

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年11月28日提出
【計算期間】	第6期(自 2023年8月29日至 2024年8月28日)
【ファンド名】	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060
【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
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

各ファンドにつき上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
--------	------	------------	------	-----------	--------------	-----

株式	年1回	グローバル	ファミリー ファンド	あり (部分 ヘッジ)	日経225	ブル・ベア型
一般	年2回	(日本を 含む)	ファンド・		TOPIX	条件付運用型
大型株	年4回		オブ・ファ ンズ	なし	その他 ()	ロング・ ショート型/絶 対収益追求型
中小型株	年6回 (隔月)	日本				その他 ()
債券	年12回 (毎月)	北米				
一般	日々	欧州				
公債	その他 ()	アジア				
社債		オセアニア				
その他債券		中南米				
クレジット属性 ()		アフリカ				
不動産投信		中近東 (中東)				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、債券)資産 配分変更型))		エマージ ング				
資産複合 ()						
資産配分 固定型						
資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

のとする。

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

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

(2)債券

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

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの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. 投資対象ファンド[※]への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式(DR(預託証券))を含みます。)及び債券に分散投資します。

※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。投資対象ファンドについては、将来除外又は新たに追加する場合があります。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

●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。

●為替ヘッジ付先進国債券部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損が生じる可能性が高いと委託会社が判断した場合には、為替ヘッジ付先進国債券部分以外においても一時的に為替ヘッジを行うことがあります。

? DR(預託証券)とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

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

ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

3.

ターゲット・イヤー※に近づくにしたがい、原則として1年に1回、各資産の基本組入比率を変更します。

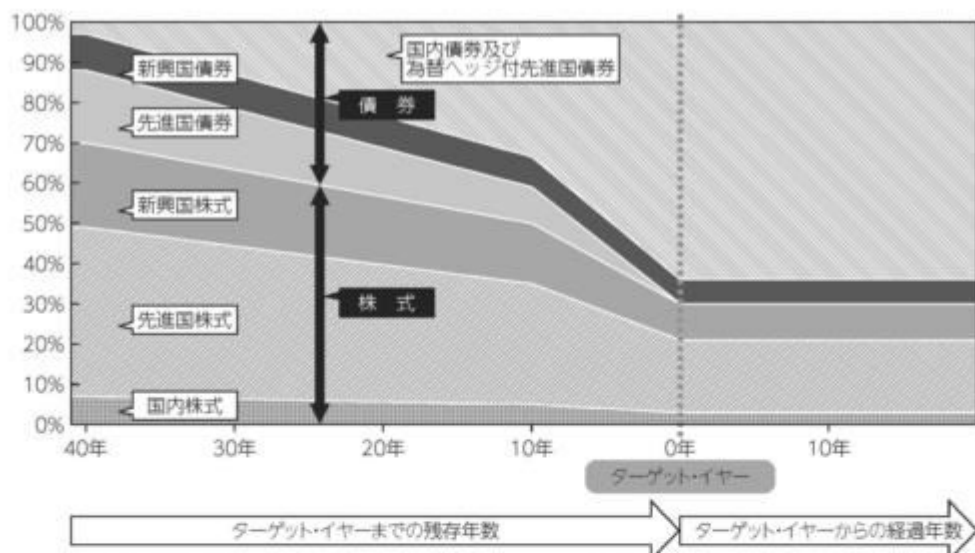
※ターゲット・イヤーとは、ファンドごとにあらかじめ定めた基準日（特定の決算日の翌日）をいいます。

- 定期的に各資産の基本組入比率を変更することで、債券中心の運用へとシフトします。
- ターゲット・イヤー以降の各資産の基本組入比率は一定とすることを基本とします。
- 基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で行います。
- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

各ファンドのターゲット・イヤー

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030	2030年8月の決算日の翌日(第13計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040	2040年8月の決算日の翌日(第23計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050	2050年8月の決算日の翌日(第33計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060	2060年8月の決算日の翌日(第43計算期間開始日)

基本組入比率の推移のイメージ



※上記は当初設定時における基本組入比率の推移のイメージ図であり、実際のファンドの組入比率と異なる場合があります。

<ご参考>

■ 当初設定時(2019年3月)

	国内株式	先進国株式	新興国株式	国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	先進国債券	新興国債券
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	5.1%	30.4%	15.2%	32.4%	9.3%	7.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	5.7%	34.4%	17.2%	22.3%	12.3%	8.1%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	6.4%	38.4%	19.2%	12.1%	15.3%	8.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	7.0%	42.0%	21.0%	3.0%	18.0%	9.0%

■ 2024年9月末現在

	国内株式	先進国株式	新興国株式	国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	先進国債券	新興国債券
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	4.2%	25.2%	12.6%	45.7%	5.4%	6.9%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	5.4%	32.4%	16.2%	27.4%	10.8%	7.8%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	6.1%	36.4%	18.2%	17.2%	13.8%	8.3%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	6.7%	40.4%	20.2%	7.1%	16.8%	8.8%

ファンドのしくみ

ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

- 原則として毎年8月28日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- 株式への直接投資は行いません。
- 外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、投資対象ファンドを通じた実質投資割合には制限を設けません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

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

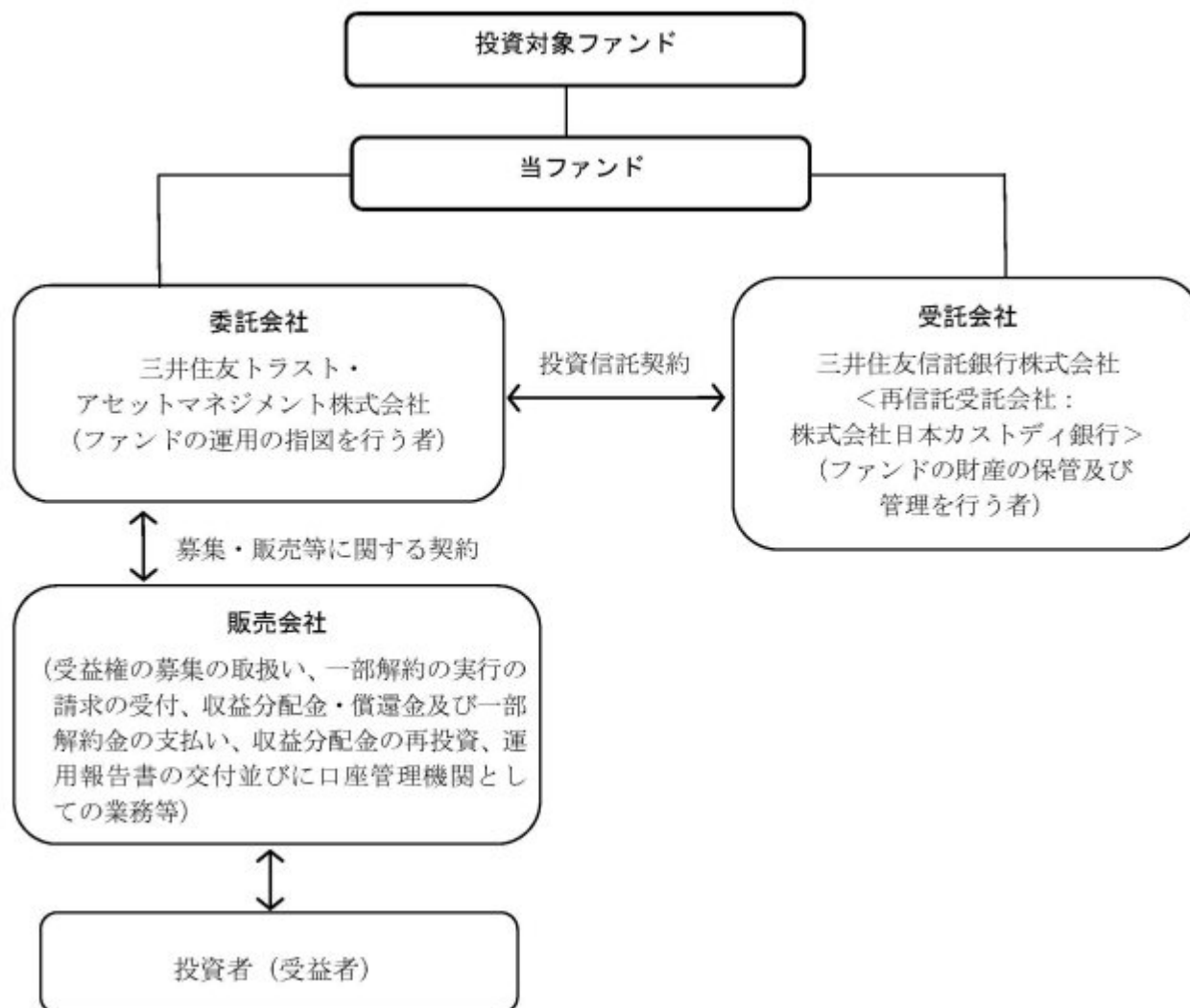
(2) 【ファンドの沿革】

2019年 3月20日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2024年10月1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、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の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」ということがあります。）を投資対象とします。

③投資態度

イ. 投資対象ファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）及び債券に分散投資します。

ロ. 当初設定時の各資産の基本組入比率は以下のとおりとします。

	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2030	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2040	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2050	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2060
国内株式	5.1%	5.7%	6.4%	7.0%
先進国株式	30.4%	34.4%	38.4%	42.0%
新興国株式	15.2%	17.2%	19.2%	21.0%
国内債券 及び為替ヘッジ 付先進国債券	32.4%	22.3%	12.1%	3.0%
先進国債券	9.3%	12.3%	15.3%	18.0%
新興国債券	7.6%	8.1%	8.6%	9.0%

ハ. （※1）年8月の決算日の翌日（第（※2）計算期間開始日）（以下、「ターゲット・イヤー」といいます。）に近づくにしたがい、定期的に各資産の基本組入比率を変更することで、債券中心の運用へとシフトします。ターゲット・イヤー以降の各資産の基本組入比率は一定とすることを基本とします。なお、基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で行います。基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

上記、（※1）及び（※2）となっている箇所には下の表より各々の数字をあてはめてお読みください。

	（※1）	（※2）
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	2030	13
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	2040	23
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2050	33
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2060	43

ニ. 投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

ホ. 投資対象ファンドについては、将来除外又は新たに追加する場合があります。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

ヘ. 為替ヘッジ付先進国債券部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損が生じる可能性が高いと委託会社が判断した場合には、為替ヘッジ付先進国債券部分以外においても一時的に為替ヘッジを行うことがあります。

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

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）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くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）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

・全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

以下の内容は、2024年 9月30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、T O P I X (東証株価指数)(配当込み)（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
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、T O P I X (東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。 ③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

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、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。 ⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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	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。

- ② J P Xは、配当込み T O P I Xの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込み T O P I Xの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込み T O P I X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。
- ③ J P Xは、配当込み T O P I Xの指数値及び配当込み T O P I X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 T O P I Xの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④ J P Xは、配当込み T O P I X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、J P Xは、配当込み T O P I Xの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤ 本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑥ J P X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。
- ⑦ J P Xは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込み T O P I X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、J P X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.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、M S C I 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、M S C I 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MSC I 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、MSC I 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、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

3.新興国株式インデックス マザーファンド

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

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

5.外国債券インデックスマザーファンド（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、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	①FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②公社債への投資割合は、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を行います。 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、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。）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、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。）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り、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、）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	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年1回：12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1月15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

※「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。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。

6. 外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（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、長期的な投資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	日本を除く世界の主要国の公社債

投資態度	①公社債への実質投資は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（※）に採用されている国の国債等に分散投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。 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により為替変動リスクの低減を目指します。 ③公社債等の実質投資割合は、原則として高位を保ちます。 ④株式以外の資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑤運用の効率化を図るため、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。 ⑥資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、実質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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、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外貨建資産への実質投資割合には、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。 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	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年2回：6月・12月の各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0.209%（税抜 0.19%）
信託財産留保額	一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額とします。

設定日	2014年5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

※「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。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。

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

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

※「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。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。

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

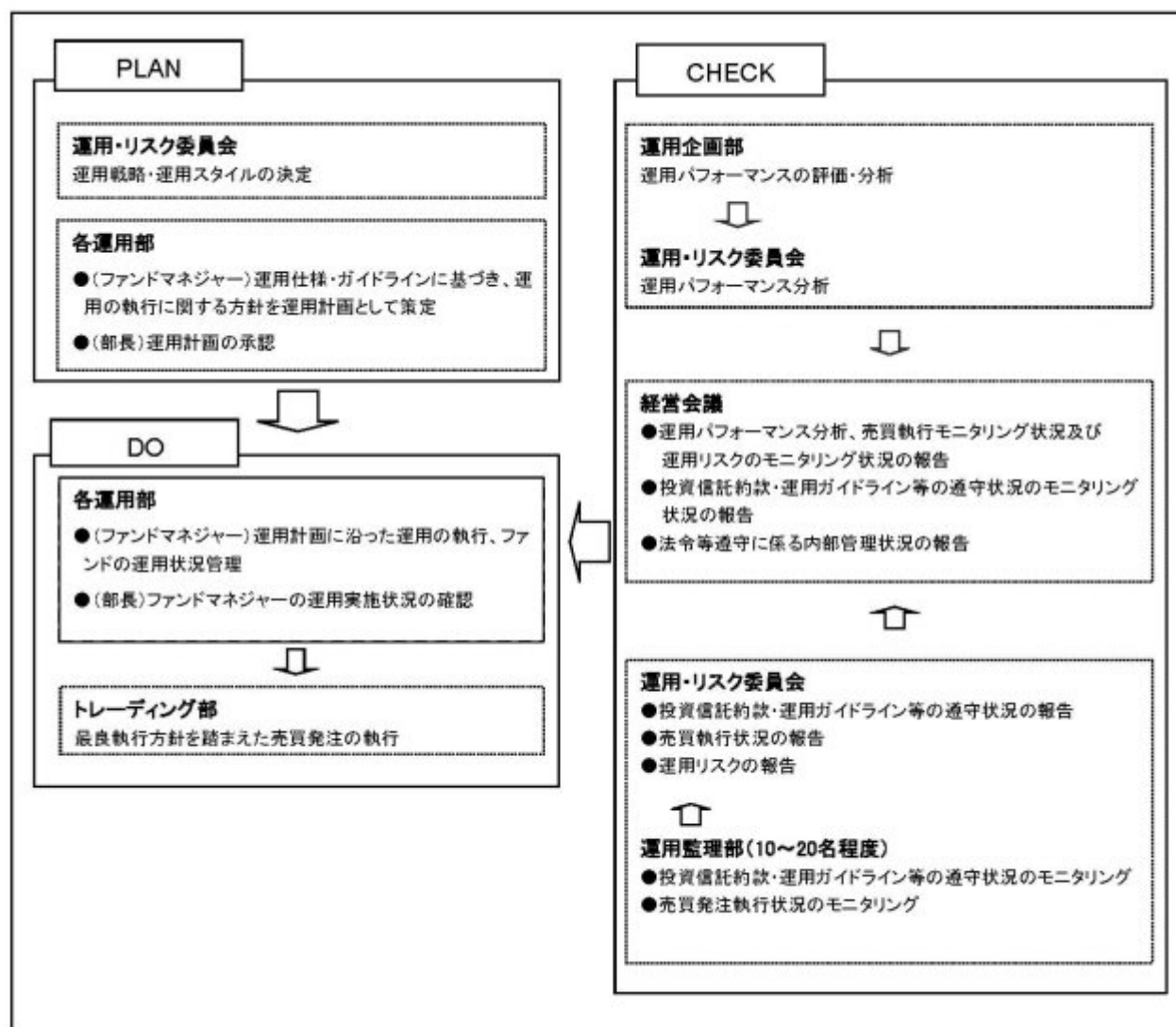
投資態度	①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。 ②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ③投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託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、並びに金利先渡し取引及び為替先渡し取引を行うことができます。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は行いません。 ②同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）
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

※「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建て債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティ

ティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

（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】

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ. 株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、投資対象ファンドを通じた実質投資割合には制限を設けません。

ニ. デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ホ. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

ヘ. 資金の借入れ

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

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ト．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 為替変動リスク

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

③ 金利変動リスク

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

④ 信用リスク

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

⑤ カントリーリスク

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

⑥流動性リスク

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

⑦有価証券の貸付等に係るリスク

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。

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

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

⑤確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

(2)リスクの管理体制

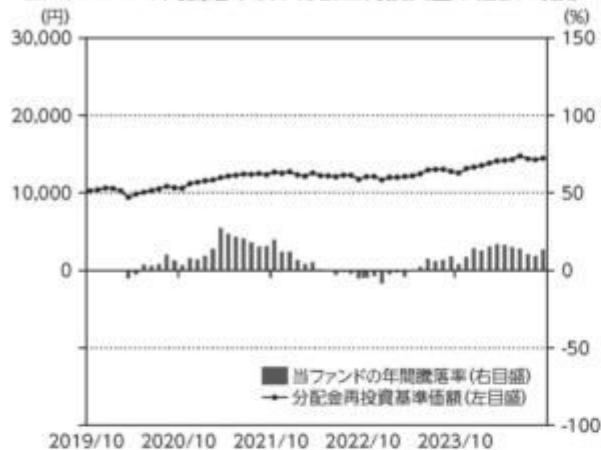
委託会社におけるリスク管理体制

- ・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。

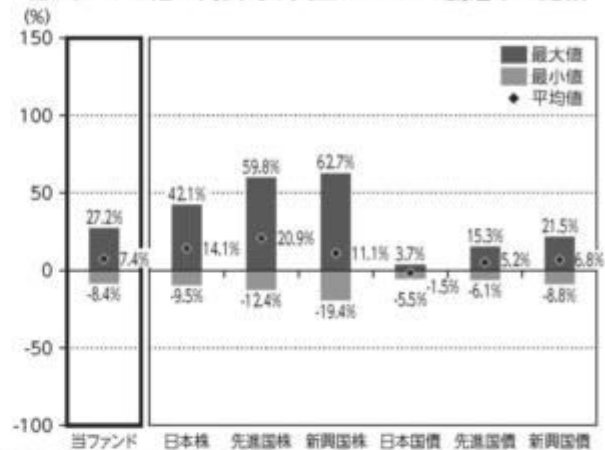
【参考情報】

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030

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

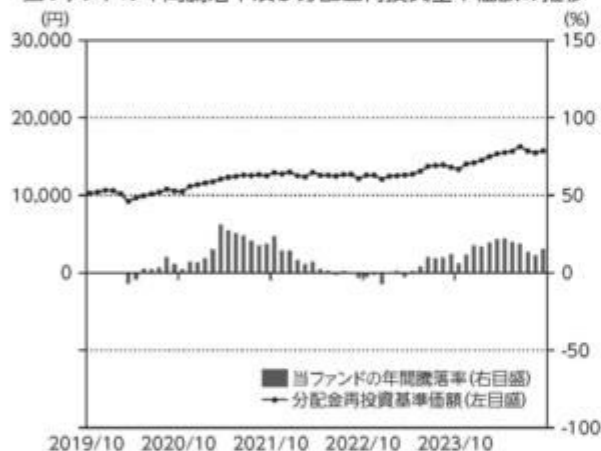


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

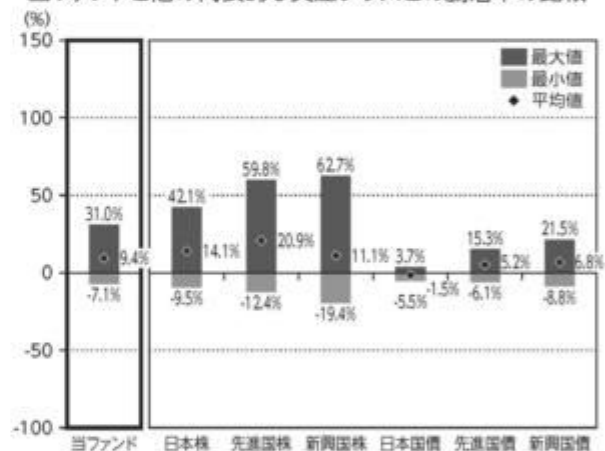


DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040

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

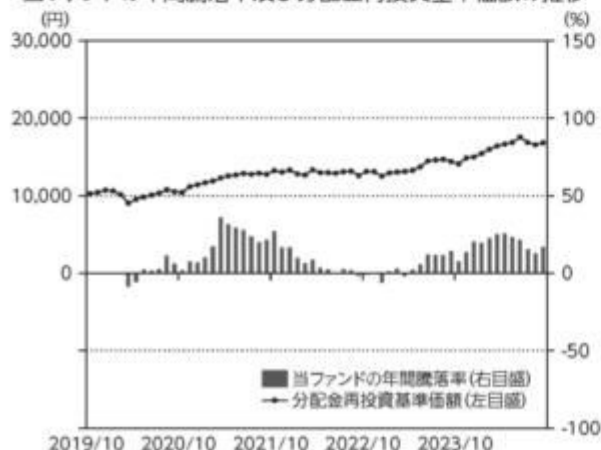


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

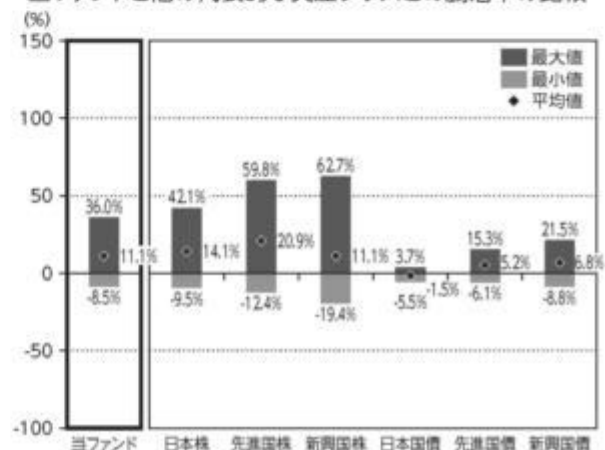


DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050

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



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



【参考情報】

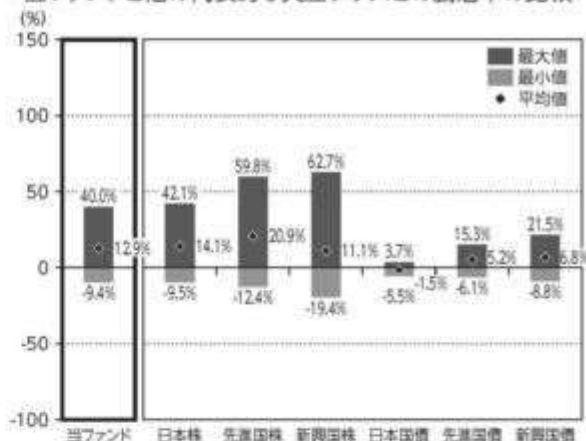
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060



*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



*当ファンドについては2020年3月～2024年9月の4年7ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2019年10月～2024年9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。

*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

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新研が算出・公表する指数で、日本の株式市場を正統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株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は義務は、株式会社JPX新研又は株式会社JPX新研の関連会社(以下「JPX」といふ。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利、ノウハウ及び同指数に係る権利又は義務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コフサイエンス・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコフサイエンス・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリリー・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定期付国債の市場全体の動きを表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリリー・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リー・リサーチ・コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としてあり、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は誤用を禁じて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(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。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、以下のイ. 及びロ. を合計した額とします。

イ. 当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.374%（税抜 0.34%）（※）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 0.165% （税抜 0.15%）	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 0.165% （税抜 0.15%）	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 0.044% （税抜 0.04%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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賃料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率（※）を乗じて得た額

※2024年11月28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。（品賃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。
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
外国債券パッシブファンド私募A （為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	年率 0.209% （税抜 0.19%）
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。

◎実質的な信託報酬率：上限 年率0.583%（税抜 上限0.53%）
（投資対象とする投資信託証券：上限 年率0.209%（税抜 上限0.19%））

品貨料の額は運用状況等によって変動するため、品貨料及び品貨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があります。）。
- ②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
- ③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。
- ④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
- ⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

※上記は、2024年 9月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	0.42%	0.36%	0.06%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	0.43%	0.36%	0.07%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	0.43%	0.36%	0.07%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	0.43%	0.36%	0.07%

※対象期間は2023年8月29日～2024年8月28日です。

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

※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。

※投資先ファンドにかかる費用は、その他費用に含まれています。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2024年9月30日現在の状況について記載してあります。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	4,383,234,670	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	42,076,907	0.95
合計(純資産総額)		4,425,311,577	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	2,002,314,291	0.8353	1,672,672,755	0.8407	1,683,345,624	38.04
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	170,132,188	6.4716	1,101,037,958	6.5421	1,113,021,787	25.15
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	123,702,025	4.4061	545,053,731	4.6656	577,144,167	13.04
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	133,400,051	2.2528	300,536,470	2.2966	306,366,557	6.92
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	216,342,514	1.3173	285,001,431	1.3200	285,572,118	6.45

日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	66,478,952	3.5216	234,116,793	3.5307	234,717,235	5.30
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	65,925,018	2.7979	184,455,832	2.7769	183,067,182	4.14

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

(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 8月28日)	488,321	488,321	9,766	9,766
第2期計算期間末	(2020年 8月28日)	9,108,305	9,108,305	10,876	10,876
第3期計算期間末	(2021年 8月30日)	168,155,570	168,155,570	12,445	12,445
第4期計算期間末	(2022年 8月29日)	769,603,219	769,603,219	12,340	12,340
第5期計算期間末	(2023年 8月28日)	2,645,439,337	2,645,439,337	12,913	12,913
第6期計算期間末	(2024年 8月28日)	4,268,778,864	4,268,778,864	14,284	14,284
	2023年 9月末日	2,679,411,756	—	12,770	—
	10月末日	2,699,878,571	—	12,555	—
	11月末日	2,854,349,113	—	13,134	—
	12月末日	2,939,866,481	—	13,322	—
	2024年 1月末日	3,105,415,659	—	13,530	—
	2月末日	3,216,183,246	—	13,830	—
	3月末日	3,565,884,729	—	14,122	—
	4月末日	3,725,166,491	—	14,198	—
	5月末日	3,833,766,434	—	14,308	—
	6月末日	4,233,968,939	—	14,764	—
	7月末日	4,236,208,793	—	14,397	—
	8月末日	4,318,567,942	—	14,279	—
	9月末日	4,425,311,577	—	14,478	—

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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	0
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	△2.3
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	11.4
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	14.4
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	△0.8
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	4.6
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	10.6

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000	—	500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	10,722,971	2,848,364	8,374,607
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	131,196,373	4,453,274	135,117,706
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	515,248,447	26,679,898	623,686,255
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	1,516,926,128	92,010,119	2,048,602,264
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	1,204,797,988	264,874,585	2,988,525,667

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	3,607,667,141	99.05
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	34,655,321	0.95
合計（純資産総額）		3,642,322,462	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

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

日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	179,920,648	6.4695	1,164,013,058	6.5421	1,177,058,871	32.32
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	930,487,218	0.8354	777,402,091	0.8407	782,260,604	21.48
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	130,842,820	4.4052	576,395,611	4.6656	610,460,260	16.76
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	109,352,505	3.5219	385,129,136	3.5307	386,090,889	10.60
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	124,022,159	2.2530	279,429,784	2.2966	284,829,290	7.82
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	69,730,044	2.7966	195,007,172	2.7769	193,633,359	5.32
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	131,313,537	1.3174	173,002,814	1.3200	173,333,868	4.76

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

(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 8月28日）	482,826	482,826	9,657	9,657
第2期計算期間末	（2020年 8月28日）	10,262,988	10,262,988	10,807	10,807
第3期計算期間末	（2021年 8月30日）	110,076,954	110,076,954	12,614	12,614
第4期計算期間末	（2022年 8月29日）	535,101,335	535,101,335	12,780	12,780
第5期計算期間末	（2023年 8月28日）	2,008,807,846	2,008,807,846	13,732	13,732
第6期計算期間末	（2024年 8月28日）	3,407,651,801	3,407,651,801	15,473	15,473
	2023年 9月末日	2,065,133,221	—	13,619	—
	10月末日	2,059,939,379	—	13,359	—
	11月末日	2,199,099,774	—	14,038	—
	12月末日	2,260,377,769	—	14,198	—
	2024年 1月末日	2,426,296,559	—	14,540	—
	2月末日	2,541,408,059	—	14,974	—
	3月末日	2,800,716,437	—	15,347	—
	4月末日	2,973,827,631	—	15,522	—
	5月末日	3,106,896,722	—	15,685	—
	6月末日	3,555,519,354	—	16,283	—

7月末日	3,471,922,743	—	15,699	—
8月末日	3,452,141,721	—	15,471	—
9月末日	3,642,322,462	—	15,715	—

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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	0
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	△3.4
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	11.9
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	16.7
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	1.3
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	7.4
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	12.7

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000	—	500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	9,066,056	69,464	9,496,592
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	79,505,469	1,737,885	87,264,176
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	348,173,003	16,742,373	418,694,806
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	1,102,286,989	58,067,840	1,462,913,955
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	876,876,174	137,516,198	2,202,273,931

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,446,870,982	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	13,909,465	0.95
合計(純資産総額)		1,460,780,447	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	81,016,052	6.4716	524,306,911	6.5421	530,015,113	36.28
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	58,900,451	4.4075	259,606,691	4.6656	274,805,944	18.81
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	56,026,191	3.5222	197,338,828	3.5307	197,811,672	13.54
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	217,623,412	0.8354	181,821,678	0.8407	182,956,002	12.52
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	52,906,217	2.2535	119,226,611	2.2966	121,504,417	8.32
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	31,564,734	2.7980	88,319,186	2.7769	87,652,109	6.00
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	39,489,186	1.3173	52,022,834	1.3200	52,125,725	3.57

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

(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 8月28日)	477,285	477,285	9,546	9,546
第2期計算期間末	(2020年 8月28日)	4,942,635	4,942,635	10,801	10,801
第3期計算期間末	(2021年 8月30日)	45,085,575	45,085,575	12,844	12,844
第4期計算期間末	(2022年 8月29日)	181,774,282	181,774,282	13,247	13,247
第5期計算期間末	(2023年 8月28日)	758,401,238	758,401,238	14,491	14,491
第6期計算期間末	(2024年 8月28日)	1,373,926,777	1,373,926,777	16,553	16,553
	2023年 9月末日	786,854,963	—	14,398	—
	10月末日	796,193,830	—	14,104	—
	11月末日	866,162,052	—	14,861	—
	12月末日	902,085,794	—	15,005	—

2024年 1月末日	968,076,053	—	15,443	—
2月末日	1,030,896,403	—	15,976	—
3月末日	1,136,938,256	—	16,410	—
4月末日	1,183,167,605	—	16,657	—
5月末日	1,244,825,754	—	16,859	—
6月末日	1,414,901,443	—	17,560	—
7月末日	1,381,016,066	—	16,846	—
8月末日	1,399,111,209	—	16,553	—
9月末日	1,460,780,447	—	16,831	—

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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	0
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	△4.5
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	13.1
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	18.9
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	3.1
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	9.4
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	14.2

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000	—	500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	4,213,212	137,106	4,576,106
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	34,461,389	3,934,457	35,103,038
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	122,053,912	19,938,780	137,218,170
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	420,238,869	34,084,620	523,372,419
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	365,763,528	59,139,937	829,996,010

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,682,526,473	99.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	16,317,900	0.96
合計（純資産総額）		1,698,844,373	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	104,498,197	6.4700	676,108,846	6.5421	683,637,654	40.24
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	75,996,012	4.4056	334,810,418	4.6656	354,566,993	20.87
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	79,281,571	3.5219	279,224,123	3.5307	279,919,442	16.48
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	65,196,899	2.2530	146,891,724	2.2966	149,731,198	8.81
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	40,294,206	2.7968	112,697,561	2.7769	111,892,980	6.59
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	72,222,984	0.8355	60,346,943	0.8407	60,717,862	3.57
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	31,863,897	1.3173	41,976,639	1.3200	42,060,344	2.48

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

(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 8月28日)	472,333	472,333	9,447	9,447
第2期計算期間末	(2020年 8月28日)	2,976,184	2,976,184	10,836	10,836
第3期計算期間末	(2021年 8月30日)	37,860,577	37,860,577	13,126	13,126
第4期計算期間末	(2022年 8月29日)	236,061,906	236,061,906	13,780	13,780

第5期計算期間末	(2023年 8月28日)	718,466,887	718,466,887	15,336	15,336
第6期計算期間末	(2024年 8月28日)	1,577,159,072	1,577,159,072	17,759	17,759
	2023年 9月末日	782,957,488	—	15,265	—
	10月末日	797,383,437	—	14,933	—
	11月末日	897,077,313	—	15,778	—
	12月末日	969,516,597	—	15,904	—
	2024年 1月末日	1,040,075,242	—	16,451	—
	2月末日	1,130,207,539	—	17,095	—
	3月末日	1,245,143,123	—	17,598	—
	4月末日	1,304,466,709	—	17,925	—
	5月末日	1,427,225,965	—	18,171	—
	6月末日	1,585,642,247	—	18,988	—
	7月末日	1,595,549,043	—	18,129	—
	8月末日	1,624,430,645	—	17,760	—
	9月末日	1,698,844,373	—	18,078	—

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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	0
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	△5.5
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	14.7
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	21.1
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	5.0
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	11.3
第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	15.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000	—	500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	2,820,411	573,769	2,746,642
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	33,572,862	7,476,531	28,842,973
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	173,520,838	31,053,827	171,309,984
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	382,072,598	84,901,598	468,480,984

第6期計算期間	2023年 8月29日～2024年 8月28日	568,063,910	148,452,355	888,092,539
---------	-------------------------	-------------	-------------	-------------

(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	661,440,523,950	98.29
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	11,507,805,123	1.71
合計（純資産総額）		672,948,329,073	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	11,172,450,000	1.66

(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	9,445,100	3,347.13	31,614,023,088	2,542.50	24,014,166,750	3.57
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,221,000	2,502.31	15,566,877,374	2,777.50	17,278,827,500	2.57
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,312,300	3,179.64	13,711,567,449	3,781.00	16,304,806,300	2.42
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,656,700	1,626.40	17,332,066,680	1,453.50	15,489,513,450	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	177,800	69,643.48	12,382,612,319	68,360.00	12,154,408,000	1.81
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス 業	1,315,400	7,778.57	10,231,936,825	8,705.00	11,450,557,000	1.70
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,648,600	3,329.13	12,146,663,718	3,045.00	11,109,987,000	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,609,600	3,326.78	12,008,351,632	2,952.50	10,657,344,000	1.58
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,263,600	7,265.08	9,180,155,361	7,678.00	9,701,920,800	1.44
日本	株式	信越化学工業	化学	1,596,000	5,895.22	9,408,782,840	5,977.00	9,539,292,000	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	376,000	34,923.45	13,131,218,689	25,290.00	9,509,040,000	1.41
日本	株式	三井物産	卸売業	2,816,000	3,970.25	11,180,234,940	3,178.00	8,949,248,000	1.33
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,708,500	5,348.30	9,137,584,960	5,231.00	8,937,163,500	1.33
日本	株式	任天堂	その他製 品	1,121,700	8,241.53	9,244,534,650	7,636.00	8,565,301,200	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	53,005,500	151.83	8,048,084,028	146.80	7,781,207,400	1.16

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	879,000	8,912.16	7,833,793,698	8,427.00	7,407,333,000	1.10
日本	株式	第一三共	医薬品	1,552,400	5,452.19	8,463,993,600	4,709.00	7,310,251,600	1.09
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,362,000	3,116.27	7,360,645,282	2,936.00	6,934,832,000	1.03
日本	株式	HOYA	精密機器	349,800	18,642.05	6,520,991,356	19,785.00	6,920,793,000	1.03
日本	株式	三菱重工業	機械	3,138,200	1,329.27	4,171,516,308	2,117.50	6,645,138,500	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,577,100	4,110.00	6,481,895,644	4,103.00	6,470,841,300	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,209,800	1,725.66	7,264,715,972	1,507.50	6,346,273,500	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,310,700	4,285.47	5,616,978,414	4,594.00	6,021,355,800	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	28,482,000	187.48	5,339,924,580	187.20	5,331,830,400	0.79
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	105,700	40,382.22	4,268,400,930	47,420.00	5,012,294,000	0.74
日本	株式	富士通	電気機器	1,651,300	2,263.84	3,738,285,364	2,935.50	4,847,391,150	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,965,700	2,669.35	5,247,153,430	2,303.50	4,527,989,950	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,587,200	2,942.93	4,671,033,137	2,806.50	4,454,476,800	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,063,100	4,385.25	4,661,964,538	4,179.00	4,442,694,900	0.66
日本	株式	ダイキン工業	機械	214,200	22,719.61	4,866,541,104	20,075.00	4,300,065,000	0.64

(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	0.27
		建設業	2.19
		食料品	3.22
		繊維製品	0.39
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.71
		医薬品	4.57
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.85
		非鉄金属	0.79
		金属製品	0.50
		機械	5.44
		電気機器	17.38
		輸送用機器	7.09
		精密機器	2.39
		その他製品	2.47
		電気・ガス業	1.35
		陸運業	2.35
		海運業	0.79

	空運業	0.38
	倉庫・運輸関連業	0.15
	情報・通信業	7.43
	卸売業	7.25
	小売業	4.44
	銀行業	7.29
	証券、商品先物取引業	0.80
	保険業	2.99
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.92
	サービス業	4.67
	小計	98.29
	合計	98.29

(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	422円		11,109,762,500	11,172,450,000	1.66

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

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

外国株式インデックス 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	534,552,020,291	69.74
	イギリス	28,508,147,884	3.72
	カナダ	24,723,718,957	3.23
	スイス	22,512,476,746	2.94
	フランス	21,118,878,997	2.76
	ドイツ	17,949,847,322	2.34
	アイルランド	13,789,799,456	1.80
	オーストラリア	13,752,851,513	1.79
	オランダ	13,482,063,072	1.76
	デンマーク	6,739,023,228	0.88
	スウェーデン	6,731,170,491	0.88
	スペイン	5,412,077,796	0.71
	イタリア	4,281,776,138	0.56

	香港	3,046,582,363	0.40
	シンガポール	2,205,378,641	0.29
	フィンランド	2,044,026,893	0.27
	ベルギー	1,604,908,703	0.21
	イスラエル	1,494,727,941	0.20
	ジャージー	1,235,753,150	0.16
	ノルウェー	1,124,906,897	0.15
	ケイマン	1,061,834,662	0.14
	バミューダ	919,995,930	0.12
	キュラソー	665,698,034	0.09
	ニュージーランド	533,651,835	0.07
	リベリア	518,969,020	0.07
	ルクセンブルク	389,317,107	0.05
	オーストリア	376,325,140	0.05
	ポルトガル	322,470,301	0.04
	パナマ	190,024,642	0.02
	マン島	74,765,738	0.01
	小計	731,363,188,888	95.41
新株予約権証券	カナダ	—	—
投資信託受益証券	オーストラリア	63,812,200	0.01
	香港	58,212,693	0.01
	小計	122,024,893	0.02
投資証券	アメリカ	12,686,333,199	1.66
	オーストラリア	1,006,977,186	0.13
	フランス	309,609,998	0.04
	イギリス	244,276,399	0.03
	シンガポール	221,072,854	0.03
	香港	174,226,591	0.02
	ベルギー	50,154,293	0.01
	カナダ	27,900,985	0.00
	小計	14,720,551,505	1.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	20,312,720,382	2.65
合計(純資産総額)		766,518,485,668	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	15,498,470,859	2.02
	買建	カナダ	517,839,852	0.07
	買建	ドイツ	2,660,497,148	0.35
	買建	イギリス	1,120,047,096	0.15

	買建	オーストラリア	570,511,305	0.07
--	----	---------	-------------	------

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	—	1,628,534,884	0.21

(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	1,155,407	27,216.34	31,445,961,048	32,512.46	37,565,131,612	4.90
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	560,017	61,369.07	34,367,726,341	61,091.29	34,212,163,528	4.46
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,951,142	16,255.37	31,716,538,166	17,327.42	33,808,260,816	4.41
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	742,859	25,977.08	19,297,309,216	26,828.95	19,930,132,985	2.60
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	173,814	68,641.42	11,930,840,144	80,979.29	14,075,334,799	1.84
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	465,895	25,135.04	11,710,293,290	23,400.58	10,902,214,850	1.42
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	400,960	25,380.47	10,176,555,622	23,591.84	9,459,384,848	1.23
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	350,741	20,252.81	7,103,492,267	24,648.04	8,645,079,495	1.13
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	227,655	25,378.50	5,777,542,903	37,175.45	8,463,178,390	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	64,074	115,822.27	7,421,196,144	125,286.96	8,027,637,104	1.05
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	105,044	58,015.68	6,094,199,621	65,294.69	6,858,815,742	0.89
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	227,765	28,557.93	6,504,497,773	30,044.66	6,843,123,124	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,000	72,161.01	5,267,754,243	83,047.45	6,062,463,887	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	355,800	16,404.92	5,836,870,708	16,530.98	5,881,725,744	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	124,853	38,693.52	4,831,002,402	39,275.01	4,903,603,335	0.64
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	65,849	63,659.87	4,191,938,933	70,457.23	4,639,538,612	0.61

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	187,206	23,317.69	4,365,212,438	24,770.79	4,637,240,794	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	78,650	47,029.84	3,698,897,320	57,024.91	4,485,009,714	0.59
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	35,163	116,361.98	4,091,636,502	126,404.54	4,444,762,931	0.58
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	190,885	20,669.26	3,945,452,082	23,036.62	4,397,345,590	0.57
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	255,486	19,582.30	5,003,003,655	17,029.17	4,350,714,527	0.57
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	350,884	9,323.23	3,271,374,904	11,386.99	3,995,515,897	0.52
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	140,059	22,328.98	3,127,375,296	27,802.37	3,893,973,078	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,693	142,469.52	4,515,286,800	120,736.33	3,826,496,792	0.50
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	34,177	92,756.63	3,170,143,555	100,960.06	3,450,512,159	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	324,600	8,859.76	2,875,880,364	10,246.58	3,326,042,043	0.43
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	200,889	17,968.28	3,609,629,885	16,226.97	3,259,820,520	0.43
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	131,290	17,854.88	2,344,167,413	24,084.26	3,162,022,522	0.41
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	558,243	5,615.24	3,134,673,570	5,623.56	3,139,314,122	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	76,856	38,444.00	2,954,652,772	39,484.82	3,034,645,879	0.40

(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	3.96
		素材	3.66
		資本財	7.00
		商業・専門サービス	1.56
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.69
		耐久消費財・アパレル	1.30
		消費者サービス	1.89
		メディア・娯楽	6.17
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.73

		生活必需品流通・小売り	1.74
		食品・飲料・タバコ	3.07
		家庭用品・パーソナル用品	1.58
		ヘルスケア機器・サービス	4.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.58
		銀行	5.40
		金融サービス	6.62
		保険	3.08
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.04
		ソフトウェア・サービス	9.50
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.38
		電気通信サービス	1.17
		公益事業	2.71
		半導体・半導体製造装置	8.75
		不動産管理・開発	0.28
		小計	95.41
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.02
投資証券	—	—	1.92
合計			97.35

(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	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	375	アメリカドル	107,098,630	15,286,187,460	108,585,937.5	15,498,470,859	2.02
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	17	カナダドル	4,866,244.5	513,729,431	4,905,180	517,839,852	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	38	スイスフラン	4,589,066	778,810,390	4,663,740	791,483,315	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	230	ユーロ	11,284,346	1,799,063,283	11,723,100	1,869,013,833	0.24
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	28	オーストラリアドル	5,740,871	566,796,194	5,778,500	570,511,305	0.07
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	70	イギリスポンド	5,862,457.5	1,119,905,256	5,863,200	1,120,047,096	0.15

(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	9,380,000.00	1,359,000,800	1,338,578,634	0.17
	ユーロ	買建	1,100,000.00	178,718,100	175,354,630	0.02
	イギリスポンド	買建	600,000.00	116,995,200	114,601,620	0.01

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	インド	42,057,037,886	18.96
	台湾	37,725,152,325	17.01
	ケイマン	34,699,306,570	15.65
	韓国	22,809,333,968	10.29
	中国	21,058,924,803	9.50
	ブラジル	8,875,260,709	4.00
	サウジアラビア	8,078,116,396	3.64
	南アフリカ	6,328,368,277	2.85
	メキシコ	3,648,012,039	1.64
	インドネシア	3,563,849,075	1.61
	マレーシア	3,211,363,375	1.45
	タイ	3,165,575,616	1.43
	アラブ首長国連邦	2,488,630,635	1.12
	香港	1,862,606,307	0.84
	ポーランド	1,750,015,704	0.79
	カタール	1,635,848,672	0.74
	クウェート	1,437,520,107	0.65
	トルコ	1,333,706,492	0.60
	フィリピン	1,240,111,212	0.56
	ギリシャ	997,800,953	0.45
	チリ	915,409,906	0.41
	バミューダ	752,190,437	0.34
	アメリカ	701,608,879	0.32
	ハンガリー	535,429,683	0.24
	イギリス	300,755,028	0.14
	ルクセンブルク	263,599,542	0.12
	チェコ	251,689,733	0.11
	コロンビア	165,452,191	0.07
	エジプト	118,027,884	0.05
	シンガポール	81,771,483	0.04

	ペルー	74,215,946	0.03
	ロシア	—	—
	英ヴァージン諸島	—	—
	小計	212,126,691,833	95.65
投資信託受益証券	ブラジル	341,953,684	0.15
	メキシコ	125,409,638	0.06
	小計	467,363,322	0.21
投資証券	メキシコ	205,090,919	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	8,972,614,611	4.05
合計(純資産総額)		221,771,760,685	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	9,006,137,397	4.06

(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	—	867,795,907	0.39
	売建	—	1,558,157	△0.00

(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	4,408,389	2,628.52	11,587,543,206	4,513.59	19,897,704,590	8.97
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,168,800	5,668.15	6,624,935,947	8,042.38	9,399,940,757	4.24
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	857,794	7,736.44	6,636,278,777	7,023.47	6,024,699,003	2.72
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2,735,288	1,500.97	4,105,607,892	1,882.92	5,150,342,157	2.32
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	552,888	4,074.21	2,252,582,745	5,219.60	2,885,856,416	1.30
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	904,050	2,072.39	1,873,546,759	3,023.70	2,733,577,793	1.23

ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	124,381	15,538.56	1,932,702,630	19,322.78	2,403,387,620	1.08
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	762,664	2,633.82	2,008,724,269	2,997.37	2,285,988,863	1.03
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	931,368	1,636.98	1,524,634,594	2,234.11	2,080,783,219	0.94
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	97,741	14,516.93	1,418,899,888	20,107.72	1,965,348,661	0.89
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	598,702	2,403.39	1,438,917,097	3,261.31	1,952,554,017	0.88
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	2,259,248	456.89	1,032,236,981	862.09	1,947,692,279	0.88
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	16,601,620	82.59	1,371,130,604	110.03	1,826,780,839	0.82
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	277,804	4,262.41	1,184,114,574	5,687.13	1,579,909,129	0.71
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	457,159	1,776.81	812,286,560	2,967.27	1,356,517,615	0.61
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	1,863.49	829,088,852	2,792.24	1,242,298,291	0.56
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	354,607	2,761.34	979,190,897	3,357.49	1,190,589,811	0.54
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	161,114	5,848.33	942,249,049	7,368.47	1,187,164,562	0.54
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	27,127.39	884,298,712	35,193.38	1,147,233,873	0.52
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	2,704,200	303.57	820,928,034	403.22	1,090,391,580	0.49
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,178,000	692.71	816,017,477	892.78	1,051,697,196	0.47
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	12,091,515	69.61	841,760,661	86.52	1,046,190,525	0.47
ブラジル	株式	VALE SA	素材	621,587	1,830.40	1,137,758,034	1,678.68	1,043,450,491	0.47
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	10,195,000	86.51	882,048,544	101.17	1,031,479,125	0.47
ケイマン	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	銀行	500,000	2,136.98	1,068,494,300	1,979.66	989,832,550	0.45
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	14,349,200	52.24	749,668,552	68.52	983,208,619	0.44
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	187,000	4,426.25	827,709,906	5,066.44	947,425,402	0.43
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	421,633	1,772.53	747,357,956	2,175.37	917,210,520	0.41
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	338,630	3,247.29	1,099,632,318	2,678.34	906,968,306	0.41
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	自動車・自動車部品	165,233	2,806.58	463,739,819	5,441.30	899,083,232	0.41

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.60
		素材	6.29

		資本財	4.66
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.77
		自動車・自動車部品	3.76
		耐久消費財・アパレル	1.14
		消費者サービス	2.72
		メディア・娯楽	6.18
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.45
		生活必需品流通・小売り	1.20
		食品・飲料・タバコ	2.97
		家庭用品・パーソナル用品	0.72
		ヘルスケア機器・サービス	0.85
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.58
		銀行	16.41
		金融サービス	2.65
		保険	2.90
		ソフトウェア・サービス	2.46
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.55
		電気通信サービス	2.72
		公益事業	2.77
		半導体・半導体製造装置	11.85
		不動産管理・開発	1.40
		小計	95.65
投資信託受益証券	—	—	0.21
投資証券	—	—	0.09
合計			95.95

(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	1,058	アメリカドル	59,049,222	8,428,095,455	63,099,120	9,006,137,397	4.06

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	6,080,901.72	883,352,176	867,795,907	0.39
	ブラジルリアル	売建	59,367.68	1,587,776	1,558,157	△0.00

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	570,702,119,170	84.80
地方債証券	日本	34,234,679,100	5.09
特殊債券	日本	35,961,440,148	5.34
	国際機関	298,305,000	0.04
	小計	36,259,745,148	5.39
社債券	日本	29,568,031,000	4.39
	フランス	1,393,940,000	0.21
	オーストラリア	99,805,000	0.01
	韓国	99,418,000	0.01
	小計	31,161,194,000	4.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	632,801,622	0.09
合計(純資産総額)		672,990,539,040	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(％)	償還期限	投資比率(％)
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	98.46	6,469,413,300	98.95	6,501,474,900	0.100	2028/3/20	0.97
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	6,180,000,000	96.25	5,948,424,400	98.28	6,073,827,600	0.600	2033/12/20	0.90
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	6,120,000,000	94.75	5,798,873,400	96.44	5,902,372,800	0.200	2032/9/20	0.88
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	5,900,000,000	99.42	5,865,783,200	99.53	5,872,447,000	0.005	2026/3/20	0.87
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	99.31	5,859,467,000	99.46	5,868,258,000	0.100	2026/9/20	0.87
日本	国債証券	第375回利付国債(10年)	5,700,000,000	101.76	5,800,738,700	102.24	5,827,908,000	1.100	2034/6/20	0.87
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,850,000,000	98.75	5,776,891,400	98.99	5,790,973,500	0.005	2027/6/20	0.86
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	5,880,000,000	96.22	5,658,174,000	98.28	5,779,040,400	0.500	2033/3/20	0.86
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	99.08	5,697,387,500	99.32	5,711,360,000	0.100	2027/3/20	0.85
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	5,580,000,000	96.07	5,360,970,000	97.38	5,433,859,800	0.100	2030/12/20	0.81
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	5,540,000,000	95.18	5,273,166,500	97.17	5,383,495,000	0.400	2033/6/20	0.80

日本	国債証券	第372回利付国債（10年）	5,360,000,000	98.21	5,264,388,100	100.33	5,377,956,000	0.800	2033/9/20	0.80
日本	国債証券	第374回利付国債（10年）	5,320,000,000	97.65	5,195,287,100	99.78	5,308,296,000	0.800	2034/3/20	0.79
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	5,325,000,000	98.29	5,234,346,200	98.82	5,262,591,000	0.100	2028/6/20	0.78
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	5,370,000,000	96.34	5,173,458,000	97.56	5,239,401,600	0.100	2030/9/20	0.78
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	5,400,000,000	95.20	5,140,800,000	97.00	5,238,162,000	0.200	2032/3/20	0.78
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	5,160,000,000	99.68	5,143,853,000	99.78	5,148,699,600	0.100	2025/12/20	0.77
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	5,160,000,000	98.65	5,090,494,800	99.06	5,111,599,200	0.100	2027/12/20	0.76
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,260,000,000	95.63	5,030,397,400	96.99	5,101,674,000	0.100	2031/6/20	0.76
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	5,170,000,000	96.55	4,991,806,000	98.56	5,095,552,000	0.500	2032/12/20	0.76
日本	国債証券	第154回利付国債（5年）	5,100,000,000	98.91	5,044,894,900	99.16	5,057,313,000	0.100	2027/9/20	0.75
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,030,000,000	100.00	5,030,000,000	100.02	5,031,207,200	0.300	2025/12/20	0.75
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,120,000,000	95.06	4,867,072,000	96.75	4,953,702,400	0.100	2031/9/20	0.74
日本	国債証券	第148回利付国債（5年）	4,960,000,000	99.21	4,920,816,000	99.40	4,930,339,200	0.005	2026/6/20	0.73
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	4,880,000,000	99.20	4,841,057,600	99.39	4,850,427,200	0.100	2026/12/20	0.72
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	99.56	4,739,056,000	99.67	4,744,339,600	0.100	2026/3/20	0.70
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	4,800,000,000	97.32	4,671,385,800	98.06	4,706,880,000	0.100	2029/9/20	0.70
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	4,790,000,000	94.93	4,547,587,400	96.72	4,633,271,200	0.200	2032/6/20	0.69
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	4,767,000,000	94.73	4,515,849,100	96.50	4,600,441,020	0.100	2031/12/20	0.68
日本	国債証券	第149回利付国債（5年）	4,580,000,000	99.09	4,538,322,000	99.27	4,546,840,800	0.005	2026/9/20	0.68

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	84.80
地方債証券	5.09
特殊債券	5.39
社債券	4.63
合計	99.91

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド（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（％）
国債証券	アメリカ	37,072,106,355	45.29
	中国	8,784,248,707	10.73
	フランス	6,127,119,733	7.49
	イタリア	5,591,994,195	6.83
	ドイツ	4,845,089,628	5.92
	イギリス	4,372,641,688	5.34
	スペイン	3,648,074,054	4.46
	カナダ	1,522,120,097	1.86
	ベルギー	1,290,312,354	1.58
	オランダ	1,086,717,079	1.33
	オーストラリア	1,072,030,678	1.31
	オーストリア	928,160,531	1.13
	メキシコ	591,027,581	0.72
	マレーシア	434,174,492	0.53
	ポーランド	427,293,923	0.52
	フィンランド	416,742,967	0.51
	アイルランド	392,752,183	0.48
	シンガポール	331,589,325	0.41
	イスラエル	247,376,887	0.30
	ニュージーランド	220,769,360	0.27
	デンマーク	213,697,850	0.26
	ノルウェー	130,964,326	0.16
	スウェーデン	129,995,193	0.16
小計		79,876,999,186	97.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,980,683,156	2.42
合計(純資産総額)		81,857,682,342	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	199,101,661	0.24
	買建	ドイツ	199,005,308	0.24

(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	—	80,008,154,934	△97.74

(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取相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	4,620,000	13,574.55	627,144,469	13,862.09	640,428,731	2.250	2027/2/15	0.78
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	4,230,000	13,461.96	569,440,930	13,965.79	590,753,167	2.875	2028/5/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/15/54	4,000,000	13,970.19	558,807,902	14,607.52	584,300,938	4.250	2054/2/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	3,500,000	14,397.33	503,906,592	14,568.49	509,897,347	4.625	2026/10/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	3,350,000	14,564.18	487,900,341	15,122.68	506,610,098	4.500	2033/11/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	3,590,000	13,465.14	483,398,821	14,072.00	505,185,058	3.500	2033/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	3,150,000	13,898.63	437,807,107	14,439.14	454,833,117	3.875	2033/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 4.875% 10/31/30	2,900,000	15,085.29	437,473,533	15,281.58	443,166,055	4.875	2030/10/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/29	3,200,000	13,432.78	429,849,236	13,707.37	438,636,049	2.625	2029/7/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/15/26	2,890,000	14,228.39	411,200,670	14,475.38	418,338,676	4.375	2026/8/15	0.51
中国	国債証券	CGB 2.18% 08/15/26	19,880,000	2,055.12	408,559,774	2,071.35	411,785,822	2.180	2026/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 4.125% 10/31/27	2,800,000	14,308.49	400,637,972	14,534.48	406,965,601	4.125	2027/10/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 5% 08/31/25	2,750,000	14,293.05	393,058,877	14,404.41	396,121,359	5.000	2025/8/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	3,190,000	11,598.20	369,982,783	12,317.15	392,917,179	1.125	2031/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/31/25	2,730,000	13,898.69	379,434,318	14,117.81	385,416,418	2.750	2025/8/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.625% 05/15/26	2,640,000	14,120.71	372,786,924	14,268.81	376,696,805	3.625	2026/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.375% 11/30/30	2,510,000	14,351.58	360,224,903	14,892.98	373,813,884	4.375	2030/11/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	2,730,000	12,889.18	351,874,835	13,537.60	369,576,641	2.875	2032/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.25% 06/30/27	2,600,000	13,765.31	357,898,287	14,183.79	368,778,638	3.250	2027/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/28/29	2,450,000	14,687.25	359,837,625	14,710.94	360,418,198	4.250	2029/2/28	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.25% 08/31/25	2,550,000	13,366.06	340,834,741	13,799.32	351,882,877	0.250	2025/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 4.625% 11/15/26	2,400,000	14,217.33	341,216,047	14,585.22	350,045,325	4.625	2026/11/15	0.43
中国	国債証券	CGB 2.74% 08/04/26	16,500,000	2,089.71	344,803,159	2,090.46	344,926,031	2.740	2026/8/4	0.42
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	2,350,000	13,537.88	318,140,290	14,061.97	330,456,328	3.125	2028/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	2,360,000	13,450.87	317,440,655	13,925.65	328,645,414	3.375	2033/5/15	0.40
中国	国債証券	CGB 2.52% 08/25/33	15,400,000	2,066.96	318,312,967	2,107.96	324,626,386	2.520	2033/8/25	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	2,620,000	11,539.38	302,331,910	12,268.92	321,445,855	1.375	2031/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	2,630,000	11,424.53	300,465,216	12,184.45	320,451,264	0.875	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/28/29	2,400,000	12,609.36	302,624,684	13,327.69	319,864,620	1.875	2029/2/28	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	2,450,000	12,394.07	303,654,836	13,034.98	319,357,120	1.125	2028/8/31	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.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	97.58
合計	97.58

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	5	アメリカドル	548,803.05	78,330,659	551,250	78,679,912	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	3	アメリカドル	342,359.97	48,865,038	344,203.14	49,128,114	0.06
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	4	アメリカドル	497,511.2	71,009,774	499,500	71,293,635	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	2	ユーロ	213,314.2	34,008,683	214,270	34,161,066	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	3	ユーロ	356,916.3	56,903,165	359,910	57,380,451	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	5	ユーロ	667,110.5	106,357,427	674,050	107,463,791	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 ／ 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	258,987,000.00	37,324,310,408	36,949,416,303	△45.14
	カナダドル	売建	15,128,000.00	1,619,238,445	1,596,503,224	△1.95
	メキシコペソ	売建	82,394,000.00	596,732,510	596,392,489	△0.73
	ユーロ	売建	152,726,000.00	24,434,292,788	24,341,469,880	△29.74
	イギリスポンド	売建	23,172,000.00	4,404,103,976	4,424,647,056	△5.41
	スウェーデンクローナ	売建	9,200,000.00	130,055,800	130,235,200	△0.16
	ノルウェークローネ	売建	9,758,000.00	134,184,331	132,660,010	△0.16
	デンマーククローネ	売建	10,045,000.00	215,523,570	214,701,830	△0.26
	ポーランドズロチ	売建	11,582,000.00	431,937,528	431,479,301	△0.53
	オーストラリアドル	売建	10,985,000.00	1,078,214,915	1,084,142,605	△1.32
	ニュージーランドドル	売建	2,470,000.00	222,842,180	224,056,170	△0.27
	シンガポールドル	売建	2,989,000.00	331,510,435	333,088,182	△0.41
	マレーシアリングット	売建	12,648,000.00	422,952,566	439,110,734	△0.54
	イスラエルシェケル	売建	6,626,000.00	260,899,742	253,516,723	△0.31
	オフショア人民元	売建	433,461,000.00	8,850,583,069	8,856,735,227	△10.82

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	162,451,816,837	45.33
	中国	38,468,325,877	10.73
	フランス	26,864,518,346	7.50
	イタリア	24,514,619,105	6.84
	ドイツ	21,304,906,293	5.94
	イギリス	19,185,384,690	5.35
	スペイン	15,997,924,905	4.46
	カナダ	6,789,129,903	1.89
	ベルギー	5,656,139,981	1.58
	オランダ	4,765,828,235	1.33
	オーストラリア	4,710,421,934	1.31
	オーストリア	4,074,470,882	1.14
	メキシコ	2,590,006,415	0.72
	マレーシア	1,893,221,177	0.53
	ポーランド	1,876,405,503	0.52
	フィンランド	1,818,973,910	0.51
	アイルランド	1,706,971,005	0.48
	シンガポール	1,450,719,763	0.40
	イスラエル	1,079,389,570	0.30
	ニュージーランド	966,432,601	0.27
	デンマーク	933,877,651	0.26
	スウェーデン	564,684,219	0.16
	ノルウェー	548,561,435	0.15
	小計	350,212,730,237	97.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	8,201,226,115	2.29
合計(純資産総額)		358,413,956,352	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,703,437,966	0.48
	買建	ドイツ	1,496,088,728	0.42

(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	—	3,889,176,502	1.09

(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	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	15,500,000	13,263.29	2,055,810,992	13,738.87	2,129,526,014	1.500	2026/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	16,100,000	12,689.95	2,043,083,214	13,082.93	2,106,352,182	0.375	2027/7/31	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/29	15,200,000	13,432.23	2,041,699,126	13,707.37	2,083,521,237	2.625	2029/7/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/31/28	14,150,000	14,131.10	1,999,551,534	14,723.77	2,083,413,499	4.375	2028/8/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	13,047.25	1,778,340,217	13,925.65	1,898,066,520	3.375	2033/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	13,220,000	13,336.70	1,763,112,135	13,945.72	1,843,624,782	2.875	2028/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	12,518.14	1,614,840,806	13,382.88	1,726,392,668	2.750	2032/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 4% 02/15/34	11,600,000	14,080.63	1,633,354,087	14,566.26	1,689,686,811	4.000	2034/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1% 07/31/28	13,000,000	12,392.43	1,611,016,314	12,996.51	1,689,546,868	1.000	2028/7/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/26	12,300,000	13,522.35	1,663,249,661	13,724.93	1,688,167,504	1.625	2026/10/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,345.81	1,560,125,482	13,869.06	1,621,293,461	2.375	2027/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	11,070,000	13,609.86	1,506,612,357	14,439.14	1,598,413,525	3.875	2033/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	13,198.62	1,478,245,685	14,072.00	1,576,064,804	3.500	2033/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	12,030,000	12,357.57	1,486,616,215	13,034.98	1,568,108,639	1.125	2028/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	11,427.32	1,437,556,935	12,268.92	1,543,430,863	1.375	2031/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/15/54	10,550,000	13,534.77	1,427,918,470	14,607.52	1,541,093,722	4.250	2054/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,391.53	1,442,267,864	13,822.50	1,488,684,158	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	11,805.05	1,383,552,244	12,647.77	1,482,319,065	1.875	2032/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	10,410,000	13,418.85	1,396,902,301	14,061.97	1,463,851,222	3.125	2028/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/31/26	10,800,000	13,026.90	1,406,905,216	13,528.12	1,461,037,804	0.625	2026/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,151.73	1,415,173,531	14,493.50	1,449,350,672	4.500	2026/7/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,256.15	1,345,110,652	12,068.76	1,442,217,938	0.625	2030/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	13,363.09	1,344,327,483	13,965.79	1,404,959,071	2.875	2028/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	9,270,000	14,220.59	1,318,248,809	15,122.68	1,401,873,318	4.500	2033/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	9,520,000	14,197.45	1,351,597,567	14,568.49	1,386,920,784	4.625	2026/10/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	10,980,000	11,887.61	1,305,259,951	12,624.91	1,386,215,615	1.625	2031/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	12,682.61	1,280,944,604	13,537.60	1,367,298,199	2.875	2032/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,365.15	1,267,214,782	12,184.45	1,358,567,150	0.875	2030/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/29	10,200,000	12,861.92	1,311,916,479	13,269.70	1,353,510,260	1.750	2029/1/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	13,922.86	1,280,903,623	14,691.15	1,351,586,201	4.125	2030/8/31	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.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	97.71
合計	97.71

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	44	アメリカドル	4,847,920.11	691,943,637	4,851,000	692,383,230	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	28	アメリカドル	3,212,359.75	458,500,106	3,212,562.64	458,529,065	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	31	アメリカドル	3,884,274.3	554,402,471	3,871,125	552,525,671	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	15	ユーロ	1,604,116.5	255,744,294	1,607,025	256,207,996	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	21	ユーロ	2,511,534.1	400,413,882	2,519,370	401,663,159	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	39	ユーロ	5,239,701.9	835,365,673	5,257,590	838,217,573	0.23

