00	80,181,000	
進学会ホールディングス	2,500	243.00	607,500	
オオバ	4,100	1,045.00	4,284,500	
いであ	1,700	2,367.00	4,023,900	
学究社	7,100	2,105.00	14,945,500	
イオンディライト	19,000	3,765.00	71,535,000	
ナック	15,300	585.00	8,950,500	
ダイセキ	36,100	3,720.00	134,292,000	
ステップ	6,500	1,945.00	12,642,500	
合　計	280,696,700		702,510,886,870	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	119,074,480
株式	15,665,906,700
投資証券	68,335,000
派生商品評価勘定	3,774,110
未収入金	102,098,785
未収配当金	14,598,410
未収利息	219
差入委託証拠金	4,484,331
流動資産合計	15,978,272,035
資産合計	15,978,272,035
負債の部	
流動負債	
前受金	3,776,750
未払解約金	151,310,944
流動負債合計	155,087,694
負債合計	155,087,694
純資産の部	
元本等	
元本	9,412,266,386
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,410,917,955
元本等合計	15,823,184,341
純資産合計	15,823,184,341
負債純資産合計	15,978,272,035

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	9,412,266,386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 1.6811円 (1万口当たり純資産額) (16,811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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。

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

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	9,069,684,311円
期中追加設定元本額	2,013,678,078円
期中一部解約元本額	1,671,096,003円
期末元本額	9,412,266,386円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	170,318,012円
コア投資戦略ファンド（成長型）	402,453,080円
コア投資戦略ファンド（切替型）	174,495,740円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	7,014,531,631円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	91,891,240円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	148,948,821円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	38,162,596円
ＤＣ日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスファンド	1,251,260,706円
私募日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	52,106,832円

ＦＯＦｓ用　日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	68,097,728円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,407,700,144
投資証券	△1,916,931
合計	1,405,783,213

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2024年 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	83,688,250	－	87,465,000	3,776,750
合計		83,688,250	－	87,465,000	3,776,750

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ＩＮＰＥＸ	35,000	2,415.00	84,525,000	
大林組	24,100	1,982.00	47,766,200	
清水建設	19,300	925.60	17,864,080	
戸田建設	8,400	1,053.00	8,845,200	
大和ハウス工業	20,800	4,085.00	84,968,000	
積水ハウス	22,100	3,586.00	79,250,600	
高砂熱学工業	1,600	5,750.00	9,200,000	
明治ホールディングス	8,700	3,594.00	31,267,800	
サッポロホールディングス	2,300	6,242.00	14,356,600	

アサヒグループホールディングス	17,900	5,692.00	101,886,800	
キリンホールディングス	28,800	2,126.50	61,243,200	
サントリー食品インターナショナル	5,200	5,640.00	29,328,000	
伊藤園	2,000	3,488.00	6,976,000	
キッコーマン	25,200	1,923.50	48,472,200	
味の素	17,400	6,030.00	104,922,000	
カゴメ	2,800	3,384.00	9,475,200	
ニチレイ	4,000	3,446.00	13,784,000	
日清食品ホールディングス	7,400	4,232.00	31,316,800	
東洋紡	3,100	1,036.00	3,211,600	
帝人	6,600	1,316.00	8,685,600	
東レ	51,400	763.90	39,264,460	
クラレ	11,200	1,878.00	21,033,600	
旭化成	46,500	1,051.00	48,871,500	
住友化学	55,300	362.90	20,068,370	
東ソー	9,600	2,063.50	19,809,600	
デンカ	3,000	2,136.00	6,408,000	
エア・ウォーター	6,800	2,160.00	14,688,000	
カネカ	1,600	4,207.00	6,731,200	
三井化学	6,300	4,361.00	27,474,300	
東京応化工業	3,600	4,593.00	16,534,800	
三菱ケミカルグループ	50,300	922.50	46,401,750	
ダイセル	8,500	1,529.50	13,000,750	
積水化学工業	14,100	2,215.00	31,231,500	
ＵＢＥ	3,500	2,766.50	9,682,750	
日本化薬	5,100	1,259.00	6,420,900	
花王	17,300	6,748.00	116,740,400	
日本ペイントホールディングス	35,200	1,018.50	35,851,200	
関西ペイント	6,200	2,541.00	15,754,200	
中国塗料	1,300	2,119.00	2,754,700	
ＤＩＣ	2,800	3,017.00	8,447,600	
富士フイルムホールディングス	41,500	3,982.00	165,253,000	
資生堂	14,800	4,550.00	67,340,000	
ライオン	9,500	1,288.00	12,236,000	
日東電工	5,300	13,180.00	69,854,000	
信越ポリマー	1,400	1,571.00	2,199,400	

ニフコ	3,000	3,940.00	11,820,000	
ユニ・チャーム	15,000	5,273.00	79,095,000	
協和キリン	10,000	3,102.00	31,020,000	
アステラス製薬	67,100	1,630.00	109,373,000	
塩野義製薬	9,300	6,462.00	60,096,600	
エーザイ	9,400	6,634.00	62,359,600	
小野薬品工業	13,900	2,171.00	30,176,900	
第一三共	68,600	5,877.00	403,162,200	
ＥＮＥＯＳホールディングス	106,900	828.40	88,555,960	
ブリヂストン	21,200	6,242.00	132,330,400	
住友理工	1,400	1,506.00	2,108,400	
太平洋セメント	4,100	4,066.00	16,670,600	
東海カーボン	7,500	930.00	6,975,000	
ＴＯＴＯ	5,300	3,914.00	20,744,200	
日本特殊陶業	5,700	4,894.00	27,895,800	
日本製鉄	31,700	3,439.00	109,016,300	
神戸製鋼所	14,000	1,971.00	27,594,000	
ＪＦＥホールディングス	21,300	2,319.00	49,394,700	
日本軽金属ホールディングス	2,100	1,772.00	3,721,200	
三井金属鉱業	2,000	5,369.00	10,738,000	
三菱マテリアル	4,600	3,013.00	13,859,800	
住友金属鉱山	9,200	5,226.00	48,079,200	
ＤＯＷＡホールディングス	2,000	5,678.00	11,356,000	
東邦チタニウム	1,200	1,450.00	1,740,000	
ＵＡＣＪ	1,300	3,815.00	4,959,500	
ＬＩＸＩＬ	10,700	1,759.50	18,826,650	
三浦工業	3,300	3,594.00	11,860,200	
ナブテスコ	4,000	2,794.00	11,176,000	
小松製作所	34,300	4,785.00	164,125,500	
日立建機	4,000	4,398.00	17,592,000	
クボタ	37,100	2,185.00	81,063,500	
荏原製作所	17,100	2,468.50	42,211,350	
ダイキン工業	9,800	23,025.00	225,645,000	
栗田工業	3,900	7,057.00	27,522,300	
ダイフク	11,300	2,990.00	33,787,000	
グローリー	1,500	2,699.00	4,048,500	

セガサミーホールディングス	5,800	2,510.50	14,560,900	
ＮＴＮ	15,800	320.90	5,070,220	
日立造船	6,000	1,069.00	6,414,000	
三菱重工業	118,900	1,875.00	222,937,500	
ＩＨＩ	5,200	5,457.00	28,376,400	
イビデン	4,200	6,805.00	28,581,000	
コニカミノルタ	16,800	463.20	7,781,760	
ブラザー工業	8,600	3,053.00	26,255,800	
日立製作所	172,000	3,818.00	656,696,000	
富士電機	4,700	9,431.00	44,325,700	
安川電機	8,900	5,713.00	50,845,700	
オムロン	6,500	5,782.00	37,583,000	
日本電気	9,100	13,760.00	125,216,000	
富士通	65,300	2,658.00	173,567,400	
ルネサスエレクトロニクス	55,500	3,293.00	182,761,500	
セイコーエプソン	10,700	2,671.50	28,585,050	
アルバック	1,600	10,790.00	17,264,000	
パナソニック　ホールディングス	86,500	1,315.50	113,790,750	
シャープ	9,700	937.80	9,096,660	
アンリツ	5,000	1,230.50	6,152,500	
ソニーグループ	46,300	14,845.00	687,323,500	
ＴＤＫ	14,400	11,005.00	158,472,000	
アルプスアルパイン	6,900	1,561.50	10,774,350	
マクセル	1,600	1,853.00	2,964,800	
横河電機	8,500	4,108.00	34,918,000	
アズビル	4,200	4,501.00	18,904,200	
アドバンテスト	28,400	6,924.00	196,641,600	
シスメックス	18,700	2,531.50	47,339,050	
スタンレー電気	4,800	2,878.00	13,814,400	
ウシオ電機	2,800	2,145.00	6,006,000	
ファナック	35,300	4,535.00	160,085,500	
ローム	12,200	2,293.00	27,974,600	
太陽誘電	4,600	4,764.00	21,914,400	
村田製作所	63,900	3,597.00	229,848,300	
リコー	20,300	1,417.50	28,775,250	
東京エレクトロン	17,500	37,820.00	661,850,000	

川崎重工業	5,600	5,942.00	33,275,200	
トヨタ自動車	393,400	3,291.00	1,294,679,400	
ヤマハ発動機	33,100	1,574.50	52,115,950	
島津製作所	8,800	4,255.00	37,444,000	
ニコン	11,100	1,700.50	18,875,550	
ＨＯＹＡ	13,000	20,640.00	268,320,000	
ノーリツ鋼機	700	4,410.00	3,087,000	
前田工繊	1,300	1,604.00	2,085,200	
大日本印刷	7,700	5,450.00	41,965,000	
ＮＩＳＳＨＡ	1,400	2,032.00	2,844,800	
アシックス	23,900	2,588.50	61,865,150	
ヤマハ	4,900	3,685.00	18,056,500	
ピジョン	4,300	1,467.00	6,308,100	
リンテック	1,400	3,530.00	4,942,000	
任天堂	38,500	9,000.00	346,500,000	
コクヨ	2,900	2,619.00	7,595,100	
美津濃	600	7,450.00	4,470,000	
東北電力	16,800	1,363.00	22,898,400	
九州電力	15,000	1,540.50	23,107,500	
電源開発	5,400	2,464.00	13,305,600	
レノバ	1,500	963.00	1,444,500	
東京瓦斯	13,400	3,411.00	45,707,400	
大阪瓦斯	13,700	3,410.00	46,717,000	
東邦瓦斯	2,700	3,840.00	10,368,000	
西部ガスホールディングス	900	1,953.00	1,757,700	
相鉄ホールディングス	2,900	2,372.00	6,878,800	
東急	18,500	1,734.00	32,079,000	
京王電鉄	3,800	3,690.00	14,022,000	
西日本旅客鉄道	16,300	2,912.50	47,473,750	
西武ホールディングス	8,400	2,240.00	18,816,000	
西日本鉄道	2,200	2,462.50	5,417,500	
阪急阪神ホールディングス	8,500	4,298.00	36,533,000	
南海電気鉄道	3,800	2,639.50	10,030,100	
京阪ホールディングス	3,600	2,819.00	10,148,400	
名古屋鉄道	6,900	1,752.50	12,092,250	
ヤマトホールディングス	9,400	1,787.50	16,802,500	

山九	1,700	5,347.00	9,089,900	
センコーグループホールディングス	4,100	1,092.00	4,477,200	
九州旅客鉄道	5,000	3,554.00	17,770,000	
ＳＧホールディングス	11,900	1,377.50	16,392,250	
日本郵船	17,000	4,801.00	81,617,000	
ＡＮＡホールディングス	5,900	3,021.00	17,823,900	
トランコム	200	6,080.00	1,216,000	
ＴＩＳ	7,900	3,100.00	24,490,000	
ＳＨＩＦＴ	500	15,255.00	7,627,500	
ティーガイア	600	3,250.00	1,950,000	
マネーフォワード	1,600	5,350.00	8,560,000	
野村総合研究所	14,000	4,664.00	65,296,000	
メルカリ	4,200	2,396.50	10,065,300	
Ｓａｎｓａｎ	2,600	1,783.00	4,635,800	
フリー	1,600	2,569.00	4,110,400	
ＬＩＮＥヤフー	99,100	404.50	40,085,950	
ネットワンシステムズ	2,800	2,936.50	8,222,200	
ＢＩＰＲＯＧＹ	2,600	4,547.00	11,822,200	
ＫＤＤＩ	55,500	4,503.00	249,916,500	
ソフトバンク	105,900	2,088.50	221,172,150	
ＳＣＳＫ	5,800	3,176.00	18,420,800	
あらた	1,000	3,475.00	3,475,000	
双日	8,300	3,871.00	32,129,300	
ＴＯＫＡＩホールディングス	3,600	975.00	3,510,000	
アズワン	2,100	3,107.00	6,524,700	
伊藤忠商事	44,100	8,138.00	358,885,800	
丸紅	52,900	3,033.00	160,445,700	
キヤノンマーケティングジャパン	1,700	4,579.00	7,784,300	
伊藤忠エネクス	2,000	1,500.00	3,000,000	
ＰＡＬＴＡＣ	1,100	4,234.00	4,657,400	
アスクル	1,400	2,056.00	2,878,400	
ゲオホールディングス	900	1,645.00	1,480,500	
アダストリア	1,100	3,105.00	3,415,500	
エディオン	2,500	1,661.00	4,152,500	
ジンズホールディングス	400	4,250.00	1,700,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	9,000	1,994.00	17,946,000	

マツキヨココカラ&カンパニー	12,700	2,380.00	30,226,000	
ＺＯＺＯ	5,000	4,391.00	21,955,000	
三越伊勢丹ホールディングス	12,500	3,594.00	44,925,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	2,000	854.00	1,708,000	
イオン北海道	1,600	888.00	1,420,800	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	14,100	4,010.00	56,541,000	
スギホールディングス	3,900	2,262.50	8,823,750	
日本瓦斯	3,800	2,346.00	8,914,800	
丸井グループ	5,800	2,350.00	13,630,000	
イオン	24,300	3,345.00	81,283,500	
ヤオコー	700	9,220.00	6,454,000	
ケーズホールディングス	5,300	1,573.00	8,336,900	
ヤマダホールディングス	19,700	436.80	8,604,960	
ファーストリテイリング	6,500	44,200.00	287,300,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	24,300	3,791.00	92,121,300	
三井住友フィナンシャルグループ	46,400	11,095.00	514,808,000	
みずほフィナンシャルグループ	89,500	3,468.00	310,386,000	
大和証券グループ本社	49,500	1,289.50	63,830,250	
野村ホールディングス	111,500	971.30	108,299,950	
ＳＯＭＰＯホールディングス	33,100	3,488.00	115,452,800	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	47,700	3,930.00	187,461,000	
東京海上ホールディングス	69,700	6,596.00	459,741,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	18,200	3,048.00	55,473,600	
東京センチュリー	5,500	1,491.00	8,200,500	
オリックス	42,800	3,669.00	157,033,200	
ヒューリック	14,200	1,441.00	20,462,200	
東急不動産ホールディングス	21,400	1,075.50	23,015,700	
三井不動産	99,000	1,491.00	147,609,000	
三菱地所	41,800	2,588.00	108,178,400	
平和不動産	1,100	3,905.00	4,295,500	
東京建物	7,000	2,651.50	18,560,500	
住友不動産	10,600	4,855.00	51,463,000	
ジェイエイシーリクルートメント	2,500	695.00	1,737,500	
パーソルホールディングス	69,200	252.30	17,459,160	

H．U．グループホールディングス	2,000	2,391.00	4,782,000	
オリエンタルランド	40,500	4,524.00	183,222,000	
ダスキン	1,500	3,732.00	5,598,000	
リゾートトラスト	3,000	2,374.50	7,123,500	
ビー・エム・エル	800	2,945.00	2,356,000	
ユー・エス・エス	15,300	1,351.50	20,677,950	
楽天グループ	55,700	913.10	50,859,670	
テクノプロ・ホールディングス	4,000	2,669.00	10,676,000	
リクルートホールディングス	55,100	9,484.00	522,568,400	
インソース	1,700	836.00	1,421,200	
カーブスホールディングス	1,900	780.00	1,482,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	900	1,652.00	1,486,800	
乃村工藝社	2,900	870.00	2,523,000	
セコム	7,800	9,369.00	73,078,200	
合　計	4,461,700		15,665,906,700	

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	森ヒルズリート投資法人	57	7,484,100	
	積水ハウス・リート投資法人	154	12,243,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	48	24,336,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	109	15,543,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	33	8,728,500	
合計		401	68,335,000	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	676,187,517
株式	49,101,552,300
未収配当金	10,316,600
未収利息	1,246
流動資産合計	49,788,057,663
資産合計	49,788,057,663
負債の部	
流動負債	
未払解約金	359,453,663
流動負債合計	359,453,663
負債合計	359,453,663
純資産の部	
元本等	
元本	7,386,247,441
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	42,042,356,559
元本等合計	49,428,604,000
純資産合計	49,428,604,000
負債純資産合計	49,788,057,663

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.収益及び費用の計上基準	受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	7,386,247,441口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 6.6920円 (1万口当たり純資産額) (66,920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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項につ	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

いての補足説明	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	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	5,358,165,446円
期中追加設定元本額	2,583,847,010円
期中一部解約元本額	555,765,015円
期末元本額	7,386,247,441円
期末元本額の内訳	
ＤＣ日本株式エクセレント・フォーカス	5,205,243,512円
コア投資戦略ファンド（安定型）	39,419,591円
コア投資戦略ファンド（成長型）	96,061,665円
コア投資戦略ファンド（切替型）	42,831,668円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	1,779,008,068円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	22,831,938円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	36,968,791円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	9,524,459円
日本株式エクセレント・フォーカスファンド	138,460,452円
ＦＯＦｓ用　日本株式エクセレント・フォーカスＳ（適格機関投資家専用）	15,692,470円
日本株式エクセレント・フォーカスＶＡ（適格機関投資家専用）	204,827円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	9,453,457,567
合計	9,453,457,567

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
大和ハウス工業	80,000	4,085.00	326,800,000	

信越化学工業	258,800	6,716.00	1,738,100,800	
ユニ・チャーム	119,700	5,273.00	631,178,100	
エーザイ	67,900	6,634.00	450,448,600	
第一三共	276,800	5,877.00	1,626,753,600	
ＭＡＲＵＷＡ	65,100	40,700.00	2,649,570,000	
日本製鉄	98,700	3,439.00	339,429,300	
ＪＦＥホールディングス	53,700	2,319.00	124,530,300	
住友金属鉱山	107,400	5,226.00	561,272,400	
住友電気工業	296,700	2,501.00	742,046,700	
ディスコ	27,700	66,270.00	1,835,679,000	
ＳＭＣ	12,100	81,800.00	989,780,000	
荏原製作所	329,100	2,468.50	812,383,350	
ダイキン工業	25,600	23,025.00	589,440,000	
ダイフク	161,100	2,990.00	481,689,000	
三菱重工業	859,300	1,875.00	1,611,187,500	
イビデン	31,000	6,805.00	210,955,000	
日立製作所	462,800	3,818.00	1,766,970,400	
富士電機	97,200	9,431.00	916,693,200	
ソニーグループ	111,900	14,845.00	1,661,155,500	
アドバンテスト	114,500	6,924.00	792,798,000	
キーエンス	20,600	75,830.00	1,562,098,000	
村田製作所	296,000	3,597.00	1,064,712,000	
東京エレクトロン	53,200	37,820.00	2,012,024,000	
デンソー	350,800	2,538.50	890,505,800	
川崎重工業	357,200	5,942.00	2,122,482,400	
トヨタ自動車	263,100	3,291.00	865,862,100	
ＨＯＹＡ	35,300	20,640.00	728,592,000	
東海旅客鉄道	228,100	3,499.00	798,121,900	
西武ホールディングス	400,300	2,240.00	896,672,000	
ＳＨＩＦＴ	38,300	15,255.00	584,266,500	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	33,100	9,013.00	298,330,300	
野村総合研究所	216,000	4,664.00	1,007,424,000	
ＮＴＴデータグループ	307,300	2,361.50	725,688,950	
三菱商事	532,300	3,337.00	1,776,285,100	
Ｊ．フロント　リテイリング	410,500	1,994.00	818,537,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	500,600	2,380.00	1,191,428,000	

三越伊勢丹ホールディングス	620,300	3,594.00	2,229,358,200	
良品計画	97,000	2,690.00	260,930,000	
ニトリホールディングス	16,300	16,460.00	268,298,000	
ファーストリテイリング	8,000	44,200.00	353,600,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,243,900	1,793.00	2,230,312,700	
三井住友フィナンシャルグループ	185,200	11,095.00	2,054,794,000	
第一生命ホールディングス	58,900	4,768.00	280,835,200	
パーク２４	365,800	1,605.00	587,109,000	
三井不動産	191,600	1,491.00	285,675,600	
オリエンタルランド	152,100	4,524.00	688,100,400	
リクルートホールディングス	175,100	9,484.00	1,660,648,400	
合　計	10,814,000		49,101,552,300	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,807,454,500
コール・ローン	5,312,895,662
株式	780,148,185,879
投資信託受益証券	128,991,278
投資証券	14,066,776,228
派生商品評価勘定	342,475,027
未収入金	306,038
未収配当金	485,259,861
未収利息	9,797
差入委託証拠金	7,865,911,801
流動資産合計	820,158,266,071
資産合計	820,158,266,071
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,353,122
前受金	335,655,652
未払解約金	5,810,987,329
流動負債合計	6,155,996,103
負債合計	6,155,996,103
純資産の部	
元本等	
元本	114,681,464,817
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	699,320,805,151
元本等合計	814,002,269,968
純資産合計	814,002,269,968
負債純資産合計	820,158,266,071

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	114,681,464,817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 7.0979円 (1万口当たり純資産額) (70,979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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	115,556,915,905円
期中追加設定元本額	11,857,592,565円
期中一部解約元本額	12,733,043,653円
期末元本額	114,681,464,817円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,408,236,951円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,311,184円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	34,376,927,166円
世界経済インデックスファンド	14,215,386,769円
外国株式インデックス・オープン	878,624,861円
ＤＣマイセレクション２５	525,486,635円
ＤＣマイセレクション５０	2,952,874,184円
ＤＣマイセレクション７５	3,974,878,927円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	13,356,887,403円
ＤＣマイセレクションＳ２５	323,849,607円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,770,240,732円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,926,765,584円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	12,854,224円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	125,337,678円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	103,077,068円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	8,430,679,455円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	850,480,283円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,643,193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）	19,941,314円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,125,682円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	22,607,833円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	5,853,633円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	17,143,564円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	109,840,661円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	100,965,304円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	796,055,660円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	52,037,785円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	11,675,363円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	85,253,670円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	27,578,247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）	688,958,825円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,158,898,606円

コア投資戦略ファンド（安定型）	106,117,974円
コア投資戦略ファンド（成長型）	263,824,942円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,386,650,142円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,674,283,956円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,531,530,500円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	971,260,351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）	425,510,919円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	22,417,863円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	112,063,161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ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	4,690,092,123円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	262,115,822円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,212,683,949円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	197,233,676円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,430,857円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	2,531,256,750円
グローバル経済コア	755,599,348円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	14,609,249円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	7,073,743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・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	162,818,432円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	185,681,595円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	81,585,680円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	100,030,321円
１０資産分散投資ファンド	60,259,310円
グローバル１０資産バランスファンド	17,288,406円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	1,314,012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	20,814円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０４０	22,941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	24,654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	24,654円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５５	22,738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	14,732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	11,713円
ＤＣマイセレクション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）	44,749,339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）	224,223,125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）	556,773,267円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,432,980,777円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	116,749,280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）	77,811,538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）	72,735,740円
ＳＭＴＡＭ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
ＳＭＴＡＭ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
ＳＭＴＡＭ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
ＳＭＴＡＭ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
ＳＭＴＡＭ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
ＳＭＴＡＭ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 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	25,554,254,421
投資信託受益証券	△8,763,087
投資証券	471,094,813
合計	26,016,586,147

(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 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	20,325,274,121	―	20,660,929,773	335,655,652
合計		20,325,274,121	―	20,660,929,773	335,655,652

(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 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,205,164,300	―	1,205,174,220	9,920
	アメリカドル	936,700,000	―	936,710,440	10,440
	イギリスポンド	268,464,300	―	268,463,780	△520
	売建	664,558,300	―	667,101,967	△2,543,667
	アメリカドル	664,558,300	―	667,101,967	△2,543,667
合計		1,869,722,600	―	1,872,276,187	△2,533,747

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	33,009	28.79	950,329.11	
	BAKER HUGHES CO	77,332	33.43	2,585,208.76	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	175.98	3,185,062.02	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	82.54	700,104.28	
	CHEVRON CORP	135,746	152.98	20,766,423.08	
	CHORD ENERGY CORP	4,800	167.99	806,352.00	
	CONOCOPHILLIPS	90,345	111.19	10,045,460.55	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	26.48	1,444,378.08	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	46.06	2,314,791.36	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	202.60	2,687,894.20	
	EOG RESOURCES INC	45,763	125.67	5,751,036.21	
	EQT CORPORATION	34,139	36.54	1,247,439.06	
	EXXON MOBIL	346,986	110.94	38,494,626.84	
	HALLIBURTON CO	70,302	32.83	2,308,014.66	
	HESS CORP	21,602	145.78	3,149,139.56	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	48.98	657,752.42	
	KINDER MORGAN INC	160,038	19.99	3,199,159.62	
	MARATHON OIL CORP	39,344	27.89	1,097,304.16	
	MARATHON PETROLEUM CORP	27,588	162.92	4,494,636.96	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	61.02	3,014,754.12	
	ONEOK INC	43,535	82.42	3,588,154.70	
	OVINTIV INC	20,398	46.47	947,895.06	
	PHILLIPS 66	32,264	132.81	4,284,981.84	
	SCHLUMBERGER	110,287	45.20	4,984,972.40	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	132.41	2,290,428.18	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,599	750.00	1,199,250.00	
	VALERO ENERGY CORP	26,282	146.30	3,845,056.60	
	WILLIAMS COS	97,655	42.39	4,139,595.45	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	254.70	4,451,901.30	
	ALBEMARLE CORP	8,403	90.47	760,219.41	

	AMCOR PLC	110,292	9.56	1,054,391.52	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	213.00	1,413,894.00	
	BALL CORP	25,896	58.86	1,524,238.56	
	CELANESE CORP-SERIES A	8,582	131.40	1,127,674.80	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,872	69.87	899,366.64	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	15.18	652,740.00	
	CORTEVA INC	51,757	50.72	2,625,115.04	
	CRH PLC	52,103	75.89	3,954,096.67	
	CROWN HOLDINGS INC	9,940	71.90	714,686.00	
	DOW INC	56,967	51.58	2,938,357.86	
	DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	78.53	2,679,365.07	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	94.66	836,037.12	
	ECOLAB INC	20,345	242.25	4,928,576.25	
	FREEPORT-MCMORAN INC	110,698	50.80	5,623,458.40	
	INT'L PAPER CO	25,191	42.55	1,071,877.05	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	96.81	1,869,110.67	
	LINDE PLC	37,432	431.20	16,140,678.40	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	93.20	1,840,234.00	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	530.67	2,662,371.39	
	MOSAIC CO/THE	27,732	26.91	746,268.12	
	NEWMONT CORPORATION	86,194	43.89	3,783,054.66	
	NUCOR CORP	18,727	150.25	2,813,731.75	
	PACKAGING CORP OF AMERICA	6,221	176.32	1,096,886.72	
	PPG INDUSTRIES INC	17,495	125.26	2,191,423.70	
	RELIANCE INC	4,126	277.90	1,146,615.40	
	RPM INTERNATIONAL INC	10,456	103.91	1,086,482.96	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,426	298.91	5,507,715.66	
	STEEL DYNAMICS INC	11,618	124.25	1,443,536.50	
	VULCAN MATERIALS CO	10,153	242.25	2,459,564.25	
	WESTLAKE CORP	2,222	140.20	311,524.40	
	3 M COMPANY	43,663	99.69	4,352,764.47	
	AECOM	10,456	82.37	861,260.72	
	AERCAP HOLDINGS NV	14,679	94.02	1,380,119.58	
	ALLEGION PLC	7,721	114.67	885,367.07	
	AMETEK INC	17,753	164.13	2,913,799.89	
	AXON ENTERPRISE INC	5,367	298.51	1,602,103.17	

	BOEING CO	44,809	183.24	8,210,801.16	
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,522	134.30	1,278,804.60	
	CARLISLE COS INC	3,456	407.60	1,408,665.60	
	CARRIER GLOBAL CORP	62,063	62.29	3,865,904.27	
	CATERPILLAR	38,627	326.06	12,594,719.62	
	CNH INDUSTRIAL NV	54,445	9.47	515,594.15	
	CUMMINS INC	10,453	268.68	2,808,512.04	
	DEERE&CO	20,534	348.84	7,163,080.56	
	DOVER CORP	10,657	175.13	1,866,360.41	
	EATON CORP	30,932	318.71	9,858,337.72	
	EMCOR GROUP INC	3,640	363.56	1,323,358.40	
	EMERSON ELECTRIC CO	44,010	109.59	4,823,055.90	
	FASTENAL CO	44,011	62.56	2,753,328.16	
	FERGUSON PLC	16,260	188.00	3,056,880.00	
	FORTIVE CORP	25,894	72.64	1,880,940.16	
	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	64.30	662,933.00	
	GE VERNOVA INC	20,868	172.98	3,609,746.64	
	GENERAL DYNAMICS CORP	18,159	279.51	5,075,622.09	
	GENERAL ELECTRIC CO	85,192	163.13	13,897,370.96	
	GRACO INC	13,378	78.05	1,044,152.90	
	GRAINGER (WW) INC	3,363	908.57	3,055,520.91	
	HEICO CORP	3,640	224.89	818,599.60	
	HEICO CORP-CLASS A	5,700	177.64	1,012,548.00	
	HONEYWELL INTL INC	51,027	210.60	10,746,286.20	
	HOWMET AEROSPACE INC	31,648	80.24	2,539,435.52	
	HUBBELL INC	4,458	371.15	1,654,586.70	
	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,433	241.93	830,545.69	
	IDEX CORP	5,916	195.24	1,155,039.84	
	ILLINOIS TOOL WORKS	22,812	234.06	5,339,376.72	
	INGERSOLL-RAND INC	31,562	91.73	2,895,182.26	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	35.55	451,485.00	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	54,141	67.14	3,635,026.74	
	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	225.96	3,317,544.72	
	LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	535.61	1,352,950.86	
	LOCKHEED MARTIN CORP	16,743	460.30	7,706,802.90	
	MASCO CORP	18,934	65.62	1,242,449.08	

	NORDSON CORP	4,121	225.00	927,225.00	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	10,696	423.73	4,532,216.08	
	OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	96.31	2,958,354.27	
	OWENS CORNING	6,460	165.34	1,068,096.40	
	PACCAR INC	40,380	101.34	4,092,109.20	
	PARKER HANNIFIN CORP	9,881	508.68	5,026,267.08	
	PENTAIR PLC	14,383	75.01	1,078,868.83	
	QUANTA SERVICES INC	11,573	254.79	2,948,684.67	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	261.24	2,211,657.84	
	RTX CORP	102,848	101.11	10,398,961.28	
	SMITH (A.O.) CORP	9,016	80.73	727,861.68	
	SNAP-ON INC	4,000	256.11	1,024,440.00	
	STANLEY BLACK&DECKER	12,598	80.85	1,018,548.30	
	TEXTRON	13,876	85.13	1,181,263.88	
	TORO CO	8,812	87.81	773,781.72	
	TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,000	333.74	6,007,320.00	
	TRANSDIGM GROUP INC	4,240	1,270.46	5,386,750.40	
	UNITED RENTALS INC	5,364	627.41	3,365,427.24	
	VERTIV HOLDINGS CO-A	29,005	92.76	2,690,503.80	
	WABTEC CORP	13,304	157.24	2,091,920.96	
	WATSCO INC	2,656	476.90	1,266,646.40	
	XYLEM INC	19,668	133.59	2,627,448.12	
	AUTOMATIC DATA PROCESS	31,919	234.71	7,491,708.49	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	154.39	1,426,563.60	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,640	199.99	1,927,903.60	
	CINTAS CORP	7,043	711.30	5,009,685.90	
	COPART INC	69,100	54.44	3,761,804.00	
	DAYFORCE INC	10,668	48.32	515,477.76	
	EQUIFAX INC	9,160	240.26	2,200,781.60	
	JACOBS SOLUTIONS INC	8,836	136.44	1,205,583.84	
	LEIDOS HOLDINGS	9,314	145.05	1,350,995.70	
	PAYCHEX INC	24,118	117.02	2,822,288.36	
	PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	140.16	593,577.60	
	PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	134.01	458,716.23	
	REPUBLIC SERVICES INC	16,455	195.32	3,213,990.60	
	ROLLINS INC	25,466	49.74	1,266,678.84	

	SMURFIT WESTROCK PLC	21,356	44.83	957,389.48	
	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	61.42	945,990.84	
	TRANSUNION	15,741	76.33	1,201,510.53	
	VERALTO CORP	17,691	95.70	1,693,028.70	
	VERISK ANALYTICS INC	10,738	275.38	2,957,030.44	
	WASTE CONNECTIONS INC	19,775	178.13	3,522,520.75	
	WASTE MANAGEMENT INC	30,660	210.02	6,439,213.20	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	86.55	724,163.85	
	CSX CORP	152,551	32.48	4,954,856.48	
	DELTA AIR LINES INC	15,193	46.89	712,399.77	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	118.65	1,457,022.00	
	FEDEX CORP	17,725	292.73	5,188,639.25	
	GRAB HOLDINGS LTD - CL A	190,364	3.58	681,503.12	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	155.54	894,043.92	
	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	47.99	653,767.77	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	17,982	213.75	3,843,652.50	
	OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,712	178.41	2,624,767.92	
	SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	27.47	371,751.51	
	U-HAUL HOLDING CO	6,606	57.18	377,731.08	
	UBER TECHNOLOGIES INC	144,319	71.32	10,292,831.08	
	UNION PACIFIC CORP	46,736	221.78	10,365,110.08	
	UNITED PARCEL SERVICE B	55,567	134.28	7,461,536.76	
	APTIV PLC	21,896	69.08	1,512,575.68	
	FORD MOTOR COMPANY	290,990	12.90	3,753,771.00	
	GENERAL MOTORS CO	89,296	46.26	4,130,832.96	
	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	15.71	806,488.56	
	TESLA INC	221,215	262.33	58,031,330.95	
	DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	939.05	1,974,822.15	
	DR HORTON INC	22,973	136.00	3,124,328.00	
	GARMIN LTD	11,170	161.49	1,803,843.30	
	LENNAR CORP-CL A	18,864	142.50	2,688,120.00	
	LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	289.87	2,498,389.53	
	NIKE B	94,445	72.46	6,843,484.70	
	NVR INC	247	7,484.08	1,848,567.76	
	PULTE GROUP INC	16,747	104.70	1,753,410.90	
	AIRBNB INC-CLASS A	34,827	152.45	5,309,376.15	

	BOOKING HOLDINGS INC	2,619	3,977.48	10,417,020.12	
	CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	36.81	646,383.60	
	CARNIVAL CORPORATION	71,810	17.90	1,285,399.00	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	104,450	57.48	6,003,786.00	
	DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	140.29	1,291,650.03	
	DOMINO'S PIZZA INC	2,848	477.83	1,360,859.84	
	DOORDASH INC - A	21,857	108.95	2,381,320.15	
	DRAFTKINGS INC	32,654	36.74	1,199,707.96	
	EXPEDIA GROUP INC	9,628	128.56	1,237,775.68	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	215.25	4,226,433.75	
	HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	148.63	562,861.81	
	LAS VEGAS SANDS CORP	30,565	41.62	1,272,115.30	
	MARRIOTT INTL A	19,516	237.52	4,635,440.32	
	MCDONALD'S CORP	55,965	245.82	13,757,316.30	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,462	43.74	676,307.88	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,429	163.13	3,006,322.77	
	STARBUCKS CORP	88,273	72.75	6,421,860.75	
	WYNN RESORTS LTD	6,702	84.76	568,061.52	
	YUM BRANDS INC	22,162	126.66	2,807,038.92	
	ALPHABET INC-CL A	455,214	188.98	86,026,341.72	
	ALPHABET INC-CL C	394,786	190.44	75,183,045.84	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	293.91	2,113,800.72	
	COMCAST CORP-CL A	309,993	37.51	11,627,837.43	
	ELECTRONIC ARTS INC	19,733	140.58	2,774,065.14	
	FOX CORP - CLASS A	21,544	35.19	758,133.36	
	FOX CORP- CLASS B	10,345	32.76	338,902.20	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	28.51	812,848.61	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	73.68	1,133,124.72	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	95.12	1,104,628.56	
	MATCH GROUP INC	22,730	30.94	703,266.20	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	169,631	530.00	89,904,430.00	
	NETFLIX INC	33,607	685.74	23,045,664.18	
	NEWS CORP-CLASS A	33,479	27.72	928,037.88	
	OMNICOM GROUP	14,048	90.51	1,271,484.48	
	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	11.53	374,817.24	
	PINTEREST INC- CLASS A	45,767	43.34	1,983,541.78	

	ROBLOX CORP -CLASS A	35,113	39.39	1,383,101.07	
	ROKU INC	9,122	63.11	575,689.42	
	SEA LTD-ADR	28,338	73.54	2,083,976.52	
	SNAP INC - A	72,602	16.75	1,216,083.50	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	12,867	149.36	1,921,815.12	
	THE WALT DISNEY CO	142,615	97.05	13,840,785.75	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	101.52	3,409,346.16	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	7.34	1,302,211.42	
	AMAZON.COM	724,185	199.34	144,359,037.90	
	AUTOZONE INC	1,368	2,817.06	3,853,738.08	
	BATH & BODY WORKS INC	13,452	37.18	500,145.36	
	BEST BUY COMPANY INC	15,285	86.42	1,320,929.70	
	BURLINGTON STORES INC	5,108	240.21	1,226,992.68	
	CARMAX INC	10,695	72.26	772,820.70	
	DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	200.96	994,752.00	
	EBAY	41,952	52.65	2,208,772.80	
	ETSY INC	10,294	57.01	586,860.94	
	GENUINE PARTS CO	9,903	131.04	1,297,689.12	
	GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	36.43	255,010.00	
	HOME DEPOT	77,067	337.09	25,978,515.03	
	LKQ CORP	19,286	41.25	795,547.50	
	LOWES COMPANIES	44,328	216.33	9,589,476.24	
	MERCADOLIBRE INC	3,573	1,722.05	6,152,884.65	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	1,015.62	4,648,492.74	
	POOL CORP	2,664	296.17	788,996.88	
	ROSS STORES INC	25,425	146.83	3,733,152.75	
	TJX COMPANIES INC	88,680	112.15	9,945,462.00	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	257.26	2,018,461.96	
	ULTA BEAUTY INC	3,920	396.01	1,552,359.20	
	WILLIAMS-SONOMA INC	8,920	142.22	1,268,602.40	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	19.45	486,250.00	
	COSTCO WHOLESALE CORP	34,237	886.85	30,363,083.45	
	DOLLAR GENERAL CORP	16,287	128.54	2,093,530.98	
	DOLLAR TREE INC	16,318	104.03	1,697,561.54	
	KROGER CO	50,664	51.86	2,627,435.04	
	SYSCO CORP	40,090	69.16	2,772,624.40	

	TARGET (DAYTON HUDSON)	35,264	147.60	5,204,966.40	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	10.79	556,407.93	
	WALMART INC	342,809	69.90	23,962,349.10	
	ALTRIA GROUP INC	132,873	46.70	6,205,169.10	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	63.13	2,564,214.34	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,082	41.50	584,403.00	
	BUNGE GLOBAL SA	11,604	109.95	1,275,859.80	
	CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	45.38	720,135.22	
	CELSIUS HOLDINGS INC	13,069	55.55	725,982.95	
	COCA-COLA CO	316,878	62.69	19,865,081.82	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	72.22	1,111,754.68	
	CONAGRA BRANDS INC	33,324	28.74	957,731.76	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	252.09	3,308,933.34	
	GENERAL MILLS INC	43,531	62.69	2,728,958.39	
	HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	182.75	1,999,650.50	
	HORMEL FOODS CORP	23,338	30.04	701,073.52	
	JM SMUCKER CO	7,850	109.37	858,554.50	
	KELLANOVA	23,448	56.37	1,321,763.76	
	KEURIG DR PEPPER INC	81,153	31.95	2,592,838.35	
	KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	31.93	2,202,020.52	
	LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	76.86	912,789.36	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	70.07	1,267,706.44	
	MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	49.94	732,569.86	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,431	65.24	6,878,318.44	
	MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	49.80	2,905,730.40	
	PEPSICO INC	107,105	161.90	17,340,299.50	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	118,983	101.67	12,097,001.61	
	TYSON FOODS INC	23,306	55.91	1,303,038.46	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	104.61	2,023,785.06	
	CLOROX COMPANY	9,570	131.85	1,261,804.50	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	97.04	6,010,463.52	
	ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	104.21	1,959,148.00	
	KENVUE INC	148,093	18.22	2,698,254.46	
	KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	139.43	3,747,460.11	
	PROCTER & GAMBLE CO	181,466	165.66	30,061,657.56	
	ABBOTT LABORATORIES	133,298	101.64	13,548,408.72	

	ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	247.48	1,300,012.44	
	BAXTER INTERNATIONAL	41,576	34.01	1,413,999.76	
	BECTON DICKINSON & CO	22,142	221.47	4,903,788.74	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,121	76.51	8,578,377.71	
	CARDINAL HEALTH	19,151	96.01	1,838,687.51	
	CENCORA INC	14,462	222.37	3,215,914.94	
	CENTENE CORP	40,934	65.74	2,691,001.16	
	COOPER COS INC/THE	12,923	85.68	1,107,242.64	
	CVS HEALTH CORP	99,034	57.62	5,706,339.08	
	DAVITA INC	4,627	137.92	638,155.84	
	DEXCOM INC	28,772	110.84	3,189,088.48	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44,930	93.48	4,200,056.40	
	ELEVANCE HEALTH INC	18,232	529.24	9,649,103.68	
	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	32,998	76.87	2,536,556.26	
	HCA HEALTHCARE INC	15,457	316.91	4,898,477.87	
	HENRY SCHEIN INC	8,755	64.44	564,172.20	
	HOLOGIC INC	18,875	74.75	1,410,906.25	
	HUMANA INC	9,013	373.36	3,365,093.68	
	IDEXX LABORATORIES INC	6,644	477.89	3,175,101.16	
	INSULET CORP	5,246	195.17	1,023,861.82	
	INTUITIVE SURGICAL INC	27,718	442.30	12,259,671.40	
	LABCORP HOLDINGS INC	6,548	199.35	1,305,343.80	
	MCKESSON CORP	10,179	586.81	5,973,138.99	
	MEDTRONIC PLC	102,632	76.88	7,890,348.16	
	MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	287.30	1,305,778.50	
	QUEST DIAGNOSTICS	8,679	138.36	1,200,826.44	
	RESMED INC	10,920	190.33	2,078,403.60	
	SOLVENTUM CORP	10,915	48.02	524,138.30	
	STERIS PLC	8,172	213.51	1,744,803.72	
	STRYKER CORP	26,379	335.57	8,852,001.03	
	TELEFLEX INC	3,934	218.07	857,887.38	
	THE CIGNA GROUP	21,946	328.37	7,206,408.02	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	71,401	492.11	35,137,146.11	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	180.95	845,398.40	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	182.23	2,276,234.93	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	105.76	1,613,263.04	

	ABBVIE INC	136,294	168.05	22,904,206.70	
	AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	125.42	2,733,027.22	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	254.74	2,456,457.82	
	AMGEN	41,885	315.91	13,231,890.35	
	AVANTOR INC	49,647	20.88	1,036,629.36	
	BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	274.88	509,352.64	
	BIO-TECHNE CORP	12,980	71.29	925,344.20	
	BIOGEN INC	10,740	229.06	2,460,104.40	
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	82.98	1,226,693.34	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	155,274	40.86	6,344,495.64	
	CATALENT INC	13,739	57.30	787,244.70	
	CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	201.85	848,577.40	
	DANAHER CORP	54,787	239.79	13,137,374.73	
	ELI LILLY & CO	62,575	932.50	58,351,187.50	
	EXACT SCIENCES CORP	12,208	44.09	538,250.72	
	GILEAD SCIENCES INC	96,270	67.76	6,523,255.20	
	ILLUMINA INC	11,423	106.68	1,218,605.64	
	INCYTE CORP	15,212	60.70	923,368.40	
	IQVIA HOLDINGS INC	13,836	213.05	2,947,759.80	
	JOHNSON & JOHNSON	187,239	147.05	27,533,494.95	
	MERCK & CO	195,618	126.04	24,655,692.72	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,308.00	2,128,116.00	
	MODERNA INC	25,884	116.07	3,004,355.88	
	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	143.30	966,128.60	
	PFIZER	432,739	27.72	11,995,525.08	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	8,327	1,054.03	8,776,907.81	
	REPLIGEN CORP	4,353	120.82	525,929.46	
	REVVITY INC	8,524	104.01	886,581.24	
	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	25.63	771,027.29	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	15.81	1,456,749.21	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29,526	531.86	15,703,698.36	
	UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	322.65	1,167,347.70	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,876	485.99	9,659,537.24	
	VIATRIS INC	89,720	10.80	968,976.00	
	WATERS CORP	4,749	282.97	1,343,824.53	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	318.63	1,837,539.21	

	ZOETIS INC	35,994	174.24	6,271,594.56	
	BANK OF AMERICA CORP	549,785	41.42	22,772,094.70	
	CITIGROUP	146,698	66.55	9,762,751.90	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	36.30	1,434,648.60	
	FIFTH THIRD BANCORP	54,420	36.21	1,970,548.20	
	FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,720.09	1,317,588.94	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	12.97	1,480,032.64	
	JPMORGAN CHASE & CO	222,518	207.63	46,201,412.34	
	KEY CORP	71,223	14.29	1,017,776.67	
	M & T BANK CORP	13,791	149.80	2,065,891.80	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,533	161.51	5,092,894.83	
	REGIONS FINL CORP	70,810	20.11	1,423,989.10	
	TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	38.91	4,137,767.22	
	US BANCORP	117,317	39.87	4,677,428.79	
	WELLS FARGO & CO	273,850	59.88	16,398,138.00	
	ALLY FINANCIAL INC	21,529	41.03	883,334.87	
	AMERICAN EXPRESS	45,006	237.75	10,700,176.50	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	433.29	3,386,594.64	
	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	29,517	116.68	3,444,043.56	
	ARES MANAGEMENT CORP - A	14,741	134.78	1,986,791.98	
	BANK NEW YORK CO	56,329	60.21	3,391,569.09	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,297	410.52	41,584,444.44	
	BLACKROCK INC	11,583	802.28	9,292,809.24	
	BLACKSTONE INC	55,334	121.28	6,710,907.52	
	BLOCK INC	42,352	64.51	2,732,127.52	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	136.99	4,122,988.03	
	CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	40.30	631,460.70	
	CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	168.57	1,483,921.71	
	CME GROUP INC	27,997	194.62	5,448,776.14	
	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	14,368	219.97	3,160,528.96	
	COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	29.49	567,653.01	
	CORPAY INC	4,988	269.47	1,344,116.36	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	130.00	2,468,310.00	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	40.80	1,141,706.40	
	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	411.74	1,296,157.52	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	45,470	73.72	3,352,048.40	

	FISERV INC	46,319	151.09	6,998,337.71	
	FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	22.06	575,104.20	
	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	67.61	291,804.76	
	GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	95.79	1,987,546.71	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,012	472.83	11,826,423.96	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,122	142.46	6,285,620.12	
	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	162.88	849,093.44	
	KKR & CO INC	47,919	105.58	5,059,288.02	
	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,490	273.22	1,499,977.80	
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	204.40	655,510.80	
	MASTERCARD INC-CLASS A	64,241	444.70	28,567,972.70	
	MOODY'S CORP	12,577	435.95	5,482,943.15	
	MORGAN STANLEY	93,827	102.61	9,627,588.47	
	MSCI INC	5,952	489.07	2,910,944.64	
	NASDAQ INC	29,020	60.81	1,764,706.20	
	NORTHERN TRUST CORP	15,902	83.93	1,334,654.86	
	PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	59.00	4,677,874.00	
	PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	114.47	2,091,939.25	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	118.67	1,837,723.62	
	ROBINHOOD MARKETS INC - A	46,668	22.60	1,054,696.80	
	S&P GLOBAL INC	24,501	460.30	11,277,810.30	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	117,095	74.53	8,727,090.35	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	64.26	613,683.00	
	STATE STREET CORP	22,335	74.42	1,662,170.70	
	SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	48.45	1,414,546.20	
	TOAST INC-CLASS A	31,526	24.93	785,943.18	
	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	104.25	944,609.25	
	VISA INC-CLASS A SHARES	122,188	265.44	32,433,582.72	
	AFLAC	43,196	88.93	3,841,420.28	
	ALLSTATE CORP	20,722	158.72	3,288,995.84	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	121.13	765,420.47	
	AMERICAN INT'L GROUP	50,875	75.75	3,853,781.25	
	AON PLC	15,249	293.16	4,470,396.84	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	98.00	2,914,226.00	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,294	263.93	4,300,475.42	
	ASSURANT INC	4,726	161.61	763,768.86	

	BROWN & BROWN INC	20,155	90.08	1,815,562.40	
	CHUBB LTD	30,987	253.34	7,850,246.58	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	116.93	1,299,092.30	
	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	356.56	772,308.96	
	EVEREST GROUP LTD	3,288	372.80	1,225,766.40	
	FNF GROUP	20,461	48.08	983,764.88	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS	21,873	99.75	2,181,831.75	
	LOEWS CORP	16,402	74.66	1,224,573.32	
	MARKEL GROUP INC	1,007	1,552.84	1,563,709.88	
	MARSH & MCLENNAN COS	38,224	211.80	8,095,843.20	
	METLIFE INC	48,925	69.92	3,420,836.00	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	80.87	1,499,006.32	
	PROGRESSIVE CORP	45,236	209.49	9,476,489.64	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,649	118.63	3,161,370.87	
	TRAVELERS COS INC/THE	17,147	203.14	3,483,241.58	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	257.34	1,991,039.58	
	WR BERKLEY CORP	14,360	78.75	1,130,850.00	
	WEYERHAEUSER CO	52,615	27.57	1,450,595.55	
	ACCENTURE PLC-CL A	48,353	298.06	14,412,095.18	
	ADOBE INC	34,893	566.02	19,750,135.86	
	AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	11,484	92.48	1,062,040.32	
	ANSYS INC	6,794	327.35	2,224,015.90	
	APPLOVIN CORP-CLASS A	12,260	84.71	1,038,544.60	
	ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	188.95	452,346.30	
	ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	177.98	2,035,379.28	
	AUTODESK INC	17,030	243.96	4,154,638.80	
	BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	47.80	708,061.40	
	CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,140	315.26	6,664,596.40	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	169.89	1,199,083.62	
	CLOUDFLARE INC - CLASS A	23,067	82.58	1,904,872.86	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	37,006	66.89	2,475,331.34	
	CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	27.87	342,801.00	
	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,478	385.88	6,744,410.64	
	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	269.79	836,349.00	
	DATADOG INC - CLASS A	20,780	126.63	2,631,371.40	
	DOCUSIGN INC	14,969	51.91	777,040.79	

	DYNATRACE INC	22,028	43.18	951,169.04	
	EPAM SYSTEMS INC	4,768	182.59	870,589.12	
	FAIR ISAAC CORP	2,026	1,568.06	3,176,889.56	
	FORTINET INC	49,270	60.28	2,969,995.60	
	GARTNER INC	5,859	448.09	2,625,359.31	
	GEN DIGITAL INC	43,555	24.13	1,050,982.15	
	GODADDY INC - CLASS A	11,388	144.38	1,644,199.44	
	HUBSPOT INC	3,646	560.21	2,042,525.66	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,082	176.48	12,544,551.36	
	INTUIT INC	21,468	650.42	13,963,216.56	
	MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	242.17	1,136,745.98	
	MICROSOFT CORP	546,006	459.54	250,911,597.24	
	MICROSTRATEGY INC-CL A	1,219	1,301.77	1,586,857.63	
	MONDAY.COM LTD	2,838	237.74	674,706.12	
	MONGODB INC	5,325	250.51	1,333,965.75	
	OKTA INC	11,505	94.64	1,088,833.20	
	ORACLE CORP	126,564	140.68	17,805,023.52	
	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,919	27.39	4,024,111.41	
	PALO ALTO NETWORKS INC	25,444	336.18	8,553,763.92	
	PTC INC	9,741	177.48	1,728,832.68	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	550.47	4,654,774.32	
	SALESFORCE INC	74,662	252.43	18,846,928.66	
	SAMSARA INC-CL A	13,283	35.13	466,631.79	
	SERVICENOW INC	15,986	744.01	11,893,743.86	
	SNOWFLAKE INC-CLASS A	23,538	137.46	3,235,533.48	
	SYNOPSYS INC	11,896	607.94	7,232,054.24	
	TWILIO INC - A	12,842	56.39	724,160.38	
	TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	508.86	1,699,083.54	
	UIPATH INC - CLASS A	28,419	11.93	339,038.67	
	UNITY SOFTWARE INC	16,437	15.52	255,102.24	
	VERISIGN INC	6,723	174.18	1,171,012.14	
	WIX.COM LTD	5,010	156.79	785,517.90	
	WORKDAY INC-CLASS A	16,432	223.09	3,665,814.88	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,869	56.88	1,187,028.72	
	ZSCALER INC	7,204	197.36	1,421,781.44	
	AMPHENOL CORPORATION	91,720	68.62	6,293,826.40	

	APPLE INC	1,134,924	228.68	259,534,420.32	
	ARISTA NETWORKS INC	20,702	365.75	7,571,756.50	
	CDW CORP/DE	9,823	214.80	2,109,980.40	
	CISCO SYSTEMS	312,372	45.80	14,306,637.60	
	CORNING	66,604	44.67	2,975,200.68	
	DELL TECHNOLOGIES -C	20,331	145.74	2,963,039.94	
	F5 INC	4,851	171.58	832,334.58	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	21.25	2,070,430.00	
	HP INC	77,024	35.42	2,728,190.08	
	JABIL INC	9,340	110.01	1,027,493.40	
	JUNIPER NETWORKS INC	25,321	36.92	934,851.32	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	136.06	1,882,798.28	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	390.72	5,141,484.48	
	NETAPP INC	15,191	132.09	2,006,579.19	
	PURE STORAGE INC - CLASS A	23,875	65.88	1,572,885.00	
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,548	104.35	1,518,083.80	
	SUPER MICRO COMPUTER INC	4,216	895.61	3,775,891.76	
	TE CONNECTIVITY LTD	23,161	149.76	3,468,591.36	
	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	381.69	1,267,210.80	
	TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	55.23	978,565.14	
	WESTERN DIGITAL CORP	25,790	78.43	2,022,709.70	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	315.24	1,312,028.88	
	AT&T INC	548,004	18.80	10,302,475.20	
	T-MOBILE US INC	41,896	179.05	7,501,478.80	
	VERIZON COMMUNICATIONS	322,255	41.30	13,309,131.50	
	AES CORP	54,375	17.68	961,350.00	
	ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	51.67	1,073,599.26	
	AMEREN CORPORATION	20,898	71.36	1,491,281.28	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	87.69	3,570,736.80	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	130.72	1,891,256.96	
	ATMOS ENERGY CORP	11,302	114.77	1,297,130.54	
	CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	29.63	1,406,417.58	
	CMS ENERGY CORP	23,697	58.86	1,394,805.42	
	CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	88.85	2,458,923.75	
	CONSTELLATION ENERGY	23,831	215.96	5,146,542.76	
	DOMINION ENERGY INC	62,863	49.48	3,110,461.24	

	DTE ENERGY COMPANY	15,851	108.67	1,722,528.17	
	DUKE ENERGY CORP	60,351	100.94	6,091,829.94	
	EDISON INTL	30,900	71.53	2,210,277.00	
	ENTERGY CORP	16,181	104.95	1,698,195.95	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	37.20	758,842.80	
	EVERGY INC	18,475	53.24	983,609.00	
	EVERSOURCE ENERGY	27,450	57.84	1,587,708.00	
	EXELON CORP	81,573	34.43	2,808,558.39	
	FIRSTENERGY CORP	39,425	38.65	1,523,776.25	
	NEXTERA ENERGY INC	160,662	72.12	11,586,943.44	
	NISOURCE INC	32,351	28.91	935,267.41	
	NRG ENERGY INC	13,109	79.26	1,039,019.34	
	PG&E CORP	164,187	17.34	2,847,002.58	
	PPL CORPORATION	58,459	27.41	1,602,361.19	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	75.58	3,043,304.28	
	SEMPRA	49,744	75.58	3,759,651.52	
	SOUTHERN CO	86,109	78.12	6,726,835.08	
	VISTRA CORP	24,594	91.40	2,247,891.60	
	WEC ENERGY GROUP INC	23,447	78.01	1,829,100.47	
	XCEL ENERGY INC	41,562	52.47	2,180,758.14	
	ADVANCED MICRO DEVICES	124,711	177.10	22,086,318.10	
	ANALOG DEVICES	37,792	232.01	8,768,121.92	
	APPLIED MATERIALS	64,814	251.47	16,298,776.58	
	BROADCOM INC	34,017	1,733.31	58,962,006.27	
	ENPHASE ENERGY INC	9,617	103.59	996,225.03	
	ENTEGRIS INC	12,389	140.23	1,737,309.47	
	FIRST SOLAR INC	7,921	225.23	1,784,046.83	
	INTEL CORP	328,277	34.59	11,355,101.43	
	KLA CORP	10,294	874.90	9,006,220.60	
	LAM RESEARCH CORP	10,237	1,112.55	11,389,174.35	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	59.75	655,935.50	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	67,749	73.84	5,002,586.16	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	92.34	3,759,900.12	
	MICRON TECHNOLOGY	85,302	131.14	11,186,504.28	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,911	846.20	3,309,488.20	
	NVIDIA CORP	1,933,750	131.38	254,056,075.00	

	NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	274.91	5,308,512.10	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	73.48	2,352,168.28	
	QORVO INC	8,678	119.69	1,038,669.82	
	QUALCOMM	85,755	207.12	17,761,575.60	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	106.41	1,196,261.22	
	TERADYNE INC	12,318	153.48	1,890,566.64	
	TEXAS INSTRUMENTS	71,015	200.16	14,214,362.40	
	CBRE GROUP INC-A	22,995	88.77	2,041,266.15	
	COSTAR GROUP INC	33,027	71.59	2,364,402.93	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.22	317,814.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	47.94	566,123.46	
アメリカドル 小計		28,182,969		3,704,347,985.54 (598,437,417,063)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	38,058	23.97	912,250.26	
	CAMECO CORP	31,793	66.83	2,124,726.19	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	165,204	48.33	7,984,309.32	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	26.26	2,922,554.18	
	ENBRIDGE	166,986	48.22	8,052,064.92	
	IMPERIAL OIL	16,202	92.19	1,493,662.38	
	KEYERA CORP	18,607	37.82	703,716.74	
	MEG ENERGY CORP	13,934	28.07	391,127.38	
	PARKLAND CORP	7,149	36.62	261,796.38	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,941	50.71	2,329,668.11	
	SUNCOR ENERGY	98,973	51.09	5,056,530.57	
	TC ENERGY CORP	82,559	51.11	4,219,590.49	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	60.77	1,519,796.93	
	AGNICO EAGLE MINES	40,306	95.73	3,858,493.38	
	BARRICK GOLD CORP	133,727	23.79	3,181,365.33	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,322	70.73	659,345.06	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,267	17.80	1,161,752.60	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,641	167.28	2,616,426.48	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	19.00	985,093.00	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	11.72	1,271,045.72	
	LUNDIN MINING CORP	38,990	15.86	618,381.40	
	NUTRIEN LTD	37,152	66.23	2,460,576.96	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	29.34	657,685.44	

	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	65.84	2,329,814.24	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	102.10	357,860.50	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,991	76.45	2,827,961.95	
	CAE INC	25,999	25.02	650,494.98	
	STANTEC INC	9,001	114.45	1,030,164.45	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	119.62	623,579.06	
	WSP GLOBAL INC	9,951	215.03	2,139,763.53	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	25.17	820,013.43	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	12,609	52.80	665,755.20	
	RB GLOBAL INC	14,445	104.50	1,509,502.50	
	THOMSON REUTERS CORP	11,495	227.81	2,618,675.95	
	AIR CANADA	13,805	17.15	236,755.75	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	157.57	6,655,284.09	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	106.96	7,821,450.00	
	TFI INTERNATIONAL INC	5,837	197.62	1,153,507.94	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	58.32	1,181,213.28	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	83.84	257,388.80	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	52.35	514,077.00	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	92.84	2,142,097.32	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	136.45	615,798.85	
	DOLLARAMA INC	22,000	130.07	2,861,540.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,865	79.74	4,614,155.10	
	EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	35.10	243,243.00	
	LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	164.69	2,126,641.97	
	METRO INC	18,840	78.50	1,478,940.00	
	WESTON (GEORGE) LTD	5,226	205.15	1,072,113.90	
	SAPUTO INC	20,898	30.97	647,211.06	
	BANK MONTREAL	56,278	115.31	6,489,416.18	
	BANK NOVA SCOTIA	97,216	62.31	6,057,528.96	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	71,075	66.18	4,703,743.50	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,646	112.12	3,099,669.52	
	ROYAL BANK OF CANADA	109,143	149.44	16,310,329.92	
	TORONTO-DOMINION BANK	136,393	76.18	10,390,418.74	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	51.65	1,497,901.65	
	BROOKFIELD CORP	104,769	58.66	6,145,749.54	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	37.44	287,726.40	

	ONEX CORP	6,603	94.60	624,643.80	
	TMX GROUP LTD	23,425	38.88	910,764.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,493	1,557.70	2,325,646.10	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	39.68	943,907.84	
	IA FINANCIAL CORP INC	6,977	84.74	591,230.98	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,255	233.01	3,088,547.55	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	135,007	36.74	4,960,157.18	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	39.22	1,709,089.94	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	66.99	2,921,701.86	
	CGI INC - CL A	16,084	138.54	2,228,277.36	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,553	4,050.00	6,289,650.00	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	136.76	955,131.84	
	OPEN TEXT CORP	20,463	42.12	861,901.56	
	SHOPIFY INC - CLASS A	94,130	90.13	8,483,936.90	
	BCE INC	6,203	43.01	266,791.03	
	QUEBECOR INC -CL B	15,200	27.99	425,448.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	49.73	1,386,522.13	
	TELUS CORP	32,908	21.05	692,713.40	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	30.74	749,902.30	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	40.33	455,527.35	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	29.77	307,345.48	
	EMERA INC	25,484	45.40	1,156,973.60	
	FORTIS INC	35,547	53.54	1,903,186.38	
	HYDRO ONE LTD	29,579	39.89	1,179,906.31	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	23.83	425,460.82	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	208.39	560,569.10	
カナダドル 小計		3,197,926		206,024,380.29 (24,411,828,820)	
ユーロ	ENI	151,339	14.11	2,135,695.96	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	19.86	787,885.63	
	NESTE OIL OYJ	32,766	16.97	556,039.02	
	OMV AG	12,549	39.86	500,203.14	
	REPSOL SA	89,536	13.76	1,232,015.36	
	TENARIS SA	40,648	14.14	574,965.96	
	TOTALENERGIES SE	167,596	63.22	10,595,419.12	
	AIR LIQUIDE	44,628	160.80	7,176,182.40	

	AKZO NOBEL	12,357	56.26	695,204.82	
	ARCELORMITTAL	29,208	20.74	605,773.92	
	ARKEMA	4,369	81.60	356,510.40	
	BASF SE	70,406	44.20	3,112,297.23	
	COVESTRO AG	14,454	55.32	799,595.28	
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	108.80	1,491,321.60	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	19.22	308,311.32	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	97.62	1,050,879.30	
	OCI NV	7,248	23.20	168,153.60	
	STORA ENSO OYJ R	42,169	12.47	526,058.27	
	SYENSQO SA	5,356	83.08	444,976.48	
	SYMRISE AG	10,018	113.80	1,140,048.40	
	UMICORE	17,605	13.53	238,195.65	
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	31.50	1,333,206.00	
	VOESTALPINE AG	7,152	25.40	181,660.80	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,593	38.52	639,162.36	
	ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	16,593	1.53	25,420.47	
	AIRBUS SE	46,092	131.84	6,076,769.28	
	ALSTOM	24,388	15.94	388,866.66	
	BOUYGUES ORD	16,606	31.12	516,778.72	
	BRENNTAG SE	9,500	63.38	602,110.00	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	36.01	1,414,400.78	
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	170.30	362,739.00	
	EIFFAGE	5,924	89.78	531,856.72	
	FERROVIAL SE	37,026	36.40	1,347,746.40	
	GEA GROUP AG	13,382	39.04	522,433.28	
	IMCD NV	4,641	129.30	600,081.30	
	KINGSPAN GROUP PLC	12,398	82.70	1,025,314.60	
	KNORR-BREMSE AG	5,022	70.75	355,306.50	
	KONE OYJ-B	26,369	46.56	1,227,740.64	
	LEGRAND SA	19,340	92.34	1,785,855.60	
	LEONARDO SPA	31,340	22.45	703,583.00	
	METSO CORPORATION	51,970	9.76	507,227.20	
	MTU AERO ENGINES AG	3,962	249.20	987,330.40	
	PRYSMIAN SPA	21,155	60.00	1,269,300.00	
	RATIONAL AG	483	760.00	367,080.00	

	REXEL SA	17,411	24.00	417,864.00	
	RHEINMETALL AG	3,203	500.80	1,604,062.40	
	SAFRAN SA	26,619	202.00	5,377,038.00	
	SAINT-GOBAIN	36,177	75.32	2,724,851.64	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,150	225.10	9,487,965.00	
	SIEMENS	58,485	173.26	10,133,111.10	
	SIEMENS ENERGY AG	47,513	26.62	1,264,796.06	
	THALES SA	6,657	151.95	1,011,531.15	
	VINCI S.A.	39,327	103.10	4,054,613.70	
	WARTSILA OYJ	41,917	17.78	745,493.84	
	BUREAU VERITAS SA	25,073	25.80	646,883.40	
	RANDSTAD NV	10,680	42.18	450,482.40	
	TELEPERFORMANCE	4,734	105.70	500,383.80	
	WOLTERS KLUWER	19,155	154.30	2,955,616.50	
	ADP	2,382	115.10	274,168.20	
	AENA SME SA	5,508	188.00	1,035,504.00	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	5.96	270,607.02	
	DHL GROUP	74,810	39.56	2,959,483.60	
	GETLINK	21,115	15.84	334,461.60	
	INPOST SA	15,470	15.53	240,249.10	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,617	87.70	2,158,910.90	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	82.15	410,010.65	
	CONTINENTAL AG	8,168	59.12	482,892.16	
	DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	72.58	744,235.32	
	FERRARI NV	10,026	395.30	3,963,277.80	
	MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,436	63.15	4,005,983.40	
	MICHELIN	49,034	34.87	1,709,815.58	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	42.67	501,159.15	
	RENAULT SA	17,081	49.24	841,068.44	
	STELLANTIS NV	166,407	18.06	3,006,641.67	
	VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	106.60	1,633,964.80	
	VOLKSWAGEN STAMM	2,486	112.40	279,426.40	
	ADIDAS AG	12,783	216.10	2,762,406.30	
	HERMES INTERNATIONAL	2,420	2,061.00	4,987,620.00	
	KERING	5,534	321.90	1,781,394.60	
	LVMH	21,429	686.90	14,719,580.10	

	MONCLER SPA	18,908	55.56	1,050,528.48	
	PUMA SE	9,220	42.56	392,403.20	
	SEB SA	2,282	99.95	228,085.90	
	ACCOR	14,436	38.84	560,694.24	
	AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	61.62	2,265,890.64	
	DELIVERY HERO SE	13,414	19.22	257,817.08	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.68	264,969.44	
	SODEXO	6,173	78.95	487,358.35	
	BOLLORE SE	31,761	5.64	179,290.84	
	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,827	76.20	367,817.40	
	PUBLICIS GROUPE	17,217	100.15	1,724,282.55	
	SCOUT24 SE	7,536	71.65	539,954.40	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	27.82	1,831,279.32	
	VIVENDI SE	61,243	10.00	612,430.00	
	D'IETEREN GROUP	2,217	204.40	453,154.80	
	INDITEX	87,257	45.37	3,958,850.09	
	PROSUS	112,590	32.72	3,684,507.75	
	ZALANDO SE	17,664	23.39	413,160.96	
	CARREFOUR	39,746	14.03	557,636.38	
	JERONIMO MARTINS	21,861	18.79	410,768.19	
	KESKO OYJ-B SHS	20,083	16.65	334,381.95	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	28.22	2,000,798.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,097	54.66	3,722,182.02	
	DANONE (GROUPE)	51,810	57.82	2,995,654.20	
	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	8.48	287,361.41	
	HEINEKEN HOLDING NV	9,512	73.30	697,229.60	
	HEINEKEN NV	23,160	88.90	2,058,924.00	
	JDE PEET'S BV	7,000	18.58	130,060.00	
	KERRY GROUP PLC-A	10,913	77.00	840,301.00	
	LOTUS BAKERIES	38	9,840.00	373,920.00	
	PERNOD-RICARD	15,339	126.90	1,946,519.10	
	REMY COINTREAU	1,032	72.15	74,458.80	
	BEIERSDORF AG	7,430	137.85	1,024,225.50	
	HENKEL AG & CO KGAA	8,780	72.80	639,184.00	
	HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,880	81.70	970,596.00	
	LOREAL	18,546	400.05	7,419,327.30	

	AMPLIFON SPA	11,650	30.45	354,742.50	
	BIOMERIEUX	3,044	91.30	277,917.20	
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	63.70	218,491.00	
	DIASORIN ITALIA SPA	2,070	98.90	204,723.00	
	ESSILORLUXOTTICA	22,901	197.20	4,516,077.20	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	35.76	607,383.60	
	FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	28.80	970,243.20	
	KONINKLIJKE PHILIPS	66,646	24.36	1,623,496.56	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	53.54	1,154,697.18	
	ARGENX SE	4,935	416.00	2,052,960.00	
	BAYER	78,462	25.35	1,989,011.70	
	EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	46.69	477,171.80	
	GRIFOLS SA	27,685	9.66	267,437.10	
	IPSEN	3,532	109.40	386,400.80	
	MERCK KGAA	10,703	149.70	1,602,239.10	
	ORION OYJ-CLASS B	10,139	40.83	413,975.37	
	QIAGEN N.V.	16,526	36.91	609,974.66	
	RECORDATI SPA	6,099	48.80	297,631.20	
	SANOFI	87,091	92.03	8,014,984.73	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	230.40	420,249.60	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	157.00	405,374.00	
	UCB (GROUPE)	9,389	143.95	1,351,546.55	
	ABN AMRO BANK NV-CVA	26,474	15.58	412,597.29	
	AIB GROUP PLC	145,826	5.18	756,107.81	
	BANCO BILBAO VIZCAYA	448,899	9.50	4,264,540.50	
	BANCO BPM SPA	118,197	6.34	749,841.76	
	BANCO DE SABADELL SA	420,800	1.84	776,376.00	
	BANCO SANTANDER SA	1,223,031	4.38	5,362,379.41	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	10.05	888,640.79	
	BNP PARIBAS	81,615	61.07	4,984,228.05	
	CAIXABANK	275,085	5.09	1,400,732.82	
	COMMERZBANK AG	81,889	14.58	1,194,351.06	
	CREDIT AGRICOLE SA	87,162	13.38	1,166,663.37	
	ERSTE GROUP BANK AG	25,376	45.39	1,151,816.64	
	FINECOBANK SPA	41,585	14.83	616,705.55	
	ING GROEP NV-CVA	256,546	16.55	4,247,375.57	

	INTESA SANPAOLO	1,145,097	3.55	4,068,529.64	
	KBC GROEP NV	18,057	66.58	1,202,235.06	
	MEDIOBANCA	33,860	14.16	479,626.90	
	NORDEA BANK ABP	236,636	10.74	2,541,470.64	
	SOCIETE GENERALE	53,019	22.85	1,211,749.24	
	UNICREDIT SPA	116,219	36.72	4,268,142.77	
	ADYEN NV	1,609	1,104.80	1,777,623.20	
	AMUNDI SA	4,626	62.80	290,512.80	
	DEUTSCHE BANK NAMEN	140,740	15.39	2,167,114.52	
	DEUTSCHE BOERSE	14,123	186.35	2,631,821.05	
	EDENRED	20,131	40.04	806,045.24	
	EURAZEO SA	3,357	74.10	248,753.70	
	EURONEXT NV	6,480	89.35	578,988.00	
	EXOR NV	7,825	96.60	755,895.00	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	67.10	571,356.50	
	NEXI SPA	48,458	5.82	282,122.47	
	SOFINA	1,238	212.80	263,446.40	
	AEGON LTD	101,846	5.80	591,317.87	
	AGEAS	11,086	43.46	481,797.56	
	ALLIANZ SE-REG	30,116	259.90	7,827,148.40	
	ASR NEDERLAND NV	11,959	44.72	534,806.48	
	AXA SA	136,349	31.63	4,312,718.87	
	GENERALI	84,111	23.50	1,976,608.50	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	238.20	1,061,181.00	
	MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	459.50	4,785,233.00	
	NN GROUP NV	22,941	44.99	1,032,115.59	
	POSTE ITALIANE SPA	24,923	11.99	298,951.38	
	SAMPO OYJ-A SHS	33,132	39.12	1,296,123.84	
	TALANX AG	5,053	71.40	360,784.20	
	BECHTLE AG	7,659	41.44	317,388.96	
	CAPGEMINI SA	12,235	185.05	2,264,086.75	
	DASSAULT SYSTEMES SA	49,547	33.69	1,669,238.43	
	NEMETSCHEK SE	5,455	91.00	496,405.00	
	SAP SE	81,129	184.76	14,989,394.04	
	NOKIA OYJ	396,129	3.59	1,424,677.94	
	CELLNEX TELECOM SA	34,475	30.79	1,061,485.25	

	DEUTSCHE TELEKOM	253,485	23.64	5,992,385.40	
	ELISA A	10,227	42.72	436,897.44	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.66	293,422.50	
	KPN (KON.)	290,883	3.64	1,059,686.76	
	ORANGE	153,281	9.83	1,506,752.23	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.22	192,932.51	
	TELEFONICA	373,259	3.93	1,468,027.64	
	ACCIONA SA	2,181	109.00	237,729.00	
	E.ON SE	166,881	12.12	2,022,597.72	
	EDP RENOVAVEIS SA	21,752	13.30	289,301.60	
	ELIA GROUP SA/NV	987	89.25	88,089.75	
	ENDESA	25,972	17.92	465,418.24	
	ENEL	640,374	6.64	4,257,846.72	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,657	3.53	832,104.86	
	ENGIE	146,393	14.10	2,064,873.26	
	FORTUM OYJ	32,550	13.71	446,423.25	
	IBERDROLA SA	447,152	11.74	5,249,564.48	
	IBERDROLA SA-RTS	447,152	0.34	153,730.85	
	REDEIA CORP SA	30,678	16.23	497,903.94	
	RWE STAMM	52,507	32.64	1,713,828.48	
	SNAM SPA	147,559	4.21	621,370.94	
	TERNA SPA	95,819	7.31	700,436.89	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	28.77	1,432,199.37	
	VERBUND AG	6,430	76.20	489,966.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,856	724.60	2,794,057.60	
	ASML HOLDING NV	30,793	982.70	30,260,281.10	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	165.35	1,051,129.95	
	INFINEON TECHNOLOGIES	96,562	34.98	3,377,738.76	
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	38.21	1,921,679.49	
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	77.96	411,239.00	
	VONOVIA SE	61,810	27.23	1,683,086.30	
ユーロ 小計		14,656,862		394,629,942.13 (68,941,850,890)	
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.54	5,974,573.09	
	SHELL PLC-NEW	491,663	28.34	13,933,729.42	
	ANGLO AMERICAN PLC	101,769	23.79	2,421,593.35	

	ANTOFAGASTA PLC	29,856	21.77	649,965.12	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	39.46	431,061.04	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	17.63	310,358.52	
	GLENCORE PLC	793,369	4.76	3,776,833.12	
	MONDI PLC	37,918	15.32	580,903.76	
	RIO TINTO PLC REG	88,047	52.18	4,594,292.46	
	SMURFIT WESTROCK PLC	19,504	35.10	684,590.40	
	ASHTEAD GROUP PLC	33,317	50.30	1,675,845.10	
	BAE SYSTEMS PLC	240,047	12.68	3,044,996.19	
	BUNZL PLC	29,337	31.10	912,380.70	
	DCC PLC	6,622	56.45	373,811.90	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	5.62	568,474.15	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	4.47	2,846,964.59	
	SMITHS GROUP PLC	26,476	16.99	449,827.24	
	SPIRAX GROUP PLC	5,514	84.45	465,657.30	
	EXPERIAN PLC	68,159	36.33	2,476,216.47	
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	47.54	660,330.60	
	RELX PLC	145,542	35.95	5,232,234.90	
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	4.65	847,164.60	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.91	359,568.22	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	47.28	328,690.56	
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	8.57	255,299.42	
	PERSIMMON PLC	25,686	14.19	364,484.34	
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.50	398,004.72	
	COMPASS GROUP PLC	129,701	21.53	2,792,462.53	
	ENTAIN PLC	49,630	6.40	317,632.00	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,042	155.35	2,026,074.70	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	13,833	81.54	1,127,942.82	
	PEARSON	55,305	10.10	558,580.50	
	WHITBREAD PLC	17,434	29.15	508,201.10	
	AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	8.07	585,058.18	
	INFORMA PLC	110,598	8.51	941,188.98	
	WPP PLC	85,821	7.41	635,933.61	
	JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.11	230,609.87	
	KINGFISHER PLC	153,717	2.57	395,513.84	
	NEXT PLC	8,464	86.74	734,167.36	

	SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.54	377,364.24	
	TESCO PLC	525,585	3.08	1,620,904.14	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	24.37	627,283.80	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,980	24.77	3,913,164.60	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	27.02	485,279.20	
	DIAGEO	174,682	24.78	4,328,619.96	
	IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	20.52	1,405,168.56	
	HALEON PLC	530,525	3.31	1,758,690.37	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	42.47	2,404,693.87	
	UNILEVER PLC	193,307	43.70	8,447,515.90	
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.78	739,454.10	
	ASTRAZENECA	120,005	119.44	14,333,397.20	
	GSK PLC	319,416	15.10	4,823,181.60	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	18.10	324,171.00	
	BARCLAYS	1,129,529	2.16	2,448,254.10	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,446,594	6.69	9,684,946.83	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.57	2,792,790.51	
	NATWEST GROUP PLC	506,122	3.22	1,632,749.57	
	STANDARD CHARTERED PLC	161,358	7.09	1,144,350.93	
	3I GROUP PLC	74,757	29.38	2,196,360.66	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	10.98	363,207.42	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	35,214	92.34	3,251,660.76	
	M&G PLC	131,539	2.09	275,574.20	
	SCHRODERS PLC	39,932	3.67	146,710.16	
	WISE PLC - A	49,048	7.21	353,881.32	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	25.93	421,492.15	
	AVIVA PLC	193,334	4.75	919,109.83	
	LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.28	1,139,881.60	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.35	272,855.35	
	PRUDENTIAL	212,226	7.15	1,517,840.35	
	SAGE GROUP PLC	76,660	10.54	808,379.70	
	HALMA PLC	31,069	26.75	831,095.75	
	BT GROUP PLC	464,863	1.40	652,900.08	
	VODAFONE GROUP PLC	1,645,717	0.71	1,168,459.07	
	CENTRICA PLC	453,631	1.36	617,845.42	
	NATIONAL GRID PLC	371,439	9.29	3,453,639.82	

	SEVERN TRENT PLC	17,468	25.64	447,879.52	
	SSE PLC	81,692	18.25	1,490,879.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.42	527,043.60	
イギリスポンド 小計		20,735,152		149,619,893.01 (30,906,981,299)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	14.63	254,532.74	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	778.00	446,572.00	
	GIVAUDAN-REG	742	4,372.00	3,244,024.00	
	HOLCIM LTD	38,804	81.08	3,146,228.32	
	SIG GROUP AG	26,203	17.30	453,311.90	
	SIKA AG-BR	12,257	257.60	3,157,403.20	
	ABB LTD	124,889	49.94	6,236,956.66	
	GEBERIT AG-REG	2,530	536.20	1,356,586.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	226.00	462,848.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	227.20	702,502.40	
	VAT GROUP AG	1,956	515.40	1,008,122.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	28.90	429,338.40	
	SGS SA	12,959	80.56	1,043,977.04	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	256.20	968,692.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,975	138.10	5,658,647.50	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	184.40	457,865.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	36.50	143,737.00	
	AVOLTA AG	7,820	34.32	268,382.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,568.00	439,040.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	108,400.00	867,200.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,950.00	897,900.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	205,438	92.56	19,015,341.28	
	ALCON INC	38,399	80.12	3,076,527.88	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	272.40	1,058,818.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	117.75	1,005,585.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	85.25	157,712.50	
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	504.60	2,793,465.60	
	NOVARTIS	152,401	97.09	14,796,613.09	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	272.00	602,480.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	54,075	244.60	13,226,745.00	
	SANDOZ GROUP AG	30,458	33.91	1,032,830.78	

	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	96.00	238,752.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	51.06	780,656.34	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,205.50	2,200,037.50	
	UBS GROUP AG	249,657	27.11	6,768,201.27	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	160.50	684,372.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	123.10	363,760.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	669.40	1,418,458.60	
	SWISS RE LTD	24,330	110.35	2,684,815.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,440	475.60	5,440,864.00	
	TEMENOS AG - REG	5,150	64.05	329,857.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	85.02	1,020,750.12	
	SWISSCOM	1,856	515.50	956,768.00	
	BKW AG	1,744	148.90	259,681.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	86.95	493,789.05	
スイスフラン 小計		1,161,275		112,050,751.27 (20,155,689,138)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	22,252	349.00	7,765,948.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	418.00	2,250,094.00	
	SCA SV CELLULOSA B	34,763	152.45	5,299,619.35	
	ALFA LAVAL AB	25,134	455.10	11,438,483.40	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	295.90	22,481,594.30	
	ATLAS COPCO A	207,097	193.40	40,052,559.80	
	ATLAS COPCO B	114,624	166.55	19,090,627.20	
	BEIJER REF AB	26,868	174.10	4,677,718.80	
	EPIROC AB-A	53,479	207.90	11,118,284.10	
	EPIROC AB-B	28,804	189.70	5,464,118.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	85.94	3,326,909.28	
	INDUTRADE AB	22,644	279.60	6,331,262.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	288.70	4,042,377.40	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	297.20	5,340,684.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	44.72	5,493,762.56	
	SAAB AB-B	25,552	257.00	6,566,864.00	
	SANDVIK AB	87,594	209.70	18,368,461.80	
	SKANSKA B	25,507	192.65	4,913,923.55	
	SKF AB-B	21,050	206.30	4,342,615.00	
	TRELLEBORG AB-B SHS	16,653	408.40	6,801,085.20	

	VOLVO AB-A SHS	13,514	268.20	3,624,454.80	
	VOLVO B	124,872	263.20	32,866,310.40	
	SECURITAS B	28,375	104.40	2,962,350.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	31.96	1,592,854.44	
	EVOLUTION AB	13,186	1,118.00	14,741,948.00	
	HENNES & MAURITZ B	40,961	168.75	6,912,168.75	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	276.60	13,684,508.40	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	181.75	3,234,423.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	281.80	4,039,603.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	114,218	153.05	17,481,064.90	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	100.00	12,073,600.00	
	SWEDBANK AB-A	71,421	211.40	15,098,399.40	
	EQT AB	31,471	323.80	10,190,309.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	348.60	4,119,754.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	344.10	3,842,908.80	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	286.95	36,883,979.10	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	526.00	3,829,280.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	67.40	14,470,038.60	
	HEXAGON AB-B SHS	172,099	117.40	20,204,422.60	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	102.15	4,776,738.30	
	TELIA CO AB	123,760	28.11	3,478,893.60	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	80.18	4,546,206.00	
	SAGAX AB-B	17,402	290.60	5,057,021.20	
スウェーデンクローナ 小計		2,467,327		434,878,230.83 (6,662,334,496)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	29,320	261.70	7,673,044.00	
	EQUINOR ASA	66,436	291.75	19,382,703.00	
	NORSK HYDRO	100,517	67.14	6,748,711.38	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	287.70	3,595,674.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,304	894.00	4,741,776.00	
	MOWI ASA	31,968	174.60	5,581,612.80	
	ORKLA	39,191	85.65	3,356,709.15	
	SALMAR ASA	5,423	570.50	3,093,821.50	
	DNB BANK ASA	71,795	204.50	14,682,077.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	195.60	3,633,074.40	
	TELENOR ASA	51,193	120.50	6,168,756.50	

ノルウェークローネ 小計		432,219		78,657,960.83 (1,198,747,323)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	428.40	12,899,980.80	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	2,884.00	2,177,420.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	83,415	160.30	13,371,424.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	11,400.00	2,496,600.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	11,680.00	3,574,080.00	
	DSV A/S	12,386	1,141.00	14,132,426.00	
	PANDORA A/S	6,512	1,020.00	6,642,240.00	
	CARLSBERG AS-B	6,810	868.00	5,911,080.00	
	COLOPLAST-B	9,737	850.40	8,280,344.80	
	DEMANT A/S	8,512	297.80	2,534,873.60	
	GENMAB A/S	4,878	1,763.50	8,602,353.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	253,029	966.00	244,426,014.00	
	DANSKE BANK A/S	53,617	202.60	10,862,804.20	
	TRYG A/S	29,772	152.00	4,525,344.00	
	ORSTED A/S	12,910	389.70	5,031,027.00	
デンマーククローネ 小計		512,970		345,468,011.90 (8,090,860,838)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	33.43	689,627.47	
	SANTOS	224,634	7.92	1,779,101.28	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	28.59	4,035,049.65	
	BHP GROUP LTD	388,318	43.74	16,985,029.32	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	20.17	701,310.90	
	FORTESCUE LTD	137,312	21.86	3,001,640.32	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	30,758	46.71	1,436,706.18	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	56.32	811,514.88	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	88,682	12.98	1,151,092.36	
	ORICA LTD	38,288	17.64	675,400.32	
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	3.01	630,549.85	
	RIO TINTO LTD	28,272	120.60	3,409,603.20	
	SOUTH32 LTD	346,773	3.72	1,289,995.56	
	REECE LTD	16,814	24.37	409,757.18	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	12,630	35.58	449,375.40	
	BRAMBLES LTD	108,007	14.13	1,526,138.91	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	26.86	1,191,939.36	

	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.58	428,135.78	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.12	520,200.00	
	TRANSURBAN GROUP	224,973	12.43	2,796,414.39	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	51.52	2,380,739.20	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.88	888,223.44	
	CAR GROUP LTD	29,334	34.19	1,002,929.46	
	REA GROUP LTD	3,586	196.86	705,939.96	
	SEEK LTD	28,001	19.84	555,539.84	
	WESFARMERS LTD	82,500	66.55	5,490,375.00	
	COLES GROUP LTD	108,486	17.10	1,855,110.60	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.01	550,604.01	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	33.94	3,124,889.74	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.96	764,961.60	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	319.77	1,529,459.91	
	PRO MEDICUS LTD	3,708	134.11	497,279.88	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	46.54	563,459.78	
	SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	25.95	1,085,462.55	
	CSL LIMITED	37,640	298.53	11,236,669.20	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	29.29	6,983,409.67	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	130,513	128.69	16,795,717.97	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	240,813	35.84	8,630,737.92	
	WESTPAC BANKING	276,117	27.68	7,642,918.56	
	ASX LTD	14,549	61.65	896,945.85	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	28,241	202.82	5,727,839.62	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	33.64	464,635.68	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	6.96	1,159,967.52	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.61	838,180.63	
	QBE INSURANCE GROUP	127,819	16.93	2,163,975.67	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	16.76	1,589,920.64	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	98.89	1,364,780.89	
	XERO LTD	11,340	135.00	1,530,900.00	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.73	1,150,581.91	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	10.83	1,684,444.05	
オーストラリアドル 小計		5,214,124		134,775,183.06 (14,659,496,661)	
ニュージーラン	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.64	630,002.04	

ドドル	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	30.10	1,203,398.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,957	4.08	542,464.56	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.64	429,030.32	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	6.60	729,590.40	
ニュージーランドドル 小計		430,555		3,534,485.32 (349,843,356)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,996	37.15	6,538,251.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	89.50	9,576,500.00	
	MTR CORP	125,000	24.75	3,093,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	19.86	2,383,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	34.05	5,924,700.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	16.30	3,227,400.00	
	WH GROUP LTD	658,301	5.01	3,298,088.01	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	22.65	6,375,975.00	
	HANG SENG BANK	59,400	99.05	5,883,570.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,300	240.00	23,112,000.00	
	AIA GROUP LTD	864,200	51.45	44,463,090.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	44.90	1,683,750.00	
	CLP HOLDINGS	136,500	62.65	8,551,725.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.08	5,500,314.56	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	42.55	4,765,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	29.25	3,568,383.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	20.90	2,617,265.20	
	SINO LAND CO	315,400	7.97	2,513,738.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	66.90	7,024,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	44,500	73.05	3,250,725.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	12.74	1,225,588.00	
	WHARF HOLDINGS	84,000	23.45	1,969,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	19.94	2,452,620.00	
香港ドル 小計		5,065,678		159,000,533.17 (3,288,131,025)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	112,800	6.57	741,096.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.32	636,768.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	7.03	761,573.96	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.84	247,416.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.12	557,232.00	

	DBS GROUP	155,760	37.40	5,825,424.00	
	OCBC BANK	257,100	15.15	3,895,065.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	32.87	3,089,780.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.62	634,920.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	2.90	1,804,214.70	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	84,100	4.73	397,793.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	2.64	686,664.00	
シンガポールドル 小計		2,379,135		19,277,946.66 (2,305,449,641)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	16.08	955,586.16	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	688.30	1,477,091.80	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	35.36	3,476,241.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	32.80	3,690,393.60	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.91	1,981,045.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	137.00	1,712,911.00	
	NICE LTD	4,991	639.20	3,190,247.20	
	AZRIELI GROUP	1,537	250.90	385,633.30	
イスラエルシェケル 小計		390,926		16,869,149.66 (739,555,329)	
合　計		84,827,118		780,148,185,879 (780,148,185,879)	

(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	650,494.90	
	オーストラリアドル 小計		83,290	650,494.90 (70,754,330)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,816,100.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,816,100.00 (58,236,948)	
投資信託受益証券合計			398,290	128,991,278	

				(128,991,278)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,450,848.12	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	929,782.02	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,290	7,111,388.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	711,386.04	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,379,190.86	
		BXP INC	11,259	689,726.34	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	836,969.49	
		CROWN CASTLE INC	33,735	3,274,319.10	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,348	3,579,248.40	
		EQUINIX INC	7,333	5,623,164.39	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	904,155.30	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,758,885.75	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,436,423.85	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	2,409,346.29	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	810,656.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,765	1,075,584.60	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	995,798.42	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,624,788.80	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	2,172,350.38	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	921,538.28	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,279,116.45	
		PROLOGIS INC	71,288	8,158,911.60	
		PUBLIC STORAGE	11,847	3,423,664.53	
		REALTY INCOME CORP	64,068	3,380,227.68	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	776,682.88	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	1,746,669.49	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,979	3,833,721.03	
		SUN COMMUNITIES INC	10,890	1,286,326.80	
		UDR INC	23,815	971,890.15	
		VENTAS INC	31,565	1,648,955.60	
		VICI PROPERTIES INC	83,762	2,315,181.68	
		WELLTOWER INC	43,994	4,611,891.02	
		WP CAREY INC	16,024	878,916.40	
	アメリカドル 小計		926,874	75,007,706.14	

				(12,117,494,926)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	226,414.71	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	261,781.00	
	カナダドル 小計		20,377	488,195.71 (57,846,309)	
	ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	220,610.52	
		GECINA SA	3,139	273,249.95	
		KLEPIERRE	17,225	426,146.50	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	783,706.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	330,856.68	
	ユーロ 小計		48,695	2,034,570.45 (355,439,457)	
	イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	349,554.69	
		SEGRO PLC	103,047	933,811.91	
	イギリスポンド 小計		159,336	1,283,366.60 (265,105,038)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	606,880.50	
		GOODMAN GROUP	135,303	4,719,368.64	
		GPT GROUP	167,884	686,645.56	
		MIRVAC GROUP	266,683	493,363.55	
		SCENTRE GROUP	381,283	1,212,479.94	
		STOCKLAND	207,412	879,426.88	
		VICINITY CENTERS	305,149	590,463.31	
	オーストラリアドル 小計		1,557,804	9,188,628.38 (999,447,108)	
	香港ドル	LINK REIT	166,900	5,023,690.00	
	香港ドル 小計		166,900	5,023,690.00 (103,889,909)	
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	727,393.28	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	673,672.71	
	シンガポールドル 小計		622,667	1,401,065.99 (167,553,481)	
投資証券合計			3,502,653	14,066,776,228 (14,066,776,228)	
合計				14,195,767,506	

		(14,195,767,506)	

有価証券明細表注記

1.券面総額欄の数値は、証券数又は口数を表示しております。

2.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

5.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 581銘柄	98.0%	—	—	—	75.3%
	投資証券 33銘柄	—	—	—	2.0%	1.5%
カナダドル	株式 85銘柄	99.8%	—	—	—	3.1%
	新株予約権証券 1銘柄	—	—	—	—	—
	投資証券 2銘柄	—	—	—	0.2%	0.0%
ユーロ	株式 219銘柄	99.5%	—	—	—	8.7%
	投資証券 5銘柄	—	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 78銘柄	99.1%	—	—	—	3.9%
	投資証券 2銘柄	—	—	—	0.9%	0.0%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.0%	—	—	—	2.5%
スウェーデンクローナ	株式 43銘柄	100.0%	—	—	—	0.8%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%	—	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 15銘柄	100.0%	—	—	—	1.0%
オーストラリアドル	株式 50銘柄	93.2%	—	—	—	1.8%
	投資信託受益証券 1銘柄	—	—	0.4%	—	0.0%
	投資証券 7銘柄	—	—	—	6.4%	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	95.3%	—	—	—	0.4%
	投資信託受益証券 1銘柄	—	—	1.7%	—	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	93.2%	—	—	—	0.3%
	投資証券 2銘柄	—	—	—	6.8%	0.0%
イスラエ	株式 8銘柄	100.0%	—	—	—	0.1%

ルシェケル						

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	203,330,591
コール・ローン	7,048,801
株式	16,979,592,058
投資信託受益証券	4,531,199
投資証券	307,175,515
派生商品評価勘定	7,720,811
未収配当金	9,615,875
未収利息	12
差入委託証拠金	240,251,631
流動資産合計	17,759,266,493
資産合計	17,759,266,493
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	92,592
前受金	7,609,634
未払解約金	1,348
流動負債合計	7,703,574
負債合計	7,703,574
純資産の部	
元本等	
元本	9,375,233,537
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	8,376,329,382
元本等合計	17,751,562,919
純資産合計	17,751,562,919
負債純資産合計	17,759,266,493

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 7月 10日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		9,375,233,537口
2． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	1.8935円
	(1万口当たり純資産額)	(18,935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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	8,493,667,478円
期中追加設定元本額	2,300,188,636円
期中一部解約元本額	1,418,622,577円
期末元本額	9,375,233,537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）	5,725,829,182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	2,689,505,536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）	57,316,569円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	289,384,415
投資信託受益証券	△336,504
投資証券	3,355,577
合計	292,403,488

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2024年 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	442,426,311	－	450,035,945	7,609,634
合計		442,426,311	－	450,035,945	7,609,634

(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 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	14,517,300	－	14,535,885	18,585
	アメリカドル	14,517,300	－	14,535,885	18,585
合計		14,517,300	－	14,535,885	18,585

(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	33.43	114,631.47	
	CHENIERE ENERGY INC	711	175.98	125,121.78	
	HALLIBURTON CO	2,908	32.83	95,469.64	
	HF SINCLAIR CORP	505	48.98	24,734.90	
	KINDER MORGAN INC	6,619	19.99	132,313.81	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,145	162.92	186,543.40	
	ONEOK INC	1,824	82.42	150,334.08	
	PHILLIPS 66	1,360	132.81	180,621.60	
	SCHLUMBERGER	4,395	45.20	198,654.00	
	TARGA RESOURCES CORP	636	132.41	84,212.76	
	VALERO ENERGY CORP	1,047	146.30	153,176.10	
	WILLIAMS COS	3,848	42.39	163,116.72	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	706	254.70	179,818.20	
	AVERY DENNISON CORP	251	213.00	53,463.00	

	BALL CORP	921	58.86	54,210.06	
	CRH PLC	2,249	75.89	170,676.61	
	ECOLAB INC	818	242.25	198,160.50	
	INT'L PAPER CO	1,067	42.55	45,400.85	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	776	96.81	75,124.56	
	LINDE PLC	1,534	431.20	661,460.80	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	801	93.20	74,653.20	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	188	530.67	99,765.96	
	NEWMONT CORPORATION	3,602	43.89	158,091.78	
	NUCOR CORP	769	150.25	115,542.25	
	PPG INDUSTRIES INC	779	125.26	97,577.54	
	STEEL DYNAMICS INC	441	124.25	54,794.25	
	3 M COMPANY	1,735	99.69	172,962.15	
	AERCAP HOLDINGS NV	651	94.02	61,207.02	
	ALLEGION PLC	283	114.67	32,451.61	
	AXON ENTERPRISE INC	219	298.51	65,373.69	
	CARRIER GLOBAL CORP	2,696	62.29	167,933.84	
	CATERPILLAR	1,587	326.06	517,457.22	
	CNH INDUSTRIAL NV	2,770	9.47	26,231.90	
	CUMMINS INC	448	268.68	120,368.64	
	DEERE&CO	840	348.84	293,025.60	
	DOVER CORP	416	175.13	72,854.08	
	EATON CORP	1,271	318.71	405,080.41	
	EMCOR GROUP INC	150	363.56	54,534.00	
	FERGUSON PLC	643	188.00	120,884.00	
	FORTIVE CORP	1,182	72.64	85,860.48	
	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	438	64.30	28,163.40	
	GENERAL ELECTRIC CO	3,474	163.13	566,713.62	
	GRACO INC	519	78.05	40,507.95	
	GRAINGER (WW) INC	138	908.57	125,382.66	
	IDEX CORP	216	195.24	42,171.84	
	ILLINOIS TOOL WORKS	950	234.06	222,357.00	
	INGERSOLL-RAND INC	1,247	91.73	114,387.31	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,151	67.14	144,418.14	
	LENNOX INTERNATIONAL INC	108	535.61	57,845.88	
	OWENS CORNING	245	165.34	40,508.30	

	PENTAIR PLC	479	75.01	35,929.79	
	QUANTA SERVICES INC	487	254.79	124,082.73	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	382	261.24	99,793.68	
	TORO CO	322	87.81	28,274.82	
	TRANE TECHNOLOGIES PLC	739	333.74	246,633.86	
	UNITED RENTALS INC	216	627.41	135,520.56	
	XYLEM INC	752	133.59	100,459.68	
	AUTOMATIC DATA PROCESS	1,288	234.71	302,306.48	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	350	199.99	69,996.50	
	CINTAS CORP	291	711.30	206,988.30	
	DAYFORCE INC	453	48.32	21,888.96	
	PAYCHEX INC	1,012	117.02	118,424.24	
	PAYLOCITY HOLDING CORP	129	134.01	17,287.29	
	SMURFIT WESTROCK PLC	968	44.83	43,395.44	
	TRANSUNION	597	76.33	45,569.01	
	VERALTO CORP	783	95.70	74,933.10	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	374	86.55	32,369.70	
	CSX CORP	6,407	32.48	208,099.36	
	DELTA AIR LINES INC	457	46.89	21,428.73	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	413	118.65	49,002.45	
	GRAB HOLDINGS LTD - CL A	6,680	3.58	23,914.40	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	226	155.54	35,152.04	
	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	528	47.99	25,338.72	
	OLD DOMINION FREIGHT LINE	621	178.41	110,792.61	
	UNION PACIFIC CORP	1,938	221.78	429,809.64	
	UNITED PARCEL SERVICE B	2,364	134.28	317,437.92	
	APTIV PLC	915	69.08	63,208.20	
	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	2,859	15.71	44,914.89	
	TESLA INC	9,108	262.33	2,389,301.64	
	DECKERS OUTDOOR CORP	81	939.05	76,063.05	
	DR HORTON INC	949	136.00	129,064.00	
	LULULEMON ATHLETICA INC	397	289.87	115,078.39	
	NIKE B	3,851	72.46	279,043.46	
	NVR INC	10	7,484.08	74,840.80	
	PULTE GROUP INC	693	104.70	72,557.10	
	BOOKING HOLDINGS INC	109	3,977.48	433,545.32	

	DARDEN RESTAURANTS INC	379	140.29	53,169.91	
	DOMINO'S PIZZA INC	111	477.83	53,039.13	
	DOORDASH INC - A	898	108.95	97,837.10	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	799	215.25	171,984.75	
	MCDONALD'S CORP	2,291	245.82	563,173.62	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	775	163.13	126,425.75	
	YUM BRANDS INC	900	126.66	113,994.00	
	ALPHABET INC-CL A	18,725	188.98	3,538,650.50	
	ALPHABET INC-CL C	16,218	190.44	3,088,555.92	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	298	293.91	87,585.18	
	COMCAST CORP-CL A	12,594	37.51	472,400.94	
	ELECTRONIC ARTS INC	762	140.58	107,121.96	
	FOX CORP - CLASS A	918	35.19	32,304.42	
	FOX CORP- CLASS B	492	32.76	16,117.92	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS	1,160	28.51	33,071.60	
	OMNICOM GROUP	623	90.51	56,387.73	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	565	149.36	84,388.40	
	THE WALT DISNEY CO	5,798	97.05	562,695.90	
	AUTOZONE INC	57	2,817.06	160,572.42	
	BATH & BODY WORKS INC	712	37.18	26,472.16	
	BEST BUY COMPANY INC	593	86.42	51,247.06	
	BURLINGTON STORES INC	211	240.21	50,684.31	
	CARMAX INC	544	72.26	39,309.44	
	DICK'S SPORTING GOODS INC	187	200.96	37,579.52	
	EBAY	1,615	52.65	85,029.75	
	ETSY INC	377	57.01	21,492.77	
	GENUINE PARTS CO	499	131.04	65,388.96	
	HOME DEPOT	3,149	337.09	1,061,496.41	
	LKQ CORP	787	41.25	32,463.75	
	LOWES COMPANIES	1,819	216.33	393,504.27	
	MERCADOLIBRE INC	149	1,722.05	256,585.45	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	188	1,015.62	190,936.56	
	POOL CORP	111	296.17	32,874.87	
	TJX COMPANIES INC	3,600	112.15	403,740.00	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	337	257.26	86,696.62	
	ULTA BEAUTY INC	149	396.01	59,005.49	

	WILLIAMS-SONOMA INC	388	142.22	55,181.36	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	1,098	19.45	21,356.10	
	KROGER CO	2,283	51.86	118,396.38	
	TARGET (DAYTON HUDSON)	1,521	147.60	224,499.60	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,330	10.79	25,140.70	
	BUNGE GLOBAL SA	425	109.95	46,728.75	
	CAMPBELL SOUP CO (US)	623	45.38	28,271.74	
	COCA-COLA CO	13,014	62.69	815,847.66	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	685	72.22	49,470.70	
	CONAGRA BRANDS INC	1,386	28.74	39,833.64	
	GENERAL MILLS INC	1,790	62.69	112,215.10	
	HORMEL FOODS CORP	878	30.04	26,375.12	
	JM SMUCKER CO	330	109.37	36,092.10	
	KELLANOVA	944	56.37	53,213.28	
	KEURIG DR PEPPER INC	3,592	31.95	114,764.40	
	LAMB WESTON HOLDINGS INC	450	76.86	34,587.00	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	733	70.07	51,361.31	
	PEPSICO INC	4,368	161.90	707,179.20	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	760	104.61	79,503.60	
	CLOROX COMPANY	452	131.85	59,596.20	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	2,485	97.04	241,144.40	
	KIMBERLY-CLARK CORP	1,062	139.43	148,074.66	
	PROCTER & GAMBLE CO	7,492	165.66	1,241,124.72	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	216	247.48	53,455.68	
	CENCORA INC	543	222.37	120,746.91	
	COOPER COS INC/THE	600	85.68	51,408.00	
	DAVITA INC	138	137.92	19,032.96	
	DEXCOM INC	1,251	110.84	138,660.84	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,946	93.48	181,912.08	
	ELEVANCE HEALTH INC	740	529.24	391,637.60	
	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	1,375	76.87	105,696.25	
	HCA HEALTHCARE INC	654	316.91	207,259.14	
	HENRY SCHEIN INC	408	64.44	26,291.52	
	HOLOGIC INC	714	74.75	53,371.50	
	HUMANA INC	378	373.36	141,130.08	
	IDEXX LABORATORIES INC	265	477.89	126,640.85	

	INSULET CORP	273	195.17	53,281.41	
	LABCORP HOLDINGS INC	246	199.35	49,040.10	
	MOLINA HEALTHCARE INC	173	287.30	49,702.90	
	QUEST DIAGNOSTICS	343	138.36	47,457.48	
	SOLVENTUM CORP	466	48.02	22,377.32	
	STERIS PLC	290	213.51	61,917.90	
	TELEFLEX INC	130	218.07	28,349.10	
	THE CIGNA GROUP	902	328.37	296,189.74	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	710	105.76	75,089.60	
	AGILENT TECHNOLOGIES	917	125.42	115,010.14	
	AMGEN	1,703	315.91	537,994.73	
	AVANTOR INC	2,087	20.88	43,576.56	
	BIO-TECHNE CORP	460	71.29	32,793.40	
	BIOGEN INC	457	229.06	104,680.42	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,440	40.86	263,138.40	
	CATALENT INC	575	57.30	32,947.50	
	DANAHER CORP	2,236	239.79	536,170.44	
	ELI LILLY & CO	2,568	932.50	2,394,660.00	
	GILEAD SCIENCES INC	4,033	67.76	273,276.08	
	IQVIA HOLDINGS INC	578	213.05	123,142.90	
	JOHNSON & JOHNSON	7,657	147.05	1,125,961.85	
	MERCK & CO	8,048	126.04	1,014,369.92	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	68	1,308.00	88,944.00	
	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	316	143.30	45,282.80	
	REPLIGEN CORP	163	120.82	19,693.66	
	WATERS CORP	180	282.97	50,934.60	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	250	318.63	79,657.50	
	ZOETIS INC	1,474	174.24	256,829.76	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,443	36.30	52,380.90	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,109	12.97	53,293.73	
	KEY CORP	2,947	14.29	42,112.63	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,304	161.51	210,609.04	
	REGIONS FINL CORP	2,685	20.11	53,995.35	
	TRUIST FINANCIAL CORP	4,208	38.91	163,733.28	
	US BANCORP	4,896	39.87	195,203.52	
	ALLY FINANCIAL INC	1,015	41.03	41,645.45	

	AMERICAN EXPRESS	1,831	237.75	435,320.25	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	319	433.29	138,219.51	
	BANK NEW YORK CO	2,299	60.21	138,422.79	
	BLACKROCK INC	473	802.28	379,478.44	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,214	136.99	166,305.86	
	CBOE GLOBAL MARKETS INC	310	168.57	52,256.70	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	785	130.00	102,050.00	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	1,127	40.80	45,981.60	
	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	109	411.74	44,879.66	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	1,883	73.72	138,814.76	
	FISERV INC	1,858	151.09	280,725.22	
	FRANKLIN RESOURCES INC	1,031	22.06	22,743.86	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,816	142.46	258,707.36	
	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	232	273.22	63,387.04	
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	116	204.40	23,710.40	
	MASTERCARD INC-CLASS A	2,648	444.70	1,177,565.60	
	MOODY'S CORP	519	435.95	226,258.05	
	MORGAN STANLEY	3,897	102.61	399,871.17	
	NASDAQ INC	1,242	60.81	75,526.02	
	NORTHERN TRUST CORP	584	83.93	49,015.12	
	PAYPAL HOLDINGS INC	3,177	59.00	187,443.00	
	PRICE T ROWE GROUP INC	661	114.47	75,664.67	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	690	118.67	81,882.30	
	S&P GLOBAL INC	1,018	460.30	468,585.40	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	4,762	74.53	354,911.86	
	STATE STREET CORP	1,059	74.42	78,810.78	
	SYNCHRONY FINANCIAL	1,453	48.45	70,397.85	
	VISA INC-CLASS A SHARES	5,026	265.44	1,334,101.44	
	AFLAC	1,791	88.93	159,273.63	
	ALLSTATE CORP	809	158.72	128,404.48	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,252	98.00	122,696.00	
	ASSURANT INC	127	161.61	20,524.47	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS	952	99.75	94,962.00	
	MARSH & MCLENNAN COS	1,540	211.80	326,172.00	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	734	80.87	59,358.58	
	PROGRESSIVE CORP	1,858	209.49	389,232.42	

	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,104	118.63	130,967.52	
	TRAVELERS COS INC/THE	704	203.14	143,010.56	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	312	257.34	80,290.08	
	WEYERHAEUSER CO	2,132	27.57	58,779.24	
	ACCENTURE PLC-CL A	1,998	298.06	595,523.88	
	ADOBE INC	1,424	566.02	806,012.48	
	AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	483	92.48	44,667.84	
	ANSYS INC	301	327.35	98,532.35	
	ASPEN TECHNOLOGY INC	91	188.95	17,194.45	
	ATLASSIAN CORP-CL A	500	177.98	88,990.00	
	AUTODESK INC	681	243.96	166,136.76	
	CADENCE DESIGN SYSTEMS	867	315.26	273,330.42	
	CONFLUENT INC-CLASS A	646	27.87	18,004.02	
	DOCUSIGN INC	624	51.91	32,391.84	
	FAIR ISAAC CORP	77	1,568.06	120,740.62	
	GARTNER INC	242	448.09	108,437.78	
	GEN DIGITAL INC	1,758	24.13	42,420.54	
	HUBSPOT INC	160	560.21	89,633.60	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,913	176.48	514,086.24	
	INTUIT INC	890	650.42	578,873.80	
	MANHATTAN ASSOCIATES INC	196	242.17	47,465.32	
	MICROSOFT CORP	22,429	459.54	10,307,022.66	
	PALO ALTO NETWORKS INC	1,027	336.18	345,256.86	
	PTC INC	352	177.48	62,472.96	
	SALESFORCE INC	3,083	252.43	778,241.69	
	SERVICENOW INC	652	744.01	485,094.52	
	SYNOPSYS INC	500	607.94	303,970.00	
	TWILIO INC - A	549	56.39	30,958.11	
	UIPATH INC - CLASS A	1,391	11.93	16,594.63	
	WORKDAY INC-CLASS A	654	223.09	145,900.86	
	ZSCALER INC	334	197.36	65,918.24	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,851	21.25	81,833.75	
	HP INC	3,046	35.42	107,889.32	
	JUNIPER NETWORKS INC	1,031	36.92	38,064.52	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	534	136.06	72,656.04	
	NETAPP INC	661	132.09	87,311.49	

	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	591	104.35	61,670.85	
	TRIMBLE IMS HOLDINGS	733	55.23	40,483.59	
	WESTERN DIGITAL CORP	987	78.43	77,410.41	
	VERIZON COMMUNICATIONS	13,359	41.30	551,726.70	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	652	130.72	85,229.44	
	ATMOS ENERGY CORP	528	114.77	60,598.56	
	CMS ENERGY CORP	839	58.86	49,383.54	
	CONSOLIDATED EDISON INC	1,035	88.85	91,959.75	
	EDISON INTL	1,297	71.53	92,774.41	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	767	37.20	28,532.40	
	EVERSOURCE ENERGY	1,194	57.84	69,060.96	
	EXELON CORP	3,057	34.43	105,252.51	
	NRG ENERGY INC	623	79.26	49,378.98	
	SEMPRA	1,927	75.58	145,642.66	
	ADVANCED MICRO DEVICES	5,135	177.10	909,408.50	
	APPLIED MATERIALS	2,641	251.47	664,132.27	
	ENPHASE ENERGY INC	431	103.59	44,647.29	
	FIRST SOLAR INC	323	225.23	72,749.29	
	INTEL CORP	13,410	34.59	463,851.90	
	LAM RESEARCH CORP	412	1,112.55	458,370.60	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	437	59.75	26,110.75	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,801	73.84	206,825.84	
	NVIDIA CORP	79,440	131.38	10,436,827.20	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	816	274.91	224,326.56	
	TEXAS INSTRUMENTS	2,892	200.16	578,862.72	
	CBRE GROUP INC-A	950	88.77	84,331.50	
アメリカドル 小計		566,667		81,561,311.66 (13,176,229,898)	
カナダドル	CAMECO CORP	1,237	66.83	82,668.71	
	ENBRIDGE	6,754	48.22	325,677.88	
	IMPERIAL OIL	613	92.19	56,512.47	
	KEYERA CORP	573	37.82	21,670.86	
	PARKLAND CORP	413	36.62	15,124.06	
	PEMBINA PIPELINE CORP	2,000	50.71	101,420.00	
	AGNICO EAGLE MINES	1,640	95.73	156,997.20	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,594	19.00	30,286.00	

	KINROSS GOLD CORP	3,375	11.72	39,555.00	
	LUNDIN MINING CORP	1,764	15.86	27,977.04	
	NUTRIEN LTD	1,453	66.23	96,232.19	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	257	102.10	26,239.70	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,359	76.45	103,895.55	
	CAE INC	1,167	25.02	29,198.34	
	STANTEC INC	362	114.45	41,430.90	
	WSP GLOBAL INC	396	215.03	85,151.88	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	1,237	25.17	31,135.29	
	RB GLOBAL INC	570	104.50	59,565.00	
	THOMSON REUTERS CORP	488	227.81	111,171.28	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,761	157.57	277,480.77	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	546	52.35	28,583.10	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	143	136.45	19,512.35	
	DOLLARAMA INC	838	130.07	108,998.66	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,403	79.74	191,615.22	
	METRO INC	705	78.50	55,342.50	
	BANK MONTREAL	2,255	115.31	260,024.05	
	BANK NOVA SCOTIA	3,962	62.31	246,872.22	
	NATIONAL BANK OF CANADA	1,167	112.12	130,844.04	
	TORONTO-DOMINION BANK	5,619	76.18	428,055.42	
	BROOKFIELD CORP	4,194	58.66	246,020.04	
	IA FINANCIAL CORP INC	312	84.74	26,438.88	
	INTACT FINANCIAL CORP	597	233.01	139,106.97	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,748	66.99	117,098.52	
	CGI INC - CL A	656	138.54	90,882.24	
	OPEN TEXT CORP	1,049	42.12	44,183.88	
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,906	90.13	352,047.78	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,342	49.73	66,737.66	
	TELUS CORP	1,700	21.05	35,785.00	
	FORTIS INC	1,705	53.54	91,285.70	
	HYDRO ONE LTD	1,129	39.89	45,035.81	
	FIRSTSERVICE CORP	81	208.39	16,879.59	
カナダドル 小計		65,070		4,460,739.75 (528,553,052)	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,436	19.86	28,526.14	

	NESTE OIL OYJ	1,576	16.97	26,744.72	
	OMV AG	448	39.86	17,857.28	
	REPSOL SA	4,227	13.76	58,163.52	
	TENARIS SA	1,751	14.14	24,767.89	
	TOTALENERGIES SE	6,826	63.22	431,539.72	
	AKZO NOBEL	535	56.26	30,099.10	
	COVESTRO AG	600	55.32	33,192.00	
	DSM-FIRMENICH AG	659	108.80	71,699.20	
	EVONIK INDUSTRIES AG	657	19.22	12,630.82	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	367	97.62	35,826.54	
	OCI NV	511	23.20	11,855.20	
	STORA ENSO OYJ R	2,074	12.47	25,873.15	
	SYMRISE AG	364	113.80	41,423.20	
	UMICORE	562	13.53	7,603.86	
	UPM KYMMENE OYJ	1,804	31.50	56,826.00	
	VOESTALPINE AG	498	25.40	12,649.20	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	766	38.52	29,506.32	
	ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	766	1.53	1,173.51	
	BOUYGUES ORD	586	31.12	18,236.32	
	EIFFAGE	297	89.78	26,664.66	
	GEA GROUP AG	399	39.04	15,576.96	
	KINGSPAN GROUP PLC	591	82.70	48,875.70	
	KNORR-BREMSE AG	224	70.75	15,848.00	
	KONE OYJ-B	1,080	46.56	50,284.80	
	METSO CORPORATION	2,196	9.76	21,432.96	
	MTU AERO ENGINES AG	171	249.20	42,613.20	
	REXEL SA	717	24.00	17,208.00	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,730	225.10	389,423.00	
	WARTSILA OYJ	1,323	17.78	23,529.55	
	WOLTERS KLUWER	760	154.30	117,268.00	
	ADP	92	115.10	10,589.20	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	2,000	5.96	11,936.00	
	GETLINK	1,366	15.84	21,637.44	
	MICHELIN	2,056	34.87	71,692.72	
	ADIDAS AG	510	216.10	110,211.00	
	HERMES INTERNATIONAL	102	2,061.00	210,222.00	

	KERING	224	321.90	72,105.60	
	LVMH	877	686.90	602,411.30	
	MONCLER SPA	637	55.56	35,391.72	
	PUMA SE	276	42.56	11,746.56	
	AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	1,403	61.62	86,452.86	
	PUBLICIS GROUPE	727	100.15	72,809.05	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	2,674	27.82	74,390.68	
	PROSUS	4,505	32.72	147,426.12	
	ZALANDO SE	648	23.39	15,156.72	
	CARREFOUR	2,101	14.03	29,477.03	
	JERONIMO MARTINS	863	18.79	16,215.77	
	KESKO OYJ-B SHS	689	16.65	11,471.85	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	2,817	28.22	79,495.74	
	DANONE (GROUPE)	1,981	57.82	114,541.42	
	JDE PEET'S BV	322	18.58	5,982.76	
	KERRY GROUP PLC-A	457	77.00	35,189.00	
	LOTUS BAKERIES	1	9,840.00	9,840.00	
	BEIERSDORF AG	341	137.85	47,006.85	
	HENKEL AG & CO KGAA	380	72.80	27,664.00	
	HENKEL AG & CO KGAA -PFD	525	81.70	42,892.50	
	LOREAL	762	400.05	304,838.10	
	EUROFINS SCIENTIFIC	429	46.69	20,030.01	
	MERCK KGAA	460	149.70	68,862.00	
	ORION OYJ-CLASS B	354	40.83	14,453.82	
	QIAGEN N.V.	703	36.91	25,947.73	
	SARTORIUS AG-VORZUG	83	230.40	19,123.20	
	BANCO DE SABADELL SA	17,286	1.84	31,892.67	
	BNP PARIBAS	3,283	61.07	200,492.81	
	COMMERZBANK AG	3,996	14.58	58,281.66	
	CREDIT AGRICOLE SA	3,742	13.38	50,086.67	
	FINECOBANK SPA	1,888	14.83	27,999.04	
	ING GROEP NV-CVA	10,393	16.55	172,066.50	
	INTESA SANPAOLO	46,473	3.55	165,118.56	
	KBC GROEP NV	872	66.58	58,057.76	
	MEDIOBANCA	1,829	14.16	25,907.78	
	DEUTSCHE BOERSE	610	186.35	113,673.50	

	EURAZEO SA	173	74.10	12,819.30	
	NEXI SPA	1,449	5.82	8,436.07	
	AGEAS	508	43.46	22,077.68	
	ASR NEDERLAND NV	504	44.72	22,538.88	
	AXA SA	5,630	31.63	178,076.90	
	GENERALI	3,503	23.50	82,320.50	
	MUENCHENER RUECKVERSICH.	429	459.50	197,125.50	
	NN GROUP NV	822	44.99	36,981.78	
	POSTE ITALIANE SPA	1,615	11.99	19,371.92	
	SAMPO OYJ-A SHS	1,434	39.12	56,098.08	
	DASSAULT SYSTEMES SA	2,343	33.69	78,935.67	
	NOKIA OYJ	16,046	3.59	57,709.43	
	CELLNEX TELECOM SA	1,446	30.79	44,522.34	
	ELISA A	400	42.72	17,088.00	
	KPN (KON.)	12,772	3.64	46,528.39	
	ENEL	25,031	6.64	166,431.11	
	IBERDROLA SA	18,369	11.74	215,652.06	
	IBERDROLA SA-RTS	18,369	0.34	6,315.26	
	REDEIA CORP SA	1,048	16.23	17,009.04	
	VERBUND AG	197	76.20	15,011.40	
	ASML HOLDING NV	1,270	982.70	1,248,029.00	
	STMICROELECTRONICS NV	2,041	38.21	77,996.81	
	LEG IMMOBILIEN SE	314	77.96	24,479.44	
ユーロ 小計		273,951		7,727,260.78 (1,349,952,458)	
イギリスポンド	ANGLO AMERICAN PLC	4,038	23.79	96,084.21	
	ANTOFAGASTA PLC	1,061	21.77	23,097.97	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	412	39.46	16,257.52	
	ENDEAVOUR MINING PLC	600	17.63	10,578.00	
	MONDI PLC	1,465	15.32	22,443.80	
	SMURFIT WESTROCK PLC	816	35.10	28,641.60	
	ASHTEAD GROUP PLC	1,493	50.30	75,097.90	
	BUNZL PLC	1,074	31.10	33,401.40	
	DCC PLC	244	56.45	13,773.80	
	SMITHS GROUP PLC	1,103	16.99	18,739.97	
	SPIRAX GROUP PLC	247	84.45	20,859.15	