(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	13,030,000.00	1,859,249,985	1,855,797,750	0.52
	カナダドル	買建	1,420,000.00	149,437,921	149,646,700	0.04
	ユーロ	買建	7,520,000.00	1,192,962,684	1,197,033,600	0.33
	イギリスポンド	買建	1,190,000.00	224,355,016	226,837,800	0.06
	オフショア人民元	買建	22,520,000.00	455,105,917	459,860,652	0.13

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	マレーシア	15,475,670,675	10.03
	インドネシア	15,129,878,457	9.81
	中国	14,959,227,604	9.69
	メキシコ	14,788,693,209	9.58
	タイ	14,786,053,777	9.58
	南アフリカ	13,541,617,990	8.78
	ブラジル	12,551,664,753	8.13
	ポーランド	11,710,666,575	7.59
	チェコ	8,474,052,860	5.49
	コロンビア	5,862,875,090	3.80
	ルーマニア	5,728,674,058	3.71

	インド	4,453,221,328	2.89
	ハンガリー	4,282,825,998	2.78
	ペルー	3,036,537,288	1.97
	チリ	2,734,693,420	1.77
	ドミニカ共和国	374,615,184	0.24
	ウルグアイ	270,497,349	0.18
	小計	148,161,465,615	96.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	6,141,332,485	3.98
合計(純資産総額)		154,302,798,100	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	—	1,921,852,320	1.25

(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(％)
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	86,500,000	2,123.57	1,836,888,733	2,270.96	1,964,383,953	0.000	2026/1/1	1.27
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	68,300,000	2,588.04	1,767,636,851	2,515.52	1,718,102,779	10.000	2027/1/1	1.11
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	195,700,000	867.69	1,698,076,375	876.83	1,715,969,667	10.500	2026/12/21	1.11
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	220,000,000	677.87	1,491,325,440	773.57	1,701,858,649	8.875	2035/2/28	1.10
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	210,100,000	747.60	1,570,717,285	806.62	1,694,711,837	8.000	2030/1/31	1.10
マレーシア	国債証券	MGS 4.893% 06/08/38	43,700,000	3,807.84	1,664,026,403	3,835.01	1,675,903,732	4.893	2038/6/8	1.09
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,003.72	1,562,903,347	2,143.01	1,671,551,806	0.000	2026/7/1	1.08
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	68,000,000	2,266.81	1,541,436,206	2,416.61	1,643,297,749	0.000	2025/7/1	1.06
メキシコ	国債証券	MBONO 7% 09/03/26	225,600,000	680.04	1,534,192,787	694.14	1,565,990,705	7.000	2026/9/3	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	198,500,000	705.30	1,400,031,038	783.30	1,554,862,232	8.250	2032/3/31	1.01
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	43,000,000	3,464.38	1,489,685,232	3,504.21	1,506,812,021	3.733	2028/6/15	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	210,800,000	649.10	1,368,320,403	675.76	1,424,506,700	7.750	2031/5/29	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	210,000,000	639.49	1,342,946,700	669.01	1,404,922,984	5.500	2027/3/4	0.91
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	187,300,000	637.98	1,194,944,581	732.73	1,372,409,802	9.000	2040/1/31	0.89
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	47,600,000,000	2.63	1,254,772,458	2.82	1,345,914,308	7.250	2034/10/18	0.87

マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	41,200,000	3,235.33	1,332,957,623	3,261.50	1,343,738,468	2.632	2031/4/15	0.87
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	188,700,000	605.87	1,143,280,524	700.79	1,322,408,939	8.750	2048/2/28	0.86
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	38,900,000	3,269.59	1,271,872,099	3,377.70	1,313,927,183	2.750	2029/10/25	0.85
ポーランド	国債証券	POLGB 6% 10/25/33	32,400,000	3,883.38	1,258,217,657	3,948.04	1,279,166,886	6.000	2033/10/25	0.83
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000	2.28	1,235,098,949	2.35	1,272,005,707	7.250	2050/10/26	0.82
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,516.62	1,293,546,832	2,441.05	1,254,703,473	10.000	2029/1/1	0.81
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/27	64,500,000	1,886.29	1,216,661,525	1,910.96	1,232,572,444	0.000	2027/7/1	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	657.57	1,152,733,714	688.29	1,206,581,073	5.750	2026/3/5	0.78
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000	3,504.88	1,188,155,361	3,497.62	1,185,693,686	3.955	2025/9/15	0.77
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	193,000,000	596.27	1,150,814,422	610.56	1,178,383,623	7.750	2042/11/13	0.76
ポーランド	国債証券	POLGB 7.5% 07/25/28	28,500,000	4,042.42	1,152,092,013	4,076.41	1,161,779,484	7.500	2028/7/25	0.75
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 05/26/33	176,000,000	633.39	1,114,782,931	651.41	1,146,487,558	7.500	2033/5/26	0.74
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	154,600,000	689.69	1,066,272,253	707.90	1,094,420,340	8.500	2029/5/31	0.71
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.375% 04/15/32	115,000,000,000	0.92	1,061,122,913	0.94	1,088,654,400	6.375	2032/4/15	0.71
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 11/07/47	175,700,000	610.04	1,071,856,855	618.69	1,087,045,765	8.000	2047/11/7	0.70

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	96.02
合計	96.02

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	メキシコペソ	買建	40,580,000.00	292,483,452	292,435,712	0.19
	チェココルナ	買建	26,180,000.00	165,872,342	165,651,332	0.11
	ハンガリーフォリント	買建	212,350,000.00	85,228,658	85,009,012	0.06
	ポーランドズロチ	買建	6,170,000.00	229,260,583	229,321,624	0.15
	マレーシアリングット	買建	8,770,000.00	297,724,125	304,099,750	0.20
	タイバーツ	買建	65,180,000.00	282,777,860	287,117,900	0.19
	南アフリカランド	買建	31,770,000.00	258,506,906	264,167,550	0.17
	オフショア人民元	買建	14,400,000.00	292,480,280	294,049,440	0.19

(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：2019年3月20日
作成基準日：2024年9月30日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030

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	14,478円
純資産総額	44.25億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年 8月	0円
2021年 8月	0円
2022年 8月	0円
2023年 8月	0円
2024年 8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

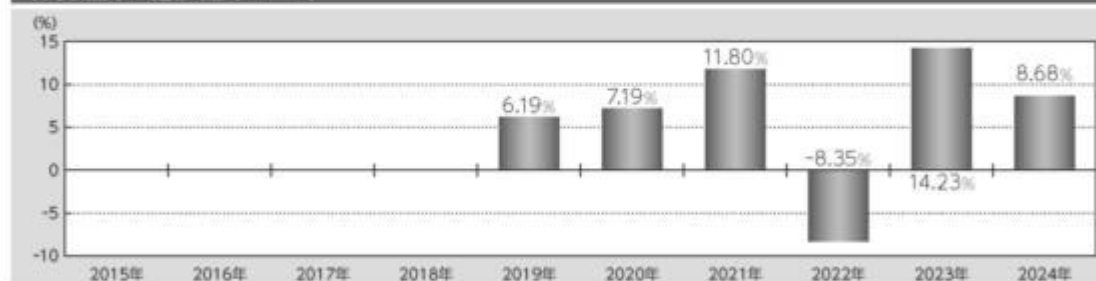
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	38.0%
外国株式インデックス マザーファンド	25.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	13.0%
新興国債券インデックス マザーファンド	6.9%
国内債券インデックス マザーファンド	6.5%
外国債券インデックス マザーファンド	5.3%
国内株式インデックス マザーファンド	4.1%

※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)



※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

当初設定日：2019年3月20日
作成基準日：2024年9月30日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040

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	15,715円
純資産総額	36.42億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年 8 月	0円
2021年 8 月	0円
2022年 8 月	0円
2023年 8 月	0円
2024年 8 月	0円
設定来 分配金合計額	0円

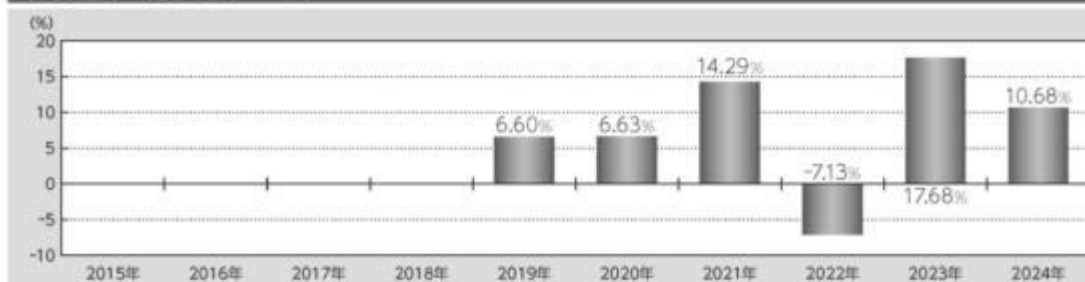
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	32.3%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	21.5%
新興国株式インデックス マザーファンド	16.8%
外国債券インデックス マザーファンド	10.6%
新興国債券インデックス マザーファンド	7.8%
国内株式インデックス マザーファンド	5.3%
国内債券インデックス マザーファンド	4.8%

※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)



※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

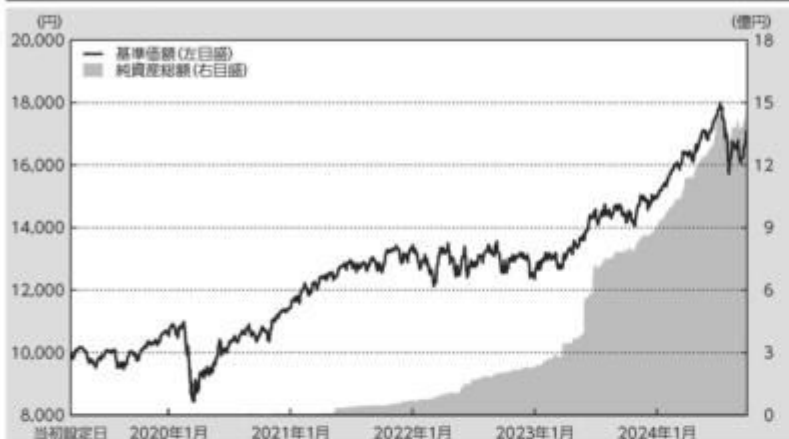
運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

運用実績

当初設定日：2019年3月20日
作成基準日：2024年9月30日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050

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	16,831円
純資産総額	14.61億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2020年 8 月	0円
2021年 8 月	0円
2022年 8 月	0円
2023年 8 月	0円
2024年 8 月	0円
設定来 分配金合計額	0円

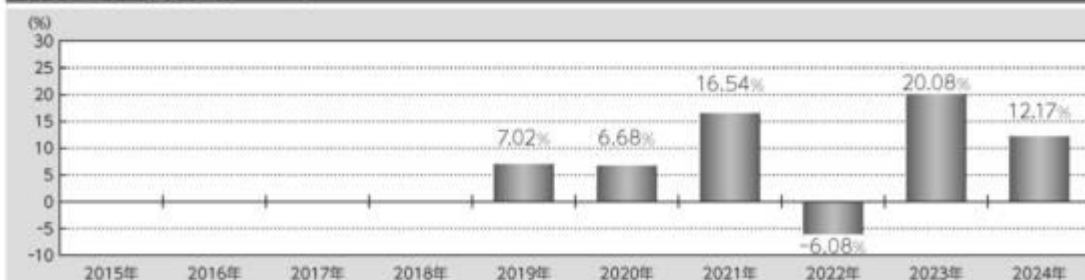
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	36.3%
新興国株式インデックス マザーファンド	18.8%
外国債券インデックス マザーファンド	13.5%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	12.5%
新興国債券インデックス マザーファンド	8.3%
国内株式インデックス マザーファンド	6.0%
国内債券インデックス マザーファンド	3.6%

※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)



※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

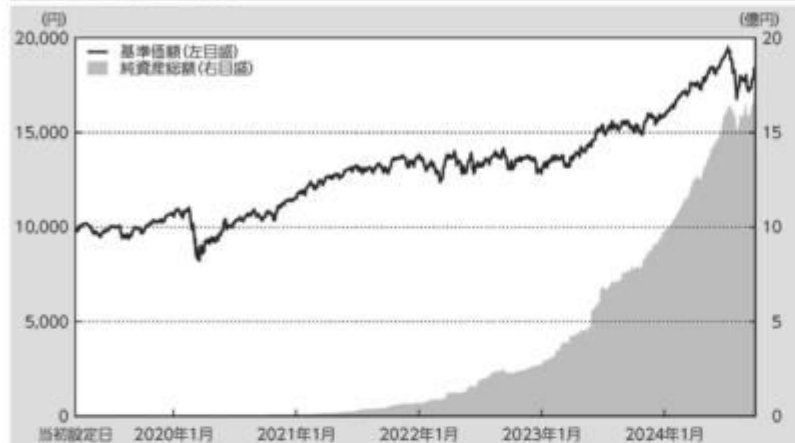
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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

当初設定日：2019年3月20日
作成基準日：2024年9月30日

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060

基準価額・純資産の推移



基準価額 18,078円

純資産総額 16.99億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年 8月	0円
2021年 8月	0円
2022年 8月	0円
2023年 8月	0円
2024年 8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

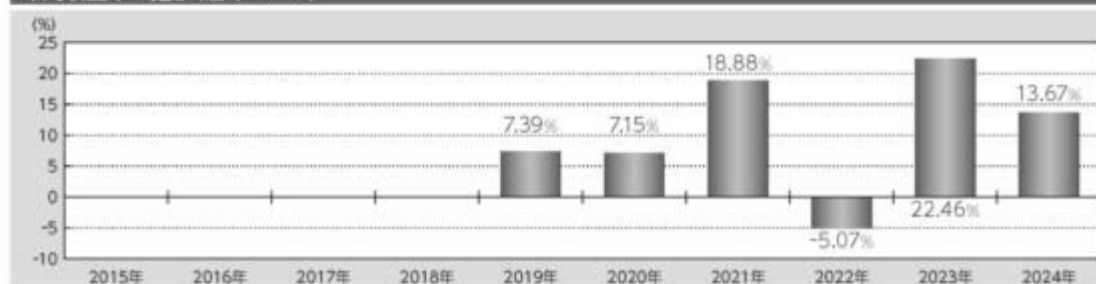
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	40.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	20.9%
外国債券インデックス マザーファンド	16.5%
新興国債券インデックス マザーファンド	8.8%
国内株式インデックス マザーファンド	6.6%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	3.6%
国内債券インデックス マザーファンド	2.5%

※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)



※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<申込手続>

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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>

当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。

※「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>

1円以上1円単位とします。

<申込価額>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

<申込手数料>

ありません。

<申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

<受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<申込受付の中止等>

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

<その他>

70/348

<受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投

資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

①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

計算日の基準価額で評価します。

②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。

③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

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、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

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

・公社債等

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

・外貨建資産等の円換算

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。（2019年 3月20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8月29日から翌年8月28日までとします。

ただし、第1計算期間は2019年3月20日から2019年8月28日までとします。

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

（1）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

（2）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知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、本手続きに従います。

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

＜運用報告書＞

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用

報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

<関係法人との契約の更改手続き>

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

<公告>

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

<混蔵寄託>

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

<投資信託財産の登記等及び記載等の留保等>

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

(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

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（以下「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【財務諸表】

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

(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8月29日から2024年8月28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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)		
	第5期 (2023年 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	26,888,615	46,880,645
親投資信託受益証券	2,619,172,926	4,226,162,412
未収入金	3,413,165	2,991,989
未収利息	-	279
流動資産合計	2,649,474,706	4,276,035,325
資産合計	2,649,474,706	4,276,035,325
負債の部		
流動負債		
未払解約金	809,968	2,171
未払受託者報酬	373,971	841,089
未払委託者報酬	2,804,693	6,308,127
未払利息	62	-
その他未払費用	46,675	105,074
流動負債合計	4,035,369	7,256,461
負債合計	4,035,369	7,256,461
純資産の部		
元本等		
元本	2,048,602,264	2,988,525,667
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	596,837,073	1,280,253,197
（分配準備積立金）	105,647,214	381,862,130
元本等合計	2,645,439,337	4,268,778,864
純資産合計	2,645,439,337	4,268,778,864
負債純資産合計	2,649,474,706	4,276,035,325

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日
営業収益		
受取利息	21	18,885
有価証券売買等損益	100,881,927	320,716,497
営業収益合計	100,881,948	320,735,382
営業費用		
支払利息	8,147	4,636
受託者報酬	562,927	1,474,159
委託者報酬	4,221,796	11,056,159
その他費用	70,232	184,146
営業費用合計	4,863,102	12,719,100
営業利益又は営業損失（△）	96,018,846	308,016,282
経常利益又は経常損失（△）	96,018,846	308,016,282
当期純利益又は当期純損失（△）	96,018,846	308,016,282
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（△）	△421,018	21,060,140
期首剰余金又は期首欠損金（△）	145,916,964	596,837,073
剰余金増加額又は欠損金減少額	375,578,891	477,746,553
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	375,578,891	477,746,553
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,098,646	81,286,571
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,098,646	81,286,571
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	596,837,073	1,280,253,197

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	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。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2023年 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,048,602,264口	2,988,525,667口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)1.2913円 (12,913円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)1.4284円 (14,284円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日			第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	30,297,851円	費用控除後の配当等収益額	A	80,030,306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	64,205,983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	206,925,836円
収益調整金額	C	491,189,859円	収益調整金額	C	898,391,067円
分配準備積立金額	D	11,143,380円	分配準備積立金額	D	94,905,988円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	596,837,073円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,280,253,197円
当ファンドの期末残存口数	F	2,048,602,264口	当ファンドの期末残存口数	F	2,988,525,667口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,913円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,283円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28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 8月28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 8月30日 至 2023年 8月28日	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	623,686,255円	2,048,602,264円
期中追加設定元本額	1,516,926,128円	1,204,797,988円
期中一部解約元本額	92,010,119円	264,874,585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 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28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)
親投資信託受益証券	90,964,952	267,268,425
合計	90,964,952	267,268,425

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘 柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	120,962,101	532,789,670	
	国内株式インデックス マザーファンド	64,469,010	180,397,183	
	外国株式インデックス マザーファンド	166,355,654	1,076,454,165	
	国内債券インデックス マザーファンド	211,498,017	278,627,487	
	外国債券インデックス マザーファンド	64,983,272	228,832,094	
	新興国債券インデックス マザーファンド	130,440,000	293,816,100	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	1,957,440,404	1,635,245,713	
合計		2,716,148,458	4,226,162,412	

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

(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8月29日から2024年8月28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。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：円)	
	第5期 (2023年 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	19,799,276	39,104,689
親投資信託受益証券	1,988,909,027	3,373,592,630
未収入金	10,674,280	1,817,640
未収利息	-	233
流動資産合計	2,019,382,583	3,414,515,192
資産合計	2,019,382,583	3,414,515,192
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,090,735	1,012,606
未払受託者報酬	288,014	678,365
未払委託者報酬	2,160,006	5,087,687
未払利息	45	-
その他未払費用	35,937	84,733
流動負債合計	10,574,737	6,863,391
負債合計	10,574,737	6,863,391
純資産の部		
元本等		
元本	1,462,913,955	2,202,273,931
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	545,893,891	1,205,377,870
（分配準備積立金）	120,809,390	370,126,968
元本等合計	2,008,807,846	3,407,651,801
純資産合計	2,008,807,846	3,407,651,801
負債純資産合計	2,019,382,583	3,414,515,192

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日
営業収益		
受取利息	18	12,096
有価証券売買等損益	112,257,561	283,546,888
営業収益合計	112,257,579	283,558,984
営業費用		
支払利息	5,999	3,284
受託者報酬	426,144	1,166,549
委託者報酬	3,195,966	8,749,002
その他費用	53,143	145,694
営業費用合計	3,681,252	10,064,529
営業利益又は営業損失（△）	108,576,327	273,494,455
経常利益又は経常損失（△）	108,576,327	273,494,455
当期純利益又は当期純損失（△）	108,576,327	273,494,455
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,467,342	15,773,937
期首剰余金又は期首欠損金（△）	116,406,529	545,893,891
剰余金増加額又は欠損金減少額	338,539,761	457,401,374
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	338,539,761	457,401,374
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,161,384	55,637,913
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,161,384	55,637,913
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	545,893,891	1,205,377,870

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	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。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2023年 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,462,913,955口	2,202,273,931口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)1.3732円 (13,732円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)1.5473円 (15,473円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日			第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	23,863,169円	費用控除後の配当等収益額	A	63,617,815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	83,245,816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	194,102,703円
収益調整金額	C	425,084,501円	収益調整金額	C	835,250,902円
分配準備積立金額	D	13,700,405円	分配準備積立金額	D	112,406,450円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	545,893,891円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,205,377,870円
当ファンドの期末残存口数	F	1,462,913,955口	当ファンドの期末残存口数	F	2,202,273,931口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,731円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,473円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28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 8月28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 8月30日 至 2023年 8月28日	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	418,694,806円	1,462,913,955円
期中追加設定元本額	1,102,286,989円	876,876,174円
期中一部解約元本額	58,067,840円	137,516,198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 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28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)
親投資信託受益証券	106,483,482	259,456,160
合計	106,483,482	259,456,160

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘 柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	124,295,081	547,470,113	
	国内株式インデックス マザーファンド	66,245,529	185,368,239	
	外国株式インデックス マザーファンド	170,940,805	1,106,123,760	
	国内債券インデックス マザーファンド	124,812,247	164,427,654	
	外国債券インデックス マザーファンド	103,889,631	365,836,946	
	新興国債券インデックス マザーファンド	117,871,728	265,506,067	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	884,438,415	738,859,851	
合計		1,592,493,436	3,373,592,630	

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

(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8月29日から2024年8月28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。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：円)	
	第5期 (2023年 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,255,988	15,349,335
親投資信託受益証券	750,894,420	1,360,185,953
未収入金	1,921,379	750,650
未収利息	-	91
流動資産合計	762,071,787	1,376,286,029
資産合計	762,071,787	1,376,286,029
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,724,160	11,736
未払受託者報酬	109,740	272,189
未払委託者報酬	822,975	2,041,369
未払利息	21	-
その他未払費用	13,653	33,958
流動負債合計	3,670,549	2,359,252
負債合計	3,670,549	2,359,252
純資産の部		
元本等		
元本	523,372,419	829,996,010
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	235,028,819	543,930,767
（分配準備積立金）	54,976,360	164,242,181
元本等合計	758,401,238	1,373,926,777
純資産合計	758,401,238	1,373,926,777
負債純資産合計	762,071,787	1,376,286,029

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日
営業収益		
受取利息	5	4,744
有価証券売買等損益	52,177,533	125,611,448
営業収益合計	52,177,538	125,616,192
営業費用		
支払利息	2,168	1,271
受託者報酬	158,980	463,034
委託者報酬	1,192,184	3,472,648
その他費用	19,749	57,748
営業費用合計	1,373,081	3,994,701
営業利益又は営業損失（△）	50,804,457	121,621,491
経常利益又は経常損失（△）	50,804,457	121,621,491
当期純利益又は当期純損失（△）	50,804,457	121,621,491
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,244,150	7,713,110
期首剰余金又は期首欠損金（△）	44,556,112	235,028,819
剰余金増加額又は欠損金減少額	152,033,203	223,159,928
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	152,033,203	223,159,928
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,120,803	28,166,361
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,120,803	28,166,361
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	235,028,819	543,930,767

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	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。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2023年 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	523,372,419口	829,996,010口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)1.4491円 (14,491円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)1.6553円 (16,553円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日			第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	9,210,178円	費用控除後の配当等収益額	A	25,384,616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	40,350,129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	88,523,765円
収益調整金額	C	180,052,459円	収益調整金額	C	379,688,586円
分配準備積立金額	D	5,416,053円	分配準備積立金額	D	50,333,800円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	235,028,819円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	543,930,767円
当ファンドの期末残存口数	F	523,372,419口	当ファンドの期末残存口数	F	829,996,010口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,490円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,553円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28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 8月28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 8月30日 至 2023年 8月28日	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	137,218,170円	523,372,419円
期中追加設定元本額	420,238,869円	365,763,528円
期中一部解約元本額	34,084,620円	59,139,937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 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28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)
親投資信託受益証券	49,981,741	116,500,553
合計	49,981,741	116,500,553

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘 柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	56,335,111	248,133,629	
	国内株式インデックス マザーファンド	30,189,983	84,477,610	
	外国株式インデックス マザーファンド	77,476,942	501,337,796	
	国内債券インデックス マザーファンド	37,765,149	49,751,807	
	外国債券インデックス マザーファンド	53,566,223	188,628,097	
	新興国債券インデックス マザーファンド	50,606,164	113,990,384	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	208,123,809	173,866,630	
合計		514,063,381	1,360,185,953	

(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。

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

(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8月29日から2024年8月28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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)		
	第5期 (2023年 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,500,906	19,973,816
親投資信託受益証券	711,356,467	1,561,378,642
未収入金	3,080,396	2,340,992
未収利息	-	119
流動資産合計	721,937,769	1,583,693,569
資産合計	721,937,769	1,583,693,569
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,461,110	3,884,867
未払受託者報酬	117,091	307,219
未払委託者報酬	878,095	2,304,076
未払利息	17	-
その他未払費用	14,569	38,335
流動負債合計	3,470,882	6,534,497
負債合計	3,470,882	6,534,497
純資産の部		
元本等		
元本	468,480,984	888,092,539
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	249,985,903	689,066,533
（分配準備積立金）	65,470,038	172,544,822
元本等合計	718,466,887	1,577,159,072
純資産合計	718,466,887	1,577,159,072
負債純資産合計	721,937,769	1,583,693,569

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日
営業収益		
受取利息	16	6,523
有価証券売買等損益	63,672,877	144,016,620
営業収益合計	63,672,893	144,023,143
営業費用		
支払利息	2,981	1,426
受託者報酬	175,189	504,424
委託者報酬	1,313,712	3,783,056
その他費用	21,767	62,928
営業費用合計	1,513,649	4,351,834
営業利益又は営業損失（△）	62,159,244	139,671,309
経常利益又は経常損失（△）	62,159,244	139,671,309
当期純利益又は当期純損失（△）	62,159,244	139,671,309
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（△）	2,549,318	19,951,445
期首剰余金又は期首欠損金（△）	64,751,922	249,985,903
剰余金増加額又は欠損金減少額	157,607,246	405,504,076
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	157,607,246	405,504,076
剰余金減少額又は欠損金増加額	31,983,191	86,143,310
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	31,983,191	86,143,310
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	249,985,903	689,066,533

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	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。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2023年 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	468,480,984口	888,092,539口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)1.5336円 (15,336円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)1.7759円 (17,759円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日			第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,230,026円	費用控除後の配当等収益額	A	27,797,890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	49,379,900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	91,921,974円
収益調整金額	C	184,515,865円	収益調整金額	C	516,521,711円
分配準備積立金額	D	5,860,112円	分配準備積立金額	D	52,824,958円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	249,985,903円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	689,066,533円
当ファンドの期末残存口数	F	468,480,984口	当ファンドの期末残存口数	F	888,092,539口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,336円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,758円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28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 8月28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 8月30日 至 2023年 8月28日	第6期 自 2023年 8月29日 至 2024年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	171,309,984円	468,480,984円
期中追加設定元本額	382,072,598円	568,063,910円
期中一部解約元本額	84,901,598円	148,452,355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 8月28日現在)	第6期 (2024年 8月28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)
親投資信託受益証券	60,926,764	132,080,807
合計	60,926,764	132,080,807

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘 柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	71,817,811	316,328,730	
	国内株式インデックス マザーファンド	38,087,585	106,576,680	
	外国株式インデックス マザーファンド	98,770,683	639,125,335	
	国内債券インデックス マザーファンド	30,122,561	39,683,461	
	外国債券インデックス マザーファンド	74,912,703	263,797,592	
	新興国債券インデックス マザーファンド	61,632,735	138,827,735	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	68,277,603	57,039,109	
合計		443,621,681	1,561,378,642	

(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 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,359,642,603
株式	671,252,357,970
派生商品評価勘定	119,321,050
未収配当金	728,655,973
未収利息	26,003
差入委託証拠金	522,717,093
流動資産合計	676,982,720,692
資産合計	676,982,720,692
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	86,068,800
前受金	33,365,000
未払解約金	189,346,581
流動負債合計	308,780,381
負債合計	308,780,381
純資産の部	
元本等	
元本	241,827,606,194
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	434,846,334,117
元本等合計	676,673,940,311
純資産合計	676,673,940,311
負債純資産合計	676,982,720,692

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月28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 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	241,827,606,194口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7982円 (27,982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 8月28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 8月28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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月29日
期首元本額	242,575,517,919円
期中追加設定元本額	35,408,826,603円
期中一部解約元本額	36,156,738,328円
期末元本額	241,827,606,194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）	271,202,239円

区分	2024年 8月28日現在
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,244,778,764円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,155,836円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,525,412,679円
世界経済インデックスファンド	6,548,401,316円
日本株式インデックス・オープン	2,766,207,866円
DCマイセクション25	4,875,657,507円
DCマイセクション50	16,597,772,443円
DCマイセクション75	18,595,958,394円
DC日本株式インデックス・オープン	6,034,231,819円
DCマイセクションS25	3,055,003,392円
DCマイセクションS50	9,801,727,259円
DCマイセクションS75	9,073,730,559円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,663,380,506円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	36,976,853円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	537,203,082円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	448,185,756円
DC世界経済インデックスファンド	3,604,378,835円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	384,023,347円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,324,370円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,080,617円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,804,284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）	94,818,801円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,891,172円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	12,186,808円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	54,250,942円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,667,663円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,165,717円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	356,944,535円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	281,605,314円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,934,146,603円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,135,416円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,034,381円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	288,796,680円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	163,109,252円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	214,040,043円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	16,032,951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）	361,150,538円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,443,556,351円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,861,389,468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）	681,460,069円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	418,823,590円
コア投資戦略ファンド（切替型）	434,167,482円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,436,476円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,677,556円
SMT インデックスバランス・オープン	46,596,576円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	16,499,180,351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	55,421,930円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	259,761,414円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	42,042,335円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,644,545円
グローバル経済コア	288,292,725円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	34,698,700円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	3,017,936,911円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	31,187,469円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	442,995,610円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	129,749,321円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	64,469,010円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	66,245,529円

区分	2024年 8月28日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	30,189,983円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	38,087,585円
10資産分散投資ファンド	112,417,423円
グローバル10資産バランスファンド	47,006,337円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	1,034,364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	35,080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	50,628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）	44,022,564,046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）	234,925,616円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	301,584,135円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,026,564円
SMTAM日本株式インデックスファンドVLP（適格機関投資家専用）	50,091,197,421円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,956,041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）	226,644,810円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△9,596,070,460
合計	△9,596,070,460

(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 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,486,260,000	—	5,519,625,000	33,365,000
合計		5,486,260,000	—	5,519,625,000	33,365,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘 柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	10,300	4,065.00	41,869,500	
ニッセイ	248,300	920.00	228,436,000	

マルハニチロ	36,900	3,015.00	111,253,500	
雪国まいたけ	21,100	1,017.00	21,458,700	
カネコ種苗	7,000	1,371.00	9,597,000	
サカタのタネ	28,300	3,485.00	98,625,500	
ホクト	19,900	1,888.00	37,571,200	
ホクリヨウ	900	980.00	882,000	
住石ホールディングス	35,100	964.00	33,836,400	
日鉄鉱業	10,000	4,415.00	44,150,000	
三井松島ホールディングス	14,700	4,760.00	69,972,000	
I N P E X	750,600	2,163.00	1,623,547,800	
石油資源開発	28,800	5,880.00	169,344,000	
K & O エナジーグループ	11,300	3,350.00	37,855,000	
ショーボンドホールディングス	33,800	5,595.00	189,111,000	
ミライト・ワン	75,000	2,125.50	159,412,500	
タマホーム	15,600	4,110.00	64,116,000	
サンヨーホームズ	600	721.00	432,600	
日本アクア	2,700	852.00	2,300,400	
ファーストコーポレーション	1,500	778.00	1,167,000	
ベステラ	1,300	905.00	1,176,500	
キャンディル	1,000	633.00	633,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,100	1,096.00	1,205,600	
第一カッター興業	7,200	1,502.00	10,814,400	
安藤・間	143,900	1,160.00	166,924,000	
東急建設	77,800	747.00	58,116,600	
コムシスホールディングス	79,300	3,192.00	253,125,600	
ビーアールホールディングス	36,400	356.00	12,958,400	
高松コンストラクショングループ	18,400	2,962.00	54,500,800	
東建コーポレーション	6,200	11,600.00	71,920,000	
ソネック	600	943.00	565,800	
ヤマウラ	12,600	1,186.00	14,943,600	
オリエンタル白石	91,900	378.00	34,738,200	
大成建設	159,100	6,565.00	1,044,491,500	
大林組	621,300	1,884.50	1,170,839,850	
清水建設	492,600	993.70	489,496,620	
飛島建設	17,900	1,372.00	24,558,800	
長谷工コーポレーション	159,400	1,820.50	290,187,700	
松井建設	16,200	791.00	12,814,200	
銭高組	600	3,640.00	2,184,000	
鹿島建設	385,200	2,658.50	1,024,054,200	
不動テトラ	12,000	2,495.00	29,940,000	
大末建設	1,500	1,679.00	2,518,500	
鉄建建設	12,500	2,437.00	30,462,500	

西松建設	33,100	5,158.00	170,729,800	
三井住友建設	129,300	384.00	49,651,200	
大豊建設	6,000	3,525.00	21,150,000	
佐田建設	2,400	877.00	2,104,800	
ナカノフドー建設	2,700	503.00	1,358,100	
奥村組	28,200	4,660.00	131,412,000	
東鉄工業	21,500	3,425.00	73,637,500	
イチケン	900	2,557.00	2,301,300	
富士ピー・エス	1,700	450.00	765,000	
浅沼組	64,200	694.00	44,554,800	
戸田建設	235,100	1,011.00	237,686,100	
熊谷組	28,700	3,580.00	102,746,000	
北野建設	700	3,800.00	2,660,000	
植木組	1,100	1,613.00	1,774,300	
矢作建設工業	23,600	1,667.00	39,341,200	
ピーエス・コンストラクション	22,000	999.00	21,978,000	
日本ハウスホールディングス	37,100	347.00	12,873,700	
新日本建設	24,400	1,624.00	39,625,600	
東亜道路工業	33,400	1,361.00	45,457,400	
日本道路	20,400	1,650.00	33,660,000	
東亜建設工業	52,400	936.00	49,046,400	
日本国土開発	49,400	492.00	24,304,800	
若築建設	6,000	3,820.00	22,920,000	
東洋建設	43,800	1,415.00	61,977,000	
五洋建設	246,300	650.00	160,095,000	
世紀東急工業	22,300	1,649.00	36,772,700	
福田組	6,500	5,580.00	36,270,000	
住友林業	150,100	6,098.00	915,309,800	
日本基礎技術	2,300	742.00	1,706,600	
巴コーポレーション	4,700	964.00	4,530,800	
大和ハウス工業	480,400	4,512.00	2,167,564,800	
ライト工業	32,000	2,203.00	70,496,000	
積水ハウス	526,900	3,717.00	1,958,487,300	
日特建設	16,600	1,099.00	18,243,400	
北陸電気工事	11,900	1,207.00	14,363,300	
ユアテック	38,300	1,463.00	56,032,900	
日本リーテック	13,600	1,112.00	15,123,200	
四電工	7,300	3,805.00	27,776,500	
中電工	27,000	3,180.00	85,860,000	
関電工	108,800	2,128.00	231,526,400	
きんでん	120,800	3,128.00	377,862,400	
東京エネシス	16,200	1,165.00	18,873,000	

トーエネック	5,800	4,875.00	28,275,000	
住友電設	16,500	3,480.00	57,420,000	
日本電設工業	32,600	1,839.00	59,951,400	
エクシオグループ	169,800	1,559.50	264,803,100	
新日本空調	11,300	3,445.00	38,928,500	
九電工	37,500	6,570.00	246,375,000	
三機工業	37,500	2,306.00	86,475,000	
日揮ホールディングス	171,900	1,325.00	227,767,500	
中外炉工業	5,700	2,781.00	15,851,700	
ヤマト	3,100	972.00	3,013,200	
太平電業	11,000	5,430.00	59,730,000	
高砂熱学工業	46,500	5,070.00	235,755,000	
三晃金属工業	500	4,255.00	2,127,500	
朝日工業社	16,200	1,344.00	21,772,800	
明星工業	33,600	1,271.00	42,705,600	
大気社	20,000	4,860.00	97,200,000	
ダイダン	22,800	2,959.00	67,465,200	
日比谷総合設備	12,600	3,480.00	43,848,000	
フィル・カンパニー	3,400	656.00	2,230,400	
テスホールディングス	37,400	302.00	11,294,800	
インフロニア・ホールディングス	200,200	1,219.00	244,043,800	
東洋エンジニアリング	25,500	726.00	18,513,000	
レイズネクスト	25,100	1,732.00	43,473,200	
ニッポン	52,200	2,295.00	119,799,000	
日清製粉グループ本社	161,300	1,905.50	307,357,150	
日東富士製粉	3,100	7,120.00	22,072,000	
昭和産業	16,400	3,045.00	49,938,000	
鳥越製粉	3,300	700.00	2,310,000	
中部飼料	24,100	1,545.00	37,234,500	
フィード・ワン	25,500	871.00	22,210,500	
東洋精糖	700	1,483.00	1,038,100	
日本甜菜製糖	10,200	2,538.00	25,887,600	
DM三井製糖ホールディングス	17,300	3,250.00	56,225,000	
塩水港精糖	4,900	269.00	1,318,100	
ウェルネオシュガー	8,700	2,228.00	19,383,600	
森永製菓	72,900	2,752.00	200,620,800	
中村屋	4,400	3,210.00	14,124,000	
江崎グリコ	49,900	4,191.00	209,130,900	
名糖産業	6,900	1,961.00	13,530,900	
井村屋グループ	10,400	2,506.00	26,062,400	
不二家	12,000	2,669.00	32,028,000	
山崎製パン	116,700	2,752.50	321,216,750	

第一屋製パン	800	617.00	493,600	
モロゾフ	5,600	4,590.00	25,704,000	
亀田製菓	10,000	4,400.00	44,000,000	
寿スピリッツ	82,500	1,729.00	142,642,500	
カルビー	79,800	3,227.00	257,514,600	
森永乳業	60,900	3,384.00	206,085,600	
六甲バター	12,800	1,434.00	18,355,200	
ヤクルト本社	249,200	3,034.00	756,072,800	
明治ホールディングス	213,800	3,604.00	770,535,200	
雪印メグミルク	42,200	2,688.00	113,433,600	
プリマハム	23,400	2,311.00	54,077,400	
日本ハム	75,000	5,479.00	410,925,000	
林兼産業	1,300	479.00	622,700	
丸大食品	17,600	1,800.00	31,680,000	
S Foods	19,200	2,707.00	51,974,400	
柿安本店	6,800	2,672.00	18,169,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	26,600	3,935.00	104,671,000	
サッポロホールディングス	57,400	7,360.00	422,464,000	
アサヒグループホールディングス	436,600	5,414.00	2,363,752,400	
キリンホールディングス	726,500	2,235.50	1,624,090,750	
宝ホールディングス	117,600	1,148.50	135,063,600	
オエノンホールディングス	56,500	406.00	22,939,000	
養命酒製造	5,700	2,339.00	13,332,300	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	123,000	2,086.00	256,578,000	
ライフドリンク カンパニー	3,500	7,360.00	25,760,000	
サントリー食品インターナショナル	122,800	5,238.00	643,226,400	
ダイドーグループホールディングス	19,800	2,763.00	54,707,400	
伊藤園	59,100	3,557.00	210,218,700	
キーコーヒー	19,500	2,118.00	41,301,000	
ユニカフェ	1,200	938.00	1,125,600	
日清オイリオグループ	24,600	5,060.00	124,476,000	
不二製油グループ本社	40,600	3,111.00	126,306,600	
かどや製油	500	3,645.00	1,822,500	
J-オイルミルズ	20,000	1,967.00	39,340,000	
キッコーマン	577,900	1,675.50	968,271,450	
味の素	409,900	5,614.00	2,301,178,600	
ブルドックソース	9,200	1,887.00	17,360,400	
キューピー	93,700	3,729.00	349,407,300	
ハウス食品グループ本社	60,100	2,940.50	176,724,050	
カゴメ	75,000	3,184.00	238,800,000	
アリアケジャパン	17,400	4,785.00	83,259,000	
ピエトロ	500	1,787.00	893,500	

エバラ食品工業	4,200	2,845.00	11,949,000	
やまみ	500	4,125.00	2,062,500	
ニチレイ	79,900	4,437.00	354,516,300	
東洋水産	88,100	9,579.00	843,909,900	
イトアンドホールディングス	8,300	1,984.00	16,467,200	
大冷	500	1,948.00	974,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	1,700.00	13,600,000	
日清食品ホールディングス	184,000	3,847.00	707,848,000	
一正蒲鉾	1,600	747.00	1,195,200	
フジッコ	17,900	1,694.00	30,322,600	
ロック・フィールド	21,300	1,529.00	32,567,700	
日本たばこ産業	1,059,800	4,199.00	4,450,100,200	
ケンコーマヨネーズ	12,000	2,424.00	29,088,000	
わらべや日洋ホールディングス	11,700	2,369.00	27,717,300	
なとり	11,000	2,104.00	23,144,000	
イフジ産業	700	1,443.00	1,010,100	
ファーマフーズ	23,100	986.00	22,776,600	
ユーグレナ	108,300	485.00	52,525,500	
紀文食品	15,100	1,168.00	17,636,800	
ピクルスホールディングス	10,200	1,040.00	10,608,000	
ミヨシ油脂	1,500	1,545.00	2,317,500	
理研ビタミン	15,100	2,612.00	39,441,200	
片倉工業	16,500	2,105.00	34,732,500	
グンゼ	12,700	5,530.00	70,231,000	
東洋紡	77,100	1,007.00	77,639,700	
ユニチカ	58,600	313.00	18,341,800	
富士紡ホールディングス	7,800	4,450.00	34,710,000	
倉敷紡績	12,700	4,820.00	61,214,000	
シキボウ	12,700	1,076.00	13,665,200	
日本毛織	45,800	1,348.00	61,738,400	
トーア紡コーポレーション	1,600	412.00	659,200	
帝国繊維	20,200	2,648.00	53,489,600	
帝人	170,700	1,355.50	231,383,850	
東レ	1,189,200	734.80	873,824,160	
住江織物	800	2,108.00	1,686,400	
日本フェルト	2,900	494.00	1,432,600	
イチカワ	700	1,699.00	1,189,300	
日東製網	400	1,493.00	597,200	
アツギ	2,700	760.00	2,052,000	
ダイニック	1,200	788.00	945,600	
セーレン	34,400	2,363.00	81,287,200	
ソトー	1,300	693.00	900,900	

東海染工	400	780.00	312,000	
小松マテーレ	25,800	712.00	18,369,600	
ワコールホールディングス	33,100	4,337.00	143,554,700	
ホギメディカル	23,400	4,400.00	102,960,000	
T S I ホールディングス	53,300	874.00	46,584,200	
マツオカコーポレーション	1,200	1,643.00	1,971,600	
ワールド	25,100	2,015.00	50,576,500	
三陽商会	8,400	2,400.00	20,160,000	
ナイガイ	1,500	239.00	358,500	
オンワードホールディングス	104,700	529.00	55,386,300	
ルックホールディングス	5,700	2,694.00	15,355,800	
ゴールドウイン	31,400	9,088.00	285,363,200	
デサント	30,600	4,345.00	132,957,000	
キング	1,500	744.00	1,116,000	
ヤマトインターナショナル	3,100	368.00	1,140,800	
特種東海製紙	9,500	3,685.00	35,007,500	
王子ホールディングス	739,100	581.10	429,491,010	
日本製紙	100,100	954.00	95,495,400	
三菱製紙	5,200	571.00	2,969,200	
北越コーポレーション	87,200	1,626.00	141,787,200	
中越パルプ工業	1,500	1,364.00	2,046,000	
大王製紙	78,400	881.20	69,086,080	
阿波製紙	1,000	478.00	478,000	
レンゴー	161,600	986.30	159,386,080	
トーモク	10,200	2,512.00	25,622,400	
ザ・バック	13,200	3,785.00	49,962,000	
北の達人コーポレーション	74,800	183.00	13,688,400	
クラレ	258,500	1,873.00	484,170,500	
旭化成	1,200,200	1,033.50	1,240,406,700	
共和レザー	2,200	718.00	1,579,600	
巴川コーポレーション	1,100	796.00	875,600	
レゾナック・ホールディングス	159,200	3,517.00	559,906,400	
住友化学	1,316,500	414.30	545,425,950	
住友精化	8,300	5,230.00	43,409,000	
日産化学	82,700	5,015.00	414,740,500	
ラサ工業	6,800	2,705.00	18,394,000	
クレハ	36,700	2,788.00	102,319,600	
多木化学	6,900	4,045.00	27,910,500	
テイカ	14,600	1,653.00	24,133,800	
石原産業	29,400	1,473.00	43,306,200	
片倉コープアグリ	900	1,057.00	951,300	
日本曹達	20,700	5,060.00	104,742,000	

東ソー	236,800	1,866.00	441,868,800	
トクヤマ	57,300	2,776.50	159,093,450	
セントラル硝子	18,900	3,510.00	66,339,000	
東亜合成	85,300	1,572.50	134,134,250	
大阪ソーダ	12,400	9,050.00	112,220,000	
関東電化工業	34,300	937.00	32,139,100	
デンカ	64,500	2,274.50	146,705,250	
信越化学工業	1,591,000	6,447.00	10,257,177,000	
日本カーバイド工業	9,400	1,760.00	16,544,000	
堺化学工業	13,500	2,626.00	35,451,000	
第一稀元素化学工業	19,400	835.00	16,199,000	
エア・ウォーター	167,400	2,011.50	336,725,100	
日本酸素ホールディングス	172,100	4,880.00	839,848,000	
日本化学工業	6,500	2,831.00	18,401,500	
東邦アセチレン	4,000	356.00	1,424,000	
日本パーカライジング	79,000	1,210.00	95,590,000	
高压ガス工業	25,800	897.00	23,142,600	
チタン工業	500	888.00	444,000	
四国化成ホールディングス	20,100	2,049.00	41,184,900	
戸田工業	4,000	1,789.00	7,156,000	
ステラ ケミファ	9,600	3,945.00	37,872,000	
保土谷化学工業	5,600	4,910.00	27,496,000	
日本触媒	103,300	1,700.50	175,661,650	
大日精化工業	12,300	3,085.00	37,945,500	
カネカ	43,700	3,757.00	164,180,900	
三菱瓦斯化学	129,500	2,687.00	347,966,500	
三井化学	146,300	3,786.00	553,891,800	
東京応化工業	84,600	3,648.00	308,620,800	
大阪有機化学工業	14,800	3,270.00	48,396,000	
三菱ケミカルグループ	1,297,000	834.80	1,082,735,600	
KHネオケム	32,000	2,073.00	66,336,000	
ダイセル	220,100	1,296.00	285,249,600	
住友ベークライト	49,700	3,777.00	187,716,900	
積水化学工業	353,300	2,215.00	782,559,500	
日本ゼオン	121,600	1,177.50	143,184,000	
アイカ工業	44,800	3,340.00	149,632,000	
UBE	84,400	2,653.00	223,913,200	
積水樹脂	26,500	2,431.00	64,421,500	
タキロンシーアイ	45,300	870.00	39,411,000	
旭有機材	11,800	4,130.00	48,734,000	
ニチバン	9,600	2,029.00	19,478,400	
リケンテクノス	33,200	1,005.00	33,366,000	

大倉工業	8,200	2,623.00	21,508,600	
積水化成成品工業	24,900	427.00	10,632,300	
群栄化学工業	4,200	2,774.00	11,650,800	
タイガースポリマー	1,700	802.00	1,363,400	
ミライアル	1,300	1,301.00	1,691,300	
ダイキアクシス	1,600	706.00	1,129,600	
ダイキョーニシカワ	39,200	692.00	27,126,400	
竹本容器	1,400	845.00	1,183,000	
森六ホールディングス	9,200	2,377.00	21,868,400	
恵和	11,500	1,182.00	13,593,000	
日本化薬	135,500	1,297.50	175,811,250	
カーリット	19,100	1,102.00	21,048,200	
日本精化	11,800	2,365.00	27,907,000	
扶桑化学工業	18,800	3,930.00	73,884,000	
トリケミカル研究所	21,500	3,685.00	79,227,500	
A D E K A	61,900	2,960.50	183,254,950	
日油	160,600	2,263.00	363,437,800	
新日本理化	5,300	189.00	1,001,700	
ハリマ化成グループ	13,800	902.00	12,447,600	
花王	432,000	6,501.00	2,808,432,000	
第一工業製薬	7,100	3,140.00	22,294,000	
石原ケミカル	7,900	2,408.00	19,023,200	
日華化学	1,500	1,244.00	1,866,000	
ニイタカ	800	1,882.00	1,505,600	
三洋化成工業	10,900	4,060.00	44,254,000	
有機合成薬品工業	3,100	281.00	871,100	
大日本塗料	19,700	1,139.00	22,438,300	
日本ペイントホールディングス	785,100	910.30	714,676,530	
関西ペイント	153,300	2,587.50	396,663,750	
神東塗料	3,200	136.00	435,200	
中国塗料	36,400	1,885.00	68,614,000	
日本特殊塗料	2,700	1,220.00	3,294,000	
藤倉化成	20,400	510.00	10,404,000	
太陽ホールディングス	30,900	3,560.00	110,004,000	
D I C	63,000	3,121.00	196,623,000	
サカタインクス	39,500	1,625.00	64,187,500	
a r t i e n c e	31,600	3,535.00	111,706,000	
富士フイルムホールディングス	988,700	3,846.00	3,802,540,200	
資生堂	370,900	3,343.00	1,239,918,700	
ライオン	226,100	1,488.00	336,436,800	
高砂香料工業	13,300	4,700.00	62,510,000	
マンダム	38,400	1,238.00	47,539,200	

ミルボン	28,500	3,027.00	86,269,500	
ファンケル	75,000	2,793.50	209,512,500	
コーセー	36,100	8,948.00	323,022,800	
コタ	18,000	1,680.00	30,240,000	
シーボン	500	1,316.00	658,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	91,100	1,471.00	134,008,100	
ノエビアホールディングス	15,800	5,680.00	89,744,000	
アジュバンホールディングス	900	845.00	760,500	
新日本製薬	10,100	1,811.00	18,291,100	
I－n e	5,900	1,827.00	10,779,300	
アクシージア	11,700	880.00	10,296,000	
エステー	13,700	1,565.00	21,440,500	
アグロ カネショウ	6,200	1,336.00	8,283,200	
コニシ	51,300	1,210.00	62,073,000	
長谷川香料	33,900	3,090.00	104,751,000	
小林製薬	46,500	5,367.00	249,565,500	
荒川化学工業	15,000	1,251.00	18,765,000	
メック	14,600	3,940.00	57,524,000	
日本高純度化学	4,000	3,230.00	12,920,000	
タカラバイオ	47,900	1,047.00	50,151,300	
J C U	19,600	3,570.00	69,972,000	
新田ゼラチン	2,600	879.00	2,285,400	
O A Tアグリオ	7,300	1,940.00	14,162,000	
デクセリアルズ	43,900	6,224.00	273,233,600	
アース製薬	16,200	5,090.00	82,458,000	
北興化学工業	15,900	1,421.00	22,593,900	
大成ラミック	5,100	2,694.00	13,739,400	
クミアイ化学工業	70,600	779.00	54,997,400	
日本農薬	32,600	635.00	20,701,000	
アキレス	11,200	1,510.00	16,912,000	
有沢製作所	31,100	1,516.00	47,147,600	
日東電工	114,100	11,650.00	1,329,265,000	
レック	22,800	1,311.00	29,890,800	
三光合成	22,400	591.00	13,238,400	
きもと	6,300	253.00	1,593,900	
藤森工業	14,000	4,475.00	62,650,000	
前澤化成工業	11,500	1,832.00	21,068,000	
未来工業	6,400	3,390.00	21,696,000	
ウェーブロックホールディングス	1,400	632.00	884,800	
J S P	12,500	2,016.00	25,200,000	
エフピコ	33,600	2,768.50	93,021,600	
天馬	11,800	2,710.00	31,978,000	

信越ポリマー	38,300	1,536.00	58,828,800	
東リ	8,500	374.00	3,179,000	
ニフコ	53,100	3,710.00	197,001,000	
パルカー	14,900	3,435.00	51,181,500	
ユニ・チャーム	370,100	5,137.00	1,901,203,700	
ショーエイコーポレーション	1,200	573.00	687,600	
協和キリン	214,600	3,310.00	710,326,000	
武田薬品工業	1,572,200	4,339.00	6,821,775,800	
アステラス製薬	1,558,200	1,814.50	2,827,353,900	
住友ファーマ	131,800	684.00	90,151,200	
塩野義製薬	216,100	6,690.00	1,445,709,000	
わかもと製薬	4,000	250.00	1,000,000	
日本新薬	46,500	3,572.00	166,098,000	
中外製薬	556,100	7,335.00	4,078,993,500	
科研製薬	30,400	4,113.00	125,035,200	
エーザイ	216,100	6,118.00	1,322,099,800	
ロート製薬	172,100	3,471.00	597,359,100	
小野薬品工業	363,300	2,181.50	792,538,950	
久光製薬	39,500	4,126.00	162,977,000	
持田製薬	19,900	3,340.00	66,466,000	
参天製薬	313,400	1,856.00	581,670,400	
扶桑薬品工業	6,300	2,256.00	14,212,800	
日本ケミファ	400	1,640.00	656,000	
ツムラ	55,900	4,049.00	226,339,100	
キッセイ薬品工業	29,400	3,510.00	103,194,000	
生化学工業	30,100	854.00	25,705,400	
栄研化学	30,600	2,274.00	69,584,400	
鳥居薬品	9,500	3,615.00	34,342,500	
J C Rファーマ	60,100	620.00	37,262,000	
東和薬品	27,300	2,891.00	78,924,300	
富士製薬工業	13,100	1,345.00	17,619,500	
ゼリア新薬工業	24,600	2,278.00	56,038,800	
ネクセラファーマ	83,400	1,717.00	143,197,800	
第一三共	1,547,500	5,980.00	9,254,050,000	
杏林製薬	38,500	1,634.00	62,909,000	
大幸薬品	40,200	429.00	17,245,800	
ダイト	13,500	2,418.00	32,643,000	
大塚ホールディングス	443,400	8,639.00	3,830,532,600	
ペプチドリーム	86,100	2,625.00	226,012,500	
セルソース	11,800	1,533.00	18,089,400	
あすか製薬ホールディングス	18,200	2,319.00	42,205,800	
サワイグループホールディングス	40,600	6,211.00	252,166,600	

日本コークス工業	180,200	102.00	18,380,400	
ニチレキ	23,100	2,470.00	57,057,000	
ユシロ化学工業	9,200	1,687.00	15,520,400	
ビーピー・カストロール	1,800	900.00	1,620,000	
富士石油	51,800	400.00	20,720,000	
MORESCO	1,400	1,261.00	1,765,400	
出光興産	922,400	1,056.00	974,054,400	
ENEOSホールディングス	2,812,300	777.50	2,186,563,250	
コスモエネルギーホールディングス	52,700	8,061.00	424,814,700	
横浜ゴム	89,800	3,322.00	298,315,600	
TOYO TIRE	102,100	2,137.50	218,238,750	
ブリヂストン	520,000	5,702.00	2,965,040,000	
住友ゴム工業	174,200	1,471.00	256,248,200	
藤倉コンポジット	17,100	1,205.00	20,605,500	
オカモト	8,300	4,990.00	41,417,000	
フコク	9,300	1,860.00	17,298,000	
ニッタ	18,000	3,760.00	67,680,000	
住友理工	27,600	1,459.00	40,268,400	
三ツ星ベルト	20,600	4,185.00	86,211,000	
バンドー化学	26,400	1,805.00	47,652,000	
日東紡績	22,500	5,580.00	125,550,000	
AGC	172,800	4,638.00	801,446,400	
日本板硝子	84,800	360.00	30,528,000	
石塚硝子	700	2,530.00	1,771,000	
日本山村硝子	1,400	1,521.00	2,129,400	
日本電気硝子	65,900	3,419.00	225,312,100	
オハラ	8,400	1,386.00	11,642,400	
住友大阪セメント	29,600	3,880.00	114,848,000	
太平洋セメント	101,800	3,316.00	337,568,800	
日本ヒューム	15,600	1,211.00	18,891,600	
日本コンクリート工業	34,500	366.00	12,627,000	
三谷セキサン	7,500	5,590.00	41,925,000	
アジアパイルホールディングス	25,300	859.00	21,732,700	
東海カーボン	163,900	890.90	146,018,510	
日本カーボン	10,200	4,440.00	45,288,000	
東洋炭素	12,500	5,710.00	71,375,000	
ノリタケ	19,700	3,910.00	77,027,000	
TOTO	117,200	4,966.00	582,015,200	
日本碍子	206,600	1,926.00	397,911,600	
日本特殊陶業	148,800	4,215.00	627,192,000	
MARUWA	6,600	37,900.00	250,140,000	
品川リフラクトリーズ	21,900	1,735.00	37,996,500	

黒崎播磨	14,500	2,202.00	31,929,000	
ヨータイ	10,400	1,749.00	18,189,600	
東京窯業	4,100	432.00	1,771,200	
ニッカトー	1,700	549.00	933,300	
フジミインコーポレーテッド	47,800	2,487.00	118,878,600	
クニミネ工業	1,100	1,031.00	1,134,100	
エーアンドエーマテリアル	800	1,244.00	995,200	
ニチアス	44,900	5,460.00	245,154,000	
ニチハ	22,300	3,495.00	77,938,500	
日本製鉄	840,400	3,302.00	2,775,000,800	
神戸製鋼所	367,500	1,766.00	649,005,000	
中山製鋼所	41,800	848.00	35,446,400	
合同製鐵	10,200	4,420.00	45,084,000	
J F Eホールディングス	508,200	1,980.50	1,006,490,100	
東京製鐵	51,400	1,984.00	101,977,600	
共英製鋼	20,800	1,763.00	36,670,400	
大和工業	34,400	7,213.00	248,127,200	
東京鐵鋼	8,100	5,180.00	41,958,000	
大阪製鐵	8,400	3,065.00	25,746,000	
淀川製鋼所	19,000	5,630.00	106,970,000	
中部鋼鈹	12,000	2,447.00	29,364,000	
丸一鋼管	55,600	3,463.00	192,542,800	
モリ工業	4,600	5,380.00	24,748,000	
大同特殊鋼	115,100	1,426.00	164,132,600	
日本高周波鋼業	1,600	410.00	656,000	
日本冶金工業	13,300	4,395.00	58,453,500	
山陽特殊製鋼	18,100	1,933.00	34,987,300	
愛知製鋼	10,500	3,200.00	33,600,000	
日本金属	1,000	716.00	716,000	
大平洋金属	15,600	1,398.00	21,808,800	
新日本電工	109,200	294.00	32,104,800	
栗本鐵工所	8,500	4,355.00	37,017,500	
虹技	500	1,079.00	539,500	
三菱製鋼	13,500	1,459.00	19,696,500	
日亜鋼業	4,100	306.00	1,254,600	
日本精線	14,500	1,108.00	16,066,000	
エンビプロ・ホールディングス	18,000	504.00	9,072,000	
シンニッタン	5,000	217.00	1,085,000	
新家工業	900	5,080.00	4,572,000	
大紀アルミニウム工業所	23,600	1,125.00	26,550,000	
日本輕金属ホールディングス	53,700	1,642.00	88,175,400	
三井金属鋳業	53,300	4,619.00	246,192,700	

三菱マテリアル	130,900	2,567.50	336,085,750	
住友金属鉱山	212,000	4,108.00	870,896,000	
DOWAホールディングス	45,300	5,065.00	229,444,500	
古河機械金属	24,500	1,585.00	38,832,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	31,900	2,527.00	80,611,300	
東邦チタニウム	38,200	1,225.00	46,795,000	
U A C J	25,700	4,870.00	125,159,000	
C Kサンエツ	4,600	3,320.00	15,272,000	
古河電気工業	61,000	3,402.00	207,522,000	
住友電気工業	683,900	2,328.00	1,592,119,200	
フジクラ	215,700	3,989.00	860,427,300	
SWC C	20,500	4,875.00	99,937,500	
カナレ電気	1,000	1,438.00	1,438,000	
平河ヒューテック	12,000	1,440.00	17,280,000	
リョービ	19,800	1,993.00	39,461,400	
アーレスティ	4,900	644.00	3,155,600	
A R Eホールディングス	69,000	1,844.00	127,236,000	
稲葉製作所	10,100	1,710.00	17,271,000	
宮地エンジニアリンググループ	9,200	4,360.00	40,112,000	
トーカロ	52,700	1,837.00	96,809,900	
アルファ C o	1,400	1,209.00	1,692,600	
S U M C O	347,900	1,694.50	589,516,550	
川田テクノロジーズ	13,000	2,765.00	35,945,000	
R S T e c h n o l o g i e s	14,000	3,420.00	47,880,000	
ジェイテックコーポレーション	700	1,523.00	1,066,100	
信和	2,500	773.00	1,932,500	
東洋製罐グループホールディングス	104,800	2,298.00	240,830,400	
ホッカンホールディングス	8,900	1,708.00	15,201,200	
コロナ	10,200	943.00	9,618,600	
横河ブリッジホールディングス	28,600	2,720.00	77,792,000	
駒井ハルテック	700	1,693.00	1,185,100	
高田機工	300	3,360.00	1,008,000	
三和ホールディングス	182,000	3,257.00	592,774,000	
文化シャッター	47,800	1,772.00	84,701,600	
三協立山	23,000	750.00	17,250,000	
アルインコ	13,900	1,005.00	13,969,500	
東洋シャッター	900	857.00	771,300	
L I X I L	285,400	1,735.00	495,169,000	
日本ファイルコン	2,600	517.00	1,344,200	
ノーリツ	25,700	1,886.00	48,470,200	
長府製作所	20,400	2,014.00	41,085,600	
リンナイ	87,400	3,288.00	287,371,200	

ダイニチ工業	2,000	643.00	1,286,000	
日東精工	26,500	581.00	15,396,500	
三洋工業	500	2,749.00	1,374,500	
岡部	32,600	751.00	24,482,600	
ジーテクト	23,300	1,667.00	38,841,100	
東プレ	32,200	1,877.00	60,439,400	
高周波熱錬	27,100	1,058.00	28,671,800	
東京製鋼	11,900	1,111.00	13,220,900	
サンコール	20,300	386.00	7,835,800	
モリテック スチール	3,500	199.00	696,500	
パイオラックス	22,100	2,367.00	52,310,700	
エイチワン	18,800	911.00	17,126,800	
日本発條	161,700	1,623.00	262,439,100	
中央発條	13,500	1,160.00	15,660,000	
アドバネクス	500	910.00	455,000	
立川ブラインド工業	8,300	1,276.00	10,590,800	
日本ドライケミカル	900	2,701.00	2,430,900	
日本製鋼所	49,300	4,359.00	214,898,700	
三浦工業	74,700	3,318.00	247,854,600	
タクマ	60,500	1,618.00	97,889,000	
ツガミ	38,200	1,417.00	54,129,400	
オークマ	15,700	6,084.00	95,518,800	
芝浦機械	16,800	3,675.00	61,740,000	
アマダ	271,200	1,492.00	404,630,400	
アイダエンジニアリング	41,500	789.00	32,743,500	
F U J I	84,200	2,437.00	205,195,400	
牧野フライス製作所	19,800	5,710.00	113,058,000	
オーエスジー	78,900	2,027.00	159,930,300	
ダイジェット工業	400	749.00	299,600	
旭ダイヤモンド工業	41,300	878.00	36,261,400	
DMG森精機	112,800	3,338.00	376,526,400	
ソディック	47,200	751.00	35,447,200	
ディスコ	86,100	42,250.00	3,637,725,000	
日東工器	8,300	2,470.00	20,501,000	
日進工具	16,600	784.00	13,014,400	
パンチ工業	3,900	448.00	1,747,200	
富士ダイス	13,300	769.00	10,227,700	
豊和工業	2,100	812.00	1,705,200	
リケンNPR	19,400	2,426.00	47,064,400	
東洋機械金属	3,200	675.00	2,160,000	
エンシュウ	1,000	639.00	639,000	
島精機製作所	28,500	1,419.00	40,441,500	