	INTERTEK GROUP PLC	614	47.54	29,189.56	
	RELX PLC	5,887	35.95	211,637.65	
	RENTOKIL INITIAL PLC	8,021	4.65	37,369.83	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,612	4.91	12,830.14	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	284	47.28	13,427.52	
	BURBERRY GROUP PLC	1,289	8.57	11,051.88	
	TAYLOR WIMPEY PLC	9,184	1.50	13,840.28	
	WHITBREAD PLC	586	29.15	17,081.90	
	AUTO TRADER GROUP PLC	2,840	8.07	22,930.16	
	INFORMA PLC	4,350	8.51	37,018.50	
	WPP PLC	3,240	7.41	24,008.40	
	KINGFISHER PLC	5,110	2.57	13,148.03	
	SAINSBURY (J) PLC	4,524	2.54	11,509.05	
	TESCO PLC	21,572	3.08	66,528.04	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,302	24.37	31,729.74	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	532	27.02	14,374.64	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,395	42.47	101,715.65	
	UNILEVER PLC	7,961	43.70	347,895.70	
	ASTRAZENECA	4,926	119.44	588,361.44	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	59,993	6.69	401,653.13	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	208,150	0.57	120,393.96	
	3I GROUP PLC	3,000	29.38	88,140.00	
	M&G PLC	7,183	2.09	15,048.38	
	SCHRODERS PLC	2,334	3.67	8,575.11	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,040	25.93	26,967.20	
	AVIVA PLC	8,603	4.75	40,898.66	
	LEGAL & GENERAL GROUP	17,346	2.28	39,687.64	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	2,320	5.35	12,412.00	
	PRUDENTIAL	8,456	7.15	60,477.31	
	SAGE GROUP PLC	3,200	10.54	33,744.00	
	BT GROUP PLC	20,577	1.40	28,900.39	
	VODAFONE GROUP PLC	74,642	0.71	52,995.82	
	NATIONAL GRID PLC	15,180	9.29	141,143.64	
イギリスポンド 小計		531,806		3,035,660.67 (627,076,424)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	589	14.63	8,617.07	

	GIVAUDAN-REG	29	4,372.00	126,788.00	
	SIG GROUP AG	1,000	17.30	17,300.00	
	SIKA AG-BR	477	257.60	122,875.20	
	ABB LTD	5,270	49.94	263,183.80	
	GEBERIT AG-REG	100	536.20	53,620.00	
	VAT GROUP AG	83	515.40	42,778.20	
	SGS SA	475	80.56	38,266.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	152	256.20	38,942.40	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	6	10,950.00	65,700.00	
	ALCON INC	1,588	80.12	127,230.56	
	SONOVA HOLDING AG-REG	157	272.40	42,766.80	
	LONZA GROUP AG-REG	237	504.60	119,590.20	
	NOVARTIS	6,263	97.09	608,074.67	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	144	96.00	13,824.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	700	51.06	35,742.00	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	160.50	25,680.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	88	669.40	58,907.20	
	SWISS RE LTD	930	110.35	102,625.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	466	475.60	221,629.60	
	TEMENOS AG - REG	200	64.05	12,810.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	508	85.02	43,190.16	
	SWISSCOM	76	515.50	39,178.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	246	86.95	21,389.70	
スイスフラン 小計		19,944		2,250,709.06 (404,857,545)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	963	349.00	336,087.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	294	418.00	122,892.00	
	SCA SV CELLULOSA B	2,552	152.45	389,052.40	
	ALFA LAVAL AB	1,050	455.10	477,855.00	
	ASSA ABLOY AB-B	3,026	295.90	895,393.40	
	ATLAS COPCO A	8,406	193.40	1,625,720.40	
	ATLAS COPCO B	4,756	166.55	792,111.80	
	EPIROC AB-A	1,838	207.90	382,120.20	
	EPIROC AB-B	1,045	189.70	198,236.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,379	85.94	118,511.26	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,447	44.72	198,869.84	

	SANDVIK AB	3,167	209.70	664,119.90	
	SKF AB-B	1,022	206.30	210,838.60	
	VOLVO AB-A SHS	636	268.20	170,575.20	
	VOLVO B	5,047	263.20	1,328,370.40	
	EVOLUTION AB	590	1,118.00	659,620.00	
	HENNES & MAURITZ B	1,899	168.75	320,456.25	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,782	276.60	492,901.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	4,600	100.00	460,000.00	
	EQT AB	1,233	323.80	399,245.40	
	TELE2 AB-B SHS	1,519	102.15	155,165.85	
	TELIA CO AB	7,952	28.11	223,530.72	
スウェーデンクローナ 小計		59,203		10,621,673.32 (162,724,035)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	772	261.70	202,032.40	
	EQUINOR ASA	2,746	291.75	801,145.50	
	NORSK HYDRO	4,021	67.14	269,969.94	
	YARA INTERNATIONAL ASA	556	287.70	159,961.20	
	MOWI ASA	1,979	174.60	345,533.40	
	ORKLA	2,110	85.65	180,721.50	
	SALMAR ASA	202	570.50	115,241.00	
	DNB BANK ASA	2,602	204.50	532,109.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	604	195.60	118,142.40	
	TELENOR ASA	2,114	120.50	254,737.00	
ノルウェークローネ 小計		17,706		2,979,593.34 (45,409,002)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	1,278	428.40	547,495.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	50	2,884.00	144,200.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	2,987	160.30	478,816.10	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	8	11,400.00	91,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	18	11,680.00	210,240.00	
	DSV A/S	566	1,141.00	645,806.00	
	PANDORA A/S	231	1,020.00	235,620.00	
	COLOPLAST-B	468	850.40	397,987.20	
	GENMAB A/S	185	1,763.50	326,247.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	10,356	966.00	10,003,896.00	
	TRYG A/S	1,109	152.00	168,568.00	

	ORSTED A/S	553	389.70	215,504.10	
デンマーククローネ 小計		17,809		13,465,580.10 (315,363,885)	
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,865	28.59	167,680.35	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,217	20.17	24,546.89	
	FORTESCUE LTD	6,047	21.86	132,187.42	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,295	46.71	60,489.45	
	MINERAL RESOURCES LTD	565	56.32	31,820.80	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	4,039	12.98	52,426.22	
	ORICA LTD	1,151	17.64	20,303.64	
	PILBARA MINERALS LTD	9,000	3.01	27,090.00	
	BRAMBLES LTD	3,949	14.13	55,799.37	
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,618	26.86	43,459.48	
	AURIZON HOLDINGS LTD	4,697	3.58	16,815.26	
	TRANSURBAN GROUP	10,540	12.43	131,012.20	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,773	51.52	91,344.96	
	CAR GROUP LTD	1,138	34.19	38,908.22	
	REA GROUP LTD	218	196.86	42,915.48	
	SEEK LTD	725	19.84	14,384.00	
	COLES GROUP LTD	3,866	17.10	66,108.60	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	3,373	5.01	16,898.73	
	COCHLEAR LIMITED	213	319.77	68,111.01	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	705	46.54	32,810.70	
	CSL LIMITED	1,535	298.53	458,243.55	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	9,419	29.29	275,882.51	
	ASX LTD	680	61.65	41,922.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	1,158	202.82	234,865.56	
	QBE INSURANCE GROUP	4,340	16.93	73,476.20	
	SUNCORP GROUP LIMITED	4,460	16.76	74,749.60	
	WISETECH GLOBAL LTD	530	98.89	52,411.70	
	XERO LTD	498	135.00	67,230.00	
オーストラリアドル 小計		84,614		2,413,893.90 (262,559,239)	
ニュージーランドドル	SPARK NEW ZEALAND LTD	5,704	4.08	23,272.32	
	MERCURY NZ LTD	2,339	6.64	15,530.96	
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,004	6.60	26,426.40	

ニュージーランドドル 小計		12,047		65,229.68 (6,456,433)	
香港ドル	MTR CORP	4,000	24.75	99,000.00	
	HANG SENG BANK	2,400	99.05	237,720.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,800	240.00	912,000.00	
	AIA GROUP LTD	35,800	51.45	1,841,910.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	3,000	44.90	134,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	31,000	6.08	188,480.00	
	SINO LAND CO	10,000	7.97	79,700.00	
	SWIRE PACIFIC A	1,500	73.05	109,575.00	
香港ドル 小計		91,500		3,603,085.00 (74,511,797)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	4,300	6.57	28,251.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	4,400	32.87	144,628.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,400	9.62	23,088.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	7,800	2.64	20,592.00	
シンガポールドル 小計		18,900		216,559.00 (25,898,290)	
合　計		1,759,217		16,979,592,058 (16,979,592,058)	

(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	41,658.54	
	オーストラリアドル 小計		5,334	41,658.54 (4,531,199)	
投資信託受益証券合計			5,334	4,531,199 (4,531,199)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	1,516	297,075.36	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	1,460	27,769.20	
		BXP INC	522	31,977.72	
		CROWN CASTLE INC	1,449	140,639.94	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,033	158,358.90	
		EQUINIX INC	302	231,582.66	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,436	47,843.04	

		IRON MOUNTAIN INC	950	88,473.50	
		PROLOGIS INC	3,003	343,693.35	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	356	69,608.68	
		WELLTOWER INC	1,823	191,105.09	
	アメリカドル 小計		14,850	1,628,127.44 (263,023,987)	
	カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	550	9,295.00	
	カナダドル 小計		550	9,295.00 (1,101,364)	
	ユーロ	COVIVIO(FP)	80	3,556.80	
		GECINA SA	121	10,533.05	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	558	14,295.96	
	ユーロ 小計		759	28,385.81 (4,959,001)	
	イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	2,248	13,960.08	
		SEGRO PLC	3,574	32,387.58	
	イギリスポンド 小計		5,822	46,347.66 (9,574,036)	
	オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	5,159	179,945.92	
		GPT GROUP	4,863	19,889.67	
	オーストラリアドル 小計		10,022	199,835.59 (21,736,117)	
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	11,900	30,464.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	13,185	26,238.15	
	シンガポールドル 小計		25,085	56,702.15 (6,781,010)	
投資証券合計			57,088	307,175,515 (307,175,515)	
合計				311,706,714 (311,706,714)	

(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　292銘柄	98.0%	—	—	76.2%
	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　96銘柄	99.6%	—	—	7.8%
	投資証券　3銘柄	—	—	0.4%	0.0%
イギリスポンド	株式　44銘柄	98.5%	—	—	3.6%
	投資証券　2銘柄	—	—	1.5%	0.1%
スイスフラン	株式　24銘柄	100.0%	—	—	2.3%
スウェーデンクローナ	株式　22銘柄	100.0%	—	—	0.9%
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%	—	—	1.8%
オーストラリアドル	株式　28銘柄	90.9%	—	—	1.5%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券　2銘柄	—	—	7.5%	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%	—	—	0.4%
シンガポールドル	株式　4銘柄	79.2%	—	—	0.1%
	投資証券　2銘柄	—	—	20.8%	0.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

世界債券総合インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	686,663,023
コール・ローン	145,852,569
国債証券	62,392,550,049
地方債証券	3,582,413,507
特殊債券	14,313,579,766
社債券	31,365,455,776
投資信託受益証券	16,256,394,229
未収利息	979,303,744
前払費用	116,553,770
差入委託証拠金	74,670,000
流動資産合計	129,913,436,433
資産合計	129,913,436,433
負債の部	
流動負債	
未払金	40,856,682
未払解約金	644,571
流動負債合計	41,501,253
負債合計	41,501,253
純資産の部	
元本等	
元本	105,249,450,279
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	24,622,484,901
元本等合計	129,871,935,180
純資産合計	129,871,935,180
負債純資産合計	129,913,436,433

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)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 7月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	105,249,450,279口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2339円 (1万口当たり純資産額) (12,339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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動

	による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
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 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	43,830,208,191円
期中追加設定元本額	66,568,959,063円
期中一部解約元本額	5,149,716,975円
期末元本額	105,249,450,279円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,276,363,250円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,094,100,541円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,709,239,768円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	91,132,228,678円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,240,327,906円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	318,030,939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）	464,795,006円
ＦＯＦｓ用　世界債券総合インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,014,364,191円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	907,135,159
地方債証券	69,643,868
特殊債券	88,790,995
社債券	620,980,522
投資信託受益証券	488,238,231
合計	2,174,788,775

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	ADGB 1.625% 06/02/28	200,000.00	177,824.10	
		CANADA 0.75% 05/19/26	200,000.00	185,982.77	
		CHILE 2.55% 07/27/33	200,000.00	163,913.50	
		CHILE 2.75% 01/31/27	200,000.00	188,548.33	
		CHILE 4.34% 03/07/42	200,000.00	174,049.78	
		CHILE 4% 01/31/52	200,000.00	155,994.33	
		HKINTL 4.5% 01/11/28	200,000.00	201,034.80	
		HKINTL 4.625% 01/11/33	200,000.00	203,281.40	
		INDON 2.85% 02/14/30	200,000.00	178,263.00	
		INDON 3.35% 03/12/71	200,000.00	129,160.50	
		INDON 4.3% 03/31/52	200,000.00	167,671.00	
		INDON 4.35% 01/11/48	200,000.00	171,305.75	
		ISRAEL 4.5% 01/17/33	200,000.00	182,627.50	
		ITALY 1.25% 02/17/26	200,000.00	187,617.90	
		ITALY 3.875% 05/06/51	200,000.00	141,286.51	
		KOREA 2.5% 06/19/29	200,000.00	182,809.03	
		KSA 2.9% 10/22/25	200,000.00	194,171.25	

		KSA 3.45% 02/02/61	200,000.00	131,122.50	
		KSA 4.5% 10/26/46	200,000.00	168,247.30	
		KSA 4.875% 07/18/33	200,000.00	195,499.00	
		KSA 5% 01/18/53	200,000.00	176,642.50	
		MEX 3.25% 04/16/30	200,000.00	177,931.47	
		MEX 3.75% 04/19/71	200,000.00	122,909.64	
		MEX 4.28% 08/14/41	200,000.00	157,733.58	
		MEX 4.4% 02/12/52	200,000.00	148,392.13	
		MEX 4.75% 04/27/32	200,000.00	187,253.28	
		MEX 6.4% 05/07/54	200,000.00	193,080.90	
		PANAMA 2.252% 09/29/32	200,000.00	145,677.66	
		PANAMA 6.4% 02/14/35	200,000.00	191,455.37	
		PERU 3.3% 03/11/41	200,000.00	149,475.63	
		PHILIP 3.229% 03/29/27	200,000.00	190,546.75	
		PHILIP 4.2% 03/29/47	200,000.00	167,316.50	
		PHILIP 5.17% 10/13/27	200,000.00	200,574.90	
		PHILIP 5.5% 01/17/48	200,000.00	202,876.70	
		POLAND 5.5% 11/16/27	200,000.00	204,264.55	
		QATAR 3.75% 04/16/30	200,000.00	191,000.00	
		QATAR 4.817% 03/14/49	200,000.00	187,215.75	
		REPHUN 5.5% 03/26/36	400,000.00	386,328.00	
		T 0.25% 08/31/25	1,000,000.00	948,203.12	
		T 0.25% 09/30/25	2,000,000.00	1,890,117.18	
		T 0.25% 10/31/25	3,350,000.00	3,155,412.10	
		T 0.375% 12/31/25	1,000,000.00	937,539.06	
		T 0.5% 02/28/26	1,450,000.00	1,353,852.54	
		T 0.5% 10/31/27	1,000,000.00	882,050.78	
		T 0.625% 05/15/30	1,000,000.00	813,789.06	
		T 0.625% 07/31/26	1,400,000.00	1,292,074.22	
		T 0.625% 08/15/30	1,000,000.00	806,835.94	
		T 0.625% 11/30/27	1,200,000.00	1,060,125.00	
		T 0.625% 12/31/27	2,000,000.00	1,761,562.50	
		T 0.75% 01/31/28	1,000,000.00	882,324.22	
		T 0.75% 03/31/26	450,000.00	420,855.47	
		T 0.75% 05/31/26	1,000,000.00	930,097.66	
		T 0.75% 08/31/26	1,000,000.00	922,792.97	

		T 0.875% 09/30/26	3,000,000.00	2,769,960.93	
		T 0.875% 11/15/30	1,400,000.00	1,140,125.00	
		T 1.125% 02/15/31	1,000,000.00	823,203.12	
		T 1.125% 02/29/28	1,000,000.00	892,617.19	
		T 1.125% 05/15/40	500,000.00	310,283.20	
		T 1.125% 08/15/40	300,000.00	184,412.10	
		T 1.125% 08/31/28	1,600,000.00	1,408,968.75	
		T 1.125% 10/31/26	1,000,000.00	925,898.44	
		T 1.25% 03/31/28	1,000,000.00	894,726.56	
		T 1.25% 04/30/28	1,150,000.00	1,026,734.37	
		T 1.25% 05/15/50	400,000.00	200,132.81	
		T 1.25% 05/31/28	1,050,000.00	935,627.93	
		T 1.25% 06/30/28	1,050,000.00	933,659.18	
		T 1.25% 08/15/31	400,000.00	326,945.31	
		T 1.25% 09/30/28	1,250,000.00	1,103,979.48	
		T 1.25% 11/30/26	1,000,000.00	926,835.94	
		T 1.25% 12/31/26	2,000,000.00	1,850,585.94	
		T 1.375% 08/15/50	950,000.00	490,734.37	
		T 1.375% 10/31/28	1,600,000.00	1,418,218.75	
		T 1.375% 11/15/31	850,000.00	696,402.34	
		T 1.375% 11/15/40	300,000.00	191,033.20	
		T 1.375% 12/31/28	1,000,000.00	882,949.22	
		T 1.5% 01/31/27	1,600,000.00	1,486,124.99	
		T 1.5% 02/15/30	500,000.00	431,953.12	
		T 1.5% 08/15/26	1,000,000.00	938,671.88	
		T 1.625% 02/15/26	1,000,000.00	952,031.25	
		T 1.625% 05/15/31	2,100,000.00	1,774,541.01	
		T 1.625% 11/15/50	1,000,000.00	552,500.00	
		T 1.75% 01/31/29	2,300,000.00	2,061,689.45	
		T 1.75% 08/15/41	400,000.00	266,726.56	
		T 1.875% 02/15/32	1,000,000.00	845,781.25	
		T 1.875% 02/15/41	500,000.00	345,087.89	
		T 1.875% 02/15/51	800,000.00	471,109.37	
		T 1.875% 02/28/27	1,000,000.00	936,308.59	
		T 1.875% 02/28/29	1,000,000.00	900,097.65	
		T 1.875% 06/30/26	160,000.00	151,825.00	

		T 1.875% 11/15/51	1,300,000.00	761,083.98	
		T 1% 07/31/28	2,470,000.00	2,168,727.52	
		T 2.25% 02/15/27	1,000,000.00	946,093.75	
		T 2.25% 02/15/52	500,000.00	321,269.53	
		T 2.25% 05/15/41	260,000.00	189,642.57	
		T 2.25% 08/15/46	300,000.00	201,632.81	
		T 2.25% 08/15/49	1,100,000.00	717,363.28	
		T 2.25% 11/15/25	2,500,000.00	2,415,527.35	
		T 2.25% 11/15/27	2,800,000.00	2,617,070.31	
		T 2.375% 02/15/42	200,000.00	146,703.12	
		T 2.375% 03/31/29	1,310,000.00	1,204,509.18	
		T 2.375% 05/15/27	2,000,000.00	1,890,625.00	
		T 2.375% 05/15/29	2,000,000.00	1,836,171.88	
		T 2.375% 05/15/51	1,450,000.00	962,380.86	
		T 2.375% 11/15/49	800,000.00	535,859.37	
		T 2.5% 02/15/45	700,000.00	503,234.37	
		T 2.5% 02/15/46	800,000.00	568,250.00	
		T 2.5% 03/31/27	1,900,000.00	1,807,300.78	
		T 2.5% 05/15/46	700,000.00	496,070.31	
		T 2.625% 01/31/26	2,000,000.00	1,935,625.00	
		T 2.625% 02/15/29	1,500,000.00	1,397,226.57	
		T 2.625% 05/31/27	1,400,000.00	1,332,542.96	
		T 2.625% 07/31/29	800,000.00	741,031.24	
		T 2.75% 04/30/27	1,000,000.00	956,152.34	
		T 2.75% 05/31/29	1,620,000.00	1,512,706.63	
		T 2.75% 08/15/32	800,000.00	716,906.24	
		T 2.75% 08/15/42	200,000.00	154,906.25	
		T 2.75% 08/31/25	630,000.00	614,545.31	
		T 2.75% 11/15/42	200,000.00	154,429.68	
		T 2.875% 04/30/29	620,000.00	582,775.78	
		T 2.875% 05/15/32	800,000.00	725,828.12	
		T 2.875% 05/15/43	300,000.00	234,703.12	
		T 2.875% 05/15/49	700,000.00	521,349.61	
		T 2.875% 05/15/52	600,000.00	443,402.34	
		T 2.875% 08/15/45	820,000.00	627,460.15	
		T 2.875% 11/15/46	600,000.00	453,984.37	

		T 2% 02/15/50	1,050,000.00	643,453.12	
		T 2% 08/15/25	1,000,000.00	968,535.16	
		T 2% 08/15/51	900,000.00	545,203.12	
		T 2% 11/15/26	1,300,000.00	1,227,230.47	
		T 2% 11/15/41	350,000.00	242,463.86	
		T 3.125% 02/15/42	200,000.00	165,273.43	
		T 3.125% 02/15/43	300,000.00	244,582.03	
		T 3.125% 05/15/48	200,000.00	156,738.28	
		T 3.125% 08/15/25	2,000,000.00	1,960,820.32	
		T 3.125% 08/15/44	600,000.00	483,046.87	
		T 3.125% 08/31/27	1,000,000.00	963,242.19	
		T 3.125% 08/31/29	1,000,000.00	948,046.88	
		T 3.125% 11/15/28	1,500,000.00	1,430,742.18	
		T 3.125% 11/15/41	500,000.00	414,453.12	
		T 3.25% 05/15/42	920,000.00	771,218.75	
		T 3.25% 06/30/27	1,000,000.00	968,378.91	
		T 3.25% 06/30/29	2,000,000.00	1,909,648.44	
		T 3.375% 05/15/33	1,500,000.00	1,399,570.32	
		T 3.375% 05/15/44	300,000.00	251,683.59	
		T 3.375% 08/15/42	1,000,000.00	850,585.93	
		T 3.375% 11/15/48	150,000.00	122,756.83	
		T 3.5% 02/15/33	1,950,000.00	1,840,274.41	
		T 3.5% 02/15/39	400,000.00	362,304.68	
		T 3.5% 09/15/25	3,000,000.00	2,950,371.09	
		T 3.625% 02/15/44	600,000.00	523,523.43	
		T 3.625% 02/15/53	820,000.00	703,838.66	
		T 3.625% 03/31/30	1,000,000.00	968,203.12	
		T 3.625% 05/15/53	400,000.00	343,437.50	
		T 3.625% 08/15/43	350,000.00	306,208.98	
		T 3.75% 06/30/30	1,150,000.00	1,119,363.28	
		T 3.75% 11/15/43	700,000.00	622,972.65	
		T 3.75% 12/31/28	1,600,000.00	1,566,312.49	
		T 3.875% 02/15/43	600,000.00	546,187.50	
		T 3.875% 05/15/43	1,000,000.00	908,984.38	
		T 3.875% 08/15/33	2,470,000.00	2,391,799.39	
		T 3.875% 08/15/40	100,000.00	93,347.65	

		T 3.875% 12/31/29	250,000.00	245,317.38	
		T 3% 02/15/47	300,000.00	231,773.43	
		T 3% 02/15/48	150,000.00	115,016.60	
		T 3% 02/15/49	500,000.00	381,699.22	
		T 3% 05/15/42	100,000.00	80,816.40	
		T 3% 05/15/45	770,000.00	603,156.63	
		T 3% 05/15/47	220,000.00	169,614.84	
		T 3% 07/15/25	1,000,000.00	980,272.71	
		T 3% 08/15/48	300,000.00	229,406.25	
		T 3% 08/15/52	800,000.00	606,734.37	
		T 3% 11/15/44	750,000.00	590,214.84	
		T 3% 11/15/45	200,000.00	156,039.06	
		T 4.125% 03/31/31	2,500,000.00	2,481,640.62	
		T 4.125% 07/31/28	1,250,000.00	1,241,894.52	
		T 4.125% 08/15/53	1,490,000.00	1,399,959.75	
		T 4.125% 09/30/27	2,100,000.00	2,084,332.02	
		T 4.125% 11/15/32	1,000,000.00	989,492.19	
		T 4.25% 02/15/54	100,000.00	96,062.50	
		T 4.25% 02/28/31	1,100,000.00	1,099,806.64	
		T 4.25% 05/15/39	100,000.00	98,300.78	
		T 4.25% 10/15/25	1,100,000.00	1,091,191.40	
		T 4.25% 11/15/40	500,000.00	487,382.81	
		T 4.375% 05/15/41	230,000.00	226,999.21	
		T 4.375% 08/15/43	800,000.00	777,625.00	
		T 4.375% 11/15/39	300,000.00	298,511.71	
		T 4.375% 11/30/30	1,000,000.00	1,006,601.56	
		T 4.5% 02/15/36	550,000.00	564,158.20	
		T 4.5% 02/15/44	450,000.00	444,445.31	
		T 4.5% 04/15/27	2,000,000.00	2,003,203.12	
		T 4.5% 05/15/38	300,000.00	304,728.51	
		T 4.5% 08/15/39	300,000.00	302,730.46	
		T 4.5% 11/15/25	2,000,000.00	1,990,507.82	
		T 4.5% 11/15/33	2,300,000.00	2,335,398.42	
		T 4.625% 02/15/40	500,000.00	511,152.34	
		T 4.625% 09/30/30	1,760,000.00	1,794,753.11	
		T 4.625% 11/15/26	1,600,000.00	1,603,375.00	

		T 4.75% 02/15/41	200,000.00	206,648.43	
		T 4.75% 11/15/43	700,000.00	714,382.81	
		T 4.75% 11/15/53	1,000,000.00	1,042,656.25	
		T 4% 01/15/27	300,000.00	296,519.53	
		T 4% 02/28/30	1,500,000.00	1,480,869.13	
		T 4% 10/31/29	900,000.00	889,189.45	
		T 4% 11/15/42	1,000,000.00	928,417.97	
		T 4% 11/15/52	840,000.00	771,782.81	
		T 5.0% 05/15/37	100,000.00	106,843.75	
		UAE 4.917% 09/25/33	200,000.00	201,783.00	
		UAE 4.951% 07/07/52	200,000.00	187,758.90	
		URUGUA 4.375% 10/27/27	100,000.00	99,339.70	
		URUGUA 5.75% 10/28/34	200,000.00	209,182.72	
	アメリカドル 小計		177,310,000.00	159,436,783.39 (25,757,012,356)	
	カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	300,000.00	282,614.05	
		CAN 0.5% 09/01/25	290,000.00	278,303.70	
		CAN 0.5% 12/01/30	540,000.00	449,768.51	
		CAN 1.25% 03/01/27	200,000.00	187,959.03	
		CAN 1.25% 06/01/30	130,000.00	114,988.29	
		CAN 1.5% 06/01/26	250,000.00	239,549.36	
		CAN 1.5% 06/01/31	640,000.00	563,731.06	
		CAN 1.5% 12/01/31	390,000.00	340,312.66	
		CAN 1.75% 12/01/53	710,000.00	490,598.66	
		CAN 1% 09/01/26	300,000.00	283,092.23	
		CAN 2.25% 06/01/29	200,000.00	189,998.39	
		CAN 2.25% 12/01/29	270,000.00	255,534.06	
		CAN 2.5% 12/01/32	350,000.00	325,216.19	
		CAN 2.75% 06/01/33	40,000.00	37,774.18	
		CAN 2.75% 09/01/27	150,000.00	146,260.64	
		CAN 2.75% 12/01/48	500,000.00	443,097.58	
		CAN 2.75% 12/01/55	300,000.00	261,715.50	
		CAN 2% 06/01/28	360,000.00	340,985.97	
		CAN 2% 06/01/32	690,000.00	619,986.81	
		CAN 2% 12/01/51	490,000.00	365,134.91	
		CAN 3.25% 09/01/28	410,000.00	406,040.26	

		CAN 3.25% 12/01/33	200,000.00	196,212.13	
		CAN 3.5% 08/01/25	160,000.00	158,744.19	
		CAN 3.5% 12/01/45	330,000.00	331,375.26	
		CAN 3% 04/01/26	70,000.00	68,920.01	
		CAN 3% 06/01/34	300,000.00	287,841.30	
		CAN 3% 10/01/25	540,000.00	532,516.02	
		CAN 4.0% 06/01/41	420,000.00	446,628.60	
		CAN 4.5% 02/01/26	130,000.00	130,880.57	
		CAN 4.5% 11/01/25	470,000.00	472,024.05	
		CAN 4% 08/01/26	500,000.00	501,764.62	
		CAN 5.75% 06/01/29	150,000.00	165,783.84	
		CAN 5.75% 06/01/33	180,000.00	210,939.83	
		CAN 5% 06/01/37	680,000.00	784,555.01	
	カナダドル 小計		11,640,000.00	10,910,847.47 (1,292,826,316)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	1,300,000.00	1,305,213.00	
		MBONO 5.5% 03/04/27	3,700,000.00	3,292,741.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	4,000,000.00	3,696,634.00	
		MBONO 7.5% 05/26/33	3,700,000.00	3,168,865.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	5,850,000.00	5,458,635.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	5,950,000.00	5,303,175.50	
		MBONO 7.75% 11/13/42	4,600,000.00	3,699,044.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	2,000,000.00	1,719,660.00	
		MBONO 7% 09/03/26	4,350,000.00	4,049,632.50	
		MBONO 8.5% 03/01/29	1,000,000.00	938,370.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	7,100,000.00	6,678,260.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	2,150,000.00	1,897,826.50	
		MBONO 8% 05/24/35	700,000.00	604,408.00	
		MBONO 8% 07/31/53	3,500,000.00	2,807,070.00	
		MBONO 8% 11/07/47	4,220,000.00	3,428,328.00	
	メキシコペソ 小計		54,120,000.00	48,047,862.50 (433,680,006)	
	コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	1,300,000,000.00	1,257,242,675.00	
		COLTES 13.25% 02/09/33	1,000,000,000.00	1,138,296,270.00	
		COLTES 9.25% 05/28/42	1,200,000,000.00	998,506,608.00	
	コロンビアペソ 小計		3,500,000,000.00	3,394,045,553.00	

				(136,481,359)	
	ユーロ	BGARIA 4.125% 09/23/29	100,000.00	102,528.75	
		BGB 0.1% 06/22/30	170,000.00	144,101.35	
		BGB 0.35% 06/22/32	460,000.00	373,911.18	
		BGB 0.4% 06/22/40	90,000.00	56,843.01	
		BGB 0.65% 06/22/71	60,000.00	24,458.37	
		BGB 0.8% 06/22/27	210,000.00	197,749.59	
		BGB 0.8% 06/22/28	170,000.00	157,179.62	
		BGB 0.9% 06/22/29	200,000.00	181,904.36	
		BGB 0% 10/22/27	200,000.00	182,211.98	
		BGB 0% 10/22/31	50,000.00	40,412.50	
		BGB 1.25% 04/22/33	210,000.00	181,518.38	
		BGB 1.4% 06/22/53	110,000.00	67,059.13	
		BGB 1.45% 06/22/37	50,000.00	40,573.00	
		BGB 1.6% 06/22/47	120,000.00	83,897.28	
		BGB 1.7% 06/22/50	270,000.00	185,415.75	
		BGB 1.9% 06/22/38	130,000.00	109,178.88	
		BGB 1% 06/22/26	120,000.00	115,557.67	
		BGB 1% 06/22/31	290,000.00	254,818.65	
		BGB 2.15% 06/22/66	140,000.00	100,702.63	
		BGB 2.25% 06/22/57	80,000.00	59,517.16	
		BGB 2.7% 10/22/29	110,000.00	108,833.39	
		BGB 2.75% 04/22/39	80,000.00	74,142.92	
		BGB 2.85% 10/22/34	150,000.00	145,978.93	
		BGB 3.3% 06/22/54	100,000.00	93,785.50	
		BGB 3.45% 06/22/43	90,000.00	89,400.69	
		BGB 3.5% 06/22/55	80,000.00	77,530.88	
		BGB 3.75% 06/22/45	160,000.00	165,151.36	
		BGB 3% 06/22/33	100,000.00	99,479.87	
		BGB 3% 06/22/34	140,000.00	138,521.77	
		BGB 4.25% 03/28/41	230,000.00	252,995.17	
		BGB 4.5% 03/28/26	210,000.00	215,085.67	
		BGB 4% 03/28/32	140,000.00	149,365.51	
		BGB 5.5% 03/28/28	320,000.00	349,029.60	
		BGB 5% 03/28/35	380,000.00	441,104.38	
		BKO 2.9% 06/18/26	160,000.00	159,924.96	

		BTPS 0.25% 03/15/28	190,000.00	170,023.78	
		BTPS 0.45% 02/15/29	100,000.00	87,644.37	
		BTPS 0.5% 02/01/26	250,000.00	239,267.81	
		BTPS 0.5% 07/15/28	210,000.00	187,890.99	
		BTPS 0.6% 08/01/31	150,000.00	122,154.48	
		BTPS 0.85% 01/15/27	370,000.00	348,545.55	
		BTPS 0.9% 04/01/31	270,000.00	227,026.12	
		BTPS 0.95% 03/01/37	250,000.00	173,959.75	
		BTPS 0.95% 06/01/32	270,000.00	219,986.21	
		BTPS 0.95% 08/01/30	200,000.00	172,017.80	
		BTPS 0.95% 09/15/27	90,000.00	83,694.69	
		BTPS 0.95% 12/01/31	230,000.00	190,385.60	
		BTPS 0% 04/01/26	100,000.00	94,475.50	
		BTPS 0% 08/01/26	160,000.00	149,585.44	
		BTPS 1.1% 04/01/27	300,000.00	282,993.30	
		BTPS 1.2% 08/15/25	330,000.00	322,025.55	
		BTPS 1.25% 12/01/26	300,000.00	286,279.67	
		BTPS 1.35% 04/01/30	350,000.00	311,487.05	
		BTPS 1.45% 03/01/36	100,000.00	76,415.70	
		BTPS 1.5% 04/30/45	170,000.00	105,872.60	
		BTPS 1.6% 06/01/26	150,000.00	145,400.47	
		BTPS 1.65% 03/01/32	320,000.00	277,858.39	
		BTPS 1.65% 12/01/30	300,000.00	267,327.00	
		BTPS 1.7% 09/01/51	210,000.00	125,064.97	
		BTPS 1.8% 03/01/41	280,000.00	199,168.34	
		BTPS 1.85% 07/01/25	300,000.00	295,431.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	560,000.00	540,013.32	
		BTPS 2.1% 07/15/26	170,000.00	166,102.44	
		BTPS 2.15% 03/01/72	110,000.00	65,398.97	
		BTPS 2.15% 09/01/52	160,000.00	103,824.80	
		BTPS 2.2% 06/01/27	420,000.00	407,632.26	
		BTPS 2.25% 09/01/36	290,000.00	240,909.23	
		BTPS 2.45% 09/01/33	100,000.00	89,760.50	
		BTPS 2.45% 09/01/50	280,000.00	198,263.94	
		BTPS 2.5% 11/15/25	530,000.00	524,203.39	
		BTPS 2.5% 12/01/32	290,000.00	264,515.52	

		BTPS 2.65% 12/01/27	390,000.00	381,957.42	
		BTPS 2.7% 03/01/47	220,000.00	169,311.12	
		BTPS 2.8% 03/01/67	140,000.00	100,131.36	
		BTPS 2.8% 06/15/29	150,000.00	145,803.75	
		BTPS 2.8% 12/01/28	300,000.00	293,457.75	
		BTPS 2.95% 02/15/27	300,000.00	297,262.80	
		BTPS 2.95% 09/01/38	180,000.00	157,023.00	
		BTPS 2% 02/01/28	200,000.00	191,325.20	
		BTPS 2% 12/01/25	200,000.00	196,394.50	
		BTPS 3.1% 03/01/40	260,000.00	226,763.55	
		BTPS 3.25% 03/01/38	240,000.00	217,627.20	
		BTPS 3.25% 09/01/46	310,000.00	263,201.78	
		BTPS 3.35% 03/01/35	220,000.00	208,476.62	
		BTPS 3.4% 04/01/28	100,000.00	100,231.50	
		BTPS 3.45% 03/01/48	280,000.00	243,351.08	
		BTPS 3.5% 01/15/26	600,000.00	600,980.70	
		BTPS 3.5% 02/15/31	280,000.00	278,193.16	
		BTPS 3.5% 03/01/30	450,000.00	450,936.00	
		BTPS 3.6% 09/29/25	300,000.00	300,516.12	
		BTPS 3.7% 06/15/30	180,000.00	181,454.22	
		BTPS 3.8% 04/15/26	300,000.00	302,341.11	
		BTPS 3.8% 08/01/28	200,000.00	203,261.00	
		BTPS 3.85% 07/01/34	180,000.00	179,025.30	
		BTPS 3.85% 09/01/49	210,000.00	193,097.62	
		BTPS 3.85% 09/15/26	180,000.00	182,015.94	
		BTPS 3.85% 12/15/29	350,000.00	356,257.65	
		BTPS 3% 08/01/29	280,000.00	274,630.44	
		BTPS 4.05% 10/30/37	140,000.00	139,151.88	
		BTPS 4.1% 02/01/29	400,000.00	411,652.00	
		BTPS 4.15% 10/01/39	150,000.00	148,414.42	
		BTPS 4.2% 03/01/34	240,000.00	246,087.24	
		BTPS 4.35% 11/01/33	520,000.00	540,381.40	
		BTPS 4.4% 05/01/33	450,000.00	470,620.17	
		BTPS 4.45% 09/01/43	100,000.00	101,143.20	
		BTPS 4.5% 03/01/26	80,000.00	81,461.02	
		BTPS 4.5% 10/01/53	160,000.00	161,036.99	

		BTPS 4.75% 09/01/28	400,000.00	421,324.00	
		BTPS 4.75% 09/01/44	230,000.00	242,430.97	
		BTPS 4% 02/01/37	440,000.00	439,560.44	
		BTPS 4% 04/30/35	140,000.00	140,850.85	
		BTPS 4% 10/30/31	150,000.00	153,653.25	
		BTPS 4% 11/15/30	250,000.00	255,847.87	
		BTPS 5.0% 08/01/39	330,000.00	357,471.24	
		BTPS 5.25% 11/01/29	430,000.00	468,068.54	
		BTPS 5.75% 02/01/33	350,000.00	399,573.65	
		BTPS 5% 08/01/34	330,000.00	360,072.40	
		BTPS 5% 09/01/40	310,000.00	335,858.96	
		BTPS 6.5% 11/01/27	200,000.00	220,059.80	
		BTPS 6% 05/01/31	400,000.00	458,528.60	
		CHILE 0.555% 01/21/29	200,000.00	175,267.70	
		CHILE 1.3% 07/26/36	100,000.00	75,387.50	
		DBR 0.25% 02/15/27	700,000.00	657,624.62	
		DBR 0.25% 08/15/28	550,000.00	501,613.75	
		DBR 0.5% 08/15/27	400,000.00	374,991.09	
		DBR 0% 02/15/30	500,000.00	435,871.87	
		DBR 0% 02/15/31	890,000.00	758,150.95	
		DBR 0% 02/15/32	1,220,000.00	1,013,160.42	
		DBR 0% 08/15/29	130,000.00	114,648.62	
		DBR 0% 08/15/30	850,000.00	732,747.80	
		DBR 0% 08/15/31	350,000.00	294,588.70	
		DBR 0% 08/15/50	700,000.00	349,757.44	
		DBR 0% 08/15/52	510,000.00	242,369.07	
		DBR 0% 11/15/28	350,000.00	313,980.10	
		DBR 1.25% 08/15/48	200,000.00	148,083.10	
		DBR 1.7% 08/15/32	220,000.00	207,453.29	
		DBR 1.8% 08/15/53	730,000.00	595,062.42	
		DBR 1% 05/15/38	420,000.00	337,772.35	
		DBR 2.1% 11/15/29	830,000.00	811,890.57	
		DBR 2.2% 02/15/34	600,000.00	582,065.48	
		DBR 2.3% 02/15/33	200,000.00	196,737.16	
		DBR 2.4% 11/15/30	550,000.00	545,916.04	
		DBR 2.5% 07/04/44	770,000.00	739,047.73	

		DBR 2.5% 08/15/46	260,000.00	249,025.53	
		DBR 2.5% 08/15/54	350,000.00	333,183.28	
		DBR 2.6% 08/15/33	520,000.00	522,918.76	
		DBR 3.25% 07/04/42	340,000.00	363,088.38	
		DBR 4.0% 01/04/37	330,000.00	376,016.85	
		DBR 4.25% 07/04/39	370,000.00	438,195.51	
		DBR 4.75% 07/04/28	1,150,000.00	1,243,760.65	
		DBR 4.75% 07/04/34	750,000.00	892,919.40	
		DBR 4.75% 07/04/40	150,000.00	188,639.62	
		DBR 5.625% 01/04/28	450,000.00	494,412.52	
		FRTR 0.25% 11/25/26	490,000.00	458,912.98	
		FRTR 0.5% 05/25/26	580,000.00	552,825.12	
		FRTR 0.5% 05/25/29	800,000.00	710,738.80	
		FRTR 0.5% 05/25/40	350,000.00	224,790.12	
		FRTR 0.5% 05/25/72	200,000.00	71,974.71	
		FRTR 0.5% 06/25/44	290,000.00	166,020.36	
		FRTR 0.75% 02/25/28	600,000.00	554,550.00	
		FRTR 0.75% 05/25/28	650,000.00	597,738.05	
		FRTR 0.75% 05/25/52	320,000.00	162,012.00	
		FRTR 0.75% 05/25/53	490,000.00	241,551.62	
		FRTR 0.75% 11/25/28	940,000.00	854,795.11	
		FRTR 0% 02/25/26	400,000.00	380,191.80	
		FRTR 0% 02/25/27	600,000.00	554,590.20	
		FRTR 0% 05/25/32	400,000.00	314,821.20	
		FRTR 0% 11/25/29	800,000.00	683,120.00	
		FRTR 0% 11/25/30	840,000.00	695,239.24	
		FRTR 0% 11/25/31	630,000.00	504,543.20	
		FRTR 1.25% 05/25/34	810,000.00	676,880.14	
		FRTR 1.25% 05/25/36	660,000.00	527,630.40	
		FRTR 1.25% 05/25/38	410,000.00	312,708.80	
		FRTR 1.5% 05/25/31	800,000.00	725,265.00	
		FRTR 1.5% 05/25/50	470,000.00	305,497.18	
		FRTR 1.75% 05/25/66	190,000.00	118,486.85	
		FRTR 1.75% 06/25/39	470,000.00	379,666.70	
		FRTR 1% 05/25/27	750,000.00	708,936.93	
		FRTR 1% 11/25/25	500,000.00	485,186.50	

		FRTR 2.5% 05/25/30	830,000.00	807,951.59	
		FRTR 2.5% 05/25/43	210,000.00	179,765.04	
		FRTR 2.5% 09/24/26	840,000.00	829,484.28	
		FRTR 2.5% 09/24/27	450,000.00	442,958.04	
		FRTR 2.75% 02/25/29	620,000.00	613,006.85	
		FRTR 2.75% 10/25/27	850,000.00	842,826.42	
		FRTR 2% 05/25/48	400,000.00	299,349.00	
		FRTR 2% 11/25/32	730,000.00	670,325.78	
		FRTR 3.25% 05/25/45	320,000.00	305,879.04	
		FRTR 3.25% 05/25/55	150,000.00	137,778.82	
		FRTR 3.5% 04/25/26	710,000.00	714,666.90	
		FRTR 3.5% 11/25/33	410,000.00	419,715.93	
		FRTR 3% 05/25/33	510,000.00	503,627.55	
		FRTR 3% 05/25/54	280,000.00	246,110.90	
		FRTR 3% 06/25/49	130,000.00	117,604.17	
		FRTR 4.5% 04/25/41	510,000.00	575,392.96	
		FRTR 4.75% 04/25/35	330,000.00	373,887.69	
		FRTR 4% 04/25/55	280,000.00	297,037.63	
		FRTR 4% 04/25/60	300,000.00	321,244.80	
		FRTR 4% 10/25/38	320,000.00	341,252.80	
		FRTR 5.5% 04/25/29	490,000.00	543,451.89	
		FRTR 5.75% 10/25/32	560,000.00	665,339.36	
		GGB 2% 04/22/27	70,000.00	68,549.06	
		GGB 3.875% 06/15/28	300,000.00	308,998.50	
		GGB 4.125% 06/15/54	80,000.00	78,931.56	
		GGB 4.25% 06/15/33	300,000.00	317,770.20	
		GGB 4.375% 07/18/38	250,000.00	263,325.20	
		ICELND 0% 04/15/28	100,000.00	88,429.34	
		IRISH 0.2% 05/15/27	60,000.00	55,710.05	
		IRISH 0.2% 10/18/30	60,000.00	51,248.36	
		IRISH 0.35% 10/18/32	40,000.00	32,704.09	
		IRISH 0.4% 05/15/35	50,000.00	38,158.75	
		IRISH 0.55% 04/22/41	80,000.00	53,076.62	
		IRISH 0.9% 05/15/28	170,000.00	158,544.29	
		IRISH 0% 10/18/31	120,000.00	98,005.12	
		IRISH 1.1% 05/15/29	170,000.00	157,279.07	

		IRISH 1.3% 05/15/33	110,000.00	96,551.51	
		IRISH 1.35% 03/18/31	100,000.00	91,255.95	
		IRISH 1.5% 05/15/50	120,000.00	84,257.07	
		IRISH 1.7% 05/15/37	130,000.00	111,104.17	
		IRISH 1% 05/15/26	180,000.00	173,632.23	
		IRISH 2.4% 05/15/30	140,000.00	137,035.15	
		IRISH 2% 02/18/45	200,000.00	164,634.40	
		IRISH 3% 10/18/43	20,000.00	19,470.88	
		ISRAEL 1.5% 01/16/29	100,000.00	89,266.50	
		ISRAEL 2.5% 01/16/49	100,000.00	79,481.25	
		KSA 0.75% 07/09/27	100,000.00	92,235.03	
		MEX 2.125% 10/25/51	100,000.00	56,976.37	
		NETHER 0.25% 07/15/25	240,000.00	233,047.55	
		NETHER 0.25% 07/15/29	170,000.00	150,463.49	
		NETHER 0.5% 01/15/40	210,000.00	146,292.48	
		NETHER 0.5% 07/15/26	170,000.00	162,114.99	
		NETHER 0.5% 07/15/32	110,000.00	92,267.94	
		NETHER 0.75% 07/15/27	250,000.00	235,509.10	
		NETHER 0.75% 07/15/28	330,000.00	305,226.86	
		NETHER 0% 01/15/26	360,000.00	344,022.96	
		NETHER 0% 01/15/27	130,000.00	121,158.89	
		NETHER 0% 01/15/29	290,000.00	256,542.26	
		NETHER 0% 01/15/38	160,000.00	107,592.73	
		NETHER 0% 01/15/52	300,000.00	138,876.00	
		NETHER 0% 07/15/30	130,000.00	110,470.88	
		NETHER 0% 07/15/31	210,000.00	173,728.01	
		NETHER 2.5% 01/15/30	220,000.00	217,142.86	
		NETHER 2.5% 01/15/33	340,000.00	332,902.50	
		NETHER 2.5% 07/15/33	110,000.00	107,278.57	
		NETHER 2.5% 07/15/34	200,000.00	193,840.54	
		NETHER 2.75% 01/15/47	270,000.00	261,331.44	
		NETHER 2% 01/15/54	180,000.00	147,007.77	
		NETHER 3.25% 01/15/44	120,000.00	124,509.90	
		NETHER 3.75% 01/15/42	270,000.00	297,537.75	
		NETHER 4% 01/15/37	240,000.00	266,192.13	
		NETHER 5.5% 01/15/28	170,000.00	185,199.61	

		OBL 0% 04/16/27	400,000.00	371,662.00	
		OBL 0% 10/09/26	740,000.00	695,621.09	
		OBL 2.1% 04/12/29	270,000.00	264,456.36	
		OBL 2.4% 10/19/28	810,000.00	803,852.10	
		PGB 0.3% 10/17/31	70,000.00	58,287.04	
		PGB 0.475% 10/18/30	200,000.00	173,502.69	
		PGB 0.7% 10/15/27	100,000.00	93,621.00	
		PGB 1.15% 04/11/42	70,000.00	48,597.39	
		PGB 1.65% 07/16/32	150,000.00	136,066.27	
		PGB 1.95% 06/15/29	100,000.00	96,241.75	
		PGB 1% 04/12/52	80,000.00	43,596.00	
		PGB 2.125% 10/17/28	200,000.00	195,229.10	
		PGB 2.25% 04/18/34	100,000.00	92,857.97	
		PGB 2.875% 07/21/26	240,000.00	239,765.69	
		PGB 2.875% 10/15/25	100,000.00	99,717.25	
		PGB 2.875% 10/20/34	250,000.00	243,261.43	
		PGB 3.5% 06/18/38	100,000.00	100,904.25	
		PGB 3.625% 06/12/54	30,000.00	29,301.03	
		PGB 3.875% 02/15/30	90,000.00	94,904.65	
		PGB 4.1% 02/15/45	50,000.00	53,522.00	
		PGB 4.1% 04/15/37	120,000.00	129,550.20	
		PGB 4.125% 04/14/27	100,000.00	103,467.83	
		POLAND 2.375% 01/18/36	100,000.00	86,439.50	
		POLAND 3.875% 02/14/33	100,000.00	102,833.55	
		POLAND 4.125% 01/11/44	100,000.00	99,692.37	
		RAGB 0.25% 10/20/36	120,000.00	84,768.14	
		RAGB 0.5% 02/20/29	280,000.00	251,516.02	
		RAGB 0.5% 04/20/27	160,000.00	149,949.52	
		RAGB 0.7% 04/20/71	70,000.00	30,309.44	
		RAGB 0.75% 02/20/28	280,000.00	259,730.52	
		RAGB 0.75% 03/20/51	150,000.00	84,260.58	
		RAGB 0.75% 10/20/26	320,000.00	304,739.20	
		RAGB 0.85% 06/30/20	50,000.00	22,098.00	
		RAGB 0.9% 02/20/32	180,000.00	154,900.89	
		RAGB 0% 02/20/30	100,000.00	85,087.82	
		RAGB 0% 02/20/31	180,000.00	148,547.34	

		RAGB 0% 10/20/28	130,000.00	115,155.36	
		RAGB 0% 10/20/40	80,000.00	47,465.32	
		RAGB 1.2% 10/20/25	40,000.00	38,990.57	
		RAGB 1.5% 02/20/47	130,000.00	93,332.96	
		RAGB 1.5% 11/02/86	20,000.00	11,684.80	
		RAGB 1.85% 05/23/49	90,000.00	68,330.56	
		RAGB 2.1% 09/20/17	100,000.00	72,782.37	
		RAGB 2.4% 05/23/34	130,000.00	122,677.58	
		RAGB 2.9% 02/20/33	200,000.00	198,010.00	
		RAGB 2.9% 02/20/34	80,000.00	78,863.88	
		RAGB 2.9% 05/23/29	60,000.00	60,030.66	
		RAGB 2% 07/15/26	150,000.00	147,126.97	
		RAGB 3.15% 06/20/44	120,000.00	117,409.53	
		RAGB 3.15% 10/20/53	50,000.00	48,520.37	
		RAGB 3.45% 10/20/30	120,000.00	123,497.16	
		RAGB 3.8% 01/26/62	70,000.00	77,857.88	
		RAGB 4.15% 03/15/37	190,000.00	208,677.22	
		RAGB 4.85% 03/15/26	70,000.00	71,954.68	
		RAGB 6.25% 07/15/27	100,000.00	109,505.85	
		REPHUN 5% 02/22/27	100,000.00	103,107.50	
		RFGB 0.125% 04/15/36	50,000.00	35,195.12	
		RFGB 0.125% 04/15/52	70,000.00	31,422.05	
		RFGB 0.125% 09/15/31	130,000.00	106,457.86	
		RFGB 0.25% 09/15/40	30,000.00	18,766.98	
		RFGB 0.5% 04/15/26	40,000.00	38,285.50	
		RFGB 0.5% 04/15/43	60,000.00	37,015.92	
		RFGB 0.5% 09/15/27	70,000.00	65,028.07	
		RFGB 0.5% 09/15/28	160,000.00	145,206.00	
		RFGB 0.5% 09/15/29	50,000.00	44,301.25	
		RFGB 0.75% 04/15/31	50,000.00	43,358.75	
		RFGB 0.875% 09/15/25	140,000.00	136,223.52	
		RFGB 0% 09/15/26	70,000.00	65,622.44	
		RFGB 0% 09/15/30	100,000.00	83,718.40	
		RFGB 1.125% 04/15/34	80,000.00	67,134.64	
		RFGB 1.375% 04/15/27	50,000.00	47,962.37	
		RFGB 1.375% 04/15/47	70,000.00	49,315.81	

		RFGB 1.5% 09/15/32	90,000.00	80,336.56	
		RFGB 2.625% 07/04/42	90,000.00	82,266.75	
		RFGB 2.75% 04/15/38	80,000.00	75,601.52	
		RFGB 2.75% 07/04/28	100,000.00	99,699.87	
		RFGB 2.875% 04/15/29	40,000.00	39,983.62	
		RFGB 2.95% 04/15/55	60,000.00	56,223.36	
		RFGB 3% 09/15/33	50,000.00	49,829.65	
		RFGB 4% 07/04/25	50,000.00	50,320.17	
		ROMANI 2.125% 03/07/28	100,000.00	92,658.65	
		ROMANI 2.625% 12/02/40	100,000.00	66,207.90	
		ROMANI 2.75% 02/26/26	300,000.00	294,840.04	
		ROMANI 2.75% 04/14/41	100,000.00	66,482.50	
		ROMANI 2% 01/28/32	100,000.00	79,046.08	
		ROMANI 2% 04/14/33	100,000.00	76,192.50	
		ROMANI 3.624% 05/26/30	100,000.00	92,634.00	
		ROMANI 3.875% 10/29/35	100,000.00	85,582.37	
		ROMANI 5% 09/27/26	100,000.00	102,230.62	
		ROMANI 6.375% 09/18/33	100,000.00	105,147.50	
		SPGB 0.1% 04/30/31	260,000.00	213,198.96	
		SPGB 0.5% 04/30/30	350,000.00	303,739.71	
		SPGB 0.5% 10/31/31	670,000.00	557,519.56	
		SPGB 0.6% 10/31/29	400,000.00	353,482.70	
		SPGB 0.7% 04/30/32	370,000.00	308,340.61	
		SPGB 0.8% 07/30/27	300,000.00	280,881.45	
		SPGB 0.8% 07/30/29	350,000.00	314,160.00	
		SPGB 0.85% 07/30/37	200,000.00	144,297.00	
		SPGB 0% 01/31/26	330,000.00	314,473.50	
		SPGB 0% 01/31/27	230,000.00	212,978.73	
		SPGB 0% 01/31/28	400,000.00	360,098.00	
		SPGB 1.2% 10/31/40	270,000.00	188,210.25	
		SPGB 1.25% 10/31/30	300,000.00	269,291.40	
		SPGB 1.3% 10/31/26	300,000.00	288,634.95	
		SPGB 1.4% 04/30/28	260,000.00	245,420.89	
		SPGB 1.4% 07/30/28	600,000.00	564,442.49	
		SPGB 1.45% 04/30/29	320,000.00	298,406.40	
		SPGB 1.45% 10/31/27	280,000.00	266,595.70	

		SPGB 1.45% 10/31/71	160,000.00	77,494.19	
		SPGB 1.5% 04/30/27	510,000.00	489,490.98	
		SPGB 1.85% 07/30/35	410,000.00	352,489.30	
		SPGB 1.9% 10/31/52	310,000.00	205,951.60	
		SPGB 1.95% 04/30/26	290,000.00	284,234.80	
		SPGB 1.95% 07/30/30	430,000.00	404,804.25	
		SPGB 1% 07/30/42	200,000.00	129,496.00	
		SPGB 1% 10/31/50	330,000.00	177,815.88	
		SPGB 2.15% 10/31/25	360,000.00	355,164.66	
		SPGB 2.35% 07/30/33	350,000.00	325,866.80	
		SPGB 2.5% 05/31/27	130,000.00	128,056.50	
		SPGB 2.55% 10/31/32	300,000.00	286,247.25	
		SPGB 2.7% 10/31/48	270,000.00	222,663.73	
		SPGB 2.8% 05/31/26	530,000.00	526,906.92	
		SPGB 2.9% 10/31/46	270,000.00	234,043.96	
		SPGB 3.15% 04/30/33	350,000.00	347,787.38	
		SPGB 3.25% 04/30/34	280,000.00	278,428.92	
		SPGB 3.45% 07/30/43	210,000.00	200,323.83	
		SPGB 3.45% 07/30/66	200,000.00	179,578.08	
		SPGB 3.5% 05/31/29	410,000.00	418,971.41	
		SPGB 3.55% 10/31/33	230,000.00	234,945.62	
		SPGB 3.9% 07/30/39	240,000.00	246,630.00	
		SPGB 4.2% 01/31/37	310,000.00	332,420.75	
		SPGB 4.65% 07/30/25	350,000.00	354,606.87	
		SPGB 4.7% 07/30/41	250,000.00	281,461.50	
		SPGB 4.9% 07/30/40	270,000.00	309,322.80	
		SPGB 4% 10/31/54	90,000.00	90,719.21	
		SPGB 5.15% 10/31/28	580,000.00	630,255.37	
		SPGB 5.15% 10/31/44	190,000.00	226,639.31	
		SPGB 5.75% 07/30/32	300,000.00	354,864.00	
		SPGB 5.9% 07/30/26	210,000.00	221,557.64	
	ユーロ 小計		104,560,000.00	96,382,869.12 (16,838,087,235)	
	イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	250,000.00	235,162.50	
		UKT 0.125% 01/31/28	430,000.00	374,826.70	
		UKT 0.25% 07/31/31	430,000.00	331,788.00	

		UKT 0.375% 10/22/26	250,000.00	229,108.75	
		UKT 0.375% 10/22/30	560,000.00	449,148.00	
		UKT 0.5% 01/31/29	520,000.00	444,762.24	
		UKT 0.5% 10/22/61	290,000.00	86,486.70	
		UKT 0.625% 07/31/35	280,000.00	191,716.00	
		UKT 0.625% 10/22/50	440,000.00	175,824.00	
		UKT 0.875% 01/31/46	150,000.00	74,016.63	
		UKT 0.875% 07/31/33	360,000.00	272,188.80	
		UKT 0.875% 10/22/29	280,000.00	239,500.80	
		UKT 1.125% 01/31/39	410,000.00	265,598.00	
		UKT 1.125% 10/22/73	210,000.00	75,516.00	
		UKT 1.25% 07/22/27	660,000.00	606,859.44	
		UKT 1.25% 07/31/51	320,000.00	154,464.00	
		UKT 1.25% 10/22/41	260,000.00	158,878.59	
		UKT 1.5% 07/22/26	310,000.00	293,431.33	
		UKT 1.5% 07/22/47	420,000.00	234,654.00	
		UKT 1.5% 07/31/53	270,000.00	135,999.00	
		UKT 1.625% 10/22/28	450,000.00	408,862.35	
		UKT 1.625% 10/22/54	380,000.00	196,004.00	
		UKT 1.625% 10/22/71	330,000.00	149,424.00	
		UKT 1.75% 01/22/49	370,000.00	214,526.00	
		UKT 1.75% 07/22/57	340,000.00	178,045.86	
		UKT 1.75% 09/07/37	600,000.00	445,920.00	
		UKT 1% 01/31/32	470,000.00	377,555.70	
		UKT 2.5% 07/22/65	330,000.00	206,019.00	
		UKT 2% 09/07/25	830,000.00	806,043.12	
		UKT 3.25% 01/22/44	340,000.00	280,670.00	
		UKT 3.25% 01/31/33	400,000.00	375,400.00	
		UKT 3.5% 01/22/45	470,000.00	399,876.00	
		UKT 3.5% 07/22/68	290,000.00	233,682.00	
		UKT 3.5% 10/22/25	660,000.00	650,270.61	
		UKT 3.75% 01/29/38	300,000.00	280,740.00	
		UKT 3.75% 03/07/27	190,000.00	186,973.30	
		UKT 3.75% 07/22/52	370,000.00	318,385.00	
		UKT 3.75% 10/22/53	350,000.00	299,110.00	
		UKT 4.125% 01/29/27	380,000.00	377,910.00	

		UKT 4.25% 03/07/36	580,000.00	579,130.00	
		UKT 4.25% 06/07/32	510,000.00	517,629.60	
		UKT 4.25% 09/07/39	510,000.00	498,066.00	
		UKT 4.25% 12/07/27	370,000.00	371,892.55	
		UKT 4.25% 12/07/40	400,000.00	387,760.00	
		UKT 4.25% 12/07/46	420,000.00	396,606.00	
		UKT 4.25% 12/07/49	270,000.00	253,665.00	
		UKT 4.25% 12/07/55	410,000.00	383,318.84	
		UKT 4.375% 07/31/54	180,000.00	171,414.00	
		UKT 4.5% 06/07/28	320,000.00	323,987.20	
		UKT 4.5% 09/07/34	670,000.00	686,616.00	
		UKT 4.5% 12/07/42	450,000.00	445,815.00	
		UKT 4.625% 01/31/34	450,000.00	466,092.00	
		UKT 4.75% 10/22/43	70,000.00	71,232.00	
		UKT 4.75% 12/07/30	600,000.00	625,050.00	
		UKT 4.75% 12/07/38	290,000.00	300,411.00	
		UKT 4% 01/22/60	390,000.00	349,206.00	
		UKT 4% 10/22/31	220,000.00	218,799.24	
		UKT 4% 10/22/63	180,000.00	160,506.00	
		UKT 6.0% 12/07/28	470,000.00	507,670.87	
	イギリスポンド 小計		22,710,000.00	19,130,213.72 (3,951,728,248)	
	スイスフラン	SWISS 0.25% 06/23/35	180,000.00	173,304.85	
		SWISS 0.5% 05/24/55	50,000.00	48,807.80	
		SWISS 0.5% 05/27/30	350,000.00	346,619.70	
		SWISS 0.5% 05/30/58	40,000.00	39,348.22	
		SWISS 0.5% 06/27/32	190,000.00	187,931.28	
		SWISS 0.5% 06/28/45	130,000.00	126,679.67	
		SWISS 0.875% 05/22/47	50,000.00	52,673.37	
		SWISS 0% 06/22/29	300,000.00	289,945.50	
		SWISS 0% 06/26/34	80,000.00	75,216.32	
		SWISS 0% 07/24/39	100,000.00	91,030.15	
		SWISS 1.25% 05/28/26	430,000.00	433,697.78	
		SWISS 1.25% 06/27/37	60,000.00	64,804.75	
		SWISS 1.5% 04/30/42	180,000.00	206,439.30	
		SWISS 1.5% 07/24/25	210,000.00	211,266.61	

		SWISS 1.5% 10/26/38	130,000.00	145,478.19	
		SWISS 2.25% 06/22/31	320,000.00	354,446.72	
		SWISS 2.5% 03/08/36	160,000.00	194,185.23	
		SWISS 2% 06/25/64	50,000.00	77,458.33	
		SWISS 3.25% 06/27/27	180,000.00	193,251.42	
		SWISS 3.5% 04/08/33	250,000.00	311,328.75	
		SWISS 4% 01/06/49	20,000.00	35,298.03	
		SWISS 4% 04/08/28	550,000.00	616,317.35	
	スイスフラン 小計		4,010,000.00	4,275,529.32 (769,082,214)	
	スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	1,870,000.00	1,625,647.10	
		SGB 0.75% 05/12/28	790,000.00	746,259.93	
		SGB 0.75% 11/12/29	3,030,000.00	2,831,110.94	
		SGB 1.75% 11/11/33	370,000.00	355,198.07	
		SGB 1% 11/12/26	1,120,000.00	1,083,519.71	
		SGB 2.25% 06/01/32	650,000.00	650,769.73	
		SGB 3.5% 03/30/39	980,000.00	1,118,748.40	
	スウェーデンクローナ 小計		8,810,000.00	8,411,253.88 (128,860,409)	
	ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	500,000.00	422,681.25	
		NGB 1.375% 08/19/30	870,000.00	758,370.90	
		NGB 1.5% 02/19/26	1,050,000.00	1,007,939.62	
		NGB 1.75% 02/17/27	1,260,000.00	1,194,621.75	
		NGB 1.75% 09/06/29	750,000.00	679,933.57	
		NGB 2.125% 05/18/32	450,000.00	401,297.17	
		NGB 2% 04/26/28	1,360,000.00	1,275,612.00	
		NGB 3.5% 10/06/42	610,000.00	600,130.81	
		NGB 3.625% 04/13/34	370,000.00	367,077.00	
		NGB 3% 08/15/33	1,310,000.00	1,237,135.69	
	ノルウェークローネ 小計		8,530,000.00	7,944,799.76 (121,078,748)	
	デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	1,000,000.00	524,210.00	
		DGB 0.5% 11/15/27	2,560,000.00	2,393,556.22	
		DGB 0.5% 11/15/29	500,000.00	451,682.13	
		DGB 0% 11/15/31	1,170,000.00	980,391.23	
		DGB 1.75% 11/15/25	4,800,000.00	4,727,591.34	

		DGB 2.25% 11/15/33	760,000.00	743,810.42	
		DGB 4.5% 11/15/39	1,550,000.00	1,891,005.72	
	デンマーククローネ 小計		12,340,000.00	11,712,247.06 (274,300,826)	
	チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	2,400,000.00	2,186,887.20	
		CZGB 0.95% 05/15/30	4,500,000.00	3,809,938.50	
		CZGB 1.2% 03/13/31	1,550,000.00	1,304,259.12	
		CZGB 1.5% 04/24/40	1,000,000.00	690,725.00	
		CZGB 1.75% 06/23/32	2,400,000.00	2,037,096.00	
		CZGB 1.95% 07/30/37	1,400,000.00	1,089,445.00	
		CZGB 1% 06/26/26	900,000.00	850,818.60	
		CZGB 2.4% 09/17/25	1,500,000.00	1,472,700.75	
		CZGB 2.5% 08/25/28	1,500,000.00	1,422,311.25	
		CZGB 2.75% 07/23/29	1,400,000.00	1,328,150.60	
		CZGB 2% 10/13/33	3,300,000.00	2,787,633.75	
		CZGB 4.2% 12/04/36	800,000.00	803,736.80	
		CZGB 4.5% 11/11/32	550,000.00	567,108.41	
		CZGB 4.85% 11/26/57	500,000.00	535,087.50	
		CZGB 4.9% 04/14/34	1,300,000.00	1,382,784.00	
		CZGB 5.5% 12/12/28	1,800,000.00	1,917,355.50	
		CZGB 5.75% 03/29/29	2,000,000.00	2,159,225.00	
		CZGB 5% 09/30/30	1,000,000.00	1,058,670.00	
		CZGB 6% 02/26/26	2,700,000.00	2,790,065.25	
	チェココルナ 小計		32,500,000.00	30,193,998.23 (208,658,644)	
	ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 04/22/26	16,000,000.00	14,675,191.20	
		HGB 1.5% 08/26/26	28,000,000.00	25,269,843.20	
		HGB 1% 11/26/25	10,000,000.00	9,302,263.00	
		HGB 2.25% 04/20/33	10,000,000.00	7,103,429.00	
		HGB 2.25% 06/22/34	8,000,000.00	5,455,734.00	
		HGB 2.75% 12/22/26	10,000,000.00	9,155,175.00	
		HGB 2% 05/23/29	15,000,000.00	12,178,160.55	
		HGB 3.25% 10/22/31	23,000,000.00	18,554,278.25	
		HGB 3% 04/25/41	8,000,000.00	5,038,956.00	
		HGB 3% 08/21/30	25,000,000.00	20,494,812.50	
		HGB 3% 10/27/27	26,000,000.00	23,274,361.50	

		HGB 3% 10/27/38	20,000,000.00	13,252,777.40	
		HGB 4.5% 03/23/28	15,000,000.00	13,966,005.00	
		HGB 4.5% 05/27/32	19,000,000.00	16,436,900.00	
		HGB 4.75% 11/24/32	12,000,000.00	10,507,110.00	
		HGB 6.75% 10/22/28	11,000,000.00	11,036,587.10	
		HGB 9.5% 10/21/26	13,000,000.00	13,772,564.00	
	ハンガリーフォリント 小計		269,000,000.00	229,474,147.70 (101,673,799)	
	ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	680,000.00	608,390.90	
		POLGB 0% 10/25/25	490,000.00	460,908.56	
		POLGB 1.25% 10/25/30	330,000.00	255,707.92	
		POLGB 1.75% 04/25/32	480,000.00	364,004.52	
		POLGB 2.5% 07/25/26	750,000.00	711,600.00	
		POLGB 2.5% 07/25/27	730,000.00	672,328.17	
		POLGB 2.75% 04/25/28	300,000.00	272,977.42	
		POLGB 2.75% 10/25/29	1,550,000.00	1,354,219.50	
		POLGB 3.25% 07/25/25	370,000.00	364,568.40	
		POLGB 3.75% 05/25/27	390,000.00	373,540.05	
		POLGB 5.75% 04/25/29	550,000.00	553,145.17	
		POLGB 5% 10/25/34	130,000.00	123,058.52	
		POLGB 6% 10/25/33	910,000.00	928,413.38	
		POLGB 7.5% 07/25/28	700,000.00	748,937.84	
	ポーランドズロチ 小計		8,360,000.00	7,791,800.35 (319,757,565)	
	オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	450,000.00	426,047.58	
		ACGB 0.5% 09/21/26	730,000.00	674,609.54	
		ACGB 1.25% 05/21/32	700,000.00	559,747.83	
		ACGB 1.5% 06/21/31	700,000.00	586,471.78	
		ACGB 1.75% 06/21/51	220,000.00	119,978.41	
		ACGB 1.75% 11/21/32	400,000.00	328,807.20	
		ACGB 1% 11/21/31	500,000.00	398,313.25	
		ACGB 1% 12/21/30	400,000.00	328,614.41	
		ACGB 2.25% 05/21/28	500,000.00	467,438.20	
		ACGB 2.5% 05/21/30	640,000.00	585,405.70	
		ACGB 2.75% 05/21/41	140,000.00	109,274.59	
		ACGB 2.75% 06/21/35	390,000.00	335,077.45	

		ACGB 2.75% 11/21/27	300,000.00	287,463.55	
		ACGB 2.75% 11/21/28	640,000.00	606,070.34	
		ACGB 2.75% 11/21/29	550,000.00	513,950.43	
		ACGB 3.25% 04/21/29	460,000.00	443,019.53	
		ACGB 3.25% 06/21/39	120,000.00	103,242.77	
		ACGB 3.5% 12/21/34	210,000.00	194,888.53	
		ACGB 3.75% 04/21/37	280,000.00	261,150.54	
		ACGB 3.75% 05/21/34	200,000.00	190,564.89	
		ACGB 3% 03/21/47	190,000.00	144,213.14	
		ACGB 3% 11/21/33	270,000.00	242,558.23	
		ACGB 4.25% 04/21/26	520,000.00	520,419.90	
		ACGB 4.5% 04/21/33	340,000.00	344,600.54	
		ACGB 4.75% 04/21/27	360,000.00	365,985.79	
		ACGB 4.75% 06/21/54	100,000.00	100,196.22	
	オーストラリアドル 小計		10,310,000.00	9,238,110.34 (1,004,829,261)	
	ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	290,000.00	247,204.43	
		NZGB 0.5% 05/15/26	330,000.00	305,483.06	
		NZGB 1.5% 05/15/31	140,000.00	115,329.57	
		NZGB 1.75% 05/15/41	110,000.00	70,255.77	
		NZGB 2.75% 04/15/37	130,000.00	104,946.88	
		NZGB 2.75% 05/15/51	90,000.00	60,611.27	
		NZGB 2% 05/15/32	250,000.00	207,934.48	
		NZGB 3.5% 04/14/33	190,000.00	175,064.25	
		NZGB 3% 04/20/29	110,000.00	103,232.87	
		NZGB 4.25% 05/15/34	50,000.00	48,517.47	
		NZGB 4.5% 04/15/27	390,000.00	389,355.18	
		NZGB 4.5% 05/15/30	260,000.00	260,202.64	
		NZGB 4.5% 05/15/35	80,000.00	78,830.04	
		NZGB 5% 05/15/54	60,000.00	60,165.40	
	ニュージーランドドル 小計		2,480,000.00	2,227,133.31 (220,441,655)	
	シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	150,000.00	144,225.00	
		SIGB 1.25% 11/01/26	150,000.00	143,164.50	
		SIGB 1.625% 07/01/31	120,000.00	108,240.00	
		SIGB 1.875% 03/01/50	110,000.00	87,285.00	

		SIGB 1.875% 10/01/51	120,000.00	94,379.40	
		SIGB 2.125% 06/01/26	230,000.00	224,687.00	
		SIGB 2.25% 08/01/36	220,000.00	199,210.00	
		SIGB 2.375% 07/01/39	60,000.00	54,113.70	
		SIGB 2.625% 05/01/28	180,000.00	176,112.00	
		SIGB 2.625% 08/01/32	60,000.00	57,492.00	
		SIGB 2.75% 03/01/46	120,000.00	113,639.40	
		SIGB 2.75% 04/01/42	160,000.00	151,280.00	
		SIGB 2.875% 07/01/29	120,000.00	118,272.00	
		SIGB 2.875% 08/01/28	50,000.00	49,375.00	
		SIGB 2.875% 09/01/27	130,000.00	128,531.00	
		SIGB 2.875% 09/01/30	200,000.00	196,400.00	
		SIGB 3.375% 09/01/33	140,000.00	141,890.00	
		SIGB 3.5% 03/01/27	180,000.00	181,044.00	
		SIGB 3% 04/01/29	40,000.00	39,680.80	
		SIGB 3% 08/01/72	60,000.00	59,670.00	
	シンガポールドル 小計		2,600,000.00	2,468,690.80 (295,230,732)	
	マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	820,000.00	764,473.70	
		MGS 3.502% 05/31/27	450,000.00	450,074.25	
		MGS 3.582% 07/15/32	600,000.00	589,309.80	
		MGS 3.733% 06/15/28	880,000.00	884,551.18	
		MGS 3.757% 05/22/40	890,000.00	858,625.52	
		MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	249,156.30	
		MGS 3.844% 04/15/33	630,000.00	628,968.70	
		MGS 3.885% 08/15/29	300,000.00	303,489.00	
		MGS 3.899% 11/16/27	1,050,000.00	1,062,302.11	
		MGS 3.9% 11/30/26	430,000.00	434,710.43	
		MGS 3.906% 07/15/26	420,000.00	424,053.04	
		MGS 3.955% 09/15/25	700,000.00	705,390.00	
		MGS 4.065% 06/15/50	1,000,000.00	975,953.77	
		MGS 4.232% 06/30/31	200,000.00	205,310.48	
		MGS 4.254% 05/31/35	690,000.00	708,918.62	
		MGS 4.392% 04/15/26	600,000.00	610,320.00	
		MGS 4.457% 03/31/53	380,000.00	394,890.30	
		MGS 4.498% 04/15/30	780,000.00	810,830.51	

		MGS 4.504% 04/30/29	850,000.00	882,202.76	
		MGS 4.642% 11/07/33	400,000.00	424,526.00	
		MGS 4.696% 10/15/42	960,000.00	1,032,452.25	
		MGS 4.736% 03/15/46	240,000.00	258,858.64	
		MGS 4.762% 04/07/37	690,000.00	743,646.94	
		MGS 4.893% 06/08/38	540,000.00	591,223.86	
		MGS 4.921% 07/06/48	220,000.00	243,754.56	
	マレーシアリンギット 小計		14,970,000.00	15,237,992.72 (522,673,816)	
	タイバーツ	THAIGB 1.585% 12/17/35	6,800,000.00	6,051,251.38	
		THAIGB 1.6% 06/17/35	4,000,000.00	3,582,109.20	
		THAIGB 1.6% 12/17/29	8,000,000.00	7,661,211.76	
		THAIGB 1% 06/17/27	4,700,000.00	4,521,920.57	
		THAIGB 2.125% 12/17/26	5,000,000.00	4,972,996.60	
		THAIGB 2.25% 03/17/27	5,500,000.00	5,486,914.73	
		THAIGB 2.35% 06/17/26	9,500,000.00	9,504,985.60	
		THAIGB 2.4% 03/17/29	3,000,000.00	2,998,069.56	
		THAIGB 2.5% 06/17/71	3,000,000.00	2,069,509.80	
		THAIGB 2.65% 06/17/28	4,000,000.00	4,044,965.60	
		THAIGB 2.75% 06/17/52	2,200,000.00	1,938,904.46	
		THAIGB 2.875% 06/17/46	4,600,000.00	4,242,720.43	
		THAIGB 2.875% 12/17/28	3,500,000.00	3,572,350.25	
		THAIGB 2% 06/17/42	5,000,000.00	4,242,604.60	
		THAIGB 2% 12/17/31	5,000,000.00	4,809,691.85	
		THAIGB 3.3% 06/17/38	3,000,000.00	3,137,286.90	
		THAIGB 3.35% 06/17/33	7,500,000.00	7,920,965.25	
		THAIGB 3.39% 06/17/37	6,400,000.00	6,792,531.84	
		THAIGB 3.45% 06/17/43	700,000.00	724,664.78	
		THAIGB 3.6% 06/17/67	7,300,000.00	6,950,797.56	
		THAIGB 3.8% 06/14/41	2,000,000.00	2,176,455.20	
		THAIGB 4% 06/17/55	2,000,000.00	2,189,390.20	
	タイバーツ 小計		102,700,000.00	99,592,298.12 (441,193,880)	
	インドネシアルピア	INDOGB 5.125% 04/15/27	7,400,000,000.00	7,118,458,934.00	
		INDOGB 5.5% 04/15/26	3,200,000,000.00	3,137,609,088.00	
		INDOGB 6.25% 06/15/36	2,000,000,000.00	1,871,700,000.00	

		INDOGB 6.375% 04/15/32	5,000,000,000.00	4,810,000,000.00	
		INDOGB 6.375% 08/15/28	5,300,000,000.00	5,213,398,000.00	
		INDOGB 6.5% 02/15/31	2,000,000,000.00	1,948,014,860.00	
		INDOGB 6.625% 02/15/34	3,500,000,000.00	3,409,945,000.00	
		INDOGB 6.875% 04/15/29	2,000,000,000.00	2,000,940,000.00	
		INDOGB 6.875% 08/15/51	1,000,000,000.00	968,964,200.00	
		INDOGB 7.125% 06/15/38	3,000,000,000.00	3,022,395,000.00	
		INDOGB 7.125% 06/15/42	3,000,000,000.00	2,997,837,390.00	
		INDOGB 7.125% 06/15/43	2,000,000,000.00	2,006,660,000.00	
		INDOGB 7.25% 02/15/26	2,000,000,000.00	2,018,100,000.00	
		INDOGB 7.375% 05/15/48	4,000,000,000.00	4,107,000,000.00	
		INDOGB 7.5% 04/15/40	1,000,000,000.00	1,039,806,200.00	
		INDOGB 7.5% 05/15/38	2,000,000,000.00	2,069,212,000.00	
		INDOGB 7% 02/15/33	5,500,000,000.00	5,496,150,000.00	
		INDOGB 7% 09/15/30	3,500,000,000.00	3,513,207,250.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/29	2,500,000,000.00	2,634,543,500.00	
		INDOGB 8.375% 04/15/39	1,100,000,000.00	1,230,916,830.00	
	インドネシアルピア 小計		61,000,000,000.00	60,614,858,252.00 (606,148,582)	
	韓国ウォン	KTB 1.375% 12/10/29	400,000,000.00	365,160,284.00	
		KTB 1.5% 03/10/50	300,000,000.00	214,602,225.00	
		KTB 1.5% 09/10/36	600,000,000.00	499,269,300.00	
		KTB 1.5% 09/10/40	200,000,000.00	158,056,130.00	
		KTB 1.5% 12/10/30	800,000,000.00	724,011,216.00	
		KTB 1.875% 06/10/29	500,000,000.00	471,571,300.00	
		KTB 1.875% 09/10/41	300,000,000.00	249,011,583.00	
		KTB 2.125% 03/10/47	200,000,000.00	167,298,116.00	
		KTB 2.25% 09/10/37	200,000,000.00	180,267,844.00	
		KTB 2.375% 03/10/27	900,000,000.00	882,959,580.00	
		KTB 2.375% 12/10/27	400,000,000.00	390,474,212.00	
		KTB 2.5% 03/10/52	300,000,000.00	266,338,929.00	
		KTB 2.625% 03/10/48	200,000,000.00	183,131,034.00	
		KTB 2.75% 12/10/44	200,000,000.00	187,951,556.00	
		KTB 2% 03/10/46	300,000,000.00	246,338,496.00	
		KTB 2% 03/10/49	300,000,000.00	242,211,288.00	
		KTB 2% 06/10/31	400,000,000.00	371,575,800.00	

		KTB 3.125% 06/10/26	800,000,000.00	799,616,232.00	
		KTB 3.25% 03/10/28	700,000,000.00	703,175,900.00	
		KTB 3.25% 03/10/53	1,500,000,000.00	1,542,147,750.00	
		KTB 3.25% 06/10/33	900,000,000.00	905,572,440.00	
		KTB 3.25% 09/10/42	600,000,000.00	607,061,700.00	
		KTB 3.375% 06/10/32	800,000,000.00	812,004,160.00	
		KTB 3.5% 06/10/34	300,000,000.00	308,105,610.00	
		KTB 3.5% 09/10/28	400,000,000.00	405,841,200.00	
		KTB 3.625% 09/10/53	600,000,000.00	660,405,240.00	
		KTB 3.75% 12/10/33	400,000,000.00	418,594,920.00	
		KTB 4.25% 12/10/25	1,400,000,000.00	1,420,704,040.00	
	韓国ウォン 小計		14,900,000,000.00	14,383,458,085.00 (1,678,549,558)	
	イスラエルシェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	450,000.00	423,288.81	
		ILGOV 1.3% 04/30/32	340,000.00	264,000.20	
		ILGOV 1.5% 05/31/37	480,000.00	320,162.97	
		ILGOV 1.75% 08/31/25	370,000.00	360,156.21	
		ILGOV 1% 03/31/30	630,000.00	516,148.22	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	250,000.00	228,145.37	
		ILGOV 2.8% 11/29/52	300,000.00	187,782.95	
		ILGOV 2% 03/31/27	550,000.00	516,623.69	
		ILGOV 3.75% 02/28/29	220,000.00	212,209.44	
		ILGOV 3.75% 03/31/47	340,000.00	270,154.92	
		ILGOV 3.75% 09/30/27	50,000.00	48,908.77	
		ILGOV 4% 03/30/35	100,000.00	92,578.15	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	270,000.00	279,366.21	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	100,000.00	104,082.81	
	イスラエルシェケル 小計		4,450,000.00	3,823,608.72 (167,629,682)	
	オフショア人民元	CGB 1.67% 06/15/26	13,000,000.00	13,007,930.00	
		CGB 1.85% 05/15/27	1,200,000.00	1,203,024.00	
		CGB 2.18% 08/15/26	7,000,000.00	7,068,606.30	
		CGB 2.18% 08/25/25	5,000,000.00	5,034,027.50	
		CGB 2.22% 09/25/25	11,000,000.00	11,084,053.20	
		CGB 2.28% 11/25/25	5,000,000.00	5,047,210.50	
		CGB 2.37% 01/20/27	11,000,000.00	11,172,201.70	

		CGB 2.4% 07/15/28	5,200,000.00	5,298,078.76	
		CGB 2.44% 10/15/27	5,500,000.00	5,604,392.20	
		CGB 2.46% 02/15/26	12,000,000.00	12,150,048.00	
		CGB 2.48% 09/25/28	12,500,000.00	12,785,012.50	
		CGB 2.5% 07/25/27	3,500,000.00	3,573,706.50	
		CGB 2.52% 08/25/33	15,000,000.00	15,282,502.50	
		CGB 2.54% 12/25/30	6,800,000.00	6,971,371.56	
		CGB 2.62% 04/15/28	6,100,000.00	6,264,758.56	
		CGB 2.62% 06/25/30	4,400,000.00	4,530,078.52	
		CGB 2.62% 09/25/29	9,000,000.00	9,284,496.30	
		CGB 2.64% 01/15/28	4,200,000.00	4,315,129.14	
		CGB 2.67% 05/25/33	15,000,000.00	15,477,934.50	
		CGB 2.67% 11/25/33	7,000,000.00	7,220,740.80	
		CGB 2.68% 05/21/30	3,000,000.00	3,097,734.00	
		CGB 2.69% 08/12/26	7,000,000.00	7,146,579.30	
		CGB 2.69% 08/15/32	5,000,000.00	5,170,856.00	
		CGB 2.75% 02/17/32	3,000,000.00	3,117,552.30	
		CGB 2.75% 06/15/29	10,500,000.00	10,889,847.15	
		CGB 2.76% 05/15/32	7,300,000.00	7,594,723.63	
		CGB 2.79% 12/15/29	6,000,000.00	6,241,615.80	
		CGB 2.8% 03/24/29	5,000,000.00	5,188,288.50	
		CGB 2.8% 11/15/32	5,000,000.00	5,216,012.50	
		CGB 2.85% 06/04/27	2,200,000.00	2,270,735.50	
		CGB 2.88% 02/25/33	6,700,000.00	7,033,249.96	
		CGB 2.91% 10/14/28	4,400,000.00	4,581,802.72	
		CGB 3.01% 05/13/28	6,600,000.00	6,894,510.48	
		CGB 3.02% 05/27/31	3,000,000.00	3,160,972.50	
		CGB 3.02% 10/22/25	2,500,000.00	2,547,443.50	
		CGB 3.12% 10/25/52	3,200,000.00	3,586,793.28	
		CGB 3.13% 11/21/29	3,100,000.00	3,281,465.01	
		CGB 3.19% 04/15/53	1,500,000.00	1,705,512.30	
		CGB 3.25% 06/06/26	2,000,000.00	2,062,580.60	
		CGB 3.27% 03/25/73	1,000,000.00	1,204,694.30	
		CGB 3.27% 11/19/30	7,000,000.00	7,521,810.10	
		CGB 3.28% 12/03/27	5,000,000.00	5,261,261.00	
		CGB 3.32% 04/15/52	2,300,000.00	2,650,714.12	

		CGB 3.39% 03/16/50	2,700,000.00	3,124,513.44	
		CGB 3.4% 07/15/72	2,000,000.00	2,495,394.60	
		CGB 3.53% 10/18/51	2,000,000.00	2,394,279.40	
		CGB 3.72% 04/12/51	3,500,000.00	4,309,603.55	
		CGB 3.73% 05/25/70	4,000,000.00	5,283,864.00	
		CGB 3.76% 03/22/71	1,000,000.00	1,331,572.10	
		CGB 3.81% 09/14/50	2,300,000.00	2,858,341.10	
		CGB 3.82% 11/19/68	1,000,000.00	1,327,291.30	
		CGB 3.86% 07/22/49	5,900,000.00	7,336,870.66	
		CGB 4.08% 10/22/48	11,100,000.00	14,276,676.81	
		CGB 4% 06/24/69	5,000,000.00	6,977,750.00	
	オフショア人民元 小計		302,200,000.00	321,518,214.55 (7,122,625,158)	
国債証券合計				62,392,550,049 (62,392,550,049)	
地方債証券	アメリカドル	ALTA 1.3% 07/22/30	200,000.00	166,281.01	
		ALTA 3.3% 03/15/28	200,000.00	191,615.22	
		ALTA 4.5% 01/24/34	200,000.00	197,400.13	
		BRCOL 0.9% 07/20/26	100,000.00	92,563.31	
		BRCOL 1.3% 01/29/31	100,000.00	82,013.47	
		BRCOL 4.2% 07/06/33	500,000.00	482,591.47	
		CADEPO 4.5% 02/13/26	250,000.00	248,292.60	
		CADEPO 4.875% 06/05/29	250,000.00	253,611.93	
		KOMMUN 3.75% 05/24/28	200,000.00	194,014.60	
		MP 1.5% 10/25/28	200,000.00	176,727.41	
		MP 4.3% 07/27/33	300,000.00	291,983.07	
		NBRNS 3.625% 02/24/28	100,000.00	96,328.70	
		ONT 1.125% 10/07/30	200,000.00	163,385.02	
		ONT 1.6% 02/25/31	200,000.00	166,686.08	
		ONT 1.8% 10/14/31	200,000.00	166,476.47	
		ONT 2.125% 01/21/32	400,000.00	339,152.60	
		ONT 5.05% 04/24/34	200,000.00	205,953.31	
		Q 1.35% 05/28/30	300,000.00	251,321.22	
		Q 1.9% 04/21/31	300,000.00	254,164.25	
		Q 4.5% 09/08/33	400,000.00	394,949.80	
		SCDA 3.25% 06/08/27	300,000.00	288,322.95	

	アメリカドル 小計		5,100,000.00	4,703,834.62 (759,904,482)	
	カナダドル	ALTA 1.65% 06/01/31	100,000.00	86,442.47	
		ALTA 2.55% 06/01/27	200,000.00	192,996.08	
		ALTA 2.9% 09/20/29	100,000.00	95,895.18	
		ALTA 2.95% 06/01/52	200,000.00	155,000.49	
		ALTA 4.15% 06/01/33	100,000.00	100,278.16	
		BRCOL 1.55% 06/18/31	200,000.00	171,335.31	
		BRCOL 2.95% 06/18/50	200,000.00	154,872.18	
		BRCOL 2.95% 12/18/28	100,000.00	96,700.54	
		BRCOL 3.2% 06/18/32	200,000.00	188,491.29	
		BRCOL 3.2% 06/18/44	100,000.00	83,524.46	
		BRCOL 5.62% 08/17/28	100,000.00	106,761.81	
		MP 2.85% 09/05/46	100,000.00	76,345.57	
		MP 3.2% 03/05/50	200,000.00	160,626.81	
		MP 3.25% 09/05/29	100,000.00	97,341.76	
		MP 6.3% 03/05/31	100,000.00	113,472.72	
		NBRNS 2.9% 08/14/52	100,000.00	75,141.58	
		NBRNS 5.5% 01/27/34	100,000.00	109,915.45	
		NF 1.25% 06/02/27	100,000.00	92,758.20	
		NF 2.65% 10/17/50	100,000.00	69,337.64	
		NF 3.15% 12/02/52	200,000.00	152,927.04	
		NF 3.7% 10/17/48	200,000.00	170,543.20	
		NS 3.15% 12/01/51	100,000.00	79,177.10	
		NS 4.05% 06/01/29	200,000.00	202,287.98	
		NS 4.4% 06/01/42	100,000.00	98,473.57	
		ONT 1.35% 09/08/26	300,000.00	284,104.77	
		ONT 1.55% 11/01/29	300,000.00	268,056.52	
		ONT 1.9% 12/02/51	200,000.00	122,351.38	
		ONT 2.25% 12/02/31	100,000.00	88,975.04	
		ONT 2.55% 12/02/52	100,000.00	70,951.54	
		ONT 2.6% 06/02/27	200,000.00	193,293.39	
		ONT 2.65% 12/02/50	100,000.00	73,050.94	
		ONT 2.8% 06/02/48	200,000.00	152,746.87	
		ONT 2.9% 12/02/46	400,000.00	313,962.45	
		ONT 3.4% 09/08/28	200,000.00	197,241.39	

		ONT 3.45% 06/02/45	200,000.00	173,575.71	
		ONT 3.5% 06/02/43	400,000.00	353,136.05	
		ONT 3.65% 06/02/33	100,000.00	96,582.25	
		ONT 3.75% 06/02/32	100,000.00	98,122.16	
		ONT 4.15% 06/02/34	500,000.00	499,072.94	
		ONT 4.65% 06/02/41	200,000.00	205,558.45	
		ONT 4.7% 06/02/37	100,000.00	103,992.27	
		ONT 5.6% 06/02/35	300,000.00	335,917.50	
		ONT 6.2% 06/02/31	100,000.00	113,660.86	
		ONT 6.5% 03/08/29	100,000.00	111,543.61	
		ONT 8% 06/02/26	400,000.00	429,154.05	
		Q 1.9% 09/01/30	100,000.00	89,393.76	
		Q 2.6% 07/06/25	200,000.00	196,747.74	
		Q 2.75% 09/01/25	200,000.00	196,706.97	
		Q 2.75% 09/01/28	200,000.00	192,277.55	
		Q 3.1% 12/01/51	300,000.00	239,090.81	
		Q 3.25% 09/01/32	200,000.00	189,038.21	
		Q 3.5% 12/01/45	300,000.00	260,863.35	
		Q 3.6% 09/01/33	300,000.00	287,899.31	
		Q 3.65% 05/20/32	100,000.00	97,719.16	
		Q 4.4% 12/01/55	200,000.00	201,045.17	
		Q 5% 12/01/41	200,000.00	213,492.56	
		Q 6% 10/01/29	100,000.00	110,326.00	
		SCDA 2.65% 06/02/27	200,000.00	193,534.17	
		SCDA 3.75% 03/05/54	100,000.00	89,668.82	
		SCDA 4.2% 12/02/54	100,000.00	97,099.06	
		SCDA 4.75% 06/01/40	100,000.00	103,852.75	
	カナダドル 小計		10,800,000.00	9,974,452.12 (1,181,872,831)	
	ユーロ	ALTA 0.625% 01/16/26	200,000.00	192,185.40	
		BAYERN 0.01% 01/18/35	100,000.00	73,679.19	
		BAYERN 0.01% 05/07/29	100,000.00	86,964.62	
		BAYERN 0.03% 04/03/28	100,000.00	89,744.82	
		BERGER 0.01% 03/25/26	200,000.00	189,606.00	
		BERGER 0.01% 07/02/30	100,000.00	84,124.00	
		BERGER 0.125% 06/04/35	100,000.00	73,233.41	

		BERGER 0.125% 11/24/45	200,000.00	104,124.50	
		BERGER 0.625% 01/26/52	100,000.00	52,447.50	
		BERGER 0.625% 07/15/39	100,000.00	69,381.90	
		HESLAN 2.375% 09/21/26	100,000.00	98,226.15	
		HESLAN 2.625% 08/24/27	100,000.00	97,096.32	
		HESLAN 4% 02/04/30	100,000.00	102,409.65	
		HESSEN 0% 06/10/26	200,000.00	188,412.50	
		HESSEN 1.3% 10/10/33	100,000.00	86,707.80	
		HESSEN 2.875% 01/10/33	100,000.00	99,529.85	
		KOMINS 0.875% 09/01/29	100,000.00	90,439.30	
		KOMINS 2.875% 05/23/30	100,000.00	99,824.15	
		KOMINS 3.375% 03/15/27	400,000.00	403,501.80	
		KOMMUN 0% 11/17/29	100,000.00	85,589.13	
		KOMMUN 3.375% 04/26/43	200,000.00	200,508.70	
		LANDER 0.01% 02/04/31	100,000.00	82,724.85	
		LANDER 1.25% 05/04/29	100,000.00	92,556.95	
		MADRID 0.16% 07/30/28	100,000.00	88,745.00	
		MADRID 3.462% 04/30/34	200,000.00	199,972.20	
		MADRID 3.596% 04/30/33	100,000.00	101,504.15	
		NIESA 0.01% 03/17/26	300,000.00	284,540.62	
		NIESA 0.05% 03/09/35	100,000.00	73,006.87	
		NIESA 0% 02/11/27	100,000.00	92,420.95	
		NIESA 0% 09/15/25	100,000.00	96,228.25	
		NIESA 1.125% 09/12/33	100,000.00	85,263.50	
		NRW 0.25% 03/13/26	300,000.00	285,754.27	
		NRW 0.375% 09/02/50	100,000.00	49,112.00	
		NRW 0.5% 11/25/39	100,000.00	67,130.75	
		NRW 0.6% 06/04/41	100,000.00	65,434.90	
		NRW 0% 10/12/35	100,000.00	71,052.12	
		NRW 1.45% 01/19/22	200,000.00	103,266.12	
		NRW 1.65% 05/16/47	100,000.00	73,899.65	
		NRW 2.25% 06/14/52	100,000.00	80,783.50	
		NRW 2.75% 01/15/32	100,000.00	98,696.52	
		NRW 3.4% 03/07/2073	100,000.00	104,116.40	
		NRW 3% 01/27/28	200,000.00	200,115.80	
		ONT 0.01% 11/25/30	100,000.00	81,968.60	

		ONT 0.25% 06/09/31	100,000.00	81,927.07	
		Q 0.875% 05/04/27	100,000.00	93,827.35	
		Q 1.125% 10/28/25	100,000.00	97,158.37	
		Q 3% 01/24/33	100,000.00	98,417.67	
		SACHAN 0.125% 06/21/29	100,000.00	87,251.82	
		SACHAN 3.15% 02/06/54	200,000.00	196,412.80	
	ユーロ 小計		6,500,000.00	5,701,025.74 (995,969,196)	
	オーストラリアドル	NSWTC 1.25% 11/20/30	400,000.00	325,691.66	
		NSWTC 1.5% 02/20/32	100,000.00	78,683.99	
		NSWTC 2.25% 05/07/41	300,000.00	191,383.01	
		NSWTC 2% 03/08/33	100,000.00	79,078.46	
		NSWTC 3% 04/20/29	400,000.00	374,040.05	
		NSWTC 3% 05/20/27	200,000.00	192,436.82	
		NSWTC 3% 11/15/28	100,000.00	94,208.72	
		NSWTC 4.25% 02/20/36	400,000.00	363,488.13	
		NSWTC 4.75% 02/20/35	200,000.00	192,836.27	
		NSWTC 4.75% 02/20/37	100,000.00	94,086.95	
		NZLGFA 4.7% 08/01/28	200,000.00	199,678.83	
		QTC 1.5% 03/02/32	300,000.00	235,529.60	
		QTC 1.5% 08/20/32	200,000.00	154,395.03	
		QTC 1.75% 07/20/34	100,000.00	73,436.53	
		QTC 2.25% 10/28/50	100,000.00	54,212.96	
		QTC 2% 08/22/33	200,000.00	155,606.33	
		QTC 3.25% 07/21/28	200,000.00	191,000.88	
		QTC 4.5% 03/09/33	100,000.00	96,674.87	
		QTC 4.5% 08/22/35	200,000.00	187,379.51	
		QTC 4.75% 02/02/34	200,000.00	195,172.61	
		QTC 4.75% 07/21/25	100,000.00	100,249.01	
		TCV 0.5% 11/20/25	400,000.00	379,248.73	
		TCV 1.25% 11/19/27	300,000.00	270,024.92	
		TCV 1.5% 09/10/31	100,000.00	79,646.63	
		TCV 1.5% 11/20/30	200,000.00	164,191.88	
		TCV 2.25% 09/15/33	400,000.00	315,878.07	
		TCV 2.5% 10/22/29	500,000.00	450,098.11	
		TCV 2% 11/20/37	100,000.00	66,586.86	

		WATC 1.5% 10/22/30	100,000.00	83,096.01	
		WATC 3% 10/21/26	100,000.00	96,961.71	
		WATC 4.25% 07/20/33	200,000.00	190,772.78	
		WATC 5% 07/23/25	200,000.00	201,106.48	
	オーストラリアドル 小計		6,800,000.00	5,926,882.40 (644,666,998)	
地方債証券合計				3,582,413,507 (3,582,413,507)	
特殊債券	アメリカドル	AFDB 0.875% 07/22/26	100,000.00	92,642.97	
		AFDB 4.375% 03/14/28	100,000.00	99,663.39	
		AFDB 5.75% PERP	200,000.00	194,739.38	
		AGFRNC 4.5% 02/17/26	200,000.00	198,260.49	
		AIIB 0.5% 01/27/26	100,000.00	93,557.31	
		AIIB 4.125% 01/18/29	200,000.00	197,964.03	
		ASIA 0.5% 02/04/26	200,000.00	187,097.63	
		ASIA 1.75% 09/19/29	100,000.00	88,048.20	
		ASIA 1.875% 01/24/30	200,000.00	175,925.49	
		ASIA 1% 04/14/26	100,000.00	93,715.57	
		ASIA 3.75% 04/25/28	200,000.00	195,344.33	
		ASIA 3.875% 09/28/32	100,000.00	96,447.92	
		ASIA 4% 01/12/33	100,000.00	96,996.16	
		BNG 0.875% 05/18/26	200,000.00	186,202.37	
		CADES 1.375% 01/20/31	200,000.00	165,290.82	
		CADES 3.75% 05/24/28	200,000.00	194,493.72	
		CADES 4.625% 11/02/25	200,000.00	198,991.62	
		CADES 4% 01/25/26	300,000.00	296,039.30	
		CAF 4.75% 04/01/26	100,000.00	98,965.75	
		COE 3.625% 01/26/28	100,000.00	97,221.64	
		COE 4.125% 01/24/29	100,000.00	99,037.51	
		DBJJP 1.25% 10/20/26	300,000.00	276,952.50	
		DBJJP 4.375% 09/22/25	200,000.00	198,025.01	
		DBJJP 4.5% 01/30/34	200,000.00	197,918.80	
		EBRD 4.375% 03/09/28	100,000.00	99,819.35	
		EDC 3.375% 08/26/25	200,000.00	196,514.91	
		EIB 0.375% 03/26/26	500,000.00	464,463.84	
		EIB 1.375% 03/15/27	400,000.00	368,554.21	

		EIB 1.75% 03/15/29	100,000.00	89,095.30	
		EIBKOR 1.25% 09/21/30	200,000.00	162,256.00	
		EIBKOR 2.5% 06/29/41	200,000.00	141,356.45	
		EIBKOR 5% 01/11/28	200,000.00	201,817.20	
		ESM 0.375% 09/10/25	200,000.00	189,676.33	
		FFCB 4.625% 04/10/26	500,000.00	498,914.85	
		FFCB 6.08% 04/28/33	500,000.00	500,000.34	
		FHLB 0.96% 03/05/26	200,000.00	187,798.14	
		FNMA 0.56% 11/17/25	200,000.00	188,897.12	
		FNMA 0.75% 10/08/27	200,000.00	177,992.08	
		FNMA 1.875% 09/24/26	100,000.00	94,334.27	
		FNMA 5.625% 07/15/37	200,000.00	220,185.22	
		FNMA 7.125% 01/15/30	200,000.00	227,149.50	
		IADB 0.875% 04/20/26	100,000.00	93,443.40	
		IADB 1.125% 01/13/31	100,000.00	81,839.71	
		IADB 3.5% 09/14/29	100,000.00	96,147.11	
		IADB 4.375% 01/24/44	200,000.00	187,516.07	
		IADB 4.5% 05/15/26	200,000.00	199,150.05	
		IADB 4.5% 09/13/33	200,000.00	201,053.81	
		IBRD 0.5% 10/28/25	200,000.00	188,983.08	
		IBRD 0.875% 07/15/26	100,000.00	92,827.97	
		IBRD 1.125% 09/13/28	200,000.00	175,449.10	
		IBRD 1.375% 04/20/28	100,000.00	89,555.86	
		IBRD 3.125% 06/15/27	500,000.00	481,668.10	
		IBRD 3.5% 07/12/28	100,000.00	96,788.71	
		IDBINV 4.125% 02/15/28	100,000.00	98,322.33	
		IFC 0.375% 07/16/25	200,000.00	190,829.97	
		IFC 0.75% 08/27/30	100,000.00	80,901.56	
		IFC 3.625% 09/15/25	100,000.00	98,479.59	
		JBIC 0.625% 07/15/25	200,000.00	191,144.25	
		JBIC 2.75% 01/21/26	200,000.00	193,425.72	
		JBIC 4.25% 01/26/26	200,000.00	197,777.33	
		JBIC 4.25% 04/27/26	300,000.00	296,536.53	
		JBIC 4.375% 10/05/27	200,000.00	198,552.09	
		JICA 3.25% 05/25/27	200,000.00	191,909.09	
		KBN 4.625% 10/24/25	200,000.00	199,008.75	

		KBN 4% 01/19/28	200,000.00	196,679.78	
		KDB 4.25% 09/08/32	200,000.00	191,234.09	
		KFW 0.75% 09/30/30	100,000.00	80,911.86	
		KFW 1% 10/01/26	500,000.00	462,573.30	
		KFW 3.625% 04/01/26	100,000.00	98,136.33	
		KFW 3.75% 02/15/28	200,000.00	195,977.66	
		KFW 4.125% 07/15/33	300,000.00	293,870.38	
		KOHNPW 1.25% 04/27/26	200,000.00	186,480.00	
		KORELE 5.375% 07/31/26	200,000.00	201,084.94	
		KORGAS 1.125% 07/13/26	200,000.00	185,196.76	
		LBANK 1.375% 10/12/28	100,000.00	88,088.30	
		NEDFIN 4.75% 11/15/28	200,000.00	201,650.76	
		NEDWBK 1% 05/28/30	200,000.00	164,377.44	
		NEDWBK 4% 06/01/28	200,000.00	196,321.36	
		NIB 3.375% 09/08/27	200,000.00	193,319.77	
		NIB 4.25% 02/28/29	200,000.00	199,019.40	
		OKB 3.625% 09/09/27	200,000.00	194,811.42	
		OKB 4.125% 01/20/26	100,000.00	98,897.01	
		OKB 4.625% 11/03/25	200,000.00	199,140.02	
		SDBC 2% 02/16/27	200,000.00	187,499.10	
		SEK 2.25% 03/22/27	200,000.00	187,950.12	
		TVA 3.875% 03/15/28	200,000.00	196,671.74	
		TVA 4.25% 09/15/65	100,000.00	85,897.31	
		TVA 7.125% 05/01/30	200,000.00	227,743.99	
	アメリカドル 小計		17,000,000.00	16,263,210.04 (2,627,321,581)	
	カナダドル	ASIA 0.75% 02/10/26	100,000.00	94,803.55	
		ASIA 1.5% 05/04/28	100,000.00	91,909.41	
		CANHOU 1.1% 03/15/31	200,000.00	169,127.63	
		CANHOU 1.1% 12/15/26	400,000.00	374,629.00	
		CANHOU 1.25% 06/15/26	100,000.00	95,020.05	
		CANHOU 1.4% 03/15/31	300,000.00	258,969.18	
		CANHOU 1.75% 06/15/30	300,000.00	269,499.18	
		CANHOU 1.95% 12/15/25	200,000.00	194,015.87	
		CANHOU 2.15% 12/15/31	100,000.00	89,781.24	
		CANHOU 2.65% 12/15/28	100,000.00	95,891.53	

		CANHOU 3.1% 06/15/28	100,000.00	97,884.78	
		CANHOU 3.55% 09/15/32	200,000.00	196,640.32	
		CANHOU 3.6% 12/15/27	300,000.00	298,875.65	
		CANHOU 3.65% 06/15/33	100,000.00	98,566.65	
		CANHOU 3.8% 06/15/27	100,000.00	100,010.60	
		CANHOU 3.95% 06/15/28	200,000.00	201,938.01	
		CANHOU 4.15% 06/15/33	200,000.00	204,638.13	
		CANHOU 4.25% 03/15/34	600,000.00	617,492.04	
		IADB 1% 06/29/26	100,000.00	94,293.91	
		IBRD 4.25% 09/18/30	100,000.00	102,441.47	
		KFW 0.75% 02/19/26	100,000.00	94,721.94	
		QHEL 2% 09/01/28	100,000.00	93,138.00	
		QHEL 3.4% 09/01/29	200,000.00	196,240.99	
		QHEL 4% 02/15/55	100,000.00	93,308.86	
		QHEL 4% 02/15/63	400,000.00	374,486.47	
		QHEL 5% 02/15/50	100,000.00	109,135.25	
	カナダドル 小計		4,900,000.00	4,707,459.71 (557,786,901)	
	ユーロ	AFDB 0.5% 03/22/27	100,000.00	93,386.40	
		AFDB 2.25% 09/14/29	100,000.00	96,564.40	
		AGFRNC 0.125% 09/29/31	100,000.00	79,556.10	
		AGFRNC 3.5% 02/25/33	200,000.00	201,648.70	
		AGFRNC 3.75% 02/15/27	100,000.00	100,885.90	
		ASFING 0.125% 06/02/31	100,000.00	82,527.80	
		ASIA 0.025% 01/31/30	100,000.00	85,176.72	
		ASIA 1.95% 07/22/32	200,000.00	185,131.20	
		BNG 0.01% 10/05/32	200,000.00	156,345.20	
		BNG 0.125% 04/11/26	200,000.00	189,853.50	
		BNG 0.125% 07/09/35	100,000.00	72,364.00	
		BNG 0.75% 01/24/29	100,000.00	90,572.67	
		BNG 0.805% 06/28/49	100,000.00	56,227.72	
		BNG 1.25% 03/30/37	100,000.00	79,103.07	
		BNG 2.75% 10/04/27	100,000.00	99,311.85	
		BNG 3% 04/23/30	100,000.00	99,977.25	
		CADES 0.45% 01/19/32	300,000.00	246,101.55	
		CADES 0% 02/25/26	300,000.00	284,439.00	

		CADES 0% 02/25/28	300,000.00	268,250.62	
		CADES 0% 05/25/29	100,000.00	86,037.65	
		CADES 0% 05/25/31	100,000.00	80,839.65	
		CADES 2.75% 11/25/32	100,000.00	96,685.37	
		CADES 2.875% 05/25/27	100,000.00	99,206.30	
		CADES 3.125% 03/01/30	100,000.00	100,001.10	
		CAF 0.25% 02/04/26	200,000.00	189,234.30	
		COE 0.25% 01/19/32	100,000.00	82,153.93	
		COE 1% 04/13/29	100,000.00	91,600.45	
		DBHNGR 1.875% 05/24/30	100,000.00	93,615.25	
		DBHNGR 4% 11/23/43	200,000.00	207,642.04	
		DBJJP 3.125% 04/13/28	100,000.00	99,647.50	
		EDC 0.25% 03/07/26	200,000.00	190,564.40	
		EDF 3.875% 01/12/27	100,000.00	100,442.62	
		EDF 4.375% 10/12/29	200,000.00	205,905.84	
		EDF 4.625% 01/25/43	100,000.00	100,550.02	
		EFSF 0.05% 10/17/29	100,000.00	86,032.00	
		EFSF 0.7% 01/17/53	200,000.00	105,108.30	
		EFSF 0.875% 04/10/35	100,000.00	79,709.85	
		EFSF 0.875% 09/05/28	100,000.00	91,999.80	
		EFSF 0% 01/20/31	100,000.00	82,624.80	
		EFSF 0% 07/20/26	300,000.00	282,044.40	
		EFSF 0% 10/15/25	100,000.00	96,065.75	
		EFSF 1.5% 12/15/25	100,000.00	97,653.85	
		EFSF 1.75% 07/17/53	200,000.00	142,344.20	
		EFSF 2.375% 06/21/32	300,000.00	286,885.33	
		EFSF 2.875% 02/16/33	200,000.00	198,111.35	
		EFSF 3% 09/04/34	42,000.00	41,685.21	
		EIB 0.01% 05/15/41	500,000.00	293,928.25	
		EIB 0.01% 11/15/35	100,000.00	70,909.68	
		EIB 0.05% 10/13/34	100,000.00	73,948.20	
		EIB 0.05% 11/15/29	100,000.00	86,064.97	
		EIB 0.2% 03/17/36	300,000.00	215,259.30	
		EIB 0.25% 01/20/32	100,000.00	82,086.52	
		EIB 0.25% 06/15/40	100,000.00	63,495.70	
		EIB 0.375% 05/15/26	500,000.00	476,520.62	

		EIB 0.375% 09/15/27	100,000.00	92,309.35	
		EIB 0.625% 01/22/29	100,000.00	90,420.10	
		EIB 0% 03/13/26	100,000.00	95,087.00	
		EIB 0% 05/15/28	200,000.00	179,061.00	
		EIB 0% 06/17/27	100,000.00	91,806.80	
		EIB 0% 09/09/30	100,000.00	83,721.55	
		EIB 2.75% 01/16/34	200,000.00	195,145.00	
		EIB 2.75% 07/28/28	100,000.00	99,473.40	
		EIB 3.625% 03/14/42	100,000.00	104,630.50	
		EIB 3% 07/15/33	300,000.00	299,244.45	
		EIBKOR 1.375% 11/24/25	100,000.00	97,031.00	
		EIBKOR 3.5% 06/07/26	200,000.00	199,809.40	
		ESM 0.01% 10/15/31	100,000.00	81,314.90	
		ESM 0.5% 03/05/29	200,000.00	179,288.55	
		ESM 0% 12/15/26	200,000.00	186,016.60	
		ESM 3% 03/15/28	200,000.00	200,446.40	
		ESM 3% 08/23/33	100,000.00	100,312.70	
		EU 0.25% 04/22/36	100,000.00	71,722.00	
		EU 0.3% 11/04/50	200,000.00	96,365.10	
		EU 0.4% 02/04/37	100,000.00	71,385.00	
		EU 0.45% 05/02/46	700,000.00	391,391.70	
		EU 0.45% 07/04/41	200,000.00	125,110.80	
		EU 0.7% 07/06/51	400,000.00	214,017.00	
		EU 0.75% 01/04/47	100,000.00	59,901.40	
		EU 0.8% 07/04/25	100,000.00	97,581.17	
		EU 0% 03/04/26	300,000.00	285,642.75	
		EU 0% 07/04/31	100,000.00	81,579.17	
		EU 0% 07/04/35	400,000.00	285,518.28	
		EU 0% 07/06/26	100,000.00	94,282.87	
		EU 0% 10/04/28	800,000.00	707,860.00	
		EU 0% 10/04/30	100,000.00	83,535.12	
		EU 0% 11/04/25	600,000.00	575,811.14	
		EU 1.125% 06/04/37	500,000.00	390,453.25	
		EU 1.625% 12/04/29	100,000.00	93,469.25	
		EU 1% 07/06/32	100,000.00	86,016.40	
		EU 2.5% 10/04/52	100,000.00	82,193.60	

		EU 2.625% 02/04/48	100,000.00	86,844.52	
		EU 2.75% 02/04/33	100,000.00	97,851.10	
		EU 2.75% 10/05/26	500,000.00	496,557.75	
		EU 2.75% 12/04/37	200,000.00	189,768.95	
		EU 2% 10/04/27	100,000.00	97,093.95	
		EU 3.125% 12/04/30	500,000.00	504,275.85	
		EU 3.375% 11/04/42	100,000.00	99,247.70	
		EU 4% 04/04/44	200,000.00	214,755.40	
		EUROF 0.01% 06/23/28	100,000.00	88,744.05	
		EUROF 0.15% 10/10/34	100,000.00	74,682.22	
		IBRD 0.01% 04/24/28	300,000.00	268,864.57	
		IBRD 0.1% 09/17/35	100,000.00	72,152.30	
		IBRD 0.2% 01/21/61	100,000.00	36,414.00	
		IBRD 0.25% 01/10/50	200,000.00	98,049.50	
		IBRD 0.5% 04/16/30	100,000.00	87,277.40	
		IBRD 0.7% 10/22/46	100,000.00	60,216.71	
		IBRD 0% 01/15/27	100,000.00	92,801.70	
		IBRD 0% 02/21/30	200,000.00	170,047.40	
		IBRD 2.9% 01/19/33	100,000.00	99,366.44	
		IBRD 3.1% 04/14/38	100,000.00	98,508.25	
		IDAWBG 0.7% 01/17/42	100,000.00	65,194.07	
		IDAWBG 1.75% 05/05/37	100,000.00	84,768.45	
		IDAWBG 2.5% 01/15/38	100,000.00	91,616.60	
		IDBINV 3.125% 06/07/30	200,000.00	200,731.54	
		IDBINV 3.125% 11/15/27	100,000.00	100,049.45	
		JBIC 3.125% 02/15/28	100,000.00	99,688.00	
		KDB 3.375% 05/23/28	200,000.00	199,895.90	
		KFW 0.125% 01/09/32	300,000.00	244,837.12	
		KFW 0.375% 05/20/36	100,000.00	73,754.00	
		KFW 0% 01/10/31	200,000.00	166,121.62	
		KFW 0% 03/31/27	100,000.00	92,334.70	
		KFW 0% 09/30/26	100,000.00	93,601.30	
		KFW 1.25% 06/30/27	200,000.00	190,545.50	
		KFW 2.625% 01/10/34	400,000.00	388,732.86	
		KFW 2.75% 02/14/33	100,000.00	98,823.65	
		KFW 2.75% 03/15/28	800,000.00	796,046.40	

		KFW 2.875% 05/29/26	600,000.00	597,651.00	
		KFW 2% 11/15/29	100,000.00	95,737.92	
		LBANK 0.375% 02/25/27	100,000.00	93,212.50	
		LBANK 0.75% 03/16/32	100,000.00	85,171.00	
		NEDFIN 0.125% 04/03/27	100,000.00	92,540.47	
		NEDWBK 0.5% 04/26/51	100,000.00	50,050.25	
		NEDWBK 0.75% 10/04/41	100,000.00	65,464.90	
		NEDWBK 0% 02/16/37	300,000.00	200,819.08	
		NIB 2.5% 01/30/30	100,000.00	98,015.70	
		NRWBK 0.1% 07/09/35	100,000.00	72,156.90	
		NRWBK 0.75% 06/30/28	100,000.00	91,647.07	
		NRWBK 0% 05/14/29	100,000.00	86,699.50	
		NRWBK 1.25% 05/13/49	100,000.00	64,485.00	
		NRWBK 1.625% 08/03/32	100,000.00	90,442.62	
		NRWBK 2.875% 04/05/33	100,000.00	99,041.12	
		OKB 1.5% 07/13/27	100,000.00	95,597.15	
		RENTEN 0.01% 11/26/40	100,000.00	59,621.00	
		RENTEN 0.05% 01/31/31	100,000.00	82,938.97	
		RENTEN 0.1% 03/08/27	100,000.00	92,689.40	
		RENTEN 0% 12/13/28	100,000.00	88,039.12	
		RENTEN 2.75% 02/16/32	200,000.00	197,118.55	
		RENTEN 3.25% 09/06/30	500,000.00	509,148.50	
		RENTEN 3% 11/14/34	100,000.00	100,101.25	
		RESFER 0.875% 01/22/29	400,000.00	359,564.60	
		RESFER 2.25% 12/20/47	100,000.00	74,070.17	
		RESFER 2.625% 12/29/25	100,000.00	98,740.50	
		RESFER 3.125% 10/25/28	100,000.00	99,299.95	
		SBAB 0.5% 02/08/27	200,000.00	185,339.00	
		SBAB 1.875% 12/10/25	100,000.00	97,740.40	
		SEK 3.25% 04/13/26	100,000.00	99,875.50	
		SNCF 0.625% 04/17/30	100,000.00	86,059.12	
		SNCF 1% 01/19/61	100,000.00	40,108.35	
		SNCF 3.375% 05/25/33	200,000.00	199,342.75	
	ユーロ 小計		27,642,000.00	24,081,773.08 (4,207,085,757)	
	イギリスポ	AIIB 1.125% 09/15/26	100,000.00	92,797.00	

	ンド	ASIA 0.75% 12/07/27	100,000.00	88,749.10	
		BNG 0.5% 12/21/26	100,000.00	90,627.57	
		COE 4.25% 03/16/26	100,000.00	99,335.00	
		DEXGRP 0.25% 12/10/26	100,000.00	89,909.44	
		EIB 0.75% 07/22/27	100,000.00	89,897.00	
		EIB 0.875% 05/15/26	200,000.00	187,536.40	
		EIB 3.875% 04/12/28	200,000.00	197,154.12	
		EIB 4.875% 12/16/30	200,000.00	206,969.00	
		EIB 5.625% 06/07/32	100,000.00	109,415.25	
		IADB 2.125% 12/15/28	100,000.00	91,471.45	
		IADB 5% 07/20/30	100,000.00	103,842.80	
		IBRD 0.25% 07/22/26	100,000.00	91,684.86	
		KFW 1.125% 07/04/25	100,000.00	96,427.30	
		KFW 3.75% 07/30/27	100,000.00	98,125.25	
		KFW 3.875% 09/02/25	200,000.00	197,745.60	
		KFW 4.875% 02/03/31	100,000.00	103,757.82	
		NEDWBK 0.875% 09/30/26	200,000.00	184,032.50	
		RENTEN 2.125% 12/15/28	100,000.00	91,518.97	
	イギリスポンド 小計		2,400,000.00	2,310,996.43 (477,382,532)	
	オーストラリアドル	AFDB 3.3% 07/27/27	100,000.00	96,166.70	
		ASIA 4.25% 01/17/28	100,000.00	98,999.27	
		BNG 1.6% 11/27/30	100,000.00	81,780.49	
		BNG 5% 03/13/34	100,000.00	99,656.12	
		EDC 4.5% 09/06/28	100,000.00	99,597.43	
		EIB 1.8% 01/19/27	100,000.00	93,492.15	
		EIB 4.55% 06/02/33	200,000.00	195,122.64	
		EUROF 3.35% 05/21/29	100,000.00	93,378.77	
		IBRD 3% 10/19/26	100,000.00	96,685.92	
		IBRD 4.4% 01/13/28	100,000.00	99,439.14	
		IFC 1.25% 02/06/31	100,000.00	80,096.93	
		IFC 3.6% 02/24/26	100,000.00	98,429.64	
		KBN 0.6% 06/01/26	100,000.00	92,583.46	
		KFW 4.3% 07/13/27	100,000.00	99,318.38	
		LBANK 4.25% 08/07/25	100,000.00	99,338.37	
		NEDWBK 2.25% 09/04/25	100,000.00	97,219.67	

		NIB 2.4% 09/22/25	100,000.00	97,360.43	
		NRWBK 1.05% 03/31/26	200,000.00	187,599.95	
		RENTEN 2.6% 03/23/27	100,000.00	95,073.11	
	オーストラリアドル 小計		2,100,000.00	2,001,338.57 (217,685,596)	
	オフショア人民元	ADBCH 2.12% 03/12/27	2,000,000.00	2,008,583.00	
		ADBCH 2.5% 08/24/27	5,000,000.00	5,079,486.00	
		ADBCH 2.55% 05/11/26	5,000,000.00	5,061,702.50	
		ADBCH 2.57% 09/13/28	5,000,000.00	5,102,208.50	
		ADBCH 2.6% 12/01/25	3,000,000.00	3,032,405.70	
		ADBCH 2.63% 06/07/28	6,000,000.00	6,130,146.00	
		ADBCH 2.74% 02/23/27	2,000,000.00	2,041,350.40	
		ADBCH 2.83% 08/11/29	7,000,000.00	7,231,335.30	
		ADBCH 2.85% 10/20/33	3,500,000.00	3,634,976.45	
		ADBCH 2.9% 03/08/28	2,000,000.00	2,063,317.00	
		ADBCH 2.91% 02/21/29	2,000,000.00	2,066,092.60	
		ADBCH 2.97% 10/14/32	2,000,000.00	2,095,432.80	
		ADBCH 2.99% 08/11/26	5,000,000.00	5,113,833.50	
		ADBCH 3.01% 03/16/30	1,500,000.00	1,562,580.75	
		ADBCH 3.06% 06/06/32	4,000,000.00	4,213,412.00	
		ADBCH 3.1% 02/27/33	5,000,000.00	5,284,646.00	
		ADBCH 3.19% 08/12/28	2,000,000.00	2,088,308.60	
		ADBCH 3.3% 11/05/31	2,000,000.00	2,137,013.60	
		ADBCH 3.35% 03/24/26	8,000,000.00	8,198,206.40	
		ADBCH 3.52% 05/24/31	5,000,000.00	5,402,492.50	
		ADBCH 3.79% 10/26/30	2,000,000.00	2,181,410.80	
		ADBCH 3.92% 06/18/51	1,000,000.00	1,270,920.00	
		ADBCH 3.95% 02/26/36	1,000,000.00	1,156,376.20	
		EXIMCH 2.5% 08/04/28	3,000,000.00	3,050,984.40	
		EXIMCH 2.61% 01/27/27	4,000,000.00	4,067,069.20	
		EXIMCH 2.82% 06/17/27	8,000,000.00	8,200,101.60	
		EXIMCH 2.87% 02/06/28	5,000,000.00	5,148,560.00	
		EXIMCH 2.9% 08/19/32	4,000,000.00	4,173,694.00	
		EXIMCH 3.1% 02/13/33	2,000,000.00	2,113,504.40	
		EXIMCH 3.18% 03/11/32	5,000,000.00	5,304,492.50	
		EXIMCH 3.22% 05/14/26	3,000,000.00	3,074,363.40	