オプトラン	29,400	1,774.00	52,155,600	
イワキポンプ	11,900	2,900.00	34,510,000	
フリュー	16,900	1,016.00	17,170,400	
ヤマシンフィルタ	42,600	428.00	18,232,800	
日阪製作所	19,500	1,057.00	20,611,500	
やまびこ	29,200	2,283.00	66,663,600	
野村マイクロ・サイエンス	24,200	2,753.00	66,622,600	
平田機工	8,600	5,270.00	45,322,000	
P E G A S U S	19,800	506.00	10,018,800	
マルマエ	7,800	1,518.00	11,840,400	
タツモ	12,800	3,440.00	44,032,000	
ナブテスコ	112,300	2,477.50	278,223,250	
三井海洋開発	22,600	3,000.00	67,800,000	
レオン自動機	20,700	1,408.00	29,145,600	
SMC	53,500	66,390.00	3,551,865,000	
ホソカワミクロン	12,500	4,295.00	53,687,500	
ユニオンツール	7,900	5,520.00	43,608,000	
瑞光	12,900	1,202.00	15,505,800	
オイレス工業	24,300	2,162.00	52,536,600	
日精エー・エス・ビー機械	6,100	4,980.00	30,378,000	
サトーホールディングス	24,500	2,044.00	50,078,000	
技研製作所	16,800	1,808.00	30,374,400	
日本エアータック	8,400	1,170.00	9,828,000	
カワタ	1,200	877.00	1,052,400	
日精樹脂工業	13,300	947.00	12,595,100	
オカダアイヨン	1,300	2,103.00	2,733,900	
ワイエイシイホールディングス	8,400	2,102.00	17,656,800	
小松製作所	838,500	4,017.00	3,368,254,500	
住友重機械工業	105,800	3,402.00	359,931,600	
日立建機	71,300	3,481.00	248,195,300	
日工	26,600	721.00	19,178,600	
巴工業	7,000	4,070.00	28,490,000	
井関農機	16,800	1,005.00	16,884,000	
T O W A	19,900	7,250.00	144,275,000	
丸山製作所	700	2,454.00	1,717,800	
北川鉄工所	7,100	1,313.00	9,322,300	
ローツェ	9,300	21,650.00	201,345,000	
タカキタ	1,300	442.00	574,600	
クボタ	935,300	2,058.50	1,925,315,050	
荏原実業	8,600	3,780.00	32,508,000	
三菱化工機	6,300	3,515.00	22,144,500	
月島ホールディングス	24,200	1,360.00	32,912,000	

帝国電機製作所	12,300	2,587.00	31,820,100	
新東工業	36,200	1,031.00	37,322,200	
澁谷工業	16,800	3,545.00	59,556,000	
アイチ コーポレーション	24,700	1,115.00	27,540,500	
小森コーポレーション	44,100	1,148.00	50,626,800	
鶴見製作所	13,700	3,735.00	51,169,500	
日本ギア工業	1,500	451.00	676,500	
酒井重工業	3,500	4,875.00	17,062,500	
荏原製作所	367,200	1,955.00	717,876,000	
石井鐵工所	500	8,340.00	4,170,000	
西島製作所	15,400	2,744.00	42,257,600	
北越工業	18,000	1,920.00	34,560,000	
ダイキン工業	213,600	18,550.00	3,962,280,000	
オルガノ	21,500	6,540.00	140,610,000	
トーヨーカネツ	6,100	4,075.00	24,857,500	
栗田工業	100,100	5,856.00	586,185,600	
椿本チエイン	24,600	5,880.00	144,648,000	
大同工業	1,700	798.00	1,356,600	
木村化工機	13,600	726.00	9,873,600	
アネスト岩田	27,700	1,261.00	34,929,700	
ダイフク	301,900	2,772.00	836,866,800	
サムコ	4,300	3,935.00	16,920,500	
加藤製作所	2,000	1,276.00	2,552,000	
油研工業	700	2,243.00	1,570,100	
タダノ	103,000	964.60	99,353,800	
フジテック	41,800	4,665.00	194,997,000	
C K D	49,500	2,836.00	140,382,000	
平和	52,900	2,084.00	110,243,600	
理想科学工業	14,300	3,435.00	49,120,500	
SANKYO	172,200	2,046.00	352,321,200	
日本金銭機械	21,600	1,008.00	21,772,800	
マースグループホールディングス	9,000	3,575.00	32,175,000	
フクシマガリレイ	11,700	5,520.00	64,584,000	
オーイズミ	1,500	374.00	561,000	
ダイコク電機	8,800	3,390.00	29,832,000	
竹内製作所	32,500	4,195.00	136,337,500	
アマノ	50,800	4,413.00	224,180,400	
JUK I	27,800	410.00	11,398,000	
ジャノメ	18,100	837.00	15,149,700	
マックス	25,200	3,535.00	89,082,000	
グローリー	43,000	2,571.00	110,553,000	
新晃工業	18,000	4,270.00	76,860,000	

大和冷機工業	27,400	1,461.00	40,031,400	
セガサミーホールディングス	159,800	2,517.50	402,296,500	
T P R	22,700	2,280.00	51,756,000	
ツバキ・ナカシマ	44,100	705.00	31,090,500	
ホシザキ	115,200	4,730.00	544,896,000	
大豊工業	15,500	641.00	9,935,500	
日本精工	331,200	751.70	248,963,040	
N T N	388,000	267.60	103,828,800	
ジェイテクト	159,200	1,112.50	177,110,000	
不二越	13,200	3,090.00	40,788,000	
日本トムソン	48,700	510.00	24,837,000	
THK	103,200	2,658.50	274,357,200	
ユーシン精機	14,200	655.00	9,301,000	
前澤給装工業	12,800	1,329.00	17,011,200	
イーグル工業	19,800	2,000.00	39,600,000	
前澤工業	2,400	1,333.00	3,199,200	
P I L L A R	16,600	4,360.00	72,376,000	
キット	59,900	1,016.00	60,858,400	
マキタ	204,000	4,755.00	970,020,000	
三井E & S	88,800	1,278.00	113,486,400	
日立造船	157,900	954.00	150,636,600	
三菱重工業	3,128,400	1,897.50	5,936,139,000	
I H I	133,200	5,997.00	798,800,400	
スター精密	30,200	1,948.00	58,829,600	
日清紡ホールディングス	134,500	976.00	131,272,000	
イビデン	93,300	5,188.00	484,040,400	
コニカミノルタ	400,200	437.70	175,167,540	
ブラザー工業	239,100	2,706.00	647,004,600	
ミネベアミツミ	311,200	3,103.00	965,653,600	
日立製作所	4,296,900	3,455.00	14,845,789,500	
三菱電機	1,959,500	2,317.50	4,541,141,250	
富士電機	108,800	8,479.00	922,515,200	
東洋電機製造	1,400	1,145.00	1,603,000	
安川電機	194,300	4,893.00	950,709,900	
シンフォニアテクノロジー	19,700	4,015.00	79,095,500	
明電舎	33,200	3,290.00	109,228,000	
オリジン	900	1,206.00	1,085,400	
山洋電気	7,800	8,740.00	68,172,000	
デンヨー	13,600	2,613.00	35,536,800	
PHCホールディングス	33,700	1,169.00	39,395,300	
KOKUSAI ELECTRIC	93,400	3,985.00	372,199,000	
ソシオネクスト	130,500	3,178.00	414,729,000	

東芝テック	22,900	3,450.00	79,005,000	
芝浦メカトロニクス	10,200	8,300.00	84,660,000	
マブチモーター	78,600	2,174.00	170,876,400	
ニデック	395,000	6,085.00	2,403,575,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,800	399.00	4,708,200	
トレックス・セミコンダクター	9,300	1,628.00	15,140,400	
東光高岳	10,900	1,790.00	19,511,000	
ダブル・スコープ	51,200	451.00	23,091,200	
ダイヘン	17,000	6,300.00	107,100,000	
ヤーマン	35,100	863.00	30,291,300	
J V C ケンウッド	141,400	1,235.00	174,629,000	
ミマキエンジニアリング	17,100	1,625.00	27,787,500	
I - P E X	10,100	1,736.00	17,533,600	
大崎電気工業	38,400	678.00	26,035,200	
オムロン	136,600	5,957.00	813,726,200	
日東工業	24,100	3,140.00	75,674,000	
I D E C	26,400	2,698.00	71,227,200	
正興電機製作所	1,400	1,333.00	1,866,200	
不二電機工業	900	1,068.00	961,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	69,900	2,758.50	192,819,150	
サクサ	900	2,436.00	2,192,400	
メルコホールディングス	5,700	3,385.00	19,294,500	
テクノメディカ	4,500	1,885.00	8,482,500	
日本電気	234,900	12,220.00	2,870,478,000	
富士通	1,646,200	2,590.00	4,263,658,000	
沖電気工業	80,900	1,033.00	83,569,700	
岩崎通信機	1,800	1,534.00	2,761,200	
電気興業	7,200	2,169.00	15,616,800	
サンケン電気	16,600	6,949.00	115,353,400	
ナカヨ	600	1,177.00	706,200	
アイホン	9,700	2,894.00	28,071,800	
ルネサスエレクトロニクス	1,363,000	2,450.00	3,339,350,000	
セイコーエプソン	229,500	2,696.00	618,732,000	
ワコム	126,100	705.00	88,900,500	
アルバック	39,200	7,999.00	313,560,800	
アクセル	9,100	1,277.00	11,620,700	
E I Z O	13,100	4,565.00	59,801,500	
日本信号	40,700	987.00	40,170,900	
京三製作所	37,500	520.00	19,500,000	
能美防災	24,300	2,392.00	58,125,600	
ホーチキ	13,500	2,292.00	30,942,000	
星和電機	2,000	529.00	1,058,000	

エレコム	42,900	1,459.00	62,591,100	
パナソニック ホールディングス	2,113,400	1,186.00	2,506,492,400	
シャープ	301,600	992.60	299,368,160	
アンリツ	126,000	1,184.50	149,247,000	
富士通ゼネラル	50,700	1,879.00	95,265,300	
ソニーグループ	1,239,800	14,095.00	17,474,981,000	
T D K	283,300	9,487.00	2,687,667,100	
帝国通信工業	7,900	2,442.00	19,291,800	
タムラ製作所	71,300	643.00	45,845,900	
アルプスアルパイン	159,900	1,529.50	244,567,050	
池上通信機	1,200	703.00	843,600	
日本電波工業	21,700	1,125.00	24,412,500	
鈴木	9,700	1,710.00	16,587,000	
メイコー	17,800	5,640.00	100,392,000	
日本トリム	4,100	3,650.00	14,965,000	
フォスター電機	13,200	1,538.00	20,301,600	
S M K	4,800	2,316.00	11,116,800	
ヨコオ	16,000	1,648.00	26,368,000	
ホシデン	40,800	2,089.00	85,231,200	
ヒロセ電機	26,000	19,125.00	497,250,000	
日本航空電子工業	42,800	2,564.00	109,739,200	
T O A	20,300	947.00	19,224,100	
マクセル	39,700	1,722.00	68,363,400	
古野電気	23,400	1,755.00	41,067,000	
スミダコーポレーション	24,400	941.00	22,960,400	
アイコム	6,900	2,738.00	18,892,200	
リオン	7,500	2,139.00	16,042,500	
横河電機	195,700	4,063.00	795,129,100	
新電元工業	6,800	2,513.00	17,088,400	
アズビル	121,800	4,696.00	571,972,800	
東亜ディーケーケー	2,000	845.00	1,690,000	
日本光電工業	152,100	1,971.50	299,865,150	
チノー	7,400	2,327.00	17,219,800	
共和電業	3,900	411.00	1,602,900	
日本電子材料	10,900	2,814.00	30,672,600	
堀場製作所	33,600	9,539.00	320,510,400	
アドバンテスト	507,500	6,381.00	3,238,357,500	
小野測器	2,100	604.00	1,268,400	
エスベック	14,300	2,508.00	35,864,400	
キーエンス	177,100	70,060.00	12,407,626,000	
日置電機	9,300	8,100.00	75,330,000	
シスメックス	458,600	2,794.00	1,281,328,400	

日本マイクロニクス	29,200	4,600.00	134,320,000	
メガチップス	13,700	4,770.00	65,349,000	
OBARA GROUP	11,100	4,125.00	45,787,500	
澤藤電機	600	1,129.00	677,400	
原田工業	2,000	546.00	1,092,000	
コーセル	19,100	1,224.00	23,378,400	
イリソ電子工業	16,400	2,696.00	44,214,400	
オブテックスグループ	32,700	1,736.00	56,767,200	
千代田インテグレ	6,200	3,510.00	21,762,000	
レーザーテック	81,200	28,735.00	2,333,282,000	
スタンレー電気	113,500	2,790.50	316,721,750	
ウシオ電機	78,400	2,087.00	163,620,800	
岡谷電機産業	3,700	237.00	876,900	
ヘリオス テクノ ホールディング	4,100	899.00	3,685,900	
エノモト	1,200	1,495.00	1,794,000	
日本セラミック	16,300	2,529.00	41,222,700	
遠藤照明	1,800	1,278.00	2,300,400	
古河電池	13,200	1,385.00	18,282,000	
山一電機	16,000	2,775.00	44,400,000	
図研	14,800	3,510.00	51,948,000	
日本電子	44,400	6,483.00	287,845,200	
カシオ計算機	128,000	1,165.00	149,120,000	
ファナック	857,100	4,208.00	3,606,676,800	
日本シイエムケイ	42,100	453.00	19,071,300	
エンプラス	5,200	7,710.00	40,092,000	
大真空	26,800	626.00	16,776,800	
ローム	321,100	1,802.00	578,622,200	
浜松ホトニクス	142,200	3,898.00	554,295,600	
三井ハイテック	78,700	1,052.00	82,792,400	
新光電気工業	62,700	5,624.00	352,624,800	
京セラ	1,100,700	1,755.50	1,932,278,850	
太陽誘電	86,300	3,429.00	295,922,700	
村田製作所	1,582,300	2,875.00	4,549,112,500	
双葉電子工業	34,200	529.00	18,091,800	
北陸電気工業	1,600	1,394.00	2,230,400	
ニチコン	46,800	967.00	45,255,600	
日本ケミコン	19,000	1,211.00	23,009,000	
KOA	27,000	1,241.00	33,507,000	
市光工業	32,500	441.00	14,332,500	
小糸製作所	183,600	2,105.50	386,569,800	
ミツバ	33,200	1,014.00	33,664,800	
SCREENホールディングス	60,600	11,085.00	671,751,000	

キヤノン電子	16,900	2,274.00	38,430,600	
キヤノン	883,400	5,014.00	4,429,367,600	
リコー	444,100	1,490.50	661,931,050	
象印マホービン	53,100	1,543.00	81,933,300	
MU TO Hホールディングス	600	2,490.00	1,494,000	
東京エレクトロン	374,900	26,190.00	9,818,631,000	
イノテック	12,000	1,539.00	18,468,000	
トヨタ紡織	74,600	1,922.50	143,418,500	
芦森工業	800	2,334.00	1,867,200	
ユニプレス	31,800	1,197.00	38,064,600	
豊田自動織機	151,100	11,545.00	1,744,449,500	
モリタホールディングス	31,100	1,830.00	56,913,000	
三櫻工業	27,100	818.00	22,167,800	
デンソー	1,461,300	2,248.50	3,285,733,050	
東海理化電機製作所	49,900	1,961.00	97,853,900	
川崎重工業	144,600	4,909.00	709,841,400	
名村造船所	55,100	1,587.00	87,443,700	
日本車輛製造	5,800	2,136.00	12,388,800	
三菱ロジスネクスト	28,300	1,311.00	37,101,300	
近畿車輛	500	1,587.00	793,500	
日産自動車	2,330,500	427.70	996,754,850	
いすゞ自動車	497,300	2,178.50	1,083,368,050	
トヨタ自動車	9,411,400	2,746.50	25,848,410,100	
日野自動車	266,400	444.20	118,334,880	
三菱自動車工業	691,000	411.30	284,208,300	
エフテック	2,700	544.00	1,468,800	
レシップホールディングス	1,800	590.00	1,062,000	
GMB	800	1,178.00	942,400	
ファルテック	800	474.00	379,200	
武蔵精密工業	43,300	2,084.00	90,237,200	
日産車体	17,900	982.00	17,577,800	
新明和工業	51,000	1,318.00	67,218,000	
極東開発工業	29,300	2,664.00	78,055,200	
トピー工業	14,400	2,022.00	29,116,800	
ティラド	3,900	3,690.00	14,391,000	
曙ブレーキ工業	108,100	140.00	15,134,000	
タチエス	32,700	1,944.00	63,568,800	
NOK	68,800	2,276.00	156,588,800	
フタバ産業	47,500	717.00	34,057,500	
カヤバ	16,700	4,710.00	78,657,000	
大同メタル工業	34,700	514.00	17,835,800	
プレス工業	70,800	603.00	42,692,400	

ミクニ	4,900	374.00	1,832,600	
太平洋工業	40,600	1,419.00	57,611,400	
アイシン	136,600	4,994.00	682,180,400	
マツダ	585,900	1,211.50	709,817,850	
今仙電機製作所	2,500	575.00	1,437,500	
本田技研工業	4,196,600	1,572.00	6,597,055,200	
スズキ	1,301,200	1,679.50	2,185,365,400	
S U B A R U	549,300	2,729.00	1,499,039,700	
安永	1,700	676.00	1,149,200	
ヤマハ発動機	765,500	1,258.50	963,381,750	
T B K	4,300	304.00	1,307,200	
エクセディ	29,000	3,015.00	87,435,000	
豊田合成	50,700	2,560.00	129,792,000	
愛三工業	29,400	1,454.00	42,747,600	
盟和産業	600	1,118.00	670,800	
日本プラスト	3,300	392.00	1,293,600	
ヨロズ	16,600	1,125.00	18,675,000	
エフ・シー・シー	31,400	2,317.00	72,753,800	
シマノ	77,300	27,500.00	2,125,750,000	
テイ・エス テック	63,100	1,864.00	117,618,400	
ジャムコ	10,700	1,313.00	14,049,100	
テルモ	987,400	2,763.00	2,728,186,200	
クリエートメディック	1,200	976.00	1,171,200	
日機装	45,800	1,014.00	46,441,200	
日本エム・ディ・エム	14,000	780.00	10,920,000	
島津製作所	235,300	4,882.00	1,148,734,600	
J M S	16,400	507.00	8,314,800	
長野計器	12,900	2,739.00	35,333,100	
ブイ・テクノロジー	9,300	2,811.00	26,142,300	
東京計器	13,600	2,843.00	38,664,800	
愛知時計電機	7,700	2,016.00	15,523,200	
インターアクション	10,700	1,270.00	13,589,000	
オーバル	3,400	400.00	1,360,000	
東京精密	36,300	8,220.00	298,386,000	
マニー	70,900	2,020.00	143,218,000	
ニコン	256,100	1,574.50	403,229,450	
トプコン	86,100	1,550.00	133,455,000	
オリンパス	1,014,100	2,678.50	2,716,266,850	
理研計器	25,100	4,170.00	104,667,000	
タムロン	24,400	4,485.00	109,434,000	
H O Y A	348,700	20,750.00	7,235,525,000	
シード	2,300	520.00	1,196,000	

ノーリツ銅機	16,800	4,090.00	68,712,000	
A & Dホロンホールディングス	25,800	2,487.00	64,164,600	
朝日インテック	215,900	2,691.00	580,986,900	
シチズン時計	162,900	926.00	150,845,400	
リズム	900	3,985.00	3,586,500	
大研医器	3,300	535.00	1,765,500	
メニコン	60,900	1,328.00	80,875,200	
シンシア	400	406.00	162,400	
松風	8,000	5,140.00	41,120,000	
セイコーグループ	24,700	3,965.00	97,935,500	
ニプロ	147,600	1,292.00	190,699,200	
KYORITSU	5,700	159.00	906,300	
中本パックス	1,300	1,630.00	2,119,000	
パラマウントベッドホールディングス	36,800	2,598.00	95,606,400	
トランザクション	11,700	1,903.00	22,265,100	
粧美堂	1,000	547.00	547,000	
ニホンフラッシュ	16,600	921.00	15,288,600	
前田工繊	31,600	1,646.00	52,013,600	
永大産業	4,500	220.00	990,000	
アートネイチャー	15,900	810.00	12,879,000	
フルヤ金属	16,800	4,140.00	69,552,000	
バンダイナムコホールディングス	480,900	3,145.00	1,512,430,500	
アイフィスジャパン	1,100	572.00	629,200	
SHOEI	49,800	2,353.00	117,179,400	
フランスベッドホールディングス	22,900	1,201.00	27,502,900	
パイロットコーポレーション	27,700	4,334.00	120,051,800	
萩原工業	11,800	1,620.00	19,116,000	
フジシールインターナショナル	35,900	2,220.00	79,698,000	
タカラトミー	80,600	3,307.00	266,544,200	
広済堂ホールディングス	57,300	459.00	26,300,700	
エステールホールディングス	900	630.00	567,000	
タカノ	1,400	844.00	1,181,600	
プロネクス	18,400	1,250.00	23,000,000	
ホクシン	2,900	110.00	319,000	
ウッドワン	1,400	815.00	1,141,000	
TOPPANホールディングス	211,100	4,231.00	893,164,100	
大日本印刷	183,600	5,033.00	924,058,800	
共同印刷	5,000	3,560.00	17,800,000	
NISSHA	30,300	2,034.00	61,630,200	
光村印刷	300	1,567.00	470,100	
TAKARA & COMPANY	10,500	2,920.00	30,660,000	
アシックス	654,000	2,722.00	1,780,188,000	

ツツミ	4,100	2,247.00	9,212,700	
ローランド	13,100	3,800.00	49,780,000	
小松ウオール工業	7,200	3,065.00	22,068,000	
ヤマハ	107,900	3,428.00	369,881,200	
河合楽器製作所	5,400	2,751.00	14,855,400	
クリナップ	17,400	730.00	12,702,000	
ピジョン	112,800	1,584.00	178,675,200	
キングジム	15,600	869.00	13,556,400	
リンテック	35,600	3,150.00	112,140,000	
イトーキ	35,400	1,383.00	48,958,200	
任天堂	1,118,200	7,967.00	8,908,699,400	
三菱鉛筆	24,500	2,307.00	56,521,500	
タカラスタANDARD	36,200	1,595.00	57,739,000	
コクヨ	88,600	2,434.00	215,652,400	
ナカバヤシ	19,100	530.00	10,123,000	
グローブライド	15,900	1,917.00	30,480,300	
オカムラ	53,300	1,993.00	106,226,900	
美津濃	17,600	9,810.00	172,656,000	
東京電力ホールディングス	1,596,600	676.60	1,080,259,560	
中部電力	652,700	1,794.50	1,171,270,150	
関西電力	683,900	2,529.00	1,729,583,100	
中国電力	307,700	1,006.00	309,546,200	
北陸電力	181,100	966.00	174,942,600	
東北電力	466,300	1,272.50	593,366,750	
四国電力	164,900	1,279.00	210,907,100	
九州電力	408,300	1,506.50	615,103,950	
北海道電力	171,100	985.00	168,533,500	
沖縄電力	45,200	1,085.00	49,042,000	
電源開発	145,500	2,470.50	359,457,750	
エフオン	12,900	388.00	5,005,200	
イーレックス	31,500	801.00	25,231,500	
レノバ	47,300	1,010.00	47,773,000	
東京瓦斯	344,800	3,583.00	1,235,418,400	
大阪瓦斯	353,000	3,516.00	1,241,148,000	
東邦瓦斯	76,700	4,345.00	333,261,500	
北海道瓦斯	10,600	3,090.00	32,754,000	
広島ガス	37,400	385.00	14,399,000	
西部ガスホールディングス	18,500	1,933.00	35,760,500	
静岡ガス	40,400	1,100.00	44,440,000	
メタウォーター	21,200	1,781.00	37,757,200	
SBSホールディングス	15,800	2,644.00	41,775,200	
東武鉄道	194,600	2,482.00	482,997,200	

相鉄ホールディングス	63,400	2,453.50	155,551,900	
東急	496,700	1,773.00	880,649,100	
京浜急行電鉄	219,200	1,158.50	253,943,200	
小田急電鉄	292,900	1,677.50	491,339,750	
京王電鉄	85,100	3,607.00	306,955,700	
京成電鉄	114,200	4,519.00	516,069,800	
富士急行	21,800	2,770.00	60,386,000	
東日本旅客鉄道	976,200	2,835.00	2,767,527,000	
西日本旅客鉄道	420,200	2,788.50	1,171,727,700	
東海旅客鉄道	682,200	3,382.00	2,307,200,400	
西武ホールディングス	214,200	2,951.00	632,104,200	
鴻池運輸	30,200	2,378.00	71,815,600	
西日本鉄道	47,300	2,420.50	114,489,650	
ハマキョウレックス	15,100	4,915.00	74,216,500	
サカイ引越センター	19,600	2,637.00	51,685,200	
近鉄グループホールディングス	176,800	3,381.00	597,760,800	
阪急阪神ホールディングス	235,800	4,432.00	1,045,065,600	
南海電気鉄道	78,900	2,368.00	186,835,200	
京阪ホールディングス	97,500	2,846.00	277,485,000	
神戸電鉄	4,800	2,678.00	12,854,400	
名古屋鉄道	182,400	1,764.00	321,753,600	
山陽電気鉄道	13,300	2,033.00	27,038,900	
アルプス物流	14,100	5,770.00	81,357,000	
ヤマトホールディングス	214,900	1,697.50	364,792,750	
山九	42,700	4,682.00	199,921,400	
丸運	2,200	562.00	1,236,400	
丸全昭和運輸	10,900	4,920.00	53,628,000	
センコーグループホールディングス	93,600	1,192.00	111,571,200	
トナミホールディングス	3,900	6,320.00	24,648,000	
ニッコンホールディングス	54,500	3,773.00	205,628,500	
日本石油輸送	400	2,888.00	1,155,200	
福山通運	16,200	3,700.00	59,940,000	
セイノーホールディングス	99,400	2,328.50	231,452,900	
神奈川中央交通	5,000	3,365.00	16,825,000	
A Z－COM丸和ホールディングス	45,200	1,123.00	50,759,600	
九州旅客鉄道	125,000	3,942.00	492,750,000	
S Gホールディングス	296,900	1,600.00	475,040,000	
N I P P O N E X P R E S Sホールディ ングス	66,000	7,465.00	492,690,000	
日本郵船	458,100	5,086.00	2,329,896,600	
商船三井	384,200	5,070.00	1,947,894,000	
川崎汽船	426,300	2,064.00	879,883,200	
N Sユナイテッド海運	9,600	4,745.00	45,552,000	

飯野海運	65,300	1,262.00	82,408,600	
共栄タンカー	1,000	1,068.00	1,068,000	
乾汽船	21,100	1,142.00	24,096,200	
日本航空	434,300	2,466.50	1,071,200,950	
A N Aホールディングス	481,200	2,922.00	1,406,066,400	
パスコ	700	1,676.00	1,173,200	
トランコム	5,100	7,060.00	36,006,000	
日新	13,400	4,125.00	55,275,000	
三菱倉庫	42,200	5,116.00	215,895,200	
三井倉庫ホールディングス	16,500	5,700.00	94,050,000	
住友倉庫	47,200	2,670.00	126,024,000	
澁澤倉庫	8,100	2,929.00	23,724,900	
東陽倉庫	1,000	1,381.00	1,381,000	
日本トランスシティ	35,600	869.00	30,936,400	
ケイヒン	700	2,012.00	1,408,400	
中央倉庫	9,500	1,345.00	12,777,500	
川西倉庫	700	1,135.00	794,500	
安田倉庫	12,100	1,602.00	19,384,200	
ファイズホールディングス	600	893.00	535,800	
東洋埠頭	1,100	1,292.00	1,421,200	
上組	81,700	3,318.00	271,080,600	
サンリツ	900	791.00	711,900	
キムラユニティー	1,800	1,582.00	2,847,600	
キューソー流通システム	11,800	2,021.00	23,847,800	
東海運	2,200	319.00	701,800	
エーアイテイー	11,100	1,753.00	19,458,300	
内外トランスライン	7,100	2,714.00	19,269,400	
日本コンセプト	6,400	1,749.00	11,193,600	
N E C ネットズエスアイ	69,200	2,677.00	185,248,400	
クロスキャット	11,300	1,194.00	13,492,200	
システナ	268,800	395.00	106,176,000	
デジタルアーツ	11,200	4,370.00	48,944,000	
日鉄ソリューションズ	60,600	3,775.00	228,765,000	
キューブシステム	9,400	1,068.00	10,039,200	
コア	7,900	1,841.00	14,543,900	
手間いらず	3,000	3,670.00	11,010,000	
ラクーンホールディングス	13,300	579.00	7,700,700	
ソリトンシステムズ	9,200	1,085.00	9,982,000	
ソフトクリエイトホールディングス	14,600	1,680.00	24,528,000	
T I S	187,800	3,625.00	680,775,000	
テクミラホールディングス	1,800	345.00	621,000	
グリー	59,600	458.00	27,296,800	

GMOペパボ	2,200	1,385.00	3,047,000	
コーエーテクモホールディングス	111,300	1,649.50	183,589,350	
三菱総合研究所	8,700	4,230.00	36,801,000	
電算	500	1,405.00	702,500	
A G S	1,600	902.00	1,443,200	
ファインデックス	14,100	956.00	13,479,600	
ブレインパッド	14,800	908.00	13,438,400	
K L a b	42,500	209.00	8,882,500	
ポールトゥウィンホールディングス	30,400	423.00	12,859,200	
ネクソン	390,000	2,913.00	1,136,070,000	
アイスタイル	59,400	517.00	30,709,800	
エムアップホールディングス	21,800	1,236.00	26,944,800	
エイチーム	11,800	702.00	8,283,600	
エニグモ	22,600	344.00	7,774,400	
テクノスジャパン	3,400	690.00	2,346,000	
コロプラ	60,400	587.00	35,454,800	
ブロードリーフ	71,300	736.00	52,476,800	
クロス・マーケティンググループ	1,800	710.00	1,278,000	
デジタルハーツホールディングス	11,100	846.00	9,390,600	
メディアドゥ	8,000	1,509.00	12,072,000	
じげん	51,800	558.00	28,904,400	
ブイキューブ	24,500	247.00	6,051,500	
エンカレッジ・テクノロジー	900	601.00	540,900	
サイバーリンクス	1,500	756.00	1,134,000	
フィックスターズ	17,800	1,592.00	28,337,600	
CART A H O L D I N G S	10,100	1,397.00	14,109,700	
オブティム	18,300	630.00	11,529,000	
セレス	8,000	1,352.00	10,816,000	
S H I F T	11,800	13,350.00	157,530,000	
ティーガイア	18,600	3,700.00	68,820,000	
セック	2,700	4,065.00	10,975,500	
テクマトリックス	32,400	2,396.00	77,630,400	
プロシップ	8,600	1,382.00	11,885,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,100	3,035.00	133,843,500	
GMOペイメントゲートウェイ	40,600	9,400.00	381,640,000	
ザッパラス	900	359.00	323,100	
システムリサーチ	12,200	1,393.00	16,994,600	
インターネットイニシアティブ	84,900	2,956.00	250,964,400	
さくらインターネット	22,200	3,580.00	79,476,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,400	2,817.00	15,211,800	
S R Aホールディングス	9,100	4,380.00	39,858,000	
システムインテグレータ	1,200	356.00	427,200	

朝日ネット	19,100	677.00	12,930,700	
e B A S E	25,000	599.00	14,975,000	
アバントグループ	22,400	1,850.00	41,440,000	
アドソル日進	7,500	1,815.00	13,612,500	
ODKソリューションズ	800	598.00	478,400	
フリービット	7,800	1,233.00	9,617,400	
コムチュア	25,600	1,633.00	41,804,800	
アステリア	13,900	538.00	7,478,200	
アイル	10,000	2,933.00	29,330,000	
マークラインズ	10,500	2,945.00	30,922,500	
メディカル・データ・ビジョン	21,200	541.00	11,469,200	
g u m i	28,900	320.00	9,248,000	
ショーケース	900	263.00	236,700	
モバイルファクトリー	800	778.00	622,400	
テラスカイ	7,700	2,404.00	18,510,800	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,200	1,825.00	16,790,000	
P C I ホールディングス	1,600	1,103.00	1,764,800	
アイビーシー	600	587.00	352,200	
ネオジャパン	5,900	1,911.00	11,274,900	
P R T I M E S	3,600	1,762.00	6,343,200	
ラクス	84,000	2,436.50	204,666,000	
ランドコンピュータ	1,900	756.00	1,436,400	
ダブルスタンダード	5,400	1,591.00	8,591,400	
オーブンドア	10,400	781.00	8,122,400	
アカツキ	8,700	2,077.00	18,069,900	
ベネフィットジャパン	200	1,121.00	224,200	
U b i c o mホールディングス	5,700	1,368.00	7,797,600	
カナミックネットワーク	22,300	509.00	11,350,700	
ノムラシステムコーポレーション	4,300	123.00	528,900	
チェンジホールディングス	39,000	1,408.00	54,912,000	
シンクロ・フード	2,500	484.00	1,210,000	
オークネット	8,200	2,371.00	19,442,200	
キャピタル・アセット・プランニング	800	803.00	642,400	
セグエグループ	3,500	640.00	2,240,000	
エイトレッド	600	1,599.00	959,400	
マクロミル	34,900	799.00	27,885,100	
ビーグリー	700	1,342.00	939,400	
オロ	7,500	2,144.00	16,080,000	
ユーザーローカル	7,500	1,885.00	14,137,500	
テモナ	900	206.00	185,400	
ニーズウェル	4,200	315.00	1,323,000	
マネーフォワード	43,400	5,590.00	242,606,000	

サインポスト	1,500	536.00	804,000	
Sun Asterisk	12,600	616.00	7,761,600	
プラスアルファ・コンサルティング	22,400	1,874.00	41,977,600	
電算システムホールディングス	7,900	2,787.00	22,017,300	
Appier Group	54,100	1,639.00	88,669,900	
ビジョナル	21,000	8,890.00	186,690,000	
ソルクシーズ	3,100	307.00	951,700	
フェイス	1,100	413.00	454,300	
プロトコーポレーション	19,400	1,466.00	28,440,400	
ハイマックス	5,600	1,364.00	7,638,400	
野村総合研究所	384,700	4,993.00	1,920,807,100	
C Eホールディングス	1,800	481.00	865,800	
日本システム技術	16,500	1,715.00	28,297,500	
インテージホールディングス	20,100	1,543.00	31,014,300	
東邦システムサイエンス	8,300	1,545.00	12,823,500	
ソースネクスト	81,300	210.00	17,073,000	
シンプレクス・ホールディングス	27,000	2,450.00	66,150,000	
HEROZ	7,000	1,089.00	7,623,000	
ラクスル	43,000	1,210.00	52,030,000	
メルカリ	86,700	2,230.00	193,341,000	
I P S	5,100	2,236.00	11,403,600	
F I G	4,500	344.00	1,548,000	
システムサポート	6,900	1,900.00	13,110,000	
イーソル	11,900	758.00	9,020,200	
東海ソフト	600	1,262.00	757,200	
ウイングアーク1st	18,500	2,930.00	54,205,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,900	873.00	5,150,700	
サーバーワークス	3,600	2,874.00	10,346,400	
東名	400	2,801.00	1,120,400	
ヴィッツ	400	809.00	323,600	
トビラシステムズ	1,100	770.00	847,000	
Sansan	58,300	2,337.00	136,247,100	
Link-Uグループ	800	529.00	423,200	
ギフトィ	15,600	1,266.00	19,749,600	
メドレー	19,500	3,530.00	68,835,000	
ベース	8,700	3,125.00	27,187,500	
JMDC	30,300	4,303.00	130,380,900	
フォーカスシステムズ	11,900	1,159.00	13,792,100	
クレスコ	29,200	1,252.00	36,558,400	
フジ・メディア・ホールディングス	170,600	1,743.50	297,441,100	
オービック	59,400	25,945.00	1,541,133,000	
ジャストシステム	25,500	3,505.00	89,377,500	

TDCソフト	33,300	1,214.00	40,426,200	
LINEヤフー	2,529,300	403.20	1,019,813,760	
トレンドマイクロ	93,300	8,636.00	805,738,800	
IDホールディングス	12,000	1,312.00	15,744,000	
日本オラクル	34,000	13,005.00	442,170,000	
アルファシステムズ	4,700	2,849.00	13,390,300	
フューチャー	44,200	1,795.00	79,339,000	
CAC Holdings	10,900	1,772.00	19,314,800	
トーセ	1,100	666.00	732,600	
オービックビジネスコンサルタント	25,000	6,951.00	173,775,000	
アイティフォー	22,700	1,348.00	30,599,600	
東計電算	5,000	4,335.00	21,675,000	
エクスネット	500	1,442.00	721,000	
大塚商会	201,400	3,474.00	699,663,600	
サイボウズ	24,500	1,748.00	42,826,000	
電通総研	17,300	5,920.00	102,416,000	
ACCESS	18,500	1,179.00	21,811,500	
デジタルガレージ	28,400	2,959.00	84,035,600	
EMシステムズ	29,600	573.00	16,960,800	
ウェザーニューズ	5,500	5,760.00	31,680,000	
C I J	44,300	408.00	18,074,400	
ビジネスエンジニアリング	4,200	4,255.00	17,871,000	
日本エンタープライズ	4,100	123.00	504,300	
WOWOW	13,400	1,100.00	14,740,000	
スカラ	16,500	468.00	7,722,000	
インテリジェント ウェイブ	2,000	952.00	1,904,000	
ANYCOLOR	25,400	2,591.00	65,811,400	
IMAGICA GROUP	17,800	493.00	8,775,400	
ネットワンシステムズ	69,200	3,397.00	235,072,400	
システムソフト	62,000	68.00	4,216,000	
アルゴグラフィックス	16,300	5,150.00	83,945,000	
マーベラス	28,900	614.00	17,744,600	
エイベックス	30,300	1,429.00	43,298,700	
BIPROGY	58,100	4,654.00	270,397,400	
都築電気	9,400	2,335.00	21,949,000	
TBSホールディングス	89,300	4,110.00	367,023,000	
日本テレビホールディングス	157,300	2,481.50	390,339,950	
朝日放送グループホールディングス	16,600	662.00	10,989,200	
テレビ朝日ホールディングス	43,100	2,013.00	86,760,300	
スカパーJ SATホールディングス	138,000	866.00	119,508,000	
テレビ東京ホールディングス	12,800	3,945.00	50,496,000	
日本BS放送	1,400	905.00	1,267,000	

ビジョン	26,600	1,311.00	34,872,600	
スマートバリュー	1,100	306.00	336,600	
U-NEXT HOLDINGS	19,900	5,590.00	111,241,000	
ワイヤレスゲート	1,900	268.00	509,200	
日本通信	174,900	181.00	31,656,900	
クロップス	500	969.00	484,500	
日本電信電話	52,840,200	155.20	8,200,799,040	
KDDI	1,306,600	4,886.00	6,384,047,600	
ソフトバンク	2,838,000	2,038.00	5,783,844,000	
光通信	17,600	30,840.00	542,784,000	
エムティーアイ	12,200	1,050.00	12,810,000	
GMOインターネットグループ	57,900	2,557.50	148,079,250	
ファイバーゲート	9,600	1,137.00	10,915,200	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,100	228.00	250,800	
KADOKAWA	93,900	2,991.00	280,854,900	
学研ホールディングス	32,500	1,037.00	33,702,500	
ゼンリン	30,400	894.00	27,177,600	
昭文社ホールディングス	1,700	373.00	634,100	
インプレスホールディングス	3,900	146.00	569,400	
アイネット	10,800	1,598.00	17,258,400	
松竹	9,200	9,737.00	89,580,400	
東宝	98,800	5,614.00	554,663,200	
東映	29,300	4,240.00	124,232,000	
NTTデータグループ	464,500	2,201.00	1,022,364,500	
ピー・シー・エー	10,200	2,093.00	21,348,600	
ビジネスブレイン太田昭和	7,000	1,930.00	13,510,000	
DTS	35,100	4,125.00	144,787,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	81,200	5,350.00	434,420,000	
シーイーシー	22,400	1,898.00	42,515,200	
カプコン	317,700	3,141.00	997,895,700	
アイ・エス・ビー	8,300	1,521.00	12,624,300	
SCSK	124,300	2,832.00	352,017,600	
NSW	7,900	2,909.00	22,981,100	
アイネス	13,900	1,553.00	21,586,700	
TKC	31,700	3,915.00	124,105,500	
富士ソフト	49,100	8,980.00	440,918,000	
NSD	62,700	3,185.00	199,699,500	
コナミグループ	66,500	12,865.00	855,522,500	
福井コンピュータホールディングス	11,000	2,652.00	29,172,000	
JBCCHホールディングス	11,800	4,440.00	52,392,000	
ミロク情報サービス	16,100	1,829.00	29,446,900	
ソフトバンクグループ	876,300	8,345.00	7,312,723,500	

リョーサン菱洋ホールディングス	35,200	2,737.00	96,342,400	
高千穂交易	7,400	3,965.00	29,341,000	
オルパヘルスケアホールディングス	700	1,918.00	1,342,600	
伊藤忠食品	4,200	7,210.00	30,282,000	
エレマテック	16,800	1,780.00	29,904,000	
あらた	28,700	3,520.00	101,024,000	
トーメンデバイス	2,700	6,080.00	16,416,000	
東京エレクトロン デバイス	18,700	3,835.00	71,714,500	
円谷フィールズホールディングス	30,300	1,978.00	59,933,400	
双日	208,600	3,404.00	710,074,400	
アルフレッサ ホールディングス	188,100	2,370.00	445,797,000	
横浜冷凍	47,100	1,031.00	48,560,100	
ラサ商事	9,500	1,518.00	14,421,000	
アルコニックス	24,700	1,411.00	34,851,700	
神戸物産	145,000	4,295.00	622,775,000	
ハイパー	900	337.00	303,300	
あい ホールディングス	30,000	2,582.00	77,460,000	
ディーブイエックス	1,100	960.00	1,056,000	
ダイワボウホールディングス	83,000	2,727.00	226,341,000	
マクニカホールディングス	44,300	5,814.00	257,560,200	
ラクト・ジャパン	8,000	3,165.00	25,320,000	
グリムス	7,900	2,640.00	20,856,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,400	1,268.00	36,011,200	
八洲電機	15,200	1,572.00	23,894,400	
メディアスホールディングス	10,900	796.00	8,676,400	
レスター	15,900	2,835.00	45,076,500	
ジオリーブグループ	900	1,156.00	1,040,400	
大光	2,100	614.00	1,289,400	
OCH I ホールディングス	900	1,407.00	1,266,300	
TOKA I ホールディングス	101,800	989.00	100,680,200	
黒谷	1,100	665.00	731,500	
C o m i n i x	800	895.00	716,000	
三洋貿易	19,200	1,445.00	27,744,000	
ビューティガレージ	5,900	1,535.00	9,056,500	
ウイン・パートナーズ	12,100	1,152.00	13,939,200	
ミタチ産業	1,100	1,138.00	1,251,800	
シップヘルスケアホールディングス	67,300	2,161.00	145,435,300	
明治電機工業	7,000	1,463.00	10,241,000	
デリカフーズホールディングス	1,800	561.00	1,009,800	
スターティアホールディングス	1,100	2,120.00	2,332,000	
コメダホールディングス	45,900	2,682.00	123,103,800	
ピーバンドットコム	500	377.00	188,500	

アセンテック	7,200	555.00	3,996,000	
富士興産	1,100	1,566.00	1,722,600	
協栄産業	400	2,329.00	931,600	
フルサト・マルカホールディングス	15,000	2,258.00	33,870,000	
ヤマエグループホールディングス	16,500	1,892.00	31,218,000	
小野建	18,900	1,530.00	28,917,000	
南陽	1,700	1,089.00	1,851,300	
佐島電機	13,100	2,006.00	26,278,600	
エコートレーディング	800	926.00	740,800	
伯東	10,700	5,000.00	53,500,000	
コンドーテック	14,400	1,299.00	18,705,600	
中山福	2,200	372.00	818,400	
ナガイレーベン	23,700	2,519.00	59,700,300	
三菱食品	17,300	5,320.00	92,036,000	
松田産業	14,300	3,185.00	45,545,500	
第一興商	72,500	1,650.50	119,661,250	
メディパルホールディングス	190,500	2,571.00	489,775,500	
S P K	8,300	2,178.00	18,077,400	
萩原電気ホールディングス	8,000	3,540.00	28,320,000	
アズワン	58,100	3,033.00	176,217,300	
スズデン	6,600	1,927.00	12,718,200	
尾家産業	1,000	2,032.00	2,032,000	
シモジマ	12,500	1,274.00	15,925,000	
ドウシシャ	17,300	2,220.00	38,406,000	
小津産業	900	1,610.00	1,449,000	
高速	11,100	2,371.00	26,318,100	
たけびし	7,200	2,478.00	17,841,600	
リックス	4,700	2,938.00	13,808,600	
丸文	16,700	1,092.00	18,236,400	
ハピネット	15,900	3,750.00	59,625,000	
橋本総業ホールディングス	7,400	1,208.00	8,939,200	
日本ライフライン	50,200	1,139.00	57,177,800	
タカショー	16,300	477.00	7,775,100	
I D O M	49,600	1,144.00	56,742,400	
進和	11,500	2,509.00	28,853,500	
エスケイジャパン	1,000	762.00	762,000	
ダイトロン	8,100	2,762.00	22,372,200	
シークス	26,700	1,130.00	30,171,000	
田中商事	1,200	679.00	814,800	
オーハシテクニカ	9,800	1,796.00	17,600,800	
白銅	5,300	2,579.00	13,668,700	
ダイコー通産	400	1,127.00	450,800	

伊藤忠商事	1,259,700	7,317.00	9,217,224,900	
丸紅	1,554,400	2,427.00	3,772,528,800	
高島	2,700	1,319.00	3,561,300	
長瀬産業	83,700	3,148.00	263,487,600	
蝶理	11,700	3,455.00	40,423,500	
豊田通商	492,500	2,710.50	1,334,921,250	
三共生興	26,000	597.00	15,522,000	
兼松	78,400	2,422.00	189,884,800	
ツカモトコーポレーション	600	1,212.00	727,200	
三井物産	2,807,300	3,022.00	8,483,660,600	
日本紙パルプ商事	9,000	6,290.00	56,610,000	
カメイ	19,900	2,069.00	41,173,100	
東都水産	400	6,410.00	2,564,000	
OUGホールディングス	600	2,590.00	1,554,000	
スターゼン	12,900	2,779.00	35,849,100	
山善	56,800	1,355.00	76,964,000	
椿本興業	11,600	1,873.00	21,726,800	
住友商事	1,134,200	3,378.00	3,831,327,600	
内田洋行	7,600	7,440.00	56,544,000	
三菱商事	3,598,400	3,000.00	10,795,200,000	
第一実業	17,600	2,413.00	42,468,800	
キャノンマーケティングジャパン	43,400	4,550.00	197,470,000	
西華産業	7,300	3,985.00	29,090,500	
佐藤商事	13,000	1,446.00	18,798,000	
東京産業	17,100	732.00	12,517,200	
ユアサ商事	14,600	5,200.00	75,920,000	
神鋼商事	4,700	7,620.00	35,814,000	
トルク	2,900	219.00	635,100	
阪和興業	33,600	5,030.00	169,008,000	
正栄食品工業	12,500	4,815.00	60,187,500	
カナデン	14,100	1,471.00	20,741,100	
RYODEN	15,100	2,576.00	38,897,600	
岩谷産業	42,700	8,814.00	376,357,800	
ナイス	1,300	1,946.00	2,529,800	
ニチモウ	1,300	1,908.00	2,480,400	
極東貿易	11,200	1,608.00	18,009,600	
アステナホールディングス	35,300	518.00	18,285,400	
三愛オブリ	43,700	2,014.00	88,011,800	
稲畑産業	37,000	3,350.00	123,950,000	
G S I クレオス	10,000	2,047.00	20,470,000	
明和産業	22,200	684.00	15,184,800	
クワザワホールディングス	1,500	711.00	1,066,500	

ワキタ	31,000	1,617.00	50,127,000	
東邦ホールディングス	50,600	4,756.00	240,653,600	
サンゲツ	43,100	2,904.00	125,162,400	
ミツウロコグループホールディングス	23,900	1,693.00	40,462,700	
シナネンホールディングス	5,200	5,610.00	29,172,000	
伊藤忠エネクス	46,500	1,611.00	74,911,500	
サンリオ	152,200	3,512.00	534,526,400	
サンワテクノス	9,600	2,061.00	19,785,600	
新光商事	25,200	945.00	23,814,000	
トーヨー	7,300	2,866.00	20,921,800	
三信電気	7,600	2,048.00	15,564,800	
東陽テクニカ	17,300	1,569.00	27,143,700	
モスフードサービス	27,600	3,495.00	96,462,000	
加賀電子	17,100	5,220.00	89,262,000	
ソーダニッカ	19,800	1,155.00	22,869,000	
立花エレテック	12,400	2,713.00	33,641,200	
フォーバル	7,400	1,402.00	10,374,800	
PAL TAC	25,000	4,455.00	111,375,000	
三谷産業	32,800	328.00	10,758,400	
西本W i s m e t t a cホールディングス	11,400	1,432.00	16,324,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	2,710.00	813,000	
コア商事ホールディングス	13,900	629.00	8,743,100	
K P Pグループホールディングス	48,500	672.00	32,592,000	
ヤマタネ	8,300	3,180.00	26,394,000	
丸紅建材リース	300	2,929.00	878,700	
泉州電業	12,900	5,090.00	65,661,000	
トラスコ中山	39,400	2,313.00	91,132,200	
オートバックスセブン	65,200	1,511.50	98,549,800	
モリト	14,900	1,374.00	20,472,600	
加藤産業	23,200	4,315.00	100,108,000	
北恵	1,000	926.00	926,000	
イエローハット	29,800	2,534.00	75,513,200	
J Kホールディングス	14,400	1,026.00	14,774,400	
日伝	12,300	3,415.00	42,004,500	
北沢産業	2,500	397.00	992,500	
杉本商事	9,100	2,923.00	26,599,300	
因幡電機産業	48,600	3,780.00	183,708,000	
東テク	18,800	2,406.00	45,232,800	
ミスミグループ本社	283,100	2,714.00	768,333,400	
アルテック	2,200	231.00	508,200	
タキヒヨー	900	1,281.00	1,152,900	
蔵王産業	700	2,510.00	1,757,000	

スズケン	66,900	5,195.00	347,545,500	
ジェコス	11,200	942.00	10,550,400	
サンエー	14,400	5,060.00	72,864,000	
カワチ薬品	14,800	2,714.00	40,167,200	
エービーシー・マート	82,100	3,003.00	246,546,300	
ハードオフコーポレーション	8,500	2,071.00	17,603,500	
アスクル	45,400	2,137.00	97,019,800	
ゲオホールディングス	21,300	1,605.00	34,186,500	
アダストリア	22,700	3,610.00	81,947,000	
くら寿司	22,000	3,840.00	84,480,000	
キャンドゥ	6,800	3,980.00	27,064,000	
I Kホールディングス	2,200	361.00	794,200	
パルグループホールディングス	36,900	2,386.00	88,043,400	
エディオン	74,400	1,848.00	137,491,200	
サーラコーポレーション	39,800	839.00	33,392,200	
ワッツ	2,200	743.00	1,634,600	
ハローズ	8,600	4,380.00	37,668,000	
あみやき亭	4,600	5,610.00	25,806,000	
大黒天物産	5,800	11,810.00	68,498,000	
ハニーズホールディングス	16,900	1,612.00	27,242,800	
ファーマライズホールディングス	1,500	604.00	906,000	
アルペン	15,600	2,215.00	34,554,000	
ハブ	1,700	773.00	1,314,100	
クオールホールディングス	26,000	1,477.00	38,402,000	
ジンズホールディングス	14,400	5,130.00	73,872,000	
ビックカメラ	112,400	1,701.00	191,192,400	
DCMホールディングス	97,300	1,486.00	144,587,800	
Monotaro	265,800	2,290.50	608,814,900	
東京一番フーズ	1,800	511.00	919,800	
きちりホールディングス	1,100	853.00	938,300	
J. フロント リテイリング	215,300	1,458.00	313,907,400	
ドトール・日レスホールディングス	33,400	2,229.00	74,448,600	
マツキヨココカラ&カンパニー	341,100	2,306.00	786,576,600	
ブロンコビリー	11,100	3,605.00	40,015,500	
ZOZO	119,500	4,756.00	568,342,000	
トレジャー・ファクトリー	13,100	1,922.00	25,178,200	
物語コーポレーション	31,400	3,565.00	111,941,000	
三越伊勢丹ホールディングス	310,400	2,158.00	669,843,200	
Hamee	7,900	1,132.00	8,942,800	
マーケットエンタープライズ	700	908.00	635,600	
ウエルシアホールディングス	97,400	2,019.50	196,699,300	
クリエイトSDホールディングス	26,700	3,280.00	87,576,000	

丸善CH I ホールディングス	5,800	326.00	1,890,800	
ミサワ	1,400	619.00	866,600	
ティーライフ	800	1,221.00	976,800	
チムニー	1,200	1,353.00	1,623,600	
シュッピン	17,200	1,434.00	24,664,800	
オイシックス・ラ・大地	25,500	1,296.00	33,048,000	
ネクステージ	43,000	2,021.00	86,903,000	
ジョイフル本田	52,200	2,182.00	113,900,400	
エターナルホスピタリティグループ	7,000	3,430.00	24,010,000	
ホットランド	14,500	2,195.00	31,827,500	
すかいらーくホールディングス	256,300	2,271.50	582,185,450	
S F Pホールディングス	9,100	2,109.00	19,191,900	
綿半ホールディングス	14,700	1,788.00	26,283,600	
ヨシックスホールディングス	4,900	3,105.00	15,214,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,800	900.00	47,520,000	
BEENOS	11,300	2,781.00	31,425,300	
あさひ	17,600	1,598.00	28,124,800	
日本調剤	12,600	1,273.00	16,039,800	
コスモス薬品	15,900	14,175.00	225,382,500	
トーエル	2,200	830.00	1,826,000	
セブン&アイ・ホールディングス	1,897,700	2,100.00	3,985,170,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	126,900	1,060.00	134,514,000	
ツルハホールディングス	39,400	8,796.00	346,562,400	
サンマルクホールディングス	15,300	2,105.00	32,206,500	
フェリシモ	1,300	939.00	1,220,700	
トリドールホールディングス	52,700	3,726.00	196,360,200	
TOKYO BASE	21,500	263.00	5,654,500	
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,224.00	1,346,400	
JMホールディングス	14,300	3,015.00	43,114,500	
サツドラホールディングス	2,000	808.00	1,616,000	
アレンザホールディングス	14,300	1,136.00	16,244,800	
串カツ田中ホールディングス	5,900	1,484.00	8,755,600	
バロックジャパンリミテッド	15,100	790.00	11,929,000	
クスリのアオキホールディングス	56,500	3,322.00	187,693,000	
力の源ホールディングス	12,000	1,136.00	13,632,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	100,100	2,743.50	274,624,350	
メディカルシステムネットワーク	21,200	455.00	9,646,000	
はるやまホールディングス	2,500	585.00	1,462,500	
ノジマ	54,600	1,676.00	91,509,600	
カッパ・クリエイト	29,500	1,765.00	52,067,500	

ライトオン	3,000	414.00	1,242,000	
良品計画	223,300	2,746.00	613,181,800	
パリミキホールディングス	5,900	336.00	1,982,400	
アドヴァングループ	16,400	939.00	15,399,600	
アルビス	6,300	2,744.00	17,287,200	
コナカ	4,800	252.00	1,209,600	
ハウス オブ ローゼ	700	1,537.00	1,075,900	
G-7ホールディングス	20,700	1,619.00	33,513,300	
イオン北海道	55,500	927.00	51,448,500	
コジマ	36,500	998.00	36,427,000	
ヒマラヤ	1,800	917.00	1,650,600	
コーナン商事	23,100	3,885.00	89,743,500	
エコス	7,100	2,030.00	14,413,000	
ワタミ	19,800	901.00	17,839,800	
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	378,600	3,705.00	1,402,713,000	
西松屋チェーン	37,000	2,566.00	94,942,000	
ゼンショーホールディングス	95,500	7,532.00	719,306,000	
幸楽苑ホールディングス	13,900	1,258.00	17,486,200	
ハークスレイ	1,700	764.00	1,298,800	
サイゼリヤ	27,800	5,260.00	146,228,000	
V Tホールディングス	73,800	500.00	36,900,000	
魚力	6,700	2,480.00	16,616,000	
フジ・コーポレーション	9,100	2,296.00	20,893,600	
ユナイテッドアローズ	22,200	2,197.00	48,773,400	
ハイデイ日高	27,900	2,725.00	76,027,500	
京都きもの友禅ホールディングス	4,900	102.00	499,800	
コロワイド	80,500	1,750.00	140,875,000	
壱番屋	74,400	1,041.00	77,450,400	
P L A N T	1,100	1,579.00	1,736,900	
スギホールディングス	113,400	2,620.50	297,164,700	
薬王堂ホールディングス	9,300	2,599.00	24,170,700	
スクロール	28,300	992.00	28,073,600	
ヨンドシーホールディングス	17,900	1,898.00	33,974,200	
木曽路	28,500	2,551.00	72,703,500	
S R Sホールディングス	31,200	1,306.00	40,747,200	
千趣会	37,900	303.00	11,483,700	
リテールパートナーズ	28,100	1,428.00	40,126,800	
上新電機	18,700	2,842.00	53,145,400	
日本瓦斯	99,500	2,323.50	231,188,250	
ロイヤルホールディングス	33,000	2,414.00	79,662,000	
いなげや	18,300	1,238.00	22,655,400	
チヨダ	18,300	873.00	15,975,900	

ライフコーポレーション	19,700	3,575.00	70,427,500	
リンガーハット	24,200	2,330.00	56,386,000	
MrMaxHD	24,200	695.00	16,819,000	
AOKIホールディングス	40,500	1,256.00	50,868,000	
オークワ	27,000	924.00	24,948,000	
コメリ	28,900	3,845.00	111,120,500	
青山商事	40,300	1,422.00	57,306,600	
しまむら	44,100	7,922.00	349,360,200	
はせがわ	2,900	336.00	974,400	
高島屋	119,400	2,281.50	272,411,100	
松屋	31,800	928.00	29,510,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	95,600	2,101.00	200,855,600	
近鉄百貨店	8,200	2,144.00	17,580,800	
丸井グループ	124,400	2,512.00	312,492,800	
アクシアル リテイリング	51,500	953.00	49,079,500	
イオン	635,300	3,715.00	2,360,139,500	
イズミ	33,200	3,470.00	115,204,000	
平和堂	31,400	2,431.00	76,333,400	
フジ	28,800	1,964.00	56,563,200	
ヤオコー	22,200	9,577.00	212,609,400	
ゼビオホールディングス	25,700	1,282.00	32,947,400	
ケーズホールディングス	126,100	1,586.50	200,057,650	
Olympicグループ	2,400	514.00	1,233,600	
日産東京販売ホールディングス	6,700	468.00	3,135,600	
シルバーライフ	5,500	919.00	5,054,500	
Genky DrugStores	16,500	3,810.00	62,865,000	
ナルミヤ・インターナショナル	900	1,285.00	1,156,500	
ブックオフグループホールディングス	13,900	1,363.00	18,945,700	
ギフトホールディングス	9,400	2,674.00	25,135,600	
アインホールディングス	25,900	5,376.00	139,238,400	
Genki Global Dining	10,700	4,080.00	43,656,000	
ヤマダホールディングス	577,200	456.00	263,203,200	
アークランズ	56,000	1,770.00	99,120,000	
ニトリホールディングス	68,200	22,430.00	1,529,726,000	
グルメ杵屋	15,500	1,129.00	17,499,500	
愛眼	3,000	163.00	489,000	
ケーユーホールディングス	9,100	1,128.00	10,264,800	
吉野家ホールディングス	69,100	3,099.00	214,140,900	
松屋フーズホールディングス	8,900	5,730.00	50,997,000	
サガミホールディングス	28,300	1,679.00	47,515,700	
王将フードサービス	13,900	8,070.00	112,173,000	
ミニストップ	13,700	1,682.00	23,043,400	

アークス	34,500	2,606.00	89,907,000	
パローホールディングス	35,900	2,293.00	82,318,700	
ベルク	9,400	6,190.00	58,186,000	
大庄	11,600	1,135.00	13,166,000	
ファーストリテイリング	105,400	46,200.00	4,869,480,000	
サンドラッグ	63,300	4,173.00	264,150,900	
サックスパー ホールディングス	16,300	816.00	13,300,800	
ヤマザワ	1,100	1,301.00	1,431,100	
やまや	900	3,035.00	2,731,500	
ペルーナ	45,600	737.00	33,607,200	
いよぎんホールディングス	207,600	1,331.00	276,315,600	
しずおかフィナンシャルグループ	384,200	1,312.50	504,262,500	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	146,900	1,557.00	228,723,300	
楽天銀行	80,900	3,245.00	262,520,500	
京都フィナンシャルグループ	219,600	2,319.50	509,362,200	
島根銀行	1,100	517.00	568,700	
じもとホールディングス	3,300	315.00	1,039,500	
めぶきフィナンシャルグループ	808,400	567.20	458,524,480	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,300	4,445.00	99,123,500	
九州フィナンシャルグループ	337,600	762.00	257,251,200	
ゆうちょ銀行	1,916,900	1,385.50	2,655,864,950	
富山第一銀行	55,400	1,208.00	66,923,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	928,000	829.20	769,497,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	97,600	1,741.00	169,921,600	
三十三フィナンシャルグループ	15,600	1,837.00	28,657,200	
第四北越フィナンシャルグループ	27,400	5,390.00	147,686,000	
ひろぎんホールディングス	248,300	1,146.50	284,675,950	
おきなわフィナンシャルグループ	14,900	2,458.00	36,624,200	
十六フィナンシャルグループ	22,600	4,295.00	97,067,000	
北國フィナンシャルホールディングス	17,100	5,040.00	86,184,000	
プロクレアホールディングス	19,900	1,849.00	36,795,100	
あいちフィナンシャルグループ	35,800	2,444.00	87,495,200	
あおぞら銀行	125,400	2,689.00	337,200,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,618,600	1,509.50	16,028,776,700	
りそなホールディングス	2,017,400	1,031.00	2,079,939,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	620,800	3,632.00	2,254,745,600	
三井住友フィナンシャルグループ	1,221,600	9,604.00	11,732,246,400	
千葉銀行	486,100	1,216.50	591,340,650	
群馬銀行	338,500	926.90	313,755,650	
武蔵野銀行	24,300	2,916.00	70,858,800	
千葉興業銀行	41,200	1,045.00	43,054,000	
筑波銀行	76,600	271.00	20,758,600	

七十七銀行	50,800	4,150.00	210,820,000	
秋田銀行	11,700	2,377.00	27,810,900	
山形銀行	19,400	1,121.00	21,747,400	
岩手銀行	11,000	2,550.00	28,050,000	
東邦銀行	138,000	278.00	38,364,000	
東北銀行	1,800	1,184.00	2,131,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	151,900	3,849.00	584,663,100	
スルガ銀行	130,600	1,159.00	151,365,400	
八十二銀行	374,300	952.00	356,333,600	
山梨中央銀行	19,500	1,778.00	34,671,000	
大垣共立銀行	33,200	1,994.00	66,200,800	
福井銀行	15,600	1,961.00	30,591,600	
清水銀行	6,900	1,518.00	10,474,200	
富山銀行	600	1,695.00	1,017,000	
滋賀銀行	29,000	3,385.00	98,165,000	
南都銀行	26,200	3,275.00	85,805,000	
百五銀行	164,100	580.00	95,178,000	
紀陽銀行	62,400	1,845.00	115,128,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	108,000	1,743.00	188,244,000	
山陰合同銀行	109,200	1,300.00	141,960,000	
鳥取銀行	1,300	1,319.00	1,714,700	
百十四銀行	17,200	2,718.00	46,749,600	
四国銀行	25,600	1,021.00	26,137,600	
阿波銀行	24,500	2,600.00	63,700,000	
大分銀行	10,500	3,415.00	35,857,500	
宮崎銀行	10,500	2,944.00	30,912,000	
佐賀銀行	10,200	2,362.00	24,092,400	
琉球銀行	37,100	1,089.00	40,401,900	
セブン銀行	546,800	285.00	155,838,000	
みずほフィナンシャルグループ	2,354,600	3,016.00	7,101,473,600	
高知銀行	1,300	856.00	1,112,800	
山口フィナンシャルグループ	171,000	1,711.50	292,666,500	
名古屋銀行	11,100	6,960.00	77,256,000	
北洋銀行	264,300	432.00	114,177,600	
大光銀行	1,200	1,461.00	1,753,200	
愛媛銀行	23,500	1,130.00	26,555,000	
トマト銀行	1,300	1,248.00	1,622,400	
京葉銀行	71,800	783.00	56,219,400	
栃木銀行	87,100	289.00	25,171,900	
北日本銀行	5,700	2,545.00	14,506,500	
東和銀行	32,000	633.00	20,256,000	
福島銀行	3,900	265.00	1,033,500	