		EXIMCH 3.23% 03/23/30	6,000,000.00	6,336,860.40	
		EXIMCH 3.38% 07/16/31	2,000,000.00	2,144,997.80	
		EXIMCH 3.43% 10/23/25	4,000,000.00	4,084,171.60	
		EXIMCH 3.74% 11/16/30	3,000,000.00	3,271,044.60	
		EXIMCH 3.86% 05/20/29	5,000,000.00	5,410,386.50	
		EXIMCH 3.88% 01/12/36	1,000,000.00	1,147,296.50	
		SDBC 2.22% 08/25/25	3,000,000.00	3,017,096.10	
		SDBC 2.25% 07/06/26	4,000,000.00	4,029,853.20	
		SDBC 2.3% 02/22/29	4,000,000.00	4,046,440.00	
		SDBC 2.59% 01/11/26	3,000,000.00	3,035,190.00	
		SDBC 2.65% 02/24/27	3,000,000.00	3,055,906.50	
		SDBC 2.69% 06/16/27	3,000,000.00	3,064,895.40	
		SDBC 2.73% 01/11/28	3,000,000.00	3,073,995.30	
		SDBC 2.82% 05/22/33	6,000,000.00	6,218,175.60	
		SDBC 2.83% 09/10/26	8,000,000.00	8,159,496.00	
		SDBC 2.96% 07/18/32	2,000,000.00	2,094,655.20	
		SDBC 2.98% 04/22/32	2,000,000.00	2,099,560.00	
		SDBC 2.99% 03/01/29	2,000,000.00	2,084,656.20	
		SDBC 3.02% 03/06/33	7,000,000.00	7,362,611.20	
		SDBC 3.03% 07/24/43	2,000,000.00	2,160,692.40	
		SDBC 3.07% 03/10/30	7,000,000.00	7,326,307.80	
		SDBC 3.09% 06/18/30	2,000,000.00	2,098,863.60	
		SDBC 3.09% 08/09/28	5,000,000.00	5,198,342.50	
		SDBC 3.12% 09/13/31	2,000,000.00	2,112,369.40	
		SDBC 3.3% 03/03/26	10,000,000.00	10,240,061.00	
		SDBC 3.4% 01/08/28	5,000,000.00	5,232,402.00	
		SDBC 3.41% 06/07/31	4,000,000.00	4,296,877.60	
		SDBC 3.43% 01/14/27	13,000,000.00	13,478,208.90	
		SDBC 3.45% 09/20/29	7,000,000.00	7,450,706.90	
		SDBC 3.49% 11/08/41	2,000,000.00	2,280,520.00	
		SDBC 3.5% 11/04/46	2,000,000.00	2,377,596.40	
		SDBC 3.65% 05/21/29	4,000,000.00	4,283,542.80	
		SDBC 3.66% 03/01/31	2,000,000.00	2,174,521.60	
		SDBC 3.7% 10/20/30	8,000,000.00	8,695,749.60	
		SDBC 3.8% 01/25/36	2,000,000.00	2,275,344.60	
		SDBC 3% 01/17/32	4,000,000.00	4,196,533.60	

		SDBC 4.04% 07/06/28	2,000,000.00	2,153,580.60	
	オフショア人民元 小計		269,000,000.00	281,058,515.50 (6,226,317,399)	
特殊債券合計				14,313,579,766 (14,313,579,766)	
社債券	アメリカドル	AAPL 0.7% 02/08/26	100,000.00	93,779.12	
		AAPL 1.4% 08/05/28	100,000.00	88,612.11	
		AAPL 2.65% 05/11/50	100,000.00	65,155.60	
		AAPL 2.7% 08/05/51	200,000.00	130,032.75	
		AAPL 3.35% 08/08/32	100,000.00	91,582.41	
		AAPL 3.75% 11/13/47	100,000.00	80,855.86	
		AAPL 4.1% 08/08/62	200,000.00	166,066.87	
		AAPL 4.421% 05/08/26	200,000.00	199,086.29	
		ABBV 4.3% 05/14/36	200,000.00	186,031.83	
		ABBV 4.45% 05/14/46	100,000.00	88,040.30	
		ABBV 5.35% 03/15/44	200,000.00	199,946.24	
		ABC 2.7% 03/15/31	100,000.00	86,026.24	
		ABIBB 4.7% 02/01/36	100,000.00	95,623.16	
		ABIBB 4.9% 02/01/46	100,000.00	93,303.28	
		ABIBB 4% 04/13/28	100,000.00	97,704.90	
		ABIBB 5.55% 01/23/49	100,000.00	101,989.86	
		ABIBB 5.8% 01/23/59	100,000.00	105,937.90	
		ABIBB 5% 06/15/34	200,000.00	199,970.17	
		ABNANV 2.47% 12/13/29	200,000.00	177,259.80	
		ABNANV 3.324% 03/13/37	200,000.00	166,304.73	
		ABT 1.15% 01/30/28	100,000.00	89,011.66	
		ABT 1.4% 06/30/30	100,000.00	83,781.05	
		ACGL 3.635% 06/30/50	100,000.00	73,468.05	
		ADBE 2.15% 02/01/27	100,000.00	93,712.46	
		ADM 4.5% 08/15/33	100,000.00	95,846.93	
		AEE 1.95% 03/15/27	100,000.00	92,309.60	
		AEE 3.9% 04/01/52	100,000.00	77,351.72	
		AEE 5.2% 04/01/34	200,000.00	200,338.96	
		AEP 3.75% 07/01/47	100,000.00	74,257.02	
		AEP 5.625% 04/01/53	200,000.00	197,458.52	
		AER 1.75% 01/30/26	150,000.00	141,820.82	

		AER 2.45% 10/29/26	150,000.00	140,571.78	
		AER 3.4% 10/29/33	150,000.00	127,606.60	
		AER 3.85% 10/29/41	150,000.00	119,539.38	
		AES 1.375% 01/15/26	100,000.00	94,090.86	
		AFL 1.125% 03/15/26	100,000.00	93,653.44	
		AGR 3.8% 06/01/29	100,000.00	93,755.58	
		AIA 5.625% 10/25/27	200,000.00	204,133.48	
		AIG 3.4% 06/30/30	200,000.00	183,131.94	
		AIRFP 3.95% 04/10/47	150,000.00	123,369.96	
		AJG 5.5% 03/02/33	100,000.00	101,271.46	
		AL 2.875% 01/15/26	100,000.00	96,229.00	
		AL 3.125% 12/01/30	100,000.00	88,417.85	
		AL 5.3% 02/01/28	100,000.00	100,265.56	
		ALL 1.45% 12/15/30	100,000.00	80,502.49	
		ALLY 4.75% 06/09/27	100,000.00	97,975.27	
		AMG 3.3% 06/15/30	100,000.00	89,815.00	
		AMGN 3.15% 02/21/40	100,000.00	75,478.14	
		AMGN 3.375% 02/21/50	200,000.00	142,929.34	
		AMGN 5.15% 03/02/28	100,000.00	100,408.30	
		AMGN 5.507% 03/02/26	200,000.00	199,975.87	
		AMGN 5.6% 03/02/43	200,000.00	198,905.52	
		AMGN 5.75% 03/02/63	100,000.00	99,228.42	
		AMP 5.15% 05/15/33	100,000.00	101,027.20	
		AMT 1.6% 04/15/26	100,000.00	93,726.35	
		AMT 1.875% 10/15/30	100,000.00	82,264.84	
		AMT 2.95% 01/15/51	100,000.00	63,650.62	
		AMT 3.8% 08/15/29	100,000.00	93,808.38	
		AMT 5.65% 03/15/33	100,000.00	101,608.09	
		AMXLMM 2.875% 05/07/30	200,000.00	177,651.65	
		AMZN 3.875% 08/22/37	100,000.00	89,551.24	
		AMZN 4.05% 08/22/47	100,000.00	84,649.57	
		AMZN 4.25% 08/22/57	100,000.00	84,957.32	
		AMZN 4.55% 12/01/27	100,000.00	99,781.12	
		AMZN 4.6% 12/01/25	200,000.00	199,057.60	
		AMZN 4.7% 12/01/32	200,000.00	199,784.07	
		AN 1.95% 08/01/28	100,000.00	87,304.93	

		ANZNZ 3.45% 01/21/28	200,000.00	190,384.68	
		AON 3.875% 12/15/25	100,000.00	98,071.57	
		APD 2.05% 05/15/30	100,000.00	86,215.49	
		APD 2.7% 05/15/40	100,000.00	72,151.71	
		APH 4.75% 03/30/26	100,000.00	99,446.81	
		ARE 2.75% 12/15/29	100,000.00	88,424.18	
		ARE 3.55% 03/15/52	100,000.00	68,153.94	
		ARE 4.75% 04/15/35	100,000.00	93,904.88	
		ATH 3.95% 05/25/51	100,000.00	72,516.00	
		ATH 5.875% 01/15/34	200,000.00	200,550.93	
		ATH 6.15% 04/03/30	100,000.00	104,206.52	
		ATO 5.75% 10/15/52	100,000.00	102,817.23	
		ATO 6.2% 11/15/53	100,000.00	108,994.71	
		AVB 1.9% 12/01/28	100,000.00	88,501.93	
		AVGO 1.95% 02/15/28	100,000.00	89,977.38	
		AVGO 3.137% 11/15/35	200,000.00	162,451.21	
		AVGO 3.469% 04/15/34	200,000.00	172,480.71	
		AVGO 4.15% 04/15/32	100,000.00	93,127.80	
		AVOL 5.75% 03/01/29	200,000.00	201,112.03	
		AXP 2.55% 03/04/27	100,000.00	94,012.56	
		AXP 5.625% 07/28/34	200,000.00	203,504.84	
		AZN 0.7% 04/08/26	100,000.00	92,932.24	
		AZN 4.875% 03/03/33	100,000.00	99,913.35	
		AZO 4% 04/15/30	100,000.00	94,766.69	
		BA 2.196% 02/04/26	100,000.00	94,442.33	
		BA 2.75% 02/01/26	200,000.00	190,491.15	
		BA 3.25% 02/01/28	200,000.00	184,362.37	
		BA 3.25% 02/01/35	100,000.00	77,591.06	
		BA 5.15% 05/01/30	100,000.00	97,091.89	
		BA 5.805% 05/01/50	100,000.00	91,928.51	
		BABA 2.125% 02/09/31	200,000.00	167,007.06	
		BAC 1.734% 07/22/27	100,000.00	93,230.53	
		BAC 1.898% 07/23/31	100,000.00	83,155.07	
		BAC 2.087% 06/14/29	100,000.00	89,306.35	
		BAC 2.572% 10/20/32	100,000.00	83,753.28	
		BAC 2.676% 06/19/41	100,000.00	70,918.34	

		BAC 2.687% 04/22/32	200,000.00	170,573.41	
		BAC 3.483% 03/13/52	100,000.00	73,458.12	
		BAC 3.5% 04/19/26	100,000.00	97,234.52	
		BAC 3.946% 01/23/49	300,000.00	240,526.26	
		BAC 4.083% 03/20/51	100,000.00	81,341.62	
		BAC 5.08% 01/20/27	500,000.00	498,550.20	
		BAC 5.468% 01/23/35	200,000.00	201,110.38	
		BAC 5.819% 09/15/29	200,000.00	205,396.14	
		BACR 5.088% 06/20/30	200,000.00	193,114.34	
		BACR 7.385% 11/02/28	200,000.00	211,840.51	
		BALN 3.4% 04/15/30	200,000.00	182,429.95	
		BATSLN 1.668% 03/25/26	100,000.00	94,096.09	
		BATSLN 3.734% 09/25/40	100,000.00	74,978.88	
		BATSLN 4.54% 08/15/47	100,000.00	78,457.90	
		BATSLN 7.75% 10/19/32	200,000.00	227,422.06	
		BAX 1.915% 02/01/27	100,000.00	92,177.69	
		BAYNGR 4.4% 07/15/44	200,000.00	153,159.70	
		BAYNGR 4.7% 07/15/64	100,000.00	74,593.88	
		BCECN 2.15% 02/15/32	100,000.00	80,638.70	
		BDX 4.298% 08/22/32	100,000.00	94,591.42	
		BDX 4.693% 02/13/28	100,000.00	99,109.77	
		BFB 4.75% 04/15/33	100,000.00	98,712.75	
		BFCM 4.753% 07/13/27	200,000.00	198,253.85	
		BFCM 4.935% 01/26/26	200,000.00	198,933.97	
		BG 2.75% 05/14/31	100,000.00	86,479.46	
		BHF 5.625% 05/15/30	100,000.00	101,903.29	
		BHI 4.08% 12/15/47	100,000.00	81,123.71	
		BHP 4.75% 02/28/28	100,000.00	99,788.61	
		BIIB 3.15% 05/01/50	100,000.00	65,608.25	
		BK 4.596% 07/26/30	100,000.00	98,461.36	
		BK 4.947% 04/26/27	200,000.00	199,517.08	
		BK 5.834% 10/25/33	100,000.00	104,523.92	
		BKH 3.05% 10/15/29	200,000.00	179,423.97	
		BKH 3.875% 10/15/49	100,000.00	72,565.24	
		BKH 6.15% 05/15/34	200,000.00	205,452.99	
		BKNG 4.625% 04/13/30	100,000.00	99,186.49	

		BLK 1.9% 01/28/31	100,000.00	83,710.21	
		BMO 0.949% 01/22/27	100,000.00	93,709.32	
		BMO 4.7% 09/14/27	100,000.00	99,157.81	
		BMW 3.45% 04/01/27	100,000.00	96,328.23	
		BMY 2.95% 03/15/32	100,000.00	87,055.62	
		BMY 3.55% 03/15/42	200,000.00	156,993.12	
		BMY 4.25% 10/26/49	100,000.00	82,601.47	
		BMY 4.625% 05/15/44	100,000.00	89,824.13	
		BMY 4.9% 02/22/29	200,000.00	200,842.33	
		BNP 1.904% 09/30/28	200,000.00	180,027.14	
		BNP 2.159% 09/15/29	200,000.00	176,341.14	
		BNP 5.738% 02/20/35	200,000.00	201,723.09	
		BNS 4.588% 05/04/37	100,000.00	90,806.34	
		BNS 4.75% 02/02/26	200,000.00	198,579.77	
		BNSF 2.875% 06/15/52	100,000.00	64,381.07	
		BNSF 3.05% 02/15/51	100,000.00	67,481.87	
		BNSF 4.05% 06/15/48	100,000.00	81,461.13	
		BOCAVI 2.625% 09/17/30	200,000.00	173,311.50	
		BOCAVI 4.875% 05/03/33	200,000.00	193,919.09	
		BPCEGP 1.652% 10/06/26	250,000.00	237,370.55	
		BPCEGP 3.116% 10/19/32	250,000.00	205,865.16	
		BPLN 3.001% 03/17/52	100,000.00	65,512.26	
		BPLN 3.06% 06/17/41	100,000.00	74,046.83	
		BPLN 3.543% 04/06/27	100,000.00	96,595.45	
		BPLN 4.893% 09/11/33	100,000.00	98,409.92	
		BRK 2.3% 03/15/27	100,000.00	94,116.38	
		BRK 2.875% 03/15/32	100,000.00	88,468.36	
		BRKHEC 2.85% 05/15/51	100,000.00	62,361.17	
		BRKHEC 3.65% 04/15/29	100,000.00	94,958.71	
		BRKHEC 3.7% 07/15/30	100,000.00	93,521.13	
		BRKHEC 3.95% 08/01/47	100,000.00	78,766.77	
		BRKHEC 4.45% 01/15/49	100,000.00	83,063.33	
		BRKHEC 5.3% 02/01/55	100,000.00	96,560.39	
		BRKHEC 5.35% 01/15/34	100,000.00	102,428.11	
		BRO 4.2% 03/17/32	200,000.00	183,846.56	
		BSX 2.65% 06/01/30	100,000.00	88,510.73	

		BWA 5% 10/01/25	200,000.00	198,094.85	
		BXP 3.25% 01/30/31	100,000.00	85,352.43	
		BXP 3.4% 06/21/29	100,000.00	89,644.91	
		BZLNZ 4.846% 02/07/28	250,000.00	249,132.00	
		C 1.122% 01/28/27	100,000.00	93,629.35	
		C 1.462% 06/09/27	100,000.00	93,133.27	
		C 2.904% 11/03/42	100,000.00	70,673.59	
		C 3.668% 07/24/28	100,000.00	95,821.99	
		C 4.65% 07/23/48	200,000.00	177,780.86	
		C 4.658% 05/24/28	200,000.00	197,750.19	
		C 4.75% 05/18/46	100,000.00	87,589.80	
		C 5.61% 09/29/26	100,000.00	100,175.94	
		C 5.827% 02/13/35	200,000.00	200,206.92	
		C 5.875% 01/30/42	300,000.00	312,948.29	
		C 6.27% 11/17/33	200,000.00	211,194.27	
		CABKSM 5.673% 03/15/30	200,000.00	201,136.34	
		CABKSM 6.684% 09/13/27	200,000.00	204,609.19	
		CAG 1.375% 11/01/27	100,000.00	88,631.17	
		CAG 5.3% 10/01/26	200,000.00	200,527.78	
		CAG 5.3% 11/01/38	100,000.00	95,364.21	
		CARGIL 3.25% 05/23/29	100,000.00	93,344.00	
		CARR 3.577% 04/05/50	200,000.00	147,594.92	
		CAT 3.25% 04/09/50	100,000.00	72,318.78	
		CAT 3.6% 08/12/27	100,000.00	96,664.27	
		CAT 4.85% 02/27/29	200,000.00	201,392.48	
		CB 1.375% 09/15/30	100,000.00	82,171.94	
		CB 2.85% 12/15/51	100,000.00	66,215.14	
		CBAAU 3.305% 03/11/41	200,000.00	147,610.89	
		CBAAU 3.9% 03/16/28	200,000.00	194,931.88	
		CCI 1.05% 07/15/26	100,000.00	91,964.52	
		CCI 3.25% 01/15/51	100,000.00	67,197.10	
		CCI 4.8% 09/01/28	100,000.00	98,432.10	
		CDEL 5.125% 02/02/33	200,000.00	192,340.82	
		CDEL 5.95% 01/08/34	200,000.00	202,131.44	
		CDEL 6.44% 01/26/36	200,000.00	208,606.07	
		CEG 5.6% 06/15/42	100,000.00	97,057.10	

		CENEXP 1.169% 08/21/26	200,000.00	183,608.00	
		CHD 5.6% 11/15/32	100,000.00	104,435.49	
		CHH 3.7% 01/15/31	100,000.00	88,666.89	
		CHTR 2.25% 01/15/29	100,000.00	85,998.63	
		CHTR 3.5% 06/01/41	100,000.00	67,831.32	
		CHTR 4.4% 04/01/33	100,000.00	88,984.02	
		CHTR 5.5% 04/01/63	100,000.00	78,406.01	
		CHTR 5.75% 04/01/48	100,000.00	84,418.42	
		CI 1.25% 03/15/26	42,000.00	39,372.48	
		CI 2.375% 03/15/31	100,000.00	84,707.57	
		CI 4.8% 07/15/46	200,000.00	177,572.12	
		CI 4.8% 08/15/38	100,000.00	93,168.09	
		CITNAT 1.375% 05/06/26	200,000.00	187,132.00	
		CL 4.8% 03/02/26	100,000.00	99,966.34	
		CLR 5.75% 01/15/31	100,000.00	99,338.16	
		CLX 1.8% 05/15/30	100,000.00	84,029.46	
		CM 3.6% 04/07/32	100,000.00	89,635.91	
		CMCSA 2.65% 02/01/30	100,000.00	89,120.55	
		CMCSA 2.8% 01/15/51	100,000.00	62,618.07	
		CMCSA 3.25% 11/01/39	100,000.00	77,987.68	
		CMCSA 3.9% 03/01/38	100,000.00	85,633.78	
		CMCSA 4% 03/01/48	100,000.00	79,545.70	
		CMCSA 5.25% 11/07/25	100,000.00	100,166.40	
		CMCSA 5.35% 05/15/53	100,000.00	96,903.59	
		CMCSA 5.35% 11/15/27	200,000.00	203,041.08	
		CMCSA 5.5% 05/15/64	100,000.00	97,772.33	
		CME 4.15% 06/15/48	100,000.00	85,036.41	
		CMS 4.75% 06/01/50	100,000.00	92,169.18	
		CNA 2.05% 08/15/30	100,000.00	83,854.88	
		CNC 4.625% 12/15/29	200,000.00	190,711.54	
		CNP 1.45% 06/01/26	100,000.00	93,299.47	
		CNP 2.65% 06/01/31	100,000.00	84,833.35	
		CNQCN 2.95% 07/15/30	100,000.00	88,309.33	
		CNRCN 2.45% 05/01/50	100,000.00	60,549.36	
		COF 3.273% 03/01/30	100,000.00	90,896.53	
		COF 4.927% 05/10/28	100,000.00	99,086.51	

		COF 5.268% 05/10/33	100,000.00	97,535.41	
		COF 5.7% 02/01/30	200,000.00	202,354.90	
		COP 3.8% 03/15/52	100,000.00	76,001.58	
		COP 4.875% 10/01/47	300,000.00	275,933.37	
		COST 1.375% 06/20/27	100,000.00	91,241.88	
		CP 3% 12/02/41	100,000.00	88,513.58	
		CP 4.95% 08/15/45	100,000.00	92,307.99	
		CPB 2.375% 04/24/30	100,000.00	86,869.99	
		CPPIBC 3.25% 06/15/27	250,000.00	240,698.57	
		CRM 1.5% 07/15/28	100,000.00	88,422.81	
		CSCO 2.5% 09/20/26	100,000.00	95,427.01	
		CSX 3.8% 03/01/28	100,000.00	96,618.75	
		CSX 4.1% 11/15/32	100,000.00	94,397.41	
		CSX 5.2% 11/15/33	200,000.00	202,294.07	
		CVECN 2.65% 01/15/32	100,000.00	83,321.31	
		CVS 1.75% 08/21/30	100,000.00	81,846.17	
		CVS 4.125% 04/01/40	100,000.00	81,456.18	
		CVS 4.78% 03/25/38	100,000.00	90,249.43	
		CVS 5.125% 02/21/30	200,000.00	199,127.03	
		CVS 5.125% 07/20/45	100,000.00	88,787.00	
		CVS 5% 02/20/26	100,000.00	99,567.99	
		CVS 6% 06/01/63	100,000.00	96,992.48	
		CVX 2.236% 05/11/30	200,000.00	174,532.48	
		CVX 6% 03/01/41	100,000.00	108,033.98	
		D 2.4% 03/30/32	100,000.00	83,075.64	
		D 3.3% 04/15/41	100,000.00	73,119.06	
		D 3.5% 03/15/27	100,000.00	96,466.56	
		D 5.45% 04/01/53	200,000.00	194,570.70	
		D 7% 06/01/54	100,000.00	104,592.70	
		DANBNK 4.298% 04/01/28	200,000.00	194,568.80	
		DB 4.875% 12/01/32	200,000.00	189,650.10	
		DB 7.146% 07/13/27	300,000.00	308,325.18	
		DBSSP 1.822% 03/10/31	200,000.00	188,482.60	
		DD 4.725% 11/15/28	100,000.00	100,056.09	
		DE 0.7% 01/15/26	100,000.00	93,882.39	
		DE 2% 06/17/31	100,000.00	83,319.08	

		DE 3.1% 04/15/30	100,000.00	91,457.28	
		DE 4.75% 01/20/28	300,000.00	299,957.60	
		DELL 3.45% 12/15/51	37,000.00	25,479.05	
		DFS 4.5% 01/30/26	100,000.00	98,323.31	
		DG 4.125% 04/03/50	100,000.00	76,809.72	
		DGELN 5.2% 10/24/25	200,000.00	199,979.66	
		DGX 2.8% 06/30/31	100,000.00	86,425.12	
		DHR 3.25% 11/15/39	100,000.00	79,792.66	
		DIS 1.75% 01/13/26	200,000.00	190,486.82	
		DIS 2.75% 09/01/49	100,000.00	64,434.28	
		DIS 3.5% 05/13/40	100,000.00	80,839.11	
		DIS 3.6% 01/13/51	100,000.00	75,557.96	
		DIS 3.7% 03/23/27	100,000.00	97,342.54	
		DIS 6.2% 12/15/34	100,000.00	109,742.12	
		DKS 4.1% 01/15/52	100,000.00	71,684.56	
		DLTR 4.2% 05/15/28	100,000.00	96,502.00	
		DNBNO 1.535% 05/25/27	200,000.00	186,280.10	
		DOW 3.6% 11/15/50	100,000.00	70,958.66	
		DOW 6.3% 03/15/33	100,000.00	106,235.20	
		DT 4.375% 06/21/28	150,000.00	146,698.15	
		DT 4.75% 06/21/38	150,000.00	141,056.98	
		DTE 3% 03/01/32	100,000.00	87,257.35	
		DTE 5.4% 04/01/53	100,000.00	98,855.90	
		DUK 3.25% 08/15/25	100,000.00	97,991.90	
		DUK 3.3% 06/15/41	200,000.00	146,892.14	
		DUK 3.64% 11/01/46	100,000.00	72,596.20	
		DUK 3.7% 09/01/28	100,000.00	95,827.61	
		DUK 5.25% 03/15/33	100,000.00	100,710.61	
		DUK 5.25% 04/01/33	100,000.00	100,510.43	
		DUK 5.35% 01/15/53	200,000.00	192,936.98	
		DUK 5.55% 03/15/54	200,000.00	196,620.39	
		DUK 5% 08/15/52	100,000.00	88,425.22	
		DVN 4.5% 01/15/30	100,000.00	96,816.36	
		EBAY 1.4% 05/10/26	100,000.00	93,427.02	
		EBAY 3.65% 05/10/51	100,000.00	72,269.95	
		ECL 3.95% 12/01/47	100,000.00	82,083.31	

		ECL 5.25% 01/15/28	200,000.00	202,826.29	
		EDF 4.875% 09/21/38	200,000.00	181,860.77	
		EDF 5.7% 05/23/28	200,000.00	203,892.77	
		EDF 6.9% 05/23/53	200,000.00	218,337.05	
		EFX 2.35% 09/15/31	100,000.00	82,951.56	
		EIX 2.25% 06/01/30	100,000.00	85,721.25	
		EIX 4.125% 03/01/48	100,000.00	79,008.12	
		EIX 4.9% 06/01/26	200,000.00	198,929.44	
		EIX 5.2% 06/01/34	200,000.00	197,175.91	
		EIX 5.95% 11/01/32	100,000.00	104,294.50	
		EL 4.375% 05/15/28	200,000.00	197,017.85	
		ELV 4.75% 02/15/33	100,000.00	97,400.64	
		ELV 4.9% 02/08/26	100,000.00	99,451.46	
		ELV 5.125% 02/15/53	100,000.00	93,235.28	
		EMN 5.75% 03/08/33	100,000.00	101,361.27	
		EMR 2.2% 12/21/31	100,000.00	84,273.30	
		ENBCN 3.4% 08/01/51	100,000.00	68,616.06	
		ENBCN 5.7% 03/08/33	100,000.00	101,912.52	
		ENELIM 1.875% 07/12/28	200,000.00	177,780.63	
		ENELIM 2.875% 07/12/41	200,000.00	132,836.74	
		ENELIM 4.75% 05/25/47	200,000.00	169,282.74	
		ENIIM 4.25% 05/09/29	200,000.00	193,559.58	
		EOG 4.375% 04/15/30	100,000.00	98,118.04	
		EPD 3.7% 01/31/51	100,000.00	75,247.72	
		EPD 3.7% 02/15/26	100,000.00	97,763.05	
		EPD 4.25% 02/15/48	100,000.00	82,992.03	
		EPD 7.55% 04/15/38	100,000.00	119,716.53	
		EQH 4.35% 04/20/28	100,000.00	97,176.76	
		EQH 5% 04/20/48	68,000.00	61,807.06	
		EQIX 1% 09/15/25	100,000.00	94,979.54	
		EQIX 2.5% 05/15/31	100,000.00	84,668.33	
		EQNR 3.625% 04/06/40	100,000.00	81,901.35	
		EQNR 3.7% 04/06/50	200,000.00	154,089.57	
		EQR 1.85% 08/01/31	100,000.00	81,273.50	
		ES 3.45% 01/15/50	100,000.00	69,736.32	
		ES 4.75% 05/15/26	100,000.00	99,030.79	

		ES 5.45% 03/01/28	100,000.00	100,769.62	
		ET 4.15% 09/15/29	100,000.00	95,452.40	
		ET 5.55% 02/15/28	100,000.00	101,224.40	
		ET 5.6% 09/01/34	200,000.00	200,648.00	
		ET 5.75% 02/15/33	100,000.00	101,782.80	
		ET 5.8% 06/15/38	100,000.00	99,565.28	
		ET 6% 06/15/48	100,000.00	98,221.56	
		ETR 1.9% 06/15/28	100,000.00	88,595.14	
		ETR 2.4% 06/15/31	100,000.00	83,290.15	
		EXC 3.35% 03/15/32	100,000.00	88,508.38	
		EXC 4.1% 03/15/52	100,000.00	77,897.38	
		EXC 5.15% 03/15/28	100,000.00	100,226.80	
		EXPE 4.625% 08/01/27	200,000.00	197,425.80	
		F 6.95% 06/10/26	200,000.00	204,476.87	
		F 7.35% 03/06/30	200,000.00	213,277.63	
		F 7.35% 11/04/27	400,000.00	418,805.05	
		FANG 4.4% 03/24/51	100,000.00	81,346.75	
		FANG 5.9% 04/18/64	200,000.00	197,058.34	
		FCX 4.125% 03/01/28	100,000.00	95,974.48	
		FCX 4.25% 03/01/30	100,000.00	95,410.93	
		FDX 2.4% 05/15/31	100,000.00	85,426.87	
		FDX 3.1% 08/05/29	100,000.00	92,134.84	
		FDX 3.25% 05/15/41	200,000.00	149,166.68	
		FDX 4.05% 02/15/48	100,000.00	78,771.57	
		FDX 5.25% 05/15/50	100,000.00	94,469.99	
		FE 4.55% 11/15/30	100,000.00	95,198.01	
		FI 5.6% 03/02/33	100,000.00	102,103.28	
		FIS 2.25% 03/01/31	100,000.00	84,296.69	
		FIS 3.1% 03/01/41	100,000.00	72,597.17	
		FISV 5.45% 03/02/28	100,000.00	101,619.16	
		FITB 1.707% 11/01/27	100,000.00	92,122.25	
		FITB 4.772% 07/28/30	100,000.00	97,032.81	
		FLEX 6% 01/15/28	100,000.00	101,826.08	
		FMC 3.45% 10/01/29	100,000.00	90,641.10	
		FMC 5.15% 05/18/26	100,000.00	99,663.81	
		FNF 2.45% 03/15/31	100,000.00	82,390.06	

		FOXA 4.709% 01/25/29	100,000.00	98,918.96	
		FUKOKU 6.8% PERP	200,000.00	208,499.96	
		GD 2.85% 06/01/41	100,000.00	72,708.82	
		GD 4.25% 04/01/40	100,000.00	88,871.32	
		GE 4.35% 05/01/50	100,000.00	86,150.40	
		GE 4.5% 03/11/44	100,000.00	87,457.53	
		GEHC 5.857% 03/15/30	100,000.00	103,605.83	
		GILD 1.2% 10/01/27	100,000.00	89,246.58	
		GILD 2.8% 10/01/50	100,000.00	63,663.84	
		GILD 5.25% 10/15/33	200,000.00	203,047.39	
		GIS 4.95% 03/29/33	100,000.00	98,313.80	
		GIS 5.5% 10/17/28	100,000.00	102,051.44	
		GLENLN 1.625% 04/27/26	100,000.00	93,760.65	
		GLW 5.45% 11/15/79	100,000.00	92,816.17	
		GM 1.25% 01/08/26	200,000.00	188,038.88	
		GM 3.1% 01/12/32	100,000.00	85,231.55	
		GM 5.25% 03/01/26	100,000.00	99,767.16	
		GM 5.4% 04/01/48	100,000.00	90,937.56	
		GM 5.4% 10/15/29	100,000.00	100,312.62	
		GM 5% 04/09/27	100,000.00	99,465.77	
		GMT 3.5% 06/01/32	100,000.00	87,527.44	
		GMT 4% 06/30/30	100,000.00	93,823.82	
		GMT 5.45% 09/15/33	100,000.00	100,283.46	
		GOOGL 1.9% 08/15/40	100,000.00	66,382.67	
		GOOGL 2.05% 08/15/50	100,000.00	58,050.65	
		GPN 1.2% 03/01/26	200,000.00	187,012.64	
		GPN 4.95% 08/15/27	100,000.00	99,446.24	
		GPN 5.95% 08/15/52	100,000.00	97,997.75	
		GS 1.431% 03/09/27	400,000.00	374,840.20	
		GS 2.6% 02/07/30	100,000.00	88,371.87	
		GS 3.102% 02/24/33	200,000.00	172,212.98	
		GS 3.8% 03/15/30	200,000.00	188,632.28	
		GS 3.85% 01/26/27	100,000.00	97,141.04	
		GS 4.411% 04/23/39	100,000.00	89,667.36	
		GS 4.482% 08/23/28	500,000.00	491,177.69	
		GS 6.75% 10/01/37	100,000.00	109,625.67	

		GSK 3.375% 06/01/29	100,000.00	94,297.84	
		HAL 2.92% 03/01/30	200,000.00	180,269.79	
		HAS 3.55% 11/19/26	100,000.00	95,914.88	
		HBAN 4.443% 08/04/28	100,000.00	97,489.13	
		HCA 2.375% 07/15/31	100,000.00	82,895.51	
		HCA 3.125% 03/15/27	200,000.00	189,863.53	
		HCA 4.375% 03/15/42	100,000.00	83,005.59	
		HCA 5.6% 04/01/34	200,000.00	200,322.00	
		HCA 5.625% 09/01/28	100,000.00	101,395.02	
		HD 0.9% 03/15/28	100,000.00	87,683.47	
		HD 3.3% 04/15/40	100,000.00	78,836.24	
		HD 3.625% 04/15/52	100,000.00	75,132.89	
		HD 4% 09/15/25	100,000.00	98,801.42	
		HES 5.8% 04/01/47	100,000.00	102,146.58	
		HIG 4.4% 03/15/48	100,000.00	84,310.81	
		HNDA 1.8% 01/13/31	100,000.00	82,501.36	
		HNDA 4.7% 01/12/28	100,000.00	99,483.60	
		HNDA 4.75% 01/12/26	100,000.00	99,400.09	
		HON 2.5% 11/01/26	100,000.00	94,976.55	
		HON 4.5% 01/15/34	300,000.00	291,419.82	
		HPQ 4% 04/15/29	100,000.00	95,787.97	
		HSBC 6.161% 03/09/29	200,000.00	205,930.84	
		HSBC 6.5% 09/15/37	100,000.00	104,532.30	
		HSBC 7.336% 11/03/26	200,000.00	204,723.31	
		HSY 2.65% 06/01/50	100,000.00	63,373.36	
		HUM 5.7% 03/13/26	100,000.00	100,001.40	
		HUM 5.75% 12/01/28	200,000.00	204,953.48	
		HYNMTR 1.5% 06/15/26	100,000.00	93,046.56	
		HYNMTR 5.8% 04/01/30	100,000.00	102,464.25	
		HYUELE 1.5% 01/19/26	200,000.00	188,391.77	
		IBM 3.5% 05/15/29	100,000.00	94,013.30	
		IBM 4.15% 07/27/27	100,000.00	98,094.56	
		IBM 4.5% 02/06/26	100,000.00	99,245.71	
		IBM 4.5% 02/06/28	200,000.00	198,408.07	
		IBM 4.75% 02/06/33	100,000.00	98,317.88	
		IBM 5.1% 02/06/53	100,000.00	95,142.22	

		ICE 2.65% 09/15/40	100,000.00	70,522.00	
		ICE 5.2% 06/15/62	100,000.00	94,980.00	
		IFCCN 5.459% 09/22/32	100,000.00	100,222.71	
		IFF 1.23% 10/01/25	100,000.00	94,922.64	
		IFF 3.268% 11/15/40	100,000.00	71,766.09	
		IMBLN 3.875% 07/26/29	200,000.00	186,269.94	
		INTC 2.45% 11/15/29	100,000.00	88,482.39	
		INTC 4.875% 02/10/26	100,000.00	99,588.06	
		INTC 5.2% 02/10/33	100,000.00	100,704.30	
		INTC 5.625% 02/10/43	100,000.00	100,585.89	
		INTC 5.7% 02/10/53	100,000.00	100,009.87	
		IPG 3.375% 03/01/41	100,000.00	74,192.53	
		ISPIM 7% 11/21/25	200,000.00	203,444.80	
		ISPIM 8.248% 11/21/33	200,000.00	223,234.80	
		J 5.9% 03/01/33	100,000.00	100,965.56	
		J 6.35% 08/18/28	200,000.00	207,420.30	
		JAPTOB 2.25% 09/14/31	200,000.00	165,427.70	
		JBL 1.7% 04/15/26	200,000.00	187,446.34	
		JCI 4.5% 02/15/47	100,000.00	84,486.59	
		JD 3.375% 01/14/30	200,000.00	183,986.78	
		JEF 2.625% 10/15/31	100,000.00	81,957.05	
		JEF 2.75% 10/15/32	200,000.00	161,460.93	
		JNJ 0.55% 09/01/25	100,000.00	95,205.41	
		JNJ 1.3% 09/01/30	200,000.00	166,319.46	
		JNJ 2.1% 09/01/40	100,000.00	67,434.53	
		JPM 1.04% 02/04/27	200,000.00	187,059.62	
		JPM 1.47% 09/22/27	100,000.00	92,308.54	
		JPM 2.963% 01/25/33	200,000.00	172,178.58	
		JPM 3.157% 04/22/42	200,000.00	151,210.21	
		JPM 3.782% 02/01/28	100,000.00	96,765.75	
		JPM 3.897% 01/23/49	400,000.00	321,112.86	
		JPM 3.96% 01/29/27	400,000.00	392,024.67	
		JPM 4.26% 02/22/48	200,000.00	170,859.46	
		JPM 4.323% 04/26/28	300,000.00	294,167.31	
		JPM 4.565% 06/14/30	100,000.00	97,799.50	
		JPM 5.625% 08/16/43	200,000.00	207,293.54	

		K 5.25% 03/01/33	100,000.00	99,967.55	
		KD 4.1% 10/15/41	100,000.00	77,261.79	
		KDP 3.95% 04/15/29	100,000.00	95,866.26	
		KEY 4.7% 01/26/26	250,000.00	245,985.79	
		KHC 4.875% 10/01/49	100,000.00	88,726.72	
		KHC 6.5% 02/09/40	100,000.00	108,065.57	
		KIM 1.9% 03/01/28	100,000.00	89,633.54	
		KLAC 5% 03/15/49	100,000.00	94,777.62	
		KMB 3.2% 04/25/29	100,000.00	93,823.78	
		KMI 1.75% 11/15/26	100,000.00	92,664.00	
		KMI 3.6% 02/15/51	200,000.00	138,544.06	
		KMI 5.2% 03/01/48	100,000.00	90,013.44	
		KMI 5.2% 06/01/33	100,000.00	97,968.68	
		KO 1.375% 03/15/31	100,000.00	81,129.16	
		KO 1.45% 06/01/27	100,000.00	91,679.35	
		KO 2.5% 06/01/40	100,000.00	71,037.44	
		KO 3.375% 03/25/27	100,000.00	96,835.98	
		KO 3% 03/05/51	100,000.00	68,462.20	
		KOROIL 4.75% 04/03/26	200,000.00	198,502.89	
		KR 4.45% 02/01/47	100,000.00	83,415.53	
		LH 2.95% 12/01/29	100,000.00	89,901.07	
		LHX 1.8% 01/15/31	100,000.00	81,708.14	
		LIN 1.1% 08/10/30	100,000.00	81,225.96	
		LIN 2% 08/10/50	100,000.00	54,705.87	
		LLOYDS 4.716% 08/11/26	400,000.00	396,156.74	
		LLY 3.375% 03/15/29	100,000.00	95,071.20	
		LLY 4.15% 03/15/59	100,000.00	83,100.24	
		LLY 5.1% 02/09/64	200,000.00	193,354.19	
		LMT 4.95% 10/15/25	200,000.00	199,715.46	
		LMT 5.2% 02/15/64	200,000.00	193,283.10	
		LMT 5.7% 11/15/54	100,000.00	104,668.64	
		LNC 4.35% 03/01/48	100,000.00	77,337.73	
		LNG 5.65% 04/15/34	200,000.00	201,543.00	
		LOW 2.8% 09/15/41	200,000.00	139,130.75	
		LOW 4.05% 05/03/47	100,000.00	78,518.41	
		LOW 5.15% 07/01/33	100,000.00	100,502.42	

		LOW 5.625% 04/15/53	100,000.00	98,517.75	
		LOW 5.75% 07/01/53	200,000.00	200,593.61	
		LRCX 4% 03/15/29	100,000.00	96,865.82	
		LUV 5.125% 06/15/27	100,000.00	99,884.37	
		LYB 3.375% 10/01/40	100,000.00	74,112.79	
		LYB 4.2% 05/01/50	100,000.00	77,362.07	
		MA 2.95% 03/15/51	100,000.00	67,114.03	
		MA 3.3% 03/26/27	100,000.00	96,348.78	
		MA 3.95% 02/26/48	100,000.00	81,743.82	
		MAERSK 4.5% 06/20/29	100,000.00	98,244.24	
		MAR 2.75% 10/15/33	200,000.00	163,502.41	
		MAR 4.625% 06/15/30	100,000.00	97,805.76	
		MARUB 1.577% 09/17/26	200,000.00	184,637.60	
		MBGGR 5.375% 11/26/25	150,000.00	150,470.70	
		MCD 2.125% 03/01/30	100,000.00	86,611.67	
		MCD 3.5% 07/01/27	100,000.00	96,239.64	
		MCD 3.625% 09/01/49	100,000.00	73,704.22	
		MCD 4.2% 04/01/50	100,000.00	81,102.76	
		MCD 4.6% 09/09/32	100,000.00	97,650.57	
		MCK 5.25% 02/15/26	100,000.00	99,900.28	
		MCO 2.75% 08/19/41	100,000.00	70,087.11	
		MDLZ 1.5% 02/04/31	100,000.00	80,585.72	
		MDLZ 2.625% 03/17/27	100,000.00	94,127.42	
		MDT 4.25% 03/30/28	100,000.00	98,182.41	
		MDT 4.375% 03/15/35	100,000.00	94,991.78	
		MET 5.25% 01/15/54	200,000.00	192,811.01	
		MET 5% 01/06/26	150,000.00	149,588.59	
		META 4.6% 05/15/28	100,000.00	100,163.54	
		META 4.65% 08/15/62	100,000.00	87,720.03	
		META 5.6% 05/15/53	100,000.00	103,554.23	
		MFCCN 3.703% 03/16/32	100,000.00	91,696.95	
		MITCO 1.125% 07/15/26	200,000.00	184,828.00	
		MITHCC 3.967% 04/13/30	200,000.00	186,587.95	
		MITHCC 5.08% 09/15/27	200,000.00	199,614.36	
		MIZUHO 2.564% 09/13/31	200,000.00	163,755.87	
		MIZUHO 5.414% 09/13/28	200,000.00	201,312.62	

		MKC 0.9% 02/15/26	100,000.00	93,414.60	
		MKC 2.5% 04/15/30	100,000.00	87,486.78	
		MKL 5% 05/20/49	100,000.00	89,670.93	
		MLM 4.25% 12/15/47	100,000.00	82,415.48	
		MMC 4.2% 03/01/48	100,000.00	82,379.92	
		MMC 4.75% 03/15/39	100,000.00	93,809.06	
		MMM 2.375% 08/26/29	200,000.00	176,462.36	
		MO 3.4% 02/04/41	100,000.00	73,126.37	
		MO 4.4% 02/14/26	100,000.00	98,634.19	
		MO 5.8% 02/14/39	100,000.00	101,433.47	
		MO 5.95% 02/14/49	100,000.00	100,105.87	
		MPC 3.8% 04/01/28	100,000.00	95,836.91	
		MPLX 2.65% 08/15/30	100,000.00	86,927.59	
		MPLX 4.5% 04/15/38	200,000.00	176,912.87	
		MPLX 5.2% 12/01/47	100,000.00	89,299.57	
		MQGAU 2.871% 01/14/33	100,000.00	83,326.26	
		MQGAU 4.098% 06/21/28	100,000.00	96,852.10	
		MRK 2.15% 12/10/31	200,000.00	167,694.57	
		MRK 3.4% 03/07/29	100,000.00	94,906.22	
		MRO 6.6% 10/01/37	200,000.00	219,756.48	
		MRVL 5.75% 02/15/29	200,000.00	205,290.30	
		MS 1.593% 05/04/27	200,000.00	187,347.46	
		MS 2.475% 01/21/28	300,000.00	280,955.77	
		MS 3.217% 04/22/42	100,000.00	76,007.00	
		MS 3.622% 04/01/31	200,000.00	184,987.51	
		MS 4.457% 04/22/39	100,000.00	90,597.22	
		MS 5.449% 07/20/29	200,000.00	202,526.24	
		MS 5.597% 03/24/51	100,000.00	102,887.69	
		MS 5.656% 04/18/30	300,000.00	306,810.77	
		MS 5.942% 02/07/39	200,000.00	199,775.19	
		MS 6.296% 10/18/28	100,000.00	103,564.87	
		MSCI 3.25% 08/15/33	100,000.00	82,970.06	
		MSFT 1.35% 09/15/30	100,000.00	83,364.53	
		MSFT 2.525% 06/01/50	200,000.00	128,856.16	
		MSFT 2.921% 03/17/52	100,000.00	69,251.76	
		MSFT 3.3% 02/06/27	100,000.00	97,040.33	

		MSFT 4.1% 02/06/37	100,000.00	94,923.23	
		MSI 5.6% 06/01/32	100,000.00	101,718.79	
		MTB 6.082% 03/13/32	100,000.00	100,926.69	
		MTNA 4.25% 07/16/29	100,000.00	95,893.98	
		MTNA 4.55% 03/11/26	100,000.00	98,489.42	
		MTNA 6.55% 11/29/27	100,000.00	103,499.21	
		MU 4.185% 02/15/27	100,000.00	97,672.87	
		MU 5.875% 09/15/33	100,000.00	103,298.12	
		MUFG 4.286% 07/26/38	100,000.00	91,658.48	
		MUFG 4.7% 03/10/44	200,000.00	182,968.39	
		MUFG 5.133% 07/20/33	200,000.00	198,890.64	
		MUNRE 5.875% 05/23/42	200,000.00	200,826.20	
		MYLIFE 5.1% 04/26/48	200,000.00	197,186.58	
		NAB 4.966% 01/12/26	250,000.00	249,678.90	
		NDAQ 1.65% 01/15/31	100,000.00	81,055.80	
		NDAQ 5.35% 06/28/28	200,000.00	202,924.01	
		NDAQ 5.55% 02/15/34	100,000.00	101,173.54	
		NDASS 4.75% 09/22/25	200,000.00	198,875.14	
		NEE 1.875% 01/15/27	100,000.00	92,494.35	
		NEE 1.9% 06/15/28	200,000.00	177,892.74	
		NEE 2.45% 02/03/32	100,000.00	84,103.99	
		NEE 3.95% 03/01/48	100,000.00	80,105.80	
		NEE 5.05% 04/01/28	100,000.00	100,693.74	
		NEE 5.25% 02/28/53	100,000.00	93,640.32	
		NEM 5.875% 04/01/35	100,000.00	104,691.75	
		NESNVX 4.95% 03/14/30	150,000.00	151,286.80	
		NESNVX 4% 09/24/48	150,000.00	123,193.11	
		NESNVX 5.25% 03/13/26	150,000.00	150,874.54	
		NFG 5.5% 01/15/26	100,000.00	99,935.37	
		NFLX 4.875% 06/15/30	100,000.00	99,287.87	
		NFLX 5.875% 11/15/28	100,000.00	103,708.20	
		NI 0.95% 08/15/25	100,000.00	95,237.35	
		NI 4.375% 05/15/47	100,000.00	82,159.84	
		NIPLIF 2.75% 01/21/51	200,000.00	167,343.54	
		NIPLIF 2.9% 09/16/51	200,000.00	166,707.35	
		NKE 3.25% 03/27/40	100,000.00	78,956.79	

		NKE 3.375% 03/27/50	100,000.00	72,938.49	
		NNN 3.5% 04/15/51	100,000.00	70,609.26	
		NOC 4.9% 06/01/34	100,000.00	98,181.77	
		NOC 5.15% 05/01/40	100,000.00	96,805.83	
		NOMURA 1.653% 07/14/26	200,000.00	185,528.34	
		NOMURA 5.605% 07/06/29	200,000.00	202,309.83	
		NOMURA 6.087% 07/12/33	200,000.00	209,403.93	
		NOV 3.6% 12/01/29	100,000.00	92,525.64	
		NOVNVX 2.2% 08/14/30	100,000.00	87,251.21	
		NOVNVX 2% 02/14/27	100,000.00	93,400.40	
		NRG 2.45% 12/02/27	100,000.00	90,885.50	
		NRUC 2.75% 04/15/32	200,000.00	169,941.69	
		NRUC 4.3% 03/15/49	100,000.00	83,094.57	
		NSC 3% 03/15/32	100,000.00	87,104.75	
		NSC 4.15% 02/28/48	100,000.00	80,978.66	
		NTRCN 5.8% 03/27/53	100,000.00	99,861.77	
		NTRS 3.65% 08/03/28	100,000.00	96,033.64	
		NTT 2.065% 04/03/31	200,000.00	165,931.90	
		NUE 3.85% 04/01/52	100,000.00	76,927.51	
		NVDA 3.5% 04/01/50	100,000.00	77,753.16	
		NWG 5.516% 09/30/28	200,000.00	201,278.72	
		NWIDE 4.85% 07/27/27	200,000.00	198,569.25	
		OC 3.95% 08/15/29	100,000.00	95,151.65	
		OGS 4.25% 09/01/32	100,000.00	96,607.78	
		OHI 3.625% 10/01/29	100,000.00	90,160.15	
		OKE 5.2% 07/15/48	100,000.00	89,801.91	
		OKE 6.1% 11/15/32	100,000.00	104,411.09	
		OMC 2.6% 08/01/31	100,000.00	85,106.92	
		ORCL 1.65% 03/25/26	200,000.00	188,432.29	
		ORCL 2.875% 03/25/31	200,000.00	174,806.70	
		ORCL 3.65% 03/25/41	200,000.00	155,556.56	
		ORCL 4.1% 03/25/61	100,000.00	73,572.40	
		ORCL 4.5% 05/06/28	100,000.00	98,756.60	
		ORCL 4.9% 02/06/33	100,000.00	98,315.88	
		ORCL 6.9% 11/09/52	100,000.00	114,002.82	
		ORIX 2.25% 03/09/31	100,000.00	84,244.88	

		ORIX 5% 09/13/27	100,000.00	99,962.72	
		OTIS 3.112% 02/15/40	100,000.00	75,410.56	
		OXY 5.5% 12/01/25	100,000.00	99,955.43	
		OXY 6.45% 09/15/36	100,000.00	105,250.79	
		OXY 6.6% 03/15/46	100,000.00	105,245.50	
		PARA 4.95% 01/15/31	100,000.00	92,223.74	
		PCG 3.3% 08/01/40	100,000.00	71,747.03	
		PCG 4.2% 06/01/41	200,000.00	158,227.94	
		PCG 4.55% 07/01/30	100,000.00	95,454.64	
		PCG 4.95% 07/01/50	100,000.00	83,854.64	
		PCG 5.45% 06/15/27	200,000.00	200,780.22	
		PCP 4.375% 06/15/45	100,000.00	88,832.90	
		PEAK 2.125% 12/01/28	100,000.00	88,756.24	
		PEAK 5.25% 12/15/32	200,000.00	198,285.87	
		PEG 0.95% 03/15/26	100,000.00	93,711.79	
		PEG 4.05% 05/01/48	100,000.00	81,534.17	
		PEG 5.2% 08/01/33	100,000.00	100,997.28	
		PEP 1.95% 10/21/31	100,000.00	82,807.69	
		PEP 3.6% 02/18/28	100,000.00	96,596.67	
		PEP 4.65% 02/15/53	100,000.00	91,267.00	
		PEP 4% 05/02/47	100,000.00	82,920.89	
		PERTIJ 1.4% 02/09/26	200,000.00	187,422.50	
		PERTIJ 2.3% 02/09/31	200,000.00	166,734.00	
		PETMK 4.55% 04/21/50	200,000.00	174,389.25	
		PFE 2.55% 05/28/40	100,000.00	70,542.43	
		PFE 3.9% 03/15/39	100,000.00	86,654.26	
		PFE 4.45% 05/19/26	200,000.00	198,094.61	
		PFE 4.65% 05/19/30	100,000.00	99,215.56	
		PFE 4% 03/15/49	100,000.00	81,824.80	
		PFG 3.7% 05/15/29	100,000.00	94,287.95	
		PFG 5.5% 03/15/53	200,000.00	193,964.33	
		PG 1% 04/23/26	100,000.00	93,774.52	
		PG 3.55% 03/25/40	100,000.00	84,291.18	
		PGR 2.5% 03/15/27	100,000.00	94,107.53	
		PH 4.5% 09/15/29	100,000.00	98,044.68	
		PKG 4.05% 12/15/49	100,000.00	79,963.61	

		PLD 4.75% 06/15/33	100,000.00	97,345.81	
		PLD 4.875% 06/15/28	200,000.00	200,125.54	
		PLD 5.25% 06/15/53	100,000.00	96,370.23	
		PLNIJ 4% 06/30/50	200,000.00	144,760.28	
		PM 4.875% 02/13/26	100,000.00	99,573.50	
		PM 5.375% 02/15/33	100,000.00	100,360.45	
		PM 5.75% 11/17/32	200,000.00	206,452.00	
		PNC 2.55% 01/22/30	100,000.00	88,445.30	
		PNC 4.758% 01/26/27	100,000.00	99,042.96	
		POHANG 5.75% 01/17/28	200,000.00	203,151.31	
		POWFIN 3.95% 04/23/30	200,000.00	185,233.50	
		PPG 2.55% 06/15/30	100,000.00	88,264.67	
		PPL 4.125% 04/15/30	100,000.00	94,917.67	
		PRU 1.5% 03/10/26	100,000.00	94,339.60	
		PRU 3.935% 12/07/49	100,000.00	77,204.06	
		PRU 6.75% 03/01/53	100,000.00	102,619.90	
		PRUFIN 3.625% 03/24/32	200,000.00	179,742.70	
		PSA 1.5% 11/09/26	100,000.00	92,494.23	
		PSA 5.1% 08/01/33	100,000.00	99,981.00	
		PSPCAP 1.625% 10/26/28	250,000.00	221,861.46	
		PSX 3.3% 03/15/52	100,000.00	66,321.98	
		PSX 4.68% 02/15/45	100,000.00	86,052.10	
		PSX 4.95% 12/01/27	100,000.00	100,154.10	
		PTTEPT 2.993% 01/15/30	200,000.00	179,748.03	
		PXD 5.1% 03/29/26	100,000.00	100,056.30	
		PYPL 4.4% 06/01/32	100,000.00	96,200.61	
		QCOM 1.65% 05/20/32	100,000.00	79,584.15	
		QCOM 6% 05/20/53	100,000.00	109,400.39	
		R 2.85% 03/01/27	100,000.00	94,602.28	
		R 3.35% 09/01/25	100,000.00	97,614.95	
		RABOBK 1.106% 02/24/27	250,000.00	233,292.29	
		RABOBK 4.655% 08/22/28	250,000.00	245,374.70	
		RCICN 4.5% 03/15/42	200,000.00	171,499.05	
		RDSALN 2.75% 04/06/30	100,000.00	89,827.85	
		RDSALN 2.875% 11/26/41	100,000.00	71,978.95	
		RDSALN 3.25% 04/06/50	200,000.00	141,083.87	

		RECLIN 5.625% 04/11/28	200,000.00	201,784.70	
		RGA 6% 09/15/33	100,000.00	102,900.72	
		RILIN 3.625% 01/12/52	250,000.00	178,851.79	
		RIOLN 5.125% 03/09/53	100,000.00	95,529.97	
		ROP 1% 09/15/25	100,000.00	95,023.66	
		ROSW 0.991% 03/05/26	200,000.00	187,640.08	
		ROSW 2.076% 12/13/31	200,000.00	165,311.63	
		RPRX 1.2% 09/02/25	100,000.00	95,200.89	
		RPRX 2.2% 09/02/30	100,000.00	83,865.00	
		RRX 6.05% 02/15/26	100,000.00	100,556.68	
		RSG 5% 04/01/34	100,000.00	99,012.16	
		RTX 1.9% 09/01/31	100,000.00	81,170.86	
		RTX 4.35% 04/15/47	100,000.00	84,148.13	
		RTX 5.75% 01/15/29	200,000.00	206,346.82	
		RTX 5% 02/27/26	100,000.00	99,765.92	
		RVTY 2.55% 03/15/31	100,000.00	84,522.65	
		RY 1.2% 04/27/26	200,000.00	186,589.05	
		RY 3.625% 05/04/27	100,000.00	96,501.77	
		RY 4.875% 01/12/26	100,000.00	99,532.26	
		RY 6% 11/01/27	100,000.00	103,129.41	
		SANUK 6.534% 01/10/29	200,000.00	206,341.29	
		SANUSA 6.499% 03/09/29	100,000.00	102,395.17	
		SBUX 4.45% 08/15/49	100,000.00	83,818.64	
		SBUX 4.8% 02/15/33	100,000.00	98,561.07	
		SCHW 2.45% 03/03/27	100,000.00	93,777.44	
		SCHW 3.25% 05/22/29	100,000.00	92,942.07	
		SCHW 5.853% 05/19/34	100,000.00	103,291.80	
		SF 4% 05/15/30	100,000.00	92,916.23	
		SHBASS 1.418% 06/11/27	250,000.00	231,808.00	
		SHBASS 3.95% 06/10/27	250,000.00	243,996.51	
		SHW 2.3% 05/15/30	100,000.00	86,336.50	
		SHW 3.45% 06/01/27	100,000.00	95,733.41	
		SJM 2.75% 09/15/41	300,000.00	201,486.39	
		SLB 2.65% 06/26/30	100,000.00	88,929.80	
		SNA 4.1% 03/01/48	100,000.00	82,577.06	
		SNX 1.75% 08/09/26	200,000.00	185,490.74	

		SO 3.7% 04/30/30	100,000.00	93,077.20	
		SO 3.7% 12/01/47	100,000.00	75,936.26	
		SO 4.25% 07/01/36	100,000.00	89,576.26	
		SO 4.65% 05/16/28	200,000.00	198,266.72	
		SO 4.7% 05/15/32	100,000.00	97,426.13	
		SOCGEN 3.653% 07/08/35	200,000.00	171,306.99	
		SOCGEN 4.027% 01/21/43	200,000.00	141,615.78	
		SOCGEN 6.447% 01/12/27	200,000.00	201,787.00	
		SPG 1.375% 01/15/27	100,000.00	91,519.21	
		SPG 2.45% 09/13/29	100,000.00	88,573.72	
		SPG 3.8% 07/15/50	300,000.00	224,503.39	
		SPGI 4.75% 08/01/28	100,000.00	100,029.86	
		SPLLLC 5.9% 09/15/37	100,000.00	102,223.91	
		SRE 3.7% 04/01/29	100,000.00	94,171.73	
		SRE 4% 02/01/48	100,000.00	77,343.60	
		SRE 5.35% 04/01/53	100,000.00	95,852.09	
		STLD 1.65% 10/15/27	100,000.00	89,732.55	
		STT 2.203% 02/07/28	100,000.00	93,494.77	
		STT 5.684% 11/21/29	100,000.00	102,952.66	
		STZ 2.25% 08/01/31	100,000.00	82,888.95	
		STZ 4.1% 02/15/48	100,000.00	79,921.47	
		STZ 4.35% 05/09/27	100,000.00	97,938.44	
		SUCN 3.75% 03/04/51	100,000.00	72,786.70	
		SUMI 5.55% 03/09/28	200,000.00	203,967.60	
		SUMIBK 2.296% 01/12/41	200,000.00	134,751.55	
		SUMIBK 3.784% 03/09/26	200,000.00	195,215.24	
		SUMIBK 5.464% 01/13/26	200,000.00	200,545.88	
		SUMIFL 5.353% 04/25/28	200,000.00	200,879.13	
		SUMILF 3.375% 04/15/81	200,000.00	172,794.74	
		SWK 6% 03/06/28	100,000.00	103,452.22	
		SYK 1.95% 06/15/30	100,000.00	84,721.48	
		SYK 2.9% 06/15/50	100,000.00	66,320.17	
		SYY 6.6% 04/01/50	100,000.00	112,135.75	
		T(AT&T) 05/15/35	100,000.00	93,046.63	
		T(AT&T) 09/15/53	100,000.00	68,957.38	
		T(AT&T) 1.7% 03/25/26	100,000.00	94,247.47	