大東銀行	1,600	716.00	1,145,600	
トモニホールディングス	165,100	393.00	64,884,300	
フィデアホールディングス	18,000	1,522.00	27,396,000	
池田泉州ホールディングス	242,000	362.00	87,604,000	
F P G	62,200	2,310.00	143,682,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	28,300	1,153.00	32,629,900	
マーキュリアホールディングス	1,700	913.00	1,552,100	
S B I ホールディングス	280,200	3,588.00	1,005,357,600	
ジャフコ グループ	52,000	2,003.50	104,182,000	
大和証券グループ本社	1,351,400	1,062.50	1,435,862,500	
野村ホールディングス	2,933,600	836.80	2,454,836,480	
岡三証券グループ	153,200	650.00	99,580,000	
丸三証券	58,100	1,012.00	58,797,200	
東洋証券	46,400	434.00	20,137,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	207,200	528.00	109,401,600	
光世証券	1,000	463.00	463,000	
水戸証券	48,000	449.00	21,552,000	
いちよし証券	32,700	735.00	24,034,500	
松井証券	85,900	808.00	69,407,200	
マネックスグループ	170,900	673.00	115,015,700	
極東証券	23,900	1,548.00	36,997,200	
岩井コスモホールディングス	19,900	2,095.00	41,690,500	
アイザワ証券グループ	25,200	2,027.00	51,080,400	
マネーパートナーズグループ	4,100	223.00	914,300	
スパークス・グループ	19,500	1,414.00	27,573,000	
かんぽ生命保険	177,700	2,808.00	498,981,600	
F P パートナー	7,700	2,974.00	22,899,800	
SOMPOホールディングス	787,300	3,334.00	2,624,858,200	
アニコム ホールディングス	59,200	658.00	38,953,600	
MS & AD インシュアランスグループホールディングス	1,171,600	3,298.00	3,863,936,800	
第一生命ホールディングス	820,200	4,215.00	3,457,143,000	
東京海上ホールディングス	1,703,200	5,395.00	9,188,764,000	
T & D ホールディングス	468,400	2,409.00	1,128,375,600	
アドバンスクリエイト	13,400	988.00	13,239,200	
NEXYZ. Group	2,000	653.00	1,306,000	
全国保証	45,700	5,933.00	271,138,100	
あんしん保証	4,300	189.00	812,700	
イントラスト	2,200	749.00	1,647,800	
日本モーゲージサービス	3,400	412.00	1,400,800	
C a s a	2,100	846.00	1,776,600	
S B I アルヒ	17,500	860.00	15,050,000	
プレミアムグループ	29,800	2,075.00	61,835,000	

ネットプロテクションズホールディングス	60,200	301.00	18,120,200	
クレディセゾン	110,700	3,237.00	358,335,900	
芙蓉総合リース	16,100	11,270.00	181,447,000	
みずほリース	146,700	1,009.00	148,020,300	
東京センチュリー	130,800	1,546.50	202,282,200	
日本証券金融	64,400	2,051.00	132,084,400	
アイフル	258,700	337.00	87,181,900	
リコーリース	16,700	5,120.00	85,504,000	
イオンフィナンシャルサービス	100,600	1,372.50	138,073,500	
アコム	313,000	378.40	118,439,200	
ジャックス	18,700	3,945.00	73,771,500	
オリエントコーポレーション	57,600	956.00	55,065,600	
オリックス	1,046,300	3,564.00	3,729,013,200	
三菱HCキャピタル	777,900	1,046.50	814,072,350	
九州リースサービス	2,100	1,058.00	2,221,800	
日本取引所グループ	449,900	3,364.00	1,513,463,600	
イー・ギャランティ	28,900	1,423.00	41,124,700	
アサックス	2,400	747.00	1,792,800	
NECキャピタルソリューション	8,700	3,910.00	34,017,000	
robot home	52,300	163.00	8,524,900	
大東建託	63,900	18,200.00	1,162,980,000	
サムティホールディングス	34,200	2,643.00	90,390,600	
いちご	178,800	380.00	67,944,000	
日本駐車場開発	210,900	210.00	44,289,000	
スター・マイカ・ホールディングス	19,100	644.00	12,300,400	
SREホールディングス	7,700	4,820.00	37,114,000	
ADワークスグループ	9,500	208.00	1,976,000	
ヒューリック	407,400	1,514.00	616,803,600	
野村不動産ホールディングス	97,300	4,111.00	400,000,300	
三重交通グループホールディングス	38,500	515.00	19,827,500	
ディア・ライフ	30,400	968.00	29,427,200	
地主	15,700	2,067.00	32,451,900	
プレサンスコーポレーション	23,400	1,947.00	45,559,800	
ハウスコム	1,200	1,036.00	1,243,200	
JPMC	10,600	1,212.00	12,847,200	
サンセイランディック	1,800	983.00	1,769,400	
フージャースホールディングス	26,900	1,060.00	28,514,000	
オープンハウスグループ	64,000	5,819.00	372,416,000	
東急不動産ホールディングス	525,100	1,032.00	541,903,200	
飯田グループホールディングス	167,400	2,286.50	382,760,100	
イーランド	1,000	1,480.00	1,480,000	
ムゲンエステート	3,300	1,396.00	4,606,800	

And Doホールディングス	10,500	1,073.00	11,266,500	
シーアールイー	8,200	1,466.00	12,021,200	
ケイアイスター不動産	8,600	3,660.00	31,476,000	
グッドコムアセット	15,000	848.00	12,720,000	
ジェイ・エス・ビー	7,500	3,010.00	22,575,000	
ロードスターキャピタル	10,200	2,413.00	24,612,600	
テンポイノベーション	1,800	933.00	1,679,400	
フェイスネットワーク	1,400	1,577.00	2,207,800	
霞ヶ関キャピタル	7,200	14,520.00	104,544,000	
パーク24	136,400	1,736.00	236,790,400	
パラカ	5,800	1,899.00	11,014,200	
三井不動産	2,420,400	1,547.00	3,744,358,800	
三菱地所	1,094,900	2,483.00	2,718,636,700	
平和不動産	28,500	4,075.00	116,137,500	
東京建物	152,700	2,438.00	372,282,600	
京阪神ビルディング	33,000	1,640.00	54,120,000	
住友不動産	252,400	4,932.00	1,244,836,800	
テーオーシー	32,100	657.00	21,089,700	
レオパレス21	174,500	559.00	97,545,500	
スターツコーポレーション	25,200	3,330.00	83,916,000	
フジ住宅	22,900	724.00	16,579,600	
空港施設	25,700	588.00	15,111,600	
明和地所	13,100	997.00	13,060,700	
ゴールドクレスト	14,500	2,858.00	41,441,000	
エスリード	8,400	4,500.00	37,800,000	
日神グループホールディングス	29,300	505.00	14,796,500	
日本エスコン	32,600	1,053.00	34,327,800	
MIRARTHホールディングス	90,700	516.00	46,801,200	
AVANTIA	2,800	850.00	2,380,000	
イオンモール	90,800	2,093.00	190,044,400	
毎日コムネット	2,100	735.00	1,543,500	
ファースト住建	2,100	1,092.00	2,293,200	
カチタス	47,300	1,840.00	87,032,000	
トーセイ	29,300	2,374.00	69,558,200	
穴吹興産	1,200	2,028.00	2,433,600	
サンフロンティア不動産	26,200	1,837.00	48,129,400	
FJネクストホールディングス	18,900	1,206.00	22,793,400	
インテリックス	900	688.00	619,200	
ランドビジネス	1,400	214.00	299,600	
サンネクスタグループ	1,800	1,008.00	1,814,400	
グランディハウス	17,400	582.00	10,126,800	
日本空港ビルデング	61,800	4,946.00	305,662,800	

明豊ファシリティワークス	2,200	854.00	1,878,800	
L I F U L L	45,700	149.00	6,809,300	
M I X I	39,100	2,769.00	108,267,900	
ジェイエシーリクルートメント	66,000	751.00	49,566,000	
日本M&Aセンターホールディングス	290,400	691.30	200,753,520	
メンバーズ	6,400	824.00	5,273,600	
中広	900	536.00	482,400	
U T グループ	23,800	2,725.00	64,855,000	
アイティメディア	7,100	1,711.00	12,148,100	
ケアネット	37,600	641.00	24,101,600	
E・Jホールディングス	10,800	1,774.00	19,159,200	
オープンアップグループ	54,800	1,921.00	105,270,800	
コシダカホールディングス	54,700	925.00	50,597,500	
アルトナー	1,700	1,836.00	3,121,200	
パソナグループ	22,200	2,284.00	50,704,800	
C D S	1,300	1,810.00	2,353,000	
リンクアンドモチベーション	44,700	595.00	26,596,500	
エス・エム・エス	63,900	2,260.00	144,414,000	
サニーサイドアップグループ	1,600	547.00	875,200	
パーソルホールディングス	1,854,200	285.60	529,559,520	
リニカル	3,000	384.00	1,152,000	
クックパッド	50,700	205.00	10,393,500	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,900	787.00	2,282,300	
学情	9,400	1,819.00	17,098,600	
スタジオアリス	9,200	2,102.00	19,338,400	
エプロ	1,300	799.00	1,038,700	
N J S	4,500	3,700.00	16,650,000	
総合警備保障	304,300	1,042.00	317,080,600	
カカクコム	118,200	2,455.50	290,240,100	
アイロムグループ	7,400	2,773.00	20,520,200	
セントケア・ホールディング	13,500	774.00	10,449,000	
サイネックス	900	744.00	669,600	
ルネサンス	14,300	1,045.00	14,943,500	
ディップ	27,900	3,000.00	83,700,000	
デジタルホールディングス	9,400	984.00	9,249,600	
新日本科学	16,700	1,226.00	20,474,200	
キャリアデザインセンター	800	1,903.00	1,522,400	
エムスリー	359,900	1,437.00	517,176,300	
ツカダ・グローバルホールディング	3,100	403.00	1,249,300	
ウェルネット	3,700	851.00	3,148,700	
ワールドホールディングス	7,200	1,986.00	14,299,200	
ディー・エヌ・エー	64,800	1,665.00	107,892,000	

博報堂DYホールディングス	232,400	1,245.00	289,338,000	
ぐるなび	34,400	376.00	12,934,400	
タカミヤ	25,100	463.00	11,621,300	
ファンコミュニケーションズ	25,900	405.00	10,489,500	
ライク	6,900	1,425.00	9,832,500	
Aoba-BBT	2,000	319.00	638,000	
エスプール	58,100	354.00	20,567,400	
WDBホールディングス	9,400	1,743.00	16,384,200	
ティア	3,000	454.00	1,362,000	
CDG	500	1,676.00	838,000	
アドウェイズ	22,800	370.00	8,436,000	
バリューコマース	16,100	1,151.00	18,531,100	
インフォマート	172,500	293.00	50,542,500	
JPホールディングス	46,800	685.00	32,058,000	
エコナックホールディングス	4,800	119.00	571,200	
CLホールディングス	4,500	940.00	4,230,000	
プレステージ・インターナショナル	85,500	771.00	65,920,500	
アミューズ	11,200	1,518.00	17,001,600	
ドリームインキュベータ	5,800	2,275.00	13,195,000	
クイック	12,700	2,178.00	27,660,600	
TAC	2,900	178.00	516,200	
電通グループ	196,900	4,519.00	889,791,100	
テイクアンドギヴ・ニーズ	8,900	830.00	7,387,000	
イオンファンタジー	6,600	2,295.00	15,147,000	
シーティーエス	22,700	855.00	19,408,500	
H. U. グループホールディングス	53,400	2,717.50	145,114,500	
アルプス技研	15,900	2,653.00	42,182,700	
日本空調サービス	19,700	1,053.00	20,744,100	
オリエンタルランド	963,600	3,983.00	3,838,018,800	
ダスキン	39,800	3,781.00	150,483,800	
明光ネットワークジャパン	22,300	730.00	16,279,000	
ファルコホールディングス	8,100	2,419.00	19,593,900	
ラウンドワン	171,900	894.00	153,678,600	
リゾートトラスト	79,100	2,730.00	215,943,000	
ビー・エム・エル	22,500	2,779.00	62,527,500	
リソー教育	90,800	246.00	22,336,800	
早稲田アカデミー	10,200	1,585.00	16,167,000	
ユー・エス・エス	408,700	1,327.00	542,344,900	
東京個別指導学院	22,000	410.00	9,020,000	
サイバーエージェント	402,600	1,042.50	419,710,500	
楽天グループ	1,281,300	1,028.50	1,317,817,050	
クリーク・アンド・リバー社	9,300	1,498.00	13,931,400	

S B I グローバルアセットマネジメント	35,900	618.00	22,186,200	
テー・オー・ダブリュー	36,200	328.00	11,873,600	
山田コンサルティンググループ	8,000	2,349.00	18,792,000	
セントラルスポーツ	6,900	2,481.00	17,118,900	
フルキャストホールディングス	15,000	1,505.00	22,575,000	
エン・ジャパン	29,700	2,485.00	73,804,500	
リソルホールディングス	400	4,725.00	1,890,000	
テクノプロ・ホールディングス	105,800	2,955.00	312,639,000	
アトラグループ	1,500	151.00	226,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,600	960.00	9,216,000	
K e e P e r 技研	11,300	3,995.00	45,143,500	
ファーストロジック	1,500	635.00	952,500	
三機サービス	800	1,078.00	862,400	
G u n o s y	14,600	925.00	13,505,000	
デザインワン・ジャパン	2,500	133.00	332,500	
イー・ガーディアン	8,800	1,918.00	16,878,400	
リブセンス	3,000	189.00	567,000	
ジャパンマテリアル	55,800	1,746.00	97,426,800	
ベクトル	21,900	946.00	20,717,400	
ウチヤマホールディングス	2,200	334.00	734,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,300	1,449.00	22,169,700	
キャリアリンク	6,700	2,500.00	16,750,000	
I B J	14,200	627.00	8,903,400	
アサンテ	9,100	1,667.00	15,169,700	
バリューHR	16,400	1,631.00	26,748,400	
M&Aキャピタルパートナーズ	14,800	2,310.00	34,188,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,400	1,003.00	7,422,200	
E R I ホールディングス	1,200	2,033.00	2,439,600	
アビスト	700	3,470.00	2,429,000	
シグマクシス・ホールディングス	24,000	1,468.00	35,232,000	
ウィルグループ	15,400	961.00	14,799,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,000	141.00	846,000	
メドピア	14,900	633.00	9,431,700	
レアジョブ	1,200	401.00	481,200	
リクルートホールディングス	1,311,300	8,899.00	11,669,258,700	
エラン	24,300	831.00	20,193,300	
土木管理総合試験所	2,400	317.00	760,800	
日本郵政	1,903,400	1,422.00	2,706,634,800	
ベルシステム24ホールディングス	19,700	1,509.00	29,727,300	
鎌倉新書	15,900	428.00	6,805,200	
SMN	1,400	301.00	421,400	
グローバルキッズCOMPANY	1,000	749.00	749,000	

エアトリ	13,500	1,310.00	17,685,000	
アトラエ	13,500	879.00	11,866,500	
ストライク	9,000	4,405.00	39,645,000	
ソラスト	50,500	590.00	29,795,000	
セラク	5,700	1,398.00	7,968,600	
インソース	39,700	1,042.00	41,367,400	
ベイカレント・コンサルティング	133,900	4,564.00	611,119,600	
Orchestra Holdings	4,200	929.00	3,901,800	
アイモバイル	23,500	475.00	11,162,500	
キャリアインデックス	2,300	200.00	460,000	
MS-Japan	8,500	1,032.00	8,772,000	
船場	1,000	1,240.00	1,240,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	59,100	2,876.00	169,971,600	
フルテック	700	1,135.00	794,500	
GameWith	2,400	210.00	504,000	
MS&Consulting	800	529.00	423,200	
エル・ティー・エス	2,500	1,840.00	4,600,000	
ミダックホールディングス	11,100	1,719.00	19,080,900	
キュービーネットホールディングス	10,600	1,093.00	11,585,800	
オープングループ	25,500	226.00	5,763,000	
スプリックス	1,400	766.00	1,072,400	
マネジメントソリューションズ	9,000	1,351.00	12,159,000	
プロレド・パートナーズ	4,800	531.00	2,548,800	
テノ.ホールディングス	900	413.00	371,700	
フロンティア・マネジメント	5,600	1,126.00	6,305,600	
コプロ・ホールディングス	1,400	1,594.00	2,231,600	
ギークス	900	453.00	407,700	
アンビスホールディングス	39,100	2,694.00	105,335,400	
カーブスホールディングス	50,000	787.00	39,350,000	
フォーラムエンジニアリング	24,900	1,036.00	25,796,400	
Fast Fitness Japan	6,300	1,275.00	8,032,500	
ダイレクトマーケティングミックス	22,900	230.00	5,267,000	
ポピンズ	3,500	1,498.00	5,243,000	
LITALICO	14,300	1,265.00	18,089,500	
コンフィデンス・インターワークス	400	1,836.00	734,400	
アドバンテッジリスクマネジメント	2,300	588.00	1,352,400	
リログループ	91,300	1,865.50	170,320,150	
東祥	13,000	685.00	8,905,000	
ID&Eホールディングス	11,000	4,000.00	44,000,000	
ビーウィズ	3,800	1,900.00	7,220,000	
TREホールディングス	35,000	1,698.00	59,430,000	
人・夢・技術グループ	7,600	1,815.00	13,794,000	

N I S S Oホールディングス	16,000	776.00	12,416,000	
大栄環境	33,100	2,994.00	99,101,400	
日本管財ホールディングス	19,200	2,679.00	51,436,800	
M&A総研ホールディングス	19,700	3,245.00	63,926,500	
エイチ・アイ・エス	58,300	1,886.00	109,953,800	
ラックランド	8,300	2,228.00	18,492,400	
共立メンテナンス	57,200	2,380.00	136,136,000	
イチネンホールディングス	19,400	1,820.00	35,308,000	
建設技術研究所	9,400	4,625.00	43,475,000	
スペース	13,400	1,175.00	15,745,000	
燦ホールディングス	16,900	1,176.00	19,874,400	
スバル興業	7,100	2,956.00	20,987,600	
東京テアトル	1,400	1,105.00	1,547,000	
タナベコンサルティンググループ	8,000	1,200.00	9,600,000	
ナガワ	5,700	7,470.00	42,579,000	
東京都競馬	13,400	4,125.00	55,275,000	
カナモト	28,300	2,805.00	79,381,500	
ニシオホールディングス	15,100	4,115.00	62,136,500	
トランス・コスモス	20,400	3,480.00	70,992,000	
乃村工藝社	79,600	851.00	67,739,600	
藤田観光	8,100	9,700.00	78,570,000	
KNT－CTホールディングス	10,900	1,289.00	14,050,100	
トーカイ	16,200	2,321.00	37,600,200	
セコム	185,400	10,695.00	1,982,853,000	
セントラル警備保障	9,900	2,740.00	27,126,000	
丹青社	35,500	930.00	33,015,000	
メイテックグループホールディングス	62,100	3,413.00	211,947,300	
応用地質	17,100	2,505.00	42,835,500	
船井総研ホールディングス	36,500	2,321.00	84,716,500	
進学会ホールディングス	1,800	228.00	410,400	
オオバ	2,800	1,055.00	2,954,000	
いであ	1,100	2,334.00	2,567,400	
学究社	7,400	1,999.00	14,792,600	
イオンディライト	19,600	4,070.00	79,772,000	
ナック	15,800	565.00	8,927,000	
ダイセキ	37,200	3,810.00	141,732,000	
ステップ	6,700	2,025.00	13,567,500	
合 計	289,133,300		671,252,357,970	

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	19,112,434,227
コール・ローン	675,085,324
株式	708,772,748,806
投資信託受益証券	123,000,208
投資証券	14,020,241,354
派生商品評価勘定	727,593,981
未収入金	3,582,586
未収配当金	843,472,490
未収利息	4,026
差入委託証拠金	7,317,978,981
流動資産合計	751,596,141,983
資産合計	751,596,141,983
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,674,171
前受金	705,926,488
未払解約金	67,332,495
流動負債合計	796,933,154
負債合計	796,933,154
純資産の部	
元本等	
元本	116,029,281,760
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	634,769,927,069
元本等合計	750,799,208,829
純資産合計	750,799,208,829
負債純資産合計	751,596,141,983

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月28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

	2024年 8月28日現在
	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	(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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	(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。
4.収益及び費用の計上基準	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。
	(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 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	116,029,281,760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 6.4708円 (1万口当たり純資産額) (64,708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 8月28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。

	2024年 8月28日現在
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 8月28日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月29日
期首元本額	113,397,092,534円
期中追加設定元本額	13,356,699,340円
期中一部解約元本額	10,724,510,114円
期末元本額	116,029,281,760円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,400,681,282円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,302,007円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,611,998,911円
世界経済インデックスファンド	14,795,704,102円
外国株式インデックス・オープン	873,825,444円
DCマイセクション25	516,675,435円
DCマイセクション50	2,988,839,435円
DCマイセクション75	3,942,134,273円
DC外国株式インデックス・オープン	13,295,199,579円
DCマイセクションS25	323,724,691円
DCマイセクションS50	1,778,781,121円
DCマイセクションS75	1,926,020,942円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	7,952,072円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	114,940,898円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	95,891,528円
DC世界経済インデックスファンド	8,446,415,378円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	848,980,894円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,832,407円

区分	2024年 8月28日現在
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,714,147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）	12,072,067円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	5,186,390円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	22,984,679円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	5,864,170円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	17,234,457円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	101,633,046円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	104,066,191円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	819,788,982円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	55,675,476円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	12,028,670円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	87,857,680円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	28,312,193円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	699,973,311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）	679,934,208円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,145,782,544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	1,373,514,140円
分散投資コア戦略ファンドS	6,645,092,841円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,541,900,078円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	970,169,305円
コア投資戦略ファンド（切替型）	84,277,565円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	425,156,525円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	22,412,928円
SMT インデックスバランス・オープン	102,980,162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）	4,941,593,100円
SMT 世界経済インデックス・オープン	268,013,508円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,254,694,238円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	203,180,703円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,572,834円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	2,795,024,228円
グローバル経済コア	667,157,823円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,861,542円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,671,369円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	95,535,998円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,143,797円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	166,355,654円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	170,940,805円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	77,476,942円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	98,770,683円
10資産分散投資ファンド	59,789,984円
グローバル10資産バランスファンド	18,957,993円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	2,420,579円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2035	22,933円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2040	22,941円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2045	24,654円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2050	24,654円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2055	32,690円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2060	14,732円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2065	11,713円
DCマイセレクション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）	43,633,636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）	349,613,553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）	675,444,771円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,459,019,017円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	112,282,172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）	52,091,389円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	73,729,182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）	81,701,663円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	148,051,885円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	161,831,680円

区分	2024年 8月28日現在
SMT AM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	161,134,831円
SMT AM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	144,550,011円
SMT AM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	143,116,935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）	66,943,643円
SMT AM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	103,069,147円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	29,536,904,686
投資信託受益証券	△641,678
投資証券	1,845,176,727
合計	31,381,439,735

(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 8月28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	28,465,992,633	—	29,171,919,121	705,926,488
合計		28,465,992,633	—	29,171,919,121	705,926,488

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2024年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,026,680,700	—	2,024,674,022	△2,006,678
	アメリカドル	1,705,235,500	—	1,703,408,872	△1,826,628
	ユーロ	225,849,200	—	225,670,900	△178,300
	イギリスポンド	95,596,000	—	95,594,250	△1,750
合計		2,026,680,700	—	2,024,674,022	△2,006,678

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表 (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	33,009	28.43	938,445.87	
	BAKER HUGHES CO	77,332	35.40	2,737,552.80	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	184.19	3,333,654.81	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	72.98	619,016.36	
	CHEVRON CORP	135,746	146.95	19,947,874.70	
	CHORD ENERGY CORP	4,800	147.19	706,512.00	
	CONOCOPHILLIPS	90,345	112.43	10,157,488.35	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	24.21	1,320,558.66	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	44.65	2,243,930.40	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	194.71	2,583,217.57	
	EOG RESOURCES INC	45,763	128.56	5,883,291.28	
	EQT CORPORATION	43,539	32.75	1,425,902.25	
	EXXON MOBIL	346,986	117.68	40,833,312.48	
	HALLIBURTON CO	70,302	31.62	2,222,949.24	
	HESS CORP	21,602	137.47	2,969,626.94	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	47.28	634,923.12	
	KINDER MORGAN INC	160,038	21.39	3,423,212.82	
	MARATHON OIL CORP	39,344	28.33	1,114,615.52	
	MARATHON PETROLEUM CORP	27,588	169.89	4,686,925.32	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	56.84	2,808,237.04	
	ONEOK INC	43,535	88.44	3,850,235.40	
	OVINTIV INC	20,398	43.24	882,009.52	
	PHILLIPS 66	32,264	134.38	4,335,636.32	
	SCHLUMBERGER	110,287	45.04	4,967,326.48	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	145.13	2,510,458.74	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,599	858.32	1,372,453.68	
	VALERO ENERGY CORP	26,282	140.93	3,703,922.26	
	WILLIAMS COS	97,655	45.38	4,431,583.90	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	277.91	4,857,588.89	
	ALBEMARLE CORP	8,403	88.98	747,698.94	
	AMCOR PLC	110,292	11.16	1,230,858.72	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	217.42	1,443,233.96	
	BALL CORP	25,896	64.06	1,658,897.76	
	CELANESE CORP-SERIES A	8,582	130.99	1,124,156.18	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,872	81.62	1,050,612.64
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	14.05	604,150.00
CORTEVA INC	51,757	55.56	2,875,618.92
CRH PLC	52,103	88.12	4,591,316.36
CROWN HOLDINGS INC	9,940	89.67	891,319.80
DOW INC	56,967	53.77	3,063,115.59
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	82.49	2,814,476.31
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	100.62	888,675.84
ECOLAB INC	20,345	248.65	5,058,784.25
FREEPORT-MCMORAN INC	110,698	45.23	5,006,870.54
INT'L PAPER CO	25,191	48.99	1,234,107.09
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	100.82	1,946,531.74
LINDE PLC	37,432	472.34	17,680,630.88
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	97.71	1,929,283.95
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	518.57	2,601,665.69
MOSAIC CO/THE	27,732	28.89	801,177.48
NEWMONT CORPORATION	86,194	52.70	4,542,423.80
NUCOR CORP	18,727	150.37	2,815,978.99
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,221	204.91	1,274,745.11
PPG INDUSTRIES INC	17,495	127.11	2,223,789.45
RELIANCE INC	4,126	281.78	1,162,624.28
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	113.24	1,184,037.44
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,426	359.98	6,632,991.48
SMURFIT WESTROCK PLC	40,860	46.89	1,915,925.40
STEEL DYNAMICS INC	11,618	121.41	1,410,541.38
VULCAN MATERIALS CO	10,153	240.41	2,440,882.73
WESTLAKE CORP	2,222	145.40	323,078.80
3 M COMPANY	43,663	131.40	5,737,318.20
AECOM	10,456	101.66	1,062,956.96
AERCAP HOLDINGS NV	14,679	94.50	1,387,165.50
ALLEGION PLC	7,721	137.21	1,059,398.41
AMETEK INC	17,753	167.98	2,982,148.94
AXON ENTERPRISE INC	5,367	363.43	1,950,528.81
BOEING CO	44,809	173.05	7,754,197.45
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,522	174.62	1,662,731.64
CARLISLE COS INC	3,456	416.41	1,439,112.96
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	71.76	4,453,640.88
CATERPILLAR	38,627	351.12	13,562,712.24
CNH INDUSTRIAL NV	54,445	10.14	552,072.30
CUMMINS INC	10,453	306.37	3,202,485.61
DEERE&CO	20,534	375.98	7,720,373.32
DOVER CORP	10,657	182.49	1,944,795.93

EATON CORP	30,932	296.03	9,156,799.96
EMCOR GROUP INC	3,640	380.87	1,386,366.80
EMERSON ELECTRIC CO	44,010	103.86	4,570,878.60
FASTENAL CO	44,011	67.68	2,978,664.48
FERGUSON ENTERPRISES INC	16,260	209.00	3,398,340.00
FORTIVE CORP	25,894	73.83	1,911,754.02
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	79.30	817,583.00
GE VERNOVA INC	20,868	185.55	3,872,057.40
GENERAL DYNAMICS CORP	18,159	290.20	5,269,741.80
GENERAL ELECTRIC CO	85,192	170.99	14,566,980.08
GRACO INC	13,378	81.76	1,093,785.28
GRAINGER (WW) INC	3,363	967.36	3,253,231.68
HEICO CORP	3,640	247.39	900,499.60
HEICO CORP-CLASS A	5,700	192.81	1,099,017.00
HONEYWELL INTL INC	51,027	206.11	10,517,174.97
HOWMET AEROSPACE INC	31,648	96.95	3,068,273.60
HUBBELL INC	4,458	387.97	1,729,570.26
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,433	276.91	950,632.03
IDEX CORP	5,916	203.59	1,204,438.44
ILLINOIS TOOL WORKS	22,812	249.27	5,686,347.24
INGERSOLL-RAND INC	31,562	90.63	2,860,464.06
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	36.55	464,185.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	54,141	71.45	3,868,374.45
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	230.06	3,377,740.92
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	578.16	1,460,432.16
LOCKHEED MARTIN CORP	16,743	560.41	9,382,944.63
MASCO CORP	18,934	79.05	1,496,732.70
NORDSON CORP	4,121	255.90	1,054,563.90
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,696	512.44	5,481,058.24
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	93.13	2,860,674.21
OWENS CORNING	6,460	167.22	1,080,241.20
PACCAR INC	40,380	94.36	3,810,256.80
PARKER HANNIFIN CORP	9,881	590.09	5,830,679.29
PENTAIR PLC	14,383	85.82	1,234,349.06
QUANTA SERVICES INC	11,573	270.36	3,128,876.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	263.32	2,229,267.12
RTX CORP	102,848	119.49	12,289,307.52
SMITH (A.O.) CORP	9,016	81.76	737,148.16
SNAP-ON INC	4,000	282.13	1,128,520.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	99.79	1,257,154.42
TEXTRON	13,876	89.53	1,242,318.28
TORO CO	8,812	90.60	798,367.20

TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,000	352.56	6,346,080.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,240	1,326.23	5,623,215.20
UNITED RENTALS INC	5,364	736.45	3,950,317.80
VERTIV HOLDINGS CO-A	29,005	80.21	2,326,491.05
WABTEC CORP	13,304	164.81	2,192,632.24
WATSCO INC	2,656	472.01	1,253,658.56
XYLEM INC	19,668	135.42	2,663,440.56
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,919	274.68	8,767,510.92
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	155.75	1,439,130.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,640	210.16	2,025,942.40
CINTAS CORP	7,043	799.59	5,631,512.37
COPART INC	69,100	52.59	3,633,969.00
DAYFORCE INC	10,668	58.55	624,611.40
EQUIFAX INC	9,160	303.24	2,777,678.40
JACOBS SOLUTIONS INC	8,836	149.98	1,325,223.28
LEIDOS HOLDINGS	9,314	156.06	1,453,542.84
PAYCHEX INC	24,118	130.10	3,137,751.80
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	163.10	690,728.50
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	161.73	553,601.79
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	206.97	3,405,691.35
ROLLINS INC	25,466	49.56	1,262,094.96
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	74.28	1,144,060.56
TRANSUNION	15,741	96.47	1,518,534.27
VERALTO CORP	17,691	111.15	1,966,354.65
VERISK ANALYTICS INC	10,738	268.92	2,887,662.96
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	186.01	3,678,347.75
WASTE MANAGEMENT INC	30,660	209.20	6,414,072.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	103.60	866,821.20
CSX CORP	152,551	33.58	5,122,662.58
DELTA AIR LINES INC	15,193	40.81	620,026.33
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	122.30	1,501,844.00
FEDEX CORP	17,725	294.90	5,227,102.50
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	190,364	3.24	616,779.36
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	172.10	989,230.80
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	51.59	702,810.57
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,982	248.89	4,475,539.98
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,712	192.86	2,837,356.32
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	29.11	393,945.63
U-HAUL HOLDING CO	6,606	67.61	446,631.66
UBER TECHNOLOGIES INC	144,319	72.56	10,471,786.64
UNION PACIFIC CORP	46,736	250.35	11,700,357.60
UNITED PARCEL SERVICE B	55,567	127.90	7,107,019.30

APTIV PLC	21,896	70.83	1,550,893.68
FORD MOTOR COMPANY	290,990	11.14	3,241,628.60
GENERAL MOTORS CO	89,296	49.25	4,397,828.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	14.48	743,345.28
TESLA INC	221,215	209.21	46,280,390.15
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	952.84	2,003,822.52
DR HORTON INC	22,973	187.54	4,308,356.42
GARMIN LTD	11,170	180.65	2,017,860.50
LENNAR CORP-CL A	18,864	182.36	3,440,039.04
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	271.18	2,337,300.42
NIKE B	94,445	85.29	8,055,214.05
NVR INC	247	9,076.03	2,241,779.41
PULTE GROUP INC	16,747	131.58	2,203,570.26
AIRBNB INC-CLASS A	34,827	116.74	4,065,703.98
BOOKING HOLDINGS INC	2,619	3,881.45	10,165,517.55
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	37.80	663,768.00
CARNIVAL CORPORATION	71,810	17.04	1,223,642.40
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	104,450	56.14	5,863,823.00
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	156.74	1,443,105.18
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	418.41	1,191,631.68
DOORDASH INC - A	21,857	128.48	2,808,187.36
DRAFTKINGS INC	32,654	35.33	1,153,665.82
EXPEDIA GROUP INC	9,628	140.80	1,355,622.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	218.34	4,287,105.90
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	148.51	562,407.37
LAS VEGAS SANDS CORP	30,565	39.94	1,220,766.10
MARRIOTT INTL A	19,516	227.62	4,442,231.92
MCDONALD'S CORP	55,965	289.64	16,209,702.60
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,462	38.01	587,710.62
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,429	169.02	3,114,869.58
STARBUCKS CORP	88,273	98.60	8,703,717.80
WYNN RESORTS LTD	6,702	77.04	516,322.08
YUM BRANDS INC	22,162	134.50	2,980,789.00
ALPHABET INC-CL A	455,214	164.68	74,964,641.52
ALPHABET INC-CL C	394,786	166.38	65,684,494.68
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	360.77	2,594,657.84
COMCAST CORP-CL A	309,993	40.24	12,474,118.32
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	149.20	2,944,262.26
FOX CORP - CLASS A	21,544	41.04	884,165.76
FOX CORP- CLASS B	10,345	38.11	394,247.95
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	32.49	926,322.39
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	77.39	1,190,180.81

LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	96.59	1,121,699.67
MATCH GROUP INC	22,730	37.09	843,055.70
META PLATFORMS INC-CLASS A	169,631	519.10	88,055,452.10
NETFLIX INC	33,607	695.72	23,381,062.04
NEWS CORP-CLASS A	33,479	27.98	936,742.42
OMNICOM GROUP	14,048	99.11	1,392,297.28
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	10.52	341,984.16
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	31.53	1,443,033.51
ROBLOX CORP -CLASS A	35,113	44.16	1,550,590.08
ROKU INC	9,122	69.74	636,168.28
SEA LTD-ADR	28,338	82.32	2,332,784.16
SNAP INC - A	72,602	9.50	689,719.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	160.78	2,068,756.26
THE WALT DISNEY CO	142,615	90.90	12,963,703.50
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	103.92	3,489,945.36
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	8.11	1,438,819.43
AMAZON.COM	724,185	173.12	125,370,907.20
AUTOZONE INC	1,368	3,181.85	4,352,770.80
BATH & BODY WORKS INC	13,452	34.72	467,053.44
BEST BUY COMPANY INC	15,285	88.88	1,358,530.80
BURLINGTON STORES INC	5,108	278.99	1,425,080.92
CARMAX INC	10,695	84.41	902,764.95
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	236.30	1,169,685.00
EBAY	41,952	59.37	2,490,690.24
ETSY INC	10,294	55.39	570,184.66
GENUINE PARTS CO	9,903	142.71	1,413,257.13
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	34.75	243,250.00
HOME DEPOT	77,067	373.18	28,759,863.06
LKQ CORP	19,286	42.40	817,726.40
LOWES COMPANIES	44,328	248.57	11,018,610.96
MERCADOLIBRE INC	3,573	2,036.21	7,275,378.33
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	1,127.73	5,161,620.21
POOL CORP	2,664	351.92	937,514.88
ROSS STORES INC	25,425	153.33	3,898,415.25
TJX COMPANIES INC	88,680	120.06	10,646,920.80
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	272.94	2,141,487.24
ULTA BEAUTY INC	3,920	371.35	1,455,692.00
WILLIAMS-SONOMA INC	8,920	134.33	1,198,223.60
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	20.63	515,750.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,237	908.90	31,118,009.30
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	125.12	2,037,829.44
DOLLAR TREE INC	16,318	95.40	1,556,737.20

KROGER CO	50,664	52.72	2,671,006.08
SYSCO CORP	40,090	76.20	3,054,858.00
TARGET (DAYTON HUDSON)	35,264	158.68	5,595,691.52
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	9.45	487,308.15
WALMART INC	342,809	76.13	26,098,049.17
ALTRIA GROUP INC	132,873	53.01	7,043,597.73
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	60.56	2,459,826.08
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,082	45.10	635,098.20
BUNGE GLOBAL SA	11,604	100.32	1,164,113.28
CAMPBELL SOUP CO	15,869	49.84	790,910.96
CELSIUS HOLDINGS INC	13,069	39.80	520,146.20
COCA-COLA CO	316,878	71.50	22,656,777.00
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	79.99	1,231,366.06
CONAGRA BRANDS INC	33,324	31.27	1,042,041.48
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	239.98	3,149,977.48
GENERAL MILLS INC	43,531	71.03	3,092,006.93
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	191.13	2,091,344.46
HORMEL FOODS CORP	23,338	32.21	751,716.98
JM SMUCKER CO	7,850	120.70	947,495.00
KELLANOVA	23,448	80.79	1,894,363.92
KEURIG DR PEPPER INC	81,153	36.37	2,951,534.61
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	35.74	2,464,773.36
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	62.24	739,162.24
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	79.26	1,433,971.92
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	53.55	785,524.95
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,431	71.25	7,511,958.75
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	47.59	2,776,781.32
PEPSICO INC	107,105	175.30	18,775,506.50
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	118,983	122.41	14,564,709.03
TYSON FOODS INC	23,306	63.93	1,489,952.58
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	101.15	1,956,847.90
CLOROX COMPANY	9,570	156.49	1,497,609.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	105.92	6,560,472.96
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	92.87	1,745,956.00
KENVUE INC	148,093	21.92	3,246,198.56
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	143.54	3,857,924.58
PROCTER & GAMBLE CO	181,466	169.25	30,713,120.50
ABBOTT LABORATORIES	133,298	113.10	15,076,003.80
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	236.28	1,241,178.84
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	37.91	1,576,146.16
BECTON DICKINSON & CO	22,142	237.97	5,269,131.74
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,121	79.83	8,950,619.43

CARDINAL HEALTH	19,151	110.08	2,108,142.08	
CENCORA INC	14,462	233.50	3,376,877.00	
CENTENE CORP	40,934	78.00	3,192,852.00	
COOPER COS INC/THE	12,923	94.35	1,219,285.05	
CVS HEALTH CORP	99,034	57.46	5,690,493.64	
DAVITA INC	4,627	154.85	716,490.95	
DEXCOM INC	28,772	72.24	2,078,489.28	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44,930	69.63	3,128,475.90	
ELEVANCE HEALTH INC	18,232	548.43	9,998,975.76	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	32,998	84.41	2,785,361.18	
HCA HEALTHCARE INC	15,457	390.18	6,031,012.26	
HENRY SCHEIN INC	8,755	72.16	631,760.80	
HOLOGIC INC	18,875	79.71	1,504,526.25	
HUMANA INC	9,013	353.45	3,185,644.85	
IDEXX LABORATORIES INC	6,644	482.56	3,206,128.64	
INSULET CORP	5,246	192.58	1,010,274.68	
INTUITIVE SURGICAL INC	27,718	482.35	13,369,777.30	
LABCORP HOLDINGS INC	6,548	230.21	1,507,415.08	
MCKESSON CORP	10,179	550.72	5,605,778.88	
MEDTRONIC PLC	102,632	88.80	9,113,721.60	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	349.81	1,589,886.45	
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	153.60	1,333,094.40	
RESMED INC	10,920	242.25	2,645,370.00	
SOLVENTUM CORP	10,915	60.55	660,903.25	
STERIS PLC	8,172	236.43	1,932,105.96	
STRYKER CORP	26,379	358.51	9,457,135.29	
TELEFLEX INC	3,934	241.81	951,280.54	
THE CIGNA GROUP	21,946	353.89	7,766,469.94	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,401	587.35	41,937,377.35	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	235.36	1,099,601.92	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	200.25	2,501,322.75	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	114.67	1,749,176.18	
ABBVIE INC	136,294	195.92	26,702,720.48	
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	141.10	3,074,710.10	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	280.26	2,702,547.18	
AMGEN	41,885	326.93	13,693,463.05	
AVANTOR INC	49,647	25.61	1,271,459.67	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	319.37	591,792.61	
BIO-TECHNE CORP	12,980	71.03	921,969.40	
BIOGEN INC	10,740	203.30	2,183,442.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	90.46	1,337,270.18	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	155,274	48.12	7,471,784.88	

CATALENT INC	13,739	59.40	816,096.60
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	203.30	854,673.20
DANAHER CORP	54,787	268.82	14,727,841.34
ELI LILLY & CO	62,575	954.48	59,726,586.00
EXACT SCIENCES CORP	12,208	59.89	731,137.12
GILEAD SCIENCES INC	96,270	77.00	7,412,790.00
ILLUMINA INC	11,423	130.90	1,495,270.70
INCYTE CORP	15,212	65.63	998,363.56
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	248.60	3,439,629.60
JOHNSON & JOHNSON	187,239	162.95	30,510,595.05
MERCK & CO	195,618	116.50	22,789,497.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,422.59	2,314,553.93
MODERNA INC	25,884	78.98	2,044,318.32
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	152.55	1,028,492.10
PFIZER	432,739	28.82	12,471,537.98
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,327	1,201.76	10,007,055.52
REPLIGEN CORP	4,353	146.03	635,668.59
REVVITY INC	8,524	122.44	1,043,678.56
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	28.52	857,967.16
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	18.76	1,728,565.16
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29,526	610.40	18,022,670.40
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	349.23	1,263,514.14
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,876	480.30	9,546,442.80
VIATRIS INC	89,720	11.69	1,048,826.80
WATERS CORP	4,749	336.77	1,599,320.73
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	302.63	1,745,267.21
ZOETIS INC	35,994	182.10	6,554,507.40
BANK OF AMERICA CORP	549,785	39.67	21,809,970.95
CITIGROUP	146,698	61.68	9,048,332.64
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	42.27	1,670,594.94
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	41.71	2,269,858.20
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,960.58	1,501,804.28
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	14.59	1,664,894.08
JPMORGAN CHASE & CO	222,518	220.18	48,994,013.24
KEY CORP	71,223	16.67	1,187,287.41
M & T BANK CORP	13,791	167.40	2,308,613.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,533	179.15	5,649,136.95
REGIONS FINL CORP	70,810	22.76	1,611,635.60
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	43.91	4,669,477.22
US BANCORP	117,317	45.73	5,364,906.41
WELLS FARGO & CO	273,850	56.26	15,406,801.00
ALLY FINANCIAL INC	21,529	42.93	924,239.97

AMERICAN EXPRESS	45,006	255.03	11,477,880.18
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	439.33	3,433,803.28
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	29,517	113.58	3,352,540.86
ARES MANAGEMENT CORP - A	14,741	146.14	2,154,249.74
BANK NEW YORK CO	56,329	67.21	3,785,872.09
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,297	460.63	46,660,437.11
BLACKROCK INC	11,583	886.13	10,264,043.79
BLACKSTONE INC	55,334	141.25	7,815,927.50
BLOCK INC	42,352	66.64	2,822,337.28
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	142.38	4,285,210.86
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	40.29	631,304.01
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	211.35	1,860,514.05
CME GROUP INC	27,997	212.40	5,946,562.80
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	14,368	198.30	2,849,174.40
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	28.87	555,718.63
CORPAY INC	4,988	303.57	1,514,207.16
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	133.33	2,531,536.71
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	41.95	1,173,886.85
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	411.71	1,296,063.08
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	45,470	81.53	3,707,169.10
FISERV INC	46,319	170.17	7,882,104.23
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	20.34	530,263.80
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	61.52	265,520.32
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	109.98	2,281,975.02
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,012	507.26	12,687,587.12
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,122	160.60	7,085,993.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	171.39	893,456.07
KKR & CO INC	47,919	122.39	5,864,806.41
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,490	227.21	1,247,382.90
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	235.60	755,569.20
MASTERCARD INC-CLASS A	64,241	474.99	30,513,832.59
MOODY'S CORP	12,577	484.18	6,089,531.86
MORGAN STANLEY	93,827	102.08	9,577,860.16
MSCI INC	5,952	584.91	3,481,384.32
NASDAQ INC	29,020	71.05	2,061,871.00
NORTHERN TRUST CORP	15,902	88.90	1,413,687.80
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	71.59	5,676,084.74
PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	107.90	1,971,872.50
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	117.68	1,822,392.48
ROBINHOOD MARKETS INC - A	46,668	21.36	996,828.48
S&P GLOBAL INC	24,501	505.39	12,382,560.39
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,095	63.91	7,483,541.45

SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	66.93	639,181.50
STATE STREET CORP	22,335	85.48	1,909,195.80
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	48.81	1,425,056.76
TOAST INC-CLASS A	31,526	24.75	780,268.50
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	117.21	1,062,039.81
VISA INC-CLASS A SHARES	122,188	270.72	33,078,735.36
AFLAC	43,196	107.71	4,652,641.16
ALLSTATE CORP	20,722	185.14	3,836,471.08
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	130.94	827,409.86
AMERICAN INT'L GROUP	50,875	74.43	3,786,626.25
AON PLC	15,249	340.26	5,188,624.74
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	110.68	3,291,291.16
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,294	290.06	4,726,237.64
ASSURANT INC	4,726	194.10	917,316.60
BROWN & BROWN INC	20,155	103.00	2,075,965.00
CHUBB LTD	30,987	277.21	8,589,906.27
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	133.60	1,484,296.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	488.54	1,058,177.64
EVEREST GROUP LTD	3,288	388.13	1,276,171.44
FNF GROUP	20,461	58.40	1,194,922.40
HARTFORD FINANCIAL SVCS	21,873	113.46	2,481,710.58
LOEWS CORP	16,402	80.67	1,323,149.34
MARKEL GROUP INC	1,007	1,573.25	1,584,262.75
MARSH & MCLENNAN COS	38,224	226.32	8,650,855.68
METLIFE INC	48,925	75.02	3,670,353.50
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	79.45	1,472,685.20
PROGRESSIVE CORP	45,236	245.57	11,108,604.52
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,649	117.92	3,142,450.08
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	223.64	3,834,755.08
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	288.04	2,228,565.48
WR BERKLEY CORP	21,540	58.71	1,264,613.40
WEYERHAEUSER CO	52,615	30.60	1,610,019.00
ACCENTURE PLC-CL A	48,353	340.38	16,458,394.14
ADOBE INC	34,893	567.82	19,812,943.26
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	101.31	1,163,444.04
ANSYS INC	6,794	318.41	2,163,277.54
APPLOVIN CORP-CLASS A	12,260	90.30	1,107,078.00
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	214.36	513,177.84
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	164.32	1,879,163.52
AUTODESK INC	17,030	256.99	4,376,539.70
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	51.95	769,535.35
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,140	268.93	5,685,180.20

CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	188.20	1,328,315.60
CLOUDFLARE INC - CLASS A	23,067	81.26	1,874,424.42
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	37,006	77.15	2,855,012.90
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	21.07	259,161.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,478	269.83	4,716,088.74
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	281.87	873,797.00
DATADOG INC - CLASS A	20,780	116.02	2,410,895.60
DOCUSIGN INC	14,969	58.46	875,087.74
DYNATRACE INC	22,028	49.87	1,098,536.36
EPAM SYSTEMS INC	4,768	200.25	954,792.00
FAIR ISAAC CORP	2,026	1,714.90	3,474,387.40
FORTINET INC	49,270	75.97	3,743,041.90
GARTNER INC	5,859	485.77	2,846,126.43
GEN DIGITAL INC	43,555	26.35	1,147,674.25
GODADDY INC - CLASS A	11,388	164.72	1,875,831.36
HUBSPOT INC	3,646	502.01	1,830,328.46
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,082	198.73	14,126,125.86
INTUIT INC	21,468	626.32	13,445,837.76
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	261.69	1,228,372.86
MICROSOFT CORP	546,006	413.84	225,959,123.04
MICROSTRATEGY INC-CL A	12,190	140.01	1,706,721.90
MONDAY.COM LTD	2,838	259.41	736,205.58
MONGODB INC	5,325	238.85	1,271,876.25
OKTA INC	11,505	96.98	1,115,754.90
ORACLE CORP	126,564	138.48	17,526,582.72
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,919	30.84	4,530,981.96
PALO ALTO NETWORKS INC	25,444	350.19	8,910,234.36
PTC INC	9,741	176.06	1,715,000.46
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	551.20	4,660,947.20
SALESFORCE INC	74,662	264.20	19,725,700.40
SAMSARA INC-CL A	13,283	41.98	557,620.34
SERVICENOW INC	15,986	831.74	13,296,195.64
SNOWFLAKE INC-CLASS A	23,538	115.54	2,719,580.52
SYNOPSYS INC	11,896	521.78	6,207,094.88
TWILIO INC - A	12,842	61.99	796,075.58
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	578.59	1,931,912.01
UIPATH INC - CLASS A	28,419	12.86	365,468.34
UNITY SOFTWARE INC	16,437	17.26	283,702.62
VERISIGN INC	6,723	181.74	1,221,838.02
WIX.COM LTD	5,010	166.86	835,968.60
WORKDAY INC-CLASS A	16,432	264.68	4,349,221.76
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,869	71.90	1,500,481.10

ZSCALER INC	7,204	197.22	1,420,772.88
AMPHENOL CORPORATION	91,720	66.52	6,101,214.40
APPLE INC	1,134,924	228.03	258,796,719.72
ARISTA NETWORKS INC	20,702	345.62	7,155,025.24
CDW CORP/DE	9,823	226.99	2,229,722.77
CISCO SYSTEMS	312,372	50.71	15,840,384.12
CORNING	66,604	42.52	2,832,002.08
DELL TECHNOLOGIES -C	20,331	111.86	2,274,225.66
F5 INC	4,851	199.71	968,793.21
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	19.10	1,860,951.20
HP INC	77,024	35.60	2,742,054.40
JABIL INC	9,340	107.60	1,004,984.00
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	38.85	983,720.85
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	154.10	2,132,435.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	432.36	5,689,425.24
NETAPP INC	15,191	133.12	2,022,225.92
PURE STORAGE INC - CLASS A	23,875	61.12	1,459,240.00
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,548	100.71	1,465,129.08
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,216	547.64	2,308,850.24
TE CONNECTIVITY LTD	23,161	151.87	3,517,461.07
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	425.53	1,412,759.60
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	56.60	1,002,838.80
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	62.85	1,620,901.50
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	346.04	1,440,218.48
AT&T INC	548,004	19.65	10,768,278.60
T-MOBILE US INC	41,896	204.03	8,548,040.88
VERIZON COMMUNICATIONS	322,255	41.45	13,357,469.75
AES CORP	54,375	17.37	944,493.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	57.59	1,196,605.02
AMEREN CORPORATION	20,898	81.65	1,706,321.70
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	98.54	4,012,548.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	140.17	2,027,979.56
ATMOS ENERGY CORP	11,302	129.31	1,461,461.62
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	27.22	1,292,024.52
CMS ENERGY CORP	23,697	67.45	1,598,362.65
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	99.59	2,756,153.25
CONSTELLATION ENERGY	23,831	196.14	4,674,212.34
DOMINION ENERGY INC	62,863	56.03	3,522,213.89
DTE ENERGY COMPANY	15,851	123.88	1,963,621.88
DUKE ENERGY CORP	60,351	111.90	6,753,276.90
EDISON INTL	30,900	84.78	2,619,702.00
ENTERGY CORP	16,181	119.08	1,926,833.48

ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	38.94	794,337.06
EVERGY INC	18,475	58.65	1,083,558.75
EVERSOURCE ENERGY	27,450	66.44	1,823,778.00
EXELON CORP	81,573	37.68	3,073,670.64
FIRSTENERGY CORP	39,425	43.18	1,702,371.50
NEXTERA ENERGY INC	160,662	79.61	12,790,301.82
NISOURCE INC	32,351	32.72	1,058,524.72
NRG ENERGY INC	13,109	83.60	1,095,912.40
PG&E CORP	164,187	18.90	3,103,134.30
PPL CORPORATION	58,459	31.73	1,854,904.07
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	80.59	3,245,036.94
SEMPRA	49,744	81.65	4,061,597.60
SOUTHERN CO	86,109	85.74	7,382,985.66
VISTRA CORP	24,594	84.59	2,080,406.46
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	92.61	2,171,426.67
XCEL ENERGY INC	41,562	60.89	2,530,710.18
ADVANCED MICRO DEVICES	124,711	150.50	18,769,005.50
ANALOG DEVICES	37,792	231.84	8,761,697.28
APPLIED MATERIALS	64,814	195.77	12,688,636.78
BROADCOM INC	340,170	161.39	54,900,036.30
ENPHASE ENERGY INC	9,617	122.53	1,178,371.01
ENTEGRIS INC	12,389	115.54	1,431,425.06
FIRST SOLAR INC	7,921	235.42	1,864,761.82
INTEL CORP	328,277	20.07	6,588,519.39
KLA CORP	10,294	812.79	8,366,860.26
LAM RESEARCH CORP	10,237	820.44	8,398,844.28
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	46.89	514,758.42
MARVELL TECHNOLOGY INC	67,749	69.71	4,722,782.79
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	80.94	3,295,714.92
MICRON TECHNOLOGY	85,302	97.86	8,347,653.72
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,911	945.46	3,697,694.06
NVIDIA CORP	1,933,750	128.30	248,100,125.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	252.73	4,880,216.30
ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	76.06	2,434,756.66
QORVO INC	8,678	113.67	986,428.26
QUALCOMM	85,755	173.93	14,915,367.15
SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	107.70	1,210,763.40
TERADYNE INC	12,318	134.98	1,662,683.64
TEXAS INSTRUMENTS	71,015	210.69	14,962,150.35
CBRE GROUP INC-A	22,995	115.34	2,652,243.30
COSTAR GROUP INC	33,027	77.17	2,548,693.59
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.67	362,229.00

	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	57.32	676,891.88	
	アメリカドル 小計	28,536,177		3,733,206,211.23 (538,589,660,094)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	38,058	25.11	955,636.38	
	CAMECO CORP	31,793	56.34	1,791,217.62	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	165,204	49.67	8,205,682.68	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	25.25	2,810,148.25	
	ENBRIDGE	166,986	53.36	8,910,372.96	
	IMPERIAL OIL	16,202	102.19	1,655,682.38	
	KEYERA CORP	18,607	39.91	742,605.37	
	MEG ENERGY CORP	13,934	27.07	377,193.38	
	PARKLAND CORP	7,149	36.45	260,581.05	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,941	54.05	2,483,111.05	
	SUNCOR ENERGY	98,973	54.90	5,433,617.70	
	TC ENERGY CORP	82,559	61.41	5,069,948.19	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	62.36	1,559,561.24	
	AGNICO EAGLE MINES	40,306	110.59	4,457,440.54	
	BARRICK GOLD CORP	133,727	27.49	3,676,155.23	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,322	77.44	721,895.68	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,267	17.18	1,121,287.06	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,641	167.39	2,618,146.99	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	18.99	984,574.53	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	12.04	1,305,750.04	
	LUNDIN MINING CORP	38,990	14.32	558,336.80	
	NUTRIEN LTD	37,152	65.12	2,419,338.24	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	28.50	638,856.00	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	65.70	2,324,860.20	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	119.44	418,637.20	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,991	83.90	3,103,544.90	
	CAE INC	25,999	23.91	621,636.09	
	STANTEC INC	9,001	112.61	1,013,602.61	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	121.80	634,943.40	
	WSP GLOBAL INC	9,951	224.50	2,233,999.50	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	27.57	898,203.03	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	12,609	56.74	715,434.66	
	RB GLOBAL INC	14,445	117.18	1,692,665.10	
	THOMSON REUTERS CORP	11,495	229.88	2,642,470.60	
	AIR CANADA	13,805	15.81	218,257.05	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	158.89	6,711,036.93	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	111.86	8,179,762.50	
	TFI INTERNATIONAL INC	5,837	200.51	1,170,376.87	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	57.12	1,156,908.48	

BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	95.12	292,018.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	60.34	592,538.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	93.39	2,154,787.47
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	157.09	708,947.17
DOLLARAMA INC	22,000	137.07	3,015,540.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,865	79.45	4,597,374.25
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	38.25	265,072.50
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	173.02	2,234,207.26
METRO INC	18,840	84.31	1,588,400.40
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	220.38	1,151,705.88
SAPUTO INC	20,898	30.59	639,269.82
BANK MONTREAL	56,278	112.04	6,305,387.12
BANK NOVA SCOTIA	97,216	67.22	6,534,859.52
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,075	74.12	5,268,079.00
NATIONAL BANK OF CANADA	27,646	119.89	3,314,478.94
ROYAL BANK OF CANADA	109,143	156.57	17,088,519.51
TORONTO-DOMINION BANK	136,393	80.25	10,945,538.25
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	56.33	1,633,626.33
BROOKFIELD CORP	104,769	66.99	7,018,475.31
IGM FINANCIAL INC	7,685	38.82	298,331.70
ONEX CORP	6,603	94.84	626,228.52
TMX GROUP LTD	23,425	41.95	982,678.75
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,493	1,605.00	2,396,265.00
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	44.42	1,056,662.96
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	102.00	711,654.00
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	252.81	3,350,996.55
MANULIFE FINANCIAL CORP	135,007	36.84	4,973,657.88
POWER CORP OF CANADA	43,577	40.36	1,758,767.72
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	73.56	3,208,245.84
CGI INC - CL A	16,084	149.61	2,406,327.24
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,553	4,291.73	6,665,056.69
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	136.39	952,547.76
OPEN TEXT CORP	20,463	43.87	897,711.81
SHOPIFY INC - CLASS A	94,130	100.21	9,432,767.30
BCE INC	6,203	47.37	293,836.11
QUEBECOR INC -CL B	15,200	32.63	495,976.00
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	55.29	1,541,540.49
TELUS CORP	32,908	21.73	715,090.84
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	33.88	826,502.60
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	38.76	437,794.20
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	33.44	345,234.56
EMERA INC	25,484	50.42	1,284,903.28

	FORTIS INC	35,547	58.95	2,095,495.65	
	HYDRO ONE LTD	29,579	44.82	1,325,730.78	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	21.92	391,359.68	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	241.37	649,285.30	
	カナダドル 小計	3,197,926		217,962,953.62 (23,389,604,552)	
ユーロ	ENI	151,339	14.70	2,224,985.97	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	19.28	764,881.67	
	NESTE OIL OYJ	32,766	20.79	681,205.14	
	OMV AG	12,549	39.44	494,932.56	
	REPSOL SA	89,536	12.63	1,131,287.36	
	TENARIS SA	40,648	12.69	516,026.36	
	TOTALENERGIES SE	167,596	62.72	10,511,621.12	
	AIR LIQUIDE	44,628	165.52	7,386,826.56	
	AKZO NOBEL	12,357	56.66	700,147.62	
	ARCELORMITTAL	29,208	20.80	607,526.40	
	ARKEMA	4,369	82.00	358,258.00	
	BASF SE	70,406	45.20	3,182,351.20	
	COVESTRO AG	14,454	53.84	778,203.36	
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	118.95	1,630,447.65	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	19.69	315,768.53	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	94.00	1,011,910.00	
	OCI NV	7,248	26.67	193,304.16	
	STORA ENSO OYJ R	42,169	11.55	487,262.79	
	SYENSQO SA	5,356	70.87	379,579.72	
	SYMRISE AG	10,018	113.70	1,139,046.60	
	UMICORE	17,605	11.63	204,746.15	
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	30.32	1,283,263.68	
	VOESTALPINE AG	7,152	21.88	156,485.76	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	17,256	40.56	699,903.36	
	AIRBUS SE	46,092	140.86	6,492,519.12	
	ALSTOM	24,388	18.69	455,933.66	
	BOUYGUES ORD	16,606	31.97	530,893.82	
	BRENTAG SE	9,500	66.28	629,660.00	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	34.16	1,341,736.48	
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	188.80	402,144.00	
	EIFFAGE	5,924	94.08	557,329.92	
	FERROVIAL SE	37,026	36.60	1,355,151.60	
	GEA GROUP AG	13,382	41.24	551,873.68	
	IMCD NV	4,641	143.45	665,751.45	
	KINGSPAN GROUP PLC	12,398	77.85	965,184.30	
	KNORR-BREMSE AG	5,022	73.20	367,610.40	

KONE OYJ-B	26,369	47.52	1,253,054.88
LEGRAND SA	19,340	98.62	1,907,310.80
LEONARDO SPA	31,340	22.25	697,315.00
METSO CORPORATION	51,970	9.24	480,514.62
MTU AERO ENGINES AG	3,962	267.20	1,058,646.40
PRYSMIAN SPA	21,155	61.72	1,305,686.60
RATIONAL AG	483	876.00	423,108.00
REXEL SA	17,411	22.51	391,921.61
RHEINMETALL AG	3,203	535.60	1,715,526.80
SAFRAN SA	26,619	196.50	5,230,633.50
SAINT-GOBAIN	36,177	77.02	2,786,352.54
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,150	225.65	9,511,147.50
SIEMENS	58,485	167.12	9,774,013.20
SIEMENS ENERGY AG	47,513	25.29	1,201,603.77
THALES SA	6,657	149.00	991,893.00
VINCI S.A.	39,327	106.65	4,194,224.55
WARTSILA OYJ	41,917	19.34	810,674.78
BUREAU VERITAS SA	25,073	29.52	740,154.96
RANDSTAD NV	10,680	43.60	465,648.00
TELEPERFORMANCE	4,734	106.75	505,354.50
WOLTERS KLUWER	19,155	149.65	2,866,545.75
ADP	2,382	116.70	277,979.40
AENA SME SA	5,508	179.50	988,686.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	5.78	262,445.28
DHL GROUP	74,810	38.40	2,872,704.00
GETLINK	21,115	16.39	346,074.85
INPOST SA	15,470	16.55	256,028.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,617	84.78	2,087,029.26
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	79.55	397,034.05
CONTINENTAL AG	8,168	61.46	502,005.28
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	69.86	716,344.44
FERRARI NV	10,026	437.70	4,388,380.20
MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,436	62.56	3,968,556.16
MICHELIN	49,034	35.56	1,743,649.04
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	40.77	478,843.65
RENAULT SA	17,081	43.21	738,070.01
STELLANTIS NV	166,407	15.02	2,499,433.14
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	96.82	1,484,056.96
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	104.80	260,532.80
ADIDAS AG	12,783	223.70	2,859,557.10
HERMES INTERNATIONAL	2,420	2,133.00	5,161,860.00
KERING	5,534	259.45	1,435,796.30

LVMH	21,429	669.80	14,353,144.20
MONCLER SPA	18,908	55.42	1,047,881.36
PUMA SE	9,220	38.54	355,338.80
SEB SA	2,282	92.10	210,172.20
ACCOR	14,436	37.55	542,071.80
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	60.80	2,235,737.60
DELIVERY HERO SE	13,414	23.83	319,655.62
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	36.44	295,455.52
SODEXO	6,173	81.90	505,568.70
BOLLORE SE	31,761	5.88	186,754.68
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,827	86.00	415,122.00
PUBLICIS GROUPE	17,217	97.68	1,681,756.56
SCOUT24 SE	7,536	68.00	512,448.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	23.40	1,540,328.40
VIVENDI SE	61,243	10.03	614,573.50
D'IETEREN GROUP	2,217	213.00	472,221.00
INDITEX	87,257	49.24	4,296,534.68
PROSUS	112,590	33.14	3,731,232.60
ZALANDO SE	17,664	24.63	435,064.32
CARREFOUR	39,746	14.61	580,689.06
JERONIMO MARTINS	21,861	16.83	367,920.63
KESKO OYJ-B SHS	20,083	18.32	367,920.56
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	30.62	2,170,958.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,097	55.44	3,775,297.68
DANONE (GROUPE)	51,810	61.48	3,185,278.80
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	8.24	279,166.57
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	68.20	648,718.40
HEINEKEN NV	23,160	81.54	1,888,466.40
JDE PEET'S BV	7,000	20.84	145,880.00
KERRY GROUP PLC-A	10,913	89.45	976,167.85
LOTUS BAKERIES	38	10,880.00	413,440.00
PERNOD-RICARD	15,339	127.40	1,954,188.60
REMY COINTREAU	1,032	72.95	75,284.40
BEIERSDORF AG	7,430	128.75	956,612.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	73.95	649,281.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,880	81.70	970,596.00
LOREAL	18,546	392.25	7,274,668.50
AMPLIFON SPA	11,650	28.88	336,452.00
BIOMERIEUX	3,044	104.50	318,098.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	65.00	222,950.00
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	102.60	212,382.00
ESSILORLUXOTTICA	22,901	213.40	4,887,073.40

FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	34.93	593,286.05
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	33.23	1,119,485.47
KONINKLIJKE PHILIPS	66,646	26.94	1,795,443.24
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	51.42	1,108,975.14
ARGENX SE	4,935	460.40	2,272,074.00
BAYER	78,462	27.54	2,160,843.48
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	52.46	536,141.20
GRIFOLS SA	27,685	9.77	270,593.19
IPSEN	3,532	107.20	378,630.40
MERCK KGAA	10,703	171.80	1,838,775.40
ORION OYJ-CLASS B	10,139	46.66	473,085.74
QIAGEN N.V.	16,526	41.06	678,640.19
RECORDATI SPA	6,099	51.40	313,488.60
SANOFI	87,091	100.72	8,771,805.52
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	245.30	447,427.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	180.40	465,792.80
UCB (GROUPE)	9,389	161.90	1,520,079.10
ABN AMRO BANK NV-CVA	26,474	15.54	411,405.96
AIB GROUP PLC	145,826	5.39	786,731.27
BANCO BILBAO VIZCAYA	448,899	9.46	4,249,277.93
BANCO BPM SPA	118,197	6.04	714,146.27
BANCO DE SABADELL SA	420,800	1.93	812,564.80
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	4.43	5,425,977.03
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	10.27	907,642.06
BNP PARIBAS	81,615	61.99	5,059,313.85
CAIXABANK	275,085	5.44	1,498,112.91
COMMERZBANK AG	81,889	13.21	1,082,163.13
CREDIT AGRICOLE SA	87,162	13.72	1,195,862.64
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	48.70	1,235,811.20
FINECOBANK SPA	41,585	14.93	620,864.05
ING GROEP NV-CVA	256,546	16.15	4,143,217.90
INTESA SANPAOLO	1,145,097	3.70	4,236,858.90
KBC GROEP NV	18,057	69.50	1,254,961.50
MEDIOBANCA	33,860	15.00	507,900.00
NORDEA BANK ABP	236,636	10.62	2,513,074.32
SOCIETE GENERALE	53,019	21.61	1,145,740.59
UNICREDIT SPA	116,219	36.48	4,240,250.21
ADYEN NV	1,609	1,310.60	2,108,755.40
AMUNDI SA	4,626	67.30	311,329.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	140,740	14.69	2,068,596.52
DEUTSCHE BOERSE	14,123	199.00	2,810,477.00
EDENRED	20,131	37.97	764,374.07

EURAZEO SA	3,357	71.05	238,514.85
EURONEXT NV	6,480	95.95	621,756.00
EXOR NV	7,825	99.15	775,848.75
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	68.20	580,723.00
NEXI SPA	48,458	6.25	303,056.33
SOFINA	1,238	216.00	267,408.00
AEGON LTD	101,846	5.48	558,116.08
AGEAS	11,086	44.50	493,327.00
ALLIANZ SE-REG	30,116	276.30	8,321,050.80
ASR NEDERLAND NV	11,959	45.01	538,274.59
AXA SA	136,349	34.05	4,642,683.45
GENERALI	84,111	24.30	2,043,897.30
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	255.30	1,137,361.50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	481.50	5,014,341.00
NN GROUP NV	22,941	43.81	1,005,045.21
POSTE ITALIANE SPA	24,923	12.46	310,540.58
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	40.38	1,337,870.16
TALANX AG	5,053	77.70	392,618.10
BECHTLE AG	7,659	38.96	298,394.64
CAPGEMINI SA	12,235	184.85	2,261,639.75
DASSAULT SYSTEMES SA	49,547	34.31	1,699,957.57
NEMETSCHEK SE	5,455	91.50	499,132.50
SAP SE	81,129	195.26	15,841,248.54
NOKIA OYJ	396,129	3.76	1,491,425.68
CELLNEX TELECOM SA	34,475	35.34	1,218,346.50
DEUTSCHE TELEKOM	253,485	25.33	6,420,775.05
ELISA A	10,227	44.66	456,737.82
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.76	326,835.00
KPN (KON.)	290,883	3.64	1,059,105.00
ORANGE	153,281	10.38	1,591,056.78
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.23	202,310.58
TELEFONICA	373,259	4.10	1,530,361.90
ACCIONA SA	2,181	123.70	269,789.70
E.ON SE	166,881	12.70	2,120,223.10
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	14.06	305,833.12
ELIA GROUP SA/NV	987	97.60	96,331.20
ENDESA	25,972	18.85	489,702.06
ENEL	640,374	6.77	4,335,972.35
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,657	3.77	890,312.14
ENGIE	146,393	15.66	2,292,514.38
FORTUM OYJ	32,550	14.50	471,975.00
IBERDROLA SA	460,303	12.69	5,841,245.07

	REDEIA CORP SA	30,678	17.02	522,139.56	
	RWE STAMM	52,507	32.12	1,686,524.84	
	SNAM SPA	147,559	4.41	651,177.86	
	TERNA SPA	95,819	7.72	739,722.68	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	29.34	1,460,574.54	
	VERBUND AG	6,430	77.70	499,611.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,856	593.00	2,286,608.00	
	ASML HOLDING NV	30,793	794.20	24,455,800.60	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	118.20	751,397.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES	96,562	32.39	3,127,643.18	
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	28.00	1,408,008.00	
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	87.60	462,090.00	
	VONOVIA SE	61,810	31.19	1,927,853.90	
	ユーロ 小計	14,206,931		395,023,494.94 (63,685,687,854)	
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.32	5,683,900.41	
	SHELL PLC-NEW	491,663	27.25	13,397,816.75	
	ANGLO AMERICAN PLC	101,769	22.79	2,319,315.51	
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	19.10	570,398.88	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	40.55	442,968.20	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	16.38	288,353.52	
	GLENCORE PLC	793,369	4.10	3,256,779.74	
	MONDI PLC	37,918	14.67	556,257.06	
	RIO TINTO PLC REG	88,047	48.14	4,238,582.58	
	ASHTED GROUP PLC	33,317	52.28	1,741,812.76	
	BAE SYSTEMS PLC	240,047	13.20	3,168,620.40	
	BUNZL PLC	29,337	34.70	1,017,993.90	
	DCC PLC	6,622	53.20	352,290.40	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	4.76	481,413.27	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	4.94	3,142,662.27	
	SMITHS GROUP PLC	26,476	17.63	466,771.88	
	SPIRAX GROUP PLC	5,514	73.40	404,727.60	
	EXPERIAN PLC	68,159	36.17	2,465,311.03	
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	48.04	667,275.60	
	RELX PLC	145,542	34.92	5,082,326.64	
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	4.81	874,621.54	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	5.15	377,429.51	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	49.80	346,209.60	
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	6.92	206,288.12	
	PERSIMMON PLC	25,686	16.32	419,195.52	
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.60	424,547.18	
	COMPASS GROUP PLC	129,701	23.66	3,068,725.66	

ENTAIN PLC	49,630	6.48	321,701.66
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,042	159.20	2,076,286.40
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,833	75.12	1,039,134.96
PEARSON	55,305	10.40	575,448.52
WHITBREAD PLC	17,434	28.98	505,237.32
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	8.43	610,999.58
INFORMA PLC	110,598	8.25	912,433.50
WPP PLC	85,821	7.22	619,970.90
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.43	295,966.57
KINGFISHER PLC	153,717	2.86	440,860.35
NEXT PLC	8,464	101.05	855,287.20
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.88	427,204.80
TESCO PLC	525,585	3.51	1,848,482.44
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	24.99	643,242.60
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,980	27.89	4,406,062.20
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	27.42	492,463.20
DIAGEO	174,682	25.30	4,419,454.60
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	21.52	1,473,646.56
HALEON PLC	530,525	3.71	1,972,491.95
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	43.48	2,461,881.08
UNILEVER PLC	193,307	48.41	9,357,991.87
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.73	804,962.32
ASTRAZENECA	120,005	131.58	15,790,257.90
GSK PLC	319,416	16.18	5,168,150.88
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	19.97	357,662.70
BARCLAYS	1,129,529	2.30	2,600,175.75
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,446,594	6.60	9,560,539.74
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.59	2,858,457.79
NATWEST GROUP PLC	506,122	3.49	1,768,390.26
STANDARD CHARTERED PLC	161,358	7.71	1,245,038.32
3I GROUP PLC	74,757	31.90	2,384,748.30
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	11.02	364,530.58
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	35,214	101.35	3,568,938.90
M&G PLC	131,539	2.12	279,914.99
SCHRODERS PLC	39,932	3.45	137,765.40
WISE PLC - A	49,048	7.11	348,976.52
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	29.35	477,084.25
AVIVA PLC	193,334	4.98	962,803.32
LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.24	1,119,455.40
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.64	287,645.64
PRUDENTIAL	212,226	6.62	1,405,785.02
SAGE GROUP PLC	76,660	10.05	770,433.00

	HALMA PLC	31,069	25.38	788,531.22	
	BT GROUP PLC	464,863	1.37	637,792.03	
	VODAFONE GROUP PLC	1,645,717	0.74	1,230,008.88	
	CENTRICA PLC	453,631	1.27	578,606.34	
	NATIONAL GRID PLC	371,439	9.93	3,689,132.14	
	SEVERN TRENT PLC	17,468	25.11	438,621.48	
	SSE PLC	81,692	18.75	1,531,725.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	9.97	504,586.08	
	イギリスポンド 小計	20,715,648		152,879,563.94 (29,236,687,807)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	13.17	229,131.66	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	703.00	403,522.00	
	GIVAUDAN-REG	742	4,198.00	3,114,916.00	
	HOLCIM LTD	38,804	80.64	3,129,154.56	
	SIG GROUP AG	26,203	17.50	458,552.50	
	SIKA AG-BR	12,257	266.20	3,262,813.40	
	ABB LTD	124,889	47.83	5,973,440.87	
	GEBERIT AG-REG	2,530	530.80	1,342,924.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	224.00	458,752.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	229.40	709,304.80	
	VAT GROUP AG	1,956	426.40	834,038.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	29.18	433,498.08	
	SGS SA	12,959	93.58	1,212,703.22	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	258.90	978,900.90	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,975	134.60	5,515,235.00	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	180.95	449,298.85	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	35.80	140,980.40	
	AVOLTA AG	7,820	33.20	259,624.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,367.00	382,760.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	109,200.00	873,600.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,960.00	898,720.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	205,438	89.68	18,423,679.84	
	ALCON INC	38,399	81.08	3,113,390.92	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	293.00	1,138,891.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	125.30	1,070,062.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	80.25	148,462.50	
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	551.60	3,053,657.60	
	NOVARTIS	152,401	100.76	15,355,924.76	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	303.20	671,588.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	54,075	282.00	15,249,150.00	
	SANDOZ GROUP AG	30,458	37.69	1,147,962.02	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	91.05	226,441.35	

	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	49.98	764,144.22	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,202.50	2,194,562.50	
	UBS GROUP AG	249,657	26.44	6,600,931.08	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	160.40	683,945.60	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	133.30	393,901.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	675.00	1,430,325.00	
	SWISS RE LTD	24,330	115.45	2,808,898.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,440	489.50	5,599,880.00	
	TEMENOS AG - REG	5,150	58.70	302,305.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	76.52	918,699.12	
	SWISSCOM	1,856	535.50	993,888.00	
	BKW AG	1,744	154.10	268,750.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	95.00	539,505.00	
	スイスフラン 小計	1,161,275		114,160,816.55 (19,558,031,091)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	22,252	314.00	6,987,128.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	412.20	2,218,872.60	
	SCA SV CELLULOSA B	34,763	137.05	4,764,269.15	
	ALFA LAVAL AB	25,134	446.20	11,214,790.80	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	320.20	24,327,835.40	
	ATLAS COPCO A	207,097	182.80	37,857,331.60	
	ATLAS COPCO B	114,624	160.55	18,402,883.20	
	BEIJER REF AB	26,868	174.30	4,683,092.40	
	EPIROC AB-A	53,479	197.00	10,535,363.00	
	EPIROC AB-B	28,804	180.10	5,187,600.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	69.54	2,692,032.48	
	INDUTRADE AB	22,644	311.00	7,042,284.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	297.80	4,169,795.60	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	326.00	5,858,220.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	50.74	6,233,307.52	
	SAAB AB-B	25,552	237.65	6,072,432.80	
	SANDVIK AB	87,594	213.20	18,675,040.80	
	SKANSKA B	25,507	204.30	5,211,080.10	
	SKF AB-B	21,050	190.45	4,008,972.50	
	TRELLEBORG AB-B SHS	16,653	391.80	6,524,645.40	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	270.40	3,654,185.60	
	VOLVO B	124,872	266.20	33,240,926.40	
	SECURITAS B	28,375	119.00	3,376,625.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	29.22	1,456,295.58	
	EVOLUTION AB	13,186	1,065.50	14,049,683.00	
	HENNES & MAURITZ B	40,961	166.95	6,838,438.95	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	305.40	15,109,359.60	

	GETINGE AB-B SHS	17,796	209.50	3,728,262.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	315.00	4,515,525.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	114,218	155.60	17,772,320.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	105.00	12,677,280.00	
	SWEDBANK AB-A	71,421	217.70	15,548,351.70	
	EQT AB	31,471	345.50	10,873,230.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	363.20	4,292,297.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	362.00	4,042,816.00	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	300.05	38,567,826.90	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	553.00	4,025,840.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	75.48	16,204,725.72	
	HEXAGON AB-B SHS	172,099	103.80	17,863,876.20	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	114.40	5,349,572.80	
	TELIA CO AB	123,760	31.40	3,886,064.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	81.14	4,600,638.00	
	SAGAX AB-B	17,402	277.40	4,827,314.80	
	スウェーデンクローナ 小計	2,467,327		439,168,433.90 (6,240,583,445)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	29,320	262.80	7,705,296.00	
	EQUINOR ASA	66,436	285.35	18,957,512.60	
	NORSK HYDRO	100,517	60.40	6,071,226.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	305.70	3,820,638.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,304	1,086.00	5,760,144.00	
	MOWI ASA	31,968	188.00	6,009,984.00	
	ORKLA	39,191	93.10	3,648,682.10	
	SALMAR ASA	5,423	577.00	3,129,071.00	
	DNB BANK ASA	71,795	223.00	16,010,285.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	181.90	3,378,610.60	
	TELENOR ASA	51,193	129.60	6,634,612.80	
	ノルウェークローネ 小計	432,219		81,126,063.50 (1,119,539,676)	
デンマークク ローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	455.00	13,700,960.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	2,894.00	2,184,970.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	83,415	153.10	12,770,836.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	10,120.00	2,216,280.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	10,380.00	3,176,280.00	
	DSV A/S	12,386	1,229.50	15,228,587.00	
	PANDORA A/S	6,512	1,156.50	7,531,128.00	
	CARLSBERG AS-B	6,810	783.80	5,337,678.00	
	COLOPLAST-B	9,737	924.20	8,998,935.40	
	DEMANT A/S	8,512	278.00	2,366,336.00	
	GENMAB A/S	4,878	1,862.00	9,082,836.00	

	NOVO NORDISK A/S-B	253,029	904.10	228,763,518.90	
	DANSKE BANK A/S	53,617	206.10	11,050,463.70	
	TRYG A/S	29,772	147.50	4,391,370.00	
	ORSTED A/S	12,910	388.60	5,016,826.00	
	デンマーククローネ 小計	512,970		331,817,005.50 (7,170,565,488)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	30.05	619,901.45	
	SANTOS	224,634	7.41	1,664,537.94	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	27.42	3,869,921.70	
	BHP GROUP LTD	388,318	41.35	16,056,949.30	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	20.94	728,083.80	
	FORTESCUE LTD	137,312	18.63	2,558,122.56	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	30,758	54.40	1,673,235.20	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	45.60	657,050.40	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	88,682	15.22	1,349,740.04	
	ORICA LTD	38,288	17.96	687,652.48	
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	3.08	645,213.80	
	RIO TINTO LTD	28,272	111.88	3,163,071.36	
	SOUTH32 LTD	346,773	3.10	1,074,996.30	
	REECE LTD	16,814	26.96	453,305.44	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	12,630	40.40	510,252.00	
	BRAMBLES LTD	108,007	17.66	1,907,403.62	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	27.99	1,242,084.24	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.32	397,042.12	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.36	540,600.00	
	TRANSURBAN GROUP	224,973	13.45	3,025,886.85	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	54.12	2,500,885.20	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.91	893,683.83	
	CAR GROUP LTD	29,334	38.00	1,114,692.00	
	REA GROUP LTD	3,586	219.44	786,911.84	
	SEEK LTD	28,001	23.51	658,303.51	
	WESFARMERS LTD	82,500	76.70	6,327,750.00	
	COLES GROUP LTD	108,486	18.77	2,036,282.22	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.20	571,485.20	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	35.46	3,264,837.66	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.90	761,124.00	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	300.48	1,437,195.84	
	PRO MEDICUS LTD	3,708	147.83	548,153.64	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	45.92	555,953.44	
	SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	28.27	1,182,505.83	
	CSL LIMITED	37,640	307.92	11,590,108.80	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	29.62	7,062,089.26	

	COMMONWEALTH BANK OF AUST	130,513	137.43	17,936,401.59	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	240,813	37.36	8,996,773.68	
	WESTPAC BANKING	276,117	30.49	8,418,807.33	
	ASX LTD	14,549	61.94	901,165.06	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	28,241	212.26	5,994,434.66	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	34.41	475,270.92	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	7.46	1,243,298.52	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.82	886,939.06	
	QBE INSURANCE GROUP	127,819	15.69	2,005,480.11	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	17.31	1,642,095.84	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	118.43	1,634,452.43	
	XERO LTD	11,340	140.37	1,591,795.80	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.00	1,233,868.00	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	9.91	1,541,351.85	
	オーストラリアドル 小計	5,214,124		138,619,147.72 (13,573,586,944)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.58	625,054.38	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	35.22	1,408,095.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,957	3.78	502,577.46	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.48	418,692.24	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	6.15	679,845.60	
	ニュージーランドドル 小計	430,555		3,634,265.28 (327,556,329)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,996	42.95	7,559,028.20	
	SWIRE PACIFIC A	44,500	66.30	2,950,350.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	106.10	11,352,700.00	
	MTR CORP	125,000	28.10	3,512,500.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	18.58	2,229,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	30.80	5,359,200.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	14.98	2,966,040.00	
	WH GROUP LTD	658,301	5.55	3,653,570.55	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	23.60	6,643,400.00	
	HANG SENG BANK	59,400	94.95	5,640,030.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,300	235.60	22,688,280.00	
	AIA GROUP LTD	864,200	55.65	48,092,730.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	57.25	2,146,875.00	
	CLP HOLDINGS	136,500	70.35	9,602,775.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.40	5,789,804.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	53.65	6,008,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	31.15	3,800,175.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	23.95	2,999,210.60	
	SINO LAND CO	315,400	8.33	2,627,282.00	

	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	75.30	7,906,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	15.02	1,444,924.00	
	WHARF HOLDINGS	84,000	20.90	1,755,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	22.80	2,804,400.00	
香港ドル 小計		5,065,678		169,533,775.55 (3,134,679,509)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	112,800	6.14	692,592.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.48	660,352.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.22	673,825.04	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.81	238,632.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.17	566,162.00	
	DBS GROUP	155,760	35.90	5,591,784.00	
	OCBC BANK	257,100	14.47	3,720,237.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	31.03	2,916,820.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	10.66	703,560.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	2.89	1,797,993.27	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	84,100	4.70	395,270.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	2.62	681,462.00	
シンガポールドル 小計		2,379,135		18,638,689.31 (2,065,912,323)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	16.40	974,602.80	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	735.40	1,578,168.40	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	35.68	3,507,700.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	34.41	3,871,537.92	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.87	1,977,065.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	137.30	1,716,661.90	
	NICE LTD	4,991	670.60	3,346,964.60	
	AZRIELI GROUP	1,537	244.20	375,335.40	
イスラエルシェケル 小計		390,926		17,348,036.82 (680,653,694)	
合 計		84,710,891		708,772,748,806 (708,772,748,806)	

(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	661,322.60	
			83,290	661,322.60	

	オーストラリアドル 小計			(64,756,708)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,150,000.00	
	香港ドル 小計		315,000	3,150,000.00	
			(58,243,500)		
投資信託受益証券合計			398,290	123,000,208	
				(123,000,208)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,507,361.68	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	969,740.42	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,290	8,207,346.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	746,169.90	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,584,518.93	
		BXP INC	11,259	835,417.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	960,256.08	
		CROWN CASTLE INC	33,735	3,830,271.90	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,348	3,516,442.28	
		EQUINIX INC	7,333	5,998,247.34	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	991,795.10	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,900,994.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,538,285.70	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	2,797,748.04	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	923,387.85	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,765	1,220,164.20	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	982,172.90	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,637,841.12	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	2,678,757.84	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	1,109,294.52	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,474,050.45	
		PROLOGIS INC	71,288	9,191,874.72	
		PUBLIC STORAGE	11,847	4,058,663.73	
		REALTY INCOME CORP	64,068	3,981,826.20	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	891,658.97	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	2,041,279.83	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,979	4,365,770.95	
		SUN COMMUNITIES INC	10,890	1,446,518.70	
		UDR INC	23,815	1,039,286.60	
		VENTAS INC	31,565	1,902,738.20	
	VICI PROPERTIES INC	83,762	2,776,710.30		
	WELLTOWER INC	43,994	5,290,718.44		
	WP CAREY INC	16,024	958,715.92		
アメリカドル 小計		926,874	84,356,027.41		
			(12,170,044,074)		
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	256,372.02		

	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	296,013.90	
カナダドル 小計		20,377	552,385.92 (59,276,533)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	253,558.20	
	GECINA SA	3,139	309,505.40	
	KLEPIERRE	17,225	467,486.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	758,196.60	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	313,293.64	
ユーロ 小計		48,695	2,102,040.34 (338,890,943)	
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	357,153.70	
	SEGRO PLC	103,047	907,431.88	
イギリスポンド 小計		159,336	1,264,585.58 (241,839,346)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	676,507.10	
	GOODMAN GROUP	135,303	4,436,585.37	
	GPT GROUP	167,884	814,237.40	
	MIRVAC GROUP	266,683	541,366.49	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,307,800.69	
	STOCKLAND	207,412	1,039,134.12	
	VICINITY CENTERS	305,149	656,070.35	
オーストラリアドル 小計		1,557,804	9,471,701.52 (927,469,012)	
香港ドル	LINK REIT	166,900	6,116,885.00	
香港ドル 小計		166,900	6,116,885.00 (113,101,203)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	812,634.68	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	717,681.48	
シンガポールドル 小計		622,667	1,530,316.16 (169,620,243)	
投資証券合計		3,502,653	14,020,241,354 (14,020,241,354)	
合計			14,143,241,562 (14,143,241,562)	

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	97.8%	—	—	—	74.5%
	投資証券	33銘柄	—	—	—	2.2%	1.7%
カナダドル	株式	85銘柄	99.7%	—	—	—	3.2%
	新株予約権証券	1銘柄	—	—	—	—	—
	投資証券	2銘柄	—	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式	217銘柄	99.5%	—	—	—	8.8%
	投資証券	5銘柄	—	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式	77銘柄	99.2%	—	—	—	4.0%
	投資証券	2銘柄	—	—	—	0.8%	0.0%
スイスフラン	株式	45銘柄	100.0%	—	—	—	2.7%
スウェーデンクローナ	株式	43銘柄	100.0%	—	—	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%	—	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	15銘柄	100.0%	—	—	—	1.0%
オーストラリアドル	株式	50銘柄	93.2%	—	—	—	1.9%
	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	94.8%	—	—	—	0.4%
	投資信託受益証券	1銘柄	—	—	1.8%	—	0.0%
	投資証券	1銘柄	—	—	—	3.4%	0.0%
シンガポールドル	株式	12銘柄	92.4%	—	—	—	0.3%
	投資証券	2銘柄	—	—	—	7.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%	—	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

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 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	12,454,548,195
コール・ローン	46,021,844
株式	190,419,963,681

	2024年 8月28日現在
項目	金額（円）
投資信託受益証券	420,333,089
投資証券	159,753,319
派生商品評価勘定	247,793,824
未収入金	12,803,016
未収配当金	397,059,810
未収利息	274
差入委託証拠金	1,968,699,250
流動資産合計	206,126,976,302
資産合計	206,126,976,302
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,542,840
前受金	221,307,294
未払金	5,248,243
未払解約金	24,082,644
流動負債合計	277,181,021
負債合計	277,181,021
純資産の部	
元本等	
元本	46,734,851,808
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	159,114,943,473
元本等合計	205,849,795,281
純資産合計	205,849,795,281
負債純資産合計	206,126,976,302

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月28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。

	2024年 8月28日現在
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 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	46,734,851,808口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.4046円 (44,046円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年 8月28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 8月28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。

	2024年 8月28日現在
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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月29日
期首元本額	40,668,171,523円
期中追加設定元本額	8,552,591,619円
期中一部解約元本額	2,485,911,334円
期末元本額	46,734,851,808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	7,194,654,020円
世界経済インデックスファンド	13,112,544,603円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,316,069,019円
DC世界経済インデックスファンド	7,684,560,981円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	79,189,571円
コア投資戦略ファンド（安定型）	49,649,474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）	1,358,310,582円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	809,137,548円
コア投資戦略ファンド（切替型）	41,079,373円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	368,696,552円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,588,059円
SMT インデックスバランス・オープン	88,204,321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）	2,323,085,520円
SMT 世界経済インデックス・オープン	295,860,504円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,384,516,064円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	224,244,991円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,630,273円
グローバル経済コア	616,057,526円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	531,404,797円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	47,958,291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	120,962,101円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	124,295,081円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	56,335,111円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	71,817,811円
10資産分散投資ファンド	17,819,743円
グローバル10資産バランスファンド	27,172,580円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	2,222,248円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,611,916,345円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	122,928,294円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	80,421,747円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	12,959,761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）	21,141,325円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	25,572,309,460
投資信託受益証券	38,926,105
投資証券	△39,553,897
合計	25,571,681,668

(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 8月28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	15,303,686,952	—	15,524,994,246	221,307,294
合計		15,303,686,952	—	15,524,994,246	221,307,294

(注)1.時価の算定方法

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

- 2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
- 4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- ※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2024年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建	716,875,300	—	716,818,990	△56,310
	アメリカドル	716,875,300	—	716,818,990	△56,310
	合計	716,875,300	—	716,818,990	△56,310

(注)時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表
(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.79	250,641.20	

	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	36,930	12.95	478,243.50	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	—	
	PHOSAGRO PJSC-BLOCKED GDR REG S	171	—	—	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	—	
	SOUTHERN COPPER CORP	16,001	105.66	1,690,665.66	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	72,831	20.90	1,522,167.90	
	NIO INC - ADR	231,271	4.00	925,084.00	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	40,826	29.45	1,202,325.70	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	8.32	659,509.76	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	33.49	2,225,477.48	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	24.75	304,004.25	
	IQIYI INC-ADR	59,454	2.26	134,366.04	
	KANZHUN LTD	38,815	13.94	541,081.10	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	158,547	10.73	1,701,209.31	
	VK CO LTD	19,368	0.00	—	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	104,219	95.91	9,995,644.29	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	12.34	674,701.84	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	57.02	843,211.76	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	488,730	1.68	824,976.24	
	CREDICORP LTD	10,882	168.87	1,837,643.34	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	25.72	533,767.16	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	168,912	1.47	249,483.02	
	KE HOLDINGS INC	114,048	14.53	1,657,117.44	
	アメリカドル 小計	1,987,402		28,251,320.99 (4,075,818,079)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,664,261	11.81	31,464,922.41	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	101.79	49,764,316.68	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	247.12	8,649,200.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	21.47	3,833,511.44	
	ALFA S.A.B. -A	313,500	11.36	3,561,360.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	116.27	11,859,540.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	522.29	17,535,886.75	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	145.70	7,736,670.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	308.89	18,527,222.20	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	174.40	7,444,264.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	941,080	62.41	58,732,802.80	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	175.24	14,347,775.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	206.26	64,588,256.40	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	371.83	9,652,706.80	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	279,600	67.81	18,959,676.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	32.35	5,881,230.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	48.46	6,915,242.00	

	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	451,600	132.19	59,697,004.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	271,700	45.66	12,405,822.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	16.47	57,996,469.80	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	16.42	3,630,462.00	
	メキシコペソ 小計	10,403,440		473,184,340.28 (3,455,996,466)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	13.96	2,262,916.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	634,100	42.33	26,841,453.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	841,840	39.04	32,865,433.60	
	PRIO SA	130,000	47.74	6,206,200.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,900	23.56	3,578,764.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	12.29	1,221,626.00	
	GERDAU SA-PREF	186,708	18.27	3,411,155.16	
	SUZANO SA	121,779	55.62	6,773,347.98	
	VALE SA	581,587	59.80	34,778,902.60	
	WEG SA	314,144	54.00	16,963,776.00	
	CCR SA	248,600	13.69	3,403,334.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	137,340	42.90	5,891,886.00	
	RUMO SA	244,300	22.85	5,582,255.00	
	LOJAS RENNER S.A.	216,447	18.35	3,971,802.45	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	25.58	4,425,340.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	9.40	1,246,440.00	
	RAIA DROGASIL SA	259,280	27.68	7,176,870.40	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	299,700	9.71	2,910,087.00	
	AMBEV SA	756,200	13.03	9,853,286.00	
	BRF SA	119,300	25.91	3,091,063.00	
	JBS SA	110,000	34.98	3,847,800.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	200,308	13.92	2,788,287.36	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.46	4,661,386.84	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	32.97	3,155,229.00	
	HYPERA SA	54,500	29.95	1,632,275.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	13.99	4,561,061.77	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	15.42	12,770,566.44	
	BANCO DO BRASIL S.A.	313,000	28.01	8,767,130.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	841,481	36.58	30,781,374.98	
	ITAUSA SA	824,701	10.95	9,030,475.95	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,055,809	12.65	13,355,983.85	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	36.64	3,990,096.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	142,000	15.45	2,193,900.00	
	TOTVS SA	124,500	31.37	3,905,565.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	51.94	4,643,436.00	
	TIM SA	96,100	17.85	1,715,385.00	

	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	45.91	1,698,670.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	41.40	8,764,380.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	275,375	11.29	3,108,983.75	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	96.20	4,858,100.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	204,600	10.48	2,144,208.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	32.91	895,152.00	
	ENEVA SA	102,200	13.77	1,407,294.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	44.72	2,068,300.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	34.88	5,758,688.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA RTS	10,876	2.99	32,519.24	
	ブラジルリアル 小計	13,196,884		324,992,186.37 (8,507,807,950)	
チリペソ	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,515.00	205,986,975.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	30,645	34,150.00	1,046,526,750.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	59.30	145,948,448.40	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	42,366,632	11.80	499,926,257.60	
	EMPRESAS COPEC SA	90,423	5,901.40	533,622,292.20	
	FALABELLA SA	214,533	3,140.00	673,633,620.00	
	CENCOSUD SA	306,432	1,825.00	559,238,400.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	114.60	869,035,063.80	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	28,000.00	195,692,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	46.30	534,772,824.70	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	94.10	328,532,741.50	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	49.90	127,807,772.20	
	チリペソ 小計	70,798,772		5,720,723,145.40 (909,062,952)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	50,698	36,200.00	1,835,267,600.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	33,660.00	2,072,277,900.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	17,340.00	875,860,740.00	
	コロンビアペソ 小計	162,774		4,783,406,240.00 (170,834,570)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	21.80	113,381.80	
	METLEN ENERGY & METALS SA	20,295	34.48	699,771.60	
	OPAP SA	44,643	16.10	718,752.30	
	JUMBO SA	19,341	23.00	444,843.00	
	ALPHA SERVICES AND HLD	511,806	1.59	813,771.54	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	2.10	898,088.10	
	NATIONAL BANK OF GREECE	133,931	8.02	1,074,126.62	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	113,059	3.88	438,668.92	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.84	388,911.88	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	11.52	643,875.84	
		1,358,036		6,234,191.60	

ユーロ 小計				(1,005,076,369)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	164.70	23,484,573.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	47.40	12,270,343.20	
	SASA POLYESTER SANAYI	2,951,032	4.63	13,663,278.16	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	56.50	11,250,958.00	
	KOC HOLDING AS	89,884	185.50	16,673,482.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	43.10	12,876,038.80	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	35,097	221.00	7,756,437.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	297.75	25,789,616.25	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	903.50	14,790,295.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	236.60	7,477,269.80	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	554.00	45,000,312.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	223,014	58.85	13,124,373.90	
	AKBANK T.A.S.	586,183	59.10	34,643,415.30	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	87.65	18,526,755.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	1,876,733	13.26	24,885,479.58	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	31.30	11,616,275.10	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	96.50	13,808,281.50	
トルコリラ 小計		7,602,687		307,637,184.39 (1,305,150,754)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	766.00	10,190,098.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	107.80	6,544,538.00	
	CEZ AS	25,283	881.00	22,274,323.00	
チェココルナ 小計		99,296		39,008,959.00 (251,502,461)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	96,018	2,710.00	260,208,780.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	10,740.00	308,678,340.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	18,550.00	742,389,550.00	
ハンガリーフォリント 小計		164,780		1,311,276,670.00 (538,193,840)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	102,979	63.46	6,535,047.34	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	142.10	2,868,430.60	
	BUDIMEX	2,656	588.00	1,561,728.00	
	LPP SA	230	14,650.00	3,369,500.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	179.40	1,202,697.60	
	ALLEGRO.EU SA	83,795	37.62	3,152,367.90	
	DINO POLSKA SA	9,471	330.00	3,125,430.00	
	BANK PEKAO SA	27,684	156.45	4,331,161.80	
	M BANK SA	1,423	619.80	881,975.40	
	PKO BANK POLSKI SA	159,920	56.48	9,032,281.60	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	510.80	3,750,804.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	116,529	48.63	5,666,805.27	

	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	6.83	682,432.40	
	ポーランドズロチ 小計	638,720		46,160,662.31 (1,737,865,846)	
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	151,214	0.00	0.01	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	—	
	ロシアルーブル 小計	5,317,350		0.48 (—)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	9.35	3,076,150.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	6.80	1,645,600.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	5.43	21,010,842.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	575,500	34.45	19,825,975.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	272,000	9.03	2,456,160.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	3,800,000	7.15	27,170,000.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	557,700	10.16	5,666,232.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,120,000	4.97	5,566,400.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	17.02	4,042,250.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	10.58	5,877,190.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	2.40	1,747,200.00	
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	6.56	5,313,600.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	18.50	999,740.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	13.74	3,215,160.00	
	MMG LIMITED	1,176,000	2.29	2,693,040.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	245,000	16.20	3,969,000.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	321,000	13.52	4,339,920.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	16.20	14,661,000.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.39	932,250.00	
	BOC AVIATION LTD	68,800	66.90	4,602,720.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	546,000	4.16	2,271,360.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	3.80	2,682,800.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	11.40	5,038,800.00	

CITIC LTD	1,038,000	7.77	8,065,260.00
CRRG CORP LTD-H	936,000	4.97	4,651,920.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.17	1,200,960.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	178,000	21.50	3,827,000.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	19.80	3,296,700.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	408,800	12.06	4,930,128.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	27.35	1,703,905.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	11.88	4,580,298.36
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	10.90	5,646,745.00
JD LOGISTICS INC	326,200	9.48	3,092,376.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	8.05	2,592,100.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	32,500	108.00	3,510,000.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.06	1,568,600.00
BYD CO LTD-H	187,000	230.20	43,047,400.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	144,000	44.30	6,379,200.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	8.60	8,152,800.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	10.68	5,273,250.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	2.49	892,276.56
LI AUTO INC-CLASS A	234,842	83.95	19,714,985.90
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	30.30	5,065,008.60
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	10.94	2,559,960.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	20.60	1,786,020.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	240,200	71.65	17,210,330.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.89	1,703,820.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	460,600	23.20	10,685,920.00
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	99,000	19.94	1,974,060.00
LI NING CO LTD	380,000	14.64	5,563,200.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	67.75	10,758,700.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	12.26	2,868,840.00
MEITUAN-CLASS B	873,750	106.20	92,792,250.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	50.60	12,371,700.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	14.40	2,401,920.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	8.25	651,750.00
TRIP.COM GROUP LTD	96,607	366.40	35,396,804.80
BAIDU INC-CLASS A	404,500	84.60	34,220,700.00
BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	113.60	4,725,760.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	24.45	1,261,620.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	2.13	2,700,840.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	21.75	3,723,600.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	452,400	40.00	18,096,000.00
NETEASE INC	338,630	131.60	44,563,708.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,137,400	381.80	434,259,320.00

ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,735,288	79.95	218,686,275.60
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	49.00	441,000.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	6.62	1,668,240.00
JD.COM INC - CL A	414,161	101.70	42,120,173.70
MINISO GROUP HOLDING LTD	42,904	31.40	1,347,185.60
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	45.90	2,965,140.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	2.92	1,197,200.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	8.79	808,680.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	2.92	2,289,280.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	22.40	4,333,280.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	101.00	1,535,200.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	3.56	2,007,840.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	12.34	7,120,180.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	23.60	5,805,600.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—
NONGFU SPRING CO LTD-H	348,600	30.20	10,527,720.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	8.91	1,737,450.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	10.12	4,209,920.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	44.50	5,162,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	4.79	4,675,040.00
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	90,600	39.70	3,596,820.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	24.00	2,100,000.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	19.76	1,489,904.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	4.20	1,676,640.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	11.28	1,448,352.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	17.74	3,391,888.00
AKESO INC	61,000	46.60	2,842,600.00
BEIGENE LTD	110,905	121.80	13,508,229.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	4.84	6,718,694.40
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.50	1,864,500.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	12.18	2,703,960.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	272,000	18.22	4,955,840.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	44.30	8,992,900.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	3.15	6,208,650.00
WUXI APPTec CO LTD-H	63,688	33.70	2,146,285.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	628,000	10.72	6,732,160.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,135,000	3.71	19,050,850.00
BANK OF CHINA LTD-H	13,437,200	3.65	49,045,780.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	6.29	8,626,577.75
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	4.95	7,747,740.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	16,601,620	5.84	96,953,460.80
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.47	926,250.00

CHINA MERCHANTS BANK-H	725,423	34.65	25,135,906.95	
CHINA MINSHENG BANKING-H	1,835,900	2.84	5,213,956.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	11,401,515	4.78	54,499,241.70	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,850,000	4.47	8,269,500.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	3.83	1,849,890.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	8.00	2,809,600.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	11.16	3,189,249.00	
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.37	1,288,800.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	6.29	557,294.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	3.48	1,243,056.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	8.30	2,207,800.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,320,000	11.16	14,731,200.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	506,600	19.70	9,980,020.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.60	1,582,606.40	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	309,600	15.30	4,736,880.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.79	5,239,620.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	10.26	12,284,174.88	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,178,000	36.50	42,997,000.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	6.13	3,022,090.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	221,500	32.90	7,287,350.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	30.25	4,855,125.00	
LENOVO GROUP LTD	1,588,000	9.57	15,197,160.00	
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	47.35	5,658,325.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	2,704,200	18.88	51,055,296.00	
ZTE CORP-H	82,908	15.48	1,283,415.84	
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.98	6,940,360.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	25.60	1,523,200.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.38	1,451,800.00	
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	3.38	4,826,640.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	6.66	3,106,224.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	6.66	3,010,320.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.64	2,424,240.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	26.40	5,195,520.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	23.00	5,920,200.00	
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	52.20	6,107,400.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	4.06	1,810,760.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.54	3,196,160.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	7.86	4,307,280.00	
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	10.50	672,000.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.10	3,463,900.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	17.02	1,531,800.00	

	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	3.11	2,786,519.57	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	12.10	1,106,593.40	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	12.20	7,131,388.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	22.05	11,931,497.55	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	22.50	2,677,500.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	3.86	1,217,830.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	8.60	2,954,100.00	
	香港ドル 小計	136,539,398		1,971,104,400.96 (36,445,720,373)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	20.90	1,847,560.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	5.82	2,423,448.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	5.35	4,053,160.00	
	GAMUDA BHD	414,102	7.79	3,225,854.58	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.55	857,682.30	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	10.30	1,104,994.30	
	MISC BHD	217,540	8.62	1,875,194.80	
	GENTING BHD	271,600	4.32	1,173,312.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.53	935,341.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	2.09	634,210.50	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.84	1,038,105.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	116,562	21.20	2,471,114.40	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	99.92	1,818,544.00	
	PPB GROUP BERHAD	163,480	14.62	2,390,077.60	
	QL RESOURCES BHD	124,800	6.61	824,928.00	
	SD GUTHRIE BHD	247,046	4.58	1,131,470.68	
	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	6.30	2,969,820.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	5.10	1,533,570.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,233,202	7.93	9,779,291.86	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	20.16	2,445,246.72	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	10.70	9,432,103.50	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,544,100	4.68	11,906,388.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.92	1,298,534.24	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.44	1,320,257.16	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	3.61	1,797,780.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.76	1,007,304.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	6.84	1,857,415.68	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	18.16	2,694,944.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	13.92	6,149,508.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	812,700	2.95	2,397,465.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	499,400	3.90	1,947,660.00	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	3.37	925,739.00	
		13,749,909		87,268,024.92	

マレーシアリングITT 小計				(2,898,302,009)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	308,100	145.00	44,674,500.00	
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	34.50	58,118,700.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	53.75	15,781,268.75	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	19.20	3,962,880.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	25.25	12,274,883.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	25.25	5,118,175.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	222.00	28,948,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	60.25	39,457,725.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	7.85	6,413,450.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	3.68	2,981,904.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	848,938	26.75	22,709,091.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	28.50	5,192,700.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	9.55	8,023,289.25	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	15.60	12,361,440.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	59.75	57,144,900.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	31.75	7,553,642.50	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	25.00	13,910,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	27.75	52,394,775.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	242.00	20,013,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	133,200	143.50	19,114,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	18.50	8,115,025.00	
	SCB X PCL-NVDR	151,200	107.00	16,178,400.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	8,727,200	1.85	16,145,320.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	42.75	4,339,125.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	102.50	50,840,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	247.00	50,338,600.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	83.50	10,174,475.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	10.30	20,760,865.40	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	42.25	2,881,450.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	694,100	50.75	35,225,575.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	59.25	22,420,200.00	
タイパーツ 小計		25,509,040		673,568,759.90	
				(2,862,667,229)	
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	54,410	626.00	34,060,660.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	23.50	13,773,890.50	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	937.00	33,999,045.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	408.40	62,538,292.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	252.40	15,398,924.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	93.70	8,953,972.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	127.40	29,913,774.80	
	BDO UNIBANK INC	394,773	151.20	59,689,677.60	

	METROPOLITAN BANK & TRUST	545,077	74.50	40,608,236.50	
	PLDT INC	20,460	1,560.00	31,917,600.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	416.00	22,122,880.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	33.50	42,910,150.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	31.00	48,153,850.00	
	フィリピンペソ 小計	5,069,060		444,040,952.40 (1,138,032,556)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	3,520.00	7,611,296,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	27,250.00	5,474,525,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	1,103,600	11,050.00	12,194,780,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,470.00	1,449,126,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,895,911	1,110.00	3,214,461,210.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK	1,270,900	9,350.00	11,882,915,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	754,000	8,650.00	6,522,100,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,450.00	3,977,077,650.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	5,150.00	16,878,095,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	52.00	7,001,275,008.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,138,700	2,860.00	8,976,682,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,553,300	5,075.00	7,882,997,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	11,425.00	6,848,145,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	1,403,800	6,800.00	9,545,840,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	2,290.00	2,650,446,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,740.00	7,287,990,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	9,369,500	10,200.00	95,568,900,000.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	7,025.00	42,865,088,800.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	5,400.00	13,956,840,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	12,030,502	5,175.00	62,257,847,850.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,898,500	2,990.00	26,606,515,000.00	
	インドネシアルピア 小計	199,939,906		360,652,943,018.00 (3,354,072,370)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	83,000.00	429,940,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	63,800.00	407,490,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,044	109,800.00	1,102,831,200.00	
	ENCHEM CO LTD	1,966	194,000.00	381,404,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	26,200.00	478,831,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	25,900.00	289,795,100.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	545,000.00	656,180,000.00	
	KUM YANG CO LTD	5,389	53,900.00	290,467,100.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	136,300.00	258,697,400.00	
	LG CHEM LTD	9,272	319,000.00	2,957,768,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	210,000.00	184,170,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	85,400.00	197,786,400.00	

POSCO HOLDINGS INC	13,371	346,000.00	4,626,366,000.00	
SKC CO LTD	1,432	128,300.00	183,725,600.00	
DOOSAN BOBCAT INC	12,098	43,750.00	529,287,500.00	
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	17,860.00	1,464,573,580.00	
ECOPRO BM CO LTD	8,232	170,100.00	1,400,263,200.00	
ECOPRO CO LTD	15,665	86,600.00	1,356,589,000.00	
ECOPRO MATERIALS CO LTD	2,769	83,600.00	231,488,400.00	
GS HOLDINGS CORP	6,593	47,000.00	309,871,000.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	284,000.00	1,654,584,000.00	
HANWHA OCEAN CO LTD	14,849	33,200.00	492,986,800.00	
HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	3,567	309,500.00	1,103,986,500.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	190,900.00	403,753,500.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	186,400.00	1,168,541,600.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	32,900.00	321,367,200.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	54,500.00	731,172,000.00	
L&F CO LTD	4,327	92,400.00	399,814,800.00	
LG CORP	16,658	80,900.00	1,347,632,200.00	
LG ENERGY SOLUTION	8,760	376,500.00	3,298,140,000.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	220,000.00	1,046,760,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	55,000.00	475,585,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	15,406	151,200.00	2,329,387,200.00	
SAMSUNG E&A CO LTD	30,300	26,450.00	801,435,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	10,280.00	978,337,320.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	34,250.00	80,076,500.00	
SK INC	6,394	146,200.00	934,802,800.00	
SK SQUARE CO LTD	19,731	80,800.00	1,594,264,800.00	
HMM CO LTD	35,545	17,360.00	617,061,200.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	5,586	111,600.00	623,397,600.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	22,450.00	602,153,900.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLGY CO	18,150	43,050.00	781,357,500.00	
HYUNDAI MOBIS	10,148	222,000.00	2,252,856,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	23,448	247,500.00	5,803,380,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	169,800.00	1,025,931,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	168,000.00	579,432,000.00	
KIA CORP	45,204	101,800.00	4,601,767,200.00	
COWAY CO LTD	9,036	65,800.00	594,568,800.00	
LG ELECTRONICS INC	17,254	98,600.00	1,701,244,400.00	
HANJIN KAL CORP	7,812	71,500.00	558,558,000.00	
HYBE CO LTD	4,975	176,800.00	879,580,000.00	
KAKAO CORP	52,020	38,000.00	1,976,760,000.00	
KRAFTON INC	6,265	342,000.00	2,142,630,000.00	
NAVER CORP	21,578	167,900.00	3,622,946,200.00	

NCSoft CORPORATION	2,709	192,400.00	521,211,600.00	
NETMARBLE CORP	2,465	61,600.00	151,844,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	338,500.00	622,501,500.00	
KT&G CORP	19,456	111,000.00	2,159,616,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	94,500.00	296,919,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	3,762	122,300.00	460,092,600.00	
LG H&H CO LTD	1,321	345,500.00	456,405,500.00	
HLB INC	23,903	83,200.00	1,988,729,600.00	
ALTEOGEN INC	6,824	315,000.00	2,149,560,000.00	
CELLTRION INC	27,796	200,500.00	5,573,098,000.00	
CELLTRION PHARM INC	2,169	71,100.00	154,215,900.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,202	300,000.00	360,600,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,362	973,000.00	3,271,226,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	108,900.00	348,153,300.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	55,500.00	116,550,000.00	
YUHAN CORPORATION	13,854	112,500.00	1,558,575,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	66,000.00	3,382,434,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	14,260.00	403,985,800.00	
KAKAObANK CORP	35,459	22,550.00	799,600,450.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	87,800.00	5,671,792,200.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	80,543	59,700.00	4,808,417,100.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	113,814	16,280.00	1,852,891,920.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	74,800.00	344,229,600.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	94,300.00	1,600,742,500.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	8,480.00	263,007,200.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	13,840.00	167,560,880.00	
DB INSURANCE CO LTD	10,074	119,000.00	1,198,806,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,144	346,500.00	2,128,896,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	95,700.00	1,160,936,700.00	
POSCO DX CO LTD	9,010	27,050.00	243,720,500.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	152,400.00	1,110,081,600.00	
COSMOAM&T CO LTD	3,978	106,000.00	421,668,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	51,846	11,240.00	582,749,040.00	
LG INNOTEK CO LTD	2,696	256,500.00	691,524,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	11,233	143,900.00	1,616,428,700.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	822,794	75,800.00	62,367,785,200.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	141,877	61,500.00	8,725,435,500.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	10,263	338,000.00	3,468,894,000.00	
KT CORP	10,500	40,100.00	421,050,000.00	
LG UPLUS CORP	22,125	9,870.00	218,373,750.00	
SK TELECOM	9,563	56,100.00	536,484,300.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	22,750.00	1,006,460,000.00	

	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	115,100.00	833,093,800.00	
	SK HYNIX INC	94,417	175,000.00	16,522,975,000.00	
	韓国ウォン 小計	2,613,000		208,003,098,640.00 (22,568,336,202)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	238,240	58.40	13,913,216.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	44.90	20,392,502.40	
	CHINA STEEL	2,373,261	22.40	53,161,046.40	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	44.05	23,877,787.05	
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	51.90	31,027,065.60	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	46.00	35,454,592.00	
	TCC GROUP HOLDINGS	1,268,419	33.05	41,921,247.95	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	31,557	874.00	27,580,818.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	36.70	13,286,427.60	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	22,000	680.00	14,960,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	2,065.00	18,585,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	34.75	17,451,901.75	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	20.60	9,579,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	35.00	13,510,000.00	
	EVERGREEN MARINE	183,215	183.50	33,619,952.50	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	29.70	14,018,400.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	78.30	5,843,920.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	62.70	13,605,900.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	463,061	50.20	23,245,662.20	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	538.00	21,486,106.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	145.00	11,440,645.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	467.50	14,492,500.00	
	POU CHEN	273,780	34.50	9,445,410.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	652.00	35,247,120.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	291.50	25,810,576.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	83.40	64,751,343.00	
	PHARMAESSENTIA CORP	25,000	701.00	17,525,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	627,846	18.00	11,301,228.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,090,237	32.85	101,514,285.45	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,524,109	27.90	70,422,641.10	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,240,618	27.15	60,832,778.70	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,533,544	25.55	39,182,049.20	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,128,069	39.75	84,590,742.75	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,836,230	24.40	44,804,012.00	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,080,677	19.20	39,948,998.40	
	TAIWAN BUSINESS BANK	890,572	15.85	14,115,566.20	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	2,139,268	25.90	55,407,041.20	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	40.30	27,806,395.50	

CHAILEASE HOLDING CO LTD	293,456	147.50	43,284,760.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,958,218	31.90	62,467,154.20
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,731,057	63.10	109,229,696.70
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,353,451	92.20	124,788,182.20
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,576,226	16.00	41,219,616.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	2,085,158	12.90	26,898,538.20
ACCTON TECHNOLOGY CORP	86,000	522.00	44,892,000.00
ACER INC	617,803	44.70	27,615,794.10
ADVANTECH CO LTD	76,261	345.50	26,348,175.50
ASIA VITAL COMPONENTS	55,000	613.00	33,715,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	554.00	70,408,968.00
AUO CORP	1,268,072	16.90	21,430,416.80
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	237.50	28,191,250.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	33.65	27,113,824.00
DELTA ELECTRONICS INC	347,903	400.00	139,161,200.00
E INK HOLDINGS INC	144,000	301.00	43,344,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	75,000	266.50	19,987,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,185,248	180.50	394,437,264.00
INNOLUX CORP	1,162,106	15.90	18,477,485.40
INVENTEC CO LTD	455,511	46.00	20,953,506.00
LARGAN PRECISION CO LTD	20,040	3,030.00	60,721,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	107.50	37,996,090.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	180.00	18,000,000.00
PEGATRON CORP	340,474	104.00	35,409,296.00
QUANTA COMPUTER INC	463,270	275.50	127,630,885.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	70.90	14,328,890.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	160.00	33,760,000.00
WISTRON CORP	427,000	101.50	43,340,500.00
WIWYNN CORP	16,000	1,905.00	30,480,000.00
WPG HOLDINGS LTD	260,692	80.10	20,881,429.20
YAGEO CORPORATION	77,172	653.00	50,393,316.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	126.50	17,447,133.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	124.50	72,747,217.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	91.10	19,677,600.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	112.00	27,462,400.00
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	12,000	2,670.00	32,040,000.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	594,315	147.00	87,364,305.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,580.00	30,960,000.00
GLOBAL UNICHIPO CORP	13,000	1,135.00	14,755,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	473.00	19,866,000.00
MEDIATEK INC	266,804	1,210.00	322,832,840.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	53.20	13,778,800.00

	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	547.00	52,536,615.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	535.00	45,980,040.00	
	SILERGY CORP	53,000	482.00	25,546,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,243,389	942.00	3,997,272,438.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,976,000	54.00	106,704,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	122.50	23,030,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	385,263	23.40	9,015,154.20	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	48.20	13,451,511.40	
	新台湾ドル 小計	60,263,710		7,904,531,869.85 (35,693,704,111)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	299,904	349.00	104,666,496.00	
	COAL INDIA LTD	295,479	531.25	156,973,218.75	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	188,229	404.15	76,072,750.35	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	173.30	103,466,338.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	328.80	177,472,430.40	
	PETRONET LNG LTD	83,779	369.35	30,943,773.65	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	522,888	3,000.45	1,568,899,299.60	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	624.25	45,902,975.25	
	APL APOLLO TUBES LTD	26,431	1,440.40	38,071,212.40	
	ASIAN PAINTS LTD	67,203	3,163.20	212,576,529.60	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	2,702.35	126,586,181.05	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	246,890	703.65	173,724,148.50	
	JINDAL STAINLESS LTD	54,371	736.40	40,038,804.40	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	968.90	67,604,028.60	
	JSW STEEL LTD	99,332	943.75	93,744,575.00	
	NMDC LTD	146,261	229.50	33,566,899.50	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	4,461.00	57,087,417.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	3,099.10	90,369,756.00	
	SHREE CEMENT LTD	1,387	24,803.05	34,401,830.35	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	4,277	10,424.65	44,586,228.05	
	SRF LTD	33,773	2,554.65	86,278,194.45	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	5,370.25	53,766,943.00	
	TATA STEEL LTD	1,356,728	154.70	209,885,821.60	
	ULTRATECH CEMENT LTD	19,852	11,299.40	224,315,688.80	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	582.85	40,596,085.35	
	VEDANTA LTD	184,749	463.75	85,677,348.75	
	ABB LTD INDIA	11,720	7,901.95	92,610,854.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	33,650	3,066.95	103,202,867.50	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	262.10	63,421,123.30	
	ASTRAL LTD	19,918	1,952.55	38,890,890.90	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	646,541	300.80	194,479,532.80	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	151,803	297.70	45,191,753.10	

CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	728.95	51,322,453.70	
CUMMINS INDIA LTD	20,968	3,765.85	78,962,342.80	
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,894.60	67,572,803.60	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	36,316	4,716.85	171,297,124.60	
LARSEN & TOUBRO LTD	118,675	3,702.40	439,382,320.00	
POLYCAB INDIA LTD	7,354	6,769.70	49,784,373.80	
SIEMENS INDIA LTD	16,262	7,006.25	113,935,637.50	
SUZLON ENERGY LTD	1,500,000	77.51	116,265,000.00	
THERMAX LTD	7,627	4,440.40	33,866,930.80	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	52,993	930.60	49,315,285.80	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	1,478.30	154,603,570.60	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	984.65	26,048,915.75	
GMR AIRPORTS INFRASTRUCRURE	394,498	95.50	37,674,559.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	4,744.90	125,507,349.90	
BAJAJ AUTO LTD	9,644	10,507.90	101,338,187.60	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,820.60	24,908,718.60	
BHARAT FORGE LTD	30,322	1,606.15	48,701,680.30	
BOSCH LTD	1,235	32,269.50	39,852,832.50	
EICHER MOTORS LTD	26,253	4,867.95	127,798,291.35	
HERO MOTOCORP LTD	21,431	5,357.85	114,824,083.35	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	165,233	2,780.70	459,463,403.10	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	24,350	12,496.60	304,292,210.00	
MRF LTD	432	138,734.35	59,933,239.20	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	199.80	104,142,753.00	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	707.30	41,935,109.70	
TATA MOTORS LTD	277,381	1,077.20	298,794,813.20	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	75,000	749.25	56,193,750.00	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	4,152.40	87,831,564.80	
TVS MOTOR CO LTD	41,254	2,740.70	113,064,837.80	
PAGE INDUSTRIES LTD	886	41,480.75	36,751,944.50	
TITAN CO LTD	56,531	3,550.70	200,724,621.70	
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	665.30	109,439,854.10	
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	661.05	29,039,926.50	
ZOMATO LTD	1,054,701	256.00	270,003,456.00	
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	7,489.85	107,524,286.60	
TRENT LTD	37,950	6,874.00	260,868,300.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	4,955.75	141,694,804.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	22,156	5,762.05	127,663,979.80	
ITC LTD	480,447	500.60	240,511,768.20	
MARICO LTD	81,711	675.10	55,163,096.10	
NESTLE INDIA LIMITED	51,460	2,520.75	129,717,795.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	1,209.30	112,753,922.70	

UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,428.50	83,681,530.00
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	1,565.55	125,804,466.90
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	3,545.10	92,172,600.00
DABUR INDIA LTD	144,837	643.25	93,166,400.25
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,455.75	92,288,727.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	144,060	2,767.15	398,635,629.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	6,777.75	98,697,595.50
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	854.20	102,667,152.20
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	1,551.25	54,937,518.75
CIPLA LTD	88,546	1,597.60	141,461,089.60
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	4,899.75	107,461,317.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	6,966.40	127,631,414.40
LUPIN LTD	48,134	2,172.20	104,556,674.80
MANKIND PHARMA LTD	18,295	2,427.50	44,411,112.50
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	167,480	1,789.00	299,621,720.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	3,365.35	41,124,577.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	92,107	634.40	58,432,680.80
AXIS BANK LTD	391,573	1,180.35	462,193,190.55
BANDHAN BANK LTD	74,811	201.10	15,044,492.10
BANK OF BARODA	248,313	251.10	62,351,394.30
CANARA BANK	305,000	110.85	33,809,250.00
HDFC BANK LTD	485,940	1,637.05	795,508,077.00
ICICI BANK LTD	879,852	1,226.15	1,078,830,529.80
IDFC FIRST BANK LTD	531,028	74.59	39,609,378.52
INDUSIND BANK LTD	48,365	1,383.55	66,915,395.75
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	186,345	1,803.45	336,063,890.25
PUNJAB NATIONAL BANK	272,403	115.95	31,585,127.85
STATE BANK OF INDIA	314,786	815.15	256,597,807.90
UNION BANK OF INDIA	238,889	124.40	29,717,791.60
YES BANK LTD	2,352,478	24.03	56,530,046.34
BAJAJ FINANCE LTD	49,376	6,863.60	338,897,113.60
BAJAJ FINSERV LTD	76,561	1,721.55	131,803,589.55
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	9,941.10	29,773,594.50
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	83,998	1,442.90	121,200,714.20
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	14,173	4,509.30	63,910,308.90
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	471,182	323.60	152,474,495.20
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,984.05	24,647,853.15
POWER FINANCE CORPORATION	265,755	536.10	142,471,255.50
REC LTD	186,584	617.10	115,140,986.40
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	736.65	44,710,971.75
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	54,695	3,234.85	176,930,120.75
SUNDARAM FINANCE LTD	11,164	4,570.15	51,021,154.60

	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	207,570	739.40	153,477,258.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	2,151.75	72,365,504.25	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	744.30	33,728,698.80	
	PB FINTECH LTD	48,956	1,774.25	86,860,183.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,838.35	133,714,225.60	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	163,324	1,710.75	279,406,533.00	
	INFOSYS LTD	579,880	1,900.15	1,101,858,982.00	
	LTIMINDTREE LTD	15,699	5,749.30	90,258,260.70	
	MPHASIS LTD	19,317	3,034.70	58,621,299.90	
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	15,982	4,909.75	78,467,624.50	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	152,359	4,494.25	684,739,435.75	
	TATA ELXSI LTD	7,679	8,970.35	68,883,317.65	
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,624.30	153,978,767.10	
	WIPRO LTD	247,008	517.10	127,727,836.80	
	BHARTI AIRTEL LTD	389,936	1,522.50	593,677,560.00	
	INDUS TOWERS LTD	127,238	437.40	55,653,901.20	
	TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,943.45	38,526,952.80	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	60,702	1,885.85	114,474,866.70	
	ADANI POWER LTD	167,705	654.15	109,704,225.75	
	GAIL INDIA LTD	504,548	236.40	119,275,147.20	
	JSW ENERGY LTD	63,163	733.20	46,311,111.60	
	NHPC LTD	546,313	95.00	51,899,735.00	
	NTPC LTD	766,679	409.60	314,031,718.40	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	800,980	335.05	268,368,349.00	
	TATA POWER CO LTD	285,870	428.00	122,352,360.00	
	TORRENT POWER LTD	28,990	1,689.05	48,965,559.50	
	DLF LTD	126,742	845.95	107,217,394.90	
	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	2,894.85	86,156,525.70	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	41,942	1,237.05	51,884,351.10	
	PHOENIX MILLS LTD	17,280	3,651.35	63,095,328.00	
	インドルピー 小計	26,473,199		21,875,717,644.01 (37,844,991,524)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	14.80	886,727.20	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.46	2,094,995.80	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	1,307,286	1.64	2,149,178.18	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	12.86	3,638,338.34	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	4.11	2,184,548.40	
	DUKHAN BANK	319,751	3.76	1,204,502.01	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.29	2,623,416.79	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	10.95	2,349,136.35	
	QATAR ISLAMIC BANK	335,301	19.34	6,484,721.34	
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	15.79	11,705,158.58	

	OOREDOO QSC	72,800	11.10	808,080.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	15.80	1,524,889.60	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.73	568,315.11	
	カタールリアル 小計	5,782,030		38,222,007.70 (1,515,502,605)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	162.50	5,560,262.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	690.61	6,899,884.51	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	67,443	541.81	36,541,291.83	
	GOLD FIELDS LTD	144,200	255.35	36,821,470.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	186.22	18,596,115.42	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	89.40	13,485,721.80	
	KUMBA IRON ORE LTD	17,679	362.48	6,408,283.92	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	125.50	6,032,659.50	
	SASOL LTD	88,115	145.10	12,785,486.50	
	SIBANYE STILLWATER LTD	799,465	19.39	15,501,626.35	
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	290.39	14,607,488.17	
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,644.14	111,477,886.74	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	22.02	10,472,227.56	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	65.66	11,576,908.56	
	BID CORP LTD	58,066	420.90	24,439,979.40	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	365.51	12,947,095.22	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	310.94	26,499,550.56	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	232.05	13,037,033.10	
	ABSA GROUP LTD	140,135	175.95	24,656,753.25	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	2,958.50	43,194,100.00	
	NEDBANK GROUP LTD	88,111	295.00	25,992,745.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	242,949	242.19	58,839,818.31	
	FIRSTRAND LTD	816,636	86.20	70,394,023.20	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	485.91	8,351,335.17	
	REMGRO LTD	74,679	143.84	10,741,827.36	
	DISCOVERY LIMITED	98,779	152.18	15,032,188.22	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	12.78	12,456,103.68	
	OUTSURANCE GROUP LTD	237,864	47.04	11,189,122.56	
	SANLAM LTD	307,490	85.25	26,213,522.50	
	MTN GROUP LTD	350,498	96.00	33,647,808.00	
	VODACOM GROUP	166,454	114.41	19,044,002.14	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	67,336	143.25	9,645,882.00	
	南アフリカランド 小計	6,024,943		753,090,203.03 (6,130,154,252)	
アラブ首長国連邦 ディールハム	MULTIPLY GROUP	519,646	2.16	1,122,435.36	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	2.83	1,220,992.18	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.61	1,602,919.42	

	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.70	4,101,441.00	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	250,781	12.50	3,134,762.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	6.20	3,255,892.80	
	EMIRATES NBD PJSC	357,699	19.75	7,064,555.25	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	13.36	9,672,893.84	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	642,138	17.66	11,340,157.08	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	7.12	5,167,916.72	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	8.56	9,490,198.08	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		6,200,824		57,174,164.23 (2,249,231,620)	
クウェートディ ナール	BOUBAYAN BANK K.S.C	171,769	0.59	101,343.71	
	GULF BANK	162,936	0.31	51,324.84	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,794,507	0.72	1,302,812.08	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,404,477	0.88	1,240,153.19	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.46	139,213.27	
	MABANEE CO KPSC	150,334	0.85	128,234.90	
クウェートディナール 小計		3,980,853		2,963,081.99 (1,403,878,616)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	8.31	1,219,077.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	41.70	3,711,300.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	14.98	958,720.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	5.71	511,045.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	9.32	932,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	24.02	2,310,724.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	7.18	1,707,346.56	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	7.66	609,736.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	14.44	142,956.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	40,365	14.08	568,339.20	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	27.85	779,800.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	6.89	1,132,027.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	21.08	620,595.20	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	6.05	2,235,475.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	9.71	895,262.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	16.23	337,584.00	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	14,420	27.39	394,963.80	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	26.04	291,648.00	
	GEM CO LTD-A	289,800	5.69	1,648,962.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	13.58	337,137.08	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	13.30	493,430.00	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	6.00	885,000.00	
	HESTEEL CO LTD-A	832,100	1.85	1,539,385.00	
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	46.72	1,046,528.00	

INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.42	654,620.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	3.59	215,400.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	7.60	169,480.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	48.52	491,992.80
LB GROUP CO LTD-A	15,300	15.36	235,008.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	6.72	316,512.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	15.31	1,212,552.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	2.25	43,875.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	13.96	664,496.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	8.60	416,670.00
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	15.63	867,074.25
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	28.82	209,002.64
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	21.78	390,733.20
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.71	1,063,286.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	10.85	176,204.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	3.87	424,453.86
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.34	458,916.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	31.23	337,284.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	9.67	482,533.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	25.54	291,156.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	11.67	114,366.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.06	1,014,696.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	69.55	2,802,865.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	26.18	386,207.36
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	33.13	546,148.05
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	30.55	55,601.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	25.41	104,181.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	23.69	886,006.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	21.81	161,612.10
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	16.40	2,122,160.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	19.28	671,869.44
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	16.07	4,324,437.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	35.48	404,472.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	37.54	581,870.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	25.13	211,092.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	7.48	478,720.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	38.33	2,116,390.95
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.18	1,314,758.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	6.87	1,580,787.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.56	3,126,944.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	54,780	183.50	10,052,130.00
CRRC CORP LTD-A	185,800	7.45	1,384,210.00

DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	13.46	581,472.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	31.97	1,261,951.81
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	53.49	128,376.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	8.25	165,915.75
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	18.08	104,864.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	48.12	551,262.72
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	12.32	506,352.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	15.67	753,727.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.19	1,055,571.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	23.32	1,958,413.60
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	8,316	87.02	723,658.32
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	44.39	556,384.26
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.21	850,272.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	16.05	672,495.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	3.53	1,718,051.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	41.70	1,183,988.10
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	5.79	145,097.40
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	14,000	71.17	996,380.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	15.51	631,257.00
TBEA CO LTD-A	29,274	12.18	356,557.32
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	12.85	555,120.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.69	1,333,986.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	17.09	540,044.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	46.50	384,090.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	15.69	114,537.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.36	509,436.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	25.88	284,680.00
AIR CHINA LTD-A	225,900	6.92	1,563,228.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.65	2,243,615.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.75	150,000.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	12.44	2,282,740.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.70	1,075,350.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	33.99	1,804,869.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	32.65	173,665.35
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	6.25	277,500.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	14.70	818,790.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	6.26	136,718.40
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	15,120	32.14	485,956.80
BYD CO LTD -A	17,000	240.80	4,093,600.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	113.60	1,022,400.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	11.68	506,351.36
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	47.09	871,165.00

HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	13.76	471,968.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	87.00	730,800.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	13.50	395,550.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	66,265	31.06	2,058,190.90	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	12.76	543,576.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	15.71	616,680.34	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	37.93	106,204.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	41.77	1,816,995.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	18.31	508,285.60	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	24.10	191,161.20	
MIDEA GROUP CO LTD-A	50,800	65.99	3,352,292.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	43.20	332,640.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	24.08	2,434,488.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	50.94	407,520.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	23.25	609,150.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	7.57	253,443.60	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	13.67	334,915.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	6.76	362,336.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.52	769,488.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	18.31	298,453.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	3.10	190,650.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	59.68	1,236,569.60	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	5.27	582,335.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	12.89	287,330.99	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	17,035	18.25	310,888.75	
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	30.20	323,140.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	167.07	267,312.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	35.20	77,440.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	48.60	889,380.00	
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	72.10	216,300.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	53.18	420,122.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	34.20	1,848,749.40	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	37.18	632,060.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	23.29	1,830,128.20	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	22.64	776,597.28	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	37.55	649,615.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	77.47	704,977.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	16.72	192,280.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,000	1,404.07	18,252,910.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	118.75	2,185,000.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	37.56	1,260,438.48	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	8.90	238,520.00	

SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	175.74	1,648,441.20
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	32.53	370,842.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	16.68	636,508.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	117.70	4,884,550.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	25.06	253,106.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	10.95	325,215.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	9.13	837,668.37
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	28.65	458,400.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	25.96	73,674.48
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	29.56	287,323.20
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	27,985	4.55	127,331.75
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	9.52	140,896.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	235.66	3,511,334.00
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	18,780	60.30	1,132,434.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	99,816	23.87	2,382,607.92
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	33.90	962,760.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	70.21	736,292.27
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	48.56	440,293.52
CHANGCHUN HIGH -TECH INDUST -A	2,200	80.36	176,792.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	13,260	43.26	573,627.60
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	22.25	330,412.50
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	48.50	1,076,360.50
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	47.58	380,640.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	14.93	281,430.50
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,912	138.55	403,457.60
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	119,102	43.60	5,192,847.20
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.36	471,776.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	13.82	150,361.60
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	29.34	205,380.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	9,440	15.10	142,544.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	32.53	365,376.96
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	10.21	173,570.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	38.07	626,784.48
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	53.24	529,205.60
ZHANGZHOU PIEN TZE HUANG PHA-A	3,900	202.26	788,814.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	16.92	152,618.40
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	4.98	5,139,858.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.63	326,540.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	14.96	2,354,704.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	8.03	4,110,557.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	13.37	1,506,799.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	8.22	1,888,462.80

BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.24	1,510,400.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	20.81	1,213,223.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.69	349,895.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	8.36	1,044,164.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.26	2,723,078.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	33.70	6,268,200.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.49	954,864.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.74	1,099,233.20	
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.41	765,354.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	6.53	3,778,258.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	17.33	3,561,315.00	
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	10.43	1,245,342.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.18	732,970.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	8.88	3,883,224.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	2.16	264,600.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	8.59	682,046.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	6.34	363,472.20	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	4.81	95,719.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	6.49	303,083.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	14.77	423,308.20	
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	18.46	2,604,336.80	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	18.57	447,537.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	10.21	1,198,929.67	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	14.35	51,660.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.18	311,836.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	11.63	704,778.00	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	4.87	836,076.73	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	9.04	2,034,904.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	13.97	1,010,031.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.14	933,587.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	94.98	512,892.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	12.35	389,025.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	5.11	583,919.70	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.34	338,403.84	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.50	932,400.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	6.00	1,845,600.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.67	418,380.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.82	472,834.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	5.73	1,803,804.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	28.91	2,896,782.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	43.15	4,522,120.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	6.73	181,037.00	

BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	181.30	874,409.90
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	28.85	930,874.10
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	15.34	254,061.08
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	33.33	359,964.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	45.98	137,940.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	11,437	28.89	330,414.93
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	32.30	177,650.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	8.13	107,072.10
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	33.30	1,262,070.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	614,600	3.79	2,329,334.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	29.52	826,560.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	7.66	266,568.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	37.36	339,976.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	165,100	19.75	3,260,725.00
GOERTEK INC -A	26,900	19.34	520,246.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	6.83	341,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	30.39	212,730.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	31.02	611,466.24
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	16.41	275,688.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	36.54	1,697,283.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	63.33	109,434.24
NINESTAR CORP-A	18,543	23.55	436,687.65
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	17.69	429,867.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	104.66	498,181.60
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	9,009	83.88	755,674.92
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	21.39	609,615.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	3.76	421,872.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	18.91	346,809.40
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	24.39	102,438.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	5.70	306,147.00
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	78.21	367,587.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	32.33	509,197.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	13.06	395,718.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	12,180	113.25	1,379,385.00
ZTE CORP-A	76,400	23.90	1,825,960.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.81	2,033,668.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	11.23	1,951,774.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.70	1,134,110.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	329,880	29.80	9,830,424.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	17.71	984,676.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	5.43	1,714,251.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	16.04	2,837,476.00

	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	17.75	1,638,325.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	130.00	922,610.00	
	AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	51.66	523,729.08	
	CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	244.10	2,788,110.20	
	CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	34.27	720,766.64	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	70.23	440,482.56	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	29,635	14.68	435,041.80	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	17.86	133,950.00	
	HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	41,125	75.30	3,096,712.50	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	43.70	327,750.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	9.34	319,446.68	
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	30.10	896,980.00	
	JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	6.92	159,063.12	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	13.23	1,327,498.20	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	52.13	1,097,597.15	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	300.64	931,984.00	
	SG MICRO CORP-A	4,095	65.99	270,229.05	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	3,920	71.48	280,201.60	
	SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	79.99	327,639.04	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	7.70	283,937.50	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	7.63	249,882.50	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	18.84	423,259.44	
	TONGWEI CO LTD-A	66,600	18.02	1,200,132.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	16.38	416,346.84	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	45.59	312,701.81	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	87.28	636,271.20	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	22.88	389,463.36	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	9.08	496,676.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	414,800	6.31	2,617,388.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.15	1,646,820.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	7.80	638,040.00	
	オフショア人民元 小計	26,183,982		327,866,322.54 (6,635,719,288)	
サウジアラビア リアル	ADES HOLDING CO	80,157	20.62	1,652,837.34	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	708,811	27.85	19,740,386.35	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	38.30	450,982.50	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	114.80	4,295,012.40	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	29.00	1,369,989.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	42.20	8,897,616.80	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	132.00	1,234,068.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	163,857	75.50	12,371,203.50	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	19.24	1,641,614.52	

SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	8.60	889,506.60	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	39.60	2,022,728.40	
SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	6,159	296.00	1,823,064.00	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	258.40	1,087,088.80	
JARIR MARKETING CO	125,000	12.84	1,605,000.00	
NAHDI MEDICAL CO	6,431	133.20	856,609.20	
ALMARAI CO	56,483	55.30	3,123,509.90	
SAVOLA	36,289	26.50	961,658.50	
DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	159.40	1,089,180.20	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	16,399	301.00	4,936,099.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	105.20	1,675,204.80	
AL RAJHI BANK	346,607	88.00	30,501,416.00	
ALINMA BANK	201,652	31.85	6,422,616.20	
ARAB NATIONAL BANK	195,935	19.90	3,899,106.50	
BANK AL-JAZIRA	122,367	18.08	2,212,395.36	
BANK ALBILAD	112,127	38.10	4,272,038.70	
BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	34.70	3,290,774.50	
RIYAD BANK	234,479	26.45	6,201,969.55	
SAUDI AWWAL BANK	147,895	35.05	5,183,719.75	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	88,300	12.70	1,121,410.00	
THE SAUDI NATIONAL BANK	490,774	36.05	17,692,402.70	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	245.80	2,693,230.60	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	232.00	3,299,736.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	16,655	161.00	2,681,455.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	289.60	1,279,163.20	
ELM CO	4,094	1,024.40	4,193,893.60	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	51.10	2,495,928.40	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	11.12	1,006,448.96	
SAUDI TELECOM CO	339,167	43.60	14,787,681.20	
ACWA POWER CO	24,653	414.00	10,206,342.00	
POWER & WATER UTILITY CO FOR	16,081	61.50	988,981.50	
SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	17.80	2,885,540.20	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	14.74	1,488,607.34	
サウジアラビアリアル 小計	4,650,675		200,528,217.07 (7,722,341,639)	
合 計	634,710,670		190,419,963,681 (190,419,963,681)	

(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	16,619,352.00	
			97,360	16,619,352.00	

	メキシコペソ 小計			(121,382,761)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	7,216,809.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,783,980.00	
		KLABIN SA-UNIT	110,000	2,418,900.00	
	ブラジルレアル 小計		347,700	11,419,689.00	
				(298,950,328)	
投資信託受益証券合計			445,060	420,333,089	
				(420,333,089)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	613,700	14,280,799.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	126,346	7,592,131.14	
	メキシコペソ 小計		740,046	21,872,930.14	
				(159,753,319)	
投資証券合計			740,046	159,753,319	
				(159,753,319)	
合計				580,086,408	
				(580,086,408)	

(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 24銘柄	100.0%	—	—	2.1%
メキシコペソ	株式 21銘柄	92.5%	—	—	1.8%
	投資信託受 益証券 1銘柄	—	3.2%	—	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	96.6%	—	—	4.5%
	投資信託受 益証券 3銘柄	—	3.4%	—	0.2%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%	—	—	0.5%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%	—	—	0.1%
ユーロ	株式 10銘柄	100.0%	—	—	0.5%
トルコリラ	株式 17銘柄	100.0%	—	—	0.7%
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	—	—	—	—
香港ドル	株式 156銘柄	100.0%	—	—	19.1%
マレーシアリンギット	株式 32銘柄	100.0%	—	—	1.5%

タイバーツ	株式	31銘柄	100.0%	—	—	1.5%
フィリピンペソ	株式	13銘柄	100.0%	—	—	0.6%
インドネシアルピア	株式	21銘柄	100.0%	—	—	1.8%
韓国ウォン	株式	98銘柄	100.0%	—	—	11.8%
新台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%	—	—	18.7%
インドルピー	株式	146銘柄	100.0%	—	—	19.8%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%	—	—	0.8%
南アフリカランド	株式	32銘柄	100.0%	—	—	3.2%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	11銘柄	100.0%	—	—	1.2%
クウェートディナール	株式	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%	—	—	4.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,546,518,427
国債証券	565,029,947,890
地方債証券	34,694,028,478
特殊債券	37,340,877,804
社債券	31,133,776,000
未収入金	493,059,000
未収利息	1,671,185,588
前払費用	92,970,273
流動資産合計	672,002,363,460
資産合計	672,002,363,460
負債の部	
流動負債	
未払金	2,787,600,880
未払解約金	102,952,618
流動負債合計	2,890,553,498
負債合計	2,890,553,498
純資産の部	
元本等	
元本	507,907,616,786
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	161,204,193,176
元本等合計	669,111,809,962
純資産合計	669,111,809,962

	2024年 8月28日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	672,002,363,460

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月28日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	507,907,616,786口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 98,913,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3174円 (1万口当たり純資産額) (13,174円)

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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年 8月28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、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月28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

	2024年 8月28日現在
	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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月29日
期首元本額	479,811,102,684円
期中追加設定元本額	82,830,768,800円
期中一部解約元本額	54,734,254,698円
期末元本額	507,907,616,786円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	5,127,062,671円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,858,300円
SMT 国内債券インデックス・オープン	15,987,869,627円
世界経済インデックスファンド	8,988,899,197円
DCマイセクション25	29,373,579,582円
DCマイセクション50	36,893,909,096円
DCマイセクション75	12,480,434,896円
DC日本債券インデックス・オープン	395,210,436円
DC日本債券インデックス・オープンS	86,615,656,946円
DC日本債券インデックス・オープンP	60,442,051,928円
DCマイセクションS25	18,404,184,212円
DCマイセクションS50	22,121,172,094円
DCマイセクションS75	6,070,146,231円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	235,163,203円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	3,146,407,067円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	1,322,335,504円
DC世界経済インデックスファンド	6,722,228,721円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,266,068円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	22,699,080円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	8,589,478円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,267,636円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	53,305,359円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	89,759,737円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	28,733,225円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	24,607,138円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,712,443,804円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	746,317,829円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,262,249,043円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	66,063,141円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	43,531,869円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	890,346,424円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	987,860,909円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,333,394,149円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	93,366,033円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,009,377,995円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,525,433,318円
分散投資コア戦略ファンドA	19,153,562,574円
分散投資コア戦略ファンドS	27,595,445,922円

区分	2024年 8月28日現在
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	344,945,741円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,240,630,556円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	91,261,416円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	50,358,245円
SMT インデックスバランス・オープン	66,171,298円
SMT 世界経済インデックス・オープン	65,549,267円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	164,801,217円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	246,199,983円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	22,844,283円
グローバル経済コア	429,650,628円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	57,099,656円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	45,579,248円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	211,498,017円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	124,812,247円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	37,765,149円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	30,122,561円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	1,238,068,984円
10資産分散投資ファンド	470,257,712円
グローバル10資産バランスファンド	648,366,737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	185,414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	154,544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	142,071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	142,071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	216,483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	210,850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	234,291円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	279,544円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	106,690,737,025円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	58,787,970円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	22,151,079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）	549,374,817円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	6,832,982,690
地方債証券	302,116,312
特殊債券	316,506,058
社債券	214,465,000
合計	7,666,070,060

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第452回利付国債（2年）	4,180,000,000	4,169,257,400	

第４５３回利付国債（２年）	1,410,000,000	1,406,009,700	
第４５４回利付国債（２年）	1,910,000,000	1,906,065,400	
第４５５回利付国債（２年）	1,550,000,000	1,544,451,000	
第４５６回利付国債（２年）	1,100,000,000	1,096,975,000	
第４５７回利付国債（２年）	2,720,000,000	2,711,486,400	
第４５８回利付国債（２年）	1,490,000,000	1,486,975,300	
第４５９回利付国債（２年）	30,000,000	29,933,400	
第４６０回利付国債（２年）	2,300,000,000	2,298,275,000	
第４６１回利付国債（２年）	2,850,000,000	2,852,479,500	
第４６２回利付国債（２年）	1,580,000,000	1,581,153,400	
第４６３回利付国債（２年）	2,870,000,000	2,871,635,900	
第１４５回利付国債（５年）	5,210,000,000	5,200,622,000	
第１４６回利付国債（５年）	4,660,000,000	4,647,837,400	
第１４７回利付国債（５年）	4,820,000,000	4,795,707,200	
第１４８回利付国債（５年）	4,960,000,000	4,928,801,600	
第１４９回利付国債（５年）	4,580,000,000	4,545,787,400	
第１５０回利付国債（５年）	4,290,000,000	4,253,620,800	
第１５１回利付国債（５年）	3,250,000,000	3,219,125,000	
第１５２回利付国債（５年）	690,000,000	685,107,900	
第１５３回利付国債（５年）	4,710,000,000	4,660,262,400	
第１５４回利付国債（５年）	5,100,000,000	5,055,222,000	
第１５５回利付国債（５年）	3,070,000,000	3,059,961,100	
第１５６回利付国債（５年）	3,490,000,000	3,467,175,400	
第１５７回利付国債（５年）	2,490,000,000	2,471,648,700	
第１５８回利付国債（５年）	3,220,000,000	3,184,998,600	
第１５９回利付国債（５年）	1,250,000,000	1,234,775,000	
第１６０回利付国債（５年）	1,730,000,000	1,715,398,800	
第１６１回利付国債（５年）	2,840,000,000	2,826,680,400	
第１６２回利付国債（５年）	1,710,000,000	1,700,441,100	
第１６３回利付国債（５年）	4,240,000,000	4,233,216,000	
第１６４回利付国債（５年）	1,750,000,000	1,730,767,500	
第１６５回利付国債（５年）	2,510,000,000	2,493,007,300	
第１６６回利付国債（５年）	1,540,000,000	1,536,088,400	
第１６７回利付国債（５年）	1,160,000,000	1,155,858,800	
第１６８回利付国債（５年）	1,410,000,000	1,417,543,500	
第１６９回利付国債（５年）	1,780,000,000	1,781,584,200	
第１７０回利付国債（５年）	2,030,000,000	2,039,520,700	
第１７１回利付国債（５年）	450,000,000	447,781,500	
第１回利付国債（４０年）	740,000,000	814,791,800	
第２回利付国債（４０年）	1,030,000,000	1,087,195,900	
第３回利付国債（４０年）	730,000,000	765,697,000	
第４回利付国債（４０年）	1,030,000,000	1,074,104,600	

第5回利付国債（40年）	1,050,000,000	1,045,348,500	
第6回利付国債（40年）	1,630,000,000	1,578,850,600	
第7回利付国債（40年）	1,460,000,000	1,342,470,000	
第8回利付国債（40年）	1,480,000,000	1,253,338,000	
第9回利付国債（40年）	2,260,000,000	1,380,182,000	
第10回利付国債（40年）	2,140,000,000	1,533,695,200	
第11回利付国債（40年）	1,915,000,000	1,307,810,950	
第12回利付国債（40年）	1,430,000,000	857,628,200	
第13回利付国債（40年）	2,230,000,000	1,311,463,000	
第14回利付国債（40年）	2,130,000,000	1,333,976,400	
第15回利付国債（40年）	2,950,000,000	2,035,706,500	
第16回利付国債（40年）	2,680,000,000	2,026,723,200	
第17回利付国債（40年）	1,070,000,000	1,047,829,600	
第340回利付国債（10年）	4,830,000,000	4,836,617,100	
第341回利付国債（10年）	5,030,000,000	5,030,000,000	
第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	4,743,006,800	
第343回利付国債（10年）	3,670,000,000	3,652,824,400	
第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	5,867,373,000	
第345回利付国債（10年）	4,880,000,000	4,849,256,000	
第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,709,232,500	
第347回利付国債（10年）	3,840,000,000	3,809,587,200	
第348回利付国債（10年）	4,340,000,000	4,301,894,800	
第349回利付国債（10年）	5,160,000,000	5,109,432,000	
第350回利付国債（10年）	6,570,000,000	6,498,584,100	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	5,325,000,000	5,260,141,500	
第352回利付国債（10年）	4,230,000,000	4,172,598,900	
第353回利付国債（10年）	4,415,000,000	4,347,803,700	
第354回利付国債（10年）	4,420,000,000	4,345,081,000	
第355回利付国債（10年）	4,170,000,000	4,091,645,700	
第356回利付国債（10年）	4,800,000,000	4,704,048,000	
第357回利付国債（10年）	3,830,000,000	3,748,804,000	
第358回利付国債（10年）	3,370,000,000	3,293,534,700	
第359回利付国債（10年）	4,065,000,000	3,966,505,050	
第360回利付国債（10年）	5,430,000,000	5,288,222,700	
第361回利付国債（10年）	5,580,000,000	5,423,536,800	
第362回利付国債（10年）	4,550,000,000	4,412,044,000	
第363回利付国債（10年）	4,960,000,000	4,797,758,400	
第364回利付国債（10年）	5,120,000,000	4,938,240,000	
第365回利付国債（10年）	4,967,000,000	4,776,366,540	
第366回利付国債（10年）	5,600,000,000	5,410,664,000	
第367回利付国債（10年）	4,790,000,000	4,614,350,700	
第368回利付国債（10年）	5,650,000,000	5,426,147,000	

第369回利付国債（10年）	5,170,000,000	5,074,820,300	
第370回利付国債（10年）	5,880,000,000	5,757,166,800	
第371回利付国債（10年）	5,540,000,000	5,362,055,200	
第372回利付国債（10年）	5,360,000,000	5,357,695,200	
第373回利付国債（10年）	5,780,000,000	5,660,180,600	
第374回利付国債（10年）	5,320,000,000	5,289,463,200	
第375回利付国債（10年）	1,780,000,000	1,813,713,200	
第1回利付国債（30年）	110,000,000	122,607,100	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	176,307,200	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	132,018,000	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	125,791,600	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	55,313,000	
第6回利付国債（30年）	580,000,000	652,314,400	
第7回利付国債（30年）	380,000,000	426,265,000	
第8回利付国債（30年）	850,000,000	923,134,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	252,993,600	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	164,568,000	
第11回利付国債（30年）	260,000,000	280,290,400	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	211,490,900	
第13回利付国債（30年）	400,000,000	441,780,000	
第14回利付国債（30年）	750,000,000	855,390,000	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	390,966,000	
第16回利付国債（30年）	400,000,000	460,100,000	
第17回利付国債（30年）	1,130,000,000	1,289,906,300	
第18回利付国債（30年）	505,000,000	571,776,150	
第19回利付国債（30年）	630,000,000	713,361,600	
第20回利付国債（30年）	660,000,000	761,244,000	
第21回利付国債（30年）	960,000,000	1,087,353,600	
第22回利付国債（30年）	300,000,000	346,257,000	
第23回利付国債（30年）	430,000,000	496,284,500	
第24回利付国債（30年）	780,000,000	900,104,400	
第25回利付国債（30年）	650,000,000	735,358,000	
第26回利付国債（30年）	1,610,000,000	1,839,891,900	
第27回利付国債（30年）	1,370,000,000	1,580,897,800	
第28回利付国債（30年）	1,830,000,000	2,109,825,300	
第29回利付国債（30年）	1,770,000,000	2,017,021,200	
第30回利付国債（30年）	1,970,000,000	2,215,186,200	
第31回利付国債（30年）	1,360,000,000	1,507,505,600	
第32回利付国債（30年）	1,950,000,000	2,182,537,500	
第33回利付国債（30年）	2,410,000,000	2,589,400,400	
第34回利付国債（30年）	2,085,000,000	2,293,771,050	
第35回利付国債（30年）	2,480,000,000	2,646,631,200	
第36回利付国債（30年）	2,310,000,000	2,458,533,000	

第 3 7 回利付国債（3 0 年）	2,605,000,000	2,722,120,800	
第 3 8 回利付国債（3 0 年）	1,390,000,000	1,425,695,200	
第 3 9 回利付国債（3 0 年）	1,800,000,000	1,871,298,000	
第 4 0 回利付国債（3 0 年）	1,290,000,000	1,317,090,000	
第 4 1 回利付国債（3 0 年）	1,310,000,000	1,313,812,100	
第 4 2 回利付国債（3 0 年）	1,560,000,000	1,561,138,800	
第 4 3 回利付国債（3 0 年）	1,390,000,000	1,387,942,800	
第 4 4 回利付国債（3 0 年）	1,310,000,000	1,306,083,100	
第 4 5 回利付国債（3 0 年）	1,600,000,000	1,536,608,000	
第 4 6 回利付国債（3 0 年）	1,860,000,000	1,781,619,600	
第 4 7 回利付国債（3 0 年）	1,710,000,000	1,663,248,600	
第 4 8 回利付国債（3 0 年）	1,720,000,000	1,608,784,800	
第 4 9 回利付国債（3 0 年）	1,820,000,000	1,697,404,800	
第 5 0 回利付国債（3 0 年）	1,860,000,000	1,530,705,600	
第 5 1 回利付国債（3 0 年）	1,920,000,000	1,402,003,200	
第 5 2 回利付国債（3 0 年）	1,810,000,000	1,379,636,300	
第 5 3 回利付国債（3 0 年）	1,550,000,000	1,204,086,500	
第 5 4 回利付国債（3 0 年）	1,880,000,000	1,523,401,600	
第 5 5 回利付国債（3 0 年）	1,600,000,000	1,291,168,000	
第 5 6 回利付国債（3 0 年）	1,780,000,000	1,430,479,200	
第 5 7 回利付国債（3 0 年）	1,630,000,000	1,304,505,300	
第 5 8 回利付国債（3 0 年）	2,050,000,000	1,633,850,000	
第 5 9 回利付国債（3 0 年）	1,450,000,000	1,122,430,500	
第 6 0 回利付国債（3 0 年）	1,610,000,000	1,302,216,300	
第 6 1 回利付国債（3 0 年）	1,530,000,000	1,172,989,800	
第 6 2 回利付国債（3 0 年）	1,135,000,000	821,478,950	
第 6 3 回利付国債（3 0 年）	1,460,000,000	1,021,824,800	
第 6 4 回利付国債（3 0 年）	1,620,000,000	1,127,082,600	
第 6 5 回利付国債（3 0 年）	1,255,000,000	868,673,350	
第 6 6 回利付国債（3 0 年）	1,515,000,000	1,042,456,350	
第 6 7 回利付国債（3 0 年）	1,475,000,000	1,068,032,750	
第 6 8 回利付国債（3 0 年）	1,670,000,000	1,203,485,500	
第 6 9 回利付国債（3 0 年）	1,710,000,000	1,261,535,400	
第 7 0 回利付国債（3 0 年）	1,920,000,000	1,410,048,000	
第 7 1 回利付国債（3 0 年）	1,470,000,000	1,074,614,100	
第 7 2 回利付国債（3 0 年）	1,810,000,000	1,317,064,600	
第 7 3 回利付国債（3 0 年）	1,830,000,000	1,325,523,900	
第 7 4 回利付国債（3 0 年）	2,110,000,000	1,655,717,000	
第 7 5 回利付国債（3 0 年）	1,700,000,000	1,437,265,000	
第 7 6 回利付国債（3 0 年）	1,810,000,000	1,565,559,500	
第 7 7 回利付国債（3 0 年）	2,010,000,000	1,820,235,900	
第 7 8 回利付国債（3 0 年）	1,460,000,000	1,256,242,400	

第 7 9 回利付国債（30年）	1,350,000,000	1,102,234,500	
第 8 0 回利付国債（30年）	2,270,000,000	2,143,220,500	
第 8 1 回利付国債（30年）	1,300,000,000	1,168,284,000	
第 8 2 回利付国債（30年）	1,520,000,000	1,430,304,800	
第 8 3 回利付国債（30年）	460,000,000	473,202,000	
第 8 1 回利付国債（20年）	390,000,000	397,133,100	
第 8 2 回利付国債（20年）	600,000,000	611,604,000	
第 8 3 回利付国債（20年）	290,000,000	296,809,200	
第 8 4 回利付国債（20年）	470,000,000	480,419,900	
第 8 5 回利付国債（20年）	290,000,000	297,969,200	
第 8 6 回利付国債（20年）	510,000,000	525,590,700	
第 8 7 回利付国債（20年）	1,790,000,000	1,841,963,700	
第 8 8 回利付国債（20年）	420,000,000	434,712,600	
第 8 9 回利付国債（20年）	350,000,000	361,634,000	
第 9 0 回利付国債（20年）	630,000,000	653,637,600	
第 9 1 回利付国債（20年）	450,000,000	467,802,000	
第 9 2 回利付国債（20年）	880,000,000	914,856,800	
第 9 3 回利付国債（20年）	120,000,000	124,936,800	
第 9 4 回利付国債（20年）	610,000,000	636,638,700	
第 9 5 回利付国債（20年）	830,000,000	874,396,700	
第 9 6 回利付国債（20年）	1,590,000,000	1,666,208,700	
第 9 7 回利付国債（20年）	900,000,000	949,545,000	
第 9 8 回利付国債（20年）	440,000,000	462,893,200	
第 9 9 回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,488,776,700	
第 1 0 0 回利付国債（20年）	480,000,000	510,379,200	
第 1 0 1 回利付国債（20年）	715,000,000	765,271,650	
第 1 0 2 回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,268,039,800	
第 1 0 3 回利付国債（20年）	400,000,000	428,344,000	
第 1 0 4 回利付国債（20年）	160,000,000	170,137,600	
第 1 0 5 回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,258,883,000	
第 1 0 6 回利付国債（20年）	680,000,000	728,171,200	
第 1 0 7 回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,176,978,000	
第 1 0 8 回利付国債（20年）	840,000,000	891,676,800	
第 1 0 9 回利付国債（20年）	920,000,000	978,898,400	
第 1 1 0 回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,180,234,000	
第 1 1 1 回利付国債（20年）	970,000,000	1,048,162,600	
第 1 1 2 回利付国債（20年）	990,000,000	1,065,121,200	
第 1 1 3 回利付国債（20年）	2,020,000,000	2,181,115,200	
第 1 1 4 回利付国債（20年）	2,200,000,000	2,383,282,000	
第 1 1 5 回利付国債（20年）	700,000,000	761,943,000	
第 1 1 6 回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,813,035,400	
第 1 1 7 回利付国債（20年）	1,980,000,000	2,151,824,400	
第 1 1 8 回利付国債（20年）	660,000,000	715,671,000	

第119回利付国債（20年）	460,000,000	493,474,200	
第120回利付国債（20年）	1,070,000,000	1,135,783,600	
第121回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,751,333,400	
第122回利付国債（20年）	750,000,000	806,400,000	
第123回利付国債（20年）	1,800,000,000	1,972,530,000	
第124回利付国債（20年）	760,000,000	828,202,400	
第125回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,369,902,400	
第126回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,190,007,500	
第127回利付国債（20年）	1,020,000,000	1,107,128,400	
第128回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,761,199,200	
第129回利付国債（20年）	740,000,000	799,651,400	
第130回利付国債（20年）	2,055,000,000	2,222,770,200	
第131回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,386,582,300	
第132回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,322,889,600	
第133回利付国債（20年）	1,810,000,000	1,960,030,900	
第134回利付国債（20年）	1,140,000,000	1,235,748,600	
第135回利付国債（20年）	170,000,000	182,988,000	
第136回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,325,795,600	
第137回利付国債（20年）	1,390,000,000	1,497,335,800	
第138回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,412,433,400	
第139回利付国債（20年）	480,000,000	513,312,000	
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,683,049,700	
第141回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,293,720,000	
第142回利付国債（20年）	1,215,000,000	1,319,951,700	
第143回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,733,497,200	
第144回利付国債（20年）	1,160,000,000	1,231,432,800	
第145回利付国債（20年）	2,275,000,000	2,452,541,000	
第146回利付国債（20年）	2,670,000,000	2,879,061,000	
第147回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,928,649,000	
第148回利付国債（20年）	2,360,000,000	2,497,776,800	
第149回利付国債（20年）	2,950,000,000	3,116,527,500	
第150回利付国債（20年）	2,390,000,000	2,497,932,400	
第151回利付国債（20年）	2,205,000,000	2,257,809,750	
第152回利付国債（20年）	2,420,000,000	2,473,288,400	
第153回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,421,111,000	
第154回利付国債（20年）	2,835,000,000	2,885,718,150	
第155回利付国債（20年）	2,400,000,000	2,386,656,000	
第156回利付国債（20年）	2,690,000,000	2,493,092,000	
第157回利付国債（20年）	2,900,000,000	2,610,841,000	
第158回利付国債（20年）	2,790,000,000	2,592,412,200	
第159回利付国債（20年）	2,780,000,000	2,603,887,000	
第160回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,277,257,200	

	第161回利付国債（20年）	2,520,000,000	2,341,735,200	
	第162回利付国債（20年）	1,650,000,000	1,527,009,000	
	第163回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,182,983,300	
	第164回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,144,067,900	
	第165回利付国債（20年）	2,310,000,000	2,080,247,400	
	第166回利付国債（20年）	2,150,000,000	1,981,332,500	
	第167回利付国債（20年）	2,340,000,000	2,086,437,600	
	第168回利付国債（20年）	1,740,000,000	1,521,316,800	
	第169回利付国債（20年）	2,160,000,000	1,849,284,000	
	第170回利付国債（20年）	2,530,000,000	2,153,055,300	
	第171回利付国債（20年）	2,060,000,000	1,743,522,200	
	第172回利付国債（20年）	1,750,000,000	1,496,810,000	
	第173回利付国債（20年）	2,600,000,000	2,211,924,000	
	第174回利付国債（20年）	2,360,000,000	1,996,866,800	
	第175回利付国債（20年）	2,210,000,000	1,891,892,600	
	第176回利付国債（20年）	2,180,000,000	1,857,599,800	
	第177回利付国債（20年）	2,230,000,000	1,857,077,100	
	第178回利付国債（20年）	2,460,000,000	2,073,706,200	
	第179回利付国債（20年）	2,825,000,000	2,370,005,500	
	第180回利付国債（20年）	2,300,000,000	2,025,587,000	
	第181回利付国債（20年）	2,690,000,000	2,400,744,300	
	第182回利付国債（20年）	2,260,000,000	2,079,810,200	
	第183回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,402,451,600	
	第184回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,266,893,600	
	第185回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,258,263,200	
	第186回利付国債（20年）	2,200,000,000	2,138,180,000	
	第187回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,902,272,400	
	第188回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,387,256,700	
	第189回利付国債（20年）	820,000,000	846,182,600	
	国債証券合計	584,937,000,000	565,029,947,890	
地方債証券	第2回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（5年））	100,000,000	99,155,000	
	第5回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	71,647,000	
	第6回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（5年））	100,000,000	99,527,000	
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	111,872,000	
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	108,601,000	
	第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	103,900,000	
	第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	100,237,000	
	第16回東京都公募公債（20年）	200,000,000	212,480,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	106,577,000	
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	107,310,000	
	第19回東京都公募公債（30年）	100,000,000	72,676,000	

第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	214,602,000	
第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	213,734,000	
第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,008,000	
第38回東京都公募公債（20年）	200,000,000	165,382,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	99,973,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	99,333,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	99,169,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	295,962,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	194,592,000	
第830回東京都公募公債	300,000,000	288,624,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	99,716,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,429,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,434,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	196,992,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	195,704,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,226,000	
第39回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	97,643,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	230,850,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,166,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	215,792,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	108,613,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,050,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	103,455,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	99,745,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,295,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,169,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	194,540,000	
第260回神奈川県公募公債	208,000,000	206,762,400	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	215,978,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	300,000,000	323,418,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	107,189,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,135,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,123,280	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,274,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	196,976,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,444,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	96,988,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	154,526,400	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	175,420,700	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	192,610,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	107,946,000	
	100,000,000	107,452,000	

平成23年度第5回京都府公募公債（20年）			
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	90,162,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	92,107,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	135,954,825	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	105,706,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,193,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	102,451,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	102,348,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	434,004,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	90,104,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	292,755,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	94,330,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	78,259,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	107,051,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	104,347,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,197,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,252,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,186,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	301,533,900	
令和5年度第7回静岡県公募公債	165,000,000	163,236,150	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	108,013,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,971,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,729,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,308,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	198,504,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	274,170,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,830,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	77,049,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	194,492,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	97,243,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	143,134,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,205,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	107,268,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	215,220,000	

平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	125,380,276	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,189,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	378,721,200	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	96,831,000	
第2回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	98,707,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	105,414,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	106,950,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	82,385,000	
第7回埼玉県公募公債（15年）	600,000,000	551,556,000	
第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	216,136,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	182,330,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	215,792,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	181,040,000	
第23回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	89,808,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	400,000,000	400,416,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,214,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,456,000	
第28回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	167,068,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,193,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	96,930,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	96,763,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	143,820,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	105,610,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	106,409,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	101,578,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,735,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	102,284,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	106,321,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	101,737,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,097,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	77,049,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	90,518,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	292,152,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,550,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	89,982,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債（グリーン ボンド・10年）	100,000,000	98,459,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	98,207,000	

第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	213,900,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	107,697,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	107,051,000	
第20回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	91,756,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,218,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,170,800	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	291,462,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	97,131,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	127,210,200	
令和6年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	98,988,000	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,114,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	290,679,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	289,788,000	
令和6年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	301,422,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	98,363,000	
令和6年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	100,388,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	214,512,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	98,163,000	
第30回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	100,772,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,125,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,139,000	
第153回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,520,000	
第154回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,030,000	
第156回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,998,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,424,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,624,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,470,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	396,840,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,078,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,309,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,446,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,354,000	
第174回共同発行市場公募地方債	594,300,000	588,172,767	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,159,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,442,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,419,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	191,900,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,640,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,366,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,521,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,027,000	
第255回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,184,000	

令和４年度第３回長崎県公募公債（１０年）	100,000,000	96,899,000	
令和４年度第１回熊本市公募公債	101,000,000	98,028,580	
平成２７年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	100,120,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	99,138,000	
平成３０年度第１回浜松市公募公債	100,000,000	98,212,000	
令和２年度第１回静岡市公募公債	200,000,000	193,898,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	216,698,000	
第１５回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	71,284,000	
第１９回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	100,461,000	
第１９回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	102,534,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	600,000,000	544,488,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	92,886,000	
令和３年度第２回大阪市公募公債	200,000,000	193,188,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	114,407,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	113,463,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	106,493,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	99,250,000	
第４９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	99,366,000	
第５１回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	292,086,000	
第５２回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,772,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	198,614,000	
令和２年度第１回京都市公募公債	200,000,000	194,232,000	
令和５年度第７回京都市公募公債	100,000,000	99,608,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	124,520,400	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	213,814,000	
平成２１年度第１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	108,690,000	
平成２４年度第１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	107,144,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	72,031,000	
令和３年度第６回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	71,429,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	322,854,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	99,299,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	99,317,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	98,875,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	99,003,000	
第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	206,360,000	
令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	292,113,000	
令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	96,592,000	
平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	102,489,000	
平成２６年度第１回札幌市公募公債（２０年）	100,000,000	101,824,000	

	平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	99,739,000	
	令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	195,490,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	107,250,000	
	第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	180,128,000	
	第17回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	105,570,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,292,000	
	第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,874,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,128,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,441,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	107,692,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	105,111,000	
	2023年度第8回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	98,875,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,262,900	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	168,420,700	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	535,513,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	298,782,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	194,308,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	288,066,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	96,416,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	97,692,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,143,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	98,101,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	105,758,000	
	地方債証券合計	35,077,030,000	34,694,028,478	
特殊債券	第37回新関西国際空港株式会社社債	100,000,000	93,526,000	
	第1回国立大学法人東京大学債券	100,000,000	61,715,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,215,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,224,000	
	第109回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	62,384,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	53,820,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	130,000,000	132,978,300	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,238,000	
	第21回道路債券	100,000,000	115,201,000	
	第28回道路債券	200,000,000	231,998,000	
	第33回道路債券	200,000,000	233,428,000	

第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,464,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,633,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,980,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,106,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,609,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,388,000	
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,864,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,087,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,221,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,191,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,472,000	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,820,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,230,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,696,000	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,165,000	
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,804,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,978,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	544,614,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,928,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	73,111,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,980,000	
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,285,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,648,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,234,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,364,000	
第247回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	165,670,000	
	100,000,000	100,045,000	

第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第261回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	140,000,000	140,046,200	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,858,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,649,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	73,540,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	247,000,000	244,678,200	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,458,000	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	111,106,240	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	203,452,250	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,248,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,496,000	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,259,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,444,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	285,186,000	
第314回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	91,177,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,554,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,153,000	
第331回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,400,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	118,902,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,562,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	271,191,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	211,539,000	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,413,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,113,000	
第400回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	274,164,000	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	116,208,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	338,007,000	

第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	102,520,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	346,608,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	230,364,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	113,599,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	215,896,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	212,744,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	141,612,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,764,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	538,055,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	106,514,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	106,736,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	529,165,000	
第43回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	100,249,000	
第45回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	100,806,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,324,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,195,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,031,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,663,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	201,000,000	199,876,410	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,742,000	
第86回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	250,533,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,112,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,215,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	249,074,830	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	359,000,000	355,926,960	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,202,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,167,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,003,400	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	154,323,000	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,881,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,085,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,735,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,373,000	
F143回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,463,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,676,000	

第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	196,084,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,799,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,590,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,796,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,595,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,132,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,197,000	
F246回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,986,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,073,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,054,000	
第33回首都高速道路株式会社社債	200,000,000	199,058,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,308,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,623,000	
第30回阪神高速道路株式会社社債	300,000,000	298,320,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	107,677,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,293,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,295,660	
第44回政府保証日本政策金融公庫債券	117,000,000	116,127,180	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,199,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	207,738,300	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	184,911,210	
第117回都市再生債券	200,000,000	201,246,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	107,110,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	59,512,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	124,266,000	
第191回都市再生債券	100,000,000	84,867,000	
第17回政府保証民間都市開発債券	300,000,000	298,947,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	97,203,000	
第23回政府保証中部国際空港債券	104,000,000	103,418,640	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	81,537,000	80,558,556	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,418,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	56,832,000	56,240,947	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	104,332,000	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	98,532,000	97,171,273	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	112,197,000	110,186,429	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	39,922,000	39,297,619	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	141,534,000	139,061,401	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	96,858,000	95,230,785	

第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,729,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,787,000	13,119,589	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,308,000	12,629,115	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,954,000	14,432,203	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,226,000	16,789,204	
第29回政府保証住宅金融支援機構債券	600,000,000	598,620,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,086,000	17,729,971	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,373,000	18,001,728	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,274,000	37,551,570	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,317,000	16,818,421	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,792,000	17,297,607	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,368,000	16,871,807	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,542,000	16,010,435	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,746,000	33,611,476	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,385,000	17,853,351	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,280,000	23,838,952	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,063,000	22,594,497	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,201,000	22,753,138	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,626,000	48,615,668	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,922,000	60,473,881	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,023,000	31,235,197	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,426,000	97,825,141	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,535,000	33,036,364	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,194,000	28,653,844	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,022,000	27,263,576	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,927,000	32,464,331	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	163,138,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,947,000	83,691,034	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,352,000	114,219,142	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,871,000	32,940,686	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,291,000	34,343,808	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,244,000	35,147,431	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,557,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,763,000	110,283,396	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,095,000	37,778,811	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,662,000	79,206,050	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,678,000	44,890,054	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,700,000	47,579,900	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	308,091,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,024,000	47,166,771	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,615,000	148,241,307	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,276,000	99,451,006	
	49,605,000	48,600,498	

第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,401,000	52,200,545	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,539,000	56,139,918	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,988,000	61,394,163	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,119,000	60,366,114	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,888,000	61,286,716	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,273,000	61,981,935	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,605,000	62,125,310	
第119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,214,000	124,301,646	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,656,000	63,811,109	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	271,676,000	256,372,490	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,328,000	63,337,469	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,192,000	63,198,107	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,030,000	63,966,568	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,880,000	130,173,612	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,000,000	127,823,680	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,766,000	131,486,262	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,883,000	65,585,894	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,972,000	130,049,997	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,133,000	65,713,919	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,758,000	132,360,862	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,816,000	132,406,508	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,908,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,023,000	67,589,264	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,342,000	67,126,401	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,526,000	66,588,560	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,030,000	136,994,363	

第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,383,000	68,707,577	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,370,000	67,898,065	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,380,000	138,773,671	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,957,000	69,517,365	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	230,301,000	209,412,699	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,758,000	141,641,652	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,368,000	73,171,740	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,156,000	73,648,134	
第158回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,059,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,924,000	151,214,972	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,153,000	76,578,923	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,438,000	154,036,262	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,654,000	155,681,296	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,890,000	77,230,811	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,056,000	156,293,962	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,272,000	155,286,449	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,654,000	78,903,608	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,743,000	79,413,216	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	259,011,000	237,041,686	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,932,000	79,612,325	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,523,000	81,312,801	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,096,000	81,761,897	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,569,000	83,202,435	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,334,000	83,988,939	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,846,000	169,511,041	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,397,000	87,820,576	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,526,000	179,353,736	

第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,300,000	90,730,518	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	88,061,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,552,000	90,973,706	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,417,000	91,644,916	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,944,000	187,596,468	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,354,000	94,593,612	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,357,000	94,884,665	
第206回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,885,000	100,389,419	
第208回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,334,000	
第299回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	60,355,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	72,288,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	281,346,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,080,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,458,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,622,000	
い第876号商工債	400,000,000	395,556,000	
い第878号商工債	100,000,000	98,726,000	
い第888号商工債	200,000,000	200,142,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,310,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,130,000	
第384回信金中金債（5年）	200,000,000	197,644,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	395,220,000	
第394回信金中金債（5年）	100,000,000	98,712,000	
第411回信金中金債（5年）	200,000,000	198,380,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	99,921,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,090,000	
第20回アンデス開発公社円貨債券（2023）	300,000,000	298,611,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	106,728,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,184,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	194,976,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	485,685,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,860,000	
第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,137,000	
第111回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,716,000	
第114回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,372,000	
第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,548,000	
第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,253,000	
第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,355,000	

	第103回中日本高速道路株式会社社債	400,000,000	399,468,000	
	第104回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,474,000	
	第105回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,438,000	
	第107回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,329,000	
	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,248,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,536,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,498,000	
	第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,097,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,506,000	
	第82回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,729,000	
	第85回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,360,000	
	第91回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,678,000	
	第93回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,928,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,100,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	186,090,000	
	特殊債券合計	38,198,450,000	37,340,877,804	
社債券	第27回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	100,000,000	99,825,000	
	第41回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	200,000,000	200,470,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,218,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,328,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,260,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	398,844,000	
	第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債（2023）	100,000,000	99,486,000	
	第8回ビー・エス・ピー・パリバ円貨社債（2023）	400,000,000	399,168,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	96,674,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,799,000	
	第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,294,000	
	第9回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,430,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,273,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,634,000	
	第2回DM三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,648,000	
	第19回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,608,000	
	第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,286,000	
	第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,227,000	

第27回株式会社ニチレイ無担保社債	200,000,000	198,976,000	
第7回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,527,000	
第8回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,233,000	
第9回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,702,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,385,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,421,000	
第10回J. フロント リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	98,540,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,855,000	
第27回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,532,000	
第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,749,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,104,000	
第16回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,545,000	
第17回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,752,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,546,000	
第9回株式会社クレハ無担保社債	100,000,000	100,001,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,417,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,605,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	98,562,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	197,586,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	79,170,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,601,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,695,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	195,474,000	
第2回株式会社ADEKA無担保社債	100,000,000	99,470,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	285,027,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,673,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	198,864,000	
第10回テルモ株式会社無担保社債	300,000,000	299,349,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,488,000	
第10回関西ペイント株式会社無担保社債	200,000,000	200,320,000	
第23回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,852,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,494,000	
第2回サワイグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,604,000	

第20回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,948,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	96,993,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,994,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,376,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	97,992,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	96,560,000	
第20回住友大阪セメント株式会社無担保社債	100,000,000	100,437,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,257,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	98,905,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,678,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	98,955,000	
第17回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,305,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	98,089,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,604,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,882,000	
第23回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,328,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,086,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,614,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,430,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	96,188,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,587,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,352,000	
第39回ソニーグループ株式会社無担保社債	500,000,000	496,905,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,716,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,927,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,052,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,273,000	
第28回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,919,000	
第29回J A三井リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,762,000	
第31回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,001,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,316,000	
第32回いすゞ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,648,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	192,050,000	
第32回マツダ株式会社無担保社債	100,000,000	100,620,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	99,749,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,210,000	
第4回オリックス銀行株式会社無担保社債	200,000,000	199,882,000	
第9回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	91,554,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	83,198,000	

第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,024,000	
第119回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,020,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	107,136,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	195,040,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,868,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,481,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	200,000,000	192,328,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,301,000	
第43回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	198,316,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	100,000,000	98,857,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,894,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	96,605,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	98,933,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	108,192,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,232,000	
第41回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,829,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,736,000	
第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,948,000	
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	389,008,000	
第25回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	98,956,000	
第26回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	194,472,000	
第30回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	300,450,000	
第34回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,019,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,743,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,221,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,656,000	
第86回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	300,000,000	300,297,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,166,000	
第44回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,203,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	98,976,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,104,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,819,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,206,000	

第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,666,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,644,000	
第36回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	198,612,000	
第42回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,336,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,794,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,901,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,504,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	98,506,000	
第39回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,413,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,689,000	
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,174,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,964,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	197,664,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,084,000	
第84回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	197,350,000	
第86回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	189,892,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,648,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	83,521,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,448,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,714,000	
第17回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	86,929,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,338,000	
第135回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,968,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	77,555,000	
第89回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,859,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,879,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,494,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,460,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	71,002,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,720,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,601,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,801,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	214,008,000	
	100,000,000	99,600,000	

第109回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債			
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,005,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	81,566,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	70,515,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,053,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	70,787,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	82,624,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	62,205,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,186,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	67,272,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	79,813,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	82,383,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,731,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,172,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,967,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	70,227,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	59,005,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	49,319,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	63,138,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	73,802,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	142,226,000	
第56回名古屋鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	87,769,000	
第13回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	100,499,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,206,000	
第32回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,002,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,913,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	169,364,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	92,406,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,264,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	91,243,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	81,834,000	
第545回中部電力株式会社社債	100,000,000	95,324,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,402,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,860,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,147,000	

第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,967,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,447,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,038,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,207,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,245,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,931,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,670,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,714,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	290,808,000	
第457回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,924,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,140,000	
第323回北陸電力株式会社社債	100,000,000	90,087,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,534,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	178,920,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,976,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,408,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,448,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,504,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,911,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,111,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	94,952,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,674,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,613,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,778,000	
第476回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,177,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,696,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,143,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,107,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,872,000	
第332回北海道電力株式会社社債	100,000,000	92,326,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,415,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	87,345,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	97,646,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	89,266,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,228,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,533,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,245,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,158,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,030,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,788,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,332,000	

第4 2 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,410,000	
第4 5 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,895,000	
第4 8 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	265,014,000	
第6 4 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,161,000	
第6 7 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	93,362,000	
第6 9 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,030,000	
第7 5 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,647,000	
第9 回株式会社J E R A 無担保社債	100,000,000	95,510,000	
第2 2 回株式会社J E R A 無担保社債	200,000,000	198,888,000	
第4 回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	99,906,000	
第5 回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	97,999,000	
第6 4 回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	70,544,000	
第6 5 回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	192,988,000	
第4 1 回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,332,000	
第4 2 回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	82,067,000	
第7 回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	197,522,000	
社債券合計	32,300,000,000	31,133,776,000	
合計		668,198,630,172	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2024年 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	92,068,605
コール・ローン	527,304,035
国債証券	76,861,362,704
派生商品評価勘定	3,113,824,640
未収入金	12,563,320
未収利息	524,482,712
前払金	597,444
前払費用	72,654,536
差入委託証拠金	51,714,486

	2024年 8月28日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	81,256,572,482
資産合計	81,256,572,482
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,246,356
未払解約金	134,410
流動負債合計	3,380,766
負債合計	3,380,766
純資産の部	
元本等	
元本	97,262,353,600
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△16,009,161,884
元本等合計	81,253,191,716
純資産合計	81,253,191,716
負債純資産合計	81,256,572,482

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月28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、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 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,262,353,600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 16,009,161,884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 0.8354円 (1万口当たり純資産額) (8,354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 8月28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、当該規定に従い債券先物取引及び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 8月28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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月29日
期首元本額	85,624,967,947円
期中追加設定元本額	20,821,443,914円
期中一部解約元本額	9,184,058,261円
期末元本額	97,262,353,600円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	21,453,874,695円
分散投資コア戦略ファンドS	31,960,151,748円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	1,957,440,404円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	884,438,415円

区分	2024年 8月28日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	208,123,809円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	68,277,603円
10資産分散投資ファンド	755,396,354円
グローバル10資産バランスファンド	136,668,598円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	9,675,651,726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）	2,712,840,265円
私募外国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	3,079,270,398円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,827,468,385円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,654,052,688円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,638,318,741円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,736,942,367円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,699,890,430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）	3,486,314,618円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	2,327,232,356円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,648,638,742
合計	1,648,638,742

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックスマザーファンド（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）

債券関連

（2024年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	432,273,130	—	431,675,686	△597,444
合計		432,273,130	—	431,675,686	△597,444

（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ではありません。

通貨関連

（2024年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	80,020,915,198	—	76,909,739,470	3,111,175,728
	アメリカドル	37,923,001,220	—	35,927,876,147	1,995,125,073
	カナダドル	1,597,509,923	—	1,557,054,399	40,455,524
	メキシコペソ	613,825,135	—	555,557,500	58,267,635
	ユーロ	24,147,456,675	—	23,594,339,839	553,116,836

	イギリスポンド	4,267,249,303	—	4,172,562,443	94,686,860
	スウェーデンクローナ	123,916,538	—	124,266,825	△350,287
	ノルウェークローネ	123,841,332	—	122,511,738	1,329,594
	デンマーククローネ	210,287,199	—	205,459,587	4,827,612
	ポーランドズロチ	413,319,213	—	405,339,857	7,979,356
	オーストラリアドル	1,026,352,013	—	1,016,138,396	10,213,617
	ニュージーランドドル	197,730,935	—	197,972,011	△241,076
	シンガポールドル	319,385,779	—	311,567,880	7,817,899
	マレーシアリンギット	395,886,374	—	397,002,335	△1,115,961
	イスラエルシェケル	250,633,327	—	242,939,751	7,693,576
	オフショア人民元	8,410,520,232	—	8,079,150,762	331,369,470
	合計	80,020,915,198	—	76,909,739,470	3,111,175,728

(注)時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 07/31/25	600,000.00	577,772.52	
		T 0.25% 08/31/25	2,550,000.00	2,447,524.11	
		T 0.25% 09/30/25	1,250,000.00	1,196,752.92	
		T 0.25% 10/31/25	1,240,000.00	1,183,812.50	
		T 0.375% 01/31/26	1,550,000.00	1,470,804.68	
		T 0.375% 07/31/27	1,000,000.00	907,832.03	
		T 0.375% 09/30/27	1,020,000.00	921,386.71	
		T 0.375% 11/30/25	800,000.00	762,937.50	
		T 0.375% 12/31/25	1,700,000.00	1,617,058.59	
		T 0.5% 02/28/26	650,000.00	616,382.81	
		T 0.5% 04/30/27	1,900,000.00	1,744,140.62	
		T 0.5% 05/31/27	1,350,000.00	1,236,199.21	
		T 0.5% 06/30/27	320,000.00	292,256.24	
		T 0.5% 08/31/27	1,150,000.00	1,045,511.71	

T 0.5% 10/31/27	1,200,000.00	1,085,343.74	
T 0.625% 03/31/27	2,260,000.00	2,085,732.80	
T 0.625% 05/15/30	1,620,000.00	1,364,913.27	
T 0.625% 07/31/26	1,000,000.00	939,687.50	
T 0.625% 08/15/30	2,020,000.00	1,689,619.52	
T 0.625% 11/30/27	1,670,000.00	1,513,111.33	
T 0.625% 12/31/27	1,370,000.00	1,238,137.50	
T 0.75% 01/31/28	1,970,000.00	1,784,158.19	
T 0.75% 03/31/26	2,200,000.00	2,089,828.13	
T 0.75% 04/30/26	2,150,000.00	2,038,006.84	
T 0.75% 05/31/26	1,200,000.00	1,135,031.25	
T 0.75% 08/31/26	2,050,000.00	1,927,160.14	
T 0.875% 06/30/26	1,000,000.00	946,289.06	
T 0.875% 11/15/30	2,630,000.00	2,220,192.58	
T 1.125% 02/15/31	3,190,000.00	2,724,334.77	
T 1.125% 02/28/27	800,000.00	749,593.75	
T 1.125% 02/29/28	740,000.00	677,649.22	
T 1.125% 05/15/40	440,000.00	288,552.34	
T 1.125% 08/15/40	830,000.00	539,597.26	
T 1.125% 08/31/28	2,450,000.00	2,216,867.18	
T 1.125% 10/31/26	2,290,000.00	2,161,187.50	
T 1.25% 03/31/28	2,120,000.00	1,946,383.59	
T 1.25% 04/30/28	5,040,000.00	4,618,195.29	
T 1.25% 05/15/50	650,000.00	347,140.62	
T 1.25% 05/31/28	960,000.00	878,118.74	
T 1.25% 06/30/28	1,950,000.00	1,780,022.45	
T 1.25% 08/15/31	1,660,000.00	1,408,341.41	
T 1.25% 09/30/28	1,840,000.00	1,670,410.93	
T 1.25% 11/30/26	1,600,000.00	1,511,875.00	
T 1.25% 12/31/26	1,300,000.00	1,226,773.44	
T 1.375% 08/15/50	1,780,000.00	980,042.97	
T 1.375% 08/31/26	440,000.00	418,825.00	
T 1.375% 10/31/28	1,650,000.00	1,503,208.01	
T 1.375% 11/15/31	2,620,000.00	2,229,558.58	
T 1.375% 11/15/40	1,390,000.00	935,508.00	
T 1.375% 12/31/28	1,500,000.00	1,361,835.93	
T 1.5% 01/31/27	600,000.00	568,441.40	
T 1.5% 02/15/30	1,770,000.00	1,578,480.47	
T 1.5% 08/15/26	1,880,000.00	1,795,400.00	
T 1.5% 11/30/28	1,930,000.00	1,764,479.88	
T 1.625% 02/15/26	1,200,000.00	1,158,375.00	
T 1.625% 05/15/26	2,020,000.00	1,941,803.90	

T 1.625% 05/15/31	2,010,000.00	1,759,809.95	
T 1.625% 08/15/29	870,000.00	790,884.37	
T 1.625% 09/30/26	330,000.00	315,317.57	
T 1.625% 10/31/26	260,000.00	248,056.25	
T 1.625% 11/15/50	700,000.00	411,605.46	
T 1.625% 11/30/26	400,000.00	381,062.50	
T 1.75% 01/31/29	1,800,000.00	1,658,566.40	
T 1.75% 08/15/41	1,630,000.00	1,147,653.70	
T 1.75% 11/15/29	1,050,000.00	955,664.06	
T 1.75% 12/31/26	900,000.00	858,972.65	
T 1.875% 02/15/32	2,260,000.00	1,984,650.77	
T 1.875% 02/15/41	1,520,000.00	1,106,720.31	
T 1.875% 02/15/51	1,070,000.00	670,756.25	
T 1.875% 02/28/27	700,000.00	668,335.93	
T 1.875% 02/28/29	2,400,000.00	2,221,125.00	
T 1.875% 06/30/26	100,000.00	96,382.81	
T 1.875% 07/31/26	230,000.00	221,437.89	
T 1.875% 11/15/51	1,190,000.00	742,750.59	
T 1% 07/31/28	980,000.00	884,086.33	
T 2.125% 05/31/26	420,000.00	407,039.06	
T 2.25% 02/15/27	4,620,000.00	4,453,246.87	
T 2.25% 02/15/52	1,300,000.00	888,951.16	
T 2.25% 03/31/26	220,000.00	214,005.86	
T 2.25% 05/15/41	1,270,000.00	977,676.75	
T 2.25% 08/15/27	1,150,000.00	1,102,472.66	
T 2.25% 08/15/46	630,000.00	449,465.62	
T 2.25% 08/15/49	1,010,000.00	697,511.52	
T 2.25% 11/15/25	830,000.00	810,790.04	
T 2.25% 11/15/27	640,000.00	611,700.00	
T 2.375% 02/15/42	1,520,000.00	1,176,218.74	
T 2.375% 03/31/29	1,330,000.00	1,256,850.00	
T 2.375% 04/30/26	310,000.00	301,971.48	
T 2.375% 05/15/27	340,000.00	327,774.60	
T 2.375% 05/15/29	790,000.00	745,886.52	
T 2.375% 05/15/51	2,550,000.00	1,798,696.27	
T 2.375% 11/15/49	810,000.00	574,198.24	
T 2.5% 02/15/45	450,000.00	342,791.01	
T 2.5% 02/15/46	800,000.00	602,718.75	
T 2.5% 02/28/26	2,500,000.00	2,443,359.37	
T 2.5% 05/15/46	430,000.00	322,953.51	
T 2.625% 01/31/26	290,000.00	284,143.36	
T 2.625% 02/15/29	1,150,000.00	1,100,024.41	
T 2.625% 05/31/27	1,210,000.00	1,174,503.51	

T 2.625% 07/31/29	3,200,000.00	3,049,062.49	
T 2.625% 12/31/25	250,000.00	245,102.54	
T 2.75% 02/15/28	2,000,000.00	1,937,109.38	
T 2.75% 05/31/29	910,000.00	873,226.75	
T 2.75% 08/15/32	1,700,000.00	1,581,431.64	
T 2.75% 08/15/42	360,000.00	294,398.43	
T 2.75% 08/15/47	1,140,000.00	886,394.52	
T 2.75% 08/31/25	2,730,000.00	2,686,903.15	
T 2.75% 11/15/42	990,000.00	806,540.62	
T 2.75% 11/15/47	850,000.00	659,347.65	
T 2.875% 04/30/29	1,200,000.00	1,158,656.25	
T 2.875% 05/15/28	4,230,000.00	4,107,478.72	
T 2.875% 05/15/32	2,730,000.00	2,568,812.69	
T 2.875% 05/15/43	1,280,000.00	1,055,950.00	
T 2.875% 05/15/49	1,030,000.00	810,521.48	
T 2.875% 05/15/52	1,060,000.00	831,913.66	
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	493,216.21	
T 2.875% 08/15/28	2,090,000.00	2,026,442.76	
T 2.875% 08/15/45	150,000.00	121,505.85	
T 2.875% 11/15/46	550,000.00	440,461.91	
T 2.875% 11/30/25	540,000.00	531,393.75	
T 2% 02/15/50	1,170,000.00	760,362.88	
T 2% 08/15/25	650,000.00	635,475.34	
T 2% 08/15/51	1,580,000.00	1,018,729.67	
T 2% 11/15/26	1,650,000.00	1,586,191.39	
T 2% 11/15/41	750,000.00	548,525.39	
T 3.125% 02/15/42	180,000.00	157,028.90	
T 3.125% 02/15/43	630,000.00	541,726.17	
T 3.125% 05/15/48	760,000.00	629,285.93	
T 3.125% 08/15/25	1,120,000.00	1,106,847.50	
T 3.125% 08/15/44	470,000.00	399,500.00	
T 3.125% 08/31/27	1,020,000.00	1,002,628.12	
T 3.125% 08/31/29	620,000.00	604,378.90	
T 3.125% 11/15/28	2,350,000.00	2,297,538.08	
T 3.125% 11/15/41	230,000.00	201,690.23	
T 3.25% 05/15/42	780,000.00	688,197.65	
T 3.25% 06/30/27	2,600,000.00	2,566,382.80	
T 3.25% 06/30/29	1,650,000.00	1,618,579.09	
T 3.375% 05/15/33	3,710,000.00	3,591,816.20	
T 3.375% 05/15/44	1,450,000.00	1,282,513.66	
T 3.375% 08/15/42	730,000.00	654,176.95	
T 3.375% 11/15/48	910,000.00	785,763.66	

T 3.5% 01/31/28	640,000.00	635,712.49	
T 3.5% 01/31/30	900,000.00	891,105.47	
T 3.5% 02/15/33	3,590,000.00	3,513,221.67	
T 3.5% 02/15/39	350,000.00	333,306.64	
T 3.625% 02/15/44	1,230,000.00	1,130,639.06	
T 3.625% 02/15/53	1,590,000.00	1,448,483.78	
T 3.625% 03/31/28	1,000,000.00	997,539.06	
T 3.625% 05/15/26	2,640,000.00	2,624,582.82	
T 3.625% 05/15/53	650,000.00	592,401.36	
T 3.625% 08/15/43	1,300,000.00	1,198,082.02	
T 3.75% 04/15/26	1,900,000.00	1,892,318.35	
T 3.75% 08/15/41	260,000.00	249,051.56	
T 3.75% 11/15/43	1,430,000.00	1,339,563.66	
T 3.875% 01/15/26	1,000,000.00	996,875.00	
T 3.875% 02/15/43	920,000.00	882,050.00	
T 3.875% 05/15/43	250,000.00	239,150.39	
T 3.875% 08/15/33	3,150,000.00	3,163,166.02	
T 3.875% 08/15/40	390,000.00	383,129.29	
T 3.875% 09/30/29	1,000,000.00	1,008,789.06	
T 3.875% 11/30/29	1,500,000.00	1,513,417.96	
T 3.875% 12/31/27	1,500,000.00	1,508,085.93	
T 3.875% 12/31/29	1,000,000.00	1,008,789.06	
T 3% 02/15/47	730,000.00	596,546.87	
T 3% 02/15/48	200,000.00	162,175.78	
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	806,601.56	
T 3% 05/15/42	370,000.00	315,425.00	
T 3% 05/15/45	330,000.00	273,435.93	
T 3% 05/15/47	180,000.00	146,833.59	
T 3% 08/15/48	800,000.00	646,468.75	
T 3% 08/15/52	1,500,000.00	1,208,642.58	
T 3% 09/30/25	1,340,000.00	1,321,732.03	
T 3% 10/31/25	270,000.00	266,229.49	
T 3% 11/15/44	720,000.00	598,528.12	
T 3% 11/15/45	320,000.00	264,337.50	
T 4.125% 03/31/31	1,900,000.00	1,943,343.75	
T 4.125% 08/15/53	1,460,000.00	1,455,437.50	
T 4.125% 08/31/30	1,910,000.00	1,951,669.34	
T 4.125% 10/31/27	2,800,000.00	2,833,468.73	
T 4.125% 11/15/32	1,500,000.00	1,536,855.46	
T 4.25% 01/31/26	1,000,000.00	1,002,109.38	
T 4.25% 02/15/54	2,500,000.00	2,548,046.87	
T 4.25% 05/15/39	150,000.00	154,722.65	
T 4.25% 10/15/25	600,000.00	599,941.40	

	T 4.25% 11/15/40	200,000.00	205,253.90	
	T 4.375% 02/15/38	210,000.00	220,770.70	
	T 4.375% 05/15/40	300,000.00	313,101.56	
	T 4.375% 05/15/41	150,000.00	155,835.93	
	T 4.375% 08/15/26	2,890,000.00	2,916,416.39	
	T 4.375% 11/15/39	350,000.00	365,380.85	
	T 4.375% 11/30/30	2,510,000.00	2,599,908.97	
	T 4.5% 02/15/36	110,000.00	117,545.31	
	T 4.5% 05/15/38	110,000.00	116,952.34	
	T 4.5% 07/15/26	860,000.00	868,935.93	
	T 4.5% 08/15/39	350,000.00	370,371.09	
	T 4.5% 11/15/33	3,350,000.00	3,525,089.82	
	T 4.625% 02/15/40	380,000.00	407,728.12	
	T 4.625% 10/15/26	3,500,000.00	3,554,550.79	
	T 4.625% 11/15/26	3,400,000.00	3,456,179.69	
	T 4.75% 02/15/41	150,000.00	163,072.26	
	T 4.75% 11/15/53	1,480,000.00	1,636,007.03	
	T 4.875% 10/31/30	2,900,000.00	3,083,289.04	
	T 4% 01/15/27	1,150,000.00	1,155,031.25	
	T 4% 02/15/34	400,000.00	405,281.24	
	T 4% 02/28/30	1,950,000.00	1,978,945.31	
	T 4% 11/15/42	240,000.00	234,464.06	
	T 4% 11/15/52	1,000,000.00	973,730.47	
	T 5.0% 05/15/37	120,000.00	133,781.25	
	T 5.25% 11/15/28	440,000.00	467,431.25	
	T 5.375% 02/15/31	60,000.00	65,925.00	
	T 5% 08/31/25	2,750,000.00	2,766,920.00	
	T 6.0% 02/15/26	420,000.00	432,846.09	
	T 6.25% 05/15/30	990,000.00	1,118,816.01	
	アメリカドル 小計	272,020,000.00	251,082,158.27 (36,223,622,973)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	330,000.00	315,002.94	
	CAN 0.5% 09/01/25	460,000.00	445,667.60	
	CAN 0.5% 12/01/30	500,000.00	430,854.74	
	CAN 1.25% 03/01/27	230,000.00	219,942.12	
	CAN 1.25% 06/01/30	870,000.00	792,971.24	
	CAN 1.5% 06/01/26	170,000.00	164,962.04	
	CAN 1.5% 06/01/31	1,060,000.00	965,154.71	
	CAN 1.5% 12/01/31	430,000.00	388,582.28	
	CAN 1.75% 12/01/53	680,000.00	498,768.48	
	CAN 1% 06/01/27	100,000.00	94,877.95	
	CAN 1% 09/01/26	530,000.00	507,959.85	

	CAN 2.25% 06/01/29	250,000.00	243,440.39	
	CAN 2.5% 12/01/32	330,000.00	317,856.60	
	CAN 2.75% 06/01/33	280,000.00	274,282.96	
	CAN 2.75% 09/01/27	350,000.00	347,485.90	
	CAN 2.75% 12/01/48	200,000.00	186,627.64	
	CAN 2.75% 12/01/55	410,000.00	377,720.41	
	CAN 2.75% 12/01/64	120,000.00	111,061.89	
	CAN 2% 06/01/28	290,000.00	280,567.24	
	CAN 2% 06/01/32	550,000.00	512,131.47	
	CAN 2% 12/01/51	860,000.00	678,293.75	
	CAN 3.25% 09/01/28	620,000.00	626,824.20	
	CAN 3.25% 12/01/33	530,000.00	539,062.17	
	CAN 3.25% 12/01/34	130,000.00	131,956.33	
	CAN 3.5% 03/01/28	190,000.00	193,312.47	
	CAN 3.5% 08/01/25	700,000.00	698,753.01	
	CAN 3.5% 12/01/45	220,000.00	231,936.23	
	CAN 3% 04/01/26	490,000.00	487,145.85	
	CAN 3% 06/01/34	480,000.00	477,738.83	
	CAN 3% 10/01/25	600,000.00	596,320.05	
	CAN 4.0% 06/01/41	190,000.00	211,002.74	
	CAN 4% 05/01/26	350,000.00	353,526.35	
	CAN 4% 08/01/26	700,000.00	709,795.84	
	CAN 5.75% 06/01/29	220,000.00	247,966.60	
	CAN 5.75% 06/01/33	620,000.00	747,649.83	
	CAN 5% 06/01/37	100,000.00	119,838.92	
カナダドル 小計		15,140,000.00	14,527,041.62 (1,558,896,836)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	1,500,000.00	1,548,728.38	
	MBONO 5.5% 03/04/27	8,220,000.00	7,483,516.11	
	MBONO 5.75% 03/05/26	12,850,000.00	12,065,836.58	
	MBONO 7.5% 05/26/33	6,190,000.00	5,446,085.80	
	MBONO 7.5% 06/03/27	6,500,000.00	6,183,628.03	
	MBONO 7.75% 05/29/31	8,050,000.00	7,365,511.80	
	MBONO 7.75% 11/13/42	7,430,000.00	6,113,313.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	3,170,000.00	2,803,552.50	
	MBONO 8.5% 03/01/29	4,410,000.00	4,252,077.90	
	MBONO 8.5% 05/31/29	7,720,000.00	7,437,266.49	
	MBONO 8.5% 11/18/38	5,790,000.00	5,238,706.65	
	MBONO 8% 07/31/53	5,140,000.00	4,232,208.29	
	MBONO 8% 11/07/47	5,920,000.00	4,921,457.02	
メキシコペソ 小計		82,890,000.00	75,091,889.05 (548,448,630)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	340,000.00	295,420.64	

BGB 0.35% 06/22/32	440,000.00	367,426.31	
BGB 0.4% 06/22/40	200,000.00	131,395.63	
BGB 0.65% 06/22/71	150,000.00	63,871.20	
BGB 0.8% 06/22/27	480,000.00	458,639.12	
BGB 0.8% 06/22/28	190,000.00	178,771.93	
BGB 0.9% 06/22/29	400,000.00	371,571.10	
BGB 0% 10/22/27	190,000.00	176,003.74	
BGB 0% 10/22/31	260,000.00	215,726.81	
BGB 1.25% 04/22/33	140,000.00	124,529.30	
BGB 1.4% 06/22/53	210,000.00	133,576.69	
BGB 1.45% 06/22/37	190,000.00	158,265.25	
BGB 1.6% 06/22/47	260,000.00	188,986.85	
BGB 1.7% 06/22/50	250,000.00	178,721.50	
BGB 1.9% 06/22/38	210,000.00	181,977.75	
BGB 1% 06/22/26	330,000.00	321,133.23	
BGB 1% 06/22/31	440,000.00	396,086.24	
BGB 2.15% 06/22/66	180,000.00	133,996.18	
BGB 2.25% 06/22/57	160,000.00	123,420.79	
BGB 2.75% 04/22/39	120,000.00	114,878.10	
BGB 2.85% 10/22/34	300,000.00	299,403.77	
BGB 3.3% 06/22/54	230,000.00	223,484.42	
BGB 3.45% 06/22/43	100,000.00	102,486.50	
BGB 3.5% 06/22/55	110,000.00	110,342.65	
BGB 3.75% 06/22/45	190,000.00	202,526.70	
BGB 3% 06/22/33	410,000.00	417,456.83	
BGB 3% 06/22/34	240,000.00	243,690.00	
BGB 4.25% 03/28/41	320,000.00	362,477.76	
BGB 4.5% 03/28/26	350,000.00	360,164.87	
BGB 4% 03/28/32	150,000.00	163,354.24	
BGB 5.5% 03/28/28	400,000.00	441,108.00	
BGB 5% 03/28/35	410,000.00	486,516.25	
BKO 2.5% 03/19/26	1,140,000.00	1,139,580.48	
BKO 2.9% 06/18/26	200,000.00	201,540.34	
BKO 3.1% 09/18/25	120,000.00	120,436.81	
BKO 3.1% 12/12/25	230,000.00	231,374.25	
BTPS 0.25% 03/15/28	520,000.00	474,194.40	
BTPS 0.45% 02/15/29	180,000.00	161,013.32	
BTPS 0.5% 02/01/26	550,000.00	531,849.45	
BTPS 0.5% 07/15/28	130,000.00	118,609.23	
BTPS 0.6% 08/01/31	460,000.00	383,977.41	
BTPS 0.85% 01/15/27	790,000.00	755,160.60	
BTPS 0.9% 04/01/31	410,000.00	353,059.20	
BTPS 0.95% 03/01/37	340,000.00	244,490.94	

BTPS 0.95% 06/01/32	450,000.00	376,287.30	
BTPS 0.95% 09/15/27	310,000.00	293,258.45	
BTPS 0.95% 12/01/31	490,000.00	415,642.50	
BTPS 0% 08/01/26	210,000.00	199,039.99	
BTPS 1.1% 04/01/27	230,000.00	220,228.52	
BTPS 1.2% 08/15/25	340,000.00	334,129.90	
BTPS 1.25% 12/01/26	480,000.00	464,119.20	
BTPS 1.35% 04/01/30	730,000.00	663,553.21	
BTPS 1.45% 03/01/36	360,000.00	283,555.25	
BTPS 1.5% 04/30/45	200,000.00	128,982.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	260,000.00	254,656.83	
BTPS 1.65% 03/01/32	510,000.00	453,518.77	
BTPS 1.65% 12/01/30	630,000.00	573,709.50	
BTPS 1.7% 09/01/51	300,000.00	184,467.97	
BTPS 1.8% 03/01/41	170,000.00	124,703.50	
BTPS 2.05% 08/01/27	470,000.00	460,033.65	
BTPS 2.1% 07/15/26	350,000.00	345,548.43	
BTPS 2.15% 03/01/72	170,000.00	104,599.30	
BTPS 2.15% 09/01/52	210,000.00	140,909.47	
BTPS 2.2% 06/01/27	150,000.00	147,656.80	
BTPS 2.25% 09/01/36	380,000.00	325,108.81	
BTPS 2.45% 09/01/33	450,000.00	414,235.12	
BTPS 2.45% 09/01/50	330,000.00	241,609.17	
BTPS 2.5% 11/15/25	280,000.00	278,743.08	
BTPS 2.5% 12/01/32	460,000.00	429,687.61	
BTPS 2.65% 12/01/27	400,000.00	397,640.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	230,000.00	182,856.09	
BTPS 2.8% 03/01/67	200,000.00	148,038.80	
BTPS 2.8% 06/15/29	670,000.00	662,363.67	
BTPS 2.8% 12/01/28	440,000.00	437,621.14	
BTPS 2.95% 02/15/27	500,000.00	501,296.85	
BTPS 2.95% 09/01/38	320,000.00	287,146.56	
BTPS 2% 02/01/28	250,000.00	243,046.62	
BTPS 2% 12/01/25	150,000.00	148,402.74	
BTPS 3.1% 03/01/40	170,000.00	152,470.28	
BTPS 3.1% 08/28/26	410,000.00	411,774.15	
BTPS 3.25% 03/01/38	420,000.00	391,246.80	
BTPS 3.25% 09/01/46	470,000.00	411,560.20	
BTPS 3.35% 03/01/35	570,000.00	554,044.56	
BTPS 3.35% 07/01/29	250,000.00	252,979.75	
BTPS 3.4% 04/01/28	500,000.00	508,352.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	410,000.00	368,029.12	

BTPS 3.45% 07/15/31	350,000.00	352,542.75	
BTPS 3.5% 01/15/26	380,000.00	382,897.95	
BTPS 3.5% 02/15/31	290,000.00	293,581.50	
BTPS 3.5% 03/01/30	490,000.00	499,873.50	
BTPS 3.6% 09/29/25	430,000.00	432,537.12	
BTPS 3.7% 06/15/30	230,000.00	235,916.17	
BTPS 3.8% 04/15/26	690,000.00	700,097.73	
BTPS 3.8% 08/01/28	560,000.00	577,416.00	
BTPS 3.85% 07/01/34	320,000.00	325,726.14	
BTPS 3.85% 09/01/49	350,000.00	331,985.71	
BTPS 3.85% 09/15/26	490,000.00	499,799.26	
BTPS 3.85% 12/15/29	510,000.00	527,828.32	
BTPS 3% 08/01/29	340,000.00	339,243.50	
BTPS 4.1% 02/01/29	140,000.00	146,179.04	
BTPS 4.15% 10/01/39	80,000.00	81,229.29	
BTPS 4.2% 03/01/34	450,000.00	471,946.50	
BTPS 4.35% 11/01/33	400,000.00	425,026.00	
BTPS 4.4% 05/01/33	260,000.00	277,768.40	
BTPS 4.45% 09/01/43	260,000.00	270,177.62	
BTPS 4.5% 03/01/26	960,000.00	982,730.39	
BTPS 4.5% 10/01/53	320,000.00	331,651.52	
BTPS 4.75% 09/01/28	390,000.00	416,290.48	
BTPS 4.75% 09/01/44	450,000.00	487,701.00	
BTPS 4% 02/01/37	650,000.00	666,236.02	
BTPS 4% 10/30/31	280,000.00	292,471.20	
BTPS 4% 11/15/30	800,000.00	833,380.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	810,000.00	901,498.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	560,000.00	618,446.24	
BTPS 5.75% 02/01/33	690,000.00	803,270.40	
BTPS 5% 08/01/34	660,000.00	736,065.00	
BTPS 5% 09/01/40	680,000.00	755,347.06	
BTPS 6.5% 11/01/27	780,000.00	866,424.00	
BTPS 6% 05/01/31	480,000.00	558,916.80	
DBR 0.25% 02/15/29	470,000.00	432,974.57	
DBR 0.25% 08/15/28	620,000.00	576,331.28	
DBR 0.5% 02/15/26	470,000.00	456,859.27	
DBR 0.5% 02/15/28	700,000.00	661,850.35	
DBR 0.5% 08/15/27	190,000.00	180,943.88	
DBR 0% 02/15/30	430,000.00	383,397.24	
DBR 0% 02/15/31	490,000.00	427,806.87	
DBR 0% 02/15/32	760,000.00	648,382.60	
DBR 0% 05/15/35	480,000.00	375,383.52	
DBR 0% 05/15/36	480,000.00	364,677.60	

DBR 0% 08/15/26	610,000.00	582,943.45	
DBR 0% 08/15/29	410,000.00	369,355.73	
DBR 0% 08/15/30	770,000.00	679,643.19	
DBR 0% 08/15/31	670,000.00	578,598.76	
DBR 0% 08/15/50	1,020,000.00	537,285.48	
DBR 0% 08/15/52	650,000.00	326,655.03	
DBR 0% 11/15/27	770,000.00	718,205.95	
DBR 0% 11/15/28	560,000.00	512,420.44	
DBR 1.25% 08/15/48	750,000.00	578,588.17	
DBR 1.7% 08/15/32	540,000.00	521,663.49	
DBR 1.8% 08/15/53	730,000.00	622,638.71	
DBR 1.8% 08/15/53	40,000.00	34,183.90	
DBR 1% 05/15/38	440,000.00	365,815.56	
DBR 1% 08/15/25	390,000.00	383,561.10	
DBR 2.1% 11/15/29	150,000.00	149,429.47	
DBR 2.2% 02/15/34	760,000.00	756,792.04	
DBR 2.3% 02/15/33	1,010,000.00	1,017,635.60	
DBR 2.4% 11/15/30	210,000.00	212,588.98	
DBR 2.5% 07/04/44	610,000.00	605,199.60	
DBR 2.5% 08/15/46	680,000.00	674,549.94	
DBR 2.5% 08/15/54	350,000.00	347,968.85	
DBR 2.6% 05/15/41	90,000.00	90,742.77	
DBR 2.6% 08/15/33	630,000.00	649,240.20	
DBR 2.6% 08/15/34	260,000.00	267,351.60	
DBR 3.25% 07/04/42	410,000.00	451,744.88	
DBR 4.0% 01/04/37	620,000.00	724,442.96	
DBR 4.25% 07/04/39	400,000.00	486,617.00	
DBR 4.75% 07/04/28	180,000.00	196,944.39	
DBR 4.75% 07/04/34	480,000.00	584,149.68	
DBR 4.75% 07/04/40	470,000.00	606,736.95	
DBR 5.5% 01/04/31	860,000.00	1,026,929.17	
DBR 5.625% 01/04/28	1,140,000.00	1,264,687.50	
DBR 6.25% 01/04/30	820,000.00	986,767.50	
DBR 6.5% 07/04/27	460,000.00	513,174.85	
FRTR 0.25% 11/25/26	590,000.00	560,112.43	
FRTR 0.5% 05/25/26	830,000.00	800,270.22	
FRTR 0.5% 05/25/29	670,000.00	606,718.07	
FRTR 0.5% 05/25/40	620,000.00	410,608.95	
FRTR 0.5% 05/25/72	270,000.00	99,436.18	
FRTR 0.5% 06/25/44	440,000.00	260,435.51	
FRTR 0.75% 02/25/28	1,410,000.00	1,323,926.55	
FRTR 0.75% 05/25/28	730,000.00	682,471.16	

FRTR 0.75% 05/25/52	730,000.00	382,210.84	
FRTR 0.75% 05/25/53	660,000.00	336,877.20	
FRTR 0.75% 11/25/28	1,250,000.00	1,157,022.50	
FRTR 0% 02/25/26	840,000.00	807,192.00	
FRTR 0% 02/25/27	730,000.00	684,761.43	
FRTR 0% 05/25/32	700,000.00	565,193.11	
FRTR 0% 11/25/29	1,060,000.00	924,234.24	
FRTR 0% 11/25/30	1,280,000.00	1,084,068.78	
FRTR 0% 11/25/31	1,330,000.00	1,091,622.77	
FRTR 1.25% 05/25/34	1,150,000.00	985,686.85	
FRTR 1.25% 05/25/36	1,000,000.00	820,389.00	
FRTR 1.25% 05/25/38	720,000.00	563,814.00	
FRTR 1.5% 05/25/31	1,230,000.00	1,138,537.34	
FRTR 1.5% 05/25/50	660,000.00	442,459.04	
FRTR 1.75% 05/25/66	370,000.00	234,965.72	
FRTR 1.75% 06/25/39	720,000.00	596,790.00	
FRTR 1% 05/25/27	1,350,000.00	1,293,826.95	
FRTR 1% 11/25/25	1,470,000.00	1,438,517.74	
FRTR 2.5% 05/25/30	980,000.00	970,814.12	
FRTR 2.5% 05/25/43	380,000.00	333,762.55	
FRTR 2.5% 09/24/26	470,000.00	468,766.48	
FRTR 2.5% 09/24/27	870,000.00	867,327.29	
FRTR 2.75% 02/25/29	940,000.00	943,443.22	
FRTR 2.75% 02/25/30	540,000.00	541,064.10	
FRTR 2.75% 10/25/27	1,110,000.00	1,114,906.20	
FRTR 2% 05/25/48	600,000.00	461,663.64	
FRTR 2% 11/25/32	110,000.00	103,237.64	
FRTR 3.25% 05/25/45	600,000.00	587,487.60	
FRTR 3.25% 05/25/55	110,000.00	103,573.87	
FRTR 3.5% 04/25/26	1,580,000.00	1,601,211.81	
FRTR 3.5% 11/25/33	980,000.00	1,024,495.02	
FRTR 3% 05/25/33	1,110,000.00	1,119,261.28	
FRTR 3% 05/25/54	590,000.00	532,006.83	
FRTR 3% 06/25/49	220,000.00	204,351.95	
FRTR 4.5% 04/25/41	800,000.00	922,388.32	
FRTR 4.75% 04/25/35	620,000.00	716,705.80	
FRTR 4% 04/25/55	550,000.00	596,904.00	
FRTR 4% 04/25/60	450,000.00	493,389.45	
FRTR 4% 10/25/38	450,000.00	490,195.12	
FRTR 5.5% 04/25/29	1,390,000.00	1,559,232.50	
FRTR 5.75% 10/25/32	1,120,000.00	1,353,241.68	
IRISH 0.2% 05/15/27	200,000.00	188,655.00	
IRISH 0.2% 10/18/30	170,000.00	148,923.21	

IRISH 0.35% 10/18/32	90,000.00	75,691.12	
IRISH 0.4% 05/15/35	110,000.00	86,627.75	
IRISH 0.55% 04/22/41	100,000.00	69,190.00	
IRISH 0.9% 05/15/28	170,000.00	161,304.07	
IRISH 0% 10/18/31	140,000.00	117,446.84	
IRISH 1.1% 05/15/29	230,000.00	217,140.01	
IRISH 1.3% 05/15/33	140,000.00	126,495.18	
IRISH 1.35% 03/18/31	120,000.00	112,083.94	
IRISH 1.5% 05/15/50	190,000.00	139,774.14	
IRISH 1.7% 05/15/37	170,000.00	150,037.07	
IRISH 1% 05/15/26	200,000.00	194,925.30	
IRISH 2.4% 05/15/30	190,000.00	189,796.70	
IRISH 2.6% 10/18/34	80,000.00	79,574.88	
IRISH 2% 02/18/45	190,000.00	161,856.53	
IRISH 3% 10/18/43	100,000.00	100,563.64	
NETHER 0.25% 07/15/29	90,000.00	81,392.22	
NETHER 0.5% 01/15/40	370,000.00	267,443.28	
NETHER 0.5% 07/15/26	390,000.00	376,408.50	
NETHER 0.5% 07/15/32	150,000.00	129,278.98	
NETHER 0.75% 07/15/27	310,000.00	296,476.40	
NETHER 0.75% 07/15/28	380,000.00	357,862.24	
NETHER 0% 01/15/26	290,000.00	280,053.29	
NETHER 0% 01/15/27	180,000.00	170,269.65	
NETHER 0% 01/15/29	310,000.00	279,967.20	
NETHER 0% 01/15/38	250,000.00	174,586.81	
NETHER 0% 01/15/52	380,000.00	185,921.13	
NETHER 0% 07/15/30	300,000.00	261,313.80	
NETHER 0% 07/15/31	340,000.00	288,767.10	
NETHER 2.5% 01/15/30	310,000.00	311,730.26	
NETHER 2.5% 01/15/33	430,000.00	430,574.73	
NETHER 2.5% 07/15/33	210,000.00	209,822.02	
NETHER 2.5% 07/15/34	240,000.00	238,680.44	
NETHER 2.75% 01/15/47	410,000.00	411,406.71	
NETHER 2% 01/15/54	280,000.00	238,989.24	
NETHER 3.25% 01/15/44	180,000.00	193,228.03	
NETHER 3.75% 01/15/42	360,000.00	409,075.20	
NETHER 4% 01/15/37	420,000.00	477,969.44	
NETHER 5.5% 01/15/28	430,000.00	473,369.58	
OBL 0% 04/10/26	760,000.00	731,410.88	
OBL 0% 04/16/27	1,020,000.00	962,153.25	
OBL 0% 10/09/26	830,000.00	790,742.66	
OBL 0% 10/10/25	270,000.00	262,390.59	

OBL 1.3% 10/15/27	240,000.00	233,681.65	
OBL 2.1% 04/12/29	180,000.00	179,320.20	
OBL 2.2% 04/13/28	200,000.00	200,009.10	
OBL 2.4% 10/19/28	1,210,000.00	1,219,684.46	
RAGB 0.25% 10/20/36	70,000.00	50,944.95	
RAGB 0.5% 02/20/29	340,000.00	311,484.20	
RAGB 0.5% 04/20/27	220,000.00	208,952.86	
RAGB 0.7% 04/20/71	70,000.00	32,119.99	
RAGB 0.75% 02/20/28	270,000.00	254,523.33	
RAGB 0.75% 03/20/51	200,000.00	116,877.70	
RAGB 0.75% 10/20/26	420,000.00	404,749.80	
RAGB 0.85% 06/30/20	90,000.00	41,476.95	
RAGB 0.9% 02/20/32	280,000.00	246,678.04	
RAGB 0% 02/20/30	230,000.00	200,396.98	
RAGB 0% 02/20/31	490,000.00	413,893.20	
RAGB 0% 10/20/28	180,000.00	162,510.52	
RAGB 0% 10/20/40	130,000.00	79,949.66	
RAGB 1.2% 10/20/25	350,000.00	344,077.30	
RAGB 1.5% 02/20/47	160,000.00	118,940.40	
RAGB 1.5% 11/02/86	90,000.00	55,475.19	
RAGB 1.85% 05/23/49	140,000.00	110,059.60	
RAGB 2.1% 09/20/17	150,000.00	115,857.49	
RAGB 2.4% 05/23/34	180,000.00	174,218.76	
RAGB 2.9% 02/20/33	350,000.00	354,016.25	
RAGB 2.9% 02/20/34	280,000.00	282,450.84	
RAGB 2% 07/15/26	110,000.00	108,889.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	240,000.00	241,753.20	
RAGB 3.15% 10/20/53	100,000.00	100,162.56	
RAGB 3.2% 07/15/39	20,000.00	20,383.89	
RAGB 3.8% 01/26/62	90,000.00	103,709.11	
RAGB 4.15% 03/15/37	370,000.00	416,070.99	
RAGB 4.85% 03/15/26	130,000.00	134,176.64	
RAGB 6.25% 07/15/27	300,000.00	330,988.62	
RFGB 0.125% 04/15/36	110,000.00	79,983.06	
RFGB 0.125% 04/15/52	110,000.00	51,881.50	
RFGB 0.125% 09/15/31	120,000.00	100,831.04	
RFGB 0.25% 09/15/40	90,000.00	58,355.74	
RFGB 0.5% 04/15/26	170,000.00	164,420.79	
RFGB 0.5% 04/15/43	150,000.00	95,941.36	
RFGB 0.5% 09/15/27	20,000.00	18,871.01	
RFGB 0.5% 09/15/28	170,000.00	157,105.36	
RFGB 0.5% 09/15/29	100,000.00	90,364.29	
RFGB 0.75% 04/15/31	210,000.00	186,477.03	

RFGB 0.875% 09/15/25	70,000.00	68,622.13	
RFGB 0% 09/15/26	110,000.00	104,490.69	
RFGB 0% 09/15/30	130,000.00	111,372.30	
RFGB 1.125% 04/15/34	220,000.00	189,618.00	
RFGB 1.375% 04/15/27	90,000.00	87,475.09	
RFGB 1.375% 04/15/47	100,000.00	73,042.33	
RFGB 1.5% 09/15/32	170,000.00	155,405.93	
RFGB 2.625% 07/04/42	110,000.00	103,806.78	
RFGB 2.75% 04/15/38	50,000.00	48,573.72	
RFGB 2.75% 07/04/28	210,000.00	212,186.68	
RFGB 2.875% 04/15/29	90,000.00	91,288.17	
RFGB 2.95% 04/15/55	60,000.00	58,492.20	
RFGB 3% 09/15/34	100,000.00	101,582.50	
SPGB 0.1% 04/30/31	620,000.00	520,459.00	
SPGB 0.5% 04/30/30	540,000.00	478,516.41	
SPGB 0.5% 10/31/31	490,000.00	417,473.38	
SPGB 0.6% 10/31/29	430,000.00	387,524.80	
SPGB 0.7% 04/30/32	600,000.00	512,379.00	
SPGB 0.8% 07/30/27	600,000.00	570,263.55	
SPGB 0.8% 07/30/29	800,000.00	731,760.40	
SPGB 0.85% 07/30/37	300,000.00	222,976.50	
SPGB 0% 01/31/26	540,000.00	519,577.74	
SPGB 0% 01/31/27	510,000.00	479,139.77	
SPGB 0% 01/31/28	530,000.00	485,432.30	
SPGB 1.2% 10/31/40	440,000.00	316,769.86	
SPGB 1.25% 10/31/30	680,000.00	622,984.72	
SPGB 1.3% 10/31/26	150,000.00	145,964.66	
SPGB 1.4% 04/30/28	500,000.00	479,391.87	
SPGB 1.4% 07/30/28	560,000.00	535,288.46	
SPGB 1.45% 04/30/29	420,000.00	398,407.80	
SPGB 1.45% 10/31/27	550,000.00	531,291.75	
SPGB 1.45% 10/31/71	170,000.00	85,619.65	
SPGB 1.5% 04/30/27	180,000.00	175,037.22	
SPGB 1.85% 07/30/35	380,000.00	335,415.74	
SPGB 1.9% 10/31/52	400,000.00	274,808.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	490,000.00	484,421.84	
SPGB 1.95% 07/30/30	550,000.00	527,511.05	
SPGB 1% 07/30/42	270,000.00	180,803.81	
SPGB 1% 10/31/50	450,000.00	251,800.87	
SPGB 2.15% 10/31/25	250,000.00	248,149.06	
SPGB 2.35% 07/30/33	470,000.00	447,674.17	
SPGB 2.5% 05/31/27	440,000.00	438,602.66	

	SPGB 2.55% 10/31/32	510,000.00	497,147.73	
	SPGB 2.7% 10/31/48	400,000.00	340,066.59	
	SPGB 2.8% 05/31/26	670,000.00	671,338.12	
	SPGB 2.9% 10/31/46	350,000.00	312,461.27	
	SPGB 3.15% 04/30/33	430,000.00	436,450.21	
	SPGB 3.25% 04/30/34	430,000.00	437,064.68	
	SPGB 3.45% 07/30/43	290,000.00	284,033.54	
	SPGB 3.45% 07/30/66	310,000.00	287,609.94	
	SPGB 3.45% 10/31/34	250,000.00	257,568.42	
	SPGB 3.5% 05/31/29	250,000.00	259,173.50	
	SPGB 3.55% 10/31/33	560,000.00	584,106.60	
	SPGB 3.9% 07/30/39	480,000.00	505,429.20	
	SPGB 4.2% 01/31/37	480,000.00	526,650.48	
	SPGB 4.7% 07/30/41	420,000.00	484,437.24	
	SPGB 4.9% 07/30/40	410,000.00	480,700.40	
	SPGB 4% 10/31/54	190,000.00	196,993.90	
	SPGB 5.15% 10/31/28	1,110,000.00	1,219,989.90	
	SPGB 5.15% 10/31/44	350,000.00	427,909.47	
	SPGB 5.75% 07/30/32	520,000.00	625,360.32	
	SPGB 5.9% 07/30/26	960,000.00	1,017,690.72	
ユーロ 小計		153,440,000.00	145,164,858.58 (23,403,478,500)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	200,000.00	190,183.88	
	UKT 0.125% 01/31/28	220,000.00	194,749.85	
	UKT 0.25% 07/31/31	630,000.00	495,713.79	
	UKT 0.375% 10/22/26	640,000.00	593,785.60	
	UKT 0.375% 10/22/30	370,000.00	302,095.75	
	UKT 0.5% 01/31/29	710,000.00	616,047.26	
	UKT 0.5% 10/22/61	530,000.00	164,989.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	430,000.00	302,015.66	
	UKT 0.625% 10/22/50	390,000.00	162,864.00	
	UKT 0.875% 01/31/46	270,000.00	138,426.30	
	UKT 0.875% 07/31/33	690,000.00	532,831.80	
	UKT 0.875% 10/22/29	300,000.00	260,334.24	
	UKT 1.125% 01/31/39	560,000.00	374,192.00	
	UKT 1.125% 10/22/73	240,000.00	90,264.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	440,000.00	409,024.00	
	UKT 1.25% 07/31/51	580,000.00	290,290.00	
	UKT 1.25% 10/22/41	490,000.00	309,138.62	
	UKT 1.5% 07/22/26	400,000.00	382,054.24	
	UKT 1.5% 07/22/47	370,000.00	214,193.00	
	UKT 1.5% 07/31/53	390,000.00	203,424.00	
UKT 1.625% 10/22/28	240,000.00	220,596.91		

UKT 1.625% 10/22/54	300,000.00	160,170.00	
UKT 1.625% 10/22/71	390,000.00	183,183.00	
UKT 1.75% 01/22/49	210,000.00	126,105.00	
UKT 1.75% 07/22/57	440,000.00	238,084.00	
UKT 1.75% 09/07/37	390,000.00	297,453.93	
UKT 1% 01/31/32	880,000.00	719,832.08	
UKT 2.5% 07/22/65	350,000.00	224,805.00	
UKT 2% 09/07/25	330,000.00	322,368.07	
UKT 3.25% 01/22/44	630,000.00	534,618.00	
UKT 3.25% 01/31/33	650,000.00	619,191.82	
UKT 3.5% 01/22/45	460,000.00	402,270.00	
UKT 3.5% 07/22/68	350,000.00	289,345.00	
UKT 3.5% 10/22/25	690,000.00	682,804.52	
UKT 3.75% 01/29/38	590,000.00	565,314.33	
UKT 3.75% 03/07/27	580,000.00	575,228.80	
UKT 3.75% 07/22/52	290,000.00	256,070.00	
UKT 3.75% 10/22/53	720,000.00	632,304.00	
UKT 4.125% 01/29/27	580,000.00	580,268.13	
UKT 4.125% 07/22/29	200,000.00	201,890.00	
UKT 4.25% 03/07/36	390,000.00	396,424.47	
UKT 4.25% 06/07/32	380,000.00	390,659.00	
UKT 4.25% 07/31/34	140,000.00	142,879.82	
UKT 4.25% 09/07/39	300,000.00	299,250.00	
UKT 4.25% 12/07/27	470,000.00	475,819.49	
UKT 4.25% 12/07/40	250,000.00	247,925.00	
UKT 4.25% 12/07/46	440,000.00	426,580.00	
UKT 4.25% 12/07/49	270,000.00	260,550.00	
UKT 4.25% 12/07/55	390,000.00	374,400.00	
UKT 4.375% 07/31/54	160,000.00	156,416.00	
UKT 4.5% 06/07/28	720,000.00	733,948.76	
UKT 4.5% 09/07/34	310,000.00	322,867.79	
UKT 4.5% 12/07/42	430,000.00	436,450.00	
UKT 4.625% 01/31/34	620,000.00	651,601.33	
UKT 4.75% 10/22/43	310,000.00	323,206.00	
UKT 4.75% 12/07/30	450,000.00	473,430.37	
UKT 4.75% 12/07/38	320,000.00	338,369.34	
UKT 4% 01/22/60	290,000.00	266,423.00	
UKT 4% 10/22/31	290,000.00	291,963.64	
UKT 4% 10/22/63	270,000.00	246,996.00	
UKT 6.0% 12/07/28	380,000.00	413,062.66	
イギリスポンド 小計	25,700,000.00	21,727,742.25 (4,155,213,427)	

スウェーデン クロナ	SGB 0.125% 05/12/31	1,100,000.00	980,254.00	
	SGB 0.75% 05/12/28	1,590,000.00	1,531,456.08	
	SGB 0.75% 11/12/29	1,740,000.00	1,647,884.40	
	SGB 1.75% 11/11/33	1,150,000.00	1,130,684.92	
	SGB 1% 11/12/26	1,470,000.00	1,443,484.52	
	SGB 2.25% 06/01/32	990,000.00	1,013,632.48	
	SGB 3.5% 03/30/39	830,000.00	970,643.50	
スウェーデンクロナ 小計		8,870,000.00	8,718,039.90 (123,883,346)	
ノルウェー クロネ	NGB 1.25% 09/17/31	930,000.00	814,419.60	
	NGB 1.375% 08/19/30	1,390,000.00	1,253,805.18	
	NGB 1.5% 02/19/26	980,000.00	951,298.25	
	NGB 1.75% 02/17/27	1,240,000.00	1,196,682.14	
	NGB 1.75% 09/06/29	720,000.00	672,156.00	
	NGB 2.125% 05/18/32	910,000.00	840,091.52	
	NGB 2% 04/26/28	850,000.00	816,527.00	
	NGB 3.5% 10/06/42	360,000.00	367,187.40	
	NGB 3.625% 04/13/34	580,000.00	592,383.00	
	NGB 3% 08/15/33	1,350,000.00	1,317,735.00	
ノルウェークロネ 小計		9,310,000.00	8,822,285.09 (121,747,534)	
デンマーク クロネ	DGB 0.25% 11/15/52	1,340,000.00	751,889.41	
	DGB 0.5% 11/15/27	1,300,000.00	1,235,254.15	
	DGB 0.5% 11/15/29	1,130,000.00	1,041,218.80	
	DGB 0% 11/15/31	1,270,000.00	1,093,996.47	
	DGB 1.75% 11/15/25	1,350,000.00	1,339,308.49	
	DGB 2.25% 11/15/26	400,000.00	400,274.80	
	DGB 2.25% 11/15/33	1,080,000.00	1,083,608.05	
	DGB 4.5% 11/15/39	1,980,000.00	2,492,500.62	
デンマーククロネ 小計		9,850,000.00	9,438,050.79 (203,956,277)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	680,000.00	617,278.49	
	POLGB 0% 10/25/25	280,000.00	266,455.63	
	POLGB 1.25% 10/25/30	1,280,000.00	1,021,733.75	
	POLGB 1.75% 04/25/32	920,000.00	721,375.68	
	POLGB 2.5% 07/25/26	1,240,000.00	1,188,290.01	
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,060,000.00	992,424.47	
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,730,000.00	1,606,440.37	
	POLGB 2.75% 10/25/29	710,000.00	637,358.12	
	POLGB 3.75% 05/25/27	480,000.00	466,078.32	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,090,000.00	1,120,817.02	
	POLGB 5% 10/25/34	170,000.00	166,051.22	
	POLGB 6% 10/25/33	1,000,000.00	1,050,465.00	

	POLGB 7.5% 07/25/28	710,000.00	772,203.24	
ポーランドズロチ 小計		11,350,000.00	10,626,971.32 (400,086,341)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	340,000.00	325,720.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	610,000.00	573,320.70	
	ACGB 1.25% 05/21/32	520,000.00	431,568.80	
	ACGB 1.5% 06/21/31	560,000.00	485,357.60	
	ACGB 1.75% 06/21/51	410,000.00	237,718.00	
	ACGB 1.75% 11/21/32	460,000.00	392,467.40	
	ACGB 1% 11/21/31	740,000.00	611,232.60	
	ACGB 1% 12/21/30	390,000.00	331,320.60	
	ACGB 2.25% 05/21/28	450,000.00	430,461.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	770,000.00	724,978.10	
	ACGB 2.75% 05/21/41	260,000.00	213,473.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	330,000.00	295,280.70	
	ACGB 2.75% 11/21/27	510,000.00	498,535.20	
	ACGB 2.75% 11/21/28	290,000.00	281,363.80	
	ACGB 2.75% 11/21/29	350,000.00	336,045.50	
	ACGB 3.25% 04/21/29	310,000.00	306,004.10	
	ACGB 3.25% 06/21/39	230,000.00	207,248.40	
	ACGB 3.5% 12/21/34	370,000.00	356,591.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	290,000.00	282,135.20	
	ACGB 3.75% 05/21/34	500,000.00	493,690.00	
	ACGB 3% 03/21/47	290,000.00	231,872.40	
	ACGB 3% 11/21/33	550,000.00	512,363.50	
	ACGB 4.25% 04/21/26	340,000.00	343,393.20	
	ACGB 4.25% 12/21/35	320,000.00	328,166.40	
	ACGB 4.5% 04/21/33	590,000.00	617,765.40	
	ACGB 4.75% 04/21/27	410,000.00	422,759.20	
	ACGB 4.75% 06/21/54	160,000.00	167,940.80	
オーストラリアドル 小計		11,350,000.00	10,438,772.80 (1,022,164,632)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	290,000.00	254,680.45	
	NZGB 0.5% 05/15/26	110,000.00	103,624.13	
	NZGB 1.5% 05/15/31	170,000.00	145,007.14	
	NZGB 1.75% 05/15/41	100,000.00	67,078.39	
	NZGB 2.75% 04/15/37	150,000.00	125,795.13	
	NZGB 2.75% 05/15/51	170,000.00	120,979.10	
	NZGB 2% 05/15/32	120,000.00	103,349.01	
	NZGB 3.5% 04/14/33	300,000.00	285,224.04	
	NZGB 3% 04/20/29	250,000.00	241,243.23	
	NZGB 4.25% 05/15/34	120,000.00	120,229.26	
	NZGB 4.5% 04/15/27	240,000.00	244,072.91	

	NZGB 4.5% 05/15/30	220,000.00	226,568.36	
	NZGB 4.5% 05/15/35	40,000.00	40,730.03	
	NZGB 5% 05/15/54	100,000.00	105,215.60	
ニュージーランドドル 小計		2,380,000.00	2,183,796.78 (196,825,603)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	110,000.00	107,005.61	
	SIGB 1.25% 11/01/26	140,000.00	135,944.90	
	SIGB 1.625% 07/01/31	230,000.00	214,935.90	
	SIGB 1.875% 03/01/50	280,000.00	231,280.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	140,000.00	138,647.05	
	SIGB 2.25% 08/01/36	150,000.00	142,575.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	70,000.00	66,652.95	
	SIGB 2.625% 05/01/28	220,000.00	219,890.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	140,000.00	139,160.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	190,000.00	187,792.20	
	SIGB 2.75% 04/01/42	150,000.00	148,500.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	190,000.00	191,900.00	
	SIGB 2.875% 09/01/27	60,000.00	60,402.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	130,000.00	131,560.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	210,000.00	220,878.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	320,000.00	326,710.40	
	SIGB 3% 08/01/72	120,000.00	125,002.96	
シンガポールドル 小計		2,850,000.00	2,788,836.97 (309,114,689)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	300,000.00	281,431.35	
	MGS 3.502% 05/31/27	470,000.00	472,062.83	
	MGS 3.519% 04/20/28	540,000.00	541,882.54	
	MGS 3.582% 07/15/32	320,000.00	316,212.87	
	MGS 3.733% 06/15/28	590,000.00	596,015.22	
	MGS 3.757% 05/22/40	910,000.00	887,134.63	
	MGS 3.828% 07/05/34	500,000.00	503,140.50	
	MGS 3.844% 04/15/33	420,000.00	421,632.79	
	MGS 3.885% 08/15/29	650,000.00	661,829.48	
	MGS 3.892% 03/15/27	390,000.00	395,477.39	
	MGS 3.899% 11/16/27	420,000.00	426,873.93	
	MGS 3.9% 11/30/26	50,000.00	50,705.62	
	MGS 3.906% 07/15/26	580,000.00	587,040.38	
	MGS 3.955% 09/15/25	150,000.00	151,265.04	
	MGS 4.065% 06/15/50	450,000.00	444,733.71	
	MGS 4.232% 06/30/31	440,000.00	453,866.95	
	MGS 4.254% 05/31/35	600,000.00	623,454.60	
	MGS 4.392% 04/15/26	270,000.00	275,104.08	

	MGS 4.457% 03/31/53	410,000.00	429,358.43	
	MGS 4.498% 04/15/30	790,000.00	826,177.72	
	MGS 4.642% 11/07/33	380,000.00	405,448.75	
	MGS 4.696% 10/15/42	300,000.00	326,050.10	
	MGS 4.736% 03/15/46	240,000.00	262,335.40	
	MGS 4.762% 04/07/37	630,000.00	684,301.90	
	MGS 4.893% 06/08/38	310,000.00	341,369.95	
	MGS 4.921% 07/06/48	320,000.00	358,752.76	
	MGS 4.935% 09/30/43	130,000.00	145,214.78	
マレーシアリングット 小計		11,560,000.00	11,868,873.70 (394,183,098)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	570,000.00	539,887.18	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	520,000.00	409,721.52	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	680,000.00	462,428.90	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	510,000.00	498,318.90	
	ILGOV 1% 03/31/30	770,000.00	639,054.10	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,240,000.00	1,140,999.49	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	360,000.00	231,186.29	
	ILGOV 2% 03/31/27	380,000.00	358,902.70	
	ILGOV 3.75% 02/28/29	60,000.00	58,293.24	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	600,000.00	489,983.40	
	ILGOV 3.75% 09/30/27	240,000.00	235,821.86	
	ILGOV 4% 03/30/35	100,000.00	93,566.15	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	480,000.00	505,418.97	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	440,000.00	457,968.58	
イスラエルシェケル 小計		6,950,000.00	6,121,551.28 (240,180,288)	
オフショア 人民元	CGB 1.67% 06/15/26	1,430,000.00	1,433,039.17	
	CGB 1.85% 05/15/27	10,200,000.00	10,238,551.92	
	CGB 1.99% 03/15/26	3,930,000.00	3,954,226.48	
	CGB 2.05% 04/15/29	6,100,000.00	6,138,257.98	
	CGB 2.12% 06/25/31	4,350,000.00	4,356,798.18	
	CGB 2.18% 08/15/26	19,880,000.00	20,080,177.68	
	CGB 2.18% 08/25/25	4,860,000.00	4,887,678.67	
	CGB 2.22% 09/25/25	5,400,000.00	5,436,872.28	
	CGB 2.27% 05/25/34	3,140,000.00	3,162,529.81	
	CGB 2.28% 03/25/31	4,600,000.00	4,652,550.86	
	CGB 2.28% 11/25/25	7,860,000.00	7,925,458.08	
	CGB 2.3% 05/15/26	10,490,000.00	10,605,926.03	
	CGB 2.33% 12/15/25	2,500,000.00	2,524,294.25	
	CGB 2.35% 02/25/34	4,750,000.00	4,818,391.45	
	CGB 2.37% 01/15/29	8,870,000.00	9,041,287.67	
	CGB 2.37% 01/20/27	8,330,000.00	8,451,936.20	

CGB 2.39% 11/15/26	5,900,000.00	5,984,216.60	
CGB 2.4% 07/15/28	9,890,000.00	10,069,921.84	
CGB 2.44% 10/15/27	7,400,000.00	7,541,379.22	
CGB 2.46% 02/15/26	9,080,000.00	9,184,577.99	
CGB 2.48% 04/15/27	4,660,000.00	4,746,608.43	
CGB 2.48% 09/25/28	4,400,000.00	4,502,553.88	
CGB 2.5% 07/25/27	6,500,000.00	6,637,639.45	
CGB 2.52% 08/25/33	15,400,000.00	15,834,959.14	
CGB 2.54% 12/25/30	5,520,000.00	5,678,051.95	
CGB 2.55% 10/15/28	3,500,000.00	3,590,491.10	
CGB 2.6% 09/01/32	160,000.00	165,460.36	
CGB 2.6% 09/15/30	6,420,000.00	6,621,157.20	
CGB 2.62% 04/15/28	3,000,000.00	3,077,981.10	
CGB 2.62% 06/25/30	9,400,000.00	9,701,140.28	
CGB 2.62% 09/25/29	4,950,000.00	5,106,843.22	
CGB 2.64% 01/15/28	9,570,000.00	9,814,982.43	
CGB 2.67% 05/25/33	8,090,000.00	8,414,925.95	
CGB 2.67% 11/25/33	600,000.00	624,673.56	
CGB 2.68% 05/21/30	6,910,000.00	7,152,500.23	
CGB 2.69% 08/12/26	9,650,000.00	9,839,605.13	
CGB 2.69% 08/15/32	4,550,000.00	4,734,817.36	
CGB 2.75% 02/17/32	5,150,000.00	5,375,263.06	
CGB 2.75% 06/15/29	5,900,000.00	6,121,569.78	
CGB 2.76% 05/15/32	2,940,000.00	3,072,510.79	
CGB 2.79% 12/15/29	7,400,000.00	7,702,528.28	
CGB 2.8% 03/24/29	4,990,000.00	5,182,270.68	
CGB 2.8% 03/25/30	6,620,000.00	6,890,993.67	
CGB 2.8% 11/15/32	4,850,000.00	5,090,013.89	
CGB 2.85% 06/04/27	3,850,000.00	3,963,272.00	
CGB 2.88% 02/25/33	7,250,000.00	7,669,835.17	
CGB 2.89% 11/18/31	2,750,000.00	2,897,977.77	
CGB 2.91% 10/14/28	11,310,000.00	11,773,144.50	
CGB 3.01% 05/13/28	6,720,000.00	6,999,410.20	
CGB 3.02% 05/27/31	7,650,000.00	8,118,460.75	
CGB 3.02% 10/22/25	8,000,000.00	8,139,221.60	
CGB 3.03% 03/11/26	4,650,000.00	4,753,938.66	
CGB 3.12% 10/25/52	3,630,000.00	4,152,164.61	
CGB 3.12% 12/05/26	1,300,000.00	1,342,287.18	
CGB 3.13% 11/21/29	2,050,000.00	2,175,421.25	
CGB 3.19% 04/15/53	3,100,000.00	3,595,090.77	
CGB 3.25% 11/22/28	3,100,000.00	3,287,229.15	
CGB 3.27% 11/19/30	620,000.00	667,171.70	
CGB 3.28% 12/03/27	1,170,000.00	1,230,378.55	

	CGB 3.32% 04/15/52	2,730,000.00	3,224,988.31	
	CGB 3.39% 03/16/50	7,170,000.00	8,496,488.00	
	CGB 3.53% 10/18/51	2,000,000.00	2,442,436.40	
	CGB 3.72% 04/12/51	4,280,000.00	5,372,926.24	
	CGB 3.81% 09/14/50	3,960,000.00	5,028,102.68	
	CGB 3.86% 07/22/49	3,210,000.00	4,079,969.70	
	CGB 3% 10/15/53	1,160,000.00	1,302,689.61	
	CGB 4.08% 10/22/48	4,900,000.00	6,396,189.02	
	オフショア人民元 小計	376,650,000.00	393,276,407.10 (7,959,560,530)	
	合計		76,861,362,704 (76,861,362,704)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 213銘柄	100.0%	47.1%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 361銘柄	100.0%	30.4%
イギリスポンド	国債証券 61銘柄	100.0%	5.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 27銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 67銘柄	100.0%	10.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	870,878,250
コール・ローン	2,338,302,234
国債証券	346,616,475,370
派生商品評価勘定	3,653,697
未収入金	6,753,426
未収利息	2,379,592,438
前払金	3,326,943
前払費用	268,577,451
差入委託証拠金	263,349,667
流動資産合計	352,750,909,476
資産合計	352,750,909,476
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,110,601
未払金	11,802,969
未払解約金	56,311,219
流動負債合計	90,224,789
負債合計	90,224,789
純資産の部	
元本等	
元本	100,146,995,181
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	252,513,689,506
元本等合計	352,660,684,687
純資産合計	352,660,684,687
負債純資産合計	352,750,909,476

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月28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、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。

	2024年 8月28日現在
	(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 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	100,146,995,181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 3.5214円 (1万口当たり純資産額) (35,214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 8月28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、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 8月28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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月29日
期首元本額	86,879,656,566円
期中追加設定元本額	20,145,025,083円
期中一部解約元本額	6,877,686,468円
期末元本額	100,146,995,181円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,072,989,580円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	452,981,329円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	309,732,561円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,365,615,556円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,965,144円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,732,501,074円
世界経済インデックスファンド	24,881,837,444円
DCマイセクション25	1,821,989,050円
DCマイセクション50	1,716,023,946円
DCマイセクション75	1,354,740,172円
DC外国債券インデックス・オープン	2,228,631,741円
DCマイセクションS25	1,141,569,256円
DCマイセクションS50	1,024,594,274円
DCマイセクションS75	660,083,274円
DCターゲット・イヤーフンド2025	7,247,384円
DCターゲット・イヤーフンド2035	99,775,976円
DCターゲット・イヤーフンド2045	56,393,057円
DC世界経済インデックスファンド	15,845,562,997円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	802,949,378円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,029,773円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	896,753円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	7,661,667円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	22,050,134円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	39,664,392円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	51,485,093円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	50,419,910円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	623,291,467円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	344,808,187円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,445,341,541円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	49,331,755円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	24,823,033円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	317,437,111円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	119,314,710円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	161,223,881円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	620,655,002円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,465,730,236円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	591,994,936円
外国債券ファンド・シリーズ1	757,830,654円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円
分散投資コア戦略ファンドS	1,606,006,912円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	814,936,897円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,544,775,872円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,241,504円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,030,790円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,295,192,631円
SMT インデックスバランス・オープン	164,002,695円
SMT 世界経済インデックス・オープン	452,580,561円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	680,844,135円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,018,206,796円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,816,198円
グローバル経済コア	1,215,120,406円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	24,321,409円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,966,734円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	64,983,272円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	103,889,631円

区分	2024年 8月28日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	53,566,223円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	74,912,703円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	916,736,264円
10資産分散投資ファンド	35,497,936円
グローバル10資産バランスファンド	32,546,738円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	24,154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	22,194円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	22,322円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	22,322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	31,494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	21,345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	21,210円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	16,457円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	13,910,106,657円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	245,708,747円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	288,286,602円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	138,767,052円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	10,320,556,862
合計	10,320,556,862

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	2,562,376,031	—	2,559,049,088	△3,326,943
合計		2,562,376,031	—	2,559,049,088	△3,326,943

(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ではありません。

通貨関連

（2024年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,002,410,531	—	2,987,280,570	△15,129,961
	アメリカドル	1,451,087,689	—	1,437,963,597	△13,124,092
	カナダドル	116,512,062	—	116,756,549	244,487
	ユーロ	918,511,816	—	917,544,390	△967,426

	イギリスポンド	174,049,833	—	175,561,668	1,511,835
	オフショア人民元	342,249,131	—	339,454,366	△2,794,765
合計		3,002,410,531	—	2,987,280,570	△15,129,961

(注)時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 07/31/25	7,640,000.00	7,356,970.08	
		T 0.25% 08/31/25	5,250,000.00	5,039,020.24	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,872,207.02	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,436,875.00	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,591,250.00	
		T 0.375% 07/31/27	16,100,000.00	14,616,095.67	
		T 0.375% 09/30/27	2,440,000.00	2,204,101.55	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,861,015.64	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,804,843.76	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,267,265.62	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,698,828.12	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,204,960.92	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,356,573.42	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,236,595.28	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,783,398.40	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,921,679.65	
		T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,667,105.44	
		T 0.625% 07/31/26	10,800,000.00	10,148,625.00	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,995,521.45	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,265,136.72	
		T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,676,000.00	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,698,144.51	
		T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,699,531.28	
		T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	9,005,146.52	
		T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,783,437.52	
		T 0.75% 08/31/26	9,630,000.00	9,052,952.28	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,570,312.48	

T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,728,775.38	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,412,603.54	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,484,415.63	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,325,937.52	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,121,419.33	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,380,609.38	
T 1.125% 08/31/28	12,030,000.00	10,885,270.30	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,785,534.38	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,330,468.72	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,964,046.87	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,488,242.18	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	8,215,488.27	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,830,717.60	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,624,404.28	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,614,453.16	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,728,380.50	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	3,138,339.85	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,206,843.76	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,705,285.12	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,038,164.04	
T 1.375% 12/31/28	8,680,000.00	7,880,490.58	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,684,414.04	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,769,925.81	
T 1.5% 08/15/26	15,500,000.00	14,802,500.00	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,856,787.10	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,405,750.00	
T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	10,353,083.17	
T 1.625% 05/15/31	10,980,000.00	9,613,290.18	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,136,171.87	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,671,375.00	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,057,253.88	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,553,696.87	
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,528,554.68	
T 1.75% 08/15/41	7,080,000.00	4,984,900.77	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,730,468.75	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	10,292,082.78	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,752,033.21	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,137,375.00	
T 1.875% 02/28/27	6,500,000.00	6,205,976.53	
T 1.875% 02/28/29	8,470,000.00	7,838,720.31	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,996,794.15	
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	2,059,728.52	

T 1% 07/31/28	13,000,000.00	11,727,675.83	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,488,906.23	
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,349,679.68	
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,940,376.93	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,295,654.32	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,973,064.46	
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	7,218,799.25	
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,170,037.50	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,798,330.08	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,298,164.06	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,311,726.56	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,256,054.66	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,630,500.00	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,532,664.05	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,269,662.31	
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,674,402.56	
T 2.375% 05/15/51	7,450,000.00	5,255,014.62	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,906,435.55	
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,140,539.44	
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,845,826.17	
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,883,255.88	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,089,029.30	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,595,283.99	
T 2.625% 02/15/29	7,740,000.00	7,403,642.58	
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,329,593.74	
T 2.625% 07/31/29	15,200,000.00	14,483,046.85	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,705,987.13	
T 2.75% 02/15/28	8,550,000.00	8,281,142.59	
T 2.75% 04/30/27	5,450,000.00	5,311,195.31	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,469,662.08	
T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	12,000,275.43	
T 2.75% 08/15/42	7,100,000.00	5,806,191.42	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,149,033.19	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,791,073.90	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,904,418.75	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,365,894.51	
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,186,304.70	
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,768,613.70	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,503,666.00	
T 2.875% 05/15/43	5,050,000.00	4,166,052.74	
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,784,437.48	
T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	8,476,101.57	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,385,921.06	

T 2.875% 08/15/28	13,220,000.00	12,817,977.68	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,863,089.83	
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	752,789.44	
T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,856,562.50	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,787,177.72	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,372,907.57	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	5,061,410.11	
T 2% 11/15/26	6,320,000.00	6,075,593.71	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,534,476.57	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	916,001.95	
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	3,267,554.67	
T 3.125% 05/15/48	4,780,000.00	3,957,877.33	
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	10,080,218.34	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,564,000.00	
T 3.125% 08/31/27	6,150,000.00	6,045,257.81	
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,969,853.53	
T 3.125% 11/15/28	10,410,000.00	10,177,604.86	
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,661,564.46	
T 3.25% 06/30/29	6,500,000.00	6,376,220.69	
T 3.375% 05/15/33	13,630,000.00	13,195,809.94	
T 3.375% 05/15/44	3,910,000.00	3,458,364.46	
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	2,061,105.46	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,576,425.76	
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,960,468.76	
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,960,468.73	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	733,274.61	
T 3.5% 04/30/30	3,500,000.00	3,463,359.37	
T 3.5% 09/15/25	2,900,000.00	2,875,597.22	
T 3.625% 02/15/44	4,890,000.00	4,494,979.68	
T 3.625% 02/15/53	9,550,000.00	8,700,012.65	
T 3.625% 05/15/53	2,300,000.00	2,096,189.45	
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	4,331,527.33	
T 3.75% 04/15/26	6,570,000.00	6,543,437.68	
T 3.75% 06/30/30	3,000,000.00	3,005,742.18	
T 3.75% 11/15/43	6,130,000.00	5,742,325.37	
T 3.75% 12/31/30	6,160,000.00	6,167,940.60	
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,479,687.50	
T 3.875% 02/15/43	2,500,000.00	2,396,875.00	
T 3.875% 08/15/33	11,070,000.00	11,116,269.16	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,424,455.07	
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,571,113.27	
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	8,202,725.37	

T 3% 02/15/47	5,920,000.00	4,837,750.00	
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	810,878.91	
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	806,601.56	
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	2,088,625.00	
T 3% 05/15/45	700,000.00	580,015.62	
T 3% 05/15/47	1,710,000.00	1,394,919.14	
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,626,279.30	
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,189,960.94	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,142,742.19	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,930,175.80	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,327,609.36	
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,899,925.78	
T 4.125% 03/31/29	3,350,000.00	3,413,532.21	
T 4.125% 07/31/31	3,500,000.00	3,583,398.42	
T 4.125% 08/15/53	4,300,000.00	4,286,562.50	
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,400,710.97	
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,137,054.67	
T 4.125% 11/15/32	8,000,000.00	8,196,562.48	
T 4.25% 02/15/54	10,050,000.00	10,243,148.43	
T 4.25% 02/28/31	9,000,000.00	9,269,472.69	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	928,335.94	
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,899,326.14	
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	759,439.45	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,051,289.06	
T 4.375% 05/15/34	3,310,000.00	3,454,553.92	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,982,976.57	
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	675,289.06	
T 4.375% 07/15/27	800,000.00	813,843.75	
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	6,054,843.72	
T 4.375% 08/15/43	1,500,000.00	1,533,779.29	
T 4.375% 08/31/28	14,150,000.00	14,506,789.98	
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	1,002,187.49	
T 4.375% 11/30/30	4,500,000.00	4,661,191.39	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,164,767.18	
T 4.5% 04/15/27	9,150,000.00	9,316,201.14	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	584,761.71	
T 4.5% 07/15/26	10,000,000.00	10,103,906.20	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,798,945.30	
T 4.5% 11/15/33	9,270,000.00	9,754,502.29	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,480,696.87	
T 4.625% 04/30/31	2,900,000.00	3,051,117.20	
T 4.625% 05/15/54	900,000.00	976,500.00	
T 4.625% 09/30/30	3,010,000.00	3,157,325.38	

	T 4.625% 10/15/26	9,520,000.00	9,668,378.14	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	815,361.33	
	T 4.75% 11/15/53	3,880,000.00	4,288,991.41	
	T 4.875% 05/31/26	3,400,000.00	3,451,265.60	
	T 4.875% 10/31/30	2,500,000.00	2,658,007.80	
	T 4% 01/15/27	7,200,000.00	7,231,500.00	
	T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,494,287.08	
	T 4% 02/15/34	8,600,000.00	8,713,546.83	
	T 4% 02/28/30	1,350,000.00	1,370,039.06	
	T 4% 07/31/30	3,980,000.00	4,039,933.18	
	T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,645,179.68	
	T 4% 11/15/52	7,400,000.00	7,205,605.47	
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	445,937.50	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,381,046.87	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,142,562.50	
	T 5% 08/31/25	6,750,000.00	6,791,530.92	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,751,996.09	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,557,164.06	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,186,623.04	
	アメリカドル 小計	1,228,610,000.00	1,130,471,449.69 (163,093,116,046)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	1,340,000.00	1,279,102.88	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,916,216.25	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,999,165.99	
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,797,787.78	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,950,000.00	3,600,271.77	
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	883,032.12	
	CAN 1.5% 06/01/31	4,110,000.00	3,742,250.83	
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,271,320.65	
	CAN 1.75% 12/01/53	2,920,000.00	2,141,770.53	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	768,511.45	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,466,374.67	
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	233,702.77	
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,215,364.20	
	CAN 2.75% 06/01/33	1,200,000.00	1,175,498.43	
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,588,507.02	
	CAN 2.75% 12/01/48	980,000.00	914,475.46	
	CAN 2.75% 12/01/55	1,990,000.00	1,833,325.94	
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	573,819.77	
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	396,664.03	
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,415,345.15	
	CAN 2% 12/01/51	3,750,000.00	2,957,676.25	

	CAN 3.25% 09/01/28	1,890,000.00	1,910,802.83	
	CAN 3.25% 12/01/33	2,370,000.00	2,410,523.36	
	CAN 3.25% 12/01/34	440,000.00	446,621.44	
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,180,223.53	
	CAN 3.5% 08/01/25	920,000.00	918,361.10	
	CAN 3.5% 09/01/29	990,000.00	1,016,007.93	
	CAN 3.5% 12/01/45	960,000.00	1,012,085.39	
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,332,194.79	
	CAN 3% 06/01/34	2,280,000.00	2,269,259.48	
	CAN 3% 10/01/25	3,290,000.00	3,269,821.64	
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	821,800.14	
	CAN 4.5% 02/01/26	300,000.00	304,252.43	
	CAN 4.5% 11/01/25	1,330,000.00	1,344,148.64	
	CAN 4% 03/01/29	2,180,000.00	2,276,525.34	
	CAN 4% 05/01/26	2,250,000.00	2,272,669.39	
	CAN 4% 08/01/26	1,490,000.00	1,510,851.14	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,679,410.21	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,953,536.66	
	CAN 5% 06/01/37	490,000.00	587,210.71	
カナダドル 小計		68,540,000.00	65,686,490.09 (7,048,817,251)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,827,751.79	
	MBONO 5.5% 03/04/27	33,260,000.00	30,280,017.74	
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	43,991,007.32	
	MBONO 7.5% 05/26/33	30,430,000.00	26,772,922.60	
	MBONO 7.5% 06/03/27	33,800,000.00	32,154,865.77	
	MBONO 7.75% 05/29/31	38,870,000.00	35,564,899.83	
	MBONO 7.75% 11/13/42	32,960,000.00	27,119,086.53	
	MBONO 7.75% 11/23/34	15,310,000.00	13,540,185.72	
	MBONO 7% 09/03/26	13,190,000.00	12,492,644.70	
	MBONO 8.5% 03/01/29	14,540,000.00	14,019,322.60	
	MBONO 8.5% 05/31/29	32,230,000.00	31,049,624.26	
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,389,548.12	
	MBONO 8% 07/31/53	24,870,000.00	20,477,630.45	
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	20,450,649.12	
メキシコペソ 小計		370,890,000.00	336,130,156.55 (2,454,993,824)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,420,000.00	1,233,815.63	
	BGB 0.35% 06/22/32	1,220,000.00	1,018,772.95	
	BGB 0.4% 06/22/40	660,000.00	433,605.59	
	BGB 0.65% 06/22/71	530,000.00	225,678.24	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,442,802.23	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,505,447.84	

BGB 0.9% 06/22/29	1,790,000.00	1,662,780.67	
BGB 0% 10/22/27	900,000.00	833,701.94	
BGB 0% 10/22/31	1,460,000.00	1,211,389.14	
BGB 1.25% 04/22/33	1,310,000.00	1,165,238.45	
BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	667,883.47	
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	666,380.00	
BGB 1.6% 06/22/47	950,000.00	690,528.87	
BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	786,374.60	
BGB 1.9% 06/22/38	1,020,000.00	883,891.96	
BGB 1% 06/22/26	1,560,000.00	1,518,084.36	
BGB 1% 06/22/31	1,770,000.00	1,593,346.92	
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	655,092.46	
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	516,824.59	
BGB 2.7% 10/22/29	480,000.00	483,535.20	
BGB 2.75% 04/22/39	730,000.00	698,841.77	
BGB 2.85% 10/22/34	1,110,000.00	1,107,793.97	
BGB 3.3% 06/22/54	1,020,000.00	991,104.82	
BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	450,940.60	
BGB 3.5% 06/22/55	630,000.00	631,962.45	
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	991,314.90	
BGB 3% 06/22/33	1,450,000.00	1,476,371.73	
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,045,836.25	
BGB 4.25% 03/28/41	1,680,000.00	1,903,008.24	
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,173,108.45	
BGB 4% 03/28/32	880,000.00	958,344.90	
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,249,650.80	
BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,147,791.25	
BKO 2.5% 03/19/26	1,010,000.00	1,009,628.32	
BKO 2.9% 06/18/26	730,000.00	735,622.24	
BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,364,950.53	
BKO 3.1% 12/12/25	1,820,000.00	1,830,874.50	
BTPS 0.25% 03/15/28	2,030,000.00	1,851,182.02	
BTPS 0.45% 02/15/29	1,640,000.00	1,467,010.30	
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,846,968.09	
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,186,092.31	
BTPS 0.6% 08/01/31	1,960,000.00	1,636,077.66	
BTPS 0.85% 01/15/27	2,340,000.00	2,236,804.83	
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,514,470.40	
BTPS 0.95% 03/01/37	1,320,000.00	949,200.12	
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,939,970.08	
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,961,954.00	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,640,000.00	1,551,431.80	
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,815,255.00	

BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,141,794.07	
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	3,061,424.68	
BTPS 1.1% 04/01/27	2,350,000.00	2,250,161.04	
BTPS 1.2% 08/15/25	1,050,000.00	1,031,871.75	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,614,748.05	
BTPS 1.35% 04/01/30	2,250,000.00	2,045,198.25	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,730,000.00	1,362,640.54	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	806,137.50	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,057,805.33	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,430,000.00	2,160,883.57	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,313,051.00	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,520,000.00	934,637.73	
BTPS 1.8% 03/01/41	960,000.00	704,208.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,280,000.00	1,252,857.60	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,421,685.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	690,000.00	424,550.10	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	684,417.45	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,244,383.36	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,650,000.00	1,411,656.67	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,510,000.00	1,389,988.97	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,380,000.00	1,010,365.62	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,660,000.00	1,652,548.26	
BTPS 2.5% 12/01/32	2,520,000.00	2,353,940.82	
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,749,616.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	882,479.41	
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	614,361.02	
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,580,252.52	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,412,322.77	
BTPS 2.95% 02/15/27	330,000.00	330,855.92	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,380,000.00	1,238,319.54	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,197,141.49	
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,185,712.21	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,273,575.28	
BTPS 3.2% 01/28/26	2,000,000.00	2,006,788.40	
BTPS 3.25% 03/01/38	2,080,000.00	1,937,603.20	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,987,748.20	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,890,000.00	1,837,095.12	
BTPS 3.35% 07/01/29	1,600,000.00	1,619,070.40	
BTPS 3.4% 04/01/28	2,000,000.00	2,033,408.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,633,690.24	
BTPS 3.5% 01/15/26	1,840,000.00	1,854,032.20	
BTPS 3.5% 02/15/31	2,440,000.00	2,470,134.00	

BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,407,554.00	
BTPS 3.7% 06/15/30	1,730,000.00	1,774,499.92	
BTPS 3.8% 04/15/26	1,870,000.00	1,897,366.32	
BTPS 3.8% 08/01/28	1,760,000.00	1,814,736.00	
BTPS 3.85% 07/01/34	1,480,000.00	1,506,483.41	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,394,340.01	
BTPS 3.85% 09/15/26	860,000.00	877,198.71	
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,959,978.45	
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,147,441.25	
BTPS 4.1% 02/01/29	440,000.00	459,419.84	
BTPS 4.15% 10/01/39	460,000.00	467,068.45	
BTPS 4.2% 03/01/34	1,920,000.00	2,013,638.40	
BTPS 4.35% 11/01/33	2,090,000.00	2,220,760.85	
BTPS 4.4% 05/01/33	1,060,000.00	1,132,440.40	
BTPS 4.45% 09/01/43	1,560,000.00	1,621,065.72	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,129,249.20	
BTPS 4.5% 10/01/53	1,510,000.00	1,564,980.61	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,807,292.24	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,700,000.00	1,842,426.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,070,000.00	3,146,683.99	
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	906,833.84	
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,305,675.00	
BTPS 4% 11/15/30	2,310,000.00	2,406,384.75	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,982,734.14	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,350,000.00	3,699,633.80	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,654,284.80	
BTPS 5% 08/01/34	2,830,000.00	3,156,157.50	
BTPS 5% 09/01/40	2,740,000.00	3,043,604.33	
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,999,160.00	
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,327,427.40	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,530,480.00	
DBR 0.25% 02/15/27	2,490,000.00	2,372,577.82	
DBR 0.25% 02/15/29	1,970,000.00	1,814,808.32	
DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,942,794.17	
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,916,123.00	
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,285,880.68	
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	333,317.68	
DBR 0% 02/15/30	970,000.00	864,872.85	
DBR 0% 02/15/31	1,660,000.00	1,449,304.90	
DBR 0% 02/15/32	3,100,000.00	2,644,718.50	
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,861,276.62	
DBR 0% 05/15/36	2,430,000.00	1,846,180.35	
DBR 0% 08/15/26	2,920,000.00	2,790,483.40	

DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,657,559.61	
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	2,074,235.72	
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,306,829.26	
DBR 0% 08/15/31	3,990,000.00	3,445,685.18	
DBR 0% 08/15/50	4,580,000.00	2,412,517.27	
DBR 0% 08/15/52	3,020,000.00	1,517,689.63	
DBR 0% 11/15/27	2,820,000.00	2,630,312.70	
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,820,922.63	
DBR 1.25% 08/15/48	3,340,000.00	2,576,646.00	
DBR 1.7% 08/15/32	2,600,000.00	2,511,713.10	
DBR 1.8% 08/15/53	3,700,000.00	3,155,840.07	
DBR 1% 05/15/38	2,360,000.00	1,962,101.64	
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,389,880.70	
DBR 2.1% 11/15/29	3,430,000.00	3,416,953.99	
DBR 2.2% 02/15/34	2,900,000.00	2,887,759.10	
DBR 2.3% 02/15/33	4,320,000.00	4,352,659.20	
DBR 2.4% 11/15/30	2,000,000.00	2,024,656.99	
DBR 2.5% 07/04/44	2,930,000.00	2,906,942.36	
DBR 2.5% 08/15/46	3,010,000.00	2,985,875.51	
DBR 2.5% 08/15/54	1,460,000.00	1,451,527.24	
DBR 2.6% 08/15/33	2,440,000.00	2,514,517.60	
DBR 2.6% 08/15/34	800,000.00	822,620.32	
DBR 3.25% 07/04/42	2,030,000.00	2,236,688.10	
DBR 4.0% 01/04/37	2,570,000.00	3,002,932.94	
DBR 4.25% 07/04/39	1,810,000.00	2,201,941.92	
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,564,613.76	
DBR 4.75% 07/04/34	2,500,000.00	3,042,446.24	
DBR 4.75% 07/04/40	2,060,000.00	2,659,315.17	
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,701,721.47	
DBR 5.625% 01/04/28	2,810,000.00	3,117,343.75	
DBR 6.25% 01/04/30	1,570,000.00	1,889,298.75	
DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	3,000,957.27	
FRTR 0.25% 11/25/26	3,700,000.00	3,512,569.50	
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,338,814.45	
FRTR 0.5% 05/25/29	4,260,000.00	3,857,640.31	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,781,513.02	
FRTR 0.5% 05/25/72	1,290,000.00	475,083.97	
FRTR 0.5% 06/25/44	2,030,000.00	1,201,554.76	
FRTR 0.75% 02/25/28	5,200,000.00	4,882,566.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,860,000.00	6,413,359.12	
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,539,314.91	
FRTR 0.75% 05/25/53	3,040,000.00	1,551,676.80	

FRTR 0.75% 11/25/28	4,550,000.00	4,211,561.90	
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,862,990.31	
FRTR 0% 02/25/27	4,000,000.00	3,752,117.46	
FRTR 0% 05/25/32	3,780,000.00	3,052,042.85	
FRTR 0% 11/25/29	4,820,000.00	4,202,650.14	
FRTR 0% 11/25/30	6,120,000.00	5,183,203.92	
FRTR 0% 11/25/31	5,340,000.00	4,382,906.46	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,510,000.00	4,722,725.69	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,650,731.05	
FRTR 1.25% 05/25/38	2,300,000.00	1,801,072.50	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,280,000.00	4,887,379.83	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,050,000.00	2,044,697.12	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,680,000.00	1,066,871.40	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,570,000.00	2,959,083.75	
FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,763,199.98	
FRTR 1% 11/25/25	4,200,000.00	4,110,050.70	
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,517,790.49	
FRTR 2.5% 05/25/43	1,710,000.00	1,501,931.47	
FRTR 2.5% 09/24/26	3,140,000.00	3,131,759.07	
FRTR 2.5% 09/24/27	1,100,000.00	1,096,620.70	
FRTR 2.75% 02/25/29	4,370,000.00	4,386,007.31	
FRTR 2.75% 02/25/30	1,520,000.00	1,522,995.31	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,460,000.00	5,484,133.20	
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,200,596.68	
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,721,719.60	
FRTR 3.25% 05/25/45	2,860,000.00	2,800,357.56	
FRTR 3.25% 05/25/55	490,000.00	461,374.55	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,793,501.19	
FRTR 3.5% 11/25/33	4,100,000.00	4,286,152.70	
FRTR 3% 05/25/33	4,210,000.00	4,245,126.13	
FRTR 3% 05/25/54	2,450,000.00	2,209,180.91	
FRTR 3% 06/25/49	770,000.00	715,231.82	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,490,000.00	4,023,919.04	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,460,000.00	3,999,680.76	
FRTR 4% 04/25/55	2,540,000.00	2,756,611.20	
FRTR 4% 04/25/60	1,880,000.00	2,061,271.48	
FRTR 4% 10/25/38	2,140,000.00	2,331,150.15	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,640,760.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,370,000.00	5,280,059.05	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	1,967,904.48	
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	631,994.25	
IRISH 0.2% 10/18/30	910,000.00	797,177.24	
IRISH 0.35% 10/18/32	450,000.00	378,455.62	

IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	543,392.25	
IRISH 0.55% 04/22/41	410,000.00	283,679.00	
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	730,612.57	
IRISH 0% 10/18/31	1,120,000.00	939,574.81	
IRISH 1.1% 05/15/29	980,000.00	925,205.26	
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	388,520.91	
IRISH 1.35% 03/18/31	370,000.00	345,592.16	
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	588,522.69	
IRISH 1.7% 05/15/37	740,000.00	653,102.54	
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	974,626.50	
IRISH 2.4% 05/15/30	930,000.00	929,004.90	
IRISH 2.6% 10/18/34	200,000.00	198,937.20	
IRISH 2% 02/18/45	1,010,000.00	860,395.26	
IRISH 3% 10/18/43	370,000.00	372,085.50	
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	859,140.15	
NETHER 0.5% 01/15/40	1,470,000.00	1,062,544.95	
NETHER 0.5% 07/15/26	1,750,000.00	1,689,012.50	
NETHER 0.5% 07/15/32	1,300,000.00	1,120,417.85	
NETHER 0.75% 07/15/27	1,060,000.00	1,013,758.03	
NETHER 0.75% 07/15/28	960,000.00	904,073.04	
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,149,184.19	
NETHER 0% 01/15/27	1,730,000.00	1,636,480.52	
NETHER 0% 01/15/29	1,770,000.00	1,598,522.40	
NETHER 0% 01/15/38	1,390,000.00	970,702.65	
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	851,323.25	
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,175,912.10	
NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,163,561.55	
NETHER 2.5% 01/15/30	1,210,000.00	1,216,753.61	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,552,071.73	
NETHER 2.5% 07/15/33	1,170,000.00	1,169,008.42	
NETHER 2.5% 07/15/34	1,090,000.00	1,084,007.06	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,900,000.00	1,906,518.90	
NETHER 2% 01/15/54	1,160,000.00	990,098.28	
NETHER 3.25% 01/15/44	750,000.00	805,116.89	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,931,744.00	
NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,889,117.35	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,684,315.03	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,954,515.04	
OBL 0% 04/16/27	1,830,000.00	1,726,216.12	
OBL 0% 10/09/26	2,680,000.00	2,553,241.36	
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,887,268.00	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,456,541.13	

OBL 2.1% 04/12/29	2,780,000.00	2,769,500.89	
OBL 2.2% 04/13/28	3,450,000.00	3,450,156.97	
OBL 2.4% 10/19/28	4,270,000.00	4,304,175.79	
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	524,005.20	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,800,000.00	1,649,034.00	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,490,000.00	1,415,180.76	
RAGB 0.7% 04/20/71	420,000.00	192,719.94	
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	829,557.52	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	455,823.03	
RAGB 0.75% 10/20/26	1,480,000.00	1,426,261.20	
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	105,996.65	
RAGB 0.9% 02/20/32	1,120,000.00	986,712.16	
RAGB 0% 02/20/30	1,480,000.00	1,289,511.03	
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,410,615.60	
RAGB 0% 10/20/28	880,000.00	794,495.89	
RAGB 0% 10/20/40	580,000.00	356,698.53	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,169,862.82	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	802,847.70	
RAGB 1.5% 11/02/86	400,000.00	246,556.45	
RAGB 1.85% 05/23/49	660,000.00	518,852.40	
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	502,049.13	
RAGB 2.4% 05/23/34	930,000.00	900,130.26	
RAGB 2.9% 02/20/33	1,510,000.00	1,527,327.25	
RAGB 2.9% 02/20/34	840,000.00	847,352.52	
RAGB 2.9% 05/23/29	350,000.00	356,248.37	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	836,063.15	
RAGB 3.15% 10/20/53	440,000.00	440,715.29	
RAGB 3.2% 07/15/39	330,000.00	336,334.18	
RAGB 3.45% 10/20/30	230,000.00	240,951.68	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	483,975.87	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,550,000.00	1,743,000.10	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,170,000.00	1,207,589.76	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,301,888.57	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	319,932.25	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	216,959.00	
RFGB 0.125% 09/15/31	710,000.00	596,583.69	
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	194,519.13	
RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	551,293.25	
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	313,408.46	
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	509,517.43	
RFGB 0.5% 09/15/28	780,000.00	720,836.37	
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	478,930.73	
RFGB 0.75% 04/15/31	510,000.00	452,872.79	

RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	431,339.15	
RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	436,961.13	
RFGB 0% 09/15/30	720,000.00	616,831.20	
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	551,616.00	
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	340,180.92	
RFGB 1.375% 04/15/47	570,000.00	416,341.32	
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	521,066.97	
RFGB 2.625% 07/04/42	470,000.00	443,538.06	
RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	388,589.80	
RFGB 2.75% 07/04/28	680,000.00	687,080.70	
RFGB 2.875% 04/15/29	320,000.00	324,580.18	
RFGB 2.95% 04/15/55	350,000.00	341,204.50	
RFGB 3% 09/15/33	480,000.00	489,304.80	
RFGB 3% 09/15/34	430,000.00	436,804.75	
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,846,790.00	
SPGB 0.5% 04/30/30	3,210,000.00	2,844,514.21	
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,189,605.30	
SPGB 0.6% 10/31/29	1,970,000.00	1,775,404.38	
SPGB 0.7% 04/30/32	2,500,000.00	2,134,912.50	
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,319,071.77	
SPGB 0.8% 07/30/29	2,210,000.00	2,021,488.10	
SPGB 0.85% 07/30/37	1,760,000.00	1,308,128.80	
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,559,401.46	
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,733,915.15	
SPGB 0% 01/31/28	3,050,000.00	2,793,525.50	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,519,055.46	
SPGB 1.25% 10/31/30	3,370,000.00	3,087,438.98	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	2,014,312.34	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,230,000.00	2,138,087.76	
SPGB 1.4% 07/30/28	2,400,000.00	2,294,093.40	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,551,707.10	
SPGB 1.45% 10/31/27	1,960,000.00	1,893,330.60	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	332,405.70	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,458,643.50	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,190,000.00	1,933,053.87	
SPGB 1.9% 10/31/52	1,890,000.00	1,298,467.80	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,273,816.80	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,937,404.22	
SPGB 1% 07/30/42	1,350,000.00	904,019.06	
SPGB 1% 10/31/50	2,000,000.00	1,119,115.00	
SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,558,376.11	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,190,000.00	2,085,971.16	

	SPGB 2.5% 05/31/27	2,330,000.00	2,322,600.48	
	SPGB 2.55% 10/31/32	2,500,000.00	2,436,998.74	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,453,784.71	
	SPGB 2.8% 05/31/26	1,670,000.00	1,673,335.32	
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,780,000.00	1,589,088.76	
	SPGB 3.15% 04/30/33	2,170,000.00	2,202,551.08	
	SPGB 3.25% 04/30/34	2,150,000.00	2,185,323.42	
	SPGB 3.45% 07/30/43	1,290,000.00	1,263,459.54	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,440,000.00	1,335,994.56	
	SPGB 3.45% 10/31/34	1,200,000.00	1,236,328.44	
	SPGB 3.5% 05/31/29	1,980,000.00	2,052,654.12	
	SPGB 3.55% 10/31/33	2,270,000.00	2,367,717.82	
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,660,000.00	1,747,942.65	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,800,000.00	1,974,939.29	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,780,000.00	2,053,091.16	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	2,028,321.20	
	SPGB 4% 10/31/54	770,000.00	798,343.70	
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,710,000.00	4,077,623.90	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,520,000.00	1,858,349.72	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,705,886.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,448,818.29	
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,037,523.94	
	ユーロ 小計		695,790,000.00	655,520,415.15 (105,683,001,330)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,198,158.44	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,336,692.16	
	UKT 0.25% 07/31/31	2,490,000.00	1,959,249.77	
	UKT 0.375% 10/22/26	2,980,000.00	2,764,814.20	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,180,000.00	1,779,915.50	
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,891,525.39	
	UKT 0.5% 10/22/61	2,420,000.00	753,346.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,250,000.00	1,580,314.50	
	UKT 0.625% 10/22/50	1,450,000.00	605,520.00	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,530,000.00	784,415.70	
	UKT 0.875% 07/31/33	3,400,000.00	2,625,548.00	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,460,000.00	1,266,959.96	
	UKT 1.125% 01/31/39	2,130,000.00	1,423,266.00	
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	394,905.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	1,250,000.00	1,162,000.00	
	UKT 1.25% 07/31/51	2,610,000.00	1,306,305.00	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,030,000.00	1,280,717.15	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,990,000.00	1,900,719.84	
	UKT 1.5% 07/22/47	1,540,000.00	891,506.00	

UKT 1.5% 07/31/53	1,520,000.00	792,832.00	
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	983,494.56	
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	715,426.00	
UKT 1.625% 10/22/71	1,670,000.00	784,399.00	
UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	648,540.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,900,000.00	1,028,090.00	
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,441,507.53	
UKT 1% 01/31/32	3,700,000.00	3,026,566.70	
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	912,066.00	
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,324,957.64	
UKT 3.25% 01/22/44	2,310,000.00	1,960,266.00	
UKT 3.25% 01/31/33	3,960,000.00	3,772,307.08	
UKT 3.5% 01/22/45	2,000,000.00	1,749,000.00	
UKT 3.5% 07/22/68	1,470,000.00	1,215,249.00	
UKT 3.5% 10/22/25	2,350,000.00	2,325,493.68	
UKT 3.75% 01/29/38	2,430,000.00	2,328,328.57	
UKT 3.75% 03/07/27	1,770,000.00	1,755,439.68	
UKT 3.75% 07/22/52	1,150,000.00	1,015,450.00	
UKT 3.75% 10/22/53	3,060,000.00	2,687,292.00	
UKT 4.125% 01/29/27	3,340,000.00	3,341,544.08	
UKT 4.125% 07/22/29	1,210,000.00	1,221,434.50	
UKT 4.25% 03/07/36	1,730,000.00	1,758,498.29	
UKT 4.25% 06/07/32	1,320,000.00	1,357,026.00	
UKT 4.25% 07/31/34	1,250,000.00	1,275,712.75	
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,266,825.00	
UKT 4.25% 12/07/27	1,800,000.00	1,822,287.42	
UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,437,965.00	
UKT 4.25% 12/07/46	1,770,000.00	1,716,015.00	
UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,457,150.00	
UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,632,000.00	
UKT 4.375% 07/31/54	1,390,000.00	1,358,864.00	
UKT 4.5% 06/07/28	3,370,000.00	3,435,288.00	
UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,447,697.51	
UKT 4.5% 12/07/42	2,290,000.00	2,324,350.00	
UKT 4.625% 01/31/34	2,230,000.00	2,343,662.87	
UKT 4.75% 10/22/43	1,600,000.00	1,668,160.00	
UKT 4.75% 12/07/30	1,710,000.00	1,799,035.42	
UKT 4.75% 12/07/38	1,800,000.00	1,903,327.55	
UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,148,375.00	
UKT 4% 10/22/31	490,000.00	493,317.88	
UKT 4% 10/22/63	1,440,000.00	1,317,312.00	
UKT 6.0% 12/07/28	2,010,000.00	2,184,884.07	

イギリスポンド 小計		115,500,000.00	98,083,316.39 (18,757,453,426)	
スウェーデン クロナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,280,000.00	4,705,219.20	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,780,000.00	6,530,359.92	
	SGB 0.75% 11/12/29	6,770,000.00	6,411,596.20	
	SGB 1.75% 11/11/33	4,610,000.00	4,532,571.75	
	SGB 1% 11/12/26	7,570,000.00	7,433,454.30	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,426,517.36	
	SGB 3.5% 03/30/39	3,970,000.00	4,642,716.50	
スウェーデンクロナ 小計		40,280,000.00	39,682,435.23 (563,887,404)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,780,000.00	4,185,941.60	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,690,494.22	
	NGB 1.5% 02/19/26	5,320,000.00	5,164,190.48	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,630,000.00	4,468,256.73	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,100,000.00	3,827,555.00	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,730,000.00	3,443,452.07	
	NGB 2% 04/26/28	4,150,000.00	3,986,573.00	
	NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,897,134.90	
	NGB 3.625% 04/13/34	3,310,000.00	3,380,668.50	
	NGB 3% 08/15/33	5,180,000.00	5,056,198.00	
ノルウェークローネ 小計		42,260,000.00	40,100,464.50 (553,386,410)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,940,000.00	3,333,002.29	
	DGB 0.5% 11/15/27	4,990,000.00	4,741,475.54	
	DGB 0.5% 11/15/29	5,290,000.00	4,874,378.29	
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,633,651.12	
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,508,047.22	
	DGB 2.25% 11/15/26	1,920,000.00	1,921,319.04	
	DGB 2.25% 11/15/33	3,880,000.00	3,892,962.28	
	DGB 4.5% 11/15/39	9,470,000.00	11,921,202.48	
デンマーククローネ 小計		44,590,000.00	42,826,038.26 (925,470,686)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	4,500,000.00	4,084,931.25	
	POLGB 0% 10/25/25	1,480,000.00	1,408,408.32	
	POLGB 1.25% 10/25/30	3,900,000.00	3,113,095.05	
	POLGB 1.75% 04/25/32	4,610,000.00	3,614,719.44	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,695,662.16	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,530,000.00	4,241,210.23	
	POLGB 2.75% 04/25/28	4,250,000.00	3,946,457.55	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,386,125.00	
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,110,000.00	2,048,802.61	
	POLGB 4.75% 07/25/29	1,650,000.00	1,627,986.15	

	POLGB 5.75% 04/25/29	4,640,000.00	4,771,184.39	
	POLGB 5% 10/25/34	550,000.00	537,224.54	
	POLGB 6% 10/25/33	4,350,000.00	4,569,522.75	
	POLGB 7.5% 07/25/28	3,970,000.00	4,317,812.49	
ポーランドズロチ 小計		51,440,000.00	48,363,141.93 (1,820,785,240)	
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	1,980,000.00	1,896,840.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,390,000.00	2,246,289.30	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,770,000.00	2,298,933.80	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,850,000.00	2,470,123.50	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,860,000.00	1,078,428.00	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,000,000.00	1,706,380.00	
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,296,252.20	
	ACGB 1% 12/21/30	1,500,000.00	1,274,310.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,730,000.00	1,654,883.40	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,203,180.20	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,091,996.50	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,680,000.00	1,503,247.20	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,530,000.00	1,495,605.60	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,610,565.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,780,000.00	1,709,031.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,110,000.00	2,082,802.10	
	ACGB 3.25% 06/21/39	940,000.00	847,015.20	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,690,000.00	1,628,754.40	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,440,000.00	1,400,947.20	
	ACGB 3.75% 05/21/34	2,340,000.00	2,310,469.20	
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,079,406.00	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,714,088.80	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,770,000.00	1,787,664.60	
	ACGB 4.25% 06/21/34	750,000.00	771,150.00	
	ACGB 4.25% 12/21/35	940,000.00	963,988.80	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,720,000.00	2,848,003.20	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,160,000.00	2,227,219.20	
	ACGB 4.75% 06/21/54	720,000.00	755,733.60	
オーストラリアドル 小計		50,950,000.00	46,953,308.60 (4,597,667,978)	
ニュージ ーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	1,340,000.00	1,176,799.34	
	NZGB 0.5% 05/15/26	730,000.00	687,687.44	
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	852,983.20	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	308,560.60	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	528,339.58	
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	426,985.07	

	NZGB 2% 05/15/32	900,000.00	775,117.58	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,320,000.00	1,254,985.80	
	NZGB 3% 04/20/29	940,000.00	907,074.59	
	NZGB 4.25% 05/15/34	750,000.00	751,432.87	
	NZGB 4.5% 04/15/27	930,000.00	945,782.56	
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	504,629.53	
	NZGB 4.5% 05/15/35	440,000.00	448,030.35	
	NZGB 5% 05/15/54	380,000.00	399,819.28	
ニュージーランドドル 小計		10,910,000.00	9,968,227.79 (898,436,370)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	768,494.84	
	SIGB 1.25% 11/01/26	870,000.00	844,800.45	
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	523,322.21	
	SIGB 1.875% 03/01/50	730,000.00	602,980.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	343,938.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	830,000.00	821,978.96	
	SIGB 2.25% 08/01/36	760,000.00	722,380.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	380,000.00	361,830.30	
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	719,640.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	460,000.00	457,240.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	820,000.00	810,471.60	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	623,700.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	990,000.00	999,900.00	
	SIGB 2.875% 08/01/28	140,000.00	141,266.31	
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	422,814.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	840,000.00	850,080.00	
	SIGB 3.25% 06/01/54	210,000.00	227,473.42	
	SIGB 3.375% 05/01/34	160,000.00	168,964.48	
	SIGB 3.375% 09/01/33	880,000.00	925,584.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	755,517.80	
	SIGB 3% 04/01/29	150,000.00	152,319.75	
	SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	510,428.78	
シンガポールドル 小計		12,990,000.00	12,755,124.90 (1,413,778,043)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,547,872.42	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,516,627.39	
	MGS 3.519% 04/20/28	710,000.00	712,475.20	
	MGS 3.582% 07/15/32	1,310,000.00	1,294,496.46	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,959,872.22	
	MGS 3.757% 05/22/40	2,950,000.00	2,875,876.02	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,781,117.37	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,830,000.00	1,837,114.30	
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,199,310.27	

	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,145,870.39	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,002,242.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,504,857.62	
	MGS 3.906% 07/15/26	1,210,000.00	1,224,687.70	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,704,252.78	
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	3,034,072.25	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,568,474.34	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,818,409.25	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,340,000.00	2,384,235.36	
	MGS 4.457% 03/31/53	1,090,000.00	1,141,465.11	
	MGS 4.498% 04/15/30	3,070,000.00	3,210,589.42	
	MGS 4.504% 04/30/29	720,000.00	750,928.60	
	MGS 4.642% 11/07/33	2,010,000.00	2,144,610.49	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,970,000.00	2,141,062.38	
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,071,202.91	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	3,019,617.93	
	MGS 4.893% 06/08/38	2,130,000.00	2,345,541.93	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,883,452.03	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,150,547.90	
マレーシアリンギット 小計		52,400,000.00	53,970,882.04 (1,792,453,948)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,510,000.00	1,430,227.45	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	2,970,000.00	2,340,140.22	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,880,000.00	1,958,522.39	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	3,450,000.00	3,370,980.84	
	ILGOV 1% 03/31/30	3,530,000.00	2,929,689.61	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,484,434.43	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	1,520,000.00	976,119.96	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,530,000.00	2,389,536.42	
	ILGOV 3.75% 02/28/29	2,690,000.00	2,613,480.52	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,570,000.00	2,098,762.23	
	ILGOV 3.75% 09/30/27	770,000.00	756,595.14	
	ILGOV 4% 03/30/35	1,210,000.00	1,132,150.53	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	1,979,557.65	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,394,722.51	
イスラエルシェケル 小計		31,550,000.00	27,854,919.90 (1,092,893,353)	
オフショア 人民元	CGB 1.67% 06/15/26	34,680,000.00	34,753,705.40	
	CGB 1.85% 05/15/27	2,400,000.00	2,409,071.04	
	CGB 1.99% 03/15/26	25,520,000.00	25,677,318.04	
	CGB 2.04% 02/25/27	41,310,000.00	41,604,511.38	
	CGB 2.05% 04/15/29	36,880,000.00	37,111,303.98	
	CGB 2.12% 06/25/31	14,000,000.00	14,021,879.20	

CGB 2.18% 08/15/26	28,600,000.00	28,887,981.98	
CGB 2.18% 08/25/25	17,100,000.00	17,197,387.92	
CGB 2.22% 09/25/25	32,270,000.00	32,490,346.01	
CGB 2.27% 05/25/34	19,000,000.00	19,136,326.90	
CGB 2.28% 03/25/31	29,700,000.00	30,039,295.77	
CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,471,672.16	
CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,620,506.81	
CGB 2.33% 12/15/25	35,250,000.00	35,592,548.92	
CGB 2.35% 02/25/34	19,880,000.00	20,166,236.21	
CGB 2.37% 01/15/29	19,460,000.00	19,835,790.11	
CGB 2.37% 01/20/27	43,880,000.00	44,522,324.21	
CGB 2.39% 11/15/26	42,750,000.00	43,360,213.50	
CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	43,385,173.90	
CGB 2.44% 10/15/27	17,700,000.00	18,038,163.81	
CGB 2.46% 02/15/26	29,300,000.00	29,637,459.82	
CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,371,710.00	
CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	27,117,654.05	
CGB 2.5% 07/25/27	26,760,000.00	27,326,651.02	
CGB 2.52% 08/25/33	58,370,000.00	60,018,608.11	
CGB 2.54% 12/25/30	30,500,000.00	31,373,294.30	
CGB 2.55% 10/15/28	27,250,000.00	27,954,537.85	
CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	33,143,779.96	
CGB 2.6% 09/15/30	30,500,000.00	31,455,653.45	
CGB 2.62% 04/15/28	34,000,000.00	34,883,785.79	
CGB 2.62% 06/25/30	36,400,000.00	37,566,117.68	
CGB 2.62% 09/25/29	20,940,000.00	21,603,494.37	
CGB 2.64% 01/15/28	38,220,000.00	39,198,393.78	
CGB 2.67% 05/25/33	34,280,000.00	35,656,818.49	
CGB 2.67% 11/25/33	23,400,000.00	24,362,268.84	
CGB 2.68% 05/21/30	30,700,000.00	31,777,388.87	
CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,546,425.78	
CGB 2.69% 08/15/32	19,420,000.00	20,208,824.86	
CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	15,134,235.80	
CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	26,447,256.55	
CGB 2.76% 05/15/32	13,150,000.00	13,742,692.85	
CGB 2.79% 12/15/29	30,300,000.00	31,538,730.66	
CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,969,300.09	
CGB 2.8% 03/25/30	39,490,000.00	41,106,546.84	
CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,827,642.04	
CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	31,942,942.93	
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,954,363.79	
CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	25,512,742.52	

	CGB 2.91% 10/14/28	24,320,000.00	25,315,904.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	13,113,478.35	
	CGB 3.02% 05/27/31	27,560,000.00	29,247,683.44	
	CGB 3.02% 10/22/25	49,870,000.00	50,737,872.64	
	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,220,225.12	
	CGB 3.12% 10/25/52	12,970,000.00	14,835,695.59	
	CGB 3.19% 04/15/53	18,360,000.00	21,292,215.01	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,371,171.29	
	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,838,155.01	
	CGB 3.29% 05/23/29	35,000,000.00	37,334,790.50	
	CGB 3.32% 04/15/52	18,600,000.00	21,972,447.84	
	CGB 3.39% 03/16/50	20,930,000.00	24,802,160.92	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	10,197,171.97	
	CGB 3.72% 04/12/51	15,140,000.00	19,006,098.92	
	CGB 3.81% 09/14/50	21,220,000.00	26,943,519.93	
	CGB 3.86% 07/22/49	18,180,000.00	23,107,118.14	
	CGB 3% 10/15/53	9,330,000.00	10,477,667.43	
	CGB 4.08% 10/22/48	19,370,000.00	25,284,526.83	
	オフショア人民元 小計	1,700,500,000.00	1,774,798,981.27 (35,920,334,061)	
合計			346,616,475,370 (346,616,475,370)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 216銘柄	100.0%	47.1%
カナダドル	国債証券 40銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 368銘柄	100.0%	30.5%
イギリスポンド	国債証券 61銘柄	100.0%	5.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 28銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券 22銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.3%

オフショア人民元	国債証券 66銘柄	100.0%	10.4%
----------	-----------	--------	-------

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	923,181,069
コール・ローン	1,572,015,418
国債証券	144,416,921,627
派生商品評価勘定	4,936,946
未収入金	1,819,638
未収利息	2,159,817,301
前払費用	307,457,879
流動資産合計	149,386,149,878
資産合計	149,386,149,878
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,490,916
未払金	83,700
未払解約金	25,322,073
流動負債合計	41,896,689
負債合計	41,896,689
純資産の部	
元本等	
元本	66,300,238,224
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	83,044,014,965
元本等合計	149,344,253,189
純資産合計	149,344,253,189
負債純資産合計	149,386,149,878

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月28日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。

	2024年 8月28日現在
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 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,300,238,224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 2.2525円 (1万口当たり純資産額) (22,525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 8月28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 8月28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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月29日
期首元本額	54,247,656,525円
期中追加設定元本額	14,213,445,115円
期中一部解約元本額	2,160,863,416円
期末元本額	66,300,238,224円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,840,582,241円
世界経済インデックスファンド	25,437,190,652円
DC新興国債券インデックス・オープン	6,013,451,617円
DC世界経済インデックスファンド	15,802,538,931円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	5,425,176円
分散投資コア戦略ファンドA	659,901,660円
分散投資コア戦略ファンドS	1,245,545,457円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	836,615,711円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,691,218,272円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	233,058,980円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	108,783,959円
SMT インデックスバランス・オープン	170,326,795円
SMT 世界経済インデックス・オープン	534,135,546円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	803,728,605円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,201,768,178円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	14,845,583円
グローバル経済コア	1,203,961,139円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	130,440,000円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	117,871,728円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	50,606,164円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	61,632,735円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	329,462,483円
10資産分散投資ファンド	57,258,301円
グローバル10資産バランスファンド	50,757,741円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	287,553,207円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	164,897,359円
SMT AM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	217,762,217円
SMT AM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	230,117,229円
SMT AM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	229,126,290円
SMT AM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	212,611,355円
SMT AM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	210,503,600円
SMT AM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	146,559,313円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,649,422,562
合計	3,649,422,562

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

(2024年 8月28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	2,006,676,079	—	1,995,122,109	△11,553,970
	メキシコペソ	298,164,231	—	286,661,752	△11,502,479
	チェココルナ	181,525,240	—	182,048,979	523,739
	ハンガリーフォリント	92,946,426	—	92,937,943	△8,483
	ポーランドズロチ	245,481,340	—	245,603,160	121,820
	マレーシアリンギット	316,415,271	—	316,453,248	37,977
	タイバーツ	294,707,750	—	295,932,892	1,225,142
	南アフリカランド	270,889,065	—	271,634,041	744,976
	オフショア人民元	306,546,756	—	303,850,094	△2,696,662
合計		2,006,676,079	—	1,995,122,109	△11,553,970

(注)時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	38,800,000.00	40,060,440.89	
		MBONO 5.5% 03/04/27	210,000,000.00	191,184,718.20	
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	164,602,424.43	
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	55,955,702.37	
		MBONO 7.5% 05/26/33	154,000,000.00	135,492,280.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	132,234,507.21	
		MBONO 7.75% 05/29/31	210,800,000.00	192,875,762.42	
		MBONO 7.75% 11/13/42	133,000,000.00	109,430,780.06	
		MBONO 7.75% 11/23/34	92,100,000.00	81,453,370.78	
		MBONO 7% 09/03/26	132,600,000.00	125,589,438.00	
		MBONO 8.5% 03/01/29	146,000,000.00	140,771,740.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000.00	134,487,358.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	88,940,391.05	
		MBONO 8% 05/24/35	20,000,000.00	17,572,200.00	
		MBONO 8% 07/31/53	118,500,000.00	97,571,339.35	
		MBONO 8% 11/07/47	175,700,000.00	146,064,189.04	

メキシコペソ 小計		2,041,200,000.00	1,854,286,641.80 (13,543,153,345)	
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/26	86,500,000.00	74,702,444.92	
	BLTN 0% 01/01/28	58,400,000.00	40,584,048.07	
	BLTN 0% 01/01/30	20,200,000.00	11,213,397.94	
	BLTN 0% 07/01/25	68,000,000.00	62,182,130.11	
	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000.00	63,875,001.84	
	BLTN 0% 07/01/27	64,500,000.00	47,424,918.22	
	BNTNF 10% 01/01/27	68,300,000.00	66,341,582.67	
	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000.00	48,816,596.78	
	BNTNF 10% 01/01/31	33,850,000.00	31,487,956.70	
	BNTNF 10% 01/01/33	28,900,000.00	26,554,521.57	
	BNTNF 10% 01/01/35	8,000,000.00	7,261,614.05	
ブラジルレアル 小計		566,050,000.00	480,444,212.87 (12,577,308,826)	
チリペソ	BTPCL 0% 04/01/29	1,700,000,000.00	1,347,233,000.00	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	1,985,000,000.00	1,958,641,647.50	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	2,160,000,000.00	2,135,501,753.04	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,290,000,000.00	2,185,969,692.22	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,360,000,000.00	2,270,354,965.76	
	BTPCL 5% 10/01/28	840,000,000.00	821,504,561.64	
	BTPCL 6.2% 10/01/40	1,400,000,000.00	1,499,225,757.40	
	BTPCL 6% 01/01/43	2,000,000,000.00	2,119,431,506.00	
	BTPCL 6% 04/01/33	2,550,000,000.00	2,636,155,317.45	
	BTPCL 7% 05/01/34	620,000,000.00	687,547,339.64	
チリペソ 小計		17,905,000,000.00	17,661,565,540.65 (2,806,546,395)	
コロンビアペソ	COLTES 13.25% 02/09/33	12,000,000,000.00	14,207,250,240.00	
	COLTES 5.75% 11/03/27	25,000,000,000.00	22,891,379,750.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	33,000,000,000.00	32,621,985,330.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	51,600,000,000.00	42,714,681,756.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000.00	37,084,289,041.10	
	COLTES 7.75% 09/18/30	7,000,000,000.00	6,475,596,190.00	
	COLTES 7% 03/26/31	10,700,000,000.00	9,423,604,169.00	
	COLTES 7% 06/30/32	10,000,000,000.00	8,517,880,800.00	
	COLTES 9.25% 05/28/42	3,000,000,000.00	2,637,166,680.00	
コロンビアペソ 小計		206,410,000,000.00	176,573,833,956.10 (6,306,157,905)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	6,950,000.00	5,890,706.36	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	9,250,000.00	8,468,047.18	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	10,400,000.00	10,685,471.36	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	11,300,000.00	11,250,508.48	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	1,750,000.00	1,827,044.03	

	PERUGB 6.9% 08/12/37	11,050,000.00	11,091,693.52	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	12,100,000.00	12,773,275.46	
	PERUGB 7.3% 08/12/33	9,800,000.00	10,393,591.19	
	PERUGB 7.6% 08/12/39	4,100,000.00	4,351,962.58	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,450,000.00	2,597,323.79	
ペルーソル 小計		79,150,000.00	79,329,623.95 (3,060,171,975)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	23,412,500.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,722,413.63	
	URUGUA 9.75% 07/20/33	40,000,000.00	40,400,000.00	
ウルグアイペソ 小計		82,000,000.00	80,534,913.63 (288,548,542)	
ドミニカペ ソ	DOMREP 10.75% 06/01/36	70,000,000.00	73,307,500.00	
	DOMREP 11.25% 09/15/35	40,000,000.00	43,224,729.60	
	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	38,314,727.04	
ドミニカペソ 小計		142,000,000.00	154,846,956.64 (374,311,548)	
チェココ ルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	41,100,000.00	34,313,362.50	
	CZGB 0.25% 02/10/27	95,200,000.00	87,987,529.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	108,900,000.00	94,092,213.60	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	84,140,350.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	34,700,000.00	24,648,841.37	
	CZGB 1.75% 06/23/32	102,500,000.00	88,879,390.00	
	CZGB 1.95% 07/30/37	29,000,000.00	23,136,925.00	
	CZGB 1% 06/26/26	68,800,000.00	65,732,724.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	74,883,651.20	
	CZGB 2.5% 08/25/28	98,700,000.00	94,941,010.50	
	CZGB 2.75% 07/23/29	100,500,000.00	96,841,573.87	
	CZGB 2% 10/13/33	102,500,000.00	88,485,687.50	
	CZGB 3.5% 05/30/35	57,000,000.00	55,076,178.75	
	CZGB 3% 03/03/33	28,000,000.00	26,349,960.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	45,000,000.00	46,267,569.00	
	CZGB 4.5% 11/11/32	25,000,000.00	26,291,100.00	
	CZGB 4.9% 04/14/34	47,500,000.00	51,512,800.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	69,000,000.00	74,385,015.30	
	CZGB 5.75% 03/29/29	18,000,000.00	19,680,750.00	
	CZGB 5% 09/30/30	80,000,000.00	86,128,200.00	
	CZGB 6.2% 06/16/31	27,000,000.00	31,157,797.50	
	CZGB 6% 02/26/26	68,000,000.00	70,508,758.00	
チェココルナ 小計		1,420,100,000.00	1,345,441,387.09 (8,674,464,254)	
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	569,788,807.50	

	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	472,471,483.08	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	787,974,261.25	
	HGB 2.25% 04/20/33	872,000,000.00	653,859,930.64	
	HGB 2.25% 06/22/34	291,000,000.00	208,486,950.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	685,500,000.00	639,671,205.97	
	HGB 2% 05/23/29	733,000,000.00	618,929,807.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	1,042,000,000.00	877,959,138.30	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	244,804,127.40	
	HGB 3% 08/21/30	835,000,000.00	715,992,084.25	
	HGB 3% 10/27/27	932,000,000.00	856,460,812.84	
	HGB 3% 10/27/38	580,000,000.00	401,987,995.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	603,000,000.00	576,697,743.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	873,000,000.00	798,323,754.60	
	HGB 5.5% 06/24/25	900,000,000.00	899,066,808.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	790,871,877.90	
	HGB 7% 10/24/35	340,000,000.00	359,153,900.00	
	HGB 9.5% 10/21/26	230,000,000.00	246,136,800.00	
ハンガリーフォリント 小計		12,014,000,000.00	10,718,637,486.73 (4,399,303,976)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	21,500,000.00	19,516,893.75	
	POLGB 0.75% 04/25/25	17,300,000.00	16,952,974.97	
	POLGB 0% 10/25/25	15,200,000.00	14,464,734.19	
	POLGB 1.25% 10/25/30	22,800,000.00	18,199,632.60	
	POLGB 1.75% 04/25/32	22,700,000.00	17,799,160.80	
	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	20,411,755.92	
	POLGB 2.5% 07/25/27	23,700,000.00	22,189,113.15	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	19,500,143.25	
	POLGB 2.75% 10/25/29	38,900,000.00	34,920,043.75	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	22,901,903.75	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	20,488,026.15	
	POLGB 4.75% 07/25/29	13,400,000.00	13,221,220.95	
	POLGB 5% 10/25/34	6,600,000.00	6,446,694.54	
	POLGB 6% 10/25/33	32,400,000.00	34,035,066.00	
	POLGB 7.5% 07/25/28	28,500,000.00	30,996,890.70	
ポーランドズロチ 小計		329,450,000.00	312,044,254.47 (11,747,904,501)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	7,500,000.00	6,731,586.30	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	11,100,000.00	10,595,949.00	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	5,800,000.00	5,644,618.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	10,207,392.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,390,478.12	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,454,150.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,538,264.08	

	ROMGB 4.25% 04/28/36	6,600,000.00	5,340,324.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	10,200,000.00	8,805,285.45	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,621,204.50	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,321,271.56	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	7,300,000.00	7,237,172.62	
	ROMGB 5% 02/12/29	11,200,000.00	10,632,006.00	
	ROMGB 6.3% 04/25/29	5,500,000.00	5,494,925.37	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	9,600,000.00	9,633,024.00	
	ROMGB 7.1% 07/31/34	3,500,000.00	3,603,426.75	
	ROMGB 7.2% 05/31/27	5,800,000.00	5,942,887.06	
	ROMGB 7.2% 10/28/26	5,300,000.00	5,418,474.08	
	ROMGB 7.2% 10/30/33	5,300,000.00	5,511,646.49	
	ROMGB 7.35% 04/28/31	8,200,000.00	8,573,013.08	
	ROMGB 7.9% 02/24/38	6,100,000.00	6,738,944.50	
	ROMGB 8.25% 09/29/32	10,200,000.00	11,175,885.00	
	ROMGB 8.75% 10/30/28	7,500,000.00	8,149,412.25	
	ROMGB 8% 04/29/30	9,100,000.00	9,712,768.52	
	ルーマニアレイ 小計	183,900,000.00	179,474,108.73 (5,813,579,172)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	43,200,000.00	40,526,114.40	
	MGS 3.502% 05/31/27	17,650,000.00	17,727,465.85	
	MGS 3.582% 07/15/32	21,500,000.00	21,245,552.66	
	MGS 3.733% 06/15/28	43,000,000.00	43,438,397.90	
	MGS 3.757% 05/22/40	32,450,000.00	31,634,636.30	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,251,504.20	
	MGS 3.882% 03/14/25	6,200,000.00	6,226,047.44	
	MGS 3.885% 08/15/29	24,800,000.00	25,251,340.16	
	MGS 3.899% 11/16/27	25,500,000.00	25,917,345.75	
	MGS 3.9% 11/30/26	20,450,000.00	20,738,598.58	
	MGS 3.906% 07/15/26	24,600,000.00	24,898,609.56	
	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000.00	34,185,899.04	
	MGS 4.065% 06/15/50	13,750,000.00	13,589,085.81	
	MGS 4.254% 05/31/35	13,650,000.00	14,183,592.15	
	MGS 4.457% 03/31/53	7,500,000.00	7,854,117.75	
	MGS 4.504% 04/30/29	14,900,000.00	15,540,050.36	
	MGS 4.642% 11/07/33	14,000,000.00	14,937,585.60	
	MGS 4.696% 10/15/42	26,800,000.00	29,127,143.16	
	MGS 4.762% 04/07/37	18,500,000.00	20,094,579.75	
	MGS 4.893% 06/08/38	26,700,000.00	29,401,863.78	
	MGS 4.921% 07/06/48	11,400,000.00	12,780,567.36	
	マレーシアリンギット 小計	448,650,000.00	457,550,097.56 (15,195,925,065)	
タイバーツ	THAIGB 0.95% 06/17/25	172,200,000.00	170,448,870.64	

	THAIGB 1.585% 12/17/35	70,800,000.00	64,125,896.40	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	59,290,198.02	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	108,100,000.00	103,554,286.90	
	THAIGB 1% 06/17/27	203,000,000.00	196,520,457.21	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	202,841,878.17	
	THAIGB 2.25% 03/17/27	83,000,000.00	83,148,619.80	
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	142,404,913.00	
	THAIGB 2.4% 03/17/29	118,000,000.00	118,614,131.00	
	THAIGB 2.4% 11/17/27	11,000,000.00	11,076,995.60	
	THAIGB 2.65% 06/17/28	164,000,000.00	166,613,930.40	
	THAIGB 2.8% 06/17/34	118,000,000.00	120,872,438.60	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	98,184,432.32	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	103,505,618.10	
	THAIGB 2% 06/17/42	93,600,000.00	82,588,609.58	
	THAIGB 2% 12/17/31	123,000,000.00	119,637,013.95	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	158,661,963.19	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	157,000,000.00	167,217,622.80	
	THAIGB 3.39% 06/17/37	170,000,000.00	183,563,688.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	169,289,230.20	
	THAIGB 3.45% 06/17/43	151,000,000.00	162,390,730.30	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,500,000.00	147,438,809.70	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	196,704,018.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	107,587,808.88	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	188,500,000.00	210,759,625.70	
	タイバーツ 小計	3,272,300,000.00	3,347,041,786.46 (14,224,927,592)	
インドネシア アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,653,931,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	7,847,775,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	61,060,230,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000.00	107,417,320,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,845,120,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	37,800,000,000.00	36,627,822,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	115,000,000,000.00	113,312,950,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	26,100,000,000.00	25,452,198,000.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	100,500,000,000.00	100,627,635,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	75,500,000,000.00	75,296,905,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	53,000,000,000.00	53,019,610,000.00	
	INDOGB 6.625% 02/15/34	82,000,000,000.00	82,013,940,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,998,600,000.00	
	INDOGB 6.875% 04/15/29	49,000,000,000.00	49,690,655,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	24,000,000,000.00	24,881,280,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	62,800,000,000.00	64,766,896,000.00	

	INDOGB 7.125% 06/15/43	28,500,000,000.00	29,468,430,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	51,000,000,000.00	54,424,650,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	34,700,000,000.00	37,006,162,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	49,700,000,000.00	52,869,369,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,315,032,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	104,000,000,000.00	106,544,880,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	39,175,912,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	85,000,000,000.00	86,989,000,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	54,200,000,000.00	57,908,906,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	37,905,760,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,658,930,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	71,000,000,000.00	79,604,490,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	24,200,000,000.00	27,763,692,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	41,595,329,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	38,700,000,000.00	43,069,230,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,157,766,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,463,810,000.00	
インドネシアルピア 小計		1,573,800,000,000.00	1,619,434,215,000.00 (15,060,738,199)	
インドル ピー	IGB 5.77% 08/03/30	185,000,000.00	176,078,413.85	
	IGB 6.1% 07/12/31	150,000,000.00	144,192,823.50	
	IGB 6.99% 12/15/51	190,000,000.00	191,359,849.00	
	IGB 7.18% 07/24/37	110,000,000.00	113,099,778.00	
	IGB 7.18% 08/14/33	200,000,000.00	203,898,700.00	
	IGB 7.26% 08/22/32	170,000,000.00	174,611,794.00	
	IGB 7.36% 09/12/52	200,000,000.00	209,523,220.00	
	IGB 7.37% 10/23/28	140,000,000.00	142,792,608.00	
	IGB 7.38% 06/20/27	160,000,000.00	162,847,392.00	
	IGB 7.54% 05/23/36	130,000,000.00	136,709,638.00	
インドルピー 小計		1,635,000,000.00	1,655,114,216.35 (2,863,347,594)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	204,700,000.00	215,242,050.00	
	SAGB 11.625% 03/31/53	35,000,000.00	36,344,000.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	51,407,064.96	
	SAGB 6.5% 02/28/41	113,100,000.00	74,703,539.62	
	SAGB 7% 02/28/31	122,700,000.00	107,978,436.82	
	SAGB 8.25% 03/31/32	198,500,000.00	182,544,976.92	
	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000.00	122,089,315.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	90,240,998.40	
	SAGB 8.75% 02/28/48	188,700,000.00	151,309,613.92	
	SAGB 8.875% 02/28/35	230,000,000.00	206,448,494.50	
	SAGB 8% 01/31/30	210,100,000.00	200,477,409.49	
	SAGB 9% 01/31/40	187,300,000.00	157,900,455.50	

南アフリカランド 小計		1,820,000,000.00	1,596,686,355.13 (12,997,026,930)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,639,830.32	
	CGB 2.04% 02/25/27	26,000,000.00	26,185,361.80	
	CGB 2.18% 08/15/26	3,400,000.00	3,434,235.62	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,258,091.04	
	CGB 2.28% 03/25/31	13,000,000.00	13,148,513.30	
	CGB 2.3% 05/15/26	14,000,000.00	14,154,715.40	
	CGB 2.35% 02/25/34	8,400,000.00	8,520,944.88	
	CGB 2.39% 11/15/26	2,000,000.00	2,028,548.00	
	CGB 2.4% 07/15/28	10,000,000.00	10,181,923.00	
	CGB 2.44% 10/15/27	16,600,000.00	16,917,147.98	
	CGB 2.46% 02/15/26	21,600,000.00	21,848,775.84	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,500,361.70	
	CGB 2.48% 09/25/28	5,000,000.00	5,116,538.50	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,127,051.80	
	CGB 2.52% 08/25/33	15,700,000.00	16,143,432.37	
	CGB 2.54% 12/25/30	17,800,000.00	18,309,660.28	
	CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	17,476,751.37	
	CGB 2.62% 04/15/28	17,800,000.00	18,262,687.86	
	CGB 2.62% 06/25/30	5,500,000.00	5,676,199.10	
	CGB 2.62% 09/25/29	4,000,000.00	4,126,742.00	
	CGB 2.64% 01/15/28	16,200,000.00	16,614,703.80	
	CGB 2.67% 05/25/33	16,700,000.00	17,370,737.13	
	CGB 2.67% 11/25/33	7,300,000.00	7,600,194.98	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	28,258,068.93	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,196,482.00	
	CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	10,406,192.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	8,036,801.08	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	11,309,340.78	
	CGB 2.76% 05/15/32	13,000,000.00	13,585,932.10	
	CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,490,586.40	
	CGB 2.8% 03/24/29	19,000,000.00	19,732,092.80	
	CGB 2.8% 03/25/30	16,500,000.00	17,175,437.40	
	CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	10,389,925.26	
	CGB 2.85% 06/04/27	9,400,000.00	9,676,560.22	
	CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	18,196,022.76	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,430,480.80	
	CGB 2.91% 10/14/28	10,000,000.00	10,409,500.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,207,473.22	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	9,020,511.95	
	CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,427,039.71	
	CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,935,871.80	

	CGB 3.12% 10/25/52	5,600,000.00	6,405,543.20	
	CGB 3.12% 12/05/26	15,000,000.00	15,487,929.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,807,803.13	
	CGB 3.19% 04/15/53	6,200,000.00	7,190,181.54	
	CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,070,290.32	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,653,571.60	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,922,083.95	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,673,834.80	
	CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,200,574.32	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	15,147,257.86	
	CGB 3.32% 04/15/52	4,000,000.00	4,725,257.60	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	10,746,720.16	
	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	10,670,531.10	
	CGB 3.81% 09/14/50	14,800,000.00	18,791,898.92	
	CGB 3% 10/15/53	13,000,000.00	14,599,107.90	
	オフショア人民元 小計	683,100,000.00	715,620,052.68 (14,483,505,808)	
合計			144,416,921,627 (144,416,921,627)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.4%
ブラジルレアル	国債証券 11銘柄	100.0%	8.7%
チリペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	1.9%
コロンビアペソ	国債証券 9銘柄	100.0%	4.4%
ペルーソル	国債証券 10銘柄	100.0%	2.1%
ウルグアイペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.3%
チェココルナ	国債証券 22銘柄	100.0%	6.0%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	3.0%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	8.1%
ルーマニアレイ	国債証券 24銘柄	100.0%	4.0%
マレーシアリンギット	国債証券 21銘柄	100.0%	10.5%
タイバーツ	国債証券 25銘柄	100.0%	9.8%
インドネシアルピア	国債証券 33銘柄	100.0%	10.4%
インドルピー	国債証券 10銘柄	100.0%	2.0%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	9.0%
オフショア人民元	国債証券 56銘柄	100.0%	10.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

【純資産額計算書】

（2024年 9月30日現在）

I 資産総額	4,433,185,669円
II 負債総額	7,874,092円
III 純資産総額（I－II）	4,425,311,577円
IV 発行済口数	3,056,673,462口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.4478円
（1万口当たり純資産額）	（14,478円）

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

【純資産額計算書】

（2024年 9月30日現在）

I 資産総額	3,644,111,723円
II 負債総額	1,789,261円
III 純資産総額（I－II）	3,642,322,462円
IV 発行済口数	2,317,702,254口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.5715円
（1万口当たり純資産額）	（15,715円）

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

【純資産額計算書】

（2024年 9月30日現在）

I 資産総額	1,462,957,956円
II 負債総額	2,177,509円
III 純資産総額（I－II）	1,460,780,447円
IV 発行済口数	867,901,419口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.6831円
（1万口当たり純資産額）	（16,831円）

【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

【純資産額計算書】

（2024年 9月30日現在）

I 資産総額	1,701,264,149円
II 負債総額	2,419,776円
III 純資産総額（I－II）	1,698,844,373円
IV 発行済口数	939,755,561口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.8078円
（1万口当たり純資産額）	（18,078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

（2024年 9月30日現在）

I 資産総額	674,463,353,960円
II 負債総額	1,515,024,887円
III 純資産総額（I－II）	672,948,329,073円
IV 発行済口数	242,341,869,199口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.7769円
（1万口当たり純資産額）	（27,769円）

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

I 資産総額	767,381,193,586円
II 負債総額	862,707,918円
III 純資産総額（I－II）	766,518,485,668円
IV 発行済口数	117,167,283,618口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	6.5421円
（1万口当たり純資産額）	（65,421円）

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

I 資産総額	222,428,236,941円
II 負債総額	656,476,256円
III 純資産総額（I－II）	221,771,760,685円
IV 発行済口数	47,533,171,848口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	4.6656円
（1万口当たり純資産額）	（46,656円）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

I 資産総額	679,769,917,472円
II 負債総額	6,779,378,432円
III 純資産総額（I－II）	672,990,539,040円
IV 発行済口数	509,858,434,543口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3200円
（1万口当たり純資産額）	（13,200円）

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

(2024年 9月30日現在)

I 資産総額	81,923,595,347円
II 負債総額	65,913,005円
III 純資産総額（I－II）	81,857,682,342円
IV 発行済口数	97,372,689,722口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.8407円
（1万口当たり純資産額）	（8,407円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 9月30日現在)

I 資産総額	358,765,531,491円
II 負債総額	351,575,139円
III 純資産総額（I－II）	358,413,956,352円
IV 発行済口数	101,514,169,946口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	3.5307円
（1万口当たり純資産額）	（35,307円）

新興国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 9月30日現在)

I 資産総額	154,390,317,667円
II 負債総額	87,519,567円
III 純資産総額（I－II）	154,302,798,100円
IV 発行済口数	67,188,481,918口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.2966円
（1万口当たり純資産額）	（22,966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てします。）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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2024年 9月30日現在）

資本金の額 ：20億円

発行可能株式総数 ：12,000株

発行済株式総数 ：3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

取締役会を招集するには、各取締役に對して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手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

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。

[D0（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－D0－CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2024年11月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年 9月30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	532	15,497,778
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	60	209,691
単位型公社債投資信託	52	175,369
合計	644	15,882,839

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。
なお、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、当事業年度（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。

（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	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					
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、それぞれ発生の際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事実であり、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)				
其他有価証券	—	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)				
其他有価証券	—	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）

前事業年度（2020年6月1日～）					
ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	—	△6
	英ポンド		3,228	—	△81
	スイスフラン		20	—	△0
	香港ドル		83	—	△0
	ユーロ		21	—	△0
合計			5,082	—	△88

当事業年度（2024年3月31日）

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表
該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

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

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度109百万円、当事業年度122百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	58 百万円	63 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187 "	220 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	277 "	298 "
税務上の費用認識差額	412 "	256 "
繰延ヘッジ損益	225 "	472 "
その他	75 "	78 "
繰延税金資産 合計	1,236 "	1,390 "
繰延税金負債		

有価証券評価差額	△21	〃	△159	〃
その他	△32	〃	△35	〃
繰延税金負債 合計	△54	〃	△194	〃
繰延税金資産の純額	1,181	〃	1,196	〃

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

- 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。
- 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。
- 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〕

- 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。
- 地域ごとの情報
 - 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。
 - 有形固定資産
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,223百万円

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

- (ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- ① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
- ② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

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

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- ① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
- ② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

- (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2023年3月31日）

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

当事業年度（2024年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	—	—
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

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

2024年11月28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。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

- ①名称：三井住友信託銀行株式会社
- ②資本金の額：342,037百万円（2024年3月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2024年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

- ①名称：株式会社日本カストディ銀行
- ②設立年月日：2000年6月20日
- ③資本金の額：51,000百万円（2024年3月末日現在）
- ④事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- ⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年11月28日	有価証券届出書
2023年11月28日	有価証券報告書
2024年 5月28日	有価証券届出書
2024年 5月28日	半期報告書

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。

独立監査人の監査報告書

2024年11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
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 百瀬和政

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DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2023年8月29日から2024年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2024年8月28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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファン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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年11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
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 百瀬和政

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DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2023年8月29日から2024年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2024年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファン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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年11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
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2023年8月29日から2024年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2024年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファン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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年11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
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2023年8月29日から2024年8月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2024年8月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファン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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。