		T(AT&T) 2.25% 02/01/32	100,000.00	81,999.52	
		T(AT&T) 2.55% 12/01/33	200,000.00	160,871.39	
		T(AT&T) 3.65% 09/15/59	100,000.00	68,137.51	
		T(AT&T) 3.8% 12/01/57	100,000.00	71,110.48	
		T(AT&T) 4.35% 03/01/29	100,000.00	97,526.71	
		T(AT&T) 4.85% 07/15/45	300,000.00	267,652.51	
		T(AT&T) 4.9% 08/15/37	200,000.00	188,977.15	
		TACHEM 5.25% 06/23/45	200,000.00	189,446.73	
		TAISEM 1.75% 10/25/26	200,000.00	185,770.68	
		TCKBCN 3.9% 07/15/30	100,000.00	94,275.42	
		TD 4.108% 06/08/27	100,000.00	97,501.38	
		TD 5.103% 01/09/26	100,000.00	99,876.44	
		TD 5.532% 07/17/26	100,000.00	100,669.43	
		TDY 2.25% 04/01/28	100,000.00	90,406.16	
		TELEFO 5.52% 03/01/49	150,000.00	141,190.40	
		TEMASE 2.375% 08/02/41	250,000.00	182,585.84	
		TEMASE 2.75% 08/02/61	250,000.00	167,194.68	
		TENCNT 1.81% 01/26/26	200,000.00	190,222.14	
		TENCNT 3.975% 04/11/29	200,000.00	191,238.16	
		TFC 1.95% 06/05/30	100,000.00	83,770.96	
		TFC 4.873% 01/26/29	100,000.00	98,743.00	
		TFC 5.9% 10/28/26	100,000.00	100,530.30	
		TGT 1.95% 01/15/27	100,000.00	93,552.84	
		TGT 4.8% 01/15/53	300,000.00	276,500.08	
		TMUS 2.05% 02/15/28	200,000.00	180,629.68	
		TMUS 2.25% 02/15/26	100,000.00	95,295.49	
		TMUS 3.375% 04/15/29	100,000.00	92,984.57	
		TMUS 3.6% 11/15/60	100,000.00	68,811.67	
		TMUS 4.5% 04/15/50	200,000.00	169,995.16	
		TMUS 5.2% 01/15/33	100,000.00	99,938.56	
		TMUS 5.75% 01/15/54	100,000.00	101,081.88	
		TOYOTA 1.125% 06/18/26	200,000.00	185,887.68	
		TOYOTA 1.9% 09/12/31	100,000.00	81,651.78	
		TOYOTA 3.05% 03/22/27	100,000.00	95,361.27	
		TOYOTA 3.375% 04/01/30	100,000.00	92,698.86	
		TPR 7.85% 11/27/33	200,000.00	212,696.05	

		TRPCN 4.75% 05/15/38	100,000.00	92,473.91	
		TRV 4.05% 03/07/48	100,000.00	82,502.73	
		TSN 4.35% 03/01/29	100,000.00	96,514.69	
		TTEFP 2.986% 06/29/41	100,000.00	73,330.08	
		TTEFP 3.386% 06/29/60	100,000.00	67,620.45	
		TTEFP 3.455% 02/19/29	100,000.00	94,499.39	
		TTWO 4.95% 03/28/28	100,000.00	99,608.73	
		TXN 3.875% 03/15/39	100,000.00	88,453.45	
		TXN 4.15% 05/15/48	100,000.00	84,389.48	
		UBS 1.305% 02/02/27	250,000.00	234,014.00	
		UBS 4.194% 04/01/31	250,000.00	235,077.57	
		UBS 6.442% 08/11/28	250,000.00	257,509.34	
		UBS 9.016% 11/15/33	250,000.00	305,037.65	
		UCGIM 1.982% 06/03/27	200,000.00	187,110.64	
		UDR 2.1% 08/01/32	100,000.00	78,878.00	
		UHS 2.65% 10/15/30	100,000.00	86,024.92	
		UNANA 1.375% 09/14/30	100,000.00	82,154.60	
		UNH 1.15% 05/15/26	200,000.00	186,762.06	
		UNH 4.25% 06/15/48	100,000.00	83,968.72	
		UNH 4.5% 04/15/33	100,000.00	96,424.87	
		UNH 4.75% 05/15/52	100,000.00	89,719.44	
		UNH 5.15% 10/15/25	100,000.00	100,085.19	
		UNH 5.2% 04/15/63	200,000.00	188,424.10	
		UNH 5% 04/15/34	200,000.00	199,140.59	
		UNM 4% 06/15/29	100,000.00	94,738.04	
		UNM 6% 06/15/54	100,000.00	97,633.33	
		UNP 2.891% 04/06/36	200,000.00	162,767.08	
		UNP 3.799% 04/06/71	100,000.00	71,837.96	
		UNP 3.85% 02/14/72	100,000.00	72,723.71	
		UNP 4.75% 02/21/26	100,000.00	99,505.30	
		UNP 4.95% 05/15/53	100,000.00	94,822.67	
		UPS 5.05% 03/03/53	100,000.00	95,087.41	
		UPS 5.3% 04/01/50	200,000.00	196,692.58	
		USB 4.548% 07/22/28	200,000.00	196,538.56	
		USB 4.967% 07/22/33	100,000.00	95,083.74	
		USB 5.727% 10/21/26	400,000.00	401,389.26	

		V 1.1% 02/15/31	100,000.00	80,516.92	
		V 1.9% 04/15/27	100,000.00	92,768.04	
		V 3.65% 09/15/47	100,000.00	79,027.10	
		VALEBZ 3.75% 07/08/30	100,000.00	89,649.57	
		VLO 2.15% 09/15/27	100,000.00	91,652.58	
		VLO 3.65% 12/01/51	100,000.00	70,261.21	
		VMC 4.7% 03/01/48	100,000.00	87,631.45	
		VMW 4.65% 05/15/27	100,000.00	98,767.18	
		VOD 5.25% 05/30/48	100,000.00	93,101.22	
		VOD 5.625% 02/10/53	100,000.00	96,871.40	
		VRSK 3.625% 05/15/50	100,000.00	72,847.17	
		VTR 2.5% 09/01/31	100,000.00	82,896.02	
		VTR 3% 01/15/30	100,000.00	89,054.89	
		VTRS 3.85% 06/22/40	100,000.00	74,139.92	
		VTRS 5.2% 04/15/48	100,000.00	82,622.53	
		VZ 1.45% 03/20/26	200,000.00	188,004.83	
		VZ 2.1% 03/22/28	200,000.00	181,253.43	
		VZ 2.55% 03/21/31	100,000.00	85,692.05	
		VZ 3.15% 03/22/30	100,000.00	90,853.57	
		VZ 3.4% 03/22/41	100,000.00	77,443.73	
		VZ 3.7% 03/22/61	100,000.00	72,077.33	
		VZ 4.812% 03/15/39	200,000.00	188,013.72	
		VZ 4.862% 08/21/46	100,000.00	92,085.96	
		WBD 3.625% 05/15/30	100,000.00	88,875.98	
		WBD 3.95% 03/20/28	200,000.00	188,263.22	
		WBD 4.65% 05/15/50	100,000.00	73,587.13	
		WBD 5.2% 09/20/47	100,000.00	78,530.03	
		WDAY 3.5% 04/01/27	100,000.00	96,076.12	
		WEC 1.8% 10/15/30	100,000.00	82,304.14	
		WELL 2.7% 02/15/27	100,000.00	94,621.71	
		WFC 2.572% 02/11/31	100,000.00	87,375.46	
		WFC 3.526% 03/24/28	100,000.00	95,845.84	
		WFC 4.54% 08/15/26	200,000.00	197,892.92	
		WFC 4.611% 04/25/53	100,000.00	87,394.54	
		WFC 4.808% 07/25/28	100,000.00	99,020.15	
		WFC 4.897% 07/25/33	200,000.00	194,189.09	

		WFC 5.557% 07/25/34	200,000.00	201,747.14	
		WFC 5.574% 07/25/29	200,000.00	202,981.44	
		WFC 5.95% 12/15/36	200,000.00	201,795.89	
		WHR 4.6% 05/15/50	100,000.00	81,045.92	
		WLK 2.875% 08/15/41	100,000.00	68,480.41	
		WM 0.75% 11/15/25	100,000.00	94,250.07	
		WM 4.875% 02/15/34	100,000.00	99,126.55	
		WMB 3.95% 05/15/50	100,000.00	76,736.88	
		WMB 4.85% 03/01/48	100,000.00	87,579.32	
		WMB 4% 03/15/28	100,000.00	96,555.09	
		WMT 1.05% 09/17/26	300,000.00	277,787.77	
		WMT 1.8% 09/22/31	100,000.00	83,051.39	
		WMT 2.65% 09/22/51	100,000.00	63,774.47	
		WMT 3.95% 06/28/38	100,000.00	90,512.26	
		WMT 4.05% 06/29/48	100,000.00	84,149.83	
		WMT 4% 04/15/26	200,000.00	197,459.43	
		WPC 2.4% 02/01/31	100,000.00	83,537.84	
		WSTP 1.15% 06/03/26	200,000.00	186,300.08	
		WSTP 3.02% 11/18/36	200,000.00	165,906.24	
		WSTP 3.133% 11/18/41	100,000.00	70,910.59	
		WSTP 5.457% 11/18/27	100,000.00	101,904.87	
		WTRG 2.4% 05/01/31	100,000.00	83,013.83	
		WTRG 5.3% 05/01/52	100,000.00	92,763.73	
		WY 4.75% 05/15/26	100,000.00	99,194.96	
		XEL 3.6% 09/15/47	100,000.00	73,610.85	
		XEL 4.1% 06/01/32	200,000.00	185,480.35	
		XEL 4% 06/15/28	100,000.00	95,913.10	
		XOM 3.482% 03/19/30	100,000.00	93,694.97	
		XOM 4.227% 03/19/40	100,000.00	89,054.46	
		XOM 4.327% 03/19/50	100,000.00	85,765.21	
		ZBH 3.05% 01/15/26	100,000.00	96,843.04	
		ZTS 5.4% 11/14/25	100,000.00	100,150.87	
	アメリカドル 小計		128,697,000.00	117,931,990.14 (19,051,913,007)	
	カナダドル	ALACN 4.638% 05/15/26	100,000.00	99,721.04	
		BAC 3.615% 03/16/28	100,000.00	97,585.94	

		BCECN 3% 03/17/31	100,000.00	90,106.06	
		BCECN 5.15% 02/09/53	100,000.00	95,559.86	
		BMO 1.928% 07/22/31	100,000.00	94,499.11	
		BMO 4.537% 12/18/28	100,000.00	100,177.60	
		BMO 4.709% 12/07/27	100,000.00	100,715.84	
		BNCN 4.82% 01/28/26	100,000.00	100,146.56	
		BNP 2.538% 07/13/29	200,000.00	183,206.00	
		BNS 5.5% 05/08/26	100,000.00	101,531.30	
		BNS 5.679% 08/02/33	200,000.00	205,707.29	
		CAECN 5.541% 06/12/28	100,000.00	101,890.58	
		CM 2.25% 01/07/27	200,000.00	189,662.29	
		CM 4.95% 06/29/27	100,000.00	101,254.17	
		CNQCN 2.5% 01/17/28	100,000.00	93,588.68	
		CNQCN 4.85% 05/30/47	100,000.00	92,610.37	
		CNRCN 3.2% 07/31/28	100,000.00	96,371.66	
		CNRCN 3.6% 02/08/49	100,000.00	81,393.81	
		CNRCN 5.1% 05/02/54	100,000.00	103,032.86	
		CP 2.54% 02/28/28	100,000.00	94,147.04	
		CPXCN 4.424% 02/08/30	200,000.00	194,265.51	
		CUCN 4.851% 06/03/52	200,000.00	195,277.68	
		CVECN 3.5% 02/07/28	100,000.00	96,613.21	
		ENBCN 5.7% 11/09/27	100,000.00	103,432.97	
		ENBCN 6.1% 11/09/32	100,000.00	107,479.41	
		FFHCN 3.95% 03/03/31	100,000.00	94,504.58	
		FTSCN 4.431% 05/31/29	100,000.00	99,974.14	
		GWOCN 2.981% 07/08/50	100,000.00	72,237.76	
		HYDONE 4.17% 06/06/44	100,000.00	90,900.05	
		HYDONE 4.91% 01/27/28	100,000.00	102,187.18	
		LCN 2.284% 05/07/30	100,000.00	89,103.27	
		MBGGR 5.14% 06/29/26	100,000.00	101,048.41	
		MFCCN 5.409% 03/10/33	100,000.00	102,157.16	
		MGCN 4.95% 01/31/31	100,000.00	101,312.07	
		MRUCN 4.27% 12/04/47	100,000.00	87,967.84	
		NACN 5.296% 11/03/25	100,000.00	100,675.74	
		NESNVX 2.192% 01/26/29	100,000.00	91,949.80	
		NGGLN 5.221% 09/16/31	100,000.00	101,913.06	

		PPLCN 5.21% 01/12/34	100,000.00	100,245.35	
		PSPCAP 3% 11/05/25	150,000.00	147,597.50	
		RCICN 5.25% 04/15/52	100,000.00	96,166.06	
		RCICN 6.75% 11/09/39	100,000.00	112,029.94	
		REIUCN 4.628% 05/01/29	100,000.00	97,840.61	
		REIUCN 6.488% 09/29/26	200,000.00	200,399.32	
		RY 2.328% 01/28/27	100,000.00	95,050.23	
		RY 5.096% 04/03/34	100,000.00	100,915.87	
		SLFCN 2.58% 05/10/32	100,000.00	94,643.02	
		SLFCN 5.12% 05/15/36	100,000.00	101,054.36	
		SRUUCN 3.192% 06/11/27	100,000.00	95,131.44	
		T(AT&T) 4% 11/25/25	150,000.00	148,192.06	
		TCN 2.35% 01/27/28	100,000.00	92,921.05	
		TCN 5.65% 09/13/52	100,000.00	101,621.45	
		TD 1.896% 09/11/28	300,000.00	273,381.82	
		TD 2.26% 01/07/27	100,000.00	94,940.13	
		TD 2.667% 09/09/25	100,000.00	97,627.44	
		TD 4.68% 01/08/29	100,000.00	100,809.04	
		TD 5.177% 04/09/34	200,000.00	202,365.94	
		TD 5.423% 07/10/26	100,000.00	101,602.06	
		TOYOTA 5.16% 07/12/28	200,000.00	205,371.12	
		TOYOTA 5.29% 07/13/26	200,000.00	202,925.84	
		TRPCN 3.3% 07/17/25	100,000.00	98,510.63	
		TRPCN 5.92% 05/12/52	100,000.00	106,717.04	
	カナダドル 小計		7,400,000.00	7,223,967.22 (855,967,875)	
	ユーロ	AALLN 4.125% 03/15/32	100,000.00	100,639.32	
		AALLN 4.5% 09/15/28	100,000.00	102,237.05	
		AAPL 0.5% 11/15/31	100,000.00	83,772.50	
		ABBV 0.75% 11/18/27	200,000.00	184,380.05	
		ABBV 1.25% 11/18/31	100,000.00	86,500.47	
		ABBV 2.125% 06/01/29	100,000.00	94,827.42	
		ABESM 1.25% 02/07/28	100,000.00	91,696.27	
		ABIBB 2.125% 12/02/27	100,000.00	96,792.85	
		ABIBB 2.875% 04/02/32	100,000.00	96,401.55	
		ABNANV 0.375% 01/14/35	100,000.00	74,993.37	

		ABNANV 3.625% 01/10/26	100,000.00	100,150.00	
		ABNANV 5.125% 02/22/33	100,000.00	102,573.47	
		ACACB 0.01% 04/12/28	100,000.00	88,872.12	
		ACACB 3.25% 09/28/32	100,000.00	100,311.46	
		ACACB 3.375% 09/04/28	500,000.00	503,281.75	
		ACAFP 1.5% 10/06/31	200,000.00	165,109.25	
		ACAFP 1.875% 04/22/27	100,000.00	96,828.05	
		ACAFP 1% 07/03/29	100,000.00	88,987.85	
		ACAFP 2% 07/17/30	100,000.00	87,652.50	
		ACAFP 4.125% 03/07/30	100,000.00	102,867.10	
		ACEIM 3.875% 01/24/31	200,000.00	200,318.10	
		ADNA 3.5% 04/04/28	100,000.00	100,887.25	
		ADPFP 2.125% 10/02/26	100,000.00	97,276.55	
		AEMSPA 0.625% 07/15/31	100,000.00	80,300.25	
		AIA 0.88% 09/09/33	100,000.00	86,826.60	
		AIB 5.75% 02/16/29	100,000.00	106,754.50	
		AIFP 2.875% 09/16/32	100,000.00	96,574.50	
		AIRFP 1.625% 06/09/30	200,000.00	180,369.25	
		AIRFP 2.375% 06/09/40	100,000.00	83,504.25	
		AKEFP 0.75% 12/03/29	200,000.00	173,436.90	
		AKERBP 1.125% 05/12/29	100,000.00	88,670.42	
		AKZANA 1.5% 03/28/28	100,000.00	92,646.90	
		ALOFP 0.125% 07/27/27	100,000.00	90,138.80	
		ALVGR 2.121% 07/08/50	100,000.00	89,211.50	
		ALVGR 4.252% 07/05/52	100,000.00	99,534.50	
		AMT 0.875% 05/21/29	100,000.00	87,295.00	
		AMXLMM 0.75% 06/26/27	100,000.00	92,552.00	
		ANNGR 0.375% 06/16/27	100,000.00	91,117.95	
		ANNGR 0.625% 12/14/29	100,000.00	84,754.00	
		ANNGR 1.375% 01/28/26	300,000.00	288,955.35	
		ANZNZ 0.2% 09/23/27	200,000.00	180,387.30	
		ARNDTN 0.375% 04/15/27	100,000.00	88,196.12	
		ARRFP 0% 06/19/28	100,000.00	87,527.15	
		ASABRE 0.336% 04/19/27	100,000.00	91,651.80	
		ASRNED 7% 12/07/43	100,000.00	113,620.00	
		ASSGEN 3.875% 01/29/29	100,000.00	100,035.50	

		ASSGEN 5.272% 09/12/33	200,000.00	212,363.94	
		ATDBCN 4.011% 02/12/36	200,000.00	198,945.30	
		ATIM 1.5% 01/25/30	100,000.00	88,062.75	
		ATIM 1% 11/25/26	100,000.00	93,877.75	
		ATOSTR 1.625% 01/25/28	100,000.00	92,626.85	
		ATOSTR 2% 01/15/30	100,000.00	90,242.67	
		ATOSTR 4.75% 01/24/31	100,000.00	103,424.12	
		AXASA 1.875% 07/10/42	100,000.00	83,690.37	
		AXASA 3.625% 01/10/33	100,000.00	101,775.30	
		BAC 0.694% 03/22/31	100,000.00	84,677.80	
		BAC 1.949% 10/27/26	400,000.00	391,528.40	
		BACR 0.877% 01/28/28	200,000.00	186,351.75	
		BACR 1.125% 03/22/31	100,000.00	94,599.57	
		BACRED 4.75% 03/14/28	100,000.00	102,638.70	
		BAMIIM 4.875% 01/17/30	200,000.00	205,751.44	
		BASGR 3.125% 06/29/28	100,000.00	99,719.25	
		BASGR 3.75% 06/29/32	100,000.00	100,877.69	
		BATSLN 3.125% 04/07/28	100,000.00	98,328.40	
		BAYNGR 0.75% 01/06/27	100,000.00	92,868.75	
		BAYNGR 1.125% 01/06/30	100,000.00	86,722.15	
		BAYNGR 1% 01/12/36	100,000.00	70,685.25	
		BBVASM 1.75% 11/26/25	100,000.00	97,503.87	
		BBVASM 3.875% 01/15/34	200,000.00	202,096.74	
		BBVASM 5.75% 09/15/33	100,000.00	105,016.70	
		BERTEL 2% 04/01/28	100,000.00	95,299.87	
		BFCM 0.01% 05/11/26	100,000.00	93,777.35	
		BFCM 3.875% 01/26/28	100,000.00	100,563.87	
		BFCM 4.375% 01/11/34	100,000.00	98,904.50	
		BFCM 4% 11/21/29	100,000.00	101,903.87	
		BHP 3.25% 09/24/27	100,000.00	99,322.03	
		BKTSM 1.25% 12/23/32	100,000.00	91,089.35	
		BMO 0.05% 06/08/29	100,000.00	85,732.27	
		BMO 0.125% 01/26/27	200,000.00	184,527.20	
		BMO 1% 04/05/26	200,000.00	192,312.65	
		BMO 2.75% 10/13/26	1,000,000.00	988,746.50	
		BMW 0.2% 01/11/33	100,000.00	77,406.25	

		BMW 0% 01/11/26	200,000.00	190,524.44	
		BMW 1% 05/22/28	100,000.00	91,793.05	
		BNFP 0% 12/01/25	100,000.00	95,320.20	
		BNFP 1% PERP	100,000.00	93,215.70	
		BNFP 3.071% 09/07/32	100,000.00	97,511.28	
		BNP 0.625% 12/03/32	100,000.00	77,468.35	
		BNP 2.125% 01/23/27	100,000.00	97,614.50	
		BNP 2.5% 03/31/32	100,000.00	95,417.25	
		BNS 0.01% 09/14/29	100,000.00	84,791.40	
		BNS 3.25% 01/18/28	200,000.00	199,774.40	
		BPCECB 1.75% 05/27/32	100,000.00	89,869.05	
		BPCECB 3.125% 07/20/27	200,000.00	199,493.10	
		BPCECB 3.25% 04/12/28	200,000.00	200,163.20	
		BPCECB 3% 10/17/29	100,000.00	98,910.67	
		BPCEGP 0.5% 09/15/27	100,000.00	93,099.17	
		BPCEGP 0.75% 03/03/31	100,000.00	82,326.00	
		BPCEGP 2.25% 03/02/32	100,000.00	95,053.90	
		BPCEGP 3.625% 04/17/26	200,000.00	200,317.54	
		BPLN 3.25 PERP	100,000.00	98,103.95	
		BPLN 3.625% PERP	100,000.00	96,137.75	
		BRK 1.625% 03/16/35	100,000.00	82,669.35	
		BYLAN 1.375% 11/22/32	100,000.00	88,517.75	
		C 1.25% 04/10/29	200,000.00	180,459.60	
		C 3.713% 09/22/28	100,000.00	100,439.35	
		CABKSM 0.375% 11/18/26	100,000.00	95,613.80	
		CABKSM 0.75% 07/09/26	100,000.00	94,550.96	
		CABKSM 5.375% 11/14/30	100,000.00	107,422.27	
		CABKSM 6.25% 02/23/33	100,000.00	105,708.25	
		CAFFIL 0.01% 02/22/28	100,000.00	89,108.20	
		CAFFIL 0.01% 03/18/31	500,000.00	404,551.75	
		CAFFIL 0.125% 06/30/31	100,000.00	80,891.35	
		CAFFIL 0.5% 10/01/46	200,000.00	112,799.00	
		CAFFIL 3.125% 05/17/39	300,000.00	293,709.00	
		CAFFIL 3.125% 11/24/33	400,000.00	396,129.60	
		CAFP 1.875% 10/30/26	100,000.00	96,260.80	
		CAPFP 1.625% 04/15/26	100,000.00	96,970.62	

		CAPFP 2% 04/15/29	100,000.00	94,536.72	
		CARLB 4.25% 10/05/33	100,000.00	103,820.87	
		CB 0.875% 06/15/27	100,000.00	92,851.70	
		CCEP 1.75% 03/27/26	100,000.00	97,111.02	
		CFF 0.01% 10/25/27	100,000.00	90,056.72	
		CFF 0.01% 10/29/35	100,000.00	69,392.80	
		CFF 0.6% 10/25/41	100,000.00	64,569.85	
		CFF 3.375% 09/16/31	100,000.00	101,036.80	
		CKHH 2% 04/13/30	100,000.00	90,794.97	
		CM 0.01% 10/07/26	200,000.00	185,868.20	
		CM 0.375% 03/10/26	400,000.00	380,936.20	
		CMCICB 3.125% 06/22/27	100,000.00	99,824.70	
		CMCSA 0.25% 05/20/27	100,000.00	91,708.30	
		CMZB 2.75% 12/08/25	200,000.00	198,452.60	
		CMZB 2.875% 04/28/26	100,000.00	99,371.75	
		CMZB 3.125% 04/20/29	100,000.00	100,057.40	
		CNPFP 1.25% 01/27/29	100,000.00	88,974.05	
		CNPFP 5.25% 07/18/53	100,000.00	103,420.05	
		COFBBB 1% 01/24/28	100,000.00	90,444.93	
		COLSM 0.75% 06/22/29	100,000.00	87,697.00	
		CONGR 3.625% 11/30/27	100,000.00	100,797.67	
		COVFP 1.125% 09/17/31	100,000.00	82,424.15	
		CPPIBC 0.75% 02/02/37	250,000.00	183,662.50	
		CRH 3.125% 02/23/33	400,000.00	396,167.40	
		CRH 3% 01/11/30	100,000.00	98,970.75	
		DAIGR 0.75% 09/10/30	100,000.00	86,314.85	
		DAIGR 2% 08/22/26	100,000.00	97,078.14	
		DANBNK 0.75% 06/09/29	100,000.00	89,100.00	
		DANBNK 4% 01/12/27	100,000.00	100,529.75	
		DB 0.75% 02/17/27	200,000.00	190,723.38	
		DB 2.625% 06/30/37	200,000.00	187,278.32	
		DB 4% 11/29/27	100,000.00	101,612.42	
		DBOERS 1.625% 10/08/25	100,000.00	97,944.50	
		DECFP 1.625% 02/07/30	100,000.00	88,352.37	
		DELL 0.5% 10/27/26	100,000.00	93,442.55	
		DELL 4.5% 10/18/27	100,000.00	102,701.00	

		DEXGRP 0.01% 01/22/27	100,000.00	92,337.45	
		DEXGRP 0% 01/21/28	100,000.00	89,691.70	
		DGFP 0.5% 01/09/32	100,000.00	80,662.85	
		DGFP 0% 11/27/28	100,000.00	87,194.40	
		DHLGR 0.375% 05/20/26	100,000.00	94,942.90	
		DHR 0.2% 03/18/26	100,000.00	94,716.20	
		DNBNO 0.01% 01/21/31	100,000.00	81,847.75	
		DNBNO 3.625% 02/16/27	100,000.00	99,901.65	
		DNBNO 4.5% 07/19/28	100,000.00	102,470.15	
		DNBNO 5% 09/13/33	200,000.00	206,499.10	
		DSYFP 0.375% 09/16/29	100,000.00	85,916.02	
		DWNIGY 1.5% 04/30/30	200,000.00	174,733.80	
		EDENFP 3.625% 12/13/26	100,000.00	100,177.35	
		EDPPL 1.625% 01/26/26	100,000.00	97,189.90	
		EFFP 0.375% 01/05/26	100,000.00	95,562.30	
		EJRAIL 1.85% 04/13/33	100,000.00	88,139.71	
		EJRAIL 3.245% 09/08/30	200,000.00	198,598.35	
		ENBW 1.625% 08/05/79	100,000.00	91,768.92	
		ENBW 2.125% 08/31/2081	100,000.00	81,500.00	
		ENELIM 1.25% 01/17/35	100,000.00	78,218.00	
		ENELIM 3.875% 03/09/29	100,000.00	101,551.55	
		ENELIM 6.625% PERP	100,000.00	108,487.50	
		ENFP 2.25% 06/29/29	100,000.00	94,653.50	
		ENFP 3.25% 06/30/37	100,000.00	94,280.56	
		ENGIFP 1.75% 03/27/28	100,000.00	93,980.10	
		ENGIFP 2.125% 03/30/32	100,000.00	89,855.35	
		ENGIFP 3.625% 01/11/30	100,000.00	100,256.37	
		ENGIFP 4.5% 09/06/42	100,000.00	102,936.97	
		ENIIM 2.625% PERP	100,000.00	97,563.50	
		ENIIM 4.25% 05/19/33	100,000.00	102,991.60	
		ENXFP 0.75% 05/17/31	100,000.00	83,464.15	
		EOANGR 0.375% 09/29/27	100,000.00	91,313.50	
		EOANGR 1% 10/07/25	100,000.00	97,015.25	
		EOANGR 2.875% 08/26/28	100,000.00	98,596.57	
		EOANGR 3.875% 01/12/35	100,000.00	101,437.35	
		EOANGR 4% 08/29/33	100,000.00	102,906.55	

		EQNR 0.75% 05/22/26	100,000.00	95,156.11	
		EQNR 1.375% 05/22/32	100,000.00	86,122.92	
		ERFFP 4% 07/06/29	100,000.00	98,012.93	
		ERSTBK 0.875% 05/22/26	200,000.00	190,445.60	
		ERSTBK 4% 01/16/31	100,000.00	102,380.72	
		EVKGR 2.25% 09/25/27	100,000.00	96,062.37	
		EXOIM 0.875% 01/19/31	100,000.00	84,262.90	
		FI 4.5% 05/24/31	100,000.00	104,213.70	
		FREGR 0.5% 10/01/28	100,000.00	88,706.62	
		FREGR 4.25% 05/28/26	100,000.00	101,243.72	
		FREGR 5.125% 10/05/30	100,000.00	107,194.30	
		GBLBBB 0.125% 01/28/31	100,000.00	79,892.00	
		GFCFP 0.875% 01/25/33	100,000.00	79,740.00	
		GM 0.85% 02/26/26	100,000.00	95,579.60	
		GM 4.5% 11/22/27	100,000.00	102,458.22	
		GS 0.25% 01/26/28	100,000.00	89,995.62	
		GS 4% 09/21/29	100,000.00	102,370.52	
		GSK 1.75% 05/21/30	100,000.00	91,382.60	
		HEIANA 2.25% 03/30/30	200,000.00	188,100.25	
		HEIGR 3.75% 05/31/32	200,000.00	201,528.14	
		HERIM 0.25% 12/03/30	100,000.00	80,148.70	
		HERIM 4.25% 04/20/33	100,000.00	101,818.40	
		HNDA 3.75% 10/25/27	100,000.00	100,991.57	
		HOFP 0% 03/26/26	100,000.00	94,092.52	
		HOLNSW 0.125% 07/19/27	100,000.00	90,665.00	
		HOLNSW 0.5% 09/03/30	100,000.00	82,621.20	
		HSBC 0.309% 11/13/26	100,000.00	95,613.75	
		HSBC 3.019% 06/15/27	200,000.00	197,486.07	
		HSBC 4.599% 03/22/35	200,000.00	202,529.60	
		HSBC 4.787% 03/10/32	100,000.00	105,364.25	
		HSBC 6.364% 11/16/32	100,000.00	106,466.60	
		HVB 0.375% 01/17/33	100,000.00	79,704.11	
		HVB 3% 07/13/26	100,000.00	99,373.75	
		IBESM 1.874% PERP	100,000.00	96,257.45	
		IBESM 3.375% 11/22/32	100,000.00	99,284.50	
		IBESM 3.625% 07/13/33	100,000.00	100,344.87	

		IFXGR 2% 06/24/32	100,000.00	89,784.12	
		IGIM 0.5% 02/16/33	100,000.00	74,987.00	
		IGIM 3.125% 02/08/29	100,000.00	97,943.75	
		IMBLN 2.125% 02/12/27	100,000.00	96,567.05	
		INFLN 2.125% 10/06/25	100,000.00	98,093.85	
		INTNED 0.5% 02/17/27	500,000.00	466,199.25	
		INTNED 1% 02/17/37	200,000.00	152,991.53	
		INTNED 2.75% 11/21/25	100,000.00	99,230.12	
		INTNED 3% 02/15/26	200,000.00	198,962.00	
		INTNED 3% 02/15/33	100,000.00	98,900.97	
		INTNED 4.5% 05/23/29	100,000.00	102,721.65	
		ISPIM 5.625% 03/08/33	150,000.00	166,018.12	
		ISPIM 5% 03/08/28	150,000.00	154,855.05	
		JAPTOB 2.375 04/07/81	100,000.00	96,622.00	
		JCI 4.25% 05/23/35	100,000.00	102,919.75	
		JDEPNA 0% 01/16/26	200,000.00	189,427.10	
		JPM 0.389% 02/24/28	100,000.00	92,157.07	
		JPM 1.963% 03/23/30	100,000.00	92,911.65	
		KBCBB 0.125% 01/14/29	100,000.00	88,483.95	
		KBCBB 4.375% 11/23/27	100,000.00	101,593.85	
		KERFP 3.25% 02/27/29	100,000.00	99,422.30	
		KERFP 3.375% 02/27/33	100,000.00	98,409.00	
		KO 0.95% 05/06/36	100,000.00	76,292.55	
		KPN 3.875% 02/16/36	100,000.00	99,809.00	
		LBBW 0.375% 02/21/31	100,000.00	80,486.40	
		LBBW 0.375% 02/28/28	100,000.00	88,858.35	
		LBBW 0.375% 05/07/29	100,000.00	86,268.14	
		LEGGR 0.375% 01/17/26	100,000.00	95,040.65	
		LEGGR 0.875% 11/28/27	100,000.00	91,895.19	
		LIFP 2% 05/12/29	100,000.00	93,031.62	
		LIN 1.625% 03/31/35	100,000.00	83,146.80	
		LLOYDS 3.125% 08/24/30	100,000.00	96,947.10	
		LLY 1.375% 09/14/61	100,000.00	55,969.72	
		LRFP 0.75% 05/20/30	100,000.00	86,495.12	
		LSELN 1.75% 12/06/27	200,000.00	189,585.20	
		LXSGR 0.625% 12/01/29	100,000.00	83,258.65	

		MAERSK 0.75% 11/25/31	100,000.00	82,233.45	
		MAPSM 2.875% 04/13/30	100,000.00	93,180.50	
		MBGGR 0.75% 02/08/30	100,000.00	87,046.55	
		MBGGR 1.375% 06/26/26	100,000.00	96,251.29	
		MCFP 0.375% 02/11/31	100,000.00	83,828.75	
		MDLZ 0.25% 03/17/28	100,000.00	89,065.00	
		MDT 3.375% 10/15/34	100,000.00	98,785.85	
		MET 4% 04/05/28	100,000.00	101,894.00	
		MIZUHO 4.157% 05/20/28	100,000.00	102,172.77	
		MO 2.2% 06/15/27	100,000.00	96,183.15	
		MRKGR 1.625% 09/09/2080	100,000.00	94,784.75	
		MS 2.95% 05/07/32	200,000.00	189,843.35	
		MS 4.813% 10/25/28	100,000.00	103,895.54	
		MSFT 2.625% 05/02/33	100,000.00	97,390.15	
		MUFG 0.337% 06/08/27	200,000.00	188,310.68	
		MUFG 0.848% 07/19/29	200,000.00	178,070.00	
		MUNRE 1% 05/26/42	100,000.00	79,995.67	
		NAB 0.01% 01/06/29	100,000.00	86,540.50	
		NAB 2.125% 05/24/28	100,000.00	95,671.50	
		NAB 3.146% 02/05/31	500,000.00	498,412.50	
		NAB 3.2627% 02/13/26	1,000,000.00	997,839.25	
		NACN 3.5% 04/25/28	200,000.00	201,611.40	
		NDAFH 0.5% 05/14/27	200,000.00	185,540.60	
		NDAQ 0.875% 02/13/30	100,000.00	86,854.84	
		NDASS 1.125% 02/16/27	100,000.00	94,183.00	
		NDASS 1% 03/30/29	200,000.00	181,738.76	
		NDB 2.25% 09/20/27	500,000.00	485,714.87	
		NDB 2.875% 03/19/30	200,000.00	197,095.90	
		NDB 4.875% 07/11/28	100,000.00	105,548.61	
		NESNVX 0.875% 06/14/41	100,000.00	67,547.75	
		NESNVX 0% 06/14/26	100,000.00	94,184.25	
		NESNVX 3.5% 12/13/27	100,000.00	101,226.00	
		NESVFH 3.875% 03/16/29	100,000.00	100,831.00	
		NGGLN 0.163% 01/20/28	100,000.00	88,649.37	
		NGGLN 2.949% 03/30/30	100,000.00	96,078.25	
		NK 1% 07/15/31	100,000.00	80,704.00	

		NNGRNV 0.875% 11/23/31	100,000.00	83,926.60	
		NNGRNV 6% 11/03/43	100,000.00	109,019.57	
		NOKIA 4.375% 08/21/31	100,000.00	101,677.37	
		NOVNVX 0% 09/23/28	100,000.00	87,762.60	
		NSANY 2.652% 03/17/26	100,000.00	97,956.30	
		NTGYSM 1.25% 01/15/26	100,000.00	96,519.52	
		NTT 0.342% 03/03/30	100,000.00	84,224.48	
		NTT 0.399% 12/13/28	100,000.00	87,929.85	
		NWG 0.125% 11/12/25	100,000.00	95,510.50	
		NWG 5.763% 02/28/34	100,000.00	105,141.23	
		NWIDE 2% 04/28/27	100,000.00	95,985.55	
		O 5.125% 07/06/34	100,000.00	108,701.02	
		OMVAV 2.375% 04/09/32	100,000.00	94,028.85	
		OMVAV 2.5% PERP	100,000.00	96,080.00	
		OPBANK 0.375% 06/16/28	200,000.00	177,032.70	
		OPBANK 2.875% 12/15/25	100,000.00	99,084.20	
		OPBANK 4.125% 04/18/27	100,000.00	101,826.82	
		ORAFP 0% 06/29/26	100,000.00	93,525.46	
		ORAFP 1.25% 07/07/27	100,000.00	94,311.08	
		ORAFP 3.625% 11/16/31	100,000.00	101,392.95	
		ORFP 0.875% 06/29/26	100,000.00	95,426.55	
		ORIX 4.477% 06/01/28	100,000.00	102,826.25	
		ORSTED 3.75% 03/01/30	100,000.00	100,326.62	
		PEP 0.5% 05/06/28	100,000.00	90,398.10	
		PHIANA 2.625% 05/05/33	100,000.00	91,335.35	
		PLD 1.5% 02/08/34	100,000.00	81,966.37	
		PLD 4.25% 01/31/43	100,000.00	99,585.27	
		PLNIJ 1.875% 11/05/31	100,000.00	83,356.20	
		PLNIJ 2.875% 10/25/25	100,000.00	98,556.73	
		POWFIN 1.841% 09/21/28	100,000.00	90,186.30	
		PROXBB 4.125% 11/17/33	100,000.00	103,985.85	
		PROXBB 4% 03/08/30	100,000.00	102,517.25	
		PRXNA 2.031% 08/03/32	100,000.00	82,148.72	
		RABOBK 3.064% 02/01/34	200,000.00	198,803.54	
		RABOBK 3.822% 07/26/34	200,000.00	201,261.00	
		RABOBK 3.875% 11/30/32	100,000.00	99,514.00	

		RBIAV 4.625% 08/21/29	100,000.00	99,970.00	
		RBIAV 7.375% 12/20/32	100,000.00	104,974.75	
		RDSALN 1.5% 04/07/28	100,000.00	93,486.50	
		RDSALN 1.875% 04/07/32	100,000.00	88,975.50	
		REESM 4.625% PERP	200,000.00	202,952.50	
		RENAUL 4.125% 12/01/25	200,000.00	200,734.34	
		RIFP 1.375% 04/07/29	100,000.00	90,916.87	
		RIFP 1.75% 04/08/30	100,000.00	91,061.40	
		RWE 2.125% 05/24/26	100,000.00	97,692.10	
		RWE 2.75% 05/24/30	100,000.00	95,827.02	
		RWE 4.125% 02/13/35	100,000.00	102,377.75	
		RY 0.01% 10/05/28	100,000.00	87,464.42	
		RY 0.625% 03/23/26	200,000.00	191,210.05	
		RY 2.375% 09/13/27	1,000,000.00	973,786.00	
		SABSM 1.125% 03/11/27	100,000.00	96,017.50	
		SABSM 1.75% 05/30/29	200,000.00	185,521.70	
		SANFP 1.25% 03/21/34	100,000.00	83,726.22	
		SANFP 1% 03/21/26	100,000.00	96,202.15	
		SANTAN 1.625% 10/22/30	100,000.00	86,834.37	
		SANTAN 3.375% 01/11/26	500,000.00	499,138.56	
		SANTAN 3.375% 01/11/30	200,000.00	200,491.60	
		SANTAN 3.5% 01/09/30	100,000.00	99,442.22	
		SANTAN 4.25% 06/12/30	100,000.00	103,888.50	
		SAPGR 0.375% 05/18/29	100,000.00	87,778.10	
		SEB 3.25% 05/04/28	100,000.00	100,143.70	
		SEB 3.25% 11/24/25	100,000.00	99,657.50	
		SEB 4% 11/09/26	100,000.00	100,691.25	
		SESGFP 3.5% 01/14/29	100,000.00	97,446.50	
		SGOFP 1.625% 08/10/25	100,000.00	97,885.20	
		SGOFP 3.875% 11/29/30	100,000.00	101,348.05	
		SHBASS 0.01% 09/30/30	100,000.00	82,240.15	
		SHBASS 3.75% 05/05/26	200,000.00	200,951.10	
		SHBASS 3.75% 11/01/27	100,000.00	101,205.12	
		SIEGR 0.375% 06/05/26	100,000.00	94,726.21	
		SIEGR 1% 02/25/30	100,000.00	89,017.40	
		SIEGR 3.5% 02/24/36	100,000.00	100,594.06	

		SIEGR 3.625% 02/24/43	100,000.00	99,110.15	
		SMINLN 2% 02/23/27	100,000.00	95,787.40	
		SOCGEN 0.5% 06/12/29	100,000.00	87,731.50	
		SOCGEN 1.125% 06/30/31	100,000.00	93,713.20	
		SOCGEN 5.25% 09/06/32	100,000.00	102,886.27	
		SOCSFH 0.01% 12/02/26	100,000.00	92,729.21	
		SOCSFH 1.75% 05/05/34	100,000.00	87,563.80	
		SOCSFH 3.125% 02/24/32	100,000.00	99,541.50	
		SOCSFH 3.375% 07/31/30	500,000.00	505,032.50	
		SRGIM 1% 09/12/34	100,000.00	76,009.75	
		SRGIM 3.375% 12/05/26	100,000.00	99,588.00	
		SSELN 4% PERP	100,000.00	98,382.00	
		STANLN 1.2% 09/23/31	100,000.00	92,843.05	
		STLA 1.25% 06/20/33	100,000.00	81,072.20	
		STLA 2.75% 05/15/26	100,000.00	98,520.25	
		STLA 3.75% 03/19/36	200,000.00	197,226.50	
		SUFP 3.375% 04/13/34	100,000.00	100,175.00	
		SWEDA 1.3% 02/17/27	100,000.00	94,293.60	
		SWEDA 3.125% 07/05/28	100,000.00	99,773.61	
		SWFP 1% 07/17/28	100,000.00	91,235.00	
		T(AT&T) 1.6% 05/19/28	200,000.00	187,130.85	
		T(AT&T) 4.3% 11/18/34	100,000.00	104,351.67	
		TACHEM 0.75% 07/09/27	100,000.00	92,527.57	
		TCLAU 4.225% 04/26/33	100,000.00	102,684.32	
		TD 3.191% 02/16/29	500,000.00	499,246.95	
		TD 3.715% 03/13/30	200,000.00	204,847.50	
		TD 3.879% 03/13/26	100,000.00	100,866.50	
		TELBSS 0.75% 03/23/31	200,000.00	170,776.45	
		TELEFO 1.788% 03/12/29	100,000.00	93,193.40	
		TELEFO 4.055% 01/24/36	100,000.00	100,428.45	
		TELNO 1.75% 05/31/34	100,000.00	86,076.95	
		TELNO 4.25% 10/03/35	200,000.00	211,527.00	
		TEMASE 3.25% 02/15/27	150,000.00	149,714.62	
		TENN 0.125% 12/09/27	100,000.00	89,668.79	
		TENN 0.875% 06/16/35	100,000.00	76,469.00	
		TENN 2.125% 11/17/29	200,000.00	187,646.90	

		TMO 1.875% 10/01/49	100,000.00	68,405.02	
		TMO 3.2% 01/21/26	300,000.00	298,518.75	
		TOTAL 1.491% 04/08/27	100,000.00	95,171.99	
		TOYOTA 0.25% 07/16/26	100,000.00	93,915.15	
		TOYOTA 4.05% 09/13/29	100,000.00	102,685.42	
		TRNIM 0.375% 06/23/29	100,000.00	86,138.05	
		TTEFP 1.618% 05/18/40	100,000.00	74,612.75	
		TTEFP 2.125% PERP	100,000.00	83,194.37	
		UBS 4.375% 01/11/31	200,000.00	205,322.50	
		UBS 7.75% 03/01/29	200,000.00	226,491.80	
		UCGIM 0.325% 01/19/26	100,000.00	95,295.95	
		UCGIM 0.925% 01/18/28	100,000.00	93,592.45	
		UCGIM 1.625% 01/18/32	100,000.00	86,259.77	
		ULFP 0.625% 05/04/27	100,000.00	92,233.20	
		ULFP 0.875% 03/29/32	100,000.00	79,601.62	
		ULFP 1.375% 05/25/33	200,000.00	161,591.90	
		ULFP 1.75% 02/27/34	100,000.00	83,208.90	
		UNANA 0.75% 02/28/26	100,000.00	95,864.25	
		UNANA 3.25% 02/23/31	100,000.00	99,974.20	
		UNANA 3.3% 06/06/29	100,000.00	100,460.60	
		VATFAL 0.125% 02/12/29	100,000.00	86,146.60	
		VIEFP 0% 06/09/26	100,000.00	93,476.30	
		VIEFP 1.625% 09/17/30	100,000.00	89,361.08	
		VIEFP 1.94% 01/07/30	100,000.00	92,260.50	
		VIVFP 1.125% 12/11/28	100,000.00	93,477.24	
		VOD 2.5% 05/24/39	100,000.00	85,100.89	
		VW 1.5% 01/21/41	200,000.00	138,514.30	
		VW 3.75% 09/28/27	100,000.00	100,388.50	
		VW 3.875% 03/29/26	300,000.00	301,252.35	
		VW 4.125% 11/15/25	100,000.00	100,727.50	
		VW 4.25% 02/15/28	100,000.00	101,931.15	
		VW 4.75% 09/25/31	100,000.00	105,810.72	
		VZ 0.375% 03/22/29	100,000.00	87,154.12	
		VZ 0.75% 03/22/32	100,000.00	81,591.48	
		VZ 1.85% 05/18/40	100,000.00	76,793.37	
		VZ 4.75% 10/31/34	100,000.00	108,633.50	

		WFC 1.741% 05/04/30	100,000.00	91,718.10	
		XOM 0.524% 06/26/28	100,000.00	90,007.20	
	ユーロ 小計		58,800,000.00	55,579,732.52 (9,709,779,271)	
	イギリスポンド	AAPL 3.05% 07/31/29	100,000.00	94,267.50	
		ALVGR 4.5% 03/13/43	100,000.00	93,323.74	
		ANNFND 2.308% 10/06/32	200,000.00	155,019.60	
		ANNFND 2.924% 10/06/51	100,000.00	58,313.22	
		ANNFND 3.685% 07/12/34	100,000.00	83,450.18	
		ANNFND 4.75% 08/09/33	200,000.00	184,595.89	
		AVLN 4% 06/03/55	100,000.00	82,329.45	
		BACR 3.75% 11/22/30	100,000.00	96,931.80	
		BACR 5.851% 03/21/35	100,000.00	100,590.20	
		BATSLN 5.75% 07/05/40	100,000.00	94,971.77	
		BFCM 1% 07/16/26	100,000.00	92,377.70	
		BNP 3.375% 01/23/26	200,000.00	194,837.60	
		BPLN 4.25% PERP	100,000.00	95,725.38	
		BRK 2.625% 06/19/59	100,000.00	57,547.87	
		CDTFIN 2.125% 09/22/28	100,000.00	89,315.60	
		CMCSA 4% 11/26/29	100,000.00	96,990.47	
		CMCSA 5.5% 11/23/29	100,000.00	103,995.25	
		CMCSA 6% 05/21/27	100,000.00	102,879.00	
		CPGLN 4.375% 09/08/32	100,000.00	98,075.55	
		EDF 5.5% 01/25/35	100,000.00	96,942.45	
		EJRAIL 4.75% 12/08/31	100,000.00	99,451.98	
		ENELIM 1% 10/20/27	100,000.00	88,594.10	
		ENGIFP 5.625% 04/03/53	100,000.00	97,092.20	
		EQNR 4.25% 04/10/41	200,000.00	180,800.55	
		GSK 5.25% 04/10/42	100,000.00	100,547.02	
		HSBC 1.75% 07/24/27	100,000.00	93,280.00	
		HSBC 3% 05/29/30	100,000.00	90,575.77	
		HSBC 4.75% 03/24/46	100,000.00	87,318.50	
		HSBC 8.201% 11/16/34	100,000.00	109,572.78	
		HTHROW 4.625% 10/31/46	100,000.00	85,957.15	
		INFLN 3.125% 07/05/26	100,000.00	95,762.65	
		LLOYDS 6.5% 09/17/40	100,000.00	113,305.00	

		LLOYDS 6.625% 06/02/33	100,000.00	101,974.91	
		MCD 3.75% 05/31/38	100,000.00	85,800.86	
		MET 1.625% 10/12/28	100,000.00	88,207.52	
		MGNLN 6.34% 12/19/63	100,000.00	95,484.22	
		MS 2.625% 03/09/27	100,000.00	93,820.87	
		NGGLN 2.75% 02/06/35	100,000.00	78,942.93	
		NGGLN 2% 04/17/40	100,000.00	62,269.11	
		NGGLN 5.272% 01/18/43	100,000.00	94,320.40	
		NWG 3.619% 03/29/29	100,000.00	94,607.30	
		NWIDE 6.178% 12/07/27	100,000.00	101,909.87	
		O 1.875% 01/14/27	100,000.00	91,862.52	
		ORSTED 2.5% 02/18/21	100,000.00	72,622.17	
		PFE 6.5% 06/03/38	100,000.00	114,745.97	
		RABOBK 1.875% 07/12/28	100,000.00	91,296.55	
		RTOLN 5% 06/27/32	100,000.00	98,379.76	
		SANTAN 4.75% 08/30/28	100,000.00	98,938.32	
		SANTAN 5.125% 01/25/30	100,000.00	100,527.86	
		SANUK 7.482% 08/29/29	100,000.00	107,070.75	
		SGOFP 4.625% 10/09/29	100,000.00	99,098.90	
		SSELN 3.74% PERP	100,000.00	96,654.83	
		STANLN 4.375% 01/18/38	100,000.00	90,924.90	
		UBS 7% 09/30/27	100,000.00	103,140.38	
		UPS 5.125% 02/12/50	100,000.00	100,868.69	
		VIEFP 5.375% 12/02/30	100,000.00	101,574.92	
		VW 3.375% 11/16/26	100,000.00	95,812.12	
		WELL 4.8% 11/20/28	100,000.00	98,274.60	
	イギリスポンド 小計		6,200,000.00	5,773,869.15 (1,192,708,150)	
	スウェーデンクローナ	LANSBK 0.5% 09/20/28	2,000,000.00	1,807,495.28	
		LANSBK 1.5% 09/16/26	1,000,000.00	967,482.82	
		LANSBK 1% 09/15/27	3,500,000.00	3,293,581.48	
		LANSBK 3% 09/19/29	2,000,000.00	1,996,915.32	
		NDAFH 1% 06/16/27	4,000,000.00	3,779,214.20	
		NDASS 0.5% 09/16/26	2,700,000.00	2,555,918.68	
		NDASS 1% 09/17/25	1,500,000.00	1,460,529.57	
		SEB 0.5% 12/16/26	2,000,000.00	1,882,564.08	

		SHBASS 2.5% 12/01/27	2,000,000.00	1,969,627.28	
		SHBASS 2% 09/01/28	1,000,000.00	962,602.78	
		SWEDA 1% 03/17/27	1,000,000.00	948,821.16	
		SWEDA 1% 03/18/26	2,000,000.00	1,930,465.04	
		SWEDA 3% 03/15/28	1,100,000.00	1,101,113.64	
		SWEDA 3% 03/28/29	1,000,000.00	999,921.56	
	スウェーデンクローナ 小計		26,800,000.00	25,656,252.89 (393,053,794)	
	オーストラリアドル	ABIBB 4.1% 09/06/27	100,000.00	97,529.33	
		ANZ 5.906% 08/12/32	100,000.00	100,963.53	
		ANZ 6.405% 09/20/34	100,000.00	102,830.36	
		BNP 5.288% 02/15/29	200,000.00	199,222.05	
		CBAAU 5% 01/13/28	200,000.00	200,371.06	
		CPPIBC 4.45% 09/01/27	100,000.00	99,358.86	
		LLOYDS 5.3906% 06/10/27	100,000.00	100,052.60	
		MQGAU 6.082% 06/07/32	100,000.00	100,900.00	
		QANAU 2.95% 11/27/29	100,000.00	86,271.22	
		TLSAU 5.65% 03/06/34	200,000.00	201,678.56	
		WSTP 2.4% 01/25/27	100,000.00	94,022.39	
		WSTP 6.934% 06/23/38	100,000.00	106,490.94	
	オーストラリアドル 小計		1,500,000.00	1,489,690.90 (162,033,679)	
社債券合計				31,365,455,776 (31,365,455,776)	
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES MBS ETF	1,091,051	100,627,633.73	
	アメリカドル 小計		1,091,051	100,627,633.73 (16,256,394,229)	
投資信託受益証券合計			1,091,051	16,256,394,229 (16,256,394,229)	
合計				127,910,393,327 (127,910,393,327)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　210銘柄	40.0%	—	20.1%
	地方債証券　21銘柄	1.2%	—	0.6%
	特殊債券　88銘柄	4.1%	—	2.1%
	社債券　963銘柄	29.6%	—	14.9%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	25.2%	12.7%
カナダドル	国債証券　34銘柄	33.2%	—	1.0%
	地方債証券　61銘柄	30.4%	—	0.9%
	特殊債券　26銘柄	14.3%	—	0.4%
	社債券　62銘柄	22.0%	—	0.7%
メキシコペソ	国債証券　15銘柄	100.0%	—	0.3%
コロンビアペソ	国債証券　3銘柄	100.0%	—	0.1%
ユーロ	国債証券　390銘柄	53.0%	—	13.2%
	地方債証券　49銘柄	3.1%	—	0.8%
	特殊債券　159銘柄	13.3%	—	3.3%
	社債券　444銘柄	30.6%	—	7.6%
イギリスポンド	国債証券　59銘柄	70.3%	—	3.1%
	特殊債券　19銘柄	8.5%	—	0.4%
	社債券　58銘柄	21.2%	—	0.9%
スイスフラン	国債証券　22銘柄	100.0%	—	0.6%
スウェーデンクローナ	国債証券　7銘柄	24.7%	—	0.1%
	社債券　14銘柄	75.3%	—	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　10銘柄	100.0%	—	0.1%
デンマーククローネ	国債証券　7銘柄	100.0%	—	0.2%
チェココルナ	国債証券　19銘柄	100.0%	—	0.2%
ハンガリーフォリント	国債証券　17銘柄	100.0%	—	0.1%
ポーランドズロチ	国債証券　14銘柄	100.0%	—	0.2%
オーストラリアドル	国債証券　26銘柄	49.5%	—	0.8%
	地方債証券　32銘柄	31.8%	—	0.5%
	特殊債券　19銘柄	10.7%	—	0.2%
	社債券　12銘柄	8.0%	—	0.1%
ニュージーランドドル	国債証券　14銘柄	100.0%	—	0.2%
シンガポールドル	国債証券　20銘柄	100.0%	—	0.2%
マレーシアリンギット	国債証券　25銘柄	100.0%	—	0.4%
タイバーツ	国債証券　22銘柄	100.0%	—	0.3%
インドネシアルピア	国債証券　20銘柄	100.0%	—	0.5%
韓国ウォン	国債証券　28銘柄	100.0%	—	1.3%
イスラエルシェケル	国債証券　14銘柄	100.0%	—	0.1%

オフショア人民元	国債証券　54銘柄	53.4%	—	5.6%
	特殊債券　68銘柄	46.6%	—	4.9%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	8,572,805,481
コール・ローン	1,105,832,784
株式	215,435,007,288
投資信託受益証券	443,705,758
投資証券	203,060,253
派生商品評価勘定	362,356,828
未収入金	3,384,324
未収配当金	1,157,512,297
未収利息	2,039
差入委託証拠金	2,322,626,319
流動資産合計	229,606,293,371
資産合計	229,606,293,371
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	88,444
前受金	361,882,501
未払金	292,088
未払解約金	998,369,012
流動負債合計	1,360,632,045
負債合計	1,360,632,045
純資産の部	
元本等	
元本	45,973,691,996
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	182,271,969,330
元本等合計	228,245,661,326
純資産合計	228,245,661,326

負債純資産合計	229,606,293,371

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	45,973,691,996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 4.9647円 (1万口当たり純資産額) (49,647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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	41,095,182,350円
期中追加設定元本額	8,130,911,558円
期中一部解約元本額	3,252,401,912円
期末元本額	45,973,691,996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	7,169,685,094円
世界経済インデックスファンド	12,514,788,748円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	6,319,694,310円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	7,698,660,755円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	78,011,171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）	1,346,341,926円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	808,234,703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）	368,442,225円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,564,445円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	96,177,211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ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	2,195,497,712円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	289,362,941円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,338,217,233円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	217,701,010円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,423,609円
グローバル経済コア	699,879,520円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	478,826,673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	117,846,117円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	127,058,534円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	55,829,059円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	68,560,955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	24,751,389円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	1,208,905円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,583,372,292円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	127,851,257円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	85,969,807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）	11,633,415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）	21,719,279円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	32,746,450,391
投資信託受益証券	△497,529
投資証券	△43,245,994
合計	32,702,706,868

(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 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	12,618,882,938	－	12,980,765,439	361,882,501
合計		12,618,882,938	－	12,980,765,439	361,882,501

(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 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	956,967,036	－	957,368,665	401,629
	アメリカドル	956,967,036	－	957,368,665	401,629
	売建	1,252,836	－	1,268,582	△15,746
	ブラジルレアル	1,252,836	－	1,268,582	△15,746
合計		958,219,872	－	958,637,247	385,883

(注)時価の算定方法

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

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

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

ます。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.83	255,799.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	36,930	16.74	618,208.20	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	－	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	－	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	－	
	SOUTHERN COPPER CORP	15,912	114.99	1,829,720.88	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	72,831	20.36	1,482,839.16	
	NIO INC - ADR	231,271	4.50	1,040,719.50	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	40,826	31.06	1,268,055.56	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	10.69	847,374.92	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	30.43	2,022,134.36	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	27.82	341,713.06	
	IQIYI INC-ADR	59,454	3.83	227,708.82	
	KANZHUN LTD	38,815	18.47	716,913.05	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	158,547	15.27	2,421,012.69	
	VK CO LTD	19,368	0.00	－	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	－	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	104,219	137.72	14,353,040.68	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	13.42	733,751.92	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	46.71	690,747.48	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	488,730	1.56	762,418.80	
	CREDICORP LTD	10,882	168.66	1,835,358.12	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	－	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	19.76	410,079.28	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	168,912	1.64	277,015.68	
	KE HOLDINGS INC	114,048	15.16	1,728,967.68	
アメリカドル 小計		2,008,880		33,863,578.84 (5,470,661,161)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,664,261	11.19	29,813,080.59	

	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	109.62	53,592,341.04	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	248.26	8,689,100.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	23.71	4,233,467.92	
	ALFA S.A.B.-A	313,500	11.11	3,482,985.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	131.77	13,440,540.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	544.76	18,290,317.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	153.72	8,162,532.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	286.61	17,190,867.80	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	167.60	7,154,006.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	941,080	63.95	60,182,066.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	177.17	14,505,793.75	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	200.48	62,778,307.20	
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	349.90	9,083,404.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	279,600	63.92	17,872,032.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	31.15	5,663,070.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	57.10	8,148,170.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	451,600	147.02	66,394,232.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	271,700	43.31	11,767,327.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	16.17	56,940,067.80	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	16.86	3,727,746.00	
メキシコペソ 小計		10,403,440		481,111,453.10 (4,342,511,975)	
ブラジルレアル	COSAN SA	162,100	14.08	2,282,368.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	634,100	40.89	25,928,349.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	841,840	38.43	32,351,911.20	
	PRIO SA	130,000	45.41	5,903,300.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,900	22.98	3,490,662.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	13.02	1,294,188.00	
	GERDAU SA-PREF	186,708	17.91	3,343,940.28	
	SUZANO SA	121,779	52.83	6,433,584.57	
	VALE SA	581,587	63.02	36,651,612.74	
	WEG SA	314,144	44.55	13,995,115.20	
	CCR SA	248,600	12.63	3,139,818.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	137,340	44.42	6,100,642.80	
	LOCALIZA RENT A CAR SA - RTS	1,387	11.95	16,574.65	
	RUMO SA	244,300	21.77	5,318,411.00	

	LOJAS RENNER S.A.	216,447	13.24	2,865,758.28	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	22.20	3,840,600.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	10.34	1,371,084.00	
	RAIA DROGASIL SA	259,280	25.19	6,531,263.20	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	299,700	11.48	3,440,556.00	
	AMBEV SA	756,200	11.25	8,507,250.00	
	BRF SA	119,300	22.15	2,642,495.00	
	JBS SA	110,000	30.92	3,401,200.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	200,308	15.89	3,182,894.12	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.06	4,243,325.24	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	28.59	2,736,063.00	
	HYPERA SA	54,500	29.07	1,584,315.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	11.35	3,700,361.05	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	12.46	10,319,147.72	
	BANCO DO BRASIL S.A.	313,000	26.20	8,200,600.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	841,481	33.10	27,853,021.10	
	ITAUSA SA	824,701	9.97	8,222,268.97	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,055,809	10.62	11,212,691.58	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	33.25	3,620,925.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	142,000	14.31	2,032,020.00	
	TOTVS SA	124,500	29.90	3,722,550.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	46.76	4,180,344.00	
	TIM SA	96,100	15.84	1,522,224.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	42.73	1,581,010.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	38.55	8,161,035.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	275,375	10.51	2,894,191.25	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	84.27	4,255,635.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	204,600	10.00	2,046,000.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	33.37	907,664.00	
	ENEVA SA	102,200	13.23	1,352,106.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	45.77	2,116,862.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	33.46	5,524,246.00	
ブラジルレアル 小計		13,187,395		304,022,184.45 (9,055,118,350)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	7,001.00	633,051,423.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,718.00	233,587,870.00	

	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	30,645	37,520.00	1,149,800,400.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	69.90	172,037,041.20	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	42,366,632	12.55	531,701,231.60	
	FALABELLA SA	214,533	3,000.00	643,599,000.00	
	CENCOSUD SA	306,432	1,724.60	528,472,627.20	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	109.00	826,569,127.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	26,700.00	186,606,300.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	45.12	521,143,625.28	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	89.00	310,727,035.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	54.60	139,845,778.80	
チリペソ 小計		70,798,772		5,877,141,459.08 (1,018,443,966)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	50,698	35,240.00	1,786,597,520.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	33,620.00	2,069,815,300.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	18,280.00	923,341,080.00	
コロンビアペソ 小計		162,774		4,779,753,900.00 (192,203,463)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	23.14	120,351.14	
	METLEN ENERGY & METALS SA	20,295	36.78	746,450.10	
	OPAP SA	44,643	15.40	687,502.20	
	JUMBO SA	19,341	27.34	528,782.94	
	ALPHA SERVICES AND HLD	511,806	1.65	844,479.90	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	2.10	900,226.40	
	NATIONAL BANK OF GREECE	133,931	7.89	1,056,715.59	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	113,059	3.68	416,283.23	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.98	366,373.86	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	11.71	654,495.32	
ユーロ 小計		1,358,036		6,321,660.68 (1,104,394,120)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	168.80	24,069,192.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	54.60	14,134,192.80	
	SASA POLYESTER SANAYI	368,879	43.58	16,075,746.82	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	64.55	12,853,970.60	
	KOC HOLDING AS	89,884	226.80	20,385,691.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	49.76	14,865,700.48	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	35,097	238.90	8,384,673.30	

	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	310.75	26,915,611.25	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	1,066.00	17,450,420.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	317.25	10,026,051.75	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	554.00	45,000,312.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	20,274	818.00	16,584,132.00	
	AKBANK T.A.S.	586,183	64.60	37,867,421.80	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	101.90	21,538,806.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	1,876,733	16.12	30,252,935.96	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	31.26	11,601,430.02	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	109.40	15,654,155.40	
トルコリラ 小計		4,817,794		343,660,444.18 (1,687,235,316)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	783.00	10,416,249.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	104.00	6,313,840.00	
	CEZ AS	25,283	893.50	22,590,360.50	
チェココルナ 小計		99,296		39,320,449.50 (271,727,898)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	96,018	2,840.00	272,691,120.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	9,595.00	275,769,895.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	17,780.00	711,573,380.00	
ハンガリーフォリント 小計		164,780		1,260,034,395.00 (558,287,219)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	102,979	66.88	6,887,235.52	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	154.65	3,121,764.90	
	BUDIMEX	2,656	693.50	1,841,936.00	
	LPP SA	230	17,060.00	3,923,800.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	147.40	988,169.60	
	ALLEGRO.EU SA	83,795	36.09	3,024,161.55	
	DINO POLSKA SA	9,471	388.50	3,679,483.50	
	BANK PEKAO SA	27,684	168.20	4,656,448.80	
	M BANK SA	1,423	633.00	900,759.00	
	PKO BANK POLSKI SA	159,920	61.70	9,867,064.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	557.40	4,092,988.20	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	116,529	50.62	5,898,697.98	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	7.32	730,935.20	
ポーランドズロチ 小計		638,720		49,613,444.25	

				(2,036,021,641)	
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 (140)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	8.81	2,898,490.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	7.35	1,778,700.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	5.04	19,501,776.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	575,500	36.35	20,919,425.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	272,000	9.63	2,619,360.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	3,800,000	8.25	31,350,000.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	557,700	11.10	6,190,470.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,120,000	5.73	6,417,600.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	20.45	4,856,875.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	12.28	6,821,540.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	2.63	1,914,640.00	
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	7.81	6,326,100.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	15.48	836,539.20	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	16.38	3,832,920.00	
	MMG LIMITED	1,176,000	3.26	3,833,760.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	245,000	16.88	4,135,600.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	321,000	14.98	4,808,580.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	17.84	16,145,200.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.59	987,250.00	

	BOC AVIATION LTD	68,800	56.50	3,887,200.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	546,000	4.57	2,495,220.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.23	2,986,380.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	11.02	4,870,840.00	
	CITIC LTD	1,038,000	7.12	7,390,560.00	
	CRRC CORP LTD-H	936,000	5.13	4,801,680.00	
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.24	1,221,120.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	178,000	21.55	3,835,900.00	
	SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	16.60	2,763,900.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	408,800	12.22	4,995,536.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	31.00	1,931,300.00	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	12.40	4,780,782.80	
	COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	12.52	6,485,986.00	
	JD LOGISTICS INC	326,200	8.23	2,684,626.00	
	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	7.93	2,553,460.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	32,500	119.90	3,896,750.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.32	1,649,200.00	
	BYD CO LTD-H	187,000	235.20	43,982,400.00	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	144,000	46.45	6,688,800.00	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	8.15	7,726,200.00	
	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	12.30	6,073,125.00	
	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	2.64	946,028.16	
	LI AUTO INC-CLASS A	234,842	78.65	18,470,323.30	
	XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	29.00	4,847,698.00	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	10.18	2,382,120.00	
	ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	23.10	2,002,770.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	240,200	69.70	16,741,940.00	
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.11	1,800,180.00	
	HAIER SMART HOME CO LTD-H	460,600	24.40	11,238,640.00	
	HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	99,000	23.25	2,301,750.00	
	LI NING CO LTD	380,000	15.04	5,715,200.00	
	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	71.25	11,314,500.00	
	HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	13.24	3,098,160.00	
	MEITUAN-CLASS B	873,750	114.70	100,219,125.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	62.20	15,207,900.00	
	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	14.80	2,468,640.00	

	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	9.34	737,860.00	
	TRIP.COM GROUP LTD	96,607	389.00	37,580,123.00	
	BAIDU INC-CLASS A	404,500	86.30	34,908,350.00	
	BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	129.70	5,395,520.00	
	CHINA LITERATURE LTD	51,600	25.05	1,292,580.00	
	CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	2.04	2,586,720.00	
	KINGSOFT CORP LTD	171,200	22.05	3,774,960.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	452,400	47.60	21,534,240.00	
	NETEASE INC	338,630	144.50	48,932,035.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	1,137,400	381.00	433,349,400.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,735,288	72.50	198,308,380.00	
	CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	51.00	459,000.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	8.17	2,058,840.00	
	JD.COM INC - CL A	414,161	102.20	42,327,254.20	
	MINISO GROUP HOLDING LTD	42,904	35.45	1,520,946.80	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	36.25	2,341,750.00	
	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	3.80	1,558,000.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	11.68	1,074,560.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	3.09	2,422,560.00	
	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	20.65	3,994,742.50	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	115.00	1,748,000.00	
	CHINA FEIHE LTD	564,000	3.59	2,024,760.00	
	CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	13.64	7,870,280.00	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	25.90	6,371,400.00	
	HUISHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
	NONGFU SPRING CO LTD-H	348,600	33.75	11,765,250.00	
	SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	8.38	1,634,100.00	
	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	9.71	4,039,360.00	
	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	47.60	5,521,600.00	
	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	4.70	4,587,200.00	
	GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	90,600	40.70	3,687,420.00	
	HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	24.55	2,148,125.00	
	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	26.05	1,964,170.00	
	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	3.88	1,548,896.00	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	11.50	1,476,600.00	
	SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	19.80	3,785,760.00	

	AKESO INC	61,000	37.30	2,275,300.00	
	BEIGENE LTD	110,905	87.75	9,731,913.75	
	CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	6.09	8,453,894.40	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.59	1,895,010.00	
	GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	8.97	1,991,340.00	
	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	272,000	15.98	4,346,560.00	
	INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	36.60	7,429,800.00	
	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	2.83	5,577,930.00	
	WUXI APPTEC CO LTD-H	63,688	28.10	1,789,632.80	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	628,000	10.84	6,807,520.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,135,000	3.35	17,202,250.00	
	BANK OF CHINA LTD-H	13,437,200	3.47	46,627,084.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	5.78	7,927,125.50	
	CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	4.65	7,278,180.00	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	16,601,620	5.38	89,316,715.60	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.34	877,500.00	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	725,423	33.10	24,011,501.30	
	CHINA MINSHENG BANKING-H	1,835,900	2.78	5,103,802.00	
	IND&COMM BK OF CHINA-H	11,401,515	4.31	49,140,529.65	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,850,000	4.20	7,770,000.00	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	3.79	1,830,570.00	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	8.19	2,876,328.00	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	10.96	3,132,094.00	
	FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.15	1,236,000.00	
	GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	6.22	551,092.00	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	3.49	1,246,628.00	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	7.94	2,112,040.00	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,320,000	10.60	13,992,000.00	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	506,600	19.26	9,757,116.00	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.34	1,534,760.16	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	309,600	15.58	4,823,568.00	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.58	4,845,240.00	
	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	9.10	10,895,320.80	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,178,000	34.95	41,171,100.00	
	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	7.68	3,786,240.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	221,500	31.80	7,043,700.00	

	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	36.70	5,890,350.00	
	LENOVO GROUP LTD	1,588,000	11.36	18,039,680.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	119,500	46.50	5,556,750.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	2,704,200	16.40	44,348,880.00	
	ZTE CORP-H	82,908	19.00	1,575,252.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	1.04	7,365,280.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	26.70	1,588,650.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.43	1,482,300.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	3.54	5,055,120.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	7.36	3,432,704.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	7.11	3,213,720.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	4.09	2,723,940.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	28.75	5,658,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	24.20	6,229,080.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	62.45	7,306,650.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	4.41	1,966,860.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	5.60	3,942,400.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	8.81	4,827,880.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	10.44	668,160.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.11	3,495,390.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	22.80	2,052,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	3.46	3,100,115.02	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	15.54	1,421,195.16	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	13.16	7,692,546.40	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	26.40	14,285,330.40	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	24.15	2,873,850.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	4.49	1,416,595.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	10.76	3,696,060.00	
香港ドル 小計		136,539,398		1,966,253,631.90 (40,662,125,107)	
マレーシアリンギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	17.32	1,531,088.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.22	2,590,008.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	6.05	4,583,480.00	
	GAMUDA BHD	414,102	7.33	3,035,367.66	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.66	894,680.36	

	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	10.12	1,085,683.72	
	MISC BHD	217,540	8.75	1,903,475.00	
	GENTING BHD	271,600	4.57	1,241,212.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.50	924,250.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.94	588,693.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.70	1,000,258.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	116,562	19.94	2,324,246.28	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	122.40	2,227,680.00	
	PPB GROUP BERHAD	163,480	14.16	2,314,876.80	
	QL RESOURCES BHD	124,800	6.53	814,944.00	
	SD GUTHRIE BHD	247,046	4.15	1,025,240.90	
	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	6.30	2,969,820.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	4.36	1,311,052.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,233,202	6.97	8,595,417.94	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	19.26	2,336,083.92	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	10.06	8,867,940.30	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,544,100	4.11	10,456,251.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.54	1,215,182.38	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.54	1,374,366.06	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	3.57	1,777,860.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.43	918,897.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	6.82	1,851,984.64	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	17.88	2,653,392.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	14.42	6,370,395.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	812,700	3.71	3,015,117.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	499,400	5.19	2,591,886.00	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	3.92	1,076,824.00	
マレーシアリンギット 小計		13,749,909		85,467,653.46 (2,931,600,341)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	308,100	151.50	46,677,150.00	
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	33.00	55,591,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	53.50	15,707,867.50	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	19.90	4,107,360.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	31.00	15,070,154.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	31.00	6,283,700.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	230.00	29,992,000.00	

	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	57.25	37,493,025.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	7.55	6,168,350.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	3.62	2,933,286.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	848,938	29.25	24,831,436.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	31.75	5,784,850.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	9.20	7,729,242.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	16.20	12,836,880.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	57.50	54,993,000.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	29.75	7,077,822.50	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	24.20	13,464,880.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	26.25	49,562,625.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	243.00	20,096,100.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	133,200	128.50	17,116,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	17.50	7,676,375.00	
	SCB X PCL-NVDR	151,200	106.50	16,102,800.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	8,727,200	1.80	15,708,960.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	38.25	3,882,375.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	85.75	42,532,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	218.00	44,428,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	74.25	9,047,362.50	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	9.05	18,241,342.90	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	12.40	2,726,760.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	40.00	2,728,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	694,100	40.50	28,111,050.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	55.75	21,095,800.00	
タイバーツ 小計		25,728,940		645,798,953.90 (2,860,889,365)	
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	54,410	566.50	30,823,265.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	27.40	16,059,770.20	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	857.00	31,096,245.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	360.00	55,126,800.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	230.80	14,081,108.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	115.50	11,037,180.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	123.00	28,880,646.00	
	BDO UNIBANK INC	394,773	140.90	55,623,515.70	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	545,077	65.65	35,784,305.05	

	PLDT INC	20,460	1,485.00	30,383,100.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	380.60	20,240,308.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	29.40	37,658,460.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	28.80	44,736,480.00	
フィリピンペソ 小計		5,069,060		411,531,182.95 (1,137,348,730)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,900.00	6,270,670,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,675.00	4,756,307,500.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	1,103,600	11,025.00	12,167,190,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,345.00	1,325,901,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,896,836	1,110.00	3,215,487,960.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK	1,270,900	9,200.00	11,692,280,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	754,000	8,875.00	6,691,750,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,440.00	3,960,844,680.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	4,560.00	14,944,488,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	50.00	6,731,995,200.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,138,700	2,860.00	8,976,682,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	1,553,300	5,300.00	8,232,490,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	10,325.00	6,188,805,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	1,403,800	5,950.00	8,352,610,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	3,000.00	3,472,200,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,550.00	6,492,175,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	9,369,500	10,075.00	94,397,712,500.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	6,375.00	38,898,924,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	4,860.00	12,561,156,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	12,030,502	4,870.00	58,588,544,740.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,898,500	3,080.00	27,407,380,000.00	
インドネシアルピア 小計		199,940,831		345,325,593,580.00 (3,453,255,935)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	73,200.00	379,176,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	66,600.00	425,374,200.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,044	112,500.00	1,129,950,000.00	
	ENCHEM CO LTD	1,966	220,500.00	433,503,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	27,350.00	499,848,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	28,750.00	321,683,750.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	532,000.00	640,528,000.00	

	KUM YANG CO LTD	5,389	84,800.00	456,987,200.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	156,400.00	296,847,200.00	
	LG CHEM LTD	9,272	362,500.00	3,361,100,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	250,500.00	219,688,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	108,600.00	251,517,600.00	
	POSCO HOLDINGS INC	13,371	373,000.00	4,987,383,000.00	
	SKC CO LTD	1,432	169,000.00	242,008,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	12,098	50,600.00	612,158,800.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	22,250.00	1,824,566,750.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	193,800.00	1,595,361,600.00	
	ECOPRO CO LTD	15,665	101,200.00	1,585,298,000.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	2,769	102,300.00	283,268,700.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	47,250.00	311,519,250.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	252,000.00	1,468,152,000.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	14,849	30,250.00	449,182,250.00	
	HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	3,567	326,500.00	1,164,625,500.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	152,400.00	322,326,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	159,700.00	1,001,159,300.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	32,100.00	313,552,800.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	50,300.00	674,824,800.00	
	L&F CO LTD	4,327	144,600.00	625,684,200.00	
	LG CORP	16,658	82,100.00	1,367,621,800.00	
	LG ENERGY SOLUTION	8,760	363,000.00	3,179,880,000.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	261,000.00	1,241,838,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	57,000.00	492,879,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	15,406	147,700.00	2,275,466,200.00	
	SAMSUNG E&A CO LTD	30,300	24,000.00	727,200,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	9,700.00	923,139,300.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	44,200.00	103,339,600.00	
	SK INC	6,394	157,500.00	1,007,055,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	19,731	103,200.00	2,036,239,200.00	
	HANJIN KAL CORP	7,812	68,000.00	531,216,000.00	
	HMM CO LTD	35,545	18,050.00	641,587,250.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	244,000.00	681,492,000.00	
	KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	22,550.00	604,836,100.00	
	HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	18,150	43,300.00	785,895,000.00	

	HYUNDAI MOBIS	10,148	233,500.00	2,369,558,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO	23,448	274,500.00	6,436,476,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	174,900.00	1,056,745,800.00	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	171,400.00	591,158,600.00	
	KIA CORP	45,204	122,500.00	5,537,490,000.00	
	COWAY CO LTD	9,036	60,700.00	548,485,200.00	
	LG ELECTRONICS INC	17,254	109,600.00	1,891,038,400.00	
	HYBE CO LTD	4,975	194,300.00	966,642,500.00	
	KAKAO CORP	52,020	42,450.00	2,208,249,000.00	
	KRAFTON INC	6,265	289,500.00	1,813,717,500.00	
	NAVER CORP	21,578	170,700.00	3,683,364,600.00	
	NCSOFT CORPORATION	2,709	191,200.00	517,960,800.00	
	NETMARBLE CORP	2,465	56,800.00	140,012,000.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	373,500.00	686,866,500.00	
	KT&G CORP	19,456	86,100.00	1,675,161,600.00	
	ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	93,900.00	295,033,800.00	
	AMOREPACIFIC CORP	3,762	153,800.00	578,595,600.00	
	LG H&H CO LTD	1,321	358,500.00	473,578,500.00	
	HLB INC	23,903	95,100.00	2,273,175,300.00	
	ALTEOGEN INC	6,824	262,500.00	1,791,300,000.00	
	CELLTRION INC	27,796	187,200.00	5,203,411,200.00	
	CELLTRION PHARM INC	2,169	94,600.00	205,187,400.00	
	HANMI PHARM CO LTD	1,202	283,500.00	340,767,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,362	796,000.00	2,676,152,000.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	80,700.00	257,997,900.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	54,000.00	113,400,000.00	
	YUHAN CORPORATION	13,854	88,500.00	1,226,079,000.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	51,249	62,400.00	3,197,937,600.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	13,880.00	393,220,400.00	
	KAKAOBANK CORP	35,459	21,750.00	771,233,250.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	85,200.00	5,503,834,800.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	80,543	51,500.00	4,147,964,500.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	113,814	14,690.00	1,671,927,660.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	71,000.00	326,742,000.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	80,700.00	1,369,882,500.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	7,540.00	233,853,100.00	

	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	12,820.00	155,211,740.00	
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	105,800.00	1,065,829,200.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,144	366,000.00	2,248,704,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	90,400.00	1,096,642,400.00	
	POSCO DX CO LTD	9,010	37,050.00	333,820,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	157,900.00	1,150,143,600.00	
	COSMOAM&T CO LTD	3,978	148,200.00	589,539,600.00	
	LG DISPLAY CO LTD	51,846	12,740.00	660,518,040.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	275,000.00	741,400,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	11,233	163,700.00	1,838,842,100.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	822,794	87,800.00	72,241,313,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	141,877	68,800.00	9,761,137,600.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	10,263	382,500.00	3,925,597,500.00	
	KT CORP	10,500	36,150.00	379,575,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	9,840.00	217,710,000.00	
	SK TELECOM	9,563	51,300.00	490,581,900.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	19,830.00	877,279,200.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	164,100.00	1,187,755,800.00	
	SK HYNIX INC	94,417	238,500.00	22,518,454,500.00	
韓国ウォン 小計		2,610,207		227,131,215,340.00 (26,506,212,830)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	238,240	63.80	15,199,712.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	44.55	20,233,540.80	
	CHINA STEEL	2,373,261	23.20	55,059,655.20	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	48.50	26,289,958.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	57.00	34,075,968.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	48.50	37,381,472.00	
	TCC GROUP HOLDINGS	1,268,419	34.00	43,126,246.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	31,557	995.00	31,399,215.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	37.55	13,594,151.40	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	20,000	948.00	18,960,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,900.00	17,100,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	35.60	17,878,782.80	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	23.80	11,067,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	34.80	13,432,800.00	
	EVERGREEN MARINE	183,215	178.00	32,612,270.00	

	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	30.70	14,490,400.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	77.20	5,761,822.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	65.20	14,148,400.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	463,061	46.20	21,393,418.20	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	553.00	22,085,161.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	140.00	11,046,140.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	381.00	11,811,000.00	
	POU CHEN	273,780	34.40	9,418,032.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	621.00	33,571,260.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	282.50	25,013,680.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	84.70	65,760,656.50	
	PHARMAESSENTIA CORP	25,000	570.00	14,250,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	608,378	18.65	11,346,249.70	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,090,237	39.95	123,454,968.15	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,474,537	29.25	72,380,207.25	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,175,358	28.65	62,324,006.70	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	27.20	41,299,419.20	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,066,087	41.65	86,052,523.55	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,791,444	26.60	47,652,410.40	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,000,651	19.60	39,212,759.60	
	TAIWAN BUSINESS BANK	798,720	18.40	14,696,448.00	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	2,066,926	26.40	54,566,846.40	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	45.95	31,704,810.75	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	287,702	157.50	45,313,065.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,919,822	33.00	63,354,126.00	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,731,057	62.10	107,498,639.70	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	16.20	41,734,861.20	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,353,451	86.00	116,396,786.00	
	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	11.00	21,250,526.00	
	ACCTON TECHNOLOGY CORP	86,000	567.00	48,762,000.00	
	ACER INC	617,803	45.75	28,264,487.25	
	ADVANTECH CO LTD	76,261	373.50	28,483,483.50	
	ASIA VITAL COMPONENTS	55,000	727.00	39,985,000.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	486.50	61,830,258.00	
	AUO CORP	1,268,072	18.25	23,142,314.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	214.50	25,461,150.00	

	COMPAL ELECTRONICS	805,760	34.10	27,476,416.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	347,903	410.00	142,640,230.00	
	E INK HOLDINGS INC	144,000	270.00	38,880,000.00	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	75,000	315.00	23,625,000.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,185,248	225.50	492,773,424.00	
	INNOLUX CORP	1,320,576	15.00	19,808,640.00	
	INVENTEC CO LTD	455,511	56.00	25,508,616.00	
	LARGAN PRECISION CO LTD	20,040	3,115.00	62,424,600.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	107.00	37,819,364.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	180.50	18,050,000.00	
	PEGATRON CORP	340,474	104.50	35,579,533.00	
	QUANTA COMPUTER INC	463,270	336.00	155,658,720.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	71.80	14,510,780.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	177.00	37,347,000.00	
	WISTRON CORP	427,000	108.50	46,329,500.00	
	WIWYNN CORP	16,000	2,670.00	42,720,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	260,692	92.90	24,218,286.80	
	YAGEO CORPORATION	64,588	745.00	48,118,060.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	142.00	19,584,924.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	119.00	69,533,485.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	86.50	18,684,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	101.00	24,765,200.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	12,000	2,695.00	32,340,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	594,315	180.00	106,976,700.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,785.00	33,420,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,635.00	21,255,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	580.00	24,360,000.00	
	MEDIATEK INC	266,804	1,460.00	389,533,840.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	73.00	18,907,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	604.00	58,011,180.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	573.00	49,245,912.00	
	SILERGY CORP	53,000	426.50	22,604,500.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,243,389	1,040.00	4,413,124,560.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,976,000	55.30	109,272,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	123.00	23,124,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	363,030	25.55	9,275,416.50	

	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	44.15	12,321,249.55	
新台湾ドル 小計		59,687,450		8,622,156,024.60 (42,771,929,391)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	299,904	300.30	90,061,171.20	
	COAL INDIA LTD	295,479	493.60	145,848,434.40	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	188,229	331.00	62,303,799.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	171.70	102,511,081.20	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	297.45	160,551,017.10	
	PETRONET LNG LTD	83,779	334.55	28,028,264.45	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	522,888	3,180.15	1,662,862,273.20	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	677.40	49,811,254.20	
	APL APOLLO TUBES LTD	26,431	1,554.50	41,086,989.50	
	ASIAN PAINTS LTD	67,203	2,905.20	195,238,155.60	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	2,772.25	129,860,506.75	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	246,890	707.20	174,600,608.00	
	JINDAL STAINLESS LTD	54,371	810.85	44,086,725.35	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	1,021.45	71,270,652.30	
	JSW STEEL LTD	99,332	935.00	92,875,420.00	
	NMDC LTD	146,261	251.15	36,733,450.15	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,862.80	49,432,251.60	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	3,112.65	90,764,874.00	
	SHREE CEMENT LTD	1,387	27,777.00	38,526,699.00	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	4,277	12,039.10	51,491,230.70	
	SRF LTD	33,773	2,391.15	80,756,308.95	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	6,022.45	60,296,769.40	
	TATA STEEL LTD	1,356,728	171.80	233,085,870.40	
	ULTRATECH CEMENT LTD	19,852	11,680.45	231,880,293.40	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	563.85	39,272,716.35	
	VEDANTA LTD	184,749	465.35	85,972,947.15	
	ABB LTD INDIA	11,720	8,572.45	100,469,114.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	33,650	3,108.90	104,614,485.00	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	228.35	55,254,534.55	
	ASTRAL LTD	19,918	2,335.40	46,516,497.20	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	646,541	334.55	216,300,291.55	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	151,803	329.25	49,981,137.75	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	757.65	53,343,105.90	

	CUMMINS INDIA LTD	20,968	3,986.20	83,582,641.60	
	HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,920.40	68,492,986.40	
	HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	36,316	5,540.50	201,208,798.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	118,675	3,664.50	434,884,537.50	
	POLYCAB INDIA LTD	7,354	6,455.75	47,475,585.50	
	SIEMENS INDIA LTD	16,262	7,757.75	126,156,530.50	
	SUZLON ENERGY LTD	1,500,000	55.39	83,085,000.00	
	THERMAX LTD	7,627	5,521.40	42,111,717.80	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	52,993	1,027.85	54,468,855.05	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	1,477.90	154,561,737.80	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	1,040.60	27,529,073.00	
	GMR AIRPORTS INFRASTRUCRURE	394,498	98.52	38,865,942.96	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	4,302.65	113,809,395.15	
	BAJAJ AUTO LTD	9,644	9,540.55	92,009,064.20	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	3,188.45	28,157,201.95	
	BHARAT FORGE LTD	30,322	1,669.55	50,624,095.10	
	BOSCH LTD	1,235	35,624.30	43,996,010.50	
	EICHER MOTORS LTD	26,253	4,827.00	126,723,231.00	
	HERO MOTOCORP LTD	21,431	5,587.55	119,746,784.05	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	165,233	2,925.80	483,438,711.40	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	24,350	12,820.20	312,171,870.00	
	MRF LTD	432	131,297.90	56,720,692.80	
	SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	203.00	105,810,705.00	
	SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	680.10	40,322,448.90	
	TATA MOTORS LTD	277,381	1,014.75	281,472,369.75	
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	75,000	691.10	51,832,500.00	
	TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	4,388.50	92,825,552.00	
	TVS MOTOR CO LTD	41,254	2,438.30	100,589,628.20	
	PAGE INDUSTRIES LTD	886	39,419.70	34,925,854.20	
	TITAN CO LTD	56,531	3,215.55	181,778,257.05	
	INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	608.55	100,104,649.35	
	JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	573.20	25,180,676.00	
	ZOMATO LTD	1,054,701	212.50	224,123,962.50	
	INFO EDGE INDIA LTD	14,356	6,943.05	99,674,425.80	
	TRENT LTD	37,950	5,589.40	212,117,730.00	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	4,806.45	137,426,018.40	

	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	22,156	5,669.55	125,614,549.80	
	ITC LTD	480,447	452.75	217,522,379.25	
	MARICO LTD	81,711	637.60	52,098,933.60	
	NESTLE INDIA LIMITED	51,460	2,630.70	135,375,822.00	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	1,142.00	106,478,938.00	
	UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,287.30	75,410,034.00	
	VARUN BEVERAGES LTD	80,358	1,611.55	129,500,934.90	
	COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	2,992.00	77,792,000.00	
	DABUR INDIA LTD	144,837	630.15	91,269,035.55	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,411.10	89,458,095.60	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	144,060	2,589.45	373,036,167.00	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	6,318.10	92,004,172.20	
	MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	917.20	110,239,185.20	
	AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	1,333.15	47,213,507.25	
	CIPLA LTD	88,546	1,511.80	133,863,842.80	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	4,554.50	99,889,294.00	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	6,583.25	120,611,723.25	
	LUPIN LTD	48,134	1,812.85	87,259,721.90	
	MANKIND PHARMA LTD	18,295	2,104.00	38,492,680.00	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	167,480	1,586.30	265,673,524.00	
	TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	2,936.10	35,879,142.00	
	AU SMALL FINANCE BANK LTD	92,107	640.25	58,971,506.75	
	AXIS BANK LTD	391,573	1,289.05	504,757,175.65	
	BANDHAN BANK LTD	74,811	200.75	15,018,308.25	
	BANK OF BARODA	248,313	261.75	64,995,927.75	
	CANARA BANK	305,000	116.00	35,380,000.00	
	HDFC BANK LTD	485,940	1,636.50	795,240,810.00	
	ICICI BANK LTD	879,852	1,248.20	1,098,231,266.40	
	IDFC FIRST BANK LTD	531,028	79.20	42,057,417.60	
	INDUSIND BANK LTD	48,365	1,434.05	69,357,828.25	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	186,345	1,847.60	344,291,022.00	
	PUNJAB NATIONAL BANK	272,403	122.30	33,314,886.90	
	STATE BANK OF INDIA	314,786	860.95	271,015,006.70	
	UNION BANK OF INDIA	238,889	139.75	33,384,737.75	
	YES BANK LTD	2,352,478	25.80	60,693,932.40	
	BAJAJ FINANCE LTD	49,376	7,065.80	348,880,940.80	

	BAJAJ FINSERV LTD	76,561	1,581.60	121,088,877.60	
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	9,849.65	29,499,701.75	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	83,998	1,403.65	117,903,792.70	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	14,173	4,187.55	59,350,146.15	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	471,182	349.95	164,890,140.90	
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,805.80	22,433,453.40	
	POWER FINANCE CORPORATION	265,755	549.95	146,151,962.25	
	REC LTD	186,584	612.15	114,217,395.60	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	730.20	44,319,489.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	54,695	2,788.15	152,497,864.25	
	SUNDARAM FINANCE LTD	11,164	4,545.40	50,744,845.60	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	207,570	623.50	129,419,895.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,858.25	62,494,805.75	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	646.20	29,283,199.20	
	PB FINTECH LTD	48,956	1,424.40	69,732,926.40	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,525.10	110,929,673.60	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	163,324	1,530.85	250,024,545.40	
	INFOSYS LTD	579,880	1,657.25	961,006,130.00	
	LTIMINDTREE LTD	15,699	5,376.55	84,406,458.45	
	MPHASIS LTD	19,317	2,600.30	50,229,995.10	
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	15,982	4,636.30	74,097,346.60	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	152,359	3,991.70	608,171,420.30	
	TATA ELXSI LTD	7,679	7,018.45	53,894,677.55	
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,467.05	139,071,938.85	
	WIPRO LTD	247,008	540.80	133,581,926.40	
	BHARTI AIRTEL LTD	389,936	1,435.10	559,597,153.60	
	INDUS TOWERS LTD	127,238	385.25	49,018,439.50	
	TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,843.25	36,540,588.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	60,702	1,757.70	106,695,905.40	
	ADANI POWER LTD	167,705	725.35	121,644,821.75	
	GAIL INDIA LTD	504,548	228.95	115,516,264.60	
	JSW ENERGY LTD	63,163	722.85	45,657,374.55	
	NHPC LTD	546,313	106.05	57,936,493.65	
	NTPC LTD	766,679	377.00	289,037,983.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	800,980	340.90	273,054,082.00	
	TATA POWER CO LTD	285,870	438.80	125,439,756.00	

	TORRENT POWER LTD	28,990	1,515.20	43,925,648.00	
	DLF LTD	126,742	838.30	106,247,818.60	
	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	3,268.55	97,278,585.10	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	41,942	1,560.55	65,452,588.10	
	PHOENIX MILLS LTD	17,280	4,026.00	69,569,280.00	
インドルピー 小計		26,473,199		21,376,024,007.86 (41,469,486,575)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	14.90	892,718.60	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.65	2,188,472.07	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	1,307,286	1.69	2,209,313.34	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	13.20	3,734,530.80	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	4.12	2,189,330.92	
	DUKHAN BANK	319,751	3.80	1,216,972.30	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.33	2,663,425.33	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	10.70	2,295,503.10	
	QATAR ISLAMIC BANK	335,301	19.80	6,638,959.80	
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	15.00	11,119,530.00	
	OOREDOO QSC	72,800	10.42	758,576.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	15.80	1,524,889.60	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.78	578,689.61	
カタールリアル 小計		5,782,030		38,010,911.47 (1,686,924,251)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	192.60	6,590,194.20	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	644.50	6,439,199.50	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	67,443	511.70	34,510,583.10	
	GOLD FIELDS LTD	144,200	285.45	41,161,890.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	176.60	17,635,452.60	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	94.66	14,279,177.02	
	KUMBA IRON ORE LTD	17,679	460.63	8,143,477.77	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	127.22	6,115,338.18	
	SASOL LTD	88,115	142.60	12,565,199.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	799,465	21.38	17,092,561.70	
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	284.99	14,335,851.97	
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,531.13	108,020,797.83	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	19.38	9,216,701.64	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	60.69	10,700,618.04	

	BID CORP LTD	58,066	425.17	24,687,921.22	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	336.60	11,923,045.20	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	288.50	24,587,124.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	235.44	13,227,490.08	
	ABSA GROUP LTD	140,135	156.18	21,886,284.30	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	2,635.00	38,471,000.00	
	NEDBANK GROUP LTD	88,111	255.82	22,540,556.02	
	STANDARD BANK GROUP LTD	242,949	212.10	51,529,482.90	
	FIRSTRAND LTD	816,636	77.72	63,468,949.92	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	454.60	7,813,210.20	
	REMGRO LTD	74,679	138.44	10,338,560.76	
	DISCOVERY LIMITED	98,779	138.70	13,700,647.30	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	12.54	12,222,186.24	
	OUTSURANCE GROUP LTD	237,864	47.25	11,239,074.00	
	SANLAM LTD	307,490	82.14	25,257,228.60	
	MTN GROUP LTD	350,498	82.14	28,789,905.72	
	VODACOM GROUP	166,454	96.52	16,066,140.08	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	67,336	130.89	8,813,609.04	
南アフリカランド 小計		6,024,943		713,369,458.13 (6,341,854,482)	
アラブ首長国連邦ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	2.06	1,070,470.76	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	3.13	1,350,425.98	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.40	1,509,674.80	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.09	3,813,868.70	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	250,781	11.90	2,984,293.90	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.81	3,051,086.64	
	EMIRATES NBD PJSC	357,699	16.75	5,991,458.25	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	12.50	9,050,237.50	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	642,138	16.04	10,299,893.52	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	6.41	4,652,576.71	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	8.07	8,946,950.76	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		6,200,824		52,720,937.52 (2,322,884,507)	
クウェートディナール	BOUBYAN BANK K.S.C	171,769	0.58	99,969.55	
	GULF BANK	162,936	0.28	45,622.08	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,794,507	0.72	1,297,428.56	

	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,404,477	0.86	1,212,063.65	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.45	135,057.65	
	MABANEE CO KPSC	150,334	0.87	130,940.91	
クウェートディナール 小計		3,980,853		2,921,082.40 (1,545,194,167)	
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	43.40	3,862,600.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	14.91	954,240.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	6.02	538,790.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	10.64	1,064,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	26.61	2,559,882.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	9.57	2,275,669.44	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	10.05	799,980.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	17.49	173,151.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	40,365	16.23	655,123.95	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	32.80	918,400.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	8.06	1,324,258.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	24.70	727,168.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	7.05	2,604,975.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	10.09	930,298.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	17.12	356,096.00	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	14,420	28.28	407,797.60	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	27.23	304,976.00	
	GEM CO LTD-A	289,800	6.33	1,834,434.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	15.99	396,967.74	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	13.87	514,577.00	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	7.26	1,070,850.00	
	HESTEEL CO LTD-A	832,100	1.96	1,630,916.00	
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	45.28	1,014,272.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.42	654,620.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	3.71	222,600.00	
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	7.58	169,034.00	
	JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	52.92	536,608.80	
	LB GROUP CO LTD-A	15,300	18.65	285,345.00	
	NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	7.50	353,250.00	
	NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	17.57	1,391,544.00	

	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	2.48	48,360.00	
	QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	16.07	764,932.00	
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	9.23	447,193.50	
	SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	18.16	1,007,426.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	29.48	213,788.96	
	SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	25.40	455,676.00	
	SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	4.07	1,166,462.00	
	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	13.37	217,128.80	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	4.69	514,389.82	
	SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.48	478,152.00	
	SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	30.11	325,188.00	
	SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	11.15	556,385.00	
	TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	27.59	314,526.00	
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	14.56	142,688.00	
	TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.76	1,246,816.00	
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	78.58	3,166,774.00	
	WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	26.27	387,535.04	
	WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	33.41	550,763.85	
	YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	32.21	58,622.20	
	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	29.59	121,319.00	
	ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	25.11	939,114.00	
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	21.44	158,870.40	
	ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	23.95	3,099,130.00	
	ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	19.45	677,793.60	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	18.82	5,064,462.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	35.04	399,456.00	
	AVICOPTER PLC-A	15,500	38.59	598,145.00	
	BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	27.30	229,320.00	
	CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	8.07	516,480.00	
	CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	41.01	2,264,367.15	
	CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.11	1,272,541.00	
	CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	7.67	1,764,867.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.26	2,958,224.00	
	CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	54,780	175.77	9,628,680.60	
	CRRC CORP LTD-A	185,800	7.81	1,451,098.00	
	DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	17.24	744,768.00	

	EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	35.54	1,402,870.42	
	GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	47.36	113,664.00	
	GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	6.69	134,542.59	
	GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	18.15	105,270.00	
	JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	42.14	482,755.84	
	JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	15.99	657,189.00	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	17.22	828,282.00	
	METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.11	1,029,099.00	
	NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	25.20	2,116,296.00	
	NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	8,316	76.35	634,926.60	
	NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	48.69	610,280.46	
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.53	902,496.00	
	SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.30	641,070.00	
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	3.56	1,732,652.00	
	SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	50.29	1,427,883.97	
	SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	7.73	193,713.80	
	SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	14,000	58.28	815,920.00	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	14.11	574,277.00	
	TBEA CO LTD-A	29,274	13.35	390,807.90	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	14.20	613,440.00	
	XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.56	1,308,064.00	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	18.42	582,072.00	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	53.35	440,671.00	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	19.20	140,160.00	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	7.42	594,342.00	
	SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	29.15	320,650.00	
	AIR CHINA LTD-A	225,900	7.14	1,612,926.00	
	BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.52	2,191,992.00	
	CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.84	153,600.00	
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	14.52	2,664,420.00	
	DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.18	1,152,390.00	
	S F HOLDING CO LTD-A	53,100	34.65	1,839,915.00	
	SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	33.80	179,782.20	
	SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	6.16	273,504.00	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	14.61	813,777.00	
	YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	7.05	153,972.00	

	BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	15,120	43.05	650,916.00	
	BYD CO LTD -A	17,000	252.60	4,294,200.00	
	CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	120.95	1,088,550.00	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	13.86	600,858.72	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	48.73	901,505.00	
	HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	15.73	539,539.00	
	HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	92.10	773,640.00	
	NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	15.18	444,774.00	
	NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	45,700	57.23	2,615,411.00	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	13.50	575,100.00	
	SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	18.22	715,207.88	
	ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	42.83	119,924.00	
	GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	38.38	1,669,530.00	
	HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	21.17	587,679.20	
	JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	28.17	223,444.44	
	MIDEA GROUP CO LTD-A	50,800	64.10	3,256,280.00	
	OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	47.05	362,285.00	
	QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	26.30	2,658,930.00	
	ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	47.25	378,000.00	
	SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	22.00	576,400.00	
	SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	7.77	260,139.60	
	37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	12.59	308,455.00	
	BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	7.69	412,184.00	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.08	847,552.00	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	19.84	323,392.00	
	ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	3.26	200,490.00	
	CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	63.15	1,308,468.00	
	SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	5.22	576,810.00	
	DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	13.55	302,043.05	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	17,035	23.61	402,196.35	
	ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	29.96	320,572.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	197.12	315,392.00	
	ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	36.44	80,168.00	
	ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	54.80	1,002,840.00	
	ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	71.71	215,130.00	
	CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	60.29	476,291.00	

	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	33.84	1,829,288.88	
	GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	44.17	750,890.00	
	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	23.22	1,824,627.60	
	INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	25.00	857,550.00	
	JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	46.24	799,952.00	
	JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	77.60	706,160.00	
	JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	21.45	246,675.00	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,000	1,438.03	18,694,390.00	
	LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	135.95	2,501,480.00	
	MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	42.79	1,435,946.82	
	NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	9.14	244,952.00	
	SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	189.80	1,780,324.00	
	SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	35.51	404,814.00	
	WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	19.31	736,869.60	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	127.07	5,273,405.00	
	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	27.24	275,124.00	
	BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	13.14	390,258.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	9.82	900,975.18	
	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	29.38	470,080.00	
	GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	25.01	70,978.38	
	HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	26.80	260,496.00	
	JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	27,985	4.75	132,928.75	
	LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	13.28	196,544.00	
	SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	281.11	4,188,539.00	
	ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	18,780	61.18	1,148,960.40	
	BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	99,816	23.89	2,384,604.24	
	BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	37.57	1,066,988.00	
	BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	65.63	688,261.81	
	BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	59.90	543,113.30	
	CHANGCHUN HIGH -TECH INDUST -A	2,200	90.20	198,440.00	
	CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	13,260	41.96	556,389.60	
	CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	26.08	387,288.00	
	DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	58.67	1,302,063.31	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	48.30	386,400.00	
	HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	15.15	285,577.50	
	IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,912	158.08	460,328.96	

	JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	119,102	38.99	4,643,786.98	
	SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.67	491,647.00	
	SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	14.94	162,547.20	
	SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	26.67	186,690.00	
	SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	14.80	139,712.00	
	SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	30.68	344,597.76	
	WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	10.85	184,450.00	
	WUXI APPTEC CO LTD-A	16,464	37.26	613,448.64	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	51.01	507,039.40	
	ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	3,900	200.85	783,315.00	
	ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	17.60	158,752.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	4.53	4,675,413.00	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.80	336,400.00	
	BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	14.84	2,335,816.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	7.74	3,962,106.00	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	13.34	1,503,418.00	
	BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.69	1,766,700.60	
	BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.14	1,495,650.00	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	21.70	1,265,110.00	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.33	333,515.00	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	7.67	957,983.00	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.27	2,731,431.00	
	CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	34.47	6,411,420.00	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.87	1,058,832.00	
	CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.81	1,127,315.80	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.40	764,160.00	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	5.94	3,436,884.00	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	16.43	3,376,365.00	
	PING AN BANK CO LTD-A	119,400	10.07	1,202,358.00	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.07	717,405.00	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	8.64	3,778,272.00	
	AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	2.18	267,050.00	
	BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	8.67	688,398.00	
	CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	6.47	370,925.10	
	CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	4.77	94,923.00	
	CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	6.56	306,352.00	

	CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.82	396,081.20	
	CITIC SECURITIES CO-A	141,080	17.86	2,519,688.80	
	CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	18.33	441,753.00	
	EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	10.13	1,189,535.51	
	EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	14.01	50,436.00	
	FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	4.89	294,378.00	
	GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	11.40	690,840.00	
	GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	4.92	844,660.68	
	GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	8.19	1,843,569.00	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	13.45	972,435.00	
	GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	5.96	906,218.00	
	HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	97.17	524,718.00	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	12.23	385,245.00	
	INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	4.91	561,065.70	
	ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	7.40	300,262.40	
	SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.22	874,384.00	
	SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	5.79	1,781,004.00	
	SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.56	405,840.00	
	ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.55	461,035.00	
	ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	5.45	1,715,660.00	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	28.91	2,896,782.00	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	41.52	4,351,296.00	
	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	7.30	196,370.00	
	BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	194.01	935,710.23	
	CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	28.72	926,679.52	
	HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	16.54	273,935.48	
	IFLYTEK CO LTD - A	10,800	39.00	421,200.00	
	SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	49.27	147,810.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	11,437	30.00	343,110.00	
	THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	43.47	239,085.00	
	YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	8.92	117,476.40	
	AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	41.52	1,573,608.00	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	614,600	4.10	2,519,860.00	
	CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	28.90	809,200.00	
	CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	8.44	293,712.00	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	37.02	336,882.00	

	FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	165,100	29.00	4,787,900.00	
	GOERTEK INC -A	26,900	20.68	556,292.00	
	GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	7.55	377,500.00	
	GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	27.82	194,740.00	
	INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	39.10	770,739.20	
	LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	19.46	326,928.00	
	LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	41.39	1,922,565.50	
	MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	73.96	127,802.88	
	NINESTAR CORP-A	18,543	26.99	500,475.57	
	SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	20.85	506,655.00	
	SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	109.75	522,410.00	
	SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	9,009	76.35	687,837.15	
	SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	23.87	680,295.00	
	TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	4.02	451,044.00	
	UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18,340	22.20	407,148.00	
	WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	29.01	121,842.00	
	WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	5.74	308,295.40	
	XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	74.24	348,928.00	
	YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	36.93	581,647.50	
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	14.69	445,107.00	
	ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	12,180	154.33	1,879,739.40	
	ZTE CORP-A	76,400	28.87	2,205,668.00	
	CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.77	2,016,756.00	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	11.46	1,991,748.00	
	CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.51	1,088,263.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	329,880	30.31	9,998,662.80	
	ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	20.94	1,164,264.00	
	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	6.06	1,913,142.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	18.95	3,352,255.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	20.10	1,855,230.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	141.90	1,007,064.30	
	AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	60.32	611,524.16	
	CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	207.34	2,368,237.48	
	CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	38.29	805,315.28	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	96.42	604,746.24	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	29,635	13.29	393,849.15	

	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	18.15	136,125.00	
	HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	41,125	73.11	3,006,648.75	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	55.27	414,525.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	9.88	337,915.76	
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	33.11	986,678.00	
	JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	7.26	166,878.36	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	13.16	1,320,474.40	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	59.78	1,258,667.90	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	324.79	1,006,849.00	
	SG MICRO CORP-A	4,095	76.77	314,373.15	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	3,920	79.32	310,934.40	
	SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	106.62	436,715.52	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	7.91	291,681.25	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.43	276,082.50	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	22.81	512,449.46	
	TONGWEI CO LTD-A	66,600	16.42	1,093,572.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	15.80	401,604.40	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	51.18	351,043.62	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	103.65	755,608.50	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	29.05	494,489.10	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	8.74	478,078.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	414,800	6.71	2,783,308.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.19	1,667,732.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	8.56	700,208.00	
オフショア人民元 小計		26,163,417		344,429,023.28 (7,630,170,595)	
サウジアラビアリアル	ADES HOLDING CO	80,157	19.78	1,585,505.46	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	708,811	28.15	19,953,029.65	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	39.20	461,580.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	114.40	4,280,047.20	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	27.80	1,313,299.80	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	42.60	8,981,954.40	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	130.00	1,215,370.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	163,857	73.80	12,092,646.60	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	21.22	1,810,554.06	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	7.95	822,276.45	

	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	39.20	2,002,296.80	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	6,159	303.40	1,868,640.60	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	231.80	975,182.60	
	JARIR MARKETING CO	125,000	12.70	1,587,500.00	
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	133.60	859,181.60	
	ALMARAI CO	56,483	57.70	3,259,069.10	
	SAVOLA	36,289	45.10	1,636,633.90	
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	157.80	1,078,247.40	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	16,399	283.60	4,650,756.40	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	122.00	1,942,728.00	
	AL RAJHI BANK	346,607	80.80	28,005,845.60	
	ALINMA BANK	201,652	31.40	6,331,872.80	
	ARAB NATIONAL BANK	195,935	21.02	4,118,553.70	
	BANK AL-JAZIRA	122,367	16.18	1,979,898.06	
	BANK ALBILAD	112,127	32.40	3,632,914.80	
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	35.55	3,371,384.25	
	RIYAD BANK	234,479	26.50	6,213,693.50	
	SAUDI AWWAL BANK	147,895	38.60	5,708,747.00	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	88,300	12.50	1,103,750.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	490,774	36.20	17,766,018.80	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	231.00	2,531,067.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	238.60	3,393,607.80	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	16,655	144.80	2,411,644.00	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	275.80	1,218,208.60	
	ELM CO	4,094	844.00	3,455,336.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	48,844	52.80	2,578,963.20	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	10.98	993,777.84	
	SAUDI TELECOM CO	339,167	38.60	13,091,846.20	
	ACWA POWER CO	24,653	370.20	9,126,540.60	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR	16,081	60.60	974,508.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	16.24	2,632,650.16	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	11.88	1,199,773.08	
サウジアラビアリアル 小計		4,650,675		194,217,101.61 (8,378,525,763)	
合　計		1,387,481,759		215,435,007,288 (215,435,007,288)	

(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	14,537,795.20	
	メキシコペソ 小計		97,360	14,537,795.20 (131,218,139)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	6,405,594.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,791,460.00	
		KLABIN SA-UNIT	110,000	2,294,600.00	
	ブラジルレアル 小計		347,700	10,491,654.00 (312,487,619)	
投資信託受益証券合計			445,060	443,705,758 (443,705,758)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	613,700	14,231,703.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	126,346	8,265,555.32	
	メキシコペソ 小計		740,046	22,497,258.32 (203,060,253)	
投資証券合計			740,046	203,060,253 (203,060,253)	
合計				646,766,011 (646,766,011)	

(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%	—	—	2.5%
メキシコペソ	株式　21銘柄	92.9%	—	—	2.0%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	2.8%	—	0.1%
	投資証券　2銘柄	—	—	4.3%	0.1%
ブラジルレアル	株式　46銘柄	96.7%	—	—	4.2%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	3.3%	—	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　156銘柄	100.0%	—	—	18.8%
マレーシアリンギット	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%	—	—	1.6%
韓国ウォン	株式　98銘柄	100.0%	—	—	12.3%
新台湾ドル	株式　88銘柄	100.0%	—	—	19.8%
インドルピー	株式　146銘柄	100.0%	—	—	19.2%
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%	—	—	2.9%
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%	—	—	3.5%
サウジアラビアリアル	株式　42銘柄	100.0%	—	—	3.9%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,573,765,518
投資証券	117,783,691,000
派生商品評価勘定	90,640
未収入金	35,354,494
未収配当金	1,149,234,713
未収利息	8,434
前払金	6,975,880
差入委託証拠金	308,408,324
流動資産合計	123,857,529,003
資産合計	123,857,529,003
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,817,820
未払解約金	245,262,859
流動負債合計	253,080,679
負債合計	253,080,679
純資産の部	
元本等	
元本	60,803,527,157
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	62,800,921,167
元本等合計	123,604,448,324
純資産合計	123,604,448,324
負債純資産合計	123,857,529,003

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	60,803,527,157口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.0328円 (1万口当たり純資産額) (20,328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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	64,657,212,453円
期中追加設定元本額	14,094,932,775円
期中一部解約元本額	17,948,618,071円
期末元本額	60,803,527,157円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,839,969,947円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,760,383円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	16,633,059,885円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	31,212,210,361円
コア投資戦略ファンド（安定型）	994,368,691円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,667,921,955円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,017,119,866円
分散投資コア戦略ファンドＳ	2,029,781,182円
コア投資戦略ファンド（切替型）	749,595,751円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	24,543,384円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	234,857,516円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	14,961,073円
グローバル経済コア	489,704,850円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	18,913,642円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	567,911,425円

コア投資戦略ファンド（積極成長型）	146,936,206円
Ｍｙ　ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	1,184,281,106円
１０資産分散投資ファンド	33,159,984円
グローバル１０資産バランスファンド	49,759,377円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	353,739,175円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	13,775,753円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	660,104,776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）	88,847,395円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	497,163,274円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	274,080,200円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△6,319,094,183
合計	△6,319,094,183

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

(2024年 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	5,809,060,880	－	5,802,085,000	△6,975,880
合計		5,809,060,880	－	5,802,085,000	△6,975,880

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,433	296,826,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,834	320,522,400	

	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	5,971	687,859,200	
	東海道リート投資法人	2,044	251,207,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,132	2,632,084,000	
	森ヒルズリート投資法人	14,073	1,847,784,900	
	産業ファンド投資法人	21,798	2,757,447,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,742	3,798,537,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,159	2,244,955,500	
	ＧＬＰ投資法人	40,199	5,233,909,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,885	1,818,465,000	
	日本プロロジスリート投資法人	20,848	5,186,982,400	
	星野リゾート・リート投資法人	2,515	1,290,195,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	2,088	526,176,000	
	イオンリート投資法人	14,680	1,934,824,000	
	ヒューリックリート投資法人	11,197	1,613,487,700	
	日本リート投資法人	3,887	1,282,710,000	
	積水ハウス・リート投資法人	35,962	2,858,979,000	
	トーセイ・リート投資法人	2,520	345,492,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	2,951	373,891,700	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	3,261	340,448,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	38,701	5,696,787,200	
	いちごホテルリート投資法人	1,983	220,113,000	
	ラサールロジポート投資法人	15,298	2,242,686,800	
	スターアジア不動産投資法人	18,444	1,069,752,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,845	228,595,500	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,978	2,120,628,000	
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	1,830	135,420,000	
	投資法人みらい	16,424	723,477,200	
	三菱地所物流リート投資法人	4,132	1,549,500,000	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	5,152	719,734,400	
	ザイマックス・リート投資法人	1,941	227,291,100	
	タカラレーベン不動産投資法人	6,375	626,025,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,244	625,609,200	
	日本ビルファンド投資法人	13,961	7,901,926,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,293	6,232,551,000	
	日本都市ファンド投資法人	57,364	5,157,023,600	
	オリックス不動産投資法人	23,845	3,734,127,000	

	日本プライムリアルティ投資法人	8,184	2,639,340,000	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	12,133	1,391,655,100	
	東急リアル・エステート投資法人	8,024	1,235,696,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	8,837	888,118,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,771	3,817,544,600	
	森トラストリート投資法人	23,068	1,587,078,400	
	インヴィンシブル投資法人	57,944	3,812,715,200	
	フロンティア不動産投資法人	4,440	1,924,740,000	
	平和不動産リート投資法人	9,274	1,213,039,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,639	2,020,515,500	
	福岡リート投資法人	6,189	974,767,500	
	ＫＤＸ不動産投資法人	33,912	5,252,968,800	
	いちごオフィスリート投資法人	9,807	803,193,300	
	大和証券オフィス投資法人	4,958	1,410,055,200	
	阪急阪神リート投資法人	5,706	754,903,800	
	スターツプロシード投資法人	2,074	405,259,600	
	大和ハウスリート投資法人	18,040	4,403,564,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	43,964	3,372,038,800	
	大和証券リビング投資法人	17,623	1,799,308,300	
	ジャパンエクセレント投資法人	10,401	1,223,157,600	
合計		766,977	117,783,691,000	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	64,857,265
コール・ローン	295,974,045
投資証券	123,931,069,523
派生商品評価勘定	2,602
未収入金	258,580,073
未収配当金	506,669,266
未収利息	545
流動資産合計	125,057,153,319
資産合計	125,057,153,319
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	27,000
未払解約金	297,783,036
流動負債合計	297,810,036
負債合計	297,810,036
純資産の部	
元本等	
元本	40,061,173,784
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	84,698,169,499
元本等合計	124,759,343,283
純資産合計	124,759,343,283
負債純資産合計	125,057,153,319

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)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 7月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	40,061,173,784口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.1142円 (1万口当たり純資産額) (31,142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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

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 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	35,682,145,567円
期中追加設定元本額	11,359,713,051円
期中一部解約元本額	6,980,684,834円
期末元本額	40,061,173,784円
期末元本額の内訳	
グローバル３資産バランスオープン	51,177,597円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	67,448,655円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,514,723,505円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,646,406円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	11,035,366,630円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	19,085,766,399円
コア投資戦略ファンド（安定型）	422,073,907円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,241,685,708円
分散投資コア戦略ファンドＡ	942,204,271円

分散投資コア戦略ファンドＳ	1,481,866,335円
コア投資戦略ファンド（切替型）	551,271,242円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	112,844,910円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	162,214,836円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	11,074,034円
グローバル経済コア	362,840,737円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	15,924,047円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	423,012,432円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	107,663,726円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	296,771,750円
１０資産分散投資ファンド	17,591,029円
グローバル１０資産バランスファンド	36,705,344円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,144,576,642円
ＦＯＦｓ用　グローバルＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	192,396,997円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	106,937,904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）	57,468,175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）	48,454,710円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	89,136,147円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	86,957,205円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	86,582,627円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	87,023,198円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	86,160,305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）	74,224,050円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２３－０２（適格機関投資家専用）	55,382,324円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	13,678,666,312
合計	13,678,666,312

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 7月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	104,042,080	－	104,066,478	△24,398
	アメリカドル	8,882,500	－	8,882,599	△99
	カナダドル	15,399,280	－	15,399,800	△520
	ユーロ	22,682,610	－	22,707,107	△24,497
	イギリスポンド	14,455,770	－	14,455,742	28
	オーストラリアドル	28,276,040	－	28,273,466	2,574
	シンガポールドル	14,345,880	－	14,347,764	△1,884

合計	104,042,080	―	104,066,478	△24,398

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	56,433	1,043,446.17	
		AGREE REALTY CORP	57,588	3,539,934.36	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	43,332	731,877.48	
		ALEXANDER'S INC	1,336	297,607.36	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	89,110	10,340,324.40	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	85,500.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	28,846	635,765.84	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	37,338	576,125.34	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	183,549	6,833,529.27	
		AMERICOLD REALTY TRUST	152,253	3,985,983.54	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	80,107	666,490.24	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	124,742	1,742,645.74	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	35,039	385,078.61	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	17,000.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,456	16,398,541.92	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	83,804.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	107,226	462,144.06	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	171,636	3,868,675.44	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	109,009	1,735,423.28	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	85,350.00	
		BXP INC	81,757	5,008,433.82	

		CAMDEN PROPERTY TRUST	60,656	6,551,454.56	
		CARETRUST REIT INC	81,143	2,086,997.96	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	14,237	332,149.21	
		CENTERSPACE	8,999	618,321.29	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,562	213,187.08	
		CITY OFFICE REIT INC	15,298	76,948.94	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	26,134.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,980	350,831.60	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	65,358	1,669,896.90	
		COUSINS PROPERTIES INC	85,700	1,963,387.00	
		CTO REALTY GROWTH INC	12,400	216,380.00	
		CUBESMART	128,035	5,657,866.65	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	123,244	1,010,600.80	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	368,800	212,060.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	184,126	28,226,515.80	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	367,920.00	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,663	1,227,367.57	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	57,918	729,766.80	
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	27,514	4,769,827.04	
		ELME COMMUNITIES	50,407	780,804.43	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	75,879	730,714.77	
		EPR PROPERTIES	42,005	1,740,687.20	
		EQUINIX INC	53,905	41,335,971.15	
		EQUITY COMMONWEALTH	59,311	1,135,805.65	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	105,892	6,795,089.64	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	195,622	13,292,514.90	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	100,129	2,787,591.36	
		ESSEX PROPERTY TRUST	36,483	10,068,213.51	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	120,526	18,504,356.78	
		FARMLAND PARTNERS INC	28,000	313,600.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	42,747	4,299,920.73	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	75,446	3,613,108.94	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	50,711	1,254,083.03	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	68,959.50	

		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	153,770	6,888,896.00	
		GETTY REALTY CORP	27,420	737,049.60	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	21,056	300,679.68	
		GLADSTONE LAND CORP	16,220	221,565.20	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	37,791	337,851.54	
		GLOBAL NET LEASE INC	105,009	785,467.32	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	212,955	3,609,587.25	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	397,288	7,802,736.32	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	61,902	1,646,593.20	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	400,439	7,023,700.06	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	66,572	342,845.80	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	126,789	2,322,774.48	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	115,749.34	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	16,461	1,777,458.78	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,939	976,508.55	
		INVITATION HOMES INC	326,321	11,780,188.10	
		IRON MOUNTAIN INC	166,868	15,540,416.84	
		JBG SMITH PROPERTIES	47,755	750,231.05	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	45,921.80	
		KILROY REALTY CORPORATION	59,364	1,903,803.48	
		KIMCO REALTY CORP	378,770	7,287,534.80	
		KITE REALTY GROUP TRUST	126,646	2,755,816.96	
		LTC PROPERTIES INC	25,175	857,712.25	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	170,594	1,574,582.62	
		MACERICH CO/THE	119,865	1,782,392.55	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	53,450.49	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	351,047	1,495,460.22	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	66,295	9,222,297.45	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	39,809	1,599,525.62	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	25,315	1,758,379.90	
		NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,552	202,511.36	
		NETSTREIT CORP	41,151	650,597.31	
		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	16,534	87,464.86	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	13,856	526,112.32	
		NNN REIT INC	103,860	4,374,583.20	

		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	44,499.72	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	139,013	4,663,886.15	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	200,098.73	
		ORION OFFICE REIT INC	34,844	116,727.40	
		PARAMOUNT GROUP INC	100,128	478,611.84	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	119,531	1,705,707.37	
		PEAKSTONE REALTY TRUST	19,000	200,640.00	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,170	914,534.50	
		PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	69,768	2,239,552.80	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,983	526,272.16	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	21,712	463,551.20	
		POSTAL REALTY TRUST INC- A	13,280	179,545.60	
		PRIME US REIT	324,500	36,993.00	
		PROLOGIS INC	526,011	60,201,958.95	
		PUBLIC STORAGE	89,713	25,926,159.87	
		REALTY INCOME CORP	493,962	26,061,435.12	
		REGENCY CENTERS CORP	93,166	5,783,745.28	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	74,747	925,367.86	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	124,162	5,625,780.22	
		RLJ LODGING TRUST	86,118	804,342.12	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	34,031	3,342,184.51	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	130,495	1,976,999.25	
		SAFEHOLD INC	23,595	440,990.55	
		SAUL CENTERS INC	6,846	250,700.52	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	89,989	456,244.23	
		SIMON PROPERTY GROUP	184,914	27,287,758.98	
		SITE CENTERS CORP	99,597	1,432,204.86	
		SL GREEN REALTY CORP	36,029	2,049,329.52	
		STAG INDUSTRIAL INC	103,605	3,669,689.10	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	67,952	385,287.84	
		SUN COMMUNITIES INC	70,687	8,349,548.44	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	114,627	1,163,464.05	
		TANGER INC	61,543	1,629,658.64	
		TERRENO REALTY CORP	55,234	3,356,017.84	

		UDR INC	172,022	7,020,217.82	
		UMH PROPERTIES INC	38,966	635,535.46	
		UNITI GROUP INC	142,514	441,793.40	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,811	300,254.84	
		URBAN EDGE PROPERTIES	65,756	1,198,074.32	
		VENTAS INC	230,152	12,023,140.48	
		VERIS RESIDENTIAL INC	47,792	721,181.28	
		VICI PROPERTIES INC	592,681	16,381,702.84	
		VORNADO REALTY TRUST	90,043	2,384,338.64	
		WELLTOWER INC	339,486	35,588,317.38	
		WHITESTONE REIT	25,954	343,111.88	
		WP CAREY INC	124,240	6,814,564.00	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,969	775,730.34	
	アメリカドル 小計		14,861,219	598,208,612.88 (96,640,601,410)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	37,679	591,937.09	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	196,538.40	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,593	994,192.02	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	151,525.00	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	62,800.00	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,706	2,163,888.98	
		CHOICE PROPERTIES REIT	90,496	1,186,402.56	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	340,982.91	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	371,304.70	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	69,220	878,401.80	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,669	45,719.97	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,799	869,296.96	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,458	1,200,761.24	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	76,841	688,495.36	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	42,842	523,957.66	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,557	621,891.93	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	169,830.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,956	203,797.88	

		NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	110,503.50	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	280,819.44	
		PRIMARIS REIT	30,375	401,253.75	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	78,080.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	87,939	1,486,169.10	
		SLATE GROCERY REIT	16,578	182,358.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	38,580	864,577.80	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,486	37,906.70	
	カナダドル 小計		897,898	14,703,392.75 (1,742,205,006)	
	ユーロ	AEDIFICA	26,407	1,527,644.95	
		ALTAREA	2,775	248,362.50	
		CARE PROPERTY INVEST	22,887	302,108.40	
		CARMILA	32,392	526,046.08	
		COFINIMMO	21,600	1,258,200.00	
		COVIVIO(FP)	27,329	1,215,047.34	
		CROMWELL REIT EUR	170,400	230,040.00	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	25,490	573,525.00	
		GECINA SA	29,616	2,578,072.80	
		HAMBORNER REIT AG	37,000	244,200.00	
		ICADE	17,487	367,926.48	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	63,254.88	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	169,963	917,800.20	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	175,756	159,059.18	
		KLEPIERRE	112,276	2,777,708.24	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	22,979	159,014.68	
		MERCIALYS	53,414	575,268.78	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	190,427	1,978,536.53	
		MONTEA NV	9,926	791,102.20	
		NSI NV	11,864	228,975.20	
		RETAIL ESTATES	6,645	415,312.50	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	17,995	643,321.25	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	57,448	4,306,302.08	
		VASTNED RETAIL	10,650	248,145.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	100,084	2,564,152.08	

		WERELDHAVE NV	16,227	213,871.86	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	18,383	589,175.15	
	ユーロ 小計		1,421,210	25,702,173.36 (4,490,169,685)	
	イギリスポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	233,848	123,939.44	
		AEW UK REIT PLC	68,000	59,840.00	
		ASSURA PLC	1,597,645	669,413.25	
		BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	306,882.40	
		BIG YELLOW GROUP PLC	111,609	1,310,289.66	
		BRITISH LAND CO PLC	524,948	2,113,440.64	
		CLS HOLDINGS PLC	75,636	68,904.39	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	178,284.03	
		DERWENT LONDON PLC	64,392	1,450,107.84	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	316,908	299,161.15	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	233,105	791,391.47	
		HAMMERSON PLC	2,067,017	598,608.12	
		HELICAL PLC	65,400	151,074.00	
		HOME REIT PLC	374,236	142,396.79	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	242,293	209,825.73	
		INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	431,966	2,682,508.86	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	60,866.67	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,130,246	2,164,421.09	
		NEWRIVER REIT PL	196,000	152,880.00	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	348,000	235,596.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	730,219	673,261.91	
		PRS REIT PLC/THE	260,002	198,901.53	
		REGIONAL REIT LTD	222,000	28,460.40	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	121,385	956,513.80	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	99,545.00	
		SEGRO PLC	763,989	6,923,268.31	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,093,936	1,557,764.86	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	668,864	493,621.63	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	347,000	276,559.00	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	115,873.02	

		TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,317,397	2,032,743.57	
		UNITE GROUP PLC	228,857	2,098,618.69	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	261,651	306,131.67	
		WAREHOUSE REIT PLC	237,876	197,437.08	
		WORKSPACE GROUP PLC	83,057	503,325.42	
	イギリスポンド 小計		16,147,342	30,241,127.42 (6,246,909,691)	
	オーストラリアドル	ABACUS GROUP	224,474	253,655.62	
		ABACUS STORAGE KING	347,779	401,684.74	
		ARENA REIT	192,648	741,694.80	
		BWP TRUST	309,156	1,066,588.20	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	491,955	767,449.80	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	316,821	963,135.84	
		CENTURIA OFFICE REIT	203,929	234,518.35	
		CHARTER HALL GROUP	274,224	3,095,988.96	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	376,694	1,258,157.96	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	307,930	991,534.60	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	210,134	495,916.24	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	264,428.80	
		DEXUS	602,323	3,884,983.35	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	314,140.00	
		GDI PROPERTY GROUP	315,597	176,734.32	
		GOODMAN GROUP	985,175	34,362,904.00	
		GPT GROUP	1,097,901	4,490,415.09	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	301,217.70	
		HEALTHCO REIT	300,321	319,841.86	
		HMC CAPITAL LTD	128,021	926,872.04	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	985,745	1,182,894.00	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	335,848.62	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	207,805	984,995.70	
		MIRVAC GROUP	2,269,400	4,198,390.00	
		NATIONAL STORAGE REIT	750,136	1,755,318.24	
		REGION RE GROUP	676,974	1,441,954.62	
		RURAL FUNDS GROUP	222,079	450,820.37	
		SCENTRE GROUP	2,955,904	9,399,774.72	
		STOCKLAND	1,360,265	5,767,523.60	

		VICINITY CENTERS	2,177,885	4,214,207.47	
		WAYPOINT REIT LTD	398,821	897,347.25	
	オーストラリアドル 小計		19,714,052	85,940,936.86 (9,347,795,702)	
	ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	507,278	517,423.56	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	585,524	1,206,179.44	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	923,753	762,096.22	
		PRECINCT PROPERTIES GROUP	877,392	1,013,387.76	
	ニュージーランドドル 小計		2,893,947	3,499,086.98 (346,339,629)	
	香港ドル	CHAMPION REIT	1,167,000	1,797,180.00	
		FORTUNE REIT	875,000	3,193,750.00	
		LINK REIT	1,450,300	43,654,030.00	
		PROSPERITY REIT	752,000	1,007,680.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	931,260.00	
		YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,228,260.40	
	香港ドル 小計		6,111,960	51,812,160.40 (1,071,475,477)	
	シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	379,900	478,674.00	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,039,418	5,220,910.08	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,497,477	1,302,804.99	
		CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	424,525.86	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,899,144	5,769,296.56	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	378,005.00	
		EC WORLD REIT	180,000	46,704.60	
		ESR-LOGOS REIT	3,505,364	963,975.10	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	329,400.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	628,862	1,345,764.68	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,733,996	1,603,946.30	
		KEPPEL DC REIT	799,503	1,463,090.49	
		KEPPEL REIT	1,231,400	1,040,533.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	1,132,750	640,003.75	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,146,463	2,396,107.67	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,843,085	2,303,856.25	

		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,283,473	1,565,837.06	
		PARAGON REIT	761,500	647,275.00	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	233,000	822,490.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	196,707.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	863,000	409,925.00	
		SUNTEC REIT	1,320,500	1,426,140.00	
	シンガポールドル 小計		25,355,756	30,775,972.39 (3,680,498,538)	
	韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	94,321,600.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	86,720	391,107,200.00	
		JR REIT XXVII	95,683	364,552,230.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	25,433	117,754,790.00	
		LOTTE REIT CO LTD	72,480	239,184,000.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	54,563,850.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	46,380	287,556,000.00	
		SK REITS CO LTD	75,914	357,934,510.00	
	韓国ウォン 小計		445,799	1,906,974,180.00 (222,543,886)	
	イスラエル シェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	601,200.00	
		REIT 1 LTD	103,500	1,552,500.00	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	155,000	1,097,400.00	
	イスラエルシェケル 小計		618,500	3,251,100.00 (142,530,499)	
合計			88,467,683	123,931,069,523 (123,931,069,523)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券　138銘柄	100.0%	78.0%
カナダドル	投資証券　26銘柄	100.0%	1.4%
ユーロ	投資証券　27銘柄	100.0%	3.6%
イギリスポンド	投資証券　36銘柄	100.0%	5.0%

オーストラリアドル	投資証券　31銘柄	100.0%	7.5%
ニュージーランドドル	投資証券　4銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券　6銘柄	100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券　22銘柄	100.0%	3.0%
韓国ウォン	投資証券　8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券　3銘柄	100.0%	0.1%

(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。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	331,528,646
コール・ローン	314,071,248
社債券	29,344,265,100
未収利息	579
流動資産合計	29,989,865,573
資産合計	29,989,865,573
負債の部	
流動負債	
未払解約金	110,727,642
流動負債合計	110,727,642
負債合計	110,727,642
純資産の部	
元本等	
元本	43,639,818,203
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△13,760,680,272
元本等合計	29,879,137,931
純資産合計	29,879,137,931
負債純資産合計	29,989,865,573

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	43,639,818,203口
2.	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損　13,760,680,272円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　0.6847円 (1万口当たり純資産額)　(6,847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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	41,280,085,914円
期中追加設定元本額	9,345,407,813円
期中一部解約元本額	6,985,675,524円
期末元本額	43,639,818,203円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（ＳＭＡ専用）	32,707,609,294円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,332,783,050円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,251,431,268円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,005,955,795円
ＳＭＴＡＭコモディティ・オープン	3,566,344,978円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	614,929,065円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	156,522,408円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	1,492,165,952円
ＦＯＦｓ用　グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	449,090,066円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	62,986,327円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	△918,103,997

合計	△918,103,997

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 042 04/30/25	8,000,000.00	7,406,400.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000.00	4,460,000.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000.00	4,806,000.00	
		SG ISSUER 035 08/30/24	18,000,000.00	17,249,400.00	
		SG ISSUER 036 10/31/24	22,000,000.00	21,344,400.00	
		SG ISSUER 037 12/30/24	23,000,000.00	23,193,200.00	
		SG ISSUER 038 02/28/25	21,000,000.00	21,222,600.00	
		STAR HELIOS 008 10/24/24	50,000,000.00	81,960,000.00	
	アメリカドル 小計		197,000,000.00	181,642,000.00 (29,344,265,100)	
合計				29,344,265,100 (29,344,265,100)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券　　8銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	50,080,500
コール・ローン	73,030,381
投資信託受益証券	31,134,017,469
未収利息	134
流動資産合計	31,257,128,484
資産合計	31,257,128,484
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	447,795,391
未払金	847,615
未払解約金	6,305,539
流動負債合計	454,948,545
負債合計	454,948,545
純資産の部	
元本等	
元本	21,536,876,050
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	9,265,303,889
元本等合計	30,802,179,939
純資産合計	30,802,179,939
負債純資産合計	31,257,128,484

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	21,536,876,050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 1.4302円 (1万口当たり純資産額) (14,302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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、当該規定に従い為替ヘッジを目的とした為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リス

	ク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	24,854,962,097円
期中追加設定元本額	3,222,543,967円
期中一部解約元本額	6,540,630,014円
期末元本額	21,536,876,050円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,531,035,994円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,557,515,681円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,929,983,078円
分散投資コア戦略ファンドＳ	7,669,032,598円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,156,062,529円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	297,446,229円
グローバル経済コア	1,562,059,842円
ＳＭＴ　ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,944,443,957円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	705,405,213円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	181,630,048円
グローバル１０資産バランスファンド	78,745,893円

ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	368,788,906円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	480,948,921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）	73,777,161円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	5,597,988,363
合計	5,597,988,363

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 7月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	30,075,584,381	－	30,523,379,772	△447,795,391
	アメリカドル	30,075,584,381	－	30,523,379,772	△447,795,391
合計		30,075,584,381	－	30,523,379,772	△447,795,391

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	4,315,285	192,720,628.10	
	アメリカドル 小計		4,315,285	192,720,628.10 (31,134,017,469)	
合計			4,315,285	31,134,017,469	

		(31,134,017,469)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

米国株式ＬＳマザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	600
コール・ローン	976,200,954
社債券	19,775,387,196
未収利息	1,800
流動資産合計	20,751,590,550
資産合計	20,751,590,550
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	106,050,600
未払金	579,731,800
未払解約金	408,386
流動負債合計	686,190,786
負債合計	686,190,786
純資産の部	
元本等	
元本	15,903,410,443
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,161,989,321
元本等合計	20,065,399,764
純資産合計	20,065,399,764
負債純資産合計	20,751,590,550

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	15,903,410,443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 1.2617円 (1万口当たり純資産額) (12,617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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	20,689,301,202円
期中追加設定元本額	1,469,520,237円
期中一部解約元本額	6,255,410,996円
期末元本額	15,903,410,443円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	958,616,493円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,358,649,623円
コア投資戦略ファンド（切替型）	606,990,747円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	267,116,183円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	11,981,569,064円
米国株式ＬＳファンド（ＳＭＡ専用）	107,000,577円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	247,342,593円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	66,793,057円
ＦＯＦｓ用　米国株式ＬＳファンドＳ（適格機関投資家専用）	309,332,106円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	3,795,349,077
合計	3,795,349,077

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

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2024年 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	19,660,750,500	―	19,766,801,100	△106,050,600
	アメリカドル	19,660,750,500	―	19,766,801,100	△106,050,600
合計		19,660,750,500	―	19,766,801,100	△106,050,600

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	STAR HELIOS 004 10/18/27	80,000,000.00	122,410,320.00	
	アメリカドル 小計		80,000,000.00	122,410,320.00 (19,775,387,196)	
合計				19,775,387,196 (19,775,387,196)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券　　1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	135,457,988
社債券	18,130,327,000
未収利息	249
流動資産合計	18,265,785,237
資産合計	18,265,785,237
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	－
負債合計	－
純資産の部	
元本等	
元本	14,434,093,138
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,831,692,099
元本等合計	18,265,785,237
純資産合計	18,265,785,237
負債純資産合計	18,265,785,237

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	14,434,093,138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　1.2655円 (1万口当たり純資産額)　(12,655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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	16,709,667,647円
期中追加設定元本額	2,118,784,589円
期中一部解約元本額	4,394,359,098円
期末元本額	14,434,093,138円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	882,072,289円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,246,194,696円
コア投資戦略ファンド（切替型）	566,603,847円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	230,431,272円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	10,785,264,741円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	215,030,778円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	54,352,537円
コモディティＬＳアルファ・ファンド（ＳＭＡ専用）	105,118,906円
ＦＯＦｓ用　コモディティＬＳアルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	349,024,072円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	187,658,000
合計	187,658,000

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	ソシエテ・ジェネラル　０％　２０２５／０４／３０	2,800,000,000	2,793,280,000	
	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　０７／１６／２５	12,030,000,000	15,337,047,000	

合計	14,830,000,000	18,130,327,000	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	83,630,476
社債券	8,113,102,000
未収利息	154
流動資産合計	8,196,732,630
資産合計	8,196,732,630
負債の部	
流動負債	
未払金	55,818,000
流動負債合計	55,818,000
負債合計	55,818,000
純資産の部	
元本等	
元本	9,181,619,333
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△1,040,704,703
元本等合計	8,140,914,630
純資産合計	8,140,914,630
負債純資産合計	8,196,732,630

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	9,181,619,333口
2．	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損　1,040,704,703円
3．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　0.8867円 (1万口当たり純資産額)　(8,867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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	9,732,934,872円
期中追加設定元本額	2,581,028,686円
期中一部解約元本額	3,132,344,225円
期末元本額	9,181,619,333円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	445,375,786円
コア投資戦略ファンド（成長型）	620,692,705円
コア投資戦略ファンド（切替型）	288,663,922円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	174,857,855円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	5,864,088,342円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	106,915,299円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	26,303,695円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（ＳＭＡ専用）	109,717,461円
ＦＯＦｓ用　米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	132,104,803円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,412,899,465円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	△139,743,500
合計	△139,743,500

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考

社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　１０／１８／２４	9,157,000,000	8,113,102,000	
合計		9,157,000,000	8,113,102,000	

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。

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

貸借対照表

	2024年 7月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,226,554,510
国債証券	11,692,263,900
派生商品評価勘定	178,829,360
未収入金	161,038,775
未収利息	9,638
前払金	187,731,612
差入委託証拠金	3,127,795,646
流動資産合計	20,574,223,441
資産合計	20,574,223,441
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	408,157,971
未払金	137,807,717
未払解約金	994,859
流動負債合計	546,960,547
負債合計	546,960,547
純資産の部	
元本等	
元本	17,508,251,506
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,519,011,388
元本等合計	20,027,262,894
純資産合計	20,027,262,894
負債純資産合計	20,574,223,441

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場)によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 7月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	17,508,251,506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 1.1439円 (1万口当たり純資産額) (11,439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 7月 10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信

	用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2024年 7月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 7月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月 11日
期首元本額	18,037,415,789円
期中追加設定元本額	2,068,282,466円
期中一部解約元本額	2,597,446,749円
期末元本額	17,508,251,506円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	344,838,529円
コア投資戦略ファンド（成長型）	482,669,382円
分散投資コア戦略ファンドA	2,532,180,367円

分散投資コア戦略ファンドＳ	6,197,597,298円
コア投資戦略ファンド（切替型）	221,650,490円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	142,281,202円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	7,014,503,908円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	82,859,039円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	20,385,380円
ＳＭＴＡＭ・ＦＯＦｓ用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド（４％目標コース）（適格機関投資家専用）	188,020,049円
ＦＯＦｓ用　ＧＢＣＡファンドＳ（ミドルリスク型）（適格機関投資家専用）	281,265,862円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 7月 10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,739,700
合計	1,739,700

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

(2024年 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	5,645,456,743	－	5,640,624,248	△4,832,495
	売建	23,206,865,291	－	23,389,764,408	△182,899,117
合計		28,852,322,034	－	29,030,388,656	△187,731,612

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2024年 7月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	6,837,816,106	－	6,994,543,195	156,727,089
	アメリカドル	3,809,970,925	－	3,881,313,244	71,342,319
	スウェーデンクローナ	1,022,509,328	－	1,046,719,561	24,210,233

	ノルウェークローネ	1,786,212,372	－	1,846,625,665	60,413,293
	オーストラリアドル	219,123,481	－	219,884,725	761,244
	売建	11,169,364,441	－	11,367,686,219	△198,321,778
	カナダドル	1,231,213,957	－	1,255,868,800	△24,654,843
	ユーロ	871,973,077	－	884,816,036	△12,842,959
	イギリスポンド	3,532,909,310	－	3,572,229,271	△39,319,961
	スイスフラン	4,648,679,345	－	4,764,086,097	△115,406,752
	ニュージーランドドル	884,588,752	－	890,686,015	△6,097,263
合計		18,007,180,547	－	18,362,229,414	△41,594,689

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第１１８３回国庫短期証券	1,000,000,000	999,980,000	
	第１１８９回国庫短期証券	2,000,000,000	1,999,720,000	
	第１２２０回国庫短期証券	1,700,000,000	1,698,821,900	
	第１２２６回国庫短期証券	7,000,000,000	6,993,742,000	
合計		11,700,000,000	11,692,263,900	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 7 期中間計算期間(2024 年 7 月 11 日から 2025 年 1 月 10 日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2025 年 3 月 24 日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の 2024 年 7 月 11 日から 2025 年 1 月 10 日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の 2025 年 1 月 10 日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024 年 7 月 11 日から 2025 年 1 月 10 日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

ると判断される。

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第６期 （2024年 7月 10日現在）	第７期中間計算期間 （2025年 1月 10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	525,313,706	411,852,468
投資信託受益証券	9,769,257,774	9,670,172,912
投資証券	1,311,284,824	1,847,887,756
親投資信託受益証券	9,564,389,005	8,809,126,442
未収入金	10,460,000	48,668,554
未収利息	968	2,436
流動資産合計	21,180,706,277	20,787,710,568
資産合計	21,180,706,277	20,787,710,568
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,336,633	28,287,182
未払受託者報酬	5,410,252	5,646,701
未払委託者報酬	143,912,397	150,202,231
その他未払費用	540,965	564,610
流動負債合計	176,200,247	184,700,724
負債合計	176,200,247	184,700,724
純資産の部		
元本等		
元本	14,206,104,792	14,110,884,046
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,798,401,238	6,492,125,798
（分配準備積立金）	4,997,939,558	4,721,967,377
元本等合計	21,004,506,030	20,603,009,844
純資産合計	21,004,506,030	20,603,009,844
負債純資産合計	21,180,706,277	20,787,710,568

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第６期中間計算期間 自　2023年７月11日 至　2024年１月10日	第７期中間計算期間 自　2024年７月11日 至　2025年１月10日
営業収益		
受取配当金	4,944,671	4,561,355
受取利息	3,417	701,713
有価証券売買等損益	984,422,190	△110,173,089
営業収益合計	989,370,278	△104,910,021
営業費用		
支払利息	234,824	－
受託者報酬	5,042,051	5,646,701
委託者報酬	134,118,388	150,202,231
その他費用	504,184	564,610
営業費用合計	139,899,447	156,413,542
営業利益又は営業損失（△）	849,470,831	△261,323,563
経常利益又は経常損失（△）	849,470,831	△261,323,563
中間純利益又は中間純損失（△）	849,470,831	△261,323,563
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（△）	29,068,133	△35,971,790
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,418,108,178	6,798,401,238
剰余金増加額又は欠損金減少額	346,415,611	304,238,207
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	346,415,611	304,238,207
剰余金減少額又は欠損金増加額	291,619,339	385,161,874
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	291,619,339	385,161,874
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,293,307,148	6,492,125,798

（3）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

	第6期 (2024年 7月 10日現在)	第7期中間計算期間 (2025年 1月 10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,206,104,792口	14,110,884,046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 1.4786円 (1万口当たり純資産額) (14,786円)	1口当たり純資産額 1.4601円 (1万口当たり純資産額) (14,601円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	第7期中間計算期間 (2025年 1月 10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第6期 自 2023年 7月 11日 至 2024年 7月 10日	第7期中間計算期間 自 2024年 7月 11日 至 2025年 1月 10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,294,735,341円	14,206,104,792円
期中追加設定元本額	2,119,254,715円	712,322,043円
期中一部解約元本額	2,207,885,264円	807,542,789円

（デリバティブ取引に関する注記）
該当事項はありません。

（参考）

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

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,327,372,001
株式	705,274,407,710
派生商品評価勘定	318,350
未収配当金	979,519,098
未収利息	31,520
前払金	63,860,600
差入委託証拠金	244,416,742
流動資産合計	711,889,926,021
資産合計	711,889,926,021
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	64,287,850
未払解約金	693,893,162
流動負債合計	758,181,012
負債合計	758,181,012
純資産の部	
元本等	
元本	249,202,068,293
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	461,929,676,716
元本等合計	711,131,745,009
純資産合計	711,131,745,009
負債純資産合計	711,889,926,021

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	249,202,068,293口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.8536円 (1万口当たり純資産額) (28,536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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	233,103,107,390円
期中追加設定元本額	26,251,536,772円
期中一部解約元本額	10,152,575,869円
期末元本額	249,202,068,293円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	258,751,421円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,201,420,217円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	11,636,580円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	10,256,007,532円
世界経済インデックスファンド	6,973,422,569円
日本株式インデックス・オープン	2,683,211,399円
ＤＣマイセレクション２５	4,707,466,476円
ＤＣマイセレクション５０	16,108,148,600円
ＤＣマイセレクション７５	18,554,809,390円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,937,943,087円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,663,718,260円
ＤＣマイセレクションＳ５０	11,132,275,330円
ＤＣマイセレクションＳ７５	11,063,559,863円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	9,615,865,397円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	36,369,940円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	547,044,088円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	455,185,271円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,716,075,924円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	313,498,202円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,917,169円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	9,114,691円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	12,727,486円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	94,596,097円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,792,720円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	10,555,233円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	42,635,748円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	12,497,620円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	39,110,073円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	291,156,137円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	272,938,251円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,870,536,395円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	24,782,917円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	8,074,492円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	270,427,384円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	146,020,980円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	200,458,965円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	15,656,000円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	356,795,299円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	2,278,170,245円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,859,512,108円

コア投資戦略ファンド（安定型）	503,870,105円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,266,388,442円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,695,277,593円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,163,278,838円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	726,993,708円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	427,905,356円
コア投資戦略ファンド（切替型）	525,427,519円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	189,163,823円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,566,976円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	45,211,463円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	17,217,748,824円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	184,654,439円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	61,362,899円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	285,223,254円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	45,439,575円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	13,421,387円
グローバル経済コア	312,178,987円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	36,294,879円
Ｍｙ　ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	3,224,530,711円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	30,787,205円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	503,973,750円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	131,503,154円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	70,005,263円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	72,776,419円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	34,365,922円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	44,833,955円
１０資産分散投資ファンド	113,760,161円
グローバル１０資産バランスファンド	52,730,845円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	6,100,025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	3,939,356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	2,451,774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	4,405,774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	1,480,764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	701,099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	208,740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	125,812円
ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型）	766,051,993円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	43,964,593,059円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	216,315,328円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	304,415,366円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,527,882円
ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用）	52,611,259,620円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,409,098円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	235,369,978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）	26,259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）	25,215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）	25,215円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ４（適格機関投資家専用）	21,335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）	25,215円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ６（適格機関投資家専用）	28,378円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益

			うち1年超	(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,449,460,600	－	5,385,600,000	△63,860,600
合計		5,449,460,600	－	5,385,600,000	△63,860,600

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	87,150,357
株式	17,289,299,130
投資証券	100,589,900
未収入金	389,819,785
未収配当金	25,723,224
未収利息	515
前払金	1,644,500
差入委託証拠金	3,728,440
流動資産合計	17,897,955,851
資産合計	17,897,955,851
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,647,316
未払金	5,676
未払解約金	412,648,231
流動負債合計	414,301,223
負債合計	414,301,223
純資産の部	
元本等	
元本	10,973,637,834
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,510,016,794
元本等合計	17,483,654,628
純資産合計	17,483,654,628
負債純資産合計	17,897,955,851

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	10,973,637,834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 1.5932円 (1万口当たり純資産額) (15,932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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	9,412,266,386円
期中追加設定元本額	2,070,244,019円
期中一部解約元本額	508,872,571円
期末元本額	10,973,637,834円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	149,819,293円
コア投資戦略ファンド（成長型）	402,453,080円
コア投資戦略ファンド（切替型）	156,246,699円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	7,773,229,710円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	83,155,128円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	151,461,746円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	38,162,596円
ＤＣ日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスファンド	2,096,837,037円
私募日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	58,127,004円
ＦＯＦｓ用　日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	64,145,541円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	88,684,500	－	87,040,000	△1,644,500
合計		88,684,500	－	87,040,000	△1,644,500

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	79,783,557
株式	49,255,328,150
未収入金	708,986,680
未収配当金	25,055,300
未収利息	472
流動資産合計	50,069,154,159
資産合計	50,069,154,159
負債の部	
流動負債	
未払解約金	27,928,122
流動負債合計	27,928,122
負債合計	27,928,122
純資産の部	
元本等	
元本	7,692,804,989
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	42,348,421,048
元本等合計	50,041,226,037
純資産合計	50,041,226,037
負債純資産合計	50,069,154,159

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.収益及び費用の計上基準	受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	7,692,804,989口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 6.5049円 (1万口当たり純資産額) (65,049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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	7,386,247,441円
期中追加設定元本額	631,520,692円
期中一部解約元本額	324,963,144円
期末元本額	7,692,804,989円
期末元本額の内訳	

ＤＣ日本株式エクセレント・フォーカス	5,145,561,154 円
コア投資戦略ファンド（安定型）	39,419,591 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	96,061,665 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	38,974,975 円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	2,004,790,616 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	20,879,736 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	37,842,119 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	9,524,459 円
日本株式エクセレント・フォーカスファンド	231,009,747 円
ＦＯＦｓ用　日本株式エクセレント・フォーカスＳ（適格機関投資家専用）	15,300,725 円
ＳＭＴ　ＥＴＦ日本株厳選投資アクティブ	53,236,560 円
日本株式エクセレント・フォーカスＶＡ（適格機関投資家専用）	203,642 円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,187,034,133
コール・ローン	1,458,661,926
株式	828,956,056,527
投資信託受益証券	117,985,559
投資証券	14,631,966,292
派生商品評価勘定	38,584,312
未収配当金	477,401,026
未収利息	8,630
前払金	300,193,649
差入委託証拠金	8,602,889,717
流動資産合計	861,770,781,771
資産合計	861,770,781,771
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	334,787,951
未払解約金	3,629,760,841
流動負債合計	3,964,548,792
負債合計	3,964,548,792
純資産の部	
元本等	
元本	117,052,828,079
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	740,753,404,900
元本等合計	857,806,232,979
純資産合計	857,806,232,979
負債純資産合計	861,770,781,771

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益

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

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	117,052,828,079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 7.3284円 (1万口当たり純資産額) (73,284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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	114,681,464,817円
期中追加設定元本額	8,224,961,550円
期中一部解約元本額	5,853,598,288円
期末元本額	117,052,828,079円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,278,242,031円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	4,756,624円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	33,821,200,375円

世界経済インデックスファンド	15,150,139,858円
外国株式インデックス・オープン	851,684,069円
ＤＣマイセレクション２５	506,850,676円
ＤＣマイセレクション５０	2,848,549,657円
ＤＣマイセレクション７５	3,797,178,982円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	13,660,861,800円
ＤＣマイセレクションＳ２５	385,683,721円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,983,899,479円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,276,076,608円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	7,833,629円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	117,016,713円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	97,346,709円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	8,703,258,204円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	704,210,058円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,640,801円
マイセレクション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）	12,035,292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）	4,961,144円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	15,525,967円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	80,115,603円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	95,886,861円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	745,055,172円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	49,360,042円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	9,649,551円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	81,609,593円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	25,985,019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）	620,173,894円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,144,201,994円
コア投資戦略ファンド（安定型）	116,406,331円
コア投資戦略ファンド（成長型）	290,563,733円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,235,176,939円
分散投資コア戦略ファンドＳ	5,936,472,873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）	938,725,779円
コア投資戦略ファンド（切替型）	121,651,695円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	396,952,088円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	20,228,803円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	91,645,373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セレクション（ＳＭＡ専用）	5,933,174,506円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	263,757,131円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,324,350,616円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	218,284,613円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,540,802円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	3,356,899,329円
グローバル経済コア	720,984,936円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	14,865,168円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	6,564,360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・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	179,833,053円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	187,164,438円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	87,672,732円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	115,468,867円

１０資産分散投資ファンド	57,360,193円
グローバル１０資産バランスファンド	21,302,642円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	13,638,983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	2,364,448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	1,475,258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	2,639,038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	888,917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	424,150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	125,337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	76,809円
ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型）	75,888,211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）	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）	50,351,774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）	378,935,316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）	700,812,150円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,463,470,869円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	101,777,684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）	75,767,435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）	92,789,485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）	15,358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

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	14,222,103,858	－	13,921,910,209	△300,193,649
合計		14,222,103,858	－	13,921,910,209	△300,193,649

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,331,405,500	－	2,327,415,490	3,990,010
	アメリカドル	1,682,952,900	－	1,680,651,170	2,301,730
	カナダドル	110,108,000	－	109,813,900	294,100
	ユーロ	163,198,000	－	162,797,100	400,900
	イギリスポンド	58,674,600	－	58,343,820	330,780
	スイスフラン	121,685,900	－	121,354,450	331,450
	ノルウェークローネ	48,485,500	－	48,557,250	△71,750
	デンマーククローネ	48,120,600	－	48,011,700	108,900
	オーストラリアドル	98,180,000	－	97,886,100	293,900
合計		2,331,405,500	－	2,327,415,490	3,990,010

(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

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	855,485,515
コール・ローン	30,369,071
株式	20,036,473,620
投資信託受益証券	3,614,721
投資証券	368,085,127
派生商品評価勘定	2,504,733
未収入金	117,131,454
未収配当金	9,977,105
未収利息	179
前払金	12,974,827
差入委託証拠金	283,725,511
流動資産合計	21,720,341,863
資産合計	21,720,341,863
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,310,618
未払解約金	706,660,560
流動負債合計	720,971,178
負債合計	720,971,178
純資産の部	
元本等	
元本	11,002,363,271
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	9,997,007,414
元本等合計	20,999,370,685
純資産合計	20,999,370,685
負債純資産合計	21,720,341,863

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	2025年 1月 10日現在	
1．	計算期間の末日における受益権の総数	11,002,363,271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 1.9086円 (1万口当たり純資産額) (19,086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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	9,375,233,537円
期中追加設定元本額	2,531,137,774円
期中一部解約元本額	904,008,040円
期末元本額	11,002,363,271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）	155,319,337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）	7,319,366,304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	2,620,658,689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）	64,539,836円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	582,666,337	－	569,691,510	△12,974,827
合計		582,666,337	－	569,691,510	△12,974,827

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	680,433,890	－	679,264,948	1,168,942
	アメリカドル	542,280,250	－	541,510,310	769,940
	カナダドル	22,021,600	－	21,962,780	58,820
	ユーロ	50,591,380	－	50,467,101	124,279
	イギリスポンド	21,514,020	－	21,392,734	121,286
	スイスフラン	13,906,960	－	13,869,080	37,880
	スウェーデンクローナ	5,102,280	－	5,099,796	2,484
	ノルウェークローネ	1,385,300	－	1,387,350	△2,050
	デンマーククローネ	8,311,740	－	8,292,930	18,810
	オーストラリアドル	9,818,000	－	9,788,610	29,390
	ニュージーランドドル	886,010	－	884,487	1,523
	香港ドル	3,459,840	－	3,454,570	5,270
	シンガポールドル	1,156,510	－	1,155,200	1,310
合計		680,433,890	－	679,264,948	1,168,942

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合

は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

世界債券総合インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	501,145,463
コール・ローン	588,417,788
国債証券	64,835,749,366
地方債証券	3,372,894,522
特殊債券	13,860,115,171
社債券	30,125,490,986
投資信託受益証券	16,411,593,419
派生商品評価勘定	8,831
未収入金	17,173,189
未収利息	1,125,557,093
前払金	6,241,039
前払費用	80,187,375
差入委託証拠金	60,280,540
流動資産合計	130,984,854,782
資産合計	130,984,854,782
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,293,362
未払金	74,805,919
未払解約金	6,348,423
流動負債合計	87,447,704
負債合計	87,447,704
純資産の部	
元本等	
元本	108,580,445,091
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	22,316,961,987
元本等合計	130,897,407,078
純資産合計	130,897,407,078
負債純資産合計	130,984,854,782

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	108,580,445,091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 1.2055円 (1万口当たり純資産額) (12,055円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	105,249,450,279円
期中追加設定元本額	7,163,669,665円
期中一部解約元本額	3,832,674,853円
期末元本額	108,580,445,091円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,187,342,685円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,866,133,709円
コア投資戦略ファンド(切替型)	2,473,101,903円
外国債券ＳＭＴＢセレクション(ＳＭＡ専用)	95,016,370,935円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,253,625,766円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	337,933,540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)	453,707,234円
ＦＯＦｓ用　世界債券総合インデックス・ファンドＳ(適格機関投資家専用)	992,229,319円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2025年 1月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	421,423,382	－	415,182,343	△6,241,039

合計	421,423,382	―	415,182,343	△6,241,039

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2025年 1月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	527,319,909	―	527,276,417	△43,492
	アメリカドル	281,965,812	―	281,971,003	5,191
	カナダドル	17,525,344	―	17,525,712	368
	ユーロ	125,040,300	―	125,042,533	2,233
	イギリスポンド	25,180,844	―	25,181,559	715
	オーストラリアドル	8,778,789	―	8,779,113	324
	オフショア人民元	68,828,820	―	68,776,497	△52,323
合計		527,319,909	―	527,276,417	△43,492

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,098,501,619
コール・ローン	116,109,299
株式	220,913,388,843
投資信託受益証券	422,711,871
投資証券	191,071,003
派生商品評価勘定	1,004,856
未収配当金	393,903,225
未収利息	686
前払金	254,755,218
差入委託証拠金	1,483,510,063
流動資産合計	229,874,956,683
資産合計	229,874,956,683
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	254,755,218
未払金	33,235
未払解約金	809,858,011
流動負債合計	1,064,646,464
負債合計	1,064,646,464
純資産の部	
元本等	
元本	48,590,594,817
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	180,219,715,402
元本等合計	228,810,310,219
純資産合計	228,810,310,219
負債純資産合計	229,874,956,683

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	2025年 1月 10日現在	
1．	計算期間の末日における受益権の総数	48,590,594,817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 4.7089円 (1万口当たり純資産額) (47,089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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	45,973,691,996円
期中追加設定元本額	4,050,490,629円
期中一部解約元本額	1,433,587,808円
期末元本額	48,590,594,817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	6,810,856,559円
世界経済インデックスファンド	14,019,587,009円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	6,430,819,992円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	7,923,132,197円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	85,076,803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）	1,455,347,475円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	828,404,994円

コア投資戦略ファンド（切替型）	62,863,771円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	370,297,486円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,370,709円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	85,237,844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ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	2,900,869,951円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	301,144,333円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,511,736,074円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	241,284,753円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	8,202,444円
グローバル経済コア	667,153,810円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	646,837,383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	131,096,730円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	136,325,237円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	63,939,534円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	84,220,119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	30,675,745円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	13,210,564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）	1,625,763,807円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	115,390,901円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	82,626,092円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	15,638,979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）	22,064,175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）	18,514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

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,503,840,121	－	7,249,084,903	△254,755,218
合計		7,503,840,121	－	7,249,084,903	△254,755,218

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	707,735,100	－	706,730,244	1,004,856
	アメリカドル	707,735,100	－	706,730,244	1,004,856
合計		707,735,100	－	706,730,244	1,004,856

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,949,388,042
投資証券	92,156,169,700
派生商品評価勘定	37,576,080
未収入金	21,285,430
未収配当金	1,108,857,679
未収利息	17,450
差入委託証拠金	173,569,893
流動資産合計	96,446,864,274
資産合計	96,446,864,274
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,032,640
前受金	34,968,040
未払金	200,486,959
未払解約金	842,199,025
流動負債合計	1,080,686,664
負債合計	1,080,686,664
純資産の部	
元本等	
元本	47,571,412,508
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	47,794,765,102
元本等合計	95,366,177,610
純資産合計	95,366,177,610
負債純資産合計	96,446,864,274

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月 10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	47,571,412,508口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.0047円 (1万口当たり純資産額) (20,047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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引

	のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	60,803,527,157円
期中追加設定元本額	5,692,632,666円
期中一部解約元本額	18,924,747,315円
期末元本額	47,571,412,508円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,804,167,082円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,616,574円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	15,425,649,908円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	20,646,921,855円
コア投資戦略ファンド（安定型）	602,448,365円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,042,334,487円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,066,487,955円
分散投資コア戦略ファンドＳ	2,272,764,047円
コア投資戦略ファンド（切替型）	451,578,256円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	21,051,315円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	137,260,651円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	16,967,004円
グローバル経済コア	591,118,841円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	20,666,807円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	299,327,569円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,105,958円
Ｍｙ　ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	1,278,590,555円
１０資産分散投資ファンド	33,342,169円
グローバル１０資産バランスファンド	62,970,856円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	210,855,786円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	12,345,283円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	934,732,383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）	66,502,345円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ１（適格機関投資家専用）	31,755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）	31,755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）	30,959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）	31,055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）	36,836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）	30,953円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	486,413,144円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先				

	物取引 買建	3,109,966,960	－	3,144,935,000	34,968,040
合計		3,109,966,960	－	3,144,935,000	34,968,040

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	628,733,528
コール・ローン	50,048,551
投資証券	134,565,140,567
未収入金	772,105
未収配当金	523,129,867
未収利息	296
流動資産合計	135,767,824,914
資産合計	135,767,824,914
負債の部	
流動負債	
未払金	73,743,474
未払解約金	42,965,139
流動負債合計	116,708,613
負債合計	116,708,613
純資産の部	
元本等	
元本	42,551,584,116
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	93,099,532,185
元本等合計	135,651,116,301
純資産合計	135,651,116,301
負債純資産合計	135,767,824,914

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	42,551,584,116口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.1879円 (1万口当たり純資産額) (31,879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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	40,061,173,784円
期中追加設定元本額	5,406,794,550円
期中一部解約元本額	2,916,384,218円
期末元本額	42,551,584,116円
期末元本額の内訳	
グローバル３資産バランスオープン	43,953,883円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	67,756,498円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,492,102,542円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,430,045円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	10,840,815,902円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	19,617,279,037円
コア投資戦略ファンド（安定型）	368,682,503円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,066,751,707円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,289,822,691円
分散投資コア戦略ファンドＳ	3,459,827,749円
コア投資戦略ファンド（切替型）	463,512,286円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	100,415,168円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	137,790,983円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	11,872,713円
グローバル経済コア	398,306,098円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	16,890,314円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	375,695,734円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	102,265,939円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	394,319,087円
１０資産分散投資ファンド	17,673,805円
グローバル１０資産バランスファンド	45,231,265円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,378,499,772円
ＦＯＦｓ用　グローバルＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	176,668,607円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	96,864,013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）	49,167,129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）	50,883,862円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ１（適格機関投資家専用）	20,773円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ２（適格機関投資家専用）	19,234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）	19,234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）	26,928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）	28,466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）	25,851円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	80,202,667円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	78,752,244円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	78,463,899円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	78,584,761円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	77,918,065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）	39,317,488円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２３－０２（適格機関投資家専用）	49,725,174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。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	124,939,346
コール・ローン	514,315,011
社債券	31,877,034,684
未収入金	1,330,088,166
未収利息	3,043
流動資産合計	33,846,380,250
資産合計	33,846,380,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,226,400
未払解約金	1,396,421,671
流動負債合計	1,397,648,071
負債合計	1,397,648,071
純資産の部	
元本等	
元本	47,641,109,928
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△15,192,377,749
元本等合計	32,448,732,179
純資産合計	32,448,732,179
負債純資産合計	33,846,380,250

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	47,641,109,928口
2.	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 15,192,377,749円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.6811円 (1万口当たり純資産額) (6,811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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	43,639,818,203円
期中追加設定元本額	7,526,100,435円
期中一部解約元本額	3,524,808,710円
期末元本額	47,641,109,928円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（ＳＭＡ専用）	36,482,005,137円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,280,014,527円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,251,431,268円
コア投資戦略ファンド（切替型）	931,933,386円
ＳＭＴＡＭコモディティ・オープン	3,723,787,257円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	642,979,200円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	172,566,955円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	1,645,786,112円
ＦＯＦｓ用　グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	437,079,882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）	73,526,204円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,105,510,000	－	1,106,736,400	△1,226,400
	アメリカドル	1,105,510,000	－	1,106,736,400	△1,226,400
合計		1,105,510,000	－	1,106,736,400	△1,226,400

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	119,185,303
投資信託受益証券	40,338,496,671
未収入金	1,981,855
未収利息	705
流動資産合計	40,459,664,534
資産合計	40,459,664,534
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	62,943,503
未払解約金	1,018,590
流動負債合計	63,962,093
負債合計	63,962,093
純資産の部	
元本等	
元本	25,807,847,692
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	14,587,854,749
元本等合計	40,395,702,441
純資産合計	40,395,702,441
負債純資産合計	40,459,664,534

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	25,807,847,692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 1.5652円 (1万口当たり純資産額) (15,652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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項につ	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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	21,536,876,050円
期中追加設定元本額	5,558,916,424円
期中一部解約元本額	1,287,944,782円
期末元本額	25,807,847,692円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,296,873,791円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,236,379,575円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,323,923,430円
分散投資コア戦略ファンドＳ	10,249,548,744円
コア投資戦略ファンド（切替型）	947,389,909円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	239,519,110円
グローバル経済コア	3,252,266,886円
ＳＭＴ　ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,342,346,172円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	639,091,028円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	174,950,264円
グローバル１０資産バランスファンド	96,494,280円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	328,250,401円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	604,911,264円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	75,560,320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）	52,750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）	65,538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）	59,144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）	40,404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）	59,144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）	65,538円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	39,756,409,089	－	39,819,352,592	△62,943,503
	アメリカドル	39,756,409,089	－	39,819,352,592	△62,943,503
合計		39,756,409,089	－	39,819,352,592	△62,943,503

(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。

米国株式ＬＳマザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	412
コール・ローン	876,455,873
社債券	13,987,452,142
未収利息	5,185
流動資産合計	14,863,913,612
資産合計	14,863,913,612
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	93,272,000
未払金	666,898,500
未払解約金	49,998
流動負債合計	760,220,498
負債合計	760,220,498
純資産の部	
元本等	
元本	11,460,668,241
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,643,024,873
元本等合計	14,103,693,114
純資産合計	14,103,693,114
負債純資産合計	14,863,913,612

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	11,460,668,241口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2306円 (1万口当たり純資産額) (12,306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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	15,903,410,443円
期中追加設定元本額	1,151,667,010円
期中一部解約元本額	5,594,409,212円
期末元本額	11,460,668,241円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	773,001,598円
コア投資戦略ファンド（成長型）	893,321,873円
コア投資戦略ファンド（切替型）	386,310,929円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	253,686,065円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	8,727,131,848円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	168,932,799円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,666,780円
ＦＯＦｓ用　米国株式ＬＳファンドＳ（適格機関投資家専用）	213,616,349円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2025年 1月 10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	13,926,515,300	－	14,019,787,300	△93,272,000
	アメリカドル	13,926,515,300	－	14,019,787,300	△93,272,000
合計		13,926,515,300	－	14,019,787,300	△93,272,000

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	178,462,691
社債券	12,412,719,000
未収利息	1,055
流動資産合計	12,591,182,746
資産合計	12,591,182,746
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	－
負債合計	－
純資産の部	
元本等	
元本	10,050,263,444
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,540,919,302
元本等合計	12,591,182,746
純資産合計	12,591,182,746
負債純資産合計	12,591,182,746

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月 10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	10,050,263,444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 1.2528円 (1万口当たり純資産額) (12,528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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	14,434,093,138円
期中追加設定元本額	430,016,921円
期中一部解約元本額	4,813,846,615円
期末元本額	10,050,263,444円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	681,351,860円
コア投資戦略ファンド（成長型）	786,039,265円
コア投資戦略ファンド（切替型）	332,272,939円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	223,854,636円

ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	7,605,340,944 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	148,167,167 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	39,302,446 円
ＦＯＦｓ用　コモディティＬＳアルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	233,934,187 円

（デリバティブ取引に関する注記）
該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2025 年 1 月 10 日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	55,946,898
社債券	5,830,014,800
未収利息	331
流動資産合計	5,885,962,029
資産合計	5,885,962,029
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	－
負債合計	－
純資産の部	
元本等	
元本	6,831,005,806
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△945,043,777
元本等合計	5,885,962,029
純資産合計	5,885,962,029
負債純資産合計	5,885,962,029

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月 10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	6,831,005,806口
2.	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損　945,043,777円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　0.8617円 (1万口当たり純資産額)　(8,617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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	9,181,619,333円
期中追加設定元本額	880,250,102円
期中一部解約元本額	3,230,863,629円
期末元本額	6,831,005,806円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,753,804円

コア投資戦略ファンド（成長型）	408,010,253円
コア投資戦略ファンド（切替型）	179,090,327円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	174,857,855円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	4,399,359,145円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	77,239,296円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	20,397,622円
ＦＯＦｓ用　米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	101,431,826円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,116,865,678円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

貸借対照表

	2025年 1月 10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,599,053,995
国債証券	11,690,635,800
派生商品評価勘定	146,701,629
未収入金	274,433,579
未収利息	50,878
差入委託証拠金	1,996,609,375
流動資産合計	22,707,485,256
資産合計	22,707,485,256
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	92,898,874
前受金	52,976,277
未払金	196,838,176
流動負債合計	342,713,327
負債合計	342,713,327
純資産の部	
元本等	
元本	20,144,737,906
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,220,034,023
元本等合計	22,364,771,929
純資産合計	22,364,771,929
負債純資産合計	22,707,485,256

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月 10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	20,144,737,906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 1.1102円 (1万口当たり純資産額) (11,102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

	2025年 1月 10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 1月 10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月 11日
期首元本額	17,508,251,506円
期中追加設定元本額	7,772,164,894円
期中一部解約元本額	5,135,678,494円
期末元本額	20,144,737,906円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	557,838,252円
コア投資戦略ファンド(成長型)	643,408,736円
分散投資コア戦略ファンドA	2,532,180,367円
分散投資コア戦略ファンドS	6,559,273,906円
コア投資戦略ファンド(切替型)	273,176,119円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	235,793,481円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	8,783,722,397円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	122,012,406円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	32,173,083円
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド(4%目標コース)(適格機関投資家専用)	173,639,866円
FOFs用 GBCAファンドS(ミドルリスク型)(適格機関投資家専用)	231,519,293円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2025年 1月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	6,118,770,463	—	6,050,435,913	△68,334,550
	売建	15,315,746,683	—	15,194,435,856	121,310,827
合計		21,434,517,146	—	21,244,871,769	52,976,277

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外

貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場)で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2025年 1月 10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	11,963,873,127	―	11,964,545,050	671,923
	アメリカドル	5,349,159,242	―	5,349,257,720	98,478
	イギリスポンド	1,043,842,833	―	1,043,872,472	29,639
	ノルウェークローネ	1,955,668,200	―	1,956,078,579	410,379
	オーストラリアドル	3,615,202,852	―	3,615,336,279	133,427
	売建	12,345,404,792	―	12,345,219,547	185,245
	カナダドル	2,370,521,842	―	2,370,571,619	△49,777
	ユーロ	314,874,210	―	314,879,833	△5,623
	スイスフラン	4,390,125,742	―	4,390,259,996	△134,254
	スウェーデンクローナ	3,705,102,889	―	3,704,683,603	419,286
	ニュージーランドドル	1,564,780,109	―	1,564,824,496	△44,387
合計		24,309,277,919	―	24,309,764,597	857,168

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

２【ファンドの現況】

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド)】

【純資産額計算書】

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	20,785,103,853円
Ⅱ　負債総額	52,561,964円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	20,732,541,889円
Ⅳ　発行済口数	14,083,460,917口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4721円
（1万口当たり純資産額）	（14,721円）

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	737,591,144,569円
Ⅱ　負債総額	3,017,987,536円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	734,573,157,033円
Ⅳ　発行済口数	250,522,802,465口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9322円
（1万口当たり純資産額）	（29,322円）

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	18,117,016,218円
Ⅱ　負債総額	5,789,841円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	18,111,226,377円
Ⅳ　発行済口数	11,031,590,373口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6418円
（1万口当たり純資産額）	（16,418円）

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

純資産額計算書

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	49,761,373,729円
Ⅱ　負債総額	1,684,591円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	49,759,689,138円
Ⅳ　発行済口数	7,635,178,953口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	6.5172円
（1万口当たり純資産額）	（65,172円）

外国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（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）

世界債券総合インデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	130,983,507,394円
Ⅱ　負債総額	1,652,997,423円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	129,330,509,971円
Ⅳ　発行済口数	108,481,243,410口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1922円
（1万口当たり純資産額）	（11,922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）

Ｊ－ＲＥＩＴ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	100,686,105,425円
Ⅱ　負債総額	370,427,930円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	100,315,677,495円
Ⅳ　発行済口数	48,204,725,476口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0810円
（1万口当たり純資産額）	（20,810円）

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	138,588,428,648円
Ⅱ　負債総額	146,691,454円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	138,441,737,194円
Ⅳ　発行済口数	43,317,584,849口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1960円
（1万口当たり純資産額）	（31,960円）

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

純資産額計算書

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	32,526,367,241円
Ⅱ　負債総額	204,676,233円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	32,321,691,008円
Ⅳ　発行済口数	47,448,846,723口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.6812円
（1万口当たり純資産額）	（6,812円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	42,215,617,548円
Ⅱ　負債総額	2,283,714円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	42,213,333,834円
Ⅳ　発行済口数	25,787,217,456口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6370円
（1万口当たり純資産額）	（16,370円）

米国株式ＬＳ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	14,556,378,614円
Ⅱ　負債総額	32,987,999円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,523,390,615円
Ⅳ　発行済口数	11,440,718,864口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2694円
（1万口当たり純資産額）	（12,694円）

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

純資産額計算書

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	13,193,048,273円
Ⅱ　負債総額	219,875円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,192,828,398円
Ⅳ　発行済口数	10,524,741,395口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2535円
（1万口当たり純資産額）	（12,535円）

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

純資産額計算書

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	6,143,015,713円
Ⅱ　負債総額	59,992円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	6,142,955,721円
Ⅳ　発行済口数	7,163,289,100口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8576円
（1万口当たり純資産額）	（8,576円）

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

純資産額計算書

（2025年 1月 31日現在）

Ⅰ　資産総額	23,314,873,867円
Ⅱ　負債総額	471,062,539円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,843,811,328円
Ⅳ　発行済口数	20,408,416,398口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1193円
（1万口当たり純資産額）	（11,193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

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

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

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

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

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

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

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

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の 3 日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

す。

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、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 4 月 10 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

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

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				
	米ドル	投資有価証券関係会社株式	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				
	米ドル	投資有価証券関係会社株式	2,126	－	1
	英ポンド		4,586	－	7
	スイスフラン		28	－	0
	香港ドル		83	－	0
	ユーロ		63	－	0
	シンガポールドル		448	－	1
合計			7,337	－	10

（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㈱	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㈱	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おりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

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おります。

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

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

４．収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

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

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6．ヘッジ会計の方法
(1) ヘッジ会計の方法
繰延ヘッジ処理によっております。
(2) ヘッジ手段とヘッジ対象
ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。
(3) ヘッジ方針
自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。
(4) ヘッジ有効性評価の方法
ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

7．グループ通算制度の適用
グループ通算制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間末 (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 項の取り扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付しておりません。

デリバティブ取引

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

（注２）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	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				
	米ドル	投資有価証券関係会社株式	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)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2025年 4月 10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

追加型証券投資信託
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）
（愛称：コアラップ（切替型ワイド））
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、運用の基本方針において「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場合があります。

(2)投資態度

①主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ*1、ヘッジファンド*2及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

＊1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。

＊2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。

②各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じても機動的に調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

※投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

③国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90％未満とします。

なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

④投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されたり、新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

⑤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。

⑥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。

⑦ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3)運用制限

①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同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

⑤デリバティブの直接利用は行いません。

⑥一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
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）
（愛称：コアラップ（切替型ワイド））
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 100 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 1 兆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 100 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。

（信託日時の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自動けいぞく投資契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に係る収益分配金の再投資の場合は、1 円以上 1 円単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

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

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

③第 1 項の規定にかかわらず、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨークもしくはロンドンの銀行休業日においては、取得の申込みは受け付けないものとします。

④第 1 項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、手数料並びに当該手数料に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込みに係る当該価額は、1 口につき 1 円に手数料及び当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

⑤前項の手数料の額は、販売会社が別に定めるところによるものとします。

⑥第 4 項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第 31 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑦前各項の規定にかかわらず、金融商品取引所等（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号もしくは同項第 5 号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託者は、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るものとします。

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たときは、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を指図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。

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 7 月 11 日から翌年 7 月 10 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は、2018 年 10 月 26 日から 2019 年 7 月 10 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等に相当する金額は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の 6 ケ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、次の各号により計算された額の合計額とします。

1. 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 138 の率を乗じて得た額
2. マザーファンド（別に定める投資信託証券に親投資信託を含む場合における当該親投資信託をいいます。以下本項において同じ。）において有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料（貸付有価証券の利子又は配当金等相当額を含まないものとします。また、有価証券の貸付にあたって担保として金銭を受け入れた場合には、当該品貸料に、当該金銭の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付の相手方に支払う当該金銭に対する利息額を控除して得た額（ただし、この額が負の場合は、零とします。）とすることができます。以下同じ。）のうち投資信託財産に属するとみなした額に 100 分の 50 未満の率を乗じて得た額
3. 前号において、投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属する当該マザーファンドの受益証券の時価総額に当該マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める品貸料の割合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 ケ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、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

（収益分配金、償還金及び一部解約金の支払い）

第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ます。

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ます。

（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

ては第 36 条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 36 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もしくはロンドンの銀行休業日の場合は、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、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 10 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

③委託者は、前 2 項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

④前項の書面決議において、受益者（委託者及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

⑤第 3 項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上に当たる多数をもって行います。

⑥第 3 項から前項までの規定は、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っ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、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③前項の書面決議において、受益者（委託者及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

⑤書面決議の効力は、この信託の全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第 47 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

（運用状況に係る情報の提供）

第 48 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 項に定める事項に係る情報を電磁的方法により受益者に提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行うものとします。

（公告）

第 49 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 50 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　　2018年10月26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項及び第34条第1項に定める「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　国内株式インデックス マザーファンド
親投資信託　日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド
親投資信託　日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド
追加型証券投資信託　国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）
追加型証券投資信託　日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）
追加型証券投資信託　FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）
追加型証券投資信託　ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）
親投資信託　国内債券インデックス マザーファンド
追加型証券投資信託　マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）
追加型証券投資信託　明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）
追加型証券投資信託　ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）
追加型証券投資信託　ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド（適格機関投資家専用）
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
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　世界債券総合インデックスマザーファンド
追加型証券投資信託　フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）
追加型証券投資信託　L&Gグローバル総合債券ファンド（除く日本）（FOFs用）（適格機関投資家専用）

外国籍円建投資信託証券　Global Aggregate Bond Strategy Fund JPY W Class
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　ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）
親投資信託　J-REIT インデックス マザーファンド
親投資信託　グローバル REIT インデックス マザーファンド
親投資信託　グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド
親投資信託　ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）
外国籍円建投資信託証券　BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラス S-JPY
追加型証券投資信託　FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）
親投資信託　米国株式 LS マザーファンド
親投資信託　コモディティ LS アルファ・マザーファンド
親投資信託　米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド
親投資信託　ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）
追加型証券投資信託　ノムラ FOFs 用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）
追加型証券投資信託　ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンド S（適格機関投資家専用）
外国籍円建投資信託証券　MA Hedge Fund Strategies Limited
外国籍円建投資信託証券　MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR