【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2026年10月9日提出
【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 小林　隆宏
【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
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）

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

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（※）とします。

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

（5）【申込手数料】

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

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

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

（6）【申込単位】

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

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

（７）【申込期間】

2026年10月10日から2027年 4月 9日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
＜申込みコース＞
「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資

コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

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

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

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

＜スイッチング＞

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

＜受付不可日＞に該当する場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

一般社団法人資産運用業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 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	ＭＭＦ ＭＲＦ ＥＴＦ	インデックス型 特殊型

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人資産運用業協会のホームページ（https://www.imaj.or.jp/）でもご覧いただけま

す。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

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

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

(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［独立した区分］

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

［補足分類］

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

記載があるものをいう。

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

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

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

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

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

［特殊型］

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

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

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

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

◆ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

＜ファンドの特色＞

1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

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

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

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

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

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

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

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

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

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

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

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

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

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

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

ポートフォリオ構築プロセス

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

投資割合の決定・見直し（年1回）

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

投資対象ファンドの決定・見直し(随時)

- STEP1 各資産の投資対象ファンドの特徴や運用パフォーマンス等を分析
- STEP2 ポートフォリオのリターン向上及びリスク低減を目的として、投資対象ファンドの組入れや入替え効果を検証
- STEP3 投資対象ファンドの組入れ・入替え効果の検証結果に基づき、ファンドの組入れ・入替えや投資割合を決定

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

定期的なリバランスの実施（年4回）

相対的に値上がりした資産の売却や値下がりした資産の購入を行うことなどにより、最適な投資割合からの乖離を修正

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

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

<(*)「コアラップ(切替型ワイド)」の切替機能のイメージ>

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

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

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

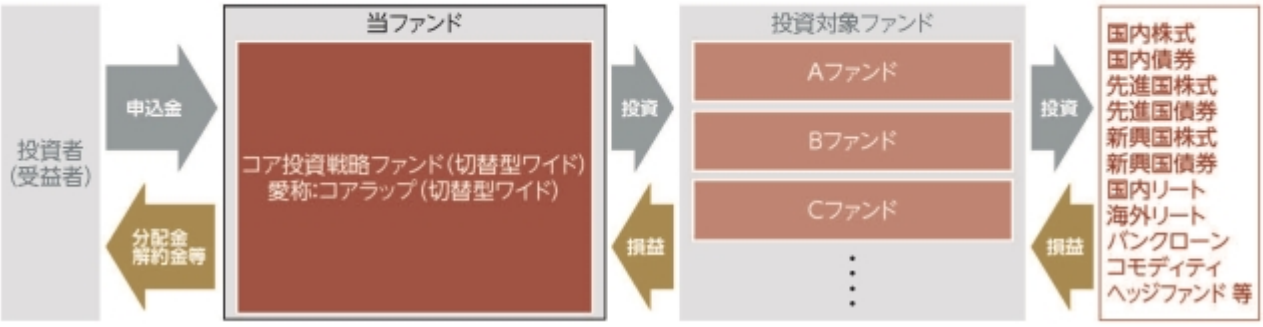
積極成長型ポートフォリオ
債券や高い収益が期待できる株式・新興国の資産などをバランスよく組み入れ、収益性を重視したポートフォリオ

コアラップ(切替型ワイド)
市場環境の変化を捉えた機動的な運用を行います。

※各ポートフォリオは適宜見直しを行います。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



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

ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

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

主な投資制限

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

〈ご参考情報〉

バンクローン

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

コモディティ

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

ヘッジファンド

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

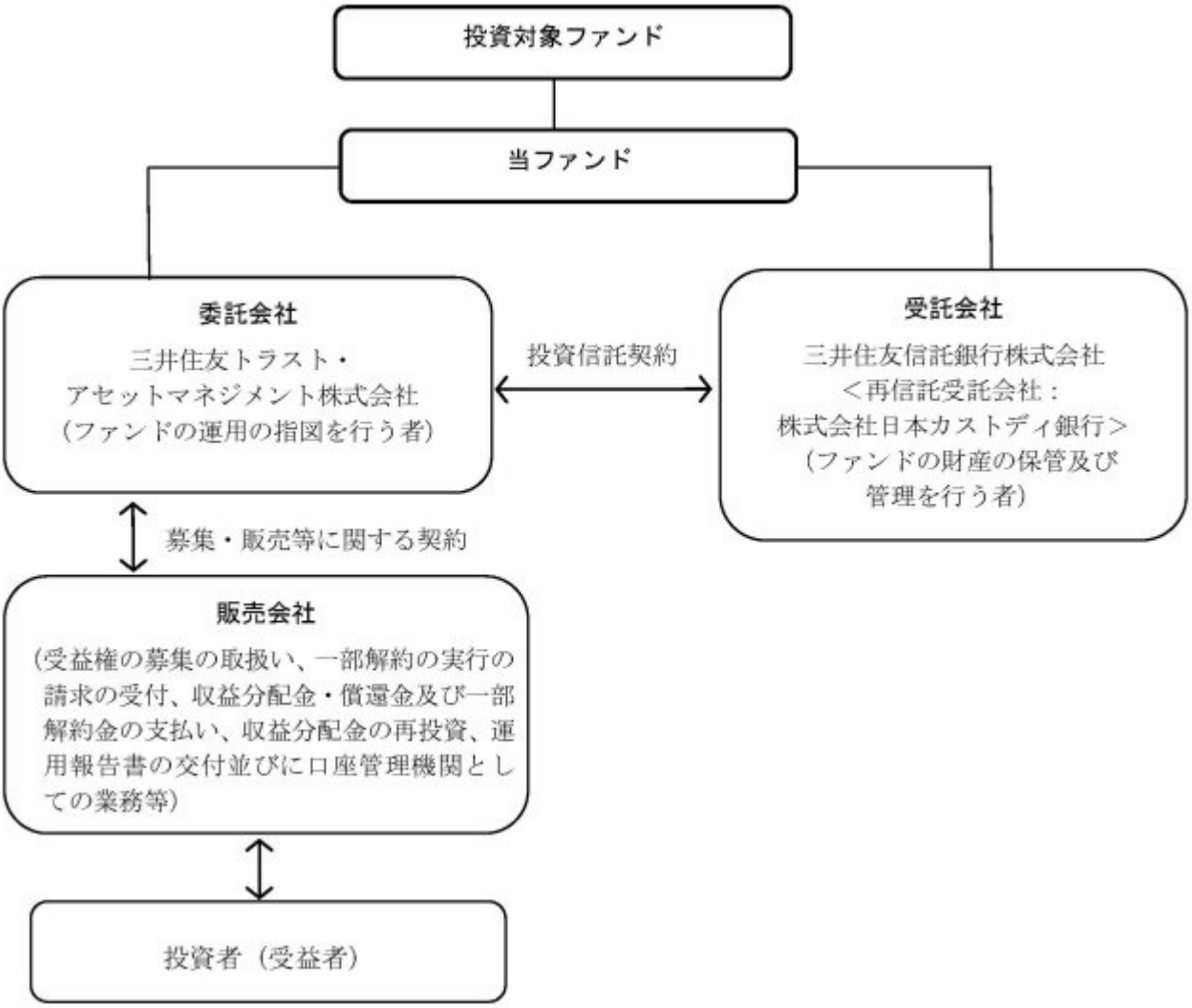
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2018年10月26日　　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2026年 7月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①基本方針

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

②投資対象

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

③投資態度

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

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

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

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

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

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90％未満とします。
なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

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

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

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

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. 金銭債権
3. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

②有価証券の指図範囲

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

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

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

③金融商品の指図範囲

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

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

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2026年7月31日（（★）のファンドに関しては2026年9月24日）現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。
なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

1.国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している株式
投資態度	①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。 ③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は、行いません。 ③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。 ⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1 項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

②ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みＴＯＰＩＸに係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
③ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の配当込みＴＯＰＩＸの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
④ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではない。
⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
⑦ＪＰＸは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みＴＯＰＩＸの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

2.日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）（※）に連動する投資成果を目指します。 ②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50％以下とします。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）
決算日	年1回：4月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年4月23日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

当ファンドは、MSCI Inc.（以下「MSCI」）、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者（総称して「MSCI当事者」）が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定的な投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使

用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害（逸失利益を含む）について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

3.日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	①個別企業分析に、市場動向分析を積極的に付加し、投資銘柄を厳選することにより、ベンチマークであるＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）（※）に対する超過リターンを目指します。 ②株式の組入比率は、原則として信託財産総額の90%以上とします。 ③信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑤信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑥信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ⑦信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑤同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑦同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑧一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：11月30日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2002年12月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

4.国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	アモーヴァ・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、長期的な観点からわが国の株式市場全体（ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）（※））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行ないません。 ④一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 ⑤デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜　0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広

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

5.日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。 ②信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。 ③事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。 ④投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。 ⑤ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。 ⑥市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ⑦株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。 ⑧デリバティブ取引等については、一般社団法人資産運用業協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑨一般社団法人資産運用業協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。 ②分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。 ③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜　0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

6.FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

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

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

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

7．ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本グロース株マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本の株式を主要投資対象とし、ＧＡＲＰ（Growth at a Reasonable Price）戦略に基づき、アクティブ運用することにより信託財産の成長を目指して運用を行います。 ②銘柄選定に関しては、ボトムアップ・アプローチによる定性分析とバリュエーション分析を重視し、組織運用による銘柄選定を行います。 ③ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)（※）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ④株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。 ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑥資金動向、市況動向、残存期間等およびやむを得ない事情が発生した場合は上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ④一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ②収益分配金額は、運用会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、運用会社の判断により分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については特に制限を定めず、運用会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

信託報酬	純資産総額に対して以下に定める率とします。 ・純資産総額200億円未満の部分 年率0.495%（税抜　0.45%） ・純資産総額200億円以上400億円未満の部分 年率0.44%（税抜　0.4%） ・純資産総額400億円以上の部分 年率0.385%（税抜　0.35%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2024年3月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

8．ＦＯＦｓ用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	アモーヴァ・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、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	国内株式エンハンスト運用戦略マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）（※）の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑤一般社団法人資産運用業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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
ベンチマーク	ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.374%（税抜　0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年1月30日
信託期間	2015年1月30日から2035年2月15日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

9.国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債

投資態度	①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。
主な投資制限	①同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は、行いません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

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

運用会社	マニュライフ・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてマニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。
投資態度	①マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 ②NOMURA-BPI総合（※）を参考指数として、ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 ③マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ④大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。
主な投資制限	①債券への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。 ⑤一般社団法人資産運用業協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑥デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 ⑦同一銘柄の株式、転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑧信用取引、空売り、有価証券の借入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。 ③留保益（収益分配に充てず信託財産内に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。
信託報酬	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り　　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.264% （税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.297% （税抜　0.27%） １%以上の場合　・・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.33% （税抜　0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

運用会社	明治安田アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	明治安田日本債券アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」ということがあります）受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	①主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等へ分散投資を行うとともに、国債先物取引、国債先物オプション取引、選択権付債券売買取引（国債店頭オプション取引）等を行い、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②NOMURA-BPI総合（※）をベンチマークとしてこれを中長期的に上回る投資成果を目指します。 ③信用リスクの低減を図るため、原則として取得時に信用ある格付会社によるBBB格相当以上の格付を有する公社債およびそれと同等の信用度を有すると判断した公社債に投資します。 ④債券市場は、長期的には経済のファンダメンタルズによって変動するという考えを基本としファンダメンタルズ分析を重視したアクティブ運用を行います。 ⑤マクロ経済分析をベースとした金利の方向性予測等に基づき、市況動向やリスク分散等を勘案して、デュレーションの調整、イールドカーブポジショニングのコントロールを行います。 ⑥デリバティブ取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への投資は行いません。 ⑧一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③収益分配金にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

信託報酬	純資産総額に対し、年率0.264%以内（税抜　0.24%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

12.ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドを主要投資対象とします。なお直接、公社債等への投資、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を行う場合があります。 ＜ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンドの主要投資対象＞ わが国の公社債を主要投資対象とします。 ＜ニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの主要投資対象＞ 主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用します。

投資態度	①ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドを通じて、主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用することで、安定したインカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行います。 ②NOMURA-BPI（総合）指数（※）をベンチマークとし、ベンチマークを中長期的に上回る投資成果の獲得をめざします。 ③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。 ④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンドの投資態度＞ ①NOMURA-BPI（総合）指数をベンチマークとします。 ②主としてわが国の公社債に投資し、債券種類別構成比の調整や社債の個別銘柄選択等、信用リスクの適切な管理を主な超過収益源として、上記ベンチマークを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。 ③公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜ニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの投資態度＞ ①主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用することで、安定したインカム収益の確保と信託財産の成長をめざした運用を行います。 ②組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。 ③資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債の転換及び新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。なお、ここでいう新株予約権とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権をいいます。 ②同一銘柄の転換社債及び転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑤外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。 ⑥デリバティブ取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑧一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	NOMURA-BPI（総合）指数
決算日	年1回：6月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。ただし、ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます。）等の全額とします。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。 ・純資産総額100億円以下の部分　年率0.275%（税抜　0.25%） ・純資産総額100億円超の部分　　年率0.253%（税抜　0.23%）
信託財産留保額	取得申込受付日及び解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.03%の率を乗じて得た額
設定日	2023年4月5日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

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

13．ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド(適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「年金日本債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債へ投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として次のような運用を行います。 ・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数（※）をベンチマークとし、デュレーション・コントロールを重視したアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。ただし、マザーファンド受益証券への投資には、制限を設けません。 ②株式への実質投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の10％以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ⑤デリバティブ取引等については、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。 ⑥一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合指数
決算日	年1回：1月27日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づいて分配金額を決定します。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の範囲内とします。 ②収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、運用会社が決定します。ただし、運用会社の判断により分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、運用会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	信託報酬率は、毎計算期間において、計算期間の開始日の属する月の前月最終営業日における日本相互証券株式会社が発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下に定める率とします。 新発10年固定利付国債の利回り（終値）　信託報酬率 2％未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.2035％（税抜　0.185％） 2％以上3％未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.2475％（税抜　0.225％） 3％以上4％未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.2915％（税抜　0.265％） 4％以上5％未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.3355％（税抜　0.305％） 5％以上の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.3795％（税抜　0.345％）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2023年4月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

14.外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	原則として、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)を構成している国の株式
投資態度	①原則としてＭＳＣＩコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。 ③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑧一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

15.外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

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

設定日	2021年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

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

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

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

16.ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

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

主要投資対象	ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	①ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）（※）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ⑤デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。 ⑥資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資を行います。 ②MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③マクロ分析に基づくトップダウンの投資判断と、ボトムアップの個別銘柄分析に基づく銘柄選択を合わせて、本源的価値に比べて割安と判断される銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。 ④外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ⑤デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。 ⑥運用の指図に関する権限を、ブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシーに委託します。 ⑦資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約券証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑤同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑨外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑩一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)
決算日	年1回：9月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則、毎決算時に分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。 ※分配金は、決算日から起算して５営業日以内に支払われます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.671%（税抜　0.61%） このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9月24日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

す。MSCI Inc.では、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

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

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

主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）及び外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的並びに価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑩一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7381%（税抜　0.671%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月7日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI KOKUSAI Index（配当込・税引後）」は、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く主

要先進国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託者が独自に円換算したものです。

18.世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

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

信託報酬	純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。 ・純資産総額100億円以下の部分 年率0.704%（税抜　0.64%） ・純資産総額100億円超、200億円以下の部分 年率0.649%（税抜　0.59%） ・純資産総額200億円超の部分 年率0.594%（税抜　0.54%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年12月16日
信託期間	2022年12月16日から2038年5月20日まで
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

19.ＧＩＭグローバル・セレクト株式ファンドＦＢ（適格機関投資家専用）

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

主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ③外貨建資産への投資割合は、制限を設けません。 ④有価証券についての有価証券関連デリバティブ取引および有価証券関連デリバティブ取引以外のデリバティブ取引の利用は、ヘッジ目的に限定します。
ベンチマーク	MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）
決算日	年1回：10月9日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	運用による収益は、期中に分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.55%（税抜　0.5%） その他の費用 ・ファンド監査にかかる費用として、信託財産の純資産総額に年0.022%（税抜0.02%）（上限）の率を乗じて得た額、または年間330万円（税抜300万円）のうちいずれか少ない額を当ファンドより支弁します。 ・財務諸表その他この信託の内容にかかる開示または報告を行う資料の印刷等にかかる費用、振替受益権の管理に関する費用、この信託にかかる計理事務にかかる費用等は、ファンドの純資産総額に委託者が合理的な基準により決定する一定の率（上限年率0.033%（税抜0.03%））を乗じた額をその費用の合計額とみなして、毎日信託財産に費用計上します。
信託財産留保額	解約申込受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2024年10月10日
信託期間	原則として無期限
運用の外部委託先	マザーファンドの運用の指図に関する権限を「Ｊ．Ｐ．モルガン・インベストメント・マネージメント・インク」に委託します。
受託会社	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

※「MSCIコクサイ指数」は、MSCI Inc.が発表しています。同インデックスに関する情報の確実性および完結性をMSCI Inc.は何ら保証するものではありません。著作権はMSCI Inc.に帰属しています。
「MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）」は、MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、米ドルベース）を運用会社にて円ベースに換算したものです。

20．ＳＭＤＡＭ／ドナルド・スミス・グローバル・ディープバリュー株式ファンド（適格機関投資家専用）（★）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「ドナルド・スミス　グローバル・ディープバリュー株式マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 世界の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、信託財産の中長期的な成長を目指します。 ・主として世界の取引所に上場している株式※のうち、企業の本源的価値に比べて極めて割安で投資魅力度が高いと判断される企業の株式に投資を行います。 ※不動産投資信託（ＲＥＩＴ）、預託証書（ＤＲ）等を含みます。 ・株式の組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として世界の取引所に上場している株式※のうち、企業の本源的価値に比べて極めて割安で投資魅力度が高いと判断される企業の株式に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 ※不動産投資信託（ＲＥＩＴ）、預託証書（ＤＲ）等を含みます。 ②運用にあたっては、運用委託契約に基づき運用の指図に関する権限の一部をドナルド・スミス・アンド・カンパニーに委託します。 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せん。 ④株式の組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。 ⑤資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：8月28日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、運用会社が収益分配方針に基づいて分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。 ※第１計算期間は、2026年9月24日から2027年8月30日までとします。
信託報酬	純資産総額に対して以下に定める率とします。 ・純資産総額300億円未満の部分 年率1.089%（税抜　0.99%） ・純資産総額300億円以上600億円未満の部分 年率1.034%（税抜　0.94%） ・純資産総額600億円以上の部分 年率0.979%（税抜　0.89%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2026年9月24日
信託期間	原則として無期限
受託会社	株式会社ＳＭＢＣ信託銀行

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

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

22.FI Institutional Global Developed Concentrated Equity Selection Fund JPY Class Shares (unhedged)

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

関係法人	・管理会社（マネージャー） Carne Global Fund Managers (Ireland) Limited ・投資顧問会社（インベストメントアドバイザー） Fisher Asset Management, LLC ・受託会社（トラスティ） State Street Fund Services (Ireland) Limited ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） State Street Fund Services (Ireland) Limited ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） State Street Fund Services (Ireland) Limited ・保管受託銀行（カストディ） State Street Custodial Services (Ireland) Limited

※「MSCIワールド・インデックス」は、先進市場の大型株および中型株の株式市場のパフォーマンスを測定するために設計された、浮動株調整時価総額加重指数です。2026年7月31日現在で、ベンチマークには次の23の先進市場国が含まれています：オーストラリア、オーストリア、ベルギー、カナダ、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、香港、アイルランド、イスラエル、イタリア、日本、オランダ、ニュージーランド、ノルウェー、ポルトガル、シンガポール、スペイン、スウェーデン、スイス、英国、米国。

23.世界債券総合インデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（※）（以下「ベンチマーク」ということがあります。）を構成する通貨建ての債券等（ベンチマークを構成する債券以外の証券等や上場投資信託証券を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてベンチマークを構成する通貨建ての債券等に投資し、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。 ②債券等への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：4月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.1%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2023年4月21日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

運用会社	フィデリティ投信株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行ないます。
主要投資対象	フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。
投資態度	①フィデリティ・外国債券・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、世界各国の投資適格債券（除く日本円）を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的として運用を行ないます。 ②実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行ないません。 ③資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
主な投資制限	①株式への実質的な直接投資は、原則として行ないません。ただし、転換社債の転換ならびに新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものを除きます。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑤一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月30日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。 ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行なうものではありません。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.451%（税抜0.41%）
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2021年7月16日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

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

運用会社	大和アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	L&Gグローバル総合債券（除く日本）マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、日本を除く世界の債券（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）に投資し、中長期的にベンチマーク（ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）（※））を上回る投資成果をめざします。 ＊マザーファンドにおいて、ETF（上場投資信託証券）を通じて債券に投資する場合があります。 ②マザーファンドの運用にあたっては、以下の方針を基本とします。 イ．原則として、投資する債券の格付けは、取得時においてBBB－格相当以上（格付けがない債券のうち、リーガル＆ジェネラル・インベストメント・マネジメント・リミテッドが同等の信用力があると判断するものを含みます。）とします。 ロ．投資成果の向上を図るため、債券および通貨にかかるデリバティブ取引ならびに為替取引をヘッジ目的以外でも行ないます。 ③マザーファンドの外貨建資産の運用にあたっては、リーガル＆ジェネラル・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。 ④マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ⑤為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 ⑥当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。 ⑦当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみに取得させることを目的とします。
主な投資制限	①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。 ②株式への実質投資割合には制限を設けません。 ③投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：4月15日（休業日の場合翌営業日）（第1期決算日は2026年4月15日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。 ②分配金額は、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.3498%（税抜0.318%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2025年4月11日

信託期間	原則として無期限
運用の委託先	名称：リーガル＆ジェネラル・インベストメント・マネジメント・リミテッド 所在の場所：英国　ロンドン 委託の内容：外貨建資産の運用に関する権限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「Bloomberg(R)」および「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」は、Bloomberg Finance L.P.、および同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、大和アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。
当ファンドについて、ブルームバーグは後援、支持、販売、または宣伝するものではありません。ブルームバーグは、一般的な証券への投資の推奨可能性または特に当ファンドへの投資の推奨可能性について、当ファンドの所有者もしくは相手先に、あるいは一般の人々に、明示、黙示を問わずいかなる表明、保証も行いません。大和アセットマネジメント株式会社とブルームバーグの唯一の関係は、特定の商標、商号、サービスマークの使用許諾、および「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」の使用許諾であり、これは、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドを考慮せずに、BISLが決定、構成、計算します。ブルームバーグは「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」を決定、構成、もしくは計算する際に、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドの所有者のニーズを考慮する義務はありません。ブルームバーグは当ファンドの発行時期、発行価格、発行数について責任を負わず、それに関与していません。ブルームバーグは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、当ファンドの顧客（これらに限定されません）に対し、いかなる義務、法的責任も負いません。
ブルームバーグは、「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」もしくはそれらに関連するデータの正確性および／または完全性を保証するものではなく、それに関連する過誤、不作為、または中断に対して一切の責任を負いません。ブルームバーグは、大和アセットマネジメント株式会社、当ファンドの所有者、もしくはその他の個人または法人が「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」、またはそれに関連するデータを使用したことで、獲得する結果について、明示的にも黙示的にもいかなる保証も行いません。ブルームバーグは、「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」もしくはそれらに関連するデータについて、特定の目的もしくは使用に対する商品性または適合性に関する明示的、黙示的な保証を行わず、あらゆる保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、法律で最大限に許される限り、ブルームバーグ、そのライセンサー、およびそれぞれの従業員、請負業者、エージェント、サプライヤー、ベンダーは、当ファンド、「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」またはそれらに関するデータまたは値について、過失、その他によるかにかかわらずその可能性について知らされていた場合でも、直接的、間接的、結果的、偶発的、懲罰的、またはそれ以外の被害または損害について法的責任もしくは責任を負いません。

26. Global Aggregate Bond Strategy Fund JPY W Class

投資運用会社	BNY Mellon Investment Management Japan Limited
運用の基本方針	安定したインカムの確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	世界各国の政府および非政府機関（民間企業等）が発行する債券等を主要投資対象とします。

投資態度	①主として世界各国の政府および非政府機関（民間企業等）が発行する債券等に投資します。投資適格の社債、新興国債券、資産担保証券、転換社債等を中心とし、ハイイールド債券やバンクローンなど非投資適格の資産にも一部投資します。また、債券先物等のデリバティブにも投資します。 ②金利戦略、クレジット戦略および通貨戦略を組み合わせることにより、ポートフォリオを構築します。 ③債券等への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります。）の空売りは行いません。 ②投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。 ③一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ④流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：1月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	・管理会社報酬および運用会社報酬：年率0.24%（上限） ・受託会社報酬：年率0.01%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00） ・管理事務代行会社報酬：年率0.07%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD25,000.00） ・保管受託銀行報酬：年率0.05%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00）
信託財産留保額	該当事項はありません。
その他の費用	投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等、デリバティブ取引に要する費用等、法律および税務顧問および監査人の報酬および費用、ファンドの財務およびその他の報告書、目論見書および類似書類の作成並びに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
設定日	2025年4月11日
信託期間	原則として無期限

関係法人	・管理会社 BNY Mellon International Management Limited ・投資運用会社 BNY Mellon Investment Management Japan Limited ・副投資運用会社 Insight Investment Management (Global) Limited ・受託会社 CIBC Caribbean Bank and Trust Company (Cayman) Limited ・管理事務代行会社 Nomura Bank (Luxembourg) S.A. ・保管受託銀行 Nomura Bank (Luxembourg) S.A.

27. PIMCO Global Bond Strategy Fund S(JPY) Class

投資顧問会社	Pacific Investment Management Company LLC
運用の基本方針	トータル・リターンの最大化を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として日本を除く世界の債券等*に投資します。 ＊投資可能な債券は、以下のものを含みます。 ・各国政府、その政府の部局または政府系機関が発行し、または保証した債券 ・社債 ・政府および企業が発行したインフレ連動債 ・仕組債 ・ローンおよびローン・パーティシペーション ・譲渡性銀行預金、定期預金および銀行引受手形 ・現先取引および逆現先取引 ・国際機関の債券 など
投資態度	①債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ②組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の90%以上とします。 ②投資する公社債は原則として取得時においてBBB－格相当以上の格付けを取得しているものに限ります。投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてAA－格相当以上に維持します。 ③平均デュレーションは、原則としてベンチマーク±2年の範囲で調整します。 ④同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、取得時において純資産総額の5%以内とします（国債や政府機関債等を除きます。）。 ⑤投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 ⑥投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。 ⑦流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円ベース）（※）

決算日	毎年6月30日
収益の分配	原則として分配は行いません。
信託報酬	年率0.4%（管理費用等込み）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年7月26日
関係法人	・管理会社（マネージャー） Pacific Investment Management Company LLC ・投資顧問会社（インベストメントアドバイザー） Pacific Investment Management Company LLC ・副投資顧問会社（サブ・インベストメントアドバイザー） 以下の関連会社に一部再委託しております。 PIMCO Australia Pty Ltd PIMCO Asia Limited PIMCO Asia Pte Ltd PIMCO Europe Ltd PIMCO Europe GmbH PIMCO Japan Ltd ・受託会社（トラスティ） Maples Trustee Services (Bermuda) Limited ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） Brown Brothers Harriman & Co. ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. ・保管受託銀行（カストディ） Brown Brothers Harriman & Co.

※「ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円ベース）」は、ブルームバーグが算出する世界の投資適格債券（円建てのものを除く）の値動きを表す指数を円換算したものです。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

28.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。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

29.J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下当マザーファンドにおいて「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。 ⑥一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

Ｘが有しています。

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

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

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

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

30.グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）のうち不動産投信指数を対象とする先物取引並びに外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下当マザーファンドにおいて「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑤一般社団法人資産運用業協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑥デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「S&P先進国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。
S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's ®及びS&P ®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones ®はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者又はいかなる一般人に対して、株式全般又は具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な

市場のパフォーマンスを追随するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示又は黙示を問わず、いかなる表明又は保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indices又はそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、及び商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社又は当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成又は計算において当社又は当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格又は数量、あるいは当ファンドの新規設定又は販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、又は償還される計算式の決定又は計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、又は取引に関して、いかなる義務又は責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追随する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、又はホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。
S&P Dow Jones Indicesは、当インデックス又はその関連データ、あるいは口頭又は書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、又は完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落又は中断に対して、いかなる義務又は責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的又は黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックス又はそれに関連するデータの商品性、特定の目的又は使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、又はその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間又は信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、又は派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、又は厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約又は取り決めの第三者受益者は存在しません。

31.グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

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

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

信託報酬	該当事項はありません。 主要投資対象である米ドル建て債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・米ドル建て債券の評価額に対して年率0.5%～0.8%程度（投資比率による加重平均）が発行・管理手数料等としてかかります。 ・ETF、ETN、米ドル建てMMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

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

32.ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 ＜別に定める金現物に投資する上場投資信託証券＞（2026年7月31日現在） iShares Gold Trust Micro SPDR Gold MiniShares Trust

投資態度	①主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 ②投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 ③投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

ベンチマーク	LBMA金価格（円ヘッジベース）（※）（2026年7月31日現在） ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※LBMA金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといいICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

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

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

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

管理会社	BlueBay Funds Management Company S.A.
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。
主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	①主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ②ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 ③債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。 ②投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年6月30日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011年5月24日
関係法人	・管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A. ・投資顧問会社 RBC Global Asset Management (UK) Limited ・副投資顧問会社 RBC Global Asset Management (U.S.) Inc. ・管理事務代行会社／名義書換事務受託会社／保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

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

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。 ※Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。 ②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%） 実質的に投資対象とする円建債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。 ・円建債券の連動対象となるPictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

35.コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてブルームバーグ商品指数（※）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」※１といいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※1この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。 ※2運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乗じる一定数は同値とします。
投資態度	①円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。 ②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。 主要投資対象である円建債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・円建債券の評価額に対して年率0.8％～1％程度（投資比率による加重平均）が発行・管理手数料等としてかかります。 ・円建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。

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

36.ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の円建短期公社債等を主要投資対象とし、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	①主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。 ②債券先物取引及び為替予約取引等は、原則として定量的手法に基づいた複数の運用戦略を組み合わせることで行います。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑤為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑥一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

37.MA Hedge Fund Strategies Limited

運用会社	O'Connor Alternative Investments, LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。

投資態度	①公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。 ②ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。 ③為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。
主な投資制限	①投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 ②投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。 ③一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ④流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%以下とします。 ⑤外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑥一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦投資信託証券への投資は行いません。 ⑧デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月31日（決算日が休日の場合は、前営業日となります。）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	運用報酬：年率0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
関係法人	・運用会社 O'Connor Alternative Investments, LLC ・保管銀行・管理事務代行会社 MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited

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

投資顧問会社	Graham Capital Management, L.P.
運用の基本方針	オルタナティブ運用手法を活用して投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物に投資します。

投資態度	・主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物で運用します。 ・トレーディング・アドバイザーの支援を受けて、各先物の市場の非効率性やトレンド等を収益機会として捕捉します。 ・各先物の収益機会の度合、ボラティリティ、流動性及び他先物との相関に係る評価等を鑑みて、各先物のロング・ショート戦略等によりポートフォリオを構築します。 ・資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	・先物での運用割合（想定元本ベース）は、投資信託財産の純資産総額の90%以上とします。 ・現物の空売りは行いません。 ・発行体の法的支配や経営権の取得を企図した有価証券の取得を行いません。 ・投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月の最終ファンド営業日
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	固定報酬：年率0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の12%
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年12月19日
信託期間	原則として無期限
関係法人	・管理会社（マネージャー） JTC Fund Solutions (Jersey) Limited ・投資顧問会社（トレーディング・アドバイザー） Graham Capital Management, L.P. ・副管理会社（サブ・マネージャー） Amundi Asset Management S.A.S ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） Societe Generale Securities Services France S.A. ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） CACEIS Bank, Luxembourg Branch ・保管受託銀行（カストディ） Societe Generale Securities Services

39.JPMorgan Funds - Europe Equity Absolute Alpha Fund Class I (perf) (acc) - JPY (hedged)

投資顧問会社	JPMorgan Asset Management (UK) Limited
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	欧州に本拠を置く、または欧州にて主な経済活動を行う企業の株式等

投資態度	①主として、直接またはデリバティブを活用して、欧州企業の株式の買建（ロングポジション）および売建（ショートポジション）を組み合わせることで、市場エクスポージャーを抑制しながら投資信託財産の成長を目指します。なお、小型株に投資することがあります。 ②ボトムアップ・アプローチを基本とし、ファンダメンタルズ分析と、定量的な分析を組み合わせることで、幅広いユニバースの中から銘柄選択を行います。 ③ロング・ショート戦略により、魅力的と判断した企業の株式を買い、魅力的でないと判断した企業の株式を空売りします。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①一発行会社に対する投資比率は、純資産総額の10%以下とします。 ②純資産総額の５%を超えて投資する発行体に対する投資比率の総計は、純資産総額の40%以下とします。
ベンチマーク	ICE BofA TONAR Overnight Rate Index（※）
決算日	年1回：6月30日
収益の分配	原則として分配を行ないません。
信託報酬	・運用報酬：年率0.75% ・管理報酬：年率上限0.16% ・成功報酬：15.0%
信託財産留保額	該当事項はありません。
その他の費用	組入有価証券の売買等取引にかかる費用および手数料等管理費用に含まれない費用が投資信託財産から支弁されることがあります。
設定日	2026年3月5日
信託期間	原則として無期限
関係法人	・管理会社 JPMorgan Asset Management (Europe) S.a r.l. ・投資顧問会社 JPMorgan Asset Management (UK) Limited ・管理事務代行会社 J P. Morgan SE, Luxembourg Branch ・名義書換事務受託会社 JPMorgan Asset Management (Europe) S.a r.l. ・保管受託銀行 J P. Morgan SE, Luxembourg Branch

※ICE BofA TONAR Overnight Rate Indexは、ICE Data Indices, LLC が公表しているものであり、著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は同社に帰属します。

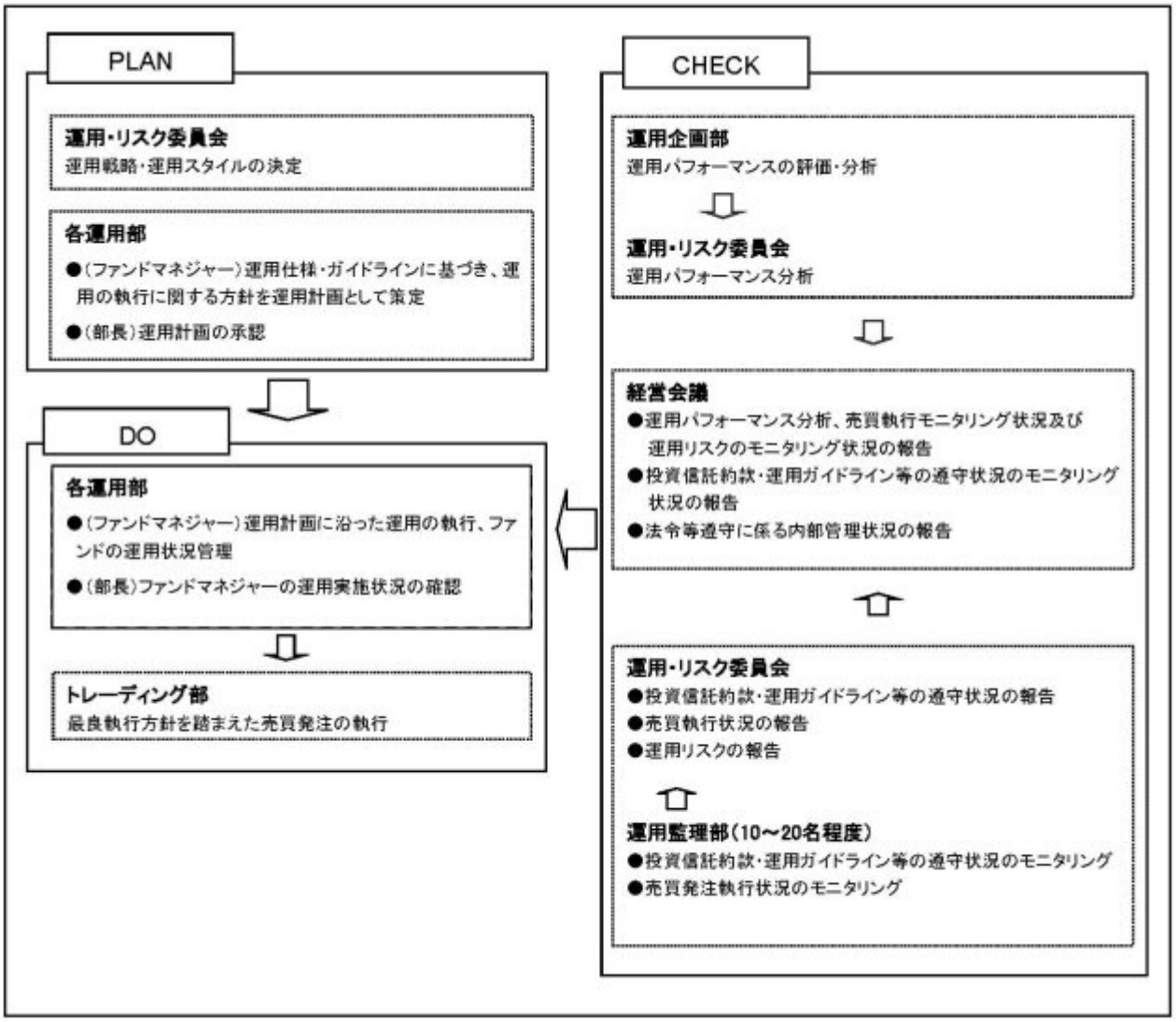
ICE BofA TONAR Overnight Rate Index SM/ (R) is a service/trade mark of ICE Data Indices, LLC or its affiliates (“ICE Data”) and has been licensed, along with the ICE BofA TONAR Overnight Rate Index (“Index”) for use by LICENSEE in connection with JPMorgan Funds - Europe Equity Absolute Alpha Fund-I (perf) (acc) - JPY (hedged) (the “Fund”). Neither the LICENSEE, J P. Morgan SE, Luxembourg Branch (the “Trust”) nor the Fund, as applicable, is sponsored, endorsed, sold or promoted by ICE Data. ICE Data makes no representations or warranties regarding the advisability of investing in securities generally, in the Fund particularly, the Trust or the ability of the Index to track general stock market performance.

ICE DATA AND ITS RESPECTIVE THIRD PARTY SUPPLIERS MAKE NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, AND HEREBY EX-PRESSLY DISCLAIMS ALL WARRANTIES OF MER-CHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE WITH RESPECT TO THE INDEX, INDEX VALUES OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. IN NO EVENT

SHALL ICE DATA HAVE ANY LIABILITY FOR ANY SPECIAL, PUNITIVE, DIRECT, INDIRECT, OR CONSEQUENTIAL DAMAGES (INCLUDING LOST PROFITS), EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES.

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。

・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．投資信託証券への投資割合
投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資
株式への直接投資は行いません。

ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合
同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ニ．外貨建資産への投資割合
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用
デリバティブの直接利用は行いません。

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

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

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

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

5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ヌ．一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

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

②金利変動リスク

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

③リートの価格変動リスク

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

④商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

⑤為替変動リスク

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

⑥信用リスク

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

⑦流動性リスク

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

⑧カントリーリスク

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

⑨資産等の選定・配分に係るリスク

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

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

⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

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

⑪仕組み債券に係るリスク

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

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市

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

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

⑫ブローカーの信用リスク

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

⑬有価証券の貸付等に係るリスク

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

⑭ESGの投資リスク

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

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

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

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

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

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

(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

*2021年8月～2026年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数)(配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、脱漏又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

①取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（税抜　3.0%）（※1）の率を上限として、販

売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

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

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

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

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

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

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

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

（２）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞
ありません。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率　1.518%（税抜1.38%）を乗じて得た額（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.968%　（税抜　0.88%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.495%　（税抜　0.45%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.055%　（税抜　0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

※2026年10月 9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%～43.45%（税抜27%～39.5%）、受託会社6.05%～19.8%（税抜5.5%～18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価、実質的に投資対象とする仕組み債券の発行・管理手数料等として、投資対象ファンドから支払われます。

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.517%　（税抜　0.47%）
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.7095%　（税抜　0.645%）
FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.495%　（税抜　0.45%）
ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	・純資産総額200億円未満の部分 年率0.495%（税抜　0.45%） ・純資産総額200億円以上400億円未満の部分 年率0.44%（税抜　0.4%） ・純資産総額400億円以上の部分 年率0.385%（税抜　0.35%）
ＦＯＦｓ用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率0.374%　（税抜　0.34%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。

マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・・・年率　0.264% （税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・・年率　0.297% （税抜　0.27%） １%以上の場合　・・・・・・・・・・年率　0.33% （税抜　0.3%）
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.264%以内　（税抜　0.24%以内）
ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	・純資産総額100億円以下の部分 年率0.275%（税抜　0.25%） ・純資産総額100億円超の部分 年率0.253%（税抜　0.23%）
ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	信託報酬率は、毎計算期間において、計算期間の開始日の属する月の前月最終営業日における日本相互証券株式会社が発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下に定める率とします。 新発10年固定利付国債の利回り（終値）　信託報酬率 2%未満の場合・・・・・・・・年率0.2035% （税抜　0.185%） 2%以上3%未満の場合・・・・年率0.2475% （税抜　0.225%） 3%以上4%未満の場合・・・・年率0.2915% （税抜　0.265%） 4%以上5%未満の場合・・・・年率0.3355% （税抜　0.305%） 5%以上の場合・・・・・・・・年率0.3795% （税抜　0.345%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.671%　（税抜　0.61%）
ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	年率　0.7381%　（税抜　0.671%）

世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	・純資産総額100億円以下の部分 年率0.704%（税抜　0.64%） ・純資産総額100億円超、200億円以下の部分 年率0.649%（税抜　0.59%） ・純資産総額200億円超の部分 年率0.594%（税抜　0.54%）
ＧＩＭグローバル・セレクト株式ファンドＦＢ（適格機関投資家専用）	年率　0.55%　（税抜　0.5%）
ＳＭＤＡＭ／ドナルド・スミス・グローバル・ディープバリュー株式ファンド（適格機関投資家専用）	・純資産総額300億円未満の部分 年率1.089%（税抜　0.99%） ・純資産総額300億円以上600億円未満の部分 年率1.034%（税抜　0.94%） ・純資産総額600億円以上の部分 年率0.979%（税抜　0.89%）
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率　0.525%
FI Institutional Global Developed Concentrated Equity Selection Fund JPY Class Shares （unhedged）	年率　0.7%（上限）
世界債券総合インデックスマザーファンド	ありません。
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.451%　（税抜　0.41%）
L&Gグローバル総合債券ファンド（除く日本）（FOFs用）（適格機関投資家専用）	年率　0.3498%　（税抜　0.318%）
Global Aggregate Bond Strategy Fund JPY W Class	・管理会社報酬および運用会社報酬：年率　0.24%（上限） ・受託会社報酬：年率0.01%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00） ・管理事務代行会社報酬：年率0.07%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD25,000.00） ・保管受託銀行報酬：年率0.05%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00）
PIMCO Global Bond Strategy Fund S(JPY) Class	年率　0.4%
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。 主要投資対象である米ドル建て債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・米ドル建て債券の評価額に対して年率0.5%～0.8%程度（投資比率による加重平均）が発行・管理手数料等としてかかります。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	年率　0.74%
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.066%（税抜　0.06%） 実質的に投資対象とする円建債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。 ・円建債券の連動対象となるPictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬がかかります。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ありません。 主要投資対象である円建債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・円建債券の評価額に対して年率0.8%～1%程度（投資比率による加重平均）が発行・管理手数料等としてかかります。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	ありません。
MA Hedge Fund Strategies Limited	運用報酬：年率　0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	固定報酬：年率　0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の12%

JPMorgan Funds - Europe Equity Absolute Alpha Fund Class I (perf) (acc) - JPY (hedged)	・運用報酬：年率0.75% ・管理報酬：年率上限0.16% ・成功報酬：15.0%

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（実質的に投資対象とする仕組み債券等に係る費用等を含みます。）の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況等により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては、別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。
◎実質的な信託報酬率：年率1.518%～2.395%程度（税抜　1.38%～2.25%程度）
（投資対象とする投資信託証券（ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券等に係る費用等を含みます。）：年率0.0%～0.877%程度（税抜　0.0%～0.87%程度））

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

（４）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※上記における役務提供の内容は以下の通りです。
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.495%（税抜0.45%）を乗じて得たものとします。
手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
①個人の受益者に対する課税
イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%、地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。
なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

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

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

②法人の受益者に対する課税
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。
なお、益金不算入制度の適用はありません。

③個別元本について
イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について
追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
受益者が収益分配金を受け取る際、
イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。ファンドは、NISAの対象ではありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は、2026年 7月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。
※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

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

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの経費率は以下の通りです。

経費率(①＋②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.87%	1.53%	0.34%

※対象期間は2025年7月11日～2026年7月10日です。
※対象期間中の運用･管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。
※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。
※投資先ファンドにかかる運用管理費用は、その他費用に含まれています。なお、運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれていません。
※ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。
※実質的に仕組み債券や上場投資信託証券等を組み入れた場合には、それぞれ固有の費用が内包されることがありますが、上記には含まれておりません。
※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、2026年7月31日現在の状況について記載してあります。

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	11,010,561,504	48.20
	ケイマン	196,471,022	0.86
	小計	11,207,032,526	49.06
投資証券	ルクセンブルク	1,936,924,050	8.48
	アイルランド	783,355,412	3.43
	ケイマン	271,541,706	1.19
	ジャージー	75,013,344	0.33
	小計	3,066,834,512	13.42
親投資信託受益証券	日本	8,368,230,585	36.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	202,638,045	0.89
合計(純資産総額)		22,844,735,668	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、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	投資信託受益証券	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	665,760,189	2.9532	1,966,122,990	2.9062	1,934,832,261	8.47
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	393,939,581	4.4008	1,733,649,308	4.3648	1,719,467,483	7.53
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	366,823.104	4,379	1,606,318,372	4,053	1,486,734,040	6.51
日本	親投資信託受益証券	グローバルＲＥＩＴインデックスマザーファンド	347,052,224	4.0232	1,396,260,507	4.0942	1,420,901,215	6.22

日本	投資信託受益証券	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	626,852,534	1.8697	1,172,026,182	1.8762	1,176,100,724	5.15
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	519,272,060	2.2527	1,169,813,476	2.2533	1,170,075,732	5.12
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	360,595,519	3.2299	1,164,687,466	3.1728	1,144,097,462	5.01
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	315,720,290	3.6737	1,159,861,629	3.565	1,125,542,833	4.93
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	206,882,381	4.1846	865,720,011	4.0309	833,922,189	3.65
アイルランド	投資証券	FI Institutional Global Developed Concentrated Equity Selection Fund JPY Class Shares (unhedged)	50,329.073	15,752.67	792,817,278	15,564.67	783,355,412	3.43
日本	投資信託受益証券	ＧＩＭグローバル・セレクト株式ファンドＦＢ（適格機関投資家専用）	59,121	13,069	772,652,349	13,182	779,333,022	3.41
日本	投資信託受益証券	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	883,191,041	0.8543	754,510,106	0.8592	758,837,742	3.32
日本	親投資信託受益証券	世界債券総合インデックスマザーファンド	547,766,407	1.3629	746,550,836	1.3504	739,703,756	3.24
日本	親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	284,450,348	2.3786	676,593,597	2.4286	690,816,115	3.02
日本	投資信託受益証券	明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	722,860,615	0.8558	618,624,114	0.8612	622,527,561	2.73
日本	投資信託受益証券	ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド（適格機関投資家専用）	704,260,412	0.8729	614,748,913	0.8773	617,847,659	2.70
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	544,059,998	0.8877	482,962,060	0.8982	488,674,690	2.14
日本	投資信託受益証券	ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	542,551,381	0.8782	476,468,622	0.8821	478,584,573	2.09
日本	投資信託受益証券	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	190,377,381	2.0864	397,203,367	2.21	420,734,012	1.84
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	40,590,185	9.9346	403,247,251	9.7944	397,556,507	1.74
日本	親投資信託受益証券	外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	156,604,457	2.5707	402,583,077	2.5330	396,679,089	1.74
日本	投資信託受益証券	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	270,480,103	1.3832	374,128,078	1.3913	376,318,967	1.65
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス　マザーファンド	49,994,402	7.8283	391,371,177	7.2665	363,284,322	1.59
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	26,183.224	10,906.74	285,573,616	10,855.35	284,228,060	1.24
日本	親投資信託受益証券	日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	119,358,366	2.4200	288,847,245	2.3760	283,595,477	1.24
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	249,091,664	1.146	285,459,046	1.1369	283,192,312	1.24
日本	投資信託受益証券	ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	152,055,050	1.9567	297,526,116	1.8325	278,640,879	1.22
日本	親投資信託受益証券	日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド	26,642,526	10.7352	286,012,845	10.3823	276,610,697	1.21
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	25,799	10,514.14	271,254,483	10,525.28	271,541,706	1.19
日本	親投資信託受益証券	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	246,422,454	1.1374	280,280,899	1.0928	269,290,457	1.18

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	49.06

投資証券	13.42
親投資信託受益証券	36.63
合計	99.11

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2019年 7月10日)	8,980,843,249	8,980,843,249	10,284	10,284
第2期計算期間末 (2020年 7月10日)	11,787,026,676	11,787,026,676	9,951	9,951
第3期計算期間末 (2021年 7月12日)	12,831,760,694	12,831,760,694	11,807	11,807
第4期計算期間末 (2022年 7月11日)	15,193,556,526	15,193,556,526	11,599	11,599
第5期計算期間末 (2023年 7月10日)	17,712,843,519	17,712,843,519	12,391	12,391
第6期計算期間末 (2024年 7月10日)	21,004,506,030	21,004,506,030	14,786	14,786
第7期計算期間末 (2025年 7月10日)	20,139,975,259	20,139,975,259	14,284	14,284
第8期計算期間末 (2026年 7月10日)	23,244,630,672	23,244,630,672	17,800	17,800
2025年 7月末日	20,410,760,469	—	14,552	—
8月末日	20,644,989,742	—	14,829	—
9月末日	21,052,251,152	—	15,252	—
10月末日	21,567,582,622	—	15,906	—
11月末日	21,701,288,928	—	16,136	—
12月末日	21,792,765,336	—	16,360	—
2026年 1月末日	22,340,076,014	—	16,800	—
2月末日	23,078,100,980	—	17,440	—
3月末日	21,420,434,830	—	16,241	—
4月末日	22,620,770,488	—	17,189	—
5月末日	23,172,636,315	—	17,617	—
6月末日	23,194,237,615	—	17,724	—
7月末日	22,844,735,668	—	17,585	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	0
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0

第5期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0
第6期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	0
第7期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	0
第8期計算期間	2025年 7月11日～2026年 7月10日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	2.8
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	△3.2
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	18.7
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	△1.8
第5期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	6.8
第6期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	19.3
第7期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	△3.4
第8期計算期間	2025年 7月11日～2026年 7月10日	24.6

(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	2018年10月26日～2019年 7月10日	9,362,328,441	629,077,416	8,733,251,025
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	6,207,727,771	3,096,276,176	11,844,702,620
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	1,926,137,065	2,903,204,631	10,867,635,054
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	3,838,843,288	1,607,580,740	13,098,897,602
第5期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	2,620,317,864	1,424,480,125	14,294,735,341
第6期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	2,119,254,715	2,207,885,264	14,206,104,792
第7期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	1,192,910,317	1,299,143,480	14,099,871,629
第8期計算期間	2025年 7月11日～2026年 7月10日	455,396,564	1,496,532,926	13,058,735,267

(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	988,007,589,160	98.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	15,079,754,200	1.50
合計(純資産総額)		1,003,087,343,360	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	14,829,780,000	1.48

(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	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,001,800	2,999.00	32,994,398,200	3,571.00	39,287,427,800	3.92
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	8,692,400	3,042.00	26,442,280,800	3,067.00	26,659,590,800	2.66
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,801,700	5,819.00	22,122,092,300	6,814.00	25,904,783,800	2.58
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,505,100	5,166.00	23,273,346,600	5,267.00	23,728,361,700	2.37
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	5,923,500	3,444.00	20,400,534,000	3,787.00	22,432,294,500	2.24
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	371,900	52,420.00	19,494,998,000	55,500.00	20,640,450,000	2.06
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,426,300	7,195.00	17,457,228,500	8,167.00	19,815,592,100	1.98
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3,404,000	7,491.00	25,499,364,000	5,260.00	17,905,040,000	1.78
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	533,200	26,170.00	13,953,844,000	32,500.00	17,329,000,000	1.73
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,439,800	5,065.00	17,422,587,000	4,776.00	16,428,484,800	1.64
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,267,600	10,570.00	13,398,532,000	12,550.00	15,908,380,000	1.59
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,792,900	7,111.00	12,749,311,900	8,114.00	14,547,590,600	1.45
日本	株式	キーエンス	電気機器	177,200	80,110.00	14,195,492,000	81,150.00	14,379,780,000	1.43
日本	株式	三井物産	卸売業	2,655,600	5,290.00	14,048,124,000	4,937.00	13,110,697,200	1.31
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	6,296,800	1,935.50	12,187,456,400	2,014.00	12,681,755,200	1.26
日本	株式	三菱重工業	機械	3,350,900	3,806.00	12,753,525,400	3,764.00	12,612,787,600	1.26
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,689,800	9,625.00	16,264,325,000	7,416.00	12,531,556,800	1.25
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,959,100	6,558.00	12,847,777,800	5,912.00	11,582,199,200	1.15
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	126,400	82,330.00	10,406,512,000	78,190.00	9,883,216,000	0.99
日本	株式	信越化学工業	化学	1,577,300	7,758.00	12,236,693,400	5,800.00	9,148,340,000	0.91
日本	株式	パナソニック　ホールディングス	電気機器	2,113,000	3,700.00	7,818,100,000	4,284.00	9,052,092,000	0.90
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,580,500	5,118.00	8,088,999,000	5,513.00	8,713,296,500	0.87
日本	株式	任天堂	その他製品	1,108,100	7,148.00	7,920,698,800	7,679.00	8,509,099,900	0.85
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	332,500	27,080.00	9,004,100,000	24,675.00	8,204,437,500	0.82
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,059,500	6,167.00	6,533,936,500	7,135.00	7,559,532,500	0.75
日本	株式	丸紅	卸売業	1,429,600	5,196.00	7,428,201,600	5,201.00	7,435,349,600	0.74
日本	株式	ＮＴＴ	情報・通信業	48,762,100	149.50	7,289,933,950	152.40	7,431,344,040	0.74
日本	株式	住友商事	卸売業	4,430,400	1,774.75	7,862,852,400	1,670.00	7,398,768,000	0.74
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	2,387,500	2,738.50	6,538,168,750	2,921.00	6,973,887,500	0.70

日本	株式	オリックス	その他金融業	1,042,100	6,237.00	6,499,577,700	6,410.00	6,679,861,000	0.67

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別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	0.07
		鉱業	0.35
		建設業	2.01
		食料品	2.77
		繊維製品	0.30
		パルプ・紙	0.13
		化学	4.44
		医薬品	3.19
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.58
		ガラス・土石製品	0.75
		鉄鋼	0.69
		非鉄金属	2.16
		金属製品	0.46
		機械	5.88
		電気機器	20.62
		輸送用機器	5.05
		精密機器	1.76
		その他製品	1.95
		電気・ガス業	1.18
		陸運業	1.90
		海運業	0.54
		空運業	0.27
		倉庫・運輸関連業	0.13
		情報・通信業	6.13
		卸売業	7.36
		小売業	3.94
		銀行業	12.18
		証券、商品先物取引業	0.97
		保険業	3.64
		その他金融業	1.25
		不動産業	1.63
		サービス業	3.73
		小計	98.50
合計			98.50

(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	372	円	14,824,247,600	14,829,780,000	1.48

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

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

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	30,699,731,830	98.85
投資証券	日本	90,562,900	0.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	267,859,106	0.86
合計(純資産総額)		31,058,153,836	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	263,109,000	0.85

(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	511,500	3,224.29	1,649,224,335	3,067.00	1,568,770,500	5.05
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	24,200	40,110.56	970,675,552	55,500.00	1,343,100,000	4.32
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	196,300	5,441.81	1,068,227,303	6,814.00	1,337,588,200	4.31
日本	株式	日立製作所	電気機器	238,700	4,725.87	1,128,065,169	5,267.00	1,257,232,900	4.05
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	315,300	3,299.64	1,040,376,492	3,787.00	1,194,041,100	3.84
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	200,400	3,829.69	767,469,876	5,260.00	1,054,104,000	3.39
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	127,700	6,554.42	836,999,434	8,167.00	1,042,925,900	3.36

日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	71,500	7,176.15	513,094,725	12,550.00	897,325,000	2.89
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	10,300	66,082.71	680,651,913	78,190.00	805,357,000	2.59
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	96,600	7,316.71	706,794,186	8,114.00	783,812,400	2.52
日本	株式	三菱重工業	機械	173,000	4,678.60	809,397,800	3,764.00	651,172,000	2.10
日本	株式	村田製作所	電気機器	87,400	9,643.30	842,824,420	7,416.00	648,158,400	2.09
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	299,400	2,013.36	602,799,984	2,014.00	602,991,600	1.94
日本	株式	パナソニック　ホールディングス	電気機器	125,900	2,857.73	359,788,207	4,284.00	539,355,600	1.74
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	158,200	2,761.30	436,837,660	2,921.00	462,102,200	1.49
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	18,300	27,858.78	509,815,674	24,675.00	451,552,500	1.45
日本	株式	丸紅	卸売業	76,200	5,845.43	445,421,766	5,201.00	396,316,200	1.28
日本	株式	オリックス	その他金融業	59,200	4,780.13	282,983,696	6,410.00	379,472,000	1.22
日本	株式	ファナック	電気機器	50,400	5,630.20	283,762,080	7,135.00	359,604,000	1.16
日本	株式	第一ライフグループ	保険業	185,700	1,469.32	272,852,724	1,918.50	356,265,450	1.15
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,553,200	217.07	337,153,124	223.40	346,984,880	1.12
日本	株式	富士通	電気機器	91,600	3,259.47	298,567,452	3,659.00	335,164,400	1.08
日本	株式	ダイキン工業	機械	14,200	19,836.88	281,683,696	23,295.00	330,789,000	1.07
日本	株式	小松製作所	機械	46,500	6,383.71	296,842,515	6,994.00	325,221,000	1.05
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	93,400	2,425.42	226,534,228	3,442.00	321,482,800	1.04
日本	株式	日本電気	電気機器	66,300	4,019.58	266,498,154	4,740.00	314,262,000	1.01
日本	株式	ＳＯＭＰＯホールディングス	保険業	44,100	6,032.12	266,016,492	7,113.00	313,683,300	1.01
日本	株式	ディスコ	機械	4,700	67,475.81	317,136,307	58,480.00	274,856,000	0.88
日本	株式	中外製薬	医薬品	36,300	8,776.47	318,585,861	6,932.00	251,631,600	0.81
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	158,400	1,273.30	201,690,720	1,520.00	240,768,000	0.78

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	鉱業	0.56
		建設業	2.58
		食料品	2.30
		繊維製品	0.33
		化学	4.35
		医薬品	2.84
		石油・石炭製品	0.77
		ゴム製品	0.74
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.37
		非鉄金属	1.25
		金属製品	0.19
		機械	6.91
		電気機器	23.95

		輸送用機器	5.47
		精密機器	1.84
		その他製品	1.41
		電気・ガス業	0.97
		陸運業	2.00
		空運業	0.09
		倉庫・運輸関連業	0.03
		情報・通信業	7.15
		卸売業	3.88
		小売業	5.01
		銀行業	8.70
		証券、商品先物取引業	1.17
		保険業	4.68
		その他金融業	1.65
		不動産業	2.46
		サービス業	4.56
		小計	98.85
投資証券	—	—	0.29
合計			99.14

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ミニＴＯＰＩＸ先物	買建	66	円	264,623,308	263,109,000	0.85

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

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

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	157,491,532,180	99.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	921,649,061	0.58
合計(純資産総額)		158,413,181,241	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	3,058,700	2,655.22	8,121,548,708	3,571.00	10,922,617,700	6.90
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,338,500	5,194.62	6,953,010,102	6,814.00	9,120,539,000	5.76
日本	株式	三越伊勢丹ホールディングス	小売業	2,080,000	2,702.76	5,621,756,182	3,587.00	7,460,960,000	4.71
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	130,800	37,249.18	4,872,193,398	55,500.00	7,259,400,000	4.58
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,220,500	4,934.69	6,022,790,135	5,267.00	6,428,373,500	4.06
日本	株式	ＭＡＲＵＷＡ	ガラス・土石製品	101,800	51,985.57	5,292,131,940	55,540.00	5,653,972,000	3.57
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,382,000	3,825.11	5,286,306,325	3,787.00	5,233,634,000	3.30
日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	2,282,000	1,868.96	4,264,979,049	2,184.00	4,983,888,000	3.15
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	585,400	6,280.18	3,676,420,810	8,167.00	4,780,961,800	3.02
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	378,000	7,654.98	2,893,585,179	12,550.00	4,743,900,000	2.99
日本	株式	三菱商事	卸売業	975,000	4,320.22	4,212,217,545	4,776.00	4,656,600,000	2.94
日本	株式	村田製作所	電気機器	599,500	3,552.07	2,129,470,953	7,416.00	4,445,892,000	2.81
日本	株式	キーエンス	電気機器	54,600	59,068.44	3,225,136,968	81,150.00	4,430,790,000	2.80
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	131,200	22,189.15	2,911,216,924	32,500.00	4,264,000,000	2.69
日本	株式	三菱重工業	機械	1,086,800	4,314.09	4,688,562,030	3,764.00	4,090,715,200	2.58
日本	株式	ダイフク	機械	680,200	5,498.67	3,740,196,808	5,983.00	4,069,636,600	2.57
日本	株式	荏原製作所	機械	649,200	4,504.41	2,924,269,396	5,558.00	3,608,253,600	2.28
日本	株式	富士電機	電気機器	248,400	11,712.30	2,909,336,100	14,285.00	3,548,394,000	2.24
日本	株式	信越化学工業	化学	597,800	5,306.03	3,171,944,792	5,800.00	3,467,240,000	2.19
日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	1,237,100	2,562.36	3,169,901,507	2,763.00	3,418,107,300	2.16
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,013,500	3,305.90	3,350,531,718	3,067.00	3,108,404,500	1.96
日本	株式	ディスコ	機械	50,900	54,134.09	2,755,425,521	58,480.00	2,976,632,000	1.88
日本	株式	ＪＸ金属	非鉄金属	761,000	2,402.69	1,828,454,518	3,797.00	2,889,517,000	1.82
日本	株式	富士通	電気機器	703,800	3,857.69	2,715,047,400	3,659.00	2,575,204,200	1.63
日本	株式	マツキヨココカラ＆カンパニー	小売業	967,100	2,689.36	2,600,881,739	2,534.50	2,451,114,950	1.55
日本	株式	野村総合研究所	情報・通信業	493,100	5,404.81	2,665,115,218	4,686.00	2,310,666,600	1.46
日本	株式	良品計画	小売業	546,900	3,298.77	1,804,101,861	4,177.00	2,284,401,300	1.44
日本	株式	ＮＴＴ	情報・通信業	14,817,400	154.94	2,295,934,547	152.40	2,258,171,760	1.43
日本	株式	第一ライフグループ	保険業	1,117,000	1,345.22	1,502,620,936	1,918.50	2,142,964,500	1.35
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	27,300	61,840.46	1,688,244,821	78,190.00	2,134,587,000	1.35

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	建設業	0.56
		食料品	1.27
		化学	3.15
		医薬品	1.81

		ガラス・土石製品	3.57
		非鉄金属	5.76
		機械	10.36
		電気機器	27.08
		輸送用機器	4.67
		精密機器	1.15
		その他製品	0.75
		陸運業	1.49
		情報・通信業	3.01
		卸売業	2.94
		小売業	10.24
		銀行業	15.67
		保険業	2.19
		不動産業	0.76
		サービス業	2.99
		小計	99.42
合計			99.42

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	821,489,381,197	70.46
	イギリス	42,894,051,640	3.68
	カナダ	42,141,592,650	3.61
	スイス	31,435,834,267	2.70
	ドイツ	26,147,094,111	2.24
	フランス	25,912,942,221	2.22
	オランダ	21,872,407,583	1.88
	オーストラリア	18,790,019,863	1.61
	アイルランド	18,528,596,122	1.59
	スペイン	11,502,019,757	0.99
	スウェーデン	9,238,414,571	0.79
	イタリア	8,959,543,190	0.77
	デンマーク	5,145,748,231	0.44
	シンガポール	5,099,045,970	0.44
	香港	3,988,822,919	0.34

	フィンランド	3,303,168,026	0.28
	イスラエル	3,261,108,774	0.28
	ケイマン	2,710,283,846	0.23
	ベルギー	2,627,339,005	0.23
	ノルウェー	1,924,938,343	0.17
	ルクセンブルク	1,887,295,805	0.16
	バミューダ	1,625,742,830	0.14
	ジャージー	1,484,928,409	0.13
	リベリア	1,062,681,238	0.09
	オーストリア	1,042,041,822	0.09
	キュラソー	990,431,272	0.08
	ニュージーランド	631,941,500	0.05
	ポルトガル	541,247,723	0.05
	小計	1,116,238,662,885	95.74
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	127,799,515	0.01
	香港	87,133,725	0.01
	小計	214,933,240	0.02
投資証券	アメリカ	14,989,405,607	1.29
	オーストラリア	931,178,272	0.08
	フランス	421,680,682	0.04
	イギリス	322,343,091	0.03
	シンガポール	263,278,157	0.02
	香港	199,101,330	0.02
	小計	17,126,987,139	1.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	32,320,592,810	2.77
合計(純資産総額)		1,165,901,176,074	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	24,800,241,130	2.13
	買建	カナダ	674,420,138	0.06
	買建	ドイツ	4,320,813,788	0.37
	買建	イギリス	1,600,569,424	0.14
	買建	オーストラリア	956,511,195	0.08

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

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

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	—	704,897,172	0.06

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

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

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	1,232,242	50,224.89	61,889,227,522	53,588.86	66,034,455,854	5.66
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,937,609	34,434.25	66,720,132,084	31,346.82	60,737,897,604	5.21
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	592,097	68,725.58	40,692,215,558	72,500.79	42,927,501,441	3.68
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	812,380	44,019.30	35,760,400,045	37,849.56	30,748,225,553	2.64
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	488,662	62,658.26	30,618,713,980	53,625.83	26,204,907,880	2.25
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	377,528	68,645.06	25,915,433,211	62,333.64	23,532,696,254	2.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	387,967	62,057.20	24,076,148,195	53,629.04	20,806,301,486	1.78
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	184,322	102,088.53	18,817,163,656	86,632.90	15,968,349,689	1.37
アメリカ	株式	MICRON TECHNOLOGY	半導体・半導体製造装置	94,655	148,653.34	14,070,782,551	140,575.35	13,306,160,246	1.14
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	225,129	47,698.14	10,738,236,226	56,388.61	12,694,711,831	1.09
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	67,407	181,005.67	12,201,049,389	185,626.77	12,512,544,252	1.07
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	236,217	71,031.08	16,778,749,534	49,638.37	11,725,427,319	1.01
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	136,840	83,258.54	11,393,099,910	78,011.88	10,675,145,769	0.92
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	116,728	76,713.00	8,954,555,228	81,915.76	9,561,863,954	0.82
アメリカ	株式	EXXONMOBIL HOLDINGS CORP	エネルギー	348,875	23,614.61	8,238,548,456	25,228.21	8,801,494,694	0.75
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,579	257,471.41	8,388,161,127	266,572.79	8,684,675,251	0.74
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	202,164	37,070.38	7,494,297,245	41,115.39	8,312,051,785	0.71
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	141,100	52,233.54	7,370,153,467	58,866.91	8,306,121,622	0.71
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	368,034	19,095.62	7,027,838,421	17,855.99	6,571,612,160	0.56

アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	69,075	79,355.50	5,481,481,163	92,791.69	6,409,586,125	0.55
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	148,459	35,134.22	5,215,992,390	41,370.93	6,141,887,669	0.53
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	331,529	19,075.68	6,324,142,204	18,251.36	6,050,856,190	0.52
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	37,237	159,780.34	5,949,740,840	153,354.20	5,710,450,435	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	569,778	8,160.74	4,649,813,094	9,921.24	5,652,907,475	0.48
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	368,753	19,414.60	7,159,192,388	14,646.41	5,400,908,954	0.46
アメリカ	株式	APPLIED MATERIALS	半導体・半導体製造装置	66,611	72,274.07	4,814,248,611	80,644.47	5,371,809,084	0.46
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	76,185	61,470.57	4,683,135,793	67,738.65	5,160,669,690	0.44
アメリカ	株式	CATERPILLAR	資本財	39,053	142,629.63	5,570,115,097	130,044.98	5,078,646,635	0.44
アメリカ	株式	LAM RESEARCH CORP	半導体・半導体製造装置	104,814	51,109.80	5,357,023,215	47,849.55	5,015,303,614	0.43
アメリカ	株式	GE AEROSPACE	資本財	87,696	51,571.50	4,522,614,397	57,062.02	5,004,111,678	0.43

(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	4.09
		素材	3.20
		資本財	7.99
		商業・専門サービス	0.98
		運輸	1.40
		自動車・自動車部品	1.44
		耐久消費財・アパレル	0.78
		消費者サービス	1.49
		メディア・娯楽	6.53
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.34
		生活必需品流通・小売り	1.64
		食品・飲料・タバコ	2.44
		家庭用品・パーソナル用品	1.01
		ヘルスケア機器・サービス	2.64
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.60
		銀行	7.20
		金融サービス	6.28
		保険	2.78
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.02
		ソフトウェア・サービス	7.50

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.28
		電気通信サービス	1.13
		公益事業	2.56
		半導体・半導体製造装置	13.23
		不動産管理・開発	0.20
		小計	95.74
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.02
投資証券	—	—	1.47
合計			97.23

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	413	アメリカドル	155,028,244.8	24,916,139,504	154,307,125	24,800,241,130	2.13
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	14	カナダドル	5,797,799	664,833,611	5,881,400	674,420,138	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	49	スイスフラン	6,829,533	1,360,989,336	7,046,200	1,404,166,736	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	248	ユーロ	15,583,028.6	2,884,730,254	15,755,440	2,916,647,052	0.25
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	38	オーストラリアドル	8,422,316	951,637,484	8,465,450	956,511,195	0.08
	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	68	イギリスポンド	7,167,210	1,550,482,539	7,398,740	1,600,569,424	0.14

(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	4,013,000.00	651,923,990	644,800,000	0.06
	スウェーデンクローナ	買建	3,567,000.00	60,424,980	60,097,172	0.01

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

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

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	24,429,379,357	68.34
	イギリス	1,305,943,750	3.65
	カナダ	1,273,613,986	3.56
	フランス	1,056,157,586	2.95
	スイス	874,374,437	2.45
	アイルランド	852,804,446	2.39
	オランダ	840,851,256	2.35
	オーストラリア	512,043,523	1.43
	ドイツ	417,745,689	1.17
	スウェーデン	313,453,735	0.88
	スペイン	295,865,502	0.83
	デンマーク	250,023,084	0.70
	香港	188,136,516	0.53
	イタリア	166,429,421	0.47
	フィンランド	127,119,819	0.36
	ノルウェー	88,796,882	0.25
	ベルギー	75,633,877	0.21
	ルクセンブルク	69,828,423	0.20
	バミューダ	67,748,280	0.19
	リベリア	63,798,129	0.18
	キュラソー	56,629,313	0.16
	シンガポール	31,330,792	0.09
	イスラエル	24,380,882	0.07
	ポルトガル	22,696,808	0.06
	オーストリア	22,503,474	0.06
	ニュージーランド	19,019,383	0.05
	ケイマン	9,523,273	0.03
	ジャージー	9,140,164	0.03
	小計	33,464,971,787	93.61
投資信託受益証券	オーストラリア	9,121,388	0.03
投資証券	アメリカ	511,717,486	1.43
	イギリス	17,428,033	0.05
	オーストラリア	11,455,701	0.03
	シンガポール	6,235,702	0.02
	小計	546,836,922	1.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,727,936,656	4.83
合計(純資産総額)		35,748,866,753	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	1,381,127,230	3.86
	買建	ドイツ	294,016,840	0.82

(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	—	3,695,692	0.01
	売建	—	6,950,496	△0.02

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	111,686	31,983.27	3,572,084,610	31,346.82	3,501,001,921	9.79
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	34,129	58,736.73	2,004,625,899	72,500.79	2,474,379,530	6.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	28,167	55,495.00	1,563,127,913	53,625.83	1,510,478,900	4.23
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	22,363	55,454.82	1,240,136,336	53,629.04	1,199,306,436	3.35
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,885	179,566.02	697,614,016	185,626.77	721,160,034	2.02
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	13,616	60,355.18	821,796,153	49,638.37	675,876,073	1.89
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	7,888	83,532.61	658,905,250	78,011.88	615,357,716	1.72
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,878	287,639.45	540,186,898	266,572.79	500,623,718	1.40
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	11,653	38,733.51	451,361,708	41,115.39	479,117,644	1.34
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	8,133	53,396.00	434,269,714	58,866.91	478,764,615	1.34
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	3,962	79,461.57	314,826,761	92,791.69	367,640,684	1.03
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	2,146	154,466.38	331,484,861	153,354.20	329,098,118	0.92

アメリカ	株式	APPLIED MATERIALS	半導体・半導体製造装置	3,840	94,659.25	363,491,553	80,644.47	309,674,782	0.87
アメリカ	株式	CATERPILLAR	資本財	2,261	159,828.00	361,371,117	130,044.98	294,031,702	0.82
アメリカ	株式	GE AEROSPACE	資本財	5,050	58,804.23	296,961,379	57,062.02	288,163,245	0.81
アメリカ	株式	LAM RESEARCH CORP	半導体・半導体製造装置	6,013	60,237.85	362,210,228	47,849.55	287,719,395	0.80
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	83,231	3,092.22	257,368,647	3,433.15	285,745,099	0.80
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	18,741	12,954.03	242,771,514	14,222.11	266,536,616	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	11,186	24,435.86	273,339,628	23,137.25	258,813,292	0.72
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	4,827	55,104.45	265,989,225	53,576.01	258,611,410	0.72
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	11,882	19,382.83	230,306,809	20,859.84	247,856,723	0.69
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,860	24,778.47	219,537,290	25,264.71	223,845,405	0.63
アメリカ	株式	PALO ALTO NETWORKS INC	ソフトウェア・サービス	3,949	45,846.98	181,049,753	52,343.28	206,703,651	0.58
アメリカ	株式	GE VERNOVA INC	資本財	1,304	169,985.50	221,661,103	157,823.82	205,802,269	0.58
イギリス	株式	ASTRAZENECA	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,316	30,091.50	220,149,436	27,517.17	201,315,660	0.56
アメリカ	株式	MORGAN STANLEY	金融サービス	5,777	35,335.89	204,135,490	33,760.84	195,036,391	0.55
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	2,235	82,888.12	185,254,960	81,748.62	182,708,167	0.51
アメリカ	株式	AMGEN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,635	56,481.82	148,829,621	62,301.50	164,164,455	0.46
オーストラリア	株式	COMMONWEALTH BANK OF AUST	銀行	8,096	18,619.62	150,744,461	20,140.46	163,057,225	0.46
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	4,551	42,262.93	192,338,600	35,638.05	162,188,778	0.45

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	2.69
		素材	3.15
		資本財	7.62
		商業・専門サービス	1.05
		運輸	1.39
		自動車・自動車部品	2.00
		耐久消費財・アパレル	0.90

		消費者サービス	1.84
		メディア・娯楽	8.42
		一般消費財・サービス流通・小売り	2.78
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	1.96
		家庭用品・パーソナル用品	1.91
		ヘルスケア機器・サービス	1.68
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.44
		銀行	5.12
		金融サービス	6.93
		保険	3.57
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.03
		ソフトウェア・サービス	10.35
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.38
		電気通信サービス	1.31
		公益事業	1.67
		半導体・半導体製造装置	15.49
		不動産管理・開発	0.24
		小計	93.61
投資信託受益証券	—	—	0.03
投資証券	—	—	1.53
合計			95.17

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	23	アメリカドル	8,605,731.4	1,383,113,151	8,593,375	1,381,127,230	3.86
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	25	ユーロ	1,565,375.2	289,782,257	1,588,250	294,016,840	0.82

(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	23,000.00	3,759,350	3,695,692	0.01
	ユーロ	売建	13,000.00	2,405,832	2,406,157	△0.01
	ニュージーランドドル	売建	27,000.00	2,547,180	2,547,466	△0.01
	イスラエルシェケル	売建	38,000.00	1,995,760	1,996,873	△0.01

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

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

世界債券総合インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	18,462,735,459	19.80
	中国	6,262,703,786	6.72
	イギリス	3,005,300,936	3.22
	フランス	3,004,850,106	3.22
	イタリア	2,796,273,570	3.00
	ドイツ	2,144,678,027	2.30
	スペイン	2,058,506,287	2.21
	カナダ	1,015,224,236	1.09
	韓国	1,010,073,681	1.08
	オーストラリア	698,176,260	0.75
	ベルギー	627,321,130	0.67
	スイス	546,992,821	0.59
	メキシコ	510,361,903	0.55
	オランダ	501,894,140	0.54
	オーストリア	434,792,512	0.47
	インドネシア	421,443,656	0.45
	マレーシア	403,280,755	0.43
	ポーランド	385,108,989	0.41
	タイ	347,229,003	0.37
	ポルトガル	243,538,724	0.26
	イスラエル	232,021,644	0.25
	フィンランド	224,980,218	0.24
	シンガポール	220,643,037	0.24
	デンマーク	197,532,778	0.21
	アイルランド	167,638,229	0.18
	サウジアラビア	159,663,397	0.17
	ニュージーランド	157,592,377	0.17
	ルーマニア	155,336,297	0.17
	チェコ	155,179,505	0.17
	スウェーデン	134,004,960	0.14
	ギリシャ	124,193,974	0.13
	ハンガリー	116,670,268	0.13
	ノルウェー	91,767,216	0.10
	アラブ首長国連邦	60,670,932	0.07
	パナマ	59,903,558	0.06

	カタール	58,832,717	0.06
	フィリピン	57,106,403	0.06
	ブルガリア	49,779,631	0.05
	チリ	46,374,683	0.05
	パラグアイ	32,939,564	0.04
	香港	32,143,269	0.03
	ペルー	24,236,576	0.03
	ウルグアイ	10,736,094	0.01
	小計	47,450,433,308	50.88
地方債証券	カナダ	1,308,527,854	1.40
	オーストラリア	472,555,621	0.51
	ドイツ	437,278,822	0.47
	スウェーデン	72,759,771	0.08
	デンマーク	42,130,998	0.05
	ニュージーランド	22,500,377	0.02
	スペイン	18,775,879	0.02
	小計	2,374,529,322	2.55
特殊債券	中国	4,302,559,920	4.61
	国際機関	2,823,666,428	3.03
	ドイツ	818,599,285	0.88
	カナダ	547,316,346	0.59
	フランス	404,183,896	0.43
	オランダ	257,395,372	0.28
	韓国	224,627,772	0.24
	日本	175,054,115	0.19
	アメリカ	132,161,191	0.14
	オーストリア	80,031,332	0.09
	スウェーデン	55,266,584	0.06
	ノルウェー	43,182,907	0.05
	スペイン	37,138,204	0.04
	インド	32,164,580	0.03
	小計	9,933,347,932	10.65
社債券	アメリカ	10,937,292,209	11.73
	フランス	1,890,225,575	2.03
	カナダ	1,086,442,825	1.16
	オランダ	1,076,461,123	1.15
	イギリス	1,070,929,219	1.15
	ドイツ	1,002,964,602	1.08
	日本	601,591,645	0.65
	スペイン	441,467,782	0.47
	オーストラリア	405,497,301	0.43
	イタリア	395,948,240	0.42

	スウェーデン	357,547,239	0.38
	ノルウェー	161,632,136	0.17
	スイス	149,063,256	0.16
	ルクセンブルク	146,410,109	0.16
	シンガポール	132,992,782	0.14
	アイルランド	128,271,052	0.14
	フィンランド	126,262,328	0.14
	ケイマン	120,571,869	0.13
	バミューダ	86,292,366	0.09
	デンマーク	84,675,219	0.09
	インドネシア	79,001,252	0.08
	ベルギー	70,331,037	0.08
	マレーシア	64,522,334	0.07
	オーストリア	55,717,227	0.06
	インド	50,224,357	0.05
	香港	32,304,212	0.03
	ニュージーランド	31,673,683	0.03
	タイ	30,188,817	0.03
	ジャージー	16,686,716	0.02
	小計	20,833,188,512	22.34
投資信託受益証券	アメリカ	10,315,155,514	11.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,356,713,751	2.53
合計(純資産総額)		93,263,368,339	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	523,369,636	0.56
	買建	ドイツ	207,543,585	0.22

(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	―	1,547,394,075	1.66
	売建	―	523,788,631	△0.56

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MBS ETF	687,972	15,297.19	10,524,040,352	14,993.56	10,315,155,514	—	—	11.06
アメリカ	国債証券	T 3.875% 06/15/28	2,750,000	16,102.76	442,825,976	15,967.78	439,114,033	3.875	2028/6/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4% 06/30/28	2,200,000	16,068.96	353,517,197	16,001.68	352,037,070	4.000	2028/6/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.75% 04/15/28	2,100,000	16,061.01	337,281,280	15,945.80	334,862,004	3.750	2028/4/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 4.125% 03/31/29	2,080,000	16,050.09	333,842,077	16,008.59	332,978,691	4.125	2029/3/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.5% 10/31/27	2,000,000	16,006.70	320,134,150	15,938.27	318,765,520	3.500	2027/10/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 4% 02/28/30	2,000,000	16,104.30	322,086,186	15,900.92	318,018,421	4.000	2030/2/28	0.34
アメリカ	国債証券	T 4.125% 10/31/27	1,900,000	16,150.79	306,865,017	16,063.21	305,200,999	4.125	2027/10/31	0.33
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/29	1,900,000	15,214.72	289,079,719	15,117.72	287,236,775	1.750	2029/1/31	0.31
アメリカ	国債証券	T 4% 03/31/30	1,600,000	16,147.65	258,362,421	15,893.07	254,289,175	4.000	2030/3/31	0.27
アメリカ	国債証券	T 3.875% 04/30/31	1,600,000	15,838.45	253,415,260	15,733.60	251,737,743	3.875	2031/4/30	0.27
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	1,620,000	15,577.59	252,357,081	15,419.70	249,799,184	2.750	2029/5/31	0.27
中国	国債証券	CGB 1.42% 08/15/28	10,400,000	2,384.86	248,025,448	2,386.24	248,169,472	1.420	2028/8/15	0.27
アメリカ	国債証券	T 1.375% 10/31/28	1,600,000	15,149.11	242,385,849	15,083.50	241,336,146	1.375	2028/10/31	0.26
アメリカ	国債証券	T 4.125% 03/31/32	1,500,000	16,074.19	241,112,854	15,829.03	237,435,547	4.125	2032/3/31	0.25
中国	特殊債券	SDBC 1.27% 01/06/30	10,000,000	2,355.19	235,519,295	2,358.94	235,894,227	1.270	2030/1/6	0.25
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	1,500,000	15,811.77	237,176,575	15,676.16	235,142,462	3.125	2028/11/15	0.25
アメリカ	国債証券	T 4.25% 05/15/35	1,500,000	16,059.12	240,886,948	15,642.57	234,638,643	4.250	2035/5/15	0.25
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	1,500,000	15,575.40	233,631,004	15,438.22	231,573,349	2.625	2029/2/15	0.25
アメリカ	国債証券	T 4.125% 07/31/31	1,400,000	16,200.70	226,809,821	15,884.91	222,388,767	4.125	2031/7/31	0.24
アメリカ	国債証券	T 3.5% 10/15/28	1,400,000	15,959.30	223,430,306	15,814.91	221,408,751	3.500	2028/10/15	0.24
中国	特殊債券	ADBCH 1.59% 05/13/30	9,000,000	2,377.92	214,013,251	2,383.26	214,493,806	1.590	2030/5/13	0.23
中国	国債証券	CGB 2.44% 10/15/27	8,600,000	2,418.93	208,027,982	2,412.06	207,437,221	2.440	2027/10/15	0.22
アメリカ	国債証券	T 4.375% 12/31/29	1,280,000	16,358.59	209,390,032	16,101.19	206,095,274	4.375	2029/12/31	0.22
中国	特殊債券	SDBC 3% 01/17/32	8,000,000	2,549.69	203,975,519	2,552.02	204,162,011	3.000	2032/1/17	0.22
アメリカ	国債証券	T 2.375% 03/31/29	1,310,000	15,440.42	202,269,508	15,305.44	200,501,276	2.375	2029/3/31	0.21
アメリカ	国債証券	T 3.625% 10/31/30	1,230,000	15,887.17	195,412,216	15,618.71	192,110,249	3.625	2030/10/31	0.21
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	1,250,000	15,130.59	189,132,439	15,077.85	188,473,236	1.250	2028/9/30	0.20
アメリカ	国債証券	T 3.75% 08/31/31	1,200,000	15,905.62	190,867,556	15,603.96	187,247,590	3.750	2031/8/31	0.20
アメリカ	国債証券	T 0.625% 11/30/27	1,200,000	15,292.57	183,510,850	15,337.45	184,049,513	0.625	2027/11/30	0.20

(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	50.88
地方債証券	2.55
特殊債券	10.65
社債券	22.34
投資信託受益証券	11.06
合計	97.47

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	30	アメリカドル	3,264,427.82	524,658,839	3,256,406.4	523,369,636	0.56
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	9	ユーロ	1,126,698.9	208,574,500	1,121,130	207,543,585	0.22

(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	4,880,000.00	791,028,569	783,269,768	0.84
	カナダドル	買建	440,000.00	50,554,516	50,423,428	0.05
	ユーロ	買建	2,180,000.00	403,980,485	403,274,712	0.43
	イギリスポンド	買建	340,000.00	73,839,389	73,449,656	0.08
	オーストラリアドル	買建	250,000.00	28,159,531	28,199,525	0.03
	オフショア人民元	買建	8,780,000.00	210,259,273	208,776,986	0.22
	アメリカドル	売建	1,660,000.00	270,354,074	266,440,126	△0.29
	カナダドル	売建	140,000.00	16,181,396	16,043,818	△0.02
	ユーロ	売建	730,000.00	135,704,664	135,041,532	△0.14
	イギリスポンド	売建	110,000.00	23,977,063	23,763,124	△0.03
	オーストラリアドル	売建	80,000.00	9,121,800	9,023,848	△0.01
	オフショア人民元	売建	3,090,000.00	74,461,584	73,476,183	△0.08

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

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

新興国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	台湾	87,402,859,901	24.32
	韓国	60,736,088,202	16.90
	ケイマン	42,532,304,310	11.84
	インド	42,443,012,127	11.81
	中国	33,655,851,804	9.37
	ブラジル	12,426,238,447	3.46
	南アフリカ	9,505,236,617	2.64
	サウジアラビア	8,947,311,034	2.49

	メキシコ	5,889,476,680	1.64
	アラブ首長国連邦	4,263,540,302	1.19
	ポーランド	3,695,796,364	1.03
	タイ	3,554,642,350	0.99
	マレーシア	3,525,539,501	0.98
	香港	3,240,567,698	0.90
	ギリシャ	2,034,244,367	0.57
	クウェート	2,020,748,330	0.56
	カタール	1,790,181,335	0.50
	インドネシア	1,784,505,875	0.50
	チリ	1,639,928,465	0.46
	トルコ	1,346,221,651	0.37
	バミューダ	1,289,390,833	0.36
	イギリス	1,255,038,737	0.35
	ハンガリー	1,252,145,546	0.35
	フィリピン	1,045,413,624	0.29
	アメリカ	1,003,270,622	0.28
	コロンビア	670,171,883	0.19
	ルクセンブルク	668,790,929	0.19
	チェコ	441,984,946	0.12
	エジプト	232,425,561	0.06
	カナダ	202,942,181	0.06
	オランダ	160,768,216	0.04
	ペルー	155,367,400	0.04
	シンガポール	74,040,615	0.02
	英ヴァージン諸島	58,130,728	0.02
	ロシア	—	—
	小計	340,944,177,181	94.87
投資信託受益証券	ブラジル	583,690,618	0.16
	メキシコ	169,738,350	0.05
	小計	753,428,968	0.21
投資証券	メキシコ	292,779,271	0.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	17,384,037,075	4.84
合計(純資産総額)		359,374,422,495	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	18,022,677,926	5.02

(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	―	1,280,116,722	0.36

(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	4,668,389	7,346.60	34,296,817,093	10,900.41	50,887,389,152	14.16
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	886,304	11,323.90	10,036,423,045	23,201.59	20,563,666,455	5.72
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	104,670	72,283.56	7,565,920,873	148,176.37	15,509,620,648	4.32
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,167,300	12,990.66	15,163,997,418	9,667.18	11,284,501,549	3.14
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	3,174,288	3,280.44	10,413,089,895	2,290.78	7,271,601,813	2.02
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	273,804	6,228.80	1,705,473,093	15,992.22	4,378,734,489	1.22
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15,945,620	166.58	2,656,280,379	191.78	3,058,153,056	0.85
台湾	株式	DELTA ELECTRONICS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	368,903	4,969.00	1,833,079,782	7,563.55	2,790,218,130	0.78
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	2,158,632	1,649.68	3,561,063,726	1,277.89	2,758,501,802	0.77
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	2,316,248	1,206.21	2,793,890,765	1,134.53	2,627,860,371	0.73
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	153,699	8,440.00	1,297,219,637	16,924.83	2,601,330,215	0.72
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1,125,227	2,498.24	2,811,089,914	2,187.53	2,461,474,571	0.68
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	1,008,033	2,265.39	2,283,590,650	2,427.68	2,447,186,594	0.68
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	3,280,200	865.49	2,839,005,228	636.00	2,086,238,690	0.58
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	12,476,515	129.70	1,618,225,206	156.54	1,953,118,574	0.54
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	934,950	2,089.98	1,954,026,801	1,898.39	1,774,907,678	0.49

インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	519,596	3,356.38	1,743,964,503	3,305.21	1,717,377,792	0.48
ブラジル	株式	VALE SA	素材	678,975	2,055.46	1,395,612,336	2,414.33	1,639,273,582	0.46
ケイマン	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	銀行	690,942	2,507.95	1,732,849,815	2,328.83	1,609,088,392	0.45
台湾	株式	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	半導体・半導体製造装置	638,315	1,218.54	777,815,112	2,496.46	1,593,532,652	0.44
韓国	株式	SK SQUARE CO LTD	資本財	17,656	35,013.63	618,200,796	89,555.91	1,581,199,235	0.44
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,283,500	1,200.09	1,540,327,452	1,202.76	1,543,746,311	0.43
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	565,523	2,932.68	1,658,501,102	2,682.76	1,517,167,856	0.42
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	107,610	21,822.56	2,348,325,854	14,053.35	1,512,281,725	0.42
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	340,330	4,487.30	1,527,166,212	4,233.23	1,440,696,527	0.40
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	12,677,200	93.84	1,189,681,692	113.51	1,439,047,287	0.40
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	995,197	1,237.47	1,231,526,432	1,356.14	1,349,626,659	0.38
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	693,900	2,005.97	1,391,943,277	1,942.45	1,347,867,443	0.38
サウジアラビア	株式	SAUDI ARABIAN OIL CO	エネルギー	1,158,228	1,106.37	1,281,433,502	1,135.72	1,315,431,043	0.37
イギリス	株式	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	素材	97,402	11,730.64	1,142,587,997	12,885.14	1,255,038,737	0.35

(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	3.50
		素材	5.81
		資本財	4.70
		商業・専門サービス	0.06
		運輸	1.43
		自動車・自動車部品	2.59
		耐久消費財・アパレル	0.72
		消費者サービス	1.32
		メディア・娯楽	4.45
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.84
		生活必需品流通・小売り	0.68
		食品・飲料・タバコ	1.87
		家庭用品・パーソナル用品	0.32
		ヘルスケア機器・サービス	0.46
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.13
		銀行	15.01
		金融サービス	2.35
		保険	2.61
		ソフトウェア・サービス	1.20

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	12.88
		電気通信サービス	2.19
		公益事業	1.93
		半導体・半導体製造装置	21.88
		不動産管理・開発	0.96
		小計	94.87
投資信託受益証券	—	—	0.21
投資証券	—	—	0.08
合計			95.16

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	1,376	アメリカドル	118,583,769	19,058,783,353	112,137,120	18,022,677,926	5.02

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	7,967,000.00	1,293,534,830	1,280,116,722	0.36

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

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	122,207,158,950	97.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,848,595,993	2.28
合計(純資産総額)		125,055,754,943	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	2,842,800,000	2.27

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	67,895	143,095.23	9,715,450,883	134,700	9,145,456,500	7.31
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	59,052	128,280.56	7,575,223,711	122,100	7,210,249,200	5.77
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	58,317	120,325.25	7,017,007,604	117,900	6,875,574,300	5.50
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	38,898	142,129.34	5,528,547,109	145,000	5,640,210,000	4.51
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	35,787	165,430.35	5,920,255,935	152,700	5,464,674,900	4.37
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	57,813	91,274.38	5,276,845,730	90,600	5,237,857,800	4.19
日本	投資証券	ＫＤＸ不動産投資法人	32,748	171,327.68	5,610,638,864	156,100	5,111,962,800	4.09
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	44,754	105,440.75	4,718,895,325	103,100	4,614,137,400	3.69
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	34,967	135,431.77	4,735,642,701	123,500	4,318,424,500	3.45
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	24,647	186,473.63	4,596,015,558	162,900	4,014,996,300	3.21
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	47,868	87,484.62	4,187,713,790	81,400	3,896,455,200	3.12
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	58,895	68,076.13	4,009,343,676	61,200	3,604,374,000	2.88
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	23,125	167,220.89	3,866,983,081	147,900	3,420,187,500	2.73
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	31,181	104,352.86	3,253,826,785	98,100	3,058,856,100	2.45
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	20,500	147,951.79	3,033,011,695	141,300	2,896,650,000	2.32
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	24,799	114,000.91	2,827,108,567	108,100	2,680,771,900	2.14
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	33,150	81,440.68	2,699,758,542	75,800	2,512,770,000	2.01
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	17,340	142,467.86	2,470,392,692	142,900	2,477,886,000	1.98
日本	投資証券	三井不動産アコモデーションファンド投資法人	19,389	131,372.06	2,547,172,871	122,800	2,380,969,200	1.90
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	22,265	101,560.67	2,261,248,317	98,900	2,202,008,500	1.76
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,081	152,641.62	2,149,346,651	152,600	2,148,760,600	1.72
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	17,015	109,201.86	1,858,069,647	102,100	1,737,231,500	1.39
日本	投資証券	三井不動産商業ファンド投資法人	20,835	90,355.93	1,882,565,930	82,000	1,708,470,000	1.37
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,999	146,606.4	1,905,736,593	130,100	1,691,169,900	1.35
日本	投資証券	イオンリート投資法人	13,637	131,725.13	1,796,335,597	121,900	1,662,350,300	1.33
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	21,647	78,077.26	1,690,138,447	76,300	1,651,666,100	1.32
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,443	111,842.82	1,839,031,489	97,100	1,596,615,300	1.28
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,924	170,331.97	1,690,374,470	157,500	1,563,030,000	1.25
日本	投資証券	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	11,309	137,884.4	1,559,334,679	137,300	1,552,725,700	1.24
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	4,547	375,939.95	1,709,398,952	341,000	1,550,527,000	1.24

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。
(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	97.72
合計	97.72

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	1,545	円	2,776,365,820	2,842,800,000	2.27

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

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

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	134,601,908,832	79.14
	オーストラリア	10,885,858,670	6.40
	イギリス	6,974,442,868	4.10
	シンガポール	5,344,084,787	3.14
	フランス	3,533,554,577	2.08
	カナダ	1,968,295,863	1.16
	ベルギー	1,700,442,457	1.00
	香港	1,401,396,588	0.82
	スペイン	928,388,463	0.55
	ガーンジー	396,457,840	0.23
	韓国	284,120,263	0.17
	イスラエル	274,964,915	0.16
	オランダ	252,700,903	0.15
	ニュージーランド	191,940,964	0.11
	アイルランド	73,366,490	0.04
	ドイツ	33,815,944	0.02
	イタリア	26,647,172	0.02
	小計	168,872,387,596	99.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,212,257,643	0.71
合計(純資産総額)		170,084,645,239	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	買建	アメリカ	1,128,357,260	0.66

(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。

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	―	1,197,090,530	△0.70

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	422,748	30,731.27	12,991,583,437	37,870.45	16,009,658,518	9.41
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	558,346	20,300.54	11,334,727,094	23,495.65	13,118,705,992	7.71
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	59,063	133,611.35	7,891,487,614	168,359.02	9,943,788,893	5.85
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	194,202	29,633.55	5,754,895,376	37,036.31	7,192,526,795	4.23
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	208,272	27,446.15	5,716,265,470	31,049.49	6,466,740,798	3.80
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	558,439	9,191.57	5,132,934,957	10,355.18	5,782,741,725	3.40
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	100,440	44,276.75	4,447,157,051	51,020.56	5,124,505,448	3.01
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	290,931	12,343.29	3,591,047,449	14,773.38	4,298,034,915	2.53
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,222,668	3,478.96	4,253,615,633	3,308.34	4,045,010,254	2.38
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	177,749	16,734.16	2,974,481,343	20,032.14	3,560,692,995	2.09
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	126,055	21,505.94	2,710,931,670	23,820.31	3,002,669,328	1.77
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	651,583	4,848.92	3,159,475,404	4,228.54	2,755,246,864	1.62
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	82,733	28,531.01	2,360,456,414	30,180.00	2,496,882,072	1.47
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	202,742	9,620.69	1,950,519,797	10,787.52	2,187,084,677	1.29
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	38,686	41,820.95	1,617,885,318	45,300.53	1,752,496,659	1.03
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	814,960	1,557.57	1,269,362,137	2,091.04	1,704,118,669	1.00
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	405,981	3,310.83	1,344,134,886	4,099.96	1,664,508,784	0.98
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	134,088	10,867.88	1,457,253,151	11,906.13	1,596,470,178	0.94
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	329,003	4,493.73	1,478,451,046	4,768.56	1,568,871,335	0.92
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	383,434	2,897.78	1,111,107,990	4,032.46	1,546,184,108	0.91
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	70,063	20,855.02	1,461,165,771	21,427.19	1,501,253,241	0.88
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	415,029	2,875.28	1,193,324,915	3,545.48	1,471,478,347	0.87
アメリカ	投資証券	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	179,276	7,015.42	1,257,697,870	8,100.28	1,452,187,231	0.85
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	73,356	15,986.96	1,172,739,672	19,345.03	1,419,074,754	0.83
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	69,734	20,343.93	1,418,664,144	19,998.38	1,394,567,700	0.82
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,144,216	460.99	1,449,481,061	440.66	1,385,533,367	0.81
アメリカ	投資証券	LAMAR ADVERTISING CO-A	52,407	20,405.01	1,069,365,422	25,819.66	1,353,131,341	0.80
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	99,201	11,272.90	1,118,283,032	12,915.45	1,281,226,468	0.75
香港	投資証券	LINK REIT	1,564,600	844.39	1,321,137,131	809.35	1,266,316,833	0.74
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	116,750	9,983.92	1,165,623,407	10,531.98	1,229,608,852	0.72

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	99.29
合計	99.29

(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(%)
不動産投信指数先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	DJ US REIT	買建	176	アメリカドル	6,925,710.8	1,113,100,239	7,020,640	1,128,357,260	0.66

(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。

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	5,900,000.00	964,355,000	948,025,570	△0.56
	イギリスポンド	売建	450,000.00	98,236,800	97,324,560	△0.06
	オーストラリアドル	売建	900,000.00	102,317,400	101,650,320	△0.06
	シンガポールドル	売建	400,000.00	50,713,600	50,090,080	△0.03

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

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

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	17,734,423,392	39.88
	ルクセンブルク	17,536,143,128	39.44
	ケイマン	4,303,278,000	9.68
	イギリス	1,926,132,768	4.33
	アメリカ	1,141,995,960	2.57
	ジャージー	1,009,321,600	2.27
	小計	43,651,294,848	98.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	813,906,526	1.83
合計(純資産総額)		44,465,201,374	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 008 10/26/26	51,000,000	35,808.41	18,262,292,160	34,773.37	17,734,423,392	0.000	2026/10/26	39.88
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 047 10/30/26	29,000,000	19,167.46	5,558,565,488	18,502.08	5,365,605,056	0.000	2026/10/30	12.07
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 046 08/28/26	23,000,000	19,999.99	4,599,999,264	19,355.50	4,451,767,208	0.000	2026/8/28	10.01
ケイマン	社債券	MS SPACE II 001 03/29/30	21,000,000	20,878.52	4,384,489,816	20,491.80	4,303,278,000	0.000	2030/3/29	9.68
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 048 12/30/26	24,000,000	18,256.18	4,381,484,352	17,594.01	4,222,564,416	0.000	2026/12/30	9.50
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 050 05/28/27	23,000,000	15,060.02	3,463,805,296	15,200.89	3,496,206,448	0.000	2027/5/28	7.86
イギリス	社債券	BAR USD COM 044 02/26/27	12,000,000	16,599.16	1,991,899,392	16,051.10	1,926,132,768	0.000	2027/2/26	4.33
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	7,955.64	1,193,346,000	7,613.30	1,141,995,960	0.000	2036/6/12	2.57
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	2,632.59	1,053,037,440	2,523.30	1,009,321,600	0.000	9999/99/99	2.27

(注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2）投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。
(注3）償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	98.17
合計	98.17

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	72,182,541,967	97.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,827,129,061	2.47
合計(純資産総額)		74,009,671,028	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	—	70,642,611,017	95.45
	売建	—	142,647,512,881	△192.74

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	3,515,983	13,091.60	46,029,850,283	13,071.35	45,958,671,108	62.10
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST MICRO	3,982,547	6,600.77	26,287,878,355	6,584.69	26,223,870,859	35.43

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	97.53
合計	97.53

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	439,676,000.00	70,639,321,100	70,642,611,017	95.45
	アメリカドル	売建	888,853,200.00	143,156,942,095	142,647,512,881	△192.74

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

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

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	10,126,233,000	42.55
	ケイマン	6,932,790,000	29.13
	イギリス	6,536,880,000	27.47
	小計	23,595,903,000	99.14

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	204,208,396	0.86
合計(純資産総額)		23,800,111,396	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ ＨＥＬＩＯＳ ０％ ０７／１６／２７	9,230,000,000	108.52	10,016,396,000	109.71	10,126,233,000	0.000	2027/7/16	42.55
ケイマン	社債券	ＭＳ ＳＰＡＣＥ ＩＩ ０％ ２０３０／０３／２９	8,100,000,000	84.87	6,874,710,000	85.59	6,932,790,000	0.000	2030/3/29	29.13
イギリス	社債券	ソシエテ・ジェネラル ０％ ２０２７／０２／２６	7,200,000,000	89.32	6,431,200,000	90.79	6,536,880,000	0.000	2027/2/26	27.47

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	99.14
合計	99.14

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	13,582,120,200	60.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	8,890,910,550	39.56
合計(純資産総額)		22,473,030,750	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	日本	12,452,860,000	55.41
	買建	アメリカ	8,914,729,476	39.67

	買建	イギリス	9,308,247,240	41.42
	売建	ドイツ	17,433,661,190	△77.58

(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	—	23,070,298,364	102.66
	売建	—	24,058,125,243	△107.05

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１３７５回国庫短期証券	7,000,000,000	98.92	6,924,652,000	99.17	6,942,138,000	—	2027/4/20	30.89
日本	国債証券	第１３９４回国庫短期証券	3,000,000,000	98.82	2,964,726,000	98.82	2,964,648,000	—	2027/7/20	13.19
日本	国債証券	第１３６３回国庫短期証券	2,000,000,000	99.00	1,980,072,000	99.37	1,987,564,000	—	2027/2/22	8.84
日本	国債証券	第１３６９回国庫短期証券	1,700,000,000	98.96	1,682,462,800	99.28	1,687,770,200	—	2027/3/23	7.51

(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	60.44
合計	60.44

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	日本	大阪取引所	長期国債標準物先物	買建	98	円	12,479,292,340	12,479,292,340	12,452,860,000	12,452,860,000	55.41
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	511	アメリカドル	55,341,136.48	8,894,427,454	55,467,455.68	8,914,729,476	39.67
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	売建	756	ユーロ	94,892,412.4	17,566,483,383	94,174,920	17,433,661,190	△77.58

	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	LONG GILT FU	買建	496	イギリスポンド	43,847,670	9,485,566,451	43,028,000	9,308,247,240	41.42

(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。

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	39,961,000.00	6,473,635,255	6,415,494,784	28.55
	カナダドル	買建	17,130,000.00	1,981,039,752	1,963,291,565	8.74
	ユーロ	買建	8,772,000.00	1,630,163,106	1,622,921,754	7.22
	イギリスポンド	買建	3,571,000.00	777,712,985	771,627,391	3.43
	スイスフラン	買建	3,994,000.00	801,634,197	796,213,084	3.54
	スウェーデンクローナ	買建	105,962,000.00	1,791,051,910	1,784,506,042	7.94
	ノルウェークローネ	買建	210,490,000.00	3,509,768,325	3,546,209,224	15.78
	オーストラリアドル	買建	19,025,000.00	2,138,249,178	2,146,626,894	9.55
	ニュージーランドドル	買建	42,665,000.00	4,001,429,403	4,023,407,626	17.90
	アメリカドル	売建	29,682,000.00	4,835,497,713	4,765,264,036	△21.20
	カナダドル	売建	26,735,000.00	3,066,332,543	3,064,133,103	△13.63
	ユーロ	売建	7,721,000.00	1,428,798,925	1,428,474,561	△6.36
	イギリスポンド	売建	14,147,000.00	3,066,154,684	3,056,906,392	△13.60
	スイスフラン	売建	24,172,000.00	4,841,733,229	4,818,743,792	△21.44
	スウェーデンクローナ	売建	215,895,000.00	3,605,655,076	3,635,887,695	△16.18
	ノルウェークローネ	売建	11,755,000.00	197,321,931	198,041,184	△0.88
	オーストラリアドル	売建	12,622,000.00	1,434,456,328	1,424,164,238	△6.34
	ニュージーランドドル	売建	17,672,000.00	1,671,899,962	1,666,510,242	△7.42

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

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

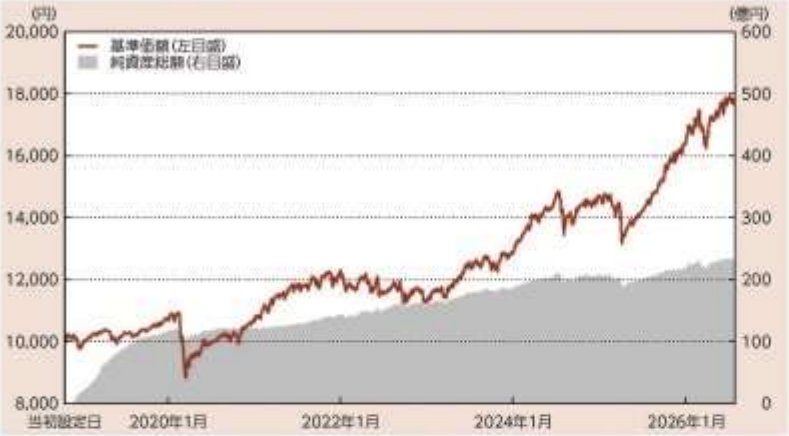
≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2018年10月26日
作成基準日：2026年 7 月31日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	17,585円
純資産総額	228.45億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2022年 7 月	0円
2023年 7 月	0円
2024年 7 月	0円
2025年 7 月	0円
2026年 7 月	0円
設定来分配金合計額	0円

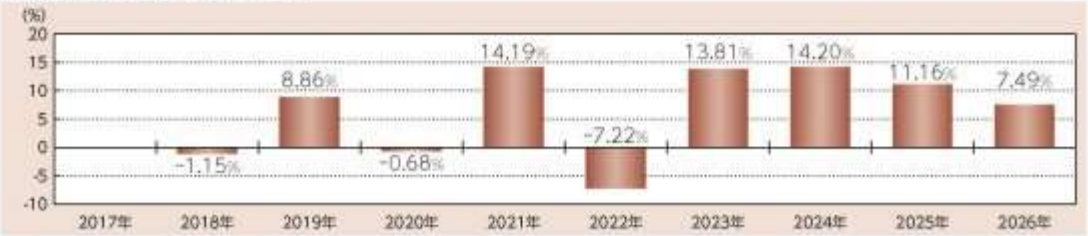
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	8.5%
国内株式インデックス マザーファンド	7.5%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	6.5%
グローバルREITインデックス マザーファンド	6.2%
世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	5.1%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	5.1%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	5.0%
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	4.9%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	3.7%
FI Institutional Global Developed Concentrated Equity Selection Fund JPY Class Shares (unhedged)	3.4%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）



※2018年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2026年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

＜申込手数料＞

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

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜申込受付の中止等＞

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

＜その他＞

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファン

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

＜スイッチング＞

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

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

＜問い合わせ先＞

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

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

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞

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

でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞
受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

＜受付不可日＞
一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜一部解約受付の中止等＞
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。

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

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

＜問い合わせ先＞
上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

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

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

③外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

④マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

⑤マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

・公社債等（仕組債を含みます。）

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

・市場デリバティブ取引

金融商品取引所が発表する計算日の清算値段又は帳入値段で評価します。

・店頭デリバティブ取引

計算日における次のa.又はb.のいずれかの価額で評価します。

a.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

b.価格情報会社の提供する価額

⑥外貨建資産等の円換算

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

仲値によって計算します。

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2018年10月26日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

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

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

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらか

じめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

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

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファン

ドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約
当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

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

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

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

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

４【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2025年7月11日から2026年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （2025年 7月10日現在）	第8期 （2026年 7月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	621,660,122	502,989,923
投資信託受益証券	9,450,830,993	11,339,821,447
投資証券	1,743,984,989	3,198,045,812
親投資信託受益証券	7,394,842,690	8,219,534,993
未収入金	1,111,546,308	186,535,823
未収利息	7,955	13,297
流動資産合計	20,322,873,057	23,446,941,295
資産合計	20,322,873,057	23,446,941,295
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,197,266	31,216,956
未払受託者報酬	5,448,173	6,184,906
未払委託者報酬	144,708,451	164,291,237
その他未払費用	543,908	617,524
流動負債合計	182,897,798	202,310,623
負債合計	182,897,798	202,310,623
純資産の部		
元本等		
元本	14,099,871,629	13,058,735,267
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,040,103,630	10,185,895,405
（分配準備積立金）	4,560,188,717	8,003,195,261
元本等合計	20,139,975,259	23,244,630,672
純資産合計	20,139,975,259	23,244,630,672
負債純資産合計	20,322,873,057	23,446,941,295

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2024年 7月11日 至　2025年 7月10日	第8期 自　2025年 7月11日 至　2026年 7月10日
営業収益		
受取配当金	8,159,946	8,528,489
受取利息	2,073,288	2,687,265
有価証券売買等損益	△409,206,144	5,080,476,066
営業収益合計	△398,972,910	5,091,691,820
営業費用		
受託者報酬	11,094,874	12,051,535
委託者報酬	294,910,682	320,076,053
その他費用	1,108,518	1,203,062
営業費用合計	307,114,074	333,330,650
営業利益又は営業損失（△）	△706,086,984	4,758,361,170
経常利益又は経常損失（△）	△706,086,984	4,758,361,170
当期純利益又は当期純損失（△）	△706,086,984	4,758,361,170
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（△）	△60,357,725	259,414,218
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,798,401,238	6,040,103,630
剰余金増加額又は欠損金減少額	506,260,465	290,674,942
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	506,260,465	290,674,942
剰余金減少額又は欠損金増加額	618,828,814	643,830,119
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	618,828,814	643,830,119
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,040,103,630	10,185,895,405

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第7期 (2025年 7月10日現在)		第8期 (2026年 7月10日現在)	
１． 計算期間の末日における受益権の総数		14,099,871,629口		13,058,735,267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	1.4284円	1口当たり純資産額	1.7800円
	(1万口当たり純資産額)	(14,284円)	(1万口当たり純資産額)	(17,800円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第7期
自 2024年 7月11日
至 2025年 7月10日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	1,582,982,218円
分配準備積立金額	D	4,560,188,717円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,143,170,935円
当ファンドの期末残存口数	F	14,099,871,629口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,356円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第8期
自 2025年 7月11日
至 2026年 7月10日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	161,197,441円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,759,688,689円
収益調整金額	C	2,182,700,144円
分配準備積立金額	D	4,082,309,131円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,185,895,405円
当ファンドの期末残存口数	F	13,058,735,267口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,800円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第8期 自 2025年 7月11日 至 2026年 7月10日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
３.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第8期 (2026年 7月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第7期 自 2024年 7月11日 至 2025年 7月10日	第8期 自 2025年 7月11日 至 2026年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,206,104,792円	14,099,871,629円
期中追加設定元本額	1,192,910,317円	455,396,564円
期中一部解約元本額	1,299,143,480円	1,496,532,926円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第7期 (2025年 7月10日現在)	第8期 (2026年 7月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	335,563,346	1,762,648,090
投資証券	130,257,384	644,104,765
親投資信託受益証券	355,251,385	1,540,057,222
合計	821,072,115	3,946,810,077

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	360,595,519	1,164,687,466	
	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	639,120,534	1,194,963,662	
	L&Gグローバル総合債券ファンド（除く日本）（FOFs用）（適格機関投資家専用）	152,158,631	179,182,003	

	明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	722,860,615	618,624,114	
	ＧＩＭグローバル・セレクト株式ファンドＦＢ（適格機関投資家専用）	60,851	795,261,719	
	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	665,760,189	1,966,122,990	
	ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	542,551,381	476,468,622	
	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	270,480,103	374,128,078	
	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	206,882,381	865,720,011	
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	190,377,381	397,203,367	
	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	249,091,664	285,459,046	
	ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド（適格機関投資家専用）	704,260,412	614,748,913	
	ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	152,055,050	297,526,116	
	FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	315,720,290	1,159,861,629	
	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	883,191,041	754,510,106	
	Global Aggregate Bond Strategy Fund JPY W Class	161,944,463	195,353,605	
投資信託受益証券合計		6,217,110,505	11,339,821,447	
投資証券	MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	7,584	74,535,552	
	FI Institutional Global Developed Concentrated Equity Selection Fund JPY Class Shares (unhedged)	50,329.073	792,817,278	
	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	26,183.224	285,573,616	
	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	366,823.104	1,606,318,372	
	JPMorgan Funds - Europe Equity Absolute Alpha Fund Class I (perf) (acc) - JPY (hedged)	16,679.593	167,546,511	
	MA Hedge Fund Strategies Limited	25,799	271,254,483	
投資証券合計		493,397.994	3,198,045,812	
親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	284,450,348	676,593,597	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	347,052,224	1,396,260,507	
	新興国株式インデックス　マザーファンド	49,994,402	391,371,177	
	国内株式インデックス　マザーファンド	393,939,581	1,733,649,308	
	外国株式インデックス　マザーファンド	40,590,185	403,247,251	
	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	544,059,998	482,962,060	
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	432,818,039	979,813,476	

	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	246,422,454	280,280,899	
	日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	119,358,366	288,847,245	
	外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	156,604,457	402,583,077	
	ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	141,553,087	151,362,715	
	世界債券総合インデックスマザーファンド	547,766,407	746,550,836	
	日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド	26,642,526	286,012,845	
親投資信託受益証券合計		3,331,252,074	8,219,534,993	
合計			22,757,402,252	

(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

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	32,849,336,229
株式	997,722,383,380
派生商品評価勘定	398,351,600
未収入金	194,908,406
未収配当金	964,057,443
未収利息	868,464
その他未収収益	68,618,403
差入委託証拠金	885,921,595
流動資産合計	1,033,084,445,520
資産合計	1,033,084,445,520
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,231,550
前受金	393,301,000
未払解約金	1,304,818,725
未払利息	5,141,065
受入担保金	19,807,956,733
流動負債合計	21,516,449,073
負債合計	21,516,449,073
純資産の部	
元本等	
元本	229,861,235,567
剰余金	

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（△）	781,706,760,880
元本等合計	1,011,567,996,447
純資産合計	1,011,567,996,447
負債純資産合計	1,033,084,445,520

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2026年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		229,861,235,567口
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券		
	株式	18,858,150,020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	4.4008円
	(1万口当たり純資産額)	(44,008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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2026年 7月10日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	251,300,064,379円
期中追加設定元本額	16,907,347,710円
期中一部解約元本額	38,346,176,522円
期末元本額	229,861,235,567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）	156,762,373円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,342,899,350円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	8,783,244円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	8,908,905,908円
世界経済インデックスファンド	6,685,874,016円
日本株式インデックス・オープン	2,351,243,717円
ＤＣマイセレクション２５	3,184,110,242円
ＤＣマイセレクション５０	12,101,957,546円
ＤＣマイセレクション７５	15,827,702,943円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,690,810,957円
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,810,346,868円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,676,241,078円
ＤＣマイセレクションＳ７５	11,155,151,149円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	9,948,021,552円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	351,786,677円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	339,773,573円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,546,412,740円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	104,361,220円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,957,022円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,833,020円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	12,523,560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）	41,295,031円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,522,759円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,824,220円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	25,767,660円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	6,523,308円

区分	2026年 7月10日現在
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	25,587,352円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	126,514,089円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	167,475,935円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,230,117,312円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	15,737,800円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	4,231,357円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	155,289,588円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	87,105,893円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	117,800,434円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	8,173,975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）	237,189,173円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	2,028,689,472円
日本株式ファンド・シリーズ２	2,534,758,074円
コア投資戦略ファンド（安定型）	390,714,912円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,017,340,392円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,307,700,360円
分散投資コア戦略ファンドＳ	4,932,035,213円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	724,054,295円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	340,940,440円
コア投資戦略ファンド（切替型）	396,572,137円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	156,614,515円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	7,295,165円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	32,981,361円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	20,096,094,007円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	149,805,222円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	52,199,258円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	271,363,100円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	37,847,801円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	13,647,377円
グローバル経済コア	843,799,844円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	36,514,615円
Ｍｙ　ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	5,867,238,462円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	28,467,961円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	393,939,581円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	116,397,477円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	76,288,123円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	97,499,709円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	51,937,510円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	71,716,927円
１０資産分散投資ファンド	81,221,600円
グローバル１０資産バランスファンド	68,996,525円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	34,666,151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	149,351,273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	57,660,188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	47,719,280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	42,712,722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	20,767,573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	6,673,788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	4,698,314円
ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型）	1,580,185,441円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０６５	313,505円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０７０	60,870円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０７５	37,166円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０７０	92,440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）	39,878,913,170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）	161,151,354円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	280,312,497円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	15,210,715円
ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用）	45,942,006,944円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	11,908,665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）	218,436,800円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ１（適格機関投資家専用）	26,836円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ２（適格機関投資家専用）	22,206円

区分	2026年 7月10日現在
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ３（適格機関投資家専用）	29,422円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ４（適格機関投資家専用）	31,413円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ５（適格機関投資家専用）	22,023円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ６（適格機関投資家専用）	24,194円
国内株式インデックスファンドＴ（一般投資家私募／適格機関投資家転売制限付）	1,715,914,541円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	19,567,729,535
合計	19,567,729,535

(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

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	12,957,519,000	－	13,350,820,000	393,301,000
合計		12,957,519,000	－	13,350,820,000	393,301,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額 単価(円)	評価額 金額(円)	備考
極洋	10,400	4,505.00	46,852,000	
ニッスイ	227,600	1,262.50	287,345,000	
Ｕｍｉｏｓ	120,600	1,310.00	157,986,000	
ユキグニファクトリー	21,100	1,163.00	24,539,300	
カネコ種苗	7,000	1,498.00	10,486,000	
サカタのタネ	30,100	4,290.00	129,129,000	
ホクト	22,100	1,915.00	42,321,500	
住石ホールディングス	22,200	577.00	12,809,400	貸付有価証券 17,100株
日鉄鉱業	47,700	2,417.00	115,290,900	
ＩＮＰＥＸ	833,800	3,361.00	2,802,401,800	
石油資源開発	153,200	1,661.00	254,465,200	

Ｋ＆Ｏエナジーグループ	22,600	1,846.00	41,719,600	
ショーボンドホールディングス	145,000	1,264.00	183,280,000	
ミライト・ワン	84,700	3,750.00	317,625,000	
タマホーム	15,600	3,020.00	47,112,000	貸付有価証券 12,000株
第一カッター興業	6,400	1,425.00	9,120,000	
安藤・間	131,900	1,813.00	239,134,700	
東急建設	77,800	1,193.00	92,815,400	
コムシスホールディングス	78,100	5,332.00	416,429,200	
高松コンストラクショングループ	18,400	3,620.00	66,608,000	
東建コーポレーション	5,400	12,980.00	70,092,000	
ヤマウラ	13,900	1,492.00	20,738,800	
オリエンタル白石	91,900	361.00	33,175,900	
大成建設	129,700	13,950.00	1,809,315,000	
大林組	549,700	3,225.00	1,772,782,500	
清水建設	474,600	2,492.50	1,182,940,500	
長谷工コーポレーション	154,900	2,788.50	431,938,650	
松井建設	14,100	1,460.00	20,586,000	
鹿島建設	385,100	5,760.00	2,218,176,000	
不動テトラ	9,800	2,715.00	26,607,000	
鉄建建設	10,900	4,520.00	49,268,000	
西松建設	27,700	5,368.00	148,693,600	
大豊建設	23,900	820.00	19,598,000	
奥村組	28,200	5,650.00	159,330,000	
東鉄工業	19,100	4,215.00	80,506,500	
淺沼組	69,500	853.00	59,283,500	
戸田建設	210,600	1,558.00	328,114,800	
熊谷組	103,200	1,484.00	153,148,800	
矢作建設工業	32,500	1,862.00	60,515,000	
ピーエス・コンストラクション	15,700	2,163.00	33,959,100	
日本ハウスホールディングス	37,100	311.00	11,538,100	貸付有価証券 28,300株
新日本建設	24,400	2,094.00	51,093,600	
東亜道路工業	26,700	1,586.00	42,346,200	
東亜建設工業	64,100	2,045.00	131,084,500	
日本国土開発	53,200	539.00	28,674,800	
若築建設	5,100	3,380.00	17,238,000	
五洋建設	246,200	1,628.00	400,813,600	
世紀東急工業	27,300	1,468.00	40,076,400	
福田組	11,800	3,760.00	44,368,000	
住友林業	450,600	1,321.00	595,242,600	
大和ハウス工業	480,500	4,506.00	2,165,133,000	
ライト工業	31,300	4,045.00	126,608,500	

積水ハウス	517,600	3,455.00	1,788,308,000	
日特建設	16,600	1,127.00	18,708,200	
北陸電気工事	9,900	1,632.00	16,156,800	
ユアテック	36,700	2,401.00	88,116,700	
日本リーテック	13,300	2,578.00	34,287,400	
四電工	21,800	2,000.00	43,600,000	
中電工	23,100	5,180.00	119,658,000	
関電工	95,200	6,351.00	604,615,200	
きんでん	119,200	7,634.00	909,972,800	
東京エネシス	15,400	2,054.00	31,631,600	
トーエネック	33,600	2,187.00	73,483,200	
日本電設工業	32,600	4,160.00	135,616,000	
エクシオグループ	163,400	2,683.50	438,483,900	
新日本空調	22,500	3,580.00	80,550,000	
クラフティア	37,500	8,800.00	330,000,000	
三機工業	106,600	2,650.00	282,490,000	
日揮ホールディングス	177,900	2,335.50	415,485,450	
中外炉工業	4,600	4,050.00	18,630,000	
太平電業	34,500	2,529.00	87,250,500	
高砂熱学工業	93,000	4,795.00	445,935,000	
朝日工業社	18,000	4,450.00	80,100,000	
明星工業	29,200	1,837.00	53,640,400	
大氣社	42,000	4,785.00	200,970,000	
ダイダン	100,400	2,774.00	278,509,600	
日比谷総合設備	23,300	2,965.00	69,084,500	
飛島ホールディングス	17,800	2,028.00	36,098,400	
フィル・カンパニー	3,000	743.00	2,229,000	貸付有価証券 2,300株
テスホールディングス	42,400	791.00	33,538,400	貸付有価証券 32,400株
インフロニア・ホールディングス	182,000	2,844.50	517,699,000	
東洋エンジニアリング	31,400	1,937.00	60,821,800	貸付有価証券 19,700株
レイズネクスト	25,100	2,434.00	61,093,400	
ニップン	61,700	2,810.00	173,377,000	
日清製粉グループ本社	168,100	2,003.50	336,788,350	
日東富士製粉	12,400	1,778.00	22,047,200	
昭和産業	14,700	3,485.00	51,229,500	
中部飼料	22,100	1,907.00	42,144,700	
フィード・ワン	22,900	1,261.00	28,876,900	
日本甜菜製糖	7,600	4,720.00	35,872,000	貸付有価証券 5,800株
ＤＭ三井製糖	14,500	3,315.00	48,067,500	
ウェルネオシュガー	9,800	2,693.00	26,391,400	

森永製菓	68,400	2,656.00	181,670,400	
中村屋	4,400	3,220.00	14,168,000	貸付有価証券 1,000株
江崎グリコ	49,900	5,185.00	258,731,500	貸付有価証券 38,000株
ｍｅｉｔｏ	7,400	3,110.00	23,014,000	貸付有価証券 5,800株
井村屋グループ	9,500	2,394.00	22,743,000	
不二家	11,900	2,434.00	28,964,600	貸付有価証券 8,600株
山崎製パン	116,700	3,176.00	370,639,200	
モロゾフ	16,300	1,560.00	25,428,000	貸付有価証券 13,000株
亀田製菓	33,200	1,263.00	41,931,600	
寿スピリッツ	92,800	2,608.50	242,068,800	貸付有価証券 62,400株
カルビー	79,800	2,959.00	236,128,200	
森永乳業	251,200	1,258.00	316,009,600	
六甲バター	14,200	1,125.00	15,975,000	
ヤクルト本社	224,500	2,840.50	637,692,250	
明治ホールディングス	242,900	3,771.00	915,975,900	
雪印メグミルク	42,300	3,665.00	155,029,500	
プリマハム	23,400	2,402.00	56,206,800	
日本ハム	62,400	6,166.00	384,758,400	
丸大食品	17,500	2,251.00	39,392,500	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	19,200	2,740.00	52,608,000	
柿安本店	6,800	2,557.00	17,387,600	貸付有価証券 5,700株
伊藤ハム米久ホールディングス	30,400	4,820.00	146,528,000	
サッポロビール	260,900	1,993.50	520,104,150	
アサヒグループホールディングス	1,309,300	1,581.00	2,070,003,300	
キリンホールディングス	648,400	2,837.00	1,839,510,800	
シマダヤ	7,500	1,684.00	12,630,000	貸付有価証券 5,700株
宝ホールディングス	143,700	2,101.50	301,985,550	
オエノンホールディングス	52,100	509.00	26,518,900	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	113,400	4,104.00	465,393,600	
ライフドリンク　カンパニー	31,200	1,490.00	46,488,000	
サントリービバレッジ＆フード	122,800	4,547.00	558,371,600	
ダイドーグループホールディングス	19,700	2,764.00	54,450,800	貸付有価証券 15,100株
伊藤園	56,400	2,942.00	165,928,800	
キーコーヒー	19,500	1,989.00	38,785,500	貸付有価証券 15,000株
日清オイリオグループ	69,400	1,873.00	129,986,200	

不二製油	34,800	3,986.00	138,712,800	
Ｊ－オイルミルズ	19,900	2,096.00	41,710,400	
キッコーマン	577,700	1,619.00	935,296,300	
味の素	841,700	5,731.00	4,823,782,700	
ブルドックソース	8,700	1,806.00	15,712,200	貸付有価証券 6,700株
キユーピー	93,700	4,380.00	410,406,000	
ハウス食品グループ本社	65,200	3,829.00	249,650,800	
カゴメ	90,500	2,677.00	242,268,500	
アリアケジャパン	19,500	5,150.00	100,425,000	
エバラ食品工業	4,400	2,487.00	10,942,800	貸付有価証券 3,300株
ニチレイ	153,200	2,134.00	326,928,800	
東洋水産	80,800	10,510.00	849,208,000	
イートアンドホールディングス	8,300	2,035.00	16,890,500	貸付有価証券 6,900株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	12,700	661.00	8,394,700	貸付有価証券 9,700株
日清食品ホールディングス	197,100	2,794.50	550,795,950	貸付有価証券 5,800株
フジッコ	19,900	1,547.00	30,785,300	貸付有価証券 1,100株
ロック・フィールド	19,500	1,363.00	26,578,500	貸付有価証券 15,000株
日本たばこ産業	1,059,500	6,117.00	6,480,961,500	
ケンコーマヨネーズ	10,900	2,098.00	22,868,200	
わらべや日洋ホールディングス	11,700	2,631.00	30,782,700	
なとり	10,900	1,980.00	21,582,000	貸付有価証券 8,300株
ファーマフーズ	21,200	618.00	13,101,600	貸付有価証券 17,700株
ユーグレナ	117,600	345.00	40,572,000	貸付有価証券 90,300株
紀文食品	15,100	1,079.00	16,292,900	貸付有価証券 7,600株
ピックルスホールディングス	10,200	1,146.00	11,689,200	貸付有価証券 2,900株
オリオンビール	28,600	1,241.00	35,492,600	貸付有価証券 21,800株
理研ビタミン	15,200	3,135.00	47,652,000	
片倉工業	18,600	2,584.00	48,062,400	
グンゼ	25,100	3,980.00	99,898,000	
ユニチカ	61,200	934.00	57,160,800	貸付有価証券 47,000株
富士紡ホールディングス	24,800	3,860.00	95,728,000	
倉敷紡績	12,400	10,020.00	124,248,000	
シキボウ	11,900	1,048.00	12,471,200	
日本毛織	44,300	1,850.00	81,955,000	

帝国繊維	18,200	3,445.00	62,699,000	
帝人	157,300	1,662.50	261,511,250	
東レ	1,195,500	1,142.50	1,365,858,750	
セーレン	38,500	3,205.00	123,392,500	
小松マテーレ	23,400	718.00	16,801,200	
ワコールホールディングス	34,800	4,413.00	153,572,400	
ＴＳＩホールディングス	46,200	1,204.00	55,624,800	
ワールド	58,600	1,590.00	93,174,000	
三陽商会	8,300	4,235.00	35,150,500	貸付有価証券 6,300株
オンワードホールディングス	103,400	722.00	74,654,800	
ルックホールディングス	5,700	2,664.00	15,184,800	貸付有価証券 4,200株
ゴールドウイン	103,700	2,241.50	232,443,550	
特種東海製紙	31,000	1,953.00	60,543,000	
王子ホールディングス	605,300	816.10	493,985,330	
日本製紙	100,100	1,327.00	132,832,700	
北越コーポレーション	86,400	865.00	74,736,000	貸付有価証券 66,000株
大王製紙	89,500	921.00	82,429,500	
レンゴー	179,500	1,412.50	253,543,750	
トーモク	10,200	4,115.00	41,973,000	
ザ・パック	35,600	1,343.00	47,810,800	貸付有価証券 3,100株
北の達人コーポレーション	74,700	126.00	9,412,200	貸付有価証券 57,100株
東洋紡	76,700	1,727.00	132,460,900	
クラレ	224,300	1,686.00	378,169,800	
旭化成	1,175,700	1,842.00	2,165,639,400	
レゾナック・ホールディングス	171,400	16,150.00	2,768,110,000	
住友化学	1,427,200	537.20	766,691,840	
住友精化	36,900	1,266.00	46,715,400	
日産化学	89,300	8,100.00	723,330,000	
ラサ工業	28,900	1,945.00	56,210,500	貸付有価証券 22,000株
クレハ	26,400	4,120.00	108,768,000	貸付有価証券 20,200株
多木化学	6,900	4,775.00	32,947,500	
テイカ	12,600	2,297.00	28,942,200	
石原産業	29,400	2,767.00	81,349,800	
日本曹達	36,600	3,640.00	133,224,000	
東ソー	258,300	2,705.00	698,701,500	
トクヤマ	62,100	4,652.00	288,889,200	
セントラル硝子	22,400	4,165.00	93,296,000	
東亜合成	71,500	1,724.00	123,266,000	

大阪ソーダ	62,000	1,802.00	111,724,000	
関東電化工業	34,300	3,070.00	105,301,000	
デンカ	70,400	3,913.00	275,475,200	
信越化学工業	1,577,300	7,320.00	11,545,836,000	
日本カーバイド工業	8,700	3,315.00	28,840,500	
堺化学工業	13,800	4,115.00	56,787,000	
第一稀元素化学工業	17,700	1,948.00	34,479,600	貸付有価証券 13,400株
日本酸素ホールディングス	200,700	6,072.00	1,218,650,400	
日本化学工業	7,100	4,220.00	29,962,000	貸付有価証券 5,300株
日本パーカライジング	87,800	1,671.00	146,713,800	
高圧ガス工業	25,800	1,135.00	29,283,000	
四国化成ホールディングス	40,000	3,020.00	120,800,000	
戸田工業	4,000	1,503.00	6,012,000	貸付有価証券 3,000株
ステラ　ケミファ	9,400	5,770.00	54,238,000	
保土谷化学工業	11,100	2,047.00	22,721,700	
日本触媒	109,300	2,070.00	226,251,000	
大日精化工業	47,800	1,078.00	51,528,400	
カネカ	41,700	5,626.00	234,604,200	
三菱瓦斯化学	126,200	4,685.00	591,247,000	
三井化学	319,200	2,088.00	666,489,600	
東京応化工業	84,600	10,365.00	876,879,000	
大阪有機化学工業	14,800	5,100.00	75,480,000	
三菱ケミカルグループ	1,240,800	1,161.50	1,441,189,200	
ＫＨネオケム	29,500	2,941.00	86,759,500	
ダイセル	194,400	1,402.50	272,646,000	
住友ベークライト	58,400	7,200.00	420,480,000	
積水化学工業	349,000	2,609.50	910,715,500	
日本ゼオン	124,700	2,249.00	280,450,300	
アイカ工業	44,800	3,670.00	164,416,000	
ＵＢＥ	91,400	3,147.00	287,635,800	
積水樹脂	21,000	2,653.00	55,713,000	
旭有機材	11,800	6,500.00	76,700,000	
ニチバン	11,000	1,897.00	20,867,000	貸付有価証券 8,300株
リケンテクノス	30,600	1,795.00	54,927,000	
大倉工業	9,000	4,975.00	44,775,000	
積水化成品工業	28,000	521.00	14,588,000	
群栄化学工業	4,200	4,625.00	19,425,000	
ダイキョーニシカワ	37,600	995.00	37,412,000	
森六	9,500	2,411.00	22,904,500	
恵和	11,500	1,213.00	13,949,500	

日本化薬	127,100	1,982.50	251,975,750	
カーリット	15,200	2,364.00	35,932,800	貸付有価証券 11,700株
日本精化	11,000	2,599.00	28,589,000	
扶桑化学工業	56,400	4,040.00	227,856,000	
トリケミカル研究所	21,500	3,325.00	71,487,500	
ＡＤＥＫＡ	68,700	4,179.00	287,097,300	
日油	203,600	2,739.00	557,660,400	
ハリマ化成グループ	13,800	1,037.00	14,310,600	
花王	841,000	3,219.00	2,707,179,000	貸付有価証券 642,600株
第一工業製薬	7,100	10,810.00	76,751,000	
石原ケミカル	7,500	3,115.00	23,362,500	貸付有価証券 200株
三洋化成工業	10,900	4,875.00	53,137,500	
大日本塗料	19,600	1,410.00	27,636,000	
日本ペイントホールディングス	941,800	1,076.50	1,013,847,700	
関西ペイント	141,400	2,675.50	378,315,700	貸付有価証券 10,100株
中国塗料	36,400	3,535.00	128,674,000	
藤倉化成	20,400	998.00	20,359,200	
太陽ホールディングス	85,100	4,865.00	414,011,500	
ＤＩＣ	63,000	4,660.00	293,580,000	貸付有価証券 48,200株
サカタインクス	39,500	2,401.00	94,839,500	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	33,300	4,350.00	144,855,000	
富士フイルムホールディングス	1,070,800	3,586.00	3,839,888,800	
資生堂	344,300	2,755.00	948,546,500	
ライオン	203,800	1,671.50	340,651,700	
高砂香料工業	66,700	1,161.00	77,438,700	
ミルボン	27,800	2,774.00	77,117,200	
コーセーホールディングス	40,100	5,218.00	209,241,800	
コタ	19,300	1,184.00	22,851,200	貸付有価証券 14,700株
ポーラ・オルビスホールディングス	91,000	1,308.50	119,073,500	貸付有価証券 69,600株
ノエビアホールディングス	15,800	4,530.00	71,574,000	
新日本製薬	10,100	2,012.00	20,321,200	貸付有価証券 7,800株
Ｉ－ｎｅ	4,700	1,210.00	5,687,000	貸付有価証券 3,600株
アクシージア	9,600	351.00	3,369,600	貸付有価証券 7,300株
エステー	15,900	1,517.00	24,120,300	
コニシ	56,000	1,451.00	81,256,000	
長谷川香料	33,900	3,225.00	109,327,500	

小林製薬	46,500	5,545.00	257,842,500	
荒川化学工業	15,000	2,272.00	34,080,000	
メック	12,900	9,240.00	119,196,000	
日本高純度化学	4,400	5,120.00	22,528,000	貸付有価証券 3,300株
ＪＣＵ	19,100	7,000.00	133,700,000	
ＯＡＴアグリオ	6,600	2,534.00	16,724,400	
デクセリアルズ	150,400	4,139.00	622,505,600	
アース製薬	16,100	4,685.00	75,428,500	
北興化学工業	12,700	2,082.00	26,441,400	
大成ラミックグループ	5,100	2,468.00	12,586,800	
クミアイ化学工業	79,400	723.00	57,406,200	
日本農薬	27,100	1,014.00	27,479,400	
アキレス	9,600	1,214.00	11,654,400	
有沢製作所	31,200	2,507.00	78,218,400	
日東電工	539,300	3,193.00	1,721,984,900	
レック	17,700	964.00	17,062,800	貸付有価証券 13,500株
三光合成	22,300	767.00	17,104,100	
ＺＡＣＲＯＳ	56,100	1,320.00	74,052,000	
未来工業	8,500	3,215.00	27,327,500	貸付有価証券 6,400株
ＪＳＰ	10,400	2,450.00	25,480,000	貸付有価証券 7,900株
エフピコ	33,600	2,519.00	84,638,400	
信越ポリマー	38,300	2,442.00	93,528,600	
ニフコ	66,400	5,089.00	337,909,600	
バルカー	14,800	6,780.00	100,344,000	
ユニ・チャーム	1,110,000	943.00	1,046,730,000	
協和キリン	208,800	2,641.00	551,440,800	
武田薬品工業	1,580,500	5,359.00	8,469,899,500	
アステラス製薬	1,557,800	2,142.00	3,336,807,600	
住友ファーマ	178,500	1,400.00	249,900,000	
塩野義製薬	648,000	2,832.50	1,835,460,000	
日本新薬	46,500	4,082.00	189,813,000	
中外製薬	555,900	7,389.00	4,107,545,100	
科研製薬	26,300	3,840.00	100,992,000	
エーザイ	231,700	4,296.00	995,383,200	
ロート製薬	187,700	2,430.00	456,111,000	
小野薬品工業	396,300	2,428.00	962,216,400	
持田製薬	21,700	3,135.00	68,029,500	
参天製薬	298,800	2,135.00	637,938,000	
扶桑薬品工業	6,900	2,156.00	14,876,400	貸付有価証券 5,200株

ツムラ	61,000	3,820.00	233,020,000	
キッセイ薬品工業	27,700	4,100.00	113,570,000	
生化学工業	30,100	725.00	21,822,500	
栄研化学	25,100	2,532.00	63,553,200	
ＪＣＲファーマ	77,300	477.00	36,872,100	
東和薬品	23,900	4,025.00	96,197,500	
富士製薬工業	13,100	1,894.00	24,811,400	
ゼリア新薬工業	23,200	2,080.00	48,256,000	
ネクセラファーマ	77,900	919.00	71,590,100	
第一三共	1,630,700	2,730.50	4,452,626,350	
杏林製薬	35,700	1,179.00	42,090,300	
大幸薬品	36,900	269.00	9,926,100	貸付有価証券 28,900株
ダイト	21,900	1,250.00	27,375,000	
大塚ホールディングス	395,500	11,185.00	4,423,667,500	
ペプチドリーム	86,100	1,019.00	87,735,900	
セルソース	10,500	347.00	3,643,500	
あすか製薬ホールディングス	17,100	2,259.00	38,628,900	
サワイグループホールディングス	91,800	1,673.00	153,581,400	
日本コークス工業	180,200	93.00	16,758,600	貸付有価証券 137,800株
ニチレキグループ	18,800	2,117.00	39,799,600	
ユシロ	9,200	3,355.00	30,866,000	
出光興産	729,000	1,240.00	903,960,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,509,300	1,252.00	3,141,643,600	
コスモエネルギーホールディングス	98,400	3,861.00	379,922,400	
横浜ゴム	99,200	7,564.00	750,348,800	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	112,300	3,905.00	438,531,500	
ブリヂストン	971,700	3,569.00	3,467,997,300	
住友ゴム工業	191,600	2,214.00	424,202,400	
藤倉コンポジット	14,600	2,584.00	37,726,400	
オカモト	9,400	5,470.00	51,418,000	
フコク	8,400	1,848.00	15,523,200	
ニッタ	17,400	6,310.00	109,794,000	
三ツ星ベルト	22,600	3,955.00	89,383,000	
バンドー化学	26,300	2,240.00	58,912,000	
日東紡績	112,500	3,445.00	387,562,500	
ＡＧＣ	172,800	6,426.00	1,110,412,800	
日本板硝子	98,900	482.00	47,669,800	
日本電気硝子	59,300	5,927.00	351,471,100	
オハラ	6,700	1,450.00	9,715,000	貸付有価証券 300株
住友大阪セメント	29,700	5,405.00	160,528,500	

太平洋セメント	109,600	3,904.00	427,878,400	
日本ヒューム	31,100	1,036.00	32,219,600	貸付有価証券 23,700株
日本コンクリート工業	34,400	340.00	11,696,000	貸付有価証券 26,400株
三谷セキサン	29,100	1,721.00	50,081,100	
アジアパイルホールディングス	27,700	1,490.00	41,273,000	
東海カーボン	178,700	1,671.50	298,697,050	
日本カーボン	10,200	4,730.00	48,246,000	
東洋炭素	15,200	7,080.00	107,616,000	貸付有価証券 5,800株
ノリタケ	37,200	3,640.00	135,408,000	
ＴＯＴＯ	110,200	8,059.00	888,101,800	
ＮＧＫ	193,500	7,061.00	1,366,303,500	
日本特殊陶業	145,100	10,425.00	1,512,667,500	
ＭＡＲＵＷＡ	7,400	61,550.00	455,470,000	
品川リフラ	21,800	1,962.00	42,771,600	
ヨータイ	10,400	1,759.00	18,293,600	
フジミインコーポレーテッド	53,000	4,165.00	220,745,000	
ニチアス	139,100	3,709.00	515,921,900	
ニチハ	20,500	2,930.00	60,065,000	
日本製鉄	4,981,500	550.20	2,740,821,300	
神戸製鋼所	367,400	1,860.00	683,364,000	
中山製鋼所	37,600	630.00	23,688,000	
合同製鐵	10,200	2,693.00	27,468,600	貸付有価証券 7,800株
ＪＦＥホールディングス	592,800	1,623.00	962,114,400	
東京製鐵	51,000	1,717.00	87,567,000	
共英製鋼	20,800	1,807.00	37,585,600	
大和工業	32,800	12,410.00	407,048,000	
東京鐵鋼	20,100	1,911.00	38,411,100	貸付有価証券 16,800株
大阪製鐵	8,400	2,526.00	21,218,400	貸付有価証券 6,400株
ヨドコウ	103,500	1,312.00	135,792,000	
中部鋼鈑	16,600	2,046.00	33,963,600	貸付有価証券 12,700株
丸一鋼管	183,600	1,783.50	327,450,600	
モリ工業	20,500	943.00	19,331,500	
大同特殊鋼	129,500	2,509.50	324,980,250	
日本冶金工業	12,300	4,925.00	60,577,500	
愛知製鋼	34,200	3,025.00	103,455,000	貸付有価証券 26,000株
大平洋金属	15,500	2,259.00	35,014,500	貸付有価証券 11,800株
新日本電工	100,100	427.00	42,742,700	

栗本鐵工所	42,400	1,453.00	61,607,200	
三菱製鋼	12,400	2,107.00	26,126,800	
日本精線	14,400	1,438.00	20,707,200	
エンビプロ・ホールディングス	16,000	800.00	12,800,000	貸付有価証券 12,200株
ＪＸ金属	699,700	3,962.00	2,772,211,400	貸付有価証券 386,600株
大紀アルミニウム工業所	26,400	1,472.00	38,860,800	
日本軽金属ホールディングス	53,600	2,707.00	145,095,200	
三井金属	45,600	36,460.00	1,662,576,000	
三菱マテリアル	122,100	4,087.00	499,022,700	貸付有価証券 93,000株
住友金属鉱山	250,400	7,275.00	1,821,660,000	
ＤＯＷＡホールディングス	49,300	8,376.00	412,936,800	
古河機械金属	19,600	3,585.00	70,266,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	32,000	2,532.00	81,024,000	貸付有価証券 24,800株
ＵＡＣＪ	110,700	2,524.00	279,406,800	
ＣＫサンエツ	4,600	5,310.00	24,426,000	貸付有価証券 3,600株
古河電気工業	608,000	3,725.00	2,264,800,000	
住友電気工業	2,523,600	2,582.00	6,515,935,200	
フジクラ	1,410,700	5,150.00	7,265,105,000	
ＳＷＣＣ	26,600	11,710.00	311,486,000	
平河ヒューテック	11,300	3,355.00	37,911,500	
リョービ	21,400	2,531.00	54,163,400	
ＡＲＥホールディングス	80,800	2,953.00	238,602,400	
稲葉製作所	9,000	1,762.00	15,858,000	貸付有価証券 6,800株
宮地エンジニアリンググループ	23,800	1,549.00	36,866,200	貸付有価証券 18,200株
トーカロ	52,700	3,075.00	162,052,500	
ＳＵＭＣＯ	347,800	5,244.00	1,823,863,200	
川田テクノロジーズ	41,600	1,336.00	55,577,600	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	12,300	7,930.00	97,539,000	
東洋製罐グループホールディングス	91,300	4,027.00	367,665,100	
ホッカンホールディングス	9,800	2,335.00	22,883,000	
コロナ	10,200	1,016.00	10,363,200	貸付有価証券 6,000株
横河ブリッジホールディングス	31,400	2,858.00	89,741,200	
三和ホールディングス	175,600	3,670.00	644,452,000	
文化シヤッター	57,400	1,916.00	109,978,400	
三協立山	23,000	649.00	14,927,000	
アルインコ	13,900	1,098.00	15,262,200	
ＬＩＸＩＬ	285,600	1,838.50	525,075,600	

ノーリツ	32,200	2,305.00	74,221,000	
長府製作所	18,100	1,967.00	35,602,700	
リンナイ	93,400	3,561.00	332,597,400	
日東精工	23,800	786.00	18,706,800	
岡部	31,300	901.00	28,201,300	
ジーテクト	23,300	2,080.00	48,464,000	
東プレ	32,200	2,594.00	83,526,800	
高周波熱錬	26,100	1,313.00	34,269,300	
東京製綱	10,800	1,985.00	21,438,000	
サンコール	18,000	1,569.00	28,242,000	貸付有価証券 13,700株
パイオラックス	19,600	1,651.00	32,359,600	貸付有価証券 2,500株
エイチワン	18,800	1,618.00	30,418,400	
日本発條	137,700	3,816.00	525,463,200	
中央発條	11,800	3,720.00	43,896,000	貸付有価証券 9,100株
立川ブラインド工業	9,300	2,515.00	23,389,500	
ＧＭＳグループ	23,500	360.00	8,460,000	
日本製鋼所	54,200	7,815.00	423,573,000	
前澤ホールディングス	12,700	1,517.00	19,265,900	
三浦工業	83,000	3,211.00	266,513,000	
タクマ	50,100	3,480.00	174,348,000	
ツガミ	38,100	7,810.00	297,561,000	
オークマ	31,300	5,080.00	159,004,000	
芝浦機械	21,300	4,770.00	101,601,000	
アマダ	252,200	3,013.00	759,878,600	
アイダエンジニアリング	31,600	1,180.00	37,288,000	
ＦＵＪＩ	71,300	8,248.00	588,082,400	
牧野フライス製作所	18,100	14,960.00	270,776,000	貸付有価証券 13,800株
オーエスジー	63,700	3,777.00	240,594,900	貸付有価証券 49,100株
旭ダイヤモンド工業	41,700	1,186.00	49,456,200	貸付有価証券 33,000株
ＤＭＧ森精機	122,500	3,755.00	459,987,500	
ソディック	43,500	1,900.00	82,650,000	
ディスコ	86,200	72,560.00	6,254,672,000	
日東工器	6,300	1,751.00	11,031,300	
日進工具	14,900	965.00	14,378,500	
冨士ダイス	13,200	990.00	13,068,000	貸付有価証券 200株
リケンＮＰＲ	20,500	3,905.00	80,052,500	
島精機製作所	27,600	910.00	25,116,000	貸付有価証券 21,100株

オプトラン	29,400	3,620.00	106,428,000	
イワキポンプ	11,900	4,505.00	53,609,500	
フリュー	18,700	1,395.00	26,086,500	
ヤマシンフィルタ	37,000	508.00	18,796,000	貸付有価証券 29,100株
日阪製作所	20,900	1,723.00	36,010,700	
やまびこ	29,200	3,780.00	110,376,000	
野村マイクロ・サイエンス	32,300	4,625.00	149,387,500	貸付有価証券 24,600株
平田機工	25,600	3,075.00	78,720,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	19,700	545.00	10,736,500	貸付有価証券 15,000株
マルマエ	13,700	2,215.00	30,345,500	貸付有価証券 10,600株
タツモ	11,800	5,210.00	61,478,000	
ナブテスコ	101,600	5,428.00	551,484,800	
三井海洋開発	45,300	9,871.00	447,156,300	
レオン自動機	20,700	1,520.00	31,464,000	
ＳＭＣ	50,800	75,570.00	3,838,956,000	
ホソカワミクロン	13,500	5,040.00	68,040,000	
ユニオンツール	7,900	20,970.00	165,663,000	貸付有価証券 6,000株
瑞光	15,200	899.00	13,664,800	貸付有価証券 11,600株
オイレス工業	22,000	2,871.00	63,162,000	
日精エー・エス・ビー機械	6,900	9,900.00	68,310,000	
サトー	24,500	2,395.00	58,677,500	
技研製作所	16,100	1,885.00	30,348,500	貸付有価証券 12,900株
日本エアーテック	8,400	1,350.00	11,340,000	
ワイエイシイホールディングス	15,500	1,281.00	19,855,500	貸付有価証券 11,800株
小松製作所	862,500	6,395.00	5,515,687,500	
住友重機械工業	105,800	5,284.00	559,047,200	
日立建機	71,200	5,247.00	373,586,400	
日工	34,400	951.00	32,714,400	
巴工業	19,800	1,901.00	37,639,800	
井関農機	16,700	1,815.00	30,310,500	貸付有価証券 100株
ＴＯＷＡ	64,700	3,130.00	202,511,000	
北川鉄工所	7,000	1,735.00	12,145,000	
ローツェ	105,100	4,655.00	489,240,500	
ハーモニック・ドライブ・システムズ	47,800	7,880.00	376,664,000	
クボタ	904,800	2,713.50	2,455,174,800	
荏原実業	18,800	2,424.00	45,571,200	
三菱化工機	18,800	3,555.00	66,834,000	

月島ホールディングス	23,900	2,677.00	63,980,300	
ＴＥＩＫＯＫＵ	11,500	3,190.00	36,685,000	
新東工業	36,100	1,224.00	44,186,400	
澁谷工業	16,700	4,305.00	71,893,500	
アイチ　コーポレーション	25,700	1,403.00	36,057,100	
小森コーポレーション	42,500	1,603.00	68,127,500	
鶴見製作所	25,200	2,268.00	57,153,600	
酒井重工業	7,100	2,156.00	15,307,600	
荏原製作所	363,300	6,127.00	2,225,939,100	
西島製作所	13,200	2,964.00	39,124,800	
ＡＩＲＭＡＮ	17,900	1,915.00	34,278,500	
ダイキン工業	232,900	25,110.00	5,848,119,000	
オルガノ	24,500	15,910.00	389,795,000	
トーヨーカネツ	14,800	2,465.00	36,482,000	
栗田工業	107,700	9,105.00	980,608,500	
椿本チエイン	77,400	2,622.00	202,942,800	
木村化工機	13,600	1,189.00	16,170,400	貸付有価証券 10,300株
アネスト岩田	33,200	1,760.00	58,432,000	
ダイフク	301,800	6,867.00	2,072,460,600	
サムコ	4,800	12,980.00	62,304,000	貸付有価証券 3,600株
タダノ	94,300	1,266.00	119,383,800	
ＣＫＤ	54,000	7,230.00	390,420,000	
平和	52,900	2,023.00	107,016,700	
理想科学工業	28,600	1,027.00	29,372,200	
ＳＡＮＫＹＯ	167,500	1,650.50	276,458,750	
日本金銭機械	21,600	1,083.00	23,392,800	
マースグループホールディングス	15,000	3,095.00	46,425,000	
ガリレイホールディングス	26,300	3,340.00	87,842,000	
ダイコク電機	8,800	2,372.00	20,873,600	
竹内製作所	32,400	7,130.00	231,012,000	
アマノ	47,100	3,747.00	176,483,700	
ＪＵＫＩ	27,700	541.00	14,985,700	
ジャノメ	13,100	1,346.00	17,632,600	
マックス	98,600	1,710.00	168,606,000	
グローリー	46,800	4,215.00	197,262,000	
新晃工業	48,000	1,258.00	60,384,000	
だいわ	27,400	1,669.00	45,730,600	
セガサミーホールディングス	141,400	2,400.00	339,360,000	
ＴＰＲ	39,700	1,405.00	55,778,500	
ツバキ・ナカシマ	41,300	421.00	17,387,300	
ホシザキ	115,100	5,530.00	636,503,000	

大豊工業	13,500	1,083.00	14,620,500	
日本精工	331,100	1,158.00	383,413,800	
ＮＴＮ	432,900	390.10	168,874,290	
ジェイテクト	168,800	2,110.00	356,168,000	
不二越	13,100	6,280.00	82,268,000	
日本トムソン	48,700	2,076.00	101,101,200	
ＴＨＫ	94,600	7,688.00	727,284,800	
ＹＵＳＨＩＮ	14,100	681.00	9,602,100	
前澤給装工業	12,800	1,572.00	20,121,600	
イーグル工業	19,700	2,879.00	56,716,300	
ＰＩＬＬＡＲ	16,500	10,130.00	167,145,000	
キッツ	63,800	2,400.00	153,120,000	
マキタ	222,500	5,603.00	1,246,667,500	
三井Ｅ＆Ｓ	88,700	4,579.00	406,157,300	
カナデビア	146,500	1,236.00	181,074,000	
三菱重工業	3,350,900	3,818.00	12,793,736,200	
ＩＨＩ	932,100	2,810.50	2,619,667,050	
キオクシアホールディングス	108,700	77,000.00	8,369,900,000	
日清紡ホールディングス	134,800	2,224.00	299,795,200	
イビデン	223,900	20,300.00	4,545,170,000	
コニカミノルタ	400,300	584.20	233,855,260	
ブラザー工業	222,000	3,735.00	829,170,000	
ミネベアミツミ	311,200	4,381.00	1,363,367,200	
日立製作所	4,505,100	4,700.00	21,173,970,000	
三菱電機	1,959,100	5,827.00	11,415,675,700	
富士電機	128,600	13,030.00	1,675,658,000	
安川電機	194,300	6,972.00	1,354,659,600	
シンフォニアテクノロジー	19,700	14,930.00	294,121,000	
明電舎	33,200	9,070.00	301,124,000	
山洋電気	20,700	6,080.00	125,856,000	
デンヨー	13,000	3,550.00	46,150,000	
ＰＨＣホールディングス	34,100	1,051.00	35,839,100	貸付有価証券 26,000株
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	205,000	10,840.00	2,222,200,000	
ソシオネクスト	155,200	2,850.00	442,320,000	
東芝テック	22,900	2,971.00	68,035,900	
芝浦メカトロニクス	55,600	5,790.00	321,924,000	
マブチモーター	172,900	1,610.50	278,455,450	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	12,500	230.00	2,875,000	貸付有価証券 9,700株
トレックス・セミコンダクター	7,100	2,171.00	15,414,100	
東光高岳	9,800	7,210.00	70,658,000	
ダイヘン	16,500	15,590.00	257,235,000	

ヤーマン	35,500	750.00	26,625,000	貸付有価証券 27,100株
ＪＶＣケンウッド	139,600	1,131.00	157,887,600	
ミマキエンジニアリング	15,100	2,100.00	31,710,000	
大崎電気工業	34,200	1,479.00	50,581,800	
オムロン	150,300	6,010.00	903,303,000	
日東工業	21,400	4,575.00	97,905,000	
ＩＤＥＣ	22,800	3,320.00	75,696,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	73,300	6,178.00	452,847,400	
ＢＵＦＦＡＬＯ	9,700	2,643.00	25,637,100	貸付有価証券 5,400株
テクノメディカ	3,700	2,073.00	7,670,100	
日本電気	1,174,500	4,333.00	5,089,108,500	
富士通	1,645,900	3,347.00	5,508,827,300	
沖電気工業	86,800	3,375.00	292,950,000	
電気興業	6,600	3,020.00	19,932,000	
サンケン電気	18,200	10,680.00	194,376,000	貸付有価証券 13,900株
アイホン	9,400	2,790.00	26,226,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,734,200	4,762.00	8,258,260,400	
セイコーエプソン	222,800	2,869.00	639,213,200	
ワコム	107,900	783.00	84,485,700	
アルバック	45,800	9,994.00	457,725,200	
アクセル	8,600	1,172.00	10,079,200	
ＥＩＺＯ	25,200	2,677.00	67,460,400	
日本信号	45,200	1,631.00	73,721,200	
京三製作所	41,700	897.00	37,404,900	
能美防災	24,300	4,300.00	104,490,000	
ホーチキ	42,200	2,030.00	85,666,000	
エレコム	43,100	1,819.00	78,398,900	
パナソニック　ホールディングス	2,113,000	4,480.00	9,466,240,000	
シャープ	215,300	648.30	139,578,990	貸付有価証券 165,700株
アンリツ	117,100	4,262.00	499,080,200	
ソニーグループ	5,923,500	3,359.00	19,897,036,500	
ＴＤＫ	1,544,700	3,389.00	5,234,988,300	
帝国通信工業	8,000	2,902.00	23,216,000	
タムラ製作所	71,500	917.00	65,565,500	
アルプスアルパイン	138,100	2,081.50	287,455,150	
日本電波工業	21,600	3,345.00	72,252,000	貸付有価証券 16,500株
鈴木	9,800	3,290.00	32,242,000	
メイコー	16,000	26,160.00	418,560,000	
日本トリム	4,100	4,540.00	18,614,000	

フォスター電機	16,500	2,849.00	47,008,500	
ＳＭＫ	4,300	2,941.00	12,646,300	貸付有価証券 3,300株
ヨコオ	15,900	5,030.00	79,977,000	
ホシデン	35,100	2,831.00	99,368,100	貸付有価証券 26,700株
ヒロセ電機	26,000	27,685.00	719,810,000	
日本航空電子工業	41,900	2,355.00	98,674,500	
ＴＯＡ	18,000	1,610.00	28,980,000	
マクセル	37,600	2,087.00	78,471,200	
古野電気	23,300	6,390.00	148,887,000	
スミダコーポレーション	31,100	1,367.00	42,513,700	
アイコム	6,900	3,320.00	22,908,000	貸付有価証券 4,900株
リオン	7,500	3,585.00	26,887,500	
横河電機	187,400	5,559.00	1,041,756,600	
新電元工業	7,600	3,725.00	28,310,000	
アズビル	430,500	1,689.00	727,114,500	
日本光電工業	147,600	1,499.50	221,326,200	
チノー	14,700	1,626.00	23,902,200	
日本電子材料	10,900	7,330.00	79,897,000	
堀場製作所	33,600	27,800.00	934,080,000	
アドバンテスト	533,200	29,830.00	15,905,356,000	
エスペック	17,400	3,900.00	67,860,000	
キーエンス	177,200	76,970.00	13,639,084,000	
日置電機	9,300	11,490.00	106,857,000	
シスメックス	458,900	1,531.00	702,575,900	
日本マイクロニクス	29,200	16,700.00	487,640,000	
メガチップス	11,400	10,410.00	118,674,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,400	6,170.00	51,828,000	貸付有価証券 6,400株
コーセル	22,200	1,381.00	30,658,200	貸付有価証券 16,800株
イリソ電子工業	14,700	2,879.00	42,321,300	
オプテックスグループ	30,100	3,770.00	113,477,000	
千代田インテグレ	4,600	3,245.00	14,927,000	
レーザーテック	74,900	44,380.00	3,324,062,000	
スタンレー電気	75,200	3,512.00	264,102,400	
ウシオ電機	66,500	4,363.00	290,139,500	
日本セラミック	14,500	3,785.00	54,882,500	
山一電機	17,400	9,230.00	160,602,000	
図研	14,800	4,745.00	70,226,000	
日本電子	41,000	7,874.00	322,834,000	
カシオ計算機	140,000	1,875.00	262,500,000	

ファナック	845,700	7,156.00	6,051,829,200	
日本シイエムケイ	57,400	657.00	37,711,800	
エンプラス	5,200	12,730.00	66,196,000	
大真空	26,100	837.00	21,845,700	貸付有価証券 20,000株
ローム	347,700	5,600.00	1,947,120,000	
浜松ホトニクス	275,000	2,508.50	689,837,500	
三井ハイテック	92,000	977.00	89,884,000	貸付有価証券 70,700株
京セラ	1,033,500	3,720.00	3,844,620,000	
太陽誘電	94,900	14,730.00	1,397,877,000	
村田製作所	1,689,800	9,860.00	16,661,428,000	
双葉電子工業	37,300	568.00	21,186,400	
ニチコン	46,500	3,510.00	163,215,000	
日本ケミコン	23,300	3,965.00	92,384,500	
ＫＯＡ	32,500	2,617.00	85,052,500	
市光工業	39,300	513.00	20,160,900	
小糸製作所	183,600	2,557.00	469,465,200	
ミツバ	33,600	1,172.00	39,379,200	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	126,400	18,150.00	2,294,160,000	
キヤノン	795,000	4,340.00	3,450,300,000	
リコー	415,400	1,497.00	621,853,800	
象印マホービン	48,500	1,393.00	67,560,500	貸付有価証券 37,100株
東京エレクトロン	371,900	72,940.00	27,126,386,000	
イノテック	11,900	3,575.00	42,542,500	
トヨタ紡織	87,000	2,178.50	189,529,500	
ＡＲＣＨＩＯＮ	266,300	313.00	83,351,900	貸付有価証券 204,200株
ユニプレス	32,800	1,258.00	41,262,400	
モリタホールディングス	27,100	2,395.00	64,904,500	
三櫻工業	27,000	884.00	23,868,000	貸付有価証券 20,600株
デンソー	1,734,800	1,933.50	3,354,235,800	
東海理化電機製作所	47,300	3,025.00	143,082,500	
川崎重工業	667,200	2,779.50	1,854,482,400	
名村造船所	55,200	3,800.00	209,760,000	
日本車輌製造	6,800	3,560.00	24,208,000	
日産自動車	2,705,200	310.50	839,964,600	
いすゞ自動車	456,100	2,349.00	1,071,378,900	
トヨタ自動車	9,413,000	2,823.00	26,572,899,000	
三菱自動車工業	677,000	361.80	244,938,600	貸付有価証券 519,000株
武蔵精密工業	39,100	3,640.00	142,324,000	
日産車体	26,900	932.00	25,070,800	

新明和工業	51,000	1,971.00	100,521,000	
極東開発工業	29,200	2,258.00	65,933,600	
トピー工業	12,700	2,859.00	36,309,300	
ティラド	31,000	1,478.00	45,818,000	
曙ブレーキ工業	108,800	110.00	11,968,000	貸付有価証券 82,800株
タチエス	32,700	2,146.00	70,174,200	
ＮＯＫ	63,900	2,910.50	185,980,950	
フタバ産業	47,500	971.00	46,122,500	
カヤバ	30,100	4,115.00	123,861,500	
大同メタル工業	34,600	1,395.00	48,267,000	
プレス工業	71,400	808.00	57,691,200	
アイシン	432,500	2,290.50	990,641,250	
マツダ	585,700	1,117.50	654,519,750	
本田技研工業	3,301,800	1,495.50	4,937,841,900	
スズキ	1,300,900	2,036.00	2,648,632,400	
ＳＵＢＡＲＵ	522,500	2,492.50	1,302,331,250	
ヤマハ発動機	876,400	1,243.50	1,089,803,400	
エクセディ	29,000	5,930.00	171,970,000	
豊田合成	54,500	5,084.00	277,078,000	
愛三工業	29,400	2,401.00	70,589,400	
ヨロズ	16,500	875.00	14,437,500	貸付有価証券 12,700株
エフ・シー・シー	34,500	3,500.00	120,750,000	
シマノ	74,500	16,975.00	1,264,637,500	
テイ・エス　テック	65,700	1,741.00	114,383,700	
リガク・ホールディングス	105,000	2,456.00	257,880,000	貸付有価証券 81,500株
北里	13,900	1,357.00	18,862,300	貸付有価証券 3,800株
テルモ	1,176,500	2,189.00	2,575,358,500	
日機装	41,200	3,700.00	152,440,000	
日本エム・ディ・エム	14,000	944.00	13,216,000	
島津製作所	235,300	4,140.00	974,142,000	
ＪＭＳ	16,300	471.00	7,677,300	
長野計器	11,300	3,990.00	45,087,000	
ブイ・テクノロジー	8,700	7,050.00	61,335,000	
東京計器	14,700	6,360.00	93,492,000	貸付有価証券 11,100株
愛知時計電機	8,400	3,055.00	25,662,000	
インターアクション	9,100	1,735.00	15,788,500	貸付有価証券 7,000株
東京精密	33,600	18,905.00	635,208,000	
マニー	70,800	1,695.00	120,006,000	
ニコン	220,900	2,232.50	493,159,250	

オリンパス	959,400	1,753.50	1,682,307,900	
理研計器	25,100	3,505.00	87,975,500	
タムロン	90,500	1,143.00	103,441,500	
ＨＯＹＡ	332,500	24,975.00	8,304,187,500	
ノーリツ鋼機	50,400	1,998.00	100,699,200	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	24,000	2,922.00	70,128,000	
朝日インテック	210,800	3,573.00	753,188,400	
シチズン時計	146,600	2,331.00	341,724,600	
メニコン	66,100	1,663.00	109,924,300	
松風	16,000	2,086.00	33,376,000	
セイコーグループ	49,300	7,510.00	370,243,000	
ニプロ	147,600	1,546.50	228,263,400	貸付有価証券 112,800株
三井松島ホールディングス	30,300	1,554.00	47,086,200	
テクセンドフォトマスク	65,800	4,325.00	284,585,000	
トランザクション	19,000	1,369.00	26,011,000	貸付有価証券 2,600株
ニホンフラッシュ	16,600	721.00	11,968,600	貸付有価証券 500株
前田工繊	36,100	1,849.00	66,748,900	
アートネイチャー	15,900	869.00	13,817,100	
フルヤ金属	15,200	7,390.00	112,328,000	貸付有価証券 300株
バンダイナムコホールディングス	469,800	4,017.00	1,887,186,600	
ＳＨＯＥＩ	41,600	1,826.00	75,961,600	
フランスベッドホールディングス	25,300	1,257.00	31,802,100	貸付有価証券 19,400株
パイロットコーポレーション	74,400	1,768.00	131,539,200	
萩原工業	11,800	1,761.00	20,779,800	貸付有価証券 9,000株
フジシールインターナショナル	35,900	2,956.00	106,120,400	
タカラトミー	86,800	3,322.00	288,349,600	
広済堂ホールディングス	57,300	558.00	31,973,400	貸付有価証券 43,800株
プロネクサス	18,300	1,142.00	20,898,600	貸付有価証券 14,000株
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	214,700	5,201.00	1,116,654,700	
大日本印刷	382,000	3,168.00	1,210,176,000	
共同印刷	17,800	1,628.00	28,978,400	
ＮＩＳＳＨＡ	31,800	1,331.00	42,325,800	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	9,700	4,165.00	40,400,500	貸付有価証券 7,300株
アシックス	680,900	4,579.00	3,117,841,100	
ツツミ	4,100	2,608.00	10,692,800	
ローランド	14,000	4,030.00	56,420,000	
小松ウオール工業	13,000	2,601.00	33,813,000	

ヤマハ	275,900	1,180.50	325,699,950	
河合楽器製作所	4,800	3,205.00	15,384,000	貸付有価証券 3,600株
クリナップ	19,300	943.00	18,199,900	
ピジョン	104,700	2,060.50	215,734,350	
キングジム	15,600	772.00	12,043,200	貸付有価証券 12,000株
リンテック	38,400	6,560.00	251,904,000	
イトーキ	38,900	2,810.00	109,309,000	
任天堂	1,108,100	7,030.00	7,789,943,000	
三菱鉛筆	23,800	2,696.00	64,164,800	貸付有価証券 18,300株
タカラスタンダード	37,800	3,055.00	115,479,000	
コクヨ	350,400	842.60	295,247,040	
ナカバヤシ	19,000	572.00	10,868,000	
グローブライド	16,600	2,392.00	39,707,200	
オカムラ	53,300	2,273.00	121,150,900	
美津濃	47,500	3,515.00	166,962,500	
グリムス	6,300	2,511.00	15,819,300	
東京電力ホールディングス	1,596,200	480.40	766,814,480	
中部電力	652,500	3,208.00	2,093,220,000	
関西電力	959,700	2,268.00	2,176,599,600	
中国電力	307,600	921.50	283,453,400	
北陸電力	181,100	900.40	163,062,440	
東北電力	466,200	1,089.50	507,924,900	
四国電力	164,900	1,490.50	245,783,450	
九州電力	408,200	1,713.50	699,450,700	
北海道電力	199,600	969.90	193,592,040	貸付有価証券 153,400株
沖縄電力	45,200	913.00	41,267,600	
電源開発	133,300	3,612.00	481,479,600	
エフオン	12,800	327.00	4,185,600	
イーレックス	36,200	789.00	28,561,800	貸付有価証券 27,800株
レノバ	48,300	923.00	44,580,900	貸付有価証券 36,900株
東京瓦斯	288,300	5,966.00	1,719,997,800	
大阪瓦斯	316,200	5,363.00	1,695,780,600	
東邦瓦斯	242,500	1,205.50	292,333,750	
北海道瓦斯	52,900	765.00	40,468,500	
広島ガス	37,600	422.00	15,867,200	貸付有価証券 28,700株
西部ガスホールディングス	20,300	2,328.00	47,258,400	貸付有価証券 15,500株
静岡ガス	40,400	1,248.00	50,419,200	

メタウォーター	23,400	3,235.00	75,699,000	
ＳＢＳホールディングス	15,700	4,155.00	65,233,500	
東武鉄道	182,900	2,915.50	533,244,950	
相鉄ホールディングス	68,200	2,524.50	172,170,900	
東急	455,100	1,702.50	774,807,750	
京浜急行電鉄	200,900	1,543.50	310,089,150	
小田急電鉄	268,400	1,699.50	456,145,800	
京王電鉄	388,000	746.00	289,448,000	
京成電鉄	308,200	1,232.00	379,702,400	
富士急行	21,800	2,509.00	54,696,200	貸付有価証券 16,600株
東日本旅客鉄道	976,500	3,478.00	3,396,267,000	
西日本旅客鉄道	422,300	2,886.50	1,218,968,950	
東海旅客鉄道	729,200	3,621.00	2,640,433,200	
東京地下鉄	282,000	1,439.50	405,939,000	貸付有価証券 215,900株
西武ホールディングス	182,200	3,525.00	642,255,000	
鴻池運輸	30,200	2,782.00	84,016,400	
西日本鉄道	51,200	2,993.00	153,241,600	
ハマキョウレックス	55,400	1,830.00	101,382,000	
サカイ引越センター	22,400	2,899.00	64,937,600	
近鉄グループホールディングス	189,400	3,456.00	654,566,400	
阪急阪神ホールディングス	233,100	4,602.00	1,072,726,200	
ＮＡＮＫＡＩ	80,800	2,912.50	235,330,000	
京阪ホールディングス	91,900	3,183.00	292,517,700	
神戸電鉄	4,800	2,424.00	11,635,200	貸付有価証券 3,600株
名古屋鉄道	195,400	1,859.50	363,346,300	
山陽電気鉄道	13,300	1,990.00	26,467,000	貸付有価証券 10,200株
ヤマトホールディングス	214,800	1,944.00	417,571,200	
山九	38,500	8,694.00	334,719,000	
丸全昭和運輸	10,900	7,490.00	81,641,000	
センコーグループホールディングス	128,000	2,052.00	262,656,000	
ニッコンホールディングス	75,400	5,419.00	408,592,600	貸付有価証券 56,900株
福山通運	18,200	5,640.00	102,648,000	
セイノーホールディングス	87,000	2,652.50	230,767,500	
神奈川中央交通	5,000	3,650.00	18,250,000	貸付有価証券 3,500株
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	54,800	825.00	45,210,000	
九州旅客鉄道	133,100	3,544.00	471,706,400	
ＳＧホールディングス	296,800	1,570.50	466,124,400	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	177,000	5,323.00	942,171,000	

日本郵船	351,900	5,286.00	1,860,143,400	
商船三井	336,500	5,324.00	1,791,526,000	
川崎汽船	380,900	2,526.50	962,343,850	貸付有価証券 291,300株
ＮＳユナイテッド海運	11,100	6,710.00	74,481,000	
飯野海運	64,900	1,466.00	95,143,400	
乾汽船	22,400	1,588.00	35,571,200	貸付有価証券 17,100株
日本航空	405,200	2,944.50	1,193,111,400	
ＡＮＡホールディングス	481,000	3,016.00	1,450,696,000	貸付有価証券 260,000株
三菱倉庫	191,800	1,572.00	301,509,600	
三井倉庫ホールディングス	54,600	3,487.00	190,390,200	
住友倉庫	50,700	3,865.00	195,955,500	
澁澤倉庫	28,200	1,869.00	52,705,800	
日本トランスシティ	44,000	1,211.00	53,284,000	
中央倉庫	9,500	1,876.00	17,822,000	
安田倉庫	12,100	2,453.00	29,681,300	貸付有価証券 9,200株
上組	77,600	5,175.00	401,580,000	
キユーソー流通システム	10,100	3,255.00	32,875,500	
エーアイテイー	11,100	2,373.00	26,340,300	
ＭＩＸＩ	33,100	2,933.00	97,082,300	
クロスキャット	10,100	1,015.00	10,251,500	
システナ	253,800	422.00	107,103,600	
デジタルアーツ	9,400	3,965.00	37,271,000	
日鉄ソリューションズ	48,500	3,775.00	183,087,500	貸付有価証券 37,000株
キューブシステム	10,400	1,059.00	11,013,600	貸付有価証券 7,200株
コア	7,900	1,990.00	15,721,000	貸付有価証券 5,900株
ディー・エヌ・エー	72,800	2,517.00	183,237,600	貸付有価証券 55,400株
手間いらず	2,100	2,314.00	4,859,400	
ラクーンホールディングス	13,300	618.00	8,219,400	貸付有価証券 10,200株
ソリトンシステムズ	9,100	1,988.00	18,090,800	
ソフトクリエイトホールディングス	14,600	1,917.00	27,988,200	
ＴＩＳＩ	181,500	3,428.00	622,182,000	
グリーホールディングス	59,500	393.00	23,383,500	
GMOペパボ	2,200	1,722.00	3,788,400	貸付有価証券 1,600株
コーエーテクモホールディングス	111,300	1,593.50	177,356,550	
三菱総合研究所	8,500	4,635.00	39,397,500	
ファインデックス	12,300	902.00	11,094,600	

ＫＬａｂ	49,600	211.00	10,465,600	貸付有価証券 38,300株
ポールトゥウィンホールディングス	25,300	329.00	8,323,700	
ネクソン	420,000	2,282.00	958,440,000	
アイスタイル	68,000	403.00	27,404,000	貸付有価証券 51,800株
エムアップホールディングス	43,500	740.00	32,190,000	
エイチームホールディングス	12,500	1,030.00	12,875,000	貸付有価証券 10,500株
セルシス	23,000	2,053.00	47,219,000	
エニグモ	19,800	401.00	7,939,800	貸付有価証券 15,300株
コロプラ	60,400	386.00	23,314,400	
ブロードリーフ	129,600	424.00	54,950,400	
デジタルハーツホールディングス	11,100	732.00	8,125,200	貸付有価証券 8,400株
メディアドゥ	6,000	1,341.00	8,046,000	貸付有価証券 4,600株
じげん	51,000	402.00	20,502,000	貸付有価証券 38,900株
フィックスターズ	24,500	2,329.00	57,060,500	貸付有価証券 18,800株
オプティム	18,100	422.00	7,638,200	貸付有価証券 14,100株
セレス	8,000	2,156.00	17,248,000	
ＳＨＩＦＴ	159,400	676.50	107,834,100	貸付有価証券 121,800株
セック	5,400	3,080.00	16,632,000	貸付有価証券 4,000株
テクマトリックス	35,400	1,871.00	66,233,400	
プロシップ	14,200	1,836.00	26,071,200	貸付有価証券 10,900株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,200	2,363.00	97,355,600	
GMOペイメントゲートウェイ	40,600	9,753.00	395,971,800	
システムリサーチ	13,200	1,844.00	24,340,800	貸付有価証券 10,100株
インターネットイニシアティブ	97,200	3,479.00	338,158,800	
さくらインターネット	25,000	2,876.00	71,900,000	貸付有価証券 18,800株
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,400	2,191.00	11,831,400	
ＳＲＡホールディングス	10,100	4,585.00	46,308,500	
朝日ネット	19,100	628.00	11,994,800	
ｅＢＡＳＥ	21,900	423.00	9,263,700	
アバントグループ	19,100	1,175.00	22,442,500	
アドソル日進	13,700	1,481.00	20,289,700	
フリービット	9,300	1,583.00	14,721,900	
コムチュア	23,500	1,350.00	31,725,000	

アステリア	13,900	1,112.00	15,456,800	貸付有価証券 10,600株
アイル	10,000	2,422.00	24,220,000	
マークラインズ	10,500	1,387.00	14,563,500	
ｇｕｍｉ	31,400	242.00	7,598,800	貸付有価証券 23,100株
テラスカイ	6,000	2,313.00	13,878,000	貸付有価証券 4,500株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	18,500	935.00	17,297,500	
ネオジャパン	4,700	1,626.00	7,642,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,600	2,473.00	8,902,800	
ラクス	164,300	1,036.50	170,296,950	
ダブルスタンダード	6,300	1,219.00	7,679,700	
オープンドア	10,300	354.00	3,646,200	貸付有価証券 8,000株
アカツキ	8,600	2,915.00	25,069,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	5,700	1,000.00	5,700,000	
カナミックネットワーク	22,300	501.00	11,172,300	貸付有価証券 1,200株
チェンジホールディングス	34,200	933.00	31,908,600	貸付有価証券 26,300株
オークネット	31,800	1,393.00	44,297,400	
オロ	7,200	2,168.00	15,609,600	貸付有価証券 5,700株
ユーザーローカル	7,500	1,784.00	13,380,000	貸付有価証券 5,700株
ＰＫＳＨＡ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｙ	19,000	2,802.00	53,238,000	貸付有価証券 16,200株
マネーフォワード	40,500	4,935.00	199,867,500	貸付有価証券 30,900株
GMOフィナンシャルゲート	2,900	6,770.00	19,633,000	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	15,500	441.00	6,835,500	貸付有価証券 10,000株
プラスアルファ・コンサルティング	22,400	2,970.00	66,528,000	
電算システムホールディングス	7,900	2,931.00	23,154,900	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	68,000	903.00	61,404,000	貸付有価証券 52,200株
ビジョナル	24,000	8,269.00	198,456,000	
ハイマックス	4,900	1,184.00	5,801,600	
野村総合研究所	346,400	4,979.00	1,724,725,600	
日本システム技術	16,400	1,783.00	29,241,200	
インテージホールディングス	13,300	1,878.00	24,977,400	貸付有価証券 10,200株
ソースネクスト	92,100	107.00	9,854,700	貸付有価証券 70,900株
シンプレクス・ホールディングス	140,800	1,046.00	147,276,800	

ＨＥＲＯＺ	7,000	692.00	4,844,000	貸付有価証券 5,400株
メルカリ	76,500	4,785.00	366,052,500	
ＩＰＳ	5,200	3,485.00	18,122,000	貸付有価証券 3,900株
システムサポートホールディングス	12,400	1,060.00	13,144,000	
ボードルア	9,600	3,200.00	30,720,000	貸付有価証券 7,300株
ＮＥ	17,300	254.00	4,394,200	
イーソル	11,900	849.00	10,103,100	貸付有価証券 900株
ウイングアーク１ｓｔ	18,500	2,543.00	47,045,500	
サーバーワークス	3,700	2,014.00	7,451,800	貸付有価証券 2,800株
Ｓａｎｓａｎ	50,700	1,723.00	87,356,100	
メドレー	21,700	2,026.00	43,964,200	貸付有価証券 1,400株
ベース	7,500	3,105.00	23,287,500	貸付有価証券 5,600株
ＪＭＤＣ	26,000	3,170.00	82,420,000	貸付有価証券 19,800株
フォーカスシステムズ	11,900	1,689.00	20,099,100	
クレスコ	30,600	1,546.00	47,307,600	
フジ・メディア・ホールディングス	139,600	4,113.00	574,174,800	貸付有価証券 10,500株
オービック	329,800	4,161.00	1,372,297,800	
ジャストシステム	25,500	3,965.00	101,107,500	
ＴＤＣソフト	33,300	994.00	33,100,200	
ＬＩＮＥヤフー	2,735,200	445.40	1,218,258,080	
トレンドマイクロ	102,600	6,277.00	644,020,200	
ＩＤホールディングス	22,800	1,107.00	25,239,600	
日本オラクル	34,000	8,680.00	295,120,000	
アルファシステムズ	5,600	3,380.00	18,928,000	貸付有価証券 3,900株
フューチャー	37,900	1,730.00	65,567,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10,900	1,829.00	19,936,100	
オービックビジネスコンサルタント	30,000	6,543.00	196,290,000	
アイティフォー	18,500	1,690.00	31,265,000	
東計電算	5,000	4,740.00	23,700,000	
大塚商会	201,300	2,893.50	582,461,550	
サイボウズ	24,400	2,602.00	63,488,800	貸付有価証券 18,700株
電通総研	64,700	2,702.00	174,819,400	
デジタルガレージ	25,300	2,122.00	53,686,600	
ＥＭシステムズ	23,300	503.00	11,719,900	貸付有価証券 17,900株

ウェザーニューズ	25,100	1,980.00	49,698,000	貸付有価証券 21,200株
ＣＩＪ	42,900	502.00	21,535,800	貸付有価証券 32,800株
ビジネスエンジニアリング	20,800	1,105.00	22,984,000	貸付有価証券 15,900株
WOWOW	13,300	1,023.00	13,605,900	貸付有価証券 10,200株
スカラ	16,500	335.00	5,527,500	貸付有価証券 11,900株
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	28,300	2,410.00	68,203,000	貸付有価証券 3,000株
日本ビジネスシステムズ	9,700	1,563.00	15,161,100	
トランヴィア	10,500	920.00	9,660,000	
ギフティグループ	13,800	1,006.00	13,882,800	貸付有価証券 10,500株
セラク	5,400	1,258.00	6,793,200	貸付有価証券 1,200株
システムソフト	62,100	49.00	3,042,900	貸付有価証券 47,600株
アルゴグラフィックス	63,600	1,304.00	82,934,400	
マーベラス	33,000	445.00	14,685,000	
エイベックス	30,400	1,256.00	38,182,400	
ＢＩＰＲＯＧＹ	59,000	4,567.00	269,453,000	
都築電気	11,300	4,055.00	45,821,500	
ＴＢＳホールディングス	87,700	6,370.00	558,649,000	
日本テレビホールディングス	155,700	2,885.00	449,194,500	
朝日放送グループホールディングス	22,200	831.00	18,448,200	
テレビ朝日ホールディングス	43,100	3,190.00	137,489,000	
スカパーＪＳＡＴ	118,300	2,530.00	299,299,000	
テレビ東京ホールディングス	11,000	3,695.00	40,645,000	
ビジョン	37,100	1,017.00	37,730,700	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	59,700	1,696.00	101,251,200	貸付有価証券 4,200株
日本通信	143,600	113.00	16,226,800	貸付有価証券 110,100株
ＮＴＴ	48,762,100	147.60	7,197,285,960	
ＫＤＤＩ	2,387,500	2,790.50	6,662,318,750	
ソフトバンク	28,596,100	211.40	6,045,215,540	
光通信	17,400	37,450.00	651,630,000	
エムティーアイ	12,000	620.00	7,440,000	
GMOインターネットグループ	56,900	3,908.00	222,365,200	
ファイバーゲート	6,900	778.00	5,368,200	貸付有価証券 1,100株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	98,700	3,789.00	373,974,300	貸付有価証券 75,100株
学研ホールディングス	29,600	1,022.00	30,251,200	

ゼンリン	26,600	915.00	24,339,000	
松竹	10,100	10,740.00	108,474,000	貸付有価証券 7,700株
東宝	450,300	1,346.00	606,103,800	
東映	29,300	5,740.00	168,182,000	
ピー・シー・エー	11,600	1,411.00	16,367,600	貸付有価証券 4,900株
ビジネスブレイン太田昭和	19,000	1,038.00	19,722,000	
ＤＴＳ	141,100	1,061.00	149,707,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	292,100	2,571.50	751,135,150	
シーイーシー	21,000	2,196.00	46,116,000	
カプコン	352,900	3,307.00	1,167,040,300	
アイ・エス・ビー	8,300	2,236.00	18,558,800	
ＮＳＷ	7,900	2,511.00	19,836,900	
アイネス	13,800	2,183.00	30,125,400	
ＴＫＣ	27,400	3,545.00	97,133,000	
ＮＳＤ	62,600	2,660.50	166,547,300	
コナミグループ	76,000	18,530.00	1,408,280,000	
福井コンピュータホールディングス	9,600	3,150.00	30,240,000	
ＪＢＣＣホールディングス	47,100	1,409.00	66,363,900	
ミロク情報サービス	14,900	1,817.00	27,073,300	
ソフトバンクグループ	3,404,000	6,370.00	21,683,480,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	35,800	2,802.00	100,311,600	
高千穂交易	14,800	2,170.00	32,116,000	貸付有価証券 11,300株
あらた	28,700	2,530.00	72,611,000	
トーメンデバイス	2,700	15,690.00	42,363,000	貸付有価証券 2,000株
東京エレクトロン　デバイス	18,600	3,910.00	72,726,000	
円谷フィールズホールディングス	34,700	1,435.00	49,794,500	
双日	180,800	5,100.00	922,080,000	
アルフレッサ　ホールディングス	177,300	2,201.50	390,325,950	
横浜冷凍	43,100	2,065.00	89,001,500	
ラサ商事	9,800	1,825.00	17,885,000	
アルコニックス	28,800	2,479.00	71,395,200	
神戸物産	163,100	2,638.00	430,257,800	
あい　ホールディングス	34,000	2,673.00	90,882,000	
ダイワボウホールディングス	70,300	3,392.00	238,457,600	
マクニカホールディングス	130,400	3,256.00	424,582,400	
ラクト・ジャパン	8,000	3,465.00	27,720,000	貸付有価証券 6,000株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,800	1,560.00	40,248,000	
八洲電機	14,000	2,797.00	39,158,000	
メディアスホールディングス	12,100	791.00	9,571,100	貸付有価証券 9,300株

レスター	15,900	3,730.00	59,307,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	100,400	1,149.00	115,359,600	
三洋貿易	46,000	815.00	37,490,000	
ビューティガレージ	5,100	1,428.00	7,282,800	貸付有価証券 3,900株
ウイン・パートナーズ	13,600	1,325.00	18,020,000	貸付有価証券 10,400株
シップヘルスケアホールディングス	68,700	2,266.00	155,674,200	
明治電機工業	9,300	2,158.00	20,069,400	
コメダホールディングス	46,000	2,835.00	130,410,000	
アセンテック	23,200	421.00	9,767,200	
ＭＩＲＡＩＮＩホールディングス	28,200	2,266.00	63,901,200	
ユニソルホールディングス	16,000	2,515.00	40,240,000	貸付有価証券 12,300株
ヤマエグループホールディングス	18,400	3,030.00	55,752,000	
小野建	19,900	1,385.00	27,561,500	
伯東	11,200	4,590.00	51,408,000	
コンドーテック	15,700	1,551.00	24,350,700	
ナガイレーベン	20,300	1,749.00	35,504,700	
松田産業	14,200	5,690.00	80,798,000	
第一興商	62,000	1,747.00	108,314,000	
メディパルホールディングス	200,200	2,636.00	527,727,200	
ＳＰＫ	15,100	1,376.00	20,777,600	
アズワン	59,600	2,417.00	144,053,200	
スズデン	9,700	2,548.00	24,715,600	
シモジマ	14,000	1,376.00	19,264,000	貸付有価証券 6,100株
ドウシシャ	22,300	2,922.00	65,160,600	
高速	12,500	3,845.00	48,062,500	貸付有価証券 9,600株
たけびし	7,200	2,376.00	17,107,200	
リックス	4,700	3,585.00	16,849,500	
丸文	16,700	1,686.00	28,156,200	
ハピネット	25,500	3,110.00	79,305,000	
橋本総業ホールディングス	6,300	1,413.00	8,901,900	貸付有価証券 4,800株
日本ライフライン	47,200	1,363.00	64,333,600	
タカショー	15,100	399.00	6,024,900	貸付有価証券 11,500株
ＩＤＯＭ	56,600	1,390.00	78,674,000	
進和	11,000	3,230.00	35,530,000	
ダイトロン	15,400	3,560.00	54,824,000	
シークス	30,000	1,341.00	40,230,000	
オーハシテクニカ	17,000	1,150.00	19,550,000	

白銅	5,300	3,360.00	17,808,000	貸付有価証券 4,000株
伊藤忠商事	6,296,800	1,884.00	11,863,171,200	
丸紅	1,429,600	4,879.00	6,975,018,400	
長瀬産業	320,200	1,149.50	368,069,900	
蝶理	10,000	3,865.00	38,650,000	
豊田通商	562,700	6,034.00	3,395,331,800	
三共生興	24,400	813.00	19,837,200	
兼松	156,700	2,065.00	323,585,500	
三井物産	2,655,600	4,556.00	12,098,913,600	
日本紙パルプ商事	99,500	1,095.00	108,952,500	
カメイ	17,400	3,640.00	63,336,000	
スターゼン	42,700	1,287.00	54,954,900	
山善	56,800	1,723.00	97,866,400	
椿本興業	12,900	2,809.00	36,236,100	貸付有価証券 9,800株
住友商事	4,430,400	1,555.50	6,891,487,200	
内田洋行	34,500	2,096.00	72,312,000	
三菱商事	3,439,800	4,409.00	15,166,078,200	
第一実業	17,300	3,330.00	57,609,000	貸付有価証券 13,300株
キヤノンマーケティングジャパン	88,300	3,485.00	307,725,500	
西華産業	26,900	2,682.00	72,145,800	
佐藤商事	12,900	2,990.00	38,571,000	
東京産業	19,000	830.00	15,770,000	
ＹＵＡＳＡ	16,100	5,470.00	88,067,000	
神鋼商事	14,000	2,452.00	34,328,000	
阪和興業	154,200	1,728.00	266,457,600	
正栄食品工業	12,400	4,190.00	51,956,000	貸付有価証券 8,900株
カナデン	14,900	2,531.00	37,711,900	
ＲＹＯＤＥＮ	14,300	3,920.00	56,056,000	
岩谷産業	186,100	1,973.50	367,268,350	
極東貿易	10,500	1,748.00	18,354,000	
アステナホールディングス	35,400	525.00	18,585,000	
三愛オブリ	41,700	2,174.00	90,655,800	
稲畑産業	42,700	3,920.00	167,384,000	
ＧＳＩクレオス	10,900	2,440.00	26,596,000	
明和産業	26,700	910.00	24,297,000	
ワキタ	31,000	1,820.00	56,420,000	
東邦ホールディングス	53,200	3,966.00	210,991,200	
サンゲツ	47,000	2,990.00	140,530,000	
ミツウロコグループホールディングス	22,700	2,139.00	48,555,300	

シナネンホールディングス	3,700	7,020.00	25,974,000	貸付有価証券 300株
伊藤忠エネクス	46,400	2,039.00	94,609,600	
サンリオ	930,200	1,142.50	1,062,753,500	貸付有価証券 718,000株
サンワテクノス	10,600	3,870.00	41,022,000	貸付有価証券 8,000株
新光商事	22,700	1,588.00	36,047,600	
トーホー	21,900	1,341.00	29,367,900	貸付有価証券 16,700株
三信電気	10,800	2,859.00	30,877,200	
東陽テクニカ	15,500	1,964.00	30,442,000	貸付有価証券 13,100株
モスフードサービス	27,600	3,745.00	103,362,000	
加賀電子	34,800	4,260.00	148,248,000	
ソーダニッカ	18,200	1,152.00	20,966,400	貸付有価証券 13,900株
立花エレテック	11,200	3,365.00	37,688,000	
フォーバル	7,300	1,010.00	7,373,000	貸付有価証券 1,400株
三谷産業	32,700	710.00	23,217,000	貸付有価証券 2,500株
コーア商事ホールディングス	16,700	783.00	13,076,100	貸付有価証券 12,700株
ＫＰＰグループホールディングス	49,000	1,032.00	50,568,000	
ヤマタネ	15,000	2,100.00	31,500,000	貸付有価証券 1,000株
泉州電業	11,900	6,420.00	76,398,000	
トラスコ中山	39,300	2,319.00	91,136,700	
オートバックスセブン	65,200	1,486.00	96,887,200	
モリト	13,300	1,773.00	23,580,900	
加藤産業	23,200	6,110.00	141,752,000	
イエローハット	45,600	1,820.00	82,992,000	
ＪＫホールディングス	12,300	1,463.00	17,994,900	
日伝	10,400	2,750.00	28,600,000	貸付有価証券 8,000株
杉本商事	15,000	1,265.00	18,975,000	
因幡電機産業	97,800	2,708.50	264,891,300	
東テク	20,800	4,065.00	84,552,000	
ミスミグループ本社	264,400	3,994.00	1,056,013,600	
スズケン	62,100	4,938.00	306,649,800	
ジェコス	13,400	1,578.00	21,145,200	
インターメスティック	8,300	1,917.00	15,911,100	
サンエー	42,500	3,260.00	138,550,000	
カワチ薬品	14,700	3,440.00	50,568,000	貸付有価証券 11,300株
エービーシー・マート	98,500	2,620.50	258,119,250	

ハードオフコーポレーション	7,500	2,693.00	20,197,500	
アスクル	36,000	1,266.00	45,576,000	貸付有価証券 27,400株
ゲオホールディングス	21,300	1,987.00	42,323,100	
アンドエスティＨＤ	26,000	3,520.00	91,520,000	
くら寿司	44,100	1,590.00	70,119,000	貸付有価証券 34,000株
キャンドゥ	6,800	3,545.00	24,106,000	貸付有価証券 5,200株
パルグループホールディングス	73,800	1,465.00	108,117,000	
エディオン	89,200	2,291.00	204,357,200	
サーラコーポレーション	39,700	1,146.00	45,496,200	
ハローズ	8,600	3,770.00	32,422,000	
あみやき亭	13,800	1,333.00	18,395,400	
大黒天物産	6,800	4,390.00	29,852,000	
ハニーズホールディングス	16,800	1,392.00	23,385,600	貸付有価証券 12,700株
アルペン	18,200	2,108.00	38,365,600	貸付有価証券 14,000株
クオールホールディングス	23,400	2,041.00	47,759,400	貸付有価証券 17,800株
ジンズホールディングス	12,700	7,740.00	98,298,000	
ビックカメラ	112,300	1,640.50	184,228,150	
ＤＣＭホールディングス	97,300	1,479.00	143,906,700	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	265,800	1,972.00	524,157,600	貸付有価証券 5,900株
Ｊ．フロント　リテイリング	215,100	3,168.00	681,436,800	
ドトール・日レスホールディングス	33,400	2,756.00	92,050,400	
マツキヨココカラ＆カンパニー	326,200	2,423.50	790,545,700	
ブロンコビリー	22,200	2,249.00	49,927,800	貸付有価証券 16,800株
ＺＯＺＯ	295,700	1,161.50	343,455,550	
トレジャー・ファクトリー	13,100	2,196.00	28,767,600	
物語コーポレーション	36,400	4,985.00	181,454,000	貸付有価証券 9,600株
三越伊勢丹ホールディングス	292,100	3,841.00	1,121,956,100	
Ｈａｍｅｅ	9,500	286.00	2,717,000	貸付有価証券 7,100株
クリエイトＳＤホールディングス	26,700	3,255.00	86,908,500	
シュッピン	20,100	1,066.00	21,426,600	
オイシックス	27,200	1,509.00	41,044,800	貸付有価証券 21,500株
ネクステージ	43,000	3,485.00	149,855,000	
ジョイフル本田	51,200	2,242.00	114,790,400	貸付有価証券 39,000株
エターナルホスピタリティグループ	7,800	2,789.00	21,754,200	貸付有価証券 5,900株

ホットランドホールディングス	14,500	1,590.00	23,055,000	貸付有価証券 11,000株
すかいらーくホールディングス	256,200	2,896.00	741,955,200	貸付有価証券 196,400株
綿半ホールディングス	14,700	1,360.00	19,992,000	
ヨシックスホールディングス	5,600	3,260.00	18,256,000	貸付有価証券 4,200株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	92,800	821.00	76,188,800	貸付有価証券 4,000株
あさひ	15,900	1,340.00	21,306,000	
コスモス薬品	31,800	6,362.00	202,311,600	
セブン＆アイ・ホールディングス	2,069,800	2,021.50	4,184,100,700	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	315,700	749.00	236,459,300	貸付有価証券 241,500株
ツルハホールディングス	293,100	2,257.00	661,526,700	
サンマルクホールディングス	16,800	2,532.00	42,537,600	
トリドールホールディングス	53,000	3,968.00	210,304,000	貸付有価証券 40,500株
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	26,900	401.00	10,786,900	貸付有価証券 20,600株
ＪＭホールディングス	27,200	1,261.00	34,299,200	貸付有価証券 18,300株
ユニシアホールディングス	5,800	1,596.00	9,256,800	貸付有価証券 4,400株
バロックジャパンリミテッド	22,300	750.00	16,725,000	貸付有価証券 17,300株
クスリのアオキホールディングス	44,400	3,681.00	163,436,400	貸付有価証券 36,900株
力の源ホールディングス	14,000	1,537.00	21,518,000	貸付有価証券 10,000株
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	215,200	4,806.00	1,034,251,200	
ブルーゾーンホールディングス	111,200	1,751.00	194,711,200	
メディカルシステムネットワーク	18,900	495.00	9,355,500	
Ｊａｐａｎ　Ｅｙｅｗｅａｒ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	6,200	2,452.00	15,202,400	
ノジマ	183,700	1,323.00	243,035,100	
カッパ・クリエイト	29,400	1,514.00	44,511,600	貸付有価証券 22,700株
良品計画	409,100	3,623.00	1,482,169,300	
アドヴァングループ	11,900	924.00	10,995,600	貸付有価証券 1,600株
アルビス	6,300	2,525.00	15,907,500	貸付有価証券 2,800株
Ｇ－７ホールディングス	20,600	1,402.00	28,881,200	
イオン北海道	55,600	848.00	47,148,800	貸付有価証券 31,900株
コジマ	31,300	1,268.00	39,688,400	貸付有価証券 23,900株

コーナン商事	20,700	4,085.00	84,559,500	
エコス	7,100	2,367.00	16,805,700	
ワタミ	22,600	932.00	21,063,200	貸付有価証券 17,200株
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	1,894,000	850.40	1,610,657,600	
西松屋チェーン	41,700	2,011.00	83,858,700	
ゼンショーホールディングス	95,800	8,793.00	842,369,400	
幸楽苑	17,900	1,111.00	19,886,900	貸付有価証券 13,700株
サイゼリヤ	27,300	5,640.00	153,972,000	
ＶＴホールディングス	73,900	470.00	34,733,000	
魚力	6,700	2,308.00	15,463,600	
ユナイテッドアローズ	20,100	2,421.00	48,662,100	
ハイデイ日高	30,400	2,731.00	83,022,400	貸付有価証券 23,200株
コロワイド	105,700	1,887.00	199,455,900	貸付有価証券 81,300株
壱番屋	74,400	900.00	66,960,000	貸付有価証券 57,000株
スギホールディングス	100,800	2,922.00	294,537,600	
薬王堂ホールディングス	10,700	1,656.00	17,719,200	
ダブルエー	7,800	1,417.00	11,052,600	貸付有価証券 1,000株
スクロール	32,300	1,715.00	55,394,500	
ヨンドシーホールディングス	17,900	2,043.00	36,569,700	貸付有価証券 13,800株
木曽路	28,500	2,372.00	67,602,000	貸付有価証券 22,000株
ＳＲＳホールディングス	31,200	1,264.00	39,436,800	貸付有価証券 22,400株
千趣会	37,900	109.00	4,131,100	貸付有価証券 29,100株
リテールパートナーズ	28,100	1,362.00	38,272,200	
Ｊｏｓｈｉｎ	20,500	3,470.00	71,135,000	
日本瓦斯	89,800	2,820.50	253,280,900	
ロイヤルホールディングス	72,600	1,251.00	90,822,600	貸付有価証券 55,600株
チヨダ	18,500	997.00	18,444,500	貸付有価証券 14,100株
ライフコーポレーション	36,000	2,426.00	87,336,000	
リンガーハット	25,900	2,201.00	57,005,900	貸付有価証券 19,700株
ＭｒＭａｘＨＤ	16,200	777.00	12,587,400	
ＡＯＫＩホールディングス	40,400	1,670.00	67,468,000	
オークワ	25,000	783.00	19,575,000	貸付有価証券 19,100株

コメリ	25,000	3,460.00	86,500,000	貸付有価証券 4,100株
青山商事	120,700	707.00	85,334,900	
しまむら	132,100	3,318.00	438,307,800	
高島屋	262,900	2,291.00	602,303,900	
松屋	35,300	1,728.00	60,998,400	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	91,300	2,797.00	255,366,100	
近鉄百貨店	10,900	1,812.00	19,750,800	貸付有価証券 8,300株
丸井グループ	109,600	2,931.50	321,292,400	
アクシアル　リテイリング	51,400	1,170.00	60,138,000	
イオン	2,212,100	1,377.00	3,046,061,700	
イズミ	99,500	981.00	97,609,500	
平和堂	30,700	2,551.00	78,315,700	貸付有価証券 23,700株
フジ	28,800	1,971.00	56,764,800	
ゼビオホールディングス	22,500	1,091.00	24,547,500	
ケーズホールディングス	122,600	1,803.50	221,109,100	
シルバーライフ	5,500	663.00	3,646,500	貸付有価証券 4,100株
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	16,500	3,760.00	62,040,000	
ブックオフグループホールディングス	13,800	2,084.00	28,759,200	貸付有価証券 10,500株
ギフトホールディングス	10,700	4,370.00	46,759,000	貸付有価証券 8,100株
アインホールディングス	18,900	5,585.00	105,556,500	
Ｇｅｎｋｉ　Ｇｌｏｂａｌ　Ｄｉｎｉｎｇ	10,700	3,300.00	35,310,000	貸付有価証券 8,100株
ヤマダホールディングス	576,800	650.40	375,150,720	
アークランズ	55,900	1,873.00	104,700,700	貸付有価証券 42,200株
ニトリホールディングス	303,300	2,380.00	721,854,000	
グルメ杵屋	15,500	964.00	14,942,000	貸付有価証券 11,900株
ケーユーホールディングス	13,400	1,178.00	15,785,200	
吉野家ホールディングス	69,100	3,406.00	235,354,600	貸付有価証券 52,700株
松屋フーズホールディングス	8,900	4,885.00	43,476,500	貸付有価証券 6,800株
サガミホールディングス	30,300	1,753.00	53,115,900	貸付有価証券 23,200株
王将フードサービス	38,800	2,915.00	113,102,000	
ミニストップ	13,600	1,842.00	25,051,200	貸付有価証券 200株
アークス	31,600	3,510.00	110,916,000	
バローホールディングス	35,900	3,270.00	117,393,000	貸付有価証券 27,300株
ベルク	8,300	6,430.00	53,369,000	

大庄	11,600	1,097.00	12,725,200	貸付有価証券 8,700株
ファーストリテイリング	126,400	82,110.00	10,378,704,000	
サンドラッグ	55,400	3,799.00	210,464,600	
サックスバー　ホールディングス	16,200	768.00	12,441,600	貸付有価証券 1,900株
ベルーナ	45,500	1,023.00	46,546,500	
いよぎんホールディングス	228,300	3,259.00	744,029,700	
しずおかフィナンシャルグループ	384,100	3,279.00	1,259,463,900	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	146,800	3,235.00	474,898,000	
楽天銀行	92,400	5,735.00	529,914,000	
京都フィナンシャルグループ	239,500	4,654.00	1,114,633,000	
めぶきフィナンシャルグループ	815,200	1,539.50	1,255,000,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	210,400	1,700.00	357,680,000	
九州フィナンシャルグループ	337,500	1,517.50	512,156,250	
ゆうちょ銀行	1,894,300	3,261.00	6,177,312,300	
富山第一銀行	55,400	2,677.00	148,305,800	
横浜フィナンシャルグループ	909,500	1,870.00	1,700,765,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	106,600	4,340.00	462,644,000	
三十三フィナンシャルグループ	67,600	1,799.00	121,612,400	
第四北越フィナンシャルグループ	164,300	2,246.00	369,017,800	
ひろぎんホールディングス	242,600	2,199.00	533,477,400	
おきなわフィナンシャルグループ	14,800	6,760.00	100,048,000	
十六フィナンシャルグループ	122,400	2,464.00	301,593,600	
ＣＣＩグループ	182,000	1,034.00	188,188,000	
プロクレアホールディングス	21,300	4,065.00	86,584,500	
あいちフィナンシャルグループ	178,900	1,498.00	267,992,200	
ＳＢＩ新生銀行	296,500	1,449.00	429,628,500	貸付有価証券 226,700株
あおぞら銀行	111,100	2,907.50	323,023,250	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,001,800	3,461.00	38,077,229,800	
りそなホールディングス	2,138,800	2,335.50	4,995,167,400	
三井住友トラストグループ	601,600	6,558.00	3,945,292,800	
三井住友フィナンシャルグループ	3,801,700	6,814.00	25,904,783,800	
千葉銀行	513,500	2,753.50	1,413,922,250	
群馬銀行	314,600	2,492.50	784,140,500	
武蔵野銀行	73,000	2,621.00	191,333,000	
千葉興業銀行	33,000	2,706.00	89,298,000	
筑波銀行	76,500	615.00	47,047,500	
七十七銀行	167,500	3,515.00	588,762,500	
秋田銀行	11,700	7,140.00	83,538,000	
山形銀行	22,400	3,690.00	82,656,000	
岩手銀行	44,100	2,083.00	91,860,300	

東邦銀行	200,600	820.00	164,492,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	139,200	7,286.00	1,014,211,200	
スルガ銀行	102,600	2,569.00	263,579,400	
八十二長野銀行	359,700	2,551.00	917,594,700	
山梨中央銀行	21,100	6,510.00	137,361,000	
大垣共立銀行	35,500	7,860.00	279,030,000	
福井銀行	16,700	5,760.00	96,192,000	
清水銀行	6,900	2,636.00	18,188,400	
滋賀銀行	119,400	2,888.00	344,827,200	
南都銀行	131,200	1,859.00	243,900,800	
百五銀行	164,100	2,064.00	338,702,400	
紀陽銀行	57,900	4,605.00	266,629,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	104,300	7,510.00	783,293,000	
山陰合同銀行	109,100	2,428.00	264,894,800	
百十四銀行	68,200	2,651.00	180,798,200	
四国銀行	27,400	3,135.00	85,899,000	
阿波銀行	25,800	7,530.00	194,274,000	
大分銀行	54,300	2,509.00	136,238,700	
宮崎銀行	50,800	2,194.00	111,455,200	
佐賀銀行	10,900	5,590.00	60,931,000	
琉球銀行	37,100	2,755.00	102,210,500	
セブン銀行	546,600	290.20	158,623,320	
みずほフィナンシャルグループ	2,426,300	8,307.00	20,155,274,100	
山口フィナンシャルグループ	171,000	2,972.50	508,297,500	
名古屋銀行	32,700	6,460.00	211,242,000	
北洋銀行	225,300	1,170.00	263,601,000	
愛媛銀行	25,400	2,239.00	56,870,600	
京葉銀行	75,300	2,591.00	195,102,300	
栃木銀行	94,400	976.00	92,134,400	
北日本銀行	5,500	5,700.00	31,350,000	
東和銀行	33,200	1,272.00	42,230,400	
トモニホールディングス	166,600	910.00	151,606,000	
フィデアホールディングス	18,000	2,034.00	36,612,000	
池田泉州ホールディングス	241,900	1,010.00	244,319,000	
ＦＰＧ	55,500	1,562.00	86,691,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	28,300	2,067.00	58,496,100	貸付有価証券 21,500株
ＳＢＩホールディングス	612,900	2,800.00	1,716,120,000	
ジャフコ　グループ	46,700	2,355.00	109,978,500	
大和証券グループ本社	1,247,000	1,768.50	2,205,319,500	
野村ホールディングス	2,863,200	1,543.00	4,417,917,600	
岡三証券グループ	137,800	1,016.00	140,004,800	
丸三証券	58,000	1,119.00	64,902,000	

東洋証券	53,800	647.00	34,808,600	貸付有価証券 41,300株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	206,400	776.00	160,166,400	
水戸証券	47,800	697.00	33,316,600	
いちよし証券	32,700	1,479.00	48,363,300	
松井証券	120,200	1,035.00	124,407,000	
マネックスグループ	183,300	715.00	131,059,500	
極東証券	23,900	1,658.00	39,626,200	
岩井コスモホールディングス	18,200	4,185.00	76,167,000	
アイザワ証券グループ	18,300	1,584.00	28,987,200	貸付有価証券 3,600株
スパークス・グループ	19,200	2,256.00	43,315,200	貸付有価証券 14,600株
ライフネット生命保険	37,400	1,662.00	62,158,800	
かんぽ生命保険	591,000	1,612.50	952,987,500	
ＦＰパートナー	7,800	2,250.00	17,550,000	貸付有価証券 6,000株
ＳＯＭＰＯホールディングス	866,100	6,513.00	5,640,909,300	
アニコム　ホールディングス	54,700	1,220.00	66,734,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	1,087,200	4,428.00	4,814,121,600	
ソニーフィナンシャルグループ	5,785,400	149.30	863,760,220	
第一ライフグループ	3,357,200	1,861.00	6,247,749,200	
東京海上ホールディングス	1,792,900	7,609.00	13,642,176,100	
Ｔ＆Ｄホールディングス	387,800	4,916.00	1,906,424,800	
ＮＳグループ	23,300	1,524.00	35,509,200	
ムニノバホールディングス	288,800	442.00	127,649,600	
全国保証	100,300	3,075.00	308,422,500	
ジェイリース	13,100	1,355.00	17,750,500	
ＳＢＩアルヒ	17,700	808.00	14,301,600	貸付有価証券 13,700株
プレミアグループ	29,600	2,096.00	62,041,600	
ネットプロテクションズホールディングス	52,700	372.00	19,604,400	
クレディセゾン	85,300	4,582.00	390,844,600	
芙蓉総合リース	48,100	4,267.00	205,242,700	
みずほリース	131,000	1,296.00	169,776,000	
東京センチュリー	130,300	2,530.00	329,659,000	
日本証券金融	60,500	2,376.00	143,748,000	
リコーリース	16,500	6,430.00	106,095,000	
イオンフィナンシャルサービス	100,100	1,518.00	151,951,800	
アコム	311,200	480.00	149,376,000	
ジャックス	20,900	3,690.00	77,121,000	
オリエントコーポレーション	68,300	883.00	60,308,900	
オリックス	1,042,100	6,469.00	6,741,344,900	
三菱ＨＣキャピタル	874,200	1,364.50	1,192,845,900	

日本取引所グループ	956,500	2,176.50	2,081,822,250	
イー・ギャランティ	27,000	1,845.00	49,815,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	8,600	4,145.00	35,647,000	
ｒｏｂｏｔ　ｈｏｍｅ	50,700	170.00	8,619,000	貸付有価証券 39,000株
大東建託	296,800	3,161.00	938,184,800	
いちご	138,700	443.00	61,444,100	
日本駐車場開発	209,100	257.00	53,738,700	
スター・マイカ・ホールディングス	18,600	1,516.00	28,197,600	
ＳＲＥホールディングス	8,800	2,526.00	22,228,800	貸付有価証券 1,600株
ヒューリック	508,700	1,755.00	892,768,500	
野村不動産ホールディングス	486,700	928.20	451,754,940	
三重交通グループホールディングス	43,300	547.00	23,685,100	貸付有価証券 33,200株
ディア・ライフ	30,100	1,071.00	32,237,100	
地主	14,400	2,918.00	42,019,200	
ＪＰＭＣ	9,700	1,587.00	15,393,900	
フージャースホールディングス	30,400	1,234.00	37,513,600	
オープンハウスグループ	54,200	8,550.00	463,410,000	
東急不動産ホールディングス	476,900	1,299.00	619,493,100	
飯田グループホールディングス	148,700	2,210.00	328,627,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	9,300	968.00	9,002,400	貸付有価証券 8,000株
ケイアイスター不動産	14,700	3,740.00	54,978,000	
グッドコムアセット	18,500	1,490.00	27,565,000	貸付有価証券 14,100株
ジェイ・エス・ビー	7,400	8,990.00	66,526,000	貸付有価証券 5,600株
ロードスターキャピタル	12,100	2,699.00	32,657,900	
アズーム	3,200	4,405.00	14,096,000	
霞ヶ関キャピタル	17,300	6,890.00	119,197,000	
パーク２４	124,800	1,981.50	247,291,200	
パラカ	5,100	2,100.00	10,710,000	
三井不動産	2,519,700	1,511.00	3,807,266,700	
三菱地所	1,047,900	4,179.00	4,379,174,100	
平和不動産	33,100	2,356.00	77,983,600	
東京建物	165,400	3,348.00	553,759,200	
京阪神ビルディング	52,000	1,162.00	60,424,000	
住友不動産	495,900	3,762.00	1,865,575,800	
テーオーシー	31,500	947.00	29,830,500	
レオパレス２１	155,000	666.00	103,230,000	
スターツコーポレーション	32,300	4,735.00	152,940,500	
フジ住宅	22,400	773.00	17,315,200	貸付有価証券 13,500株

空港施設	24,500	979.00	23,985,500	
明和地所	14,300	823.00	11,768,900	貸付有価証券 10,900株
ゴールドクレスト	9,600	3,345.00	32,112,000	
エスリード	8,300	5,060.00	41,998,000	貸付有価証券 5,700株
日神グループホールディングス	28,500	663.00	18,895,500	貸付有価証券 21,700株
エスコン	39,200	1,119.00	43,864,800	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	111,500	411.00	45,826,500	
カチタス	47,000	3,235.00	152,045,000	
トーセイ	51,800	1,747.00	90,494,600	
サンフロンティア不動産	26,000	2,499.00	64,974,000	
ＦＪネクストホールディングス	16,200	1,826.00	29,581,200	
グランディハウス	16,900	537.00	9,075,300	
日本空港ビルデング	61,800	5,301.00	327,601,800	
ＬＩＦＵＬＬ	54,100	204.00	11,036,400	
ジェイエイシーリクルートメント	65,900	874.00	57,596,600	
日本M＆Aセンターホールディングス	290,300	676.70	196,446,010	
フィットイージー	4,200	2,688.00	11,289,600	貸付有価証券 3,100株
メンバーズ	6,400	1,129.00	7,225,600	
ＵＴグループ	357,800	179.00	64,046,200	
アイティメディア	9,900	1,182.00	11,701,800	貸付有価証券 7,300株
Ｅ・Ｊホールディングス	12,200	1,681.00	20,508,200	
オープンアップグループ	54,200	1,942.00	105,256,400	
コシダカホールディングス	50,000	970.00	48,500,000	貸付有価証券 29,700株
パソナグループ	18,700	1,532.00	28,648,400	貸付有価証券 14,300株
リンクアンドモチベーション	43,300	585.00	25,330,500	貸付有価証券 11,000株
エス・エム・エス	69,600	2,343.00	163,072,800	
パーソルホールディングス	1,660,200	255.30	423,849,060	
クックパッド	27,300	117.00	3,194,100	貸付有価証券 20,900株
学情	8,300	1,625.00	13,487,500	貸付有価証券 6,700株
スタジオアリス	9,200	1,908.00	17,553,600	貸付有価証券 7,000株
ＮＪＳ	4,000	4,525.00	18,100,000	貸付有価証券 3,200株
ＡＬＳＯＫ	304,200	1,093.50	332,642,700	
カカクコム	118,600	3,630.00	430,518,000	
ルネサンス	14,200	1,041.00	14,782,200	貸付有価証券 10,900株

ディップ	31,900	1,869.00	59,621,100	貸付有価証券 24,600株
新日本科学	19,400	1,275.00	24,735,000	貸付有価証券 14,800株
エムスリー	359,800	1,870.00	672,826,000	
ワールドホールディングス	8,400	2,561.00	21,512,400	
博報堂ＤＹホールディングス	217,000	1,200.50	260,508,500	
ぐるなび	34,900	126.00	4,397,400	貸付有価証券 26,700株
タカミヤ	25,000	407.00	10,175,000	
ファンコミュニケーションズ	26,700	401.00	10,706,700	貸付有価証券 20,400株
ライク	9,600	1,505.00	14,448,000	貸付有価証券 7,300株
エスプール	47,700	268.00	12,783,600	貸付有価証券 36,400株
ＷＤＢホールディングス	8,000	1,787.00	14,296,000	
アドウェイズ	20,000	303.00	6,060,000	貸付有価証券 15,100株
バリューコマース	16,300	467.00	7,612,100	貸付有価証券 12,400株
インフォマート	172,200	490.00	84,378,000	
ＪＰホールディングス	46,800	614.00	28,735,200	貸付有価証券 35,800株
グロービング	5,800	2,106.00	12,214,800	貸付有価証券 4,300株
ＣＬホールディングス	5,500	1,111.00	6,110,500	貸付有価証券 4,200株
プレステージ・インターナショナル	67,600	666.00	45,021,600	
アミューズ	9,900	1,880.00	18,612,000	
ドリームインキュベータ	5,700	2,566.00	14,626,200	貸付有価証券 4,200株
クイック	45,100	761.00	34,321,100	
電通グループ	176,100	3,324.00	585,356,400	貸付有価証券 135,300株
テイクアンドギヴ・ニーズ	8,900	682.00	6,069,800	
イオンファンタジー	7,900	2,561.00	20,231,900	貸付有価証券 6,000株
シーティーエス	22,400	870.00	19,488,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	6,100	900.00	5,490,000	貸付有価証券 3,900株
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	57,100	3,381.00	193,055,100	
アルプス技研	45,300	803.00	36,375,900	
サニックスホールディングス	23,300	249.00	5,801,700	貸付有価証券 17,700株
日本空調サービス	19,600	1,633.00	32,006,800	
オリエンタルランド	1,073,000	2,615.00	2,805,895,000	
ダスキン	41,400	4,469.00	185,016,600	

明光ネットワークジャパン	22,400	709.00	15,881,600	貸付有価証券 18,400株
ファルコホールディングス	7,100	2,682.00	19,042,200	
ラウンドワン	172,500	1,235.00	213,037,500	
リゾートトラスト	172,500	1,733.00	298,942,500	
ビー・エム・エル	24,300	3,655.00	88,816,500	
リソー教育グループ	57,600	206.00	11,865,600	貸付有価証券 16,600株
早稲田アカデミー	8,900	2,455.00	21,849,500	貸付有価証券 6,800株
ユー・エス・エス	345,300	1,982.50	684,557,250	
サイバーエージェント	403,100	1,495.50	602,836,050	
楽天グループ	1,440,100	803.20	1,156,688,320	
クリーク・アンド・リバー社	10,800	1,448.00	15,638,400	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	34,300	577.00	19,791,100	
テー・オー・ダブリュー	33,100	335.00	11,088,500	貸付有価証券 7,600株
GMOインターネット	4,600	514.00	2,364,400	貸付有価証券 3,500株
山田コンサルティンググループ	8,000	1,691.00	13,528,000	
セントラルスポーツ	7,700	2,384.00	18,356,800	貸付有価証券 5,900株
フルキャストホールディングス	14,000	1,602.00	22,428,000	貸付有価証券 10,100株
エン	29,700	1,216.00	36,115,200	
弁護士ドットコム	6,800	2,374.00	16,143,200	貸付有価証券 5,200株
アイ・アールジャパンホールディングス	9,600	714.00	6,854,400	
ＫｅｅＰｅｒ技研	11,300	2,945.00	33,278,500	貸付有価証券 8,700株
Ｇｕｎｏｓｙ	14,700	463.00	6,806,100	貸付有価証券 11,300株
イー・ガーディアン	5,600	1,747.00	9,783,200	貸付有価証券 4,200株
ジャパンマテリアル	55,800	2,657.00	148,260,600	
ベクトル	24,900	1,982.00	49,351,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,200	1,360.00	20,672,000	
キャリアリンク	6,700	2,343.00	15,698,100	貸付有価証券 1,100株
ＩＢＪ	14,100	847.00	11,942,700	
アサンテ	9,100	1,491.00	13,568,100	貸付有価証券 6,900株
バリューＨＲ	16,400	1,509.00	24,747,600	貸付有価証券 12,300株
M&Aキャピタルパートナーズ	14,700	3,610.00	53,067,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,400	987.00	7,303,800	貸付有価証券 5,600株
シグマクシス・ホールディングス	51,500	569.00	29,303,500	

ウィルグループ	16,900	1,068.00	18,049,200	貸付有価証券 13,000株
リクルートホールディングス	1,267,600	12,240.00	15,515,424,000	
エラン	16,200	761.00	12,328,200	
日本郵政	1,497,400	2,319.50	3,473,219,300	
ベルシステム２４ホールディングス	24,800	1,358.00	33,678,400	
鎌倉新書	18,300	521.00	9,534,300	貸付有価証券 14,100株
エアトリ	15,000	870.00	13,050,000	
アトラエ	13,800	805.00	11,109,000	貸付有価証券 10,600株
ストライクグループ	26,900	1,341.00	36,072,900	貸付有価証券 19,800株
インソース	39,800	625.00	24,875,000	
ベイカレント	133,800	6,692.00	895,389,600	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	4,100	1,177.00	4,825,700	貸付有価証券 3,100株
アイモバイル	27,200	518.00	14,089,600	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	11,700	985.00	11,524,500	貸付有価証券 9,000株
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	154,000	1,826.50	281,281,000	
エル・ティー・エス	2,600	1,830.00	4,758,000	
ミダックホールディングス	9,300	2,148.00	19,976,400	
キュービーネットホールディングス	8,900	1,265.00	11,258,500	貸付有価証券 6,700株
オープングループ	25,600	219.00	5,606,400	
マネジメントソリューションズ	10,100	1,352.00	13,655,200	
プロレド・パートナーズ	4,800	343.00	1,646,400	
フロンティア・マネジメント	7,300	557.00	4,066,100	貸付有価証券 5,600株
アンビスホールディングス	39,300	375.00	14,737,500	貸付有価証券 30,100株
カーブスホールディングス	49,900	921.00	45,957,900	貸付有価証券 38,100株
Ｍａｃｂｅｅ　Ｐｌａｎｅｔ	7,000	1,149.00	8,043,000	貸付有価証券 5,300株
ダイレクトマーケティングミックス	19,400	352.00	6,828,800	
ポピンズ	2,800	1,492.00	4,177,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	16,600	1,645.00	27,307,000	
リログループ	81,100	2,089.00	169,417,900	
東祥	15,300	777.00	11,888,100	
ビーウィズ	4,800	1,620.00	7,776,000	貸付有価証券 3,600株
サンウェルズ	14,400	155.00	2,232,000	貸付有価証券 11,000株
ＴＲＥホールディングス	41,900	2,144.00	89,833,600	
人・夢・技術グループ	7,000	1,530.00	10,710,000	

ＮＩＳＳＯホールディングス	16,000	607.00	9,712,000	貸付有価証券 8,300株
大栄環境	39,700	3,945.00	156,616,500	
ＧＥＮＯＶＡ	10,900	620.00	6,758,000	貸付有価証券 3,300株
日本管財ホールディングス	19,100	2,729.00	52,123,900	
クオンツ総研ホールディングス	21,600	844.00	18,230,400	貸付有価証券 700株
エイチ・アイ・エス	53,000	993.00	52,629,000	
ラックランド	8,300	1,282.00	10,640,600	
共立メンテナンス	69,500	2,896.50	201,306,750	
イチネンホールディングス	17,300	2,285.00	39,530,500	
建設技術研究所	18,800	2,950.00	55,460,000	
スペース	13,300	1,448.00	19,258,400	
燦ホールディングス	15,300	1,427.00	21,833,100	
スバル興業	6,200	3,585.00	22,227,000	
タナベコンサルティンググループ	15,400	766.00	11,796,400	貸付有価証券 11,700株
ナガワ	4,900	5,040.00	24,696,000	貸付有価証券 1,000株
東京都競馬	13,000	4,840.00	62,920,000	
カナモト	25,700	5,130.00	131,841,000	
ニシオホールディングス	15,000	4,030.00	60,450,000	
トランス・コスモス	23,300	3,650.00	85,045,000	
乃村工藝社	79,500	1,183.00	94,048,500	
藤田観光	36,400	1,878.00	68,359,200	貸付有価証券 29,000株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	9,000	1,951.00	17,559,000	
トーカイ	13,200	2,416.00	31,891,200	
セコム	339,900	6,622.00	2,250,817,800	
セントラル警備保障	8,900	2,728.00	24,279,200	
丹青社	38,600	1,390.00	53,654,000	貸付有価証券 29,500株
メイテックグループホールディングス	67,200	3,174.00	213,292,800	
応用地質	16,100	2,771.00	44,613,100	貸付有価証券 12,300株
船井総研ホールディングス	73,000	1,100.00	80,300,000	
学究社	7,300	2,553.00	18,636,900	
ナック	18,800	528.00	9,926,400	貸付有価証券 5,700株
ダイセキ	35,000	3,950.00	138,250,000	
ステップ	6,700	2,247.00	15,054,900	
合　計	371,079,500		997,722,383,380	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	482,746,283
株式	31,621,493,540
投資証券	89,203,700
派生商品評価勘定	8,383,936
未収入金	10,397,772
未収配当金	31,297,079
未収利息	12,762
差入委託証拠金	21,852,132
流動資産合計	32,265,387,204
資産合計	32,265,387,204
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	250,940
前受金	8,140,300
未払解約金	207,285,056
流動負債合計	215,676,296
負債合計	215,676,296
純資産の部	
元本等	
元本	13,243,451,362
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	18,806,259,546
元本等合計	32,049,710,908
純資産合計	32,049,710,908
負債純資産合計	32,265,387,204

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 先物取引

	2026年 7月10日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2026年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		13,243,451,362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	2.4200円
	(1万口当たり純資産額)	(24,200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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2026年 7月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	11,549,751,477円
期中追加設定元本額	2,701,958,702円
期中一部解約元本額	1,008,258,817円
期末元本額	13,243,451,362円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	118,434,713円
コア投資戦略ファンド（成長型）	307,659,299円
コア投資戦略ファンド（切替型）	120,271,683円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	9,133,479,408円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	68,049,681円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	119,358,366円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,249,866円
ＤＣ日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスファンド	3,229,967,168円
私募日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	61,506,603円
ＦＯＦｓ用　日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	49,474,575円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,179,633,290
投資証券	△2,169,964
合計	3,177,463,326

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	328,673,700	－	336,814,000	8,140,300
合計		328,673,700	－	336,814,000	8,140,300

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数（株）	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ＩＮＰＥＸ	48,100	3,361.00	161,664,100	
ミライト・ワン	4,500	3,750.00	16,875,000	
安藤・間	7,900	1,813.00	14,322,700	
大成建設	7,800	13,950.00	108,810,000	
大林組	34,000	3,225.00	109,650,000	
清水建設	26,400	2,492.50	65,802,000	
鹿島建設	21,600	5,760.00	124,416,000	
戸田建設	10,800	1,558.00	16,826,400	
熊谷組	7,100	1,484.00	10,536,400	
住友林業	25,300	1,321.00	33,421,300	
大和ハウス工業	30,600	4,506.00	137,883,600	
積水ハウス	32,600	3,455.00	112,633,000	
三機工業	5,700	2,650.00	15,105,000	
高砂熱学工業	5,000	4,795.00	23,975,000	
大氣社	2,300	4,785.00	11,005,500	
インフロニア・ホールディングス	11,200	2,844.50	31,858,400	
明治ホールディングス	13,100	3,771.00	49,400,100	
サッポロビール	16,700	1,993.50	33,291,450	
アサヒグループホールディングス	76,800	1,581.00	121,420,800	
キリンホールディングス	42,300	2,837.00	120,005,100	
サントリービバレッジ＆フード	6,700	4,547.00	30,464,900	
キッコーマン	37,000	1,619.00	59,903,000	
味の素	46,700	5,731.00	267,637,700	
カゴメ	4,500	2,677.00	12,046,500	
ニチレイ	10,800	2,134.00	23,047,200	
日清食品ホールディングス	9,700	2,794.50	27,106,650	
帝人	9,500	1,662.50	15,793,750	
東レ	69,800	1,142.50	79,746,500	
ゴールドウイン	3,100	2,241.50	6,948,650	
東洋紡	4,400	1,727.00	7,598,800	
クラレ	14,300	1,686.00	24,109,800	
旭化成	67,100	1,842.00	123,598,200	
レゾナック・ホールディングス	9,600	16,150.00	155,040,000	
住友化学	79,200	537.20	42,546,240	
日産化学	6,600	8,100.00	53,460,000	
東ソー	14,600	2,705.00	39,493,000	
三井化学	19,200	2,088.00	40,089,600	
三菱ケミカルグループ	64,900	1,161.50	75,381,350	
ダイセル	11,300	1,402.50	15,848,250	
積水化学工業	19,400	2,609.50	50,624,300	

ＵＢＥ	4,800	3,147.00	15,105,600	
日本化薬	6,500	1,982.50	12,886,250	
花王	49,500	3,219.00	159,340,500	
日本ペイントホールディングス	51,700	1,076.50	55,655,050	
関西ペイント	7,800	2,675.50	20,868,900	
中国塗料	2,000	3,535.00	7,070,000	
サカタインクス	2,100	2,401.00	5,042,100	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	1,800	4,350.00	7,830,000	
富士フイルムホールディングス	61,100	3,586.00	219,104,600	
資生堂	21,800	2,755.00	60,059,000	
ライオン	13,000	1,671.50	21,729,500	
コニシ	2,500	1,451.00	3,627,500	
長谷川香料	1,600	3,225.00	5,160,000	
日東電工	37,000	3,193.00	118,141,000	
ニフコ	3,800	5,089.00	19,338,200	
アステラス製薬	93,800	2,142.00	200,919,600	
塩野義製薬	41,300	2,832.50	116,982,250	
中外製薬	36,700	7,389.00	271,176,300	
エーザイ	13,900	4,296.00	59,714,400	
栄研化学	1,600	2,532.00	4,051,200	
第一三共	93,000	2,730.50	253,936,500	
出光興産	42,200	1,240.00	52,328,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	140,300	1,252.00	175,655,600	
ブリヂストン	58,200	3,569.00	207,715,800	
東海カーボン	10,400	1,671.50	17,383,600	
ＴＯＴＯ	7,300	8,059.00	58,830,700	
ＮＧＫ	11,900	7,061.00	84,025,900	
日本特殊陶業	8,200	10,425.00	85,485,000	
神戸製鋼所	20,500	1,860.00	38,130,000	
ＪＦＥホールディングス	31,400	1,623.00	50,962,200	
大同特殊鋼	7,100	2,509.50	17,817,450	
ＪＸ金属	29,900	3,962.00	118,463,800	
日本軽金属ホールディングス	3,000	2,707.00	8,121,000	
三井金属	3,000	36,460.00	109,380,000	
三菱マテリアル	6,800	4,087.00	27,791,600	
住友金属鉱山	13,100	7,275.00	95,302,500	
ＤＯＷＡホールディングス	2,900	8,376.00	24,290,400	
ＵＡＣＪ	8,600	2,524.00	21,706,400	
三和ホールディングス	9,600	3,670.00	35,232,000	
ＬＩＸＩＬ	14,900	1,838.50	27,393,650	
三浦工業	4,800	3,211.00	15,412,800	
アマダ	16,500	3,013.00	49,714,500	

ディスコ	4,700	72,560.00	341,032,000	
ナブテスコ	5,800	5,428.00	31,482,400	
小松製作所	47,000	6,395.00	300,565,000	
クボタ	52,800	2,713.50	143,272,800	
荏原製作所	25,000	6,127.00	153,175,000	
ダイキン工業	14,400	25,110.00	361,584,000	
栗田工業	5,400	9,105.00	49,167,000	
ダイフク	17,100	6,867.00	117,425,700	
セガサミーホールディングス	7,500	2,400.00	18,000,000	
ＮＴＮ	26,100	390.10	10,181,610	
キッツ	3,300	2,400.00	7,920,000	
カナデビア	8,600	1,236.00	10,629,600	
三菱重工業	174,900	3,818.00	667,768,200	
イビデン	12,700	20,300.00	257,810,000	
コニカミノルタ	24,700	584.20	14,429,740	
ブラザー工業	12,300	3,735.00	45,940,500	
日立製作所	241,300	4,700.00	1,134,110,000	
富士電機	7,500	13,030.00	97,725,000	
明電舎	1,900	9,070.00	17,233,000	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	12,000	10,840.00	130,080,000	
マブチモーター	9,200	1,610.50	14,816,600	
オムロン	9,600	6,010.00	57,696,000	
日本電気	67,000	4,333.00	290,311,000	
富士通	92,600	3,347.00	309,932,200	
ルネサスエレクトロニクス	94,400	4,762.00	449,532,800	
セイコーエプソン	15,300	2,869.00	43,895,700	
パナソニック　ホールディングス	127,300	4,480.00	570,304,000	
シャープ	10,600	648.30	6,871,980	
アンリツ	7,000	4,262.00	29,834,000	
ソニーグループ	318,800	3,359.00	1,070,849,200	
アルプスアルパイン	8,800	2,081.50	18,317,200	
マクセル	1,800	2,087.00	3,756,600	
横河電機	11,900	5,559.00	66,152,100	
アズビル	23,600	1,689.00	39,860,400	
シスメックス	24,900	1,531.00	38,121,900	
スタンレー電気	4,500	3,512.00	15,804,000	
ウシオ電機	3,400	4,363.00	14,834,200	
ファナック	50,900	7,156.00	364,240,400	
太陽誘電	6,600	14,730.00	97,218,000	
村田製作所	88,400	9,860.00	871,624,000	
キヤノン	43,700	4,340.00	189,658,000	
リコー	28,000	1,497.00	41,916,000	

東京エレクトロン	24,500	72,940.00	1,787,030,000	
いすゞ自動車	28,200	2,349.00	66,241,800	
トヨタ自動車	517,200	2,823.00	1,460,055,600	
ヤマハ発動機	48,600	1,243.50	60,434,100	
島津製作所	12,500	4,140.00	51,750,000	
東京精密	2,100	18,905.00	39,700,500	
ニコン	11,800	2,232.50	26,343,500	
ＨＯＹＡ	18,500	24,975.00	462,037,500	
ノーリツ鋼機	3,000	1,998.00	5,994,000	
メニコン	3,100	1,663.00	5,155,300	
バンダイナムコホールディングス	27,500	4,017.00	110,467,500	
大日本印刷	19,800	3,168.00	62,726,400	
アシックス	37,100	4,579.00	169,880,900	
ローランド	800	4,030.00	3,224,000	
ヤマハ	20,200	1,180.50	23,846,100	
ピジョン	6,100	2,060.50	12,569,050	
リンテック	2,200	6,560.00	14,432,000	
コクヨ	17,400	842.60	14,661,240	
美津濃	2,900	3,515.00	10,193,500	
中部電力	36,200	3,208.00	116,129,600	
東京瓦斯	16,200	5,966.00	96,649,200	
大阪瓦斯	18,500	5,363.00	99,215,500	
東急	26,400	1,702.50	44,946,000	
京王電鉄	25,300	746.00	18,873,800	
東日本旅客鉄道	52,600	3,478.00	182,942,800	
西日本旅客鉄道	22,400	2,886.50	64,657,600	
西武ホールディングス	10,800	3,525.00	38,070,000	
阪急阪神ホールディングス	12,300	4,602.00	56,604,600	
ＮＡＮＫＡＩ	5,000	2,912.50	14,562,500	
京阪ホールディングス	5,000	3,183.00	15,915,000	
名古屋鉄道	10,200	1,859.50	18,966,900	
ヤマトホールディングス	12,300	1,944.00	23,911,200	
山九	2,200	8,694.00	19,126,800	
九州旅客鉄道	7,200	3,544.00	25,516,800	
ＳＧホールディングス	15,700	1,570.50	24,656,850	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	10,600	5,323.00	56,423,800	
ＡＮＡホールディングス	8,800	3,016.00	26,540,800	
三井倉庫ホールディングス	3,000	3,487.00	10,461,000	
ＴＩＳＩ	10,900	3,428.00	37,365,200	
ＳＨＩＦＴ	10,200	676.50	6,900,300	
ラクス	8,700	1,036.50	9,017,550	
マネーフォワード	2,400	4,935.00	11,844,000	

Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	3,600	903.00	3,250,800	
野村総合研究所	20,600	4,979.00	102,567,400	
メルカリ	6,300	4,785.00	30,145,500	
ウイングアーク１ｓｔ	1,100	2,543.00	2,797,300	
Ｓａｎｓａｎ	3,800	1,723.00	6,547,400	
フリー	2,400	2,250.00	5,400,000	
ＬＩＮＥヤフー	140,900	445.40	62,756,860	
大塚商会	12,400	2,893.50	35,879,400	
電通総研	3,700	2,702.00	9,997,400	
ＢＩＰＲＯＧＹ	4,100	4,567.00	18,724,700	
スカパーＪＳＡＴ	5,400	2,530.00	13,662,000	
ＫＤＤＩ	160,000	2,790.50	446,480,000	
ソフトバンク	1,570,400	211.40	331,982,560	
ソフトバンクグループ	202,600	6,370.00	1,290,562,000	
あらた	1,500	2,530.00	3,795,000	
双日	11,400	5,100.00	58,140,000	
アルフレッサ　ホールディングス	8,900	2,201.50	19,593,350	
アズワン	3,300	2,417.00	7,976,100	
ハピネット	1,400	3,110.00	4,354,000	
伊藤忠商事	302,700	1,884.00	570,286,800	
丸紅	77,000	4,879.00	375,683,000	
長瀬産業	16,800	1,149.50	19,311,600	
三愛オブリ	2,600	2,174.00	5,652,400	
サンゲツ	2,600	2,990.00	7,774,000	
ミツウロコグループホールディングス	1,400	2,139.00	2,994,600	
伊藤忠エネクス	2,400	2,039.00	4,893,600	
サンリオ	52,300	1,142.50	59,752,750	
アスクル	1,700	1,266.00	2,152,200	
日本マクドナルドホールディングス	4,700	7,680.00	36,096,000	
エディオン	4,000	2,291.00	9,164,000	
ジンズホールディングス	700	7,740.00	5,418,000	
ビックカメラ	4,900	1,640.50	8,038,450	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	13,000	1,972.00	25,636,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	12,500	3,168.00	39,600,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	17,400	2,423.50	42,168,900	
ＺＯＺＯ	21,900	1,161.50	25,436,850	
三越伊勢丹ホールディングス	17,000	3,841.00	65,297,000	
ジョイフル本田	2,800	2,242.00	6,277,600	
セブン＆アイ・ホールディングス	103,100	2,021.50	208,416,650	
スギホールディングス	5,700	2,922.00	16,655,400	
日本瓦斯	5,400	2,820.50	15,230,700	
ＡＯＫＩホールディングス	1,900	1,670.00	3,173,000	

コメリ	1,400	3,460.00	4,844,000	
丸井グループ	8,800	2,931.50	25,797,200	
イオン	117,700	1,377.00	162,072,900	
イズミ	5,600	981.00	5,493,600	
ケーズホールディングス	6,400	1,803.50	11,542,400	
ヤマダホールディングス	29,000	650.40	18,861,600	
ファーストリテイリング	10,400	82,110.00	853,944,000	
サンドラッグ	3,700	3,799.00	14,056,300	
横浜フィナンシャルグループ	53,100	1,870.00	99,297,000	
三井住友トラストグループ	34,300	6,558.00	224,939,400	
三井住友フィナンシャルグループ	198,400	6,814.00	1,351,897,600	
みずほフィナンシャルグループ	129,100	8,307.00	1,072,433,700	
大和証券グループ本社	68,500	1,768.50	121,142,250	
野村ホールディングス	160,100	1,543.00	247,034,300	
ＳＯＭＰＯホールディングス	44,600	6,513.00	290,479,800	
第一ライフグループ	187,800	1,861.00	349,495,800	
東京海上ホールディングス	97,600	7,609.00	742,638,400	
東京センチュリー	7,400	2,530.00	18,722,000	
オリックス	59,800	6,469.00	386,846,200	
日本取引所グループ	52,100	2,176.50	113,395,650	
大東建託	15,500	3,161.00	48,995,500	
ヒューリック	25,100	1,755.00	44,050,500	
オープンハウスグループ	3,800	8,550.00	32,490,000	
東急不動産ホールディングス	30,400	1,299.00	39,489,600	
パーク２４	7,000	1,981.50	13,870,500	
三井不動産	135,400	1,511.00	204,589,400	
三菱地所	56,500	4,179.00	236,113,500	
平和不動産	1,900	2,356.00	4,476,400	
東京建物	9,600	3,348.00	32,140,800	
住友不動産	31,900	3,762.00	120,007,800	
トーセイ	3,200	1,747.00	5,590,400	
パーソルホールディングス	93,300	255.30	23,819,490	
ディップ	1,700	1,869.00	3,177,300	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	2,900	3,381.00	9,804,900	
オリエンタルランド	59,000	2,615.00	154,285,000	
ダスキン	2,100	4,469.00	9,384,900	
ラウンドワン	9,500	1,235.00	11,732,500	
リゾートトラスト	8,900	1,733.00	15,423,700	
ユー・エス・エス	20,700	1,982.50	41,037,750	
楽天グループ	77,100	803.20	61,926,720	
リクルートホールディングス	72,300	12,240.00	884,952,000	
ベルシステム２４ホールディングス	1,800	1,358.00	2,444,400	

乃村工藝社	3,900	1,183.00	4,613,700	
セコム	21,600	6,622.00	143,035,200	
合　計	9,635,000		31,621,493,540	

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	イオンリート投資法人	87	10,848,900	
	オリックス不動産投資法人	286	27,942,200	
	日本プライムリアルティ投資法人	188	17,709,600	
	東急リアル・エステート投資法人	39	7,363,200	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	157	25,339,800	
合計		757	89,203,700	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,436,904,003
株式	162,354,526,120
未収配当金	95,583,050
未収利息	37,988
流動資産合計	163,887,051,161
資産合計	163,887,051,161
負債の部	
流動負債	
未払解約金	195,074,722
流動負債合計	195,074,722
負債合計	195,074,722
純資産の部	
元本等	
元本	15,248,124,580
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	148,443,851,859
元本等合計	163,691,976,439
純資産合計	163,691,976,439
負債純資産合計	163,887,051,161

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	2026年 7月10日現在
2．収益及び費用の計上基準	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。 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 7月10日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		15,248,124,580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	10.7352円
	(1万口当たり純資産額)	(107,352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

	2026年 7月10日現在
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2026年 7月10日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	7,638,753,165円
期中追加設定元本額	8,401,134,983円
期中一部解約元本額	791,763,568円
期末元本額	15,248,124,580円

区分	2026年 7月10日現在
期末元本額の内訳	
ＤＣ日本株式エクセレント・フォーカス	5,216,057,523円
コア投資戦略ファンド（安定型）	26,442,089円
コア投資戦略ファンド（成長型）	68,766,705円
コア投資戦略ファンド（切替型）	26,818,280円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	2,084,938,051円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	15,215,638円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	26,642,526円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	7,817,716円
日本株式エクセレント・フォーカスファンド	344,176,853円
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	616,079,190円
ＦＯＦｓ用　日本株式エクセレント・フォーカスＳ（適格機関投資家専用）	10,957,872円
ＦＯＦｓ用日本株式エクセレント・フォーカス（適格機関投資家専用）	6,768,486,392円
ＳＭＴ　ＥＴＦ日本株厳選投資アクティブ	35,725,745円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	27,090,245,268
合計	27,090,245,268

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
大和ハウス工業	187,300	4,506.00	843,973,800	
キッコーマン	1,215,500	1,619.00	1,967,894,500	
信越化学工業	595,800	7,320.00	4,361,256,000	
ユニ・チャーム	1,501,400	943.00	1,415,820,200	
エーザイ	199,300	4,296.00	856,192,800	
第一三共	738,100	2,730.50	2,015,382,050	
ＭＡＲＵＷＡ	101,500	61,550.00	6,247,325,000	
ＪＸ金属	758,300	3,962.00	3,004,384,600	
住友金属鉱山	153,100	7,275.00	1,113,802,500	
住友電気工業	2,274,100	2,582.00	5,871,726,200	
ディスコ	50,700	72,560.00	3,678,792,000	
ＳＭＣ	23,500	75,570.00	1,775,895,000	
荏原製作所	646,900	6,127.00	3,963,556,300	
ダイフク	677,900	6,867.00	4,655,139,300	
三菱重工業	1,083,000	3,818.00	4,134,894,000	
キオクシアホールディングス	25,600	77,000.00	1,971,200,000	

イビデン	92,400	20,300.00	1,875,720,000	
日立製作所	1,216,300	4,700.00	5,716,610,000	
富士電機	247,500	13,030.00	3,224,925,000	
日本電気	403,900	4,333.00	1,750,098,700	
富士通	701,400	3,347.00	2,347,585,800	
ソニーグループ	1,377,200	3,359.00	4,626,014,800	
アドバンテスト	130,800	29,830.00	3,901,764,000	
キーエンス	54,500	76,970.00	4,194,865,000	
村田製作所	597,400	9,860.00	5,890,364,000	
東京エレクトロン	130,400	72,940.00	9,511,376,000	
デンソー	437,300	1,933.50	845,519,550	
川崎重工業	1,232,800	2,779.50	3,426,567,600	
トヨタ自動車	1,010,000	2,823.00	2,851,230,000	
ＨＯＹＡ	73,900	24,975.00	1,845,652,500	
ピジョン	589,200	2,060.50	1,214,046,600	
東海旅客鉄道	328,000	3,621.00	1,187,688,000	
西武ホールディングス	291,700	3,525.00	1,028,242,500	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	28,900	9,753.00	281,861,700	
野村総合研究所	491,400	4,979.00	2,446,680,600	
ＮＴＴ	14,766,100	147.60	2,179,476,360	
三菱商事	971,600	4,409.00	4,283,784,400	
マツキヨココカラ＆カンパニー	963,800	2,423.50	2,335,769,300	
三越伊勢丹ホールディングス	2,072,800	3,841.00	7,961,624,800	
良品計画	545,000	3,623.00	1,974,535,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	2,081,900	850.40	1,770,447,760	
ファーストリテイリング	27,200	82,110.00	2,233,392,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	3,048,100	3,461.00	10,549,474,100	
三井住友フィナンシャルグループ	1,333,900	6,814.00	9,089,194,600	
みずほフィナンシャルグループ	583,400	8,307.00	4,846,303,800	
第一ライフグループ	1,113,100	1,861.00	2,071,479,100	
東京海上ホールディングス	163,000	7,609.00	1,240,267,000	
三井不動産	770,300	1,511.00	1,163,923,300	
リクルートホールディングス	376,700	12,240.00	4,610,808,000	
合　計	48,483,900		162,354,526,120	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	14,864,652,972
コール・ローン	1,782,024,135
株式	1,133,133,684,385
投資信託受益証券	202,227,131
投資証券	16,841,743,722
派生商品評価勘定	302,327,842
未収入金	30,265,055
未収配当金	592,284,567
未収利息	47,112
差入委託証拠金	12,121,005,528
流動資産合計	1,179,870,262,449
資産合計	1,179,870,262,449
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,229,087
前受金	279,707,831
未払解約金	902,263,027
流動負債合計	1,205,199,945
負債合計	1,205,199,945
純資産の部	
元本等	
元本	118,642,989,027
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,060,022,073,477
元本等合計	1,178,665,062,504
純資産合計	1,178,665,062,504
負債純資産合計	1,179,870,262,449

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (4)投資証券

	2026年 7月10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	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2026年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		118,642,989,027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	9.9346円
	(1万口当たり純資産額)	(99,346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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2026年 7月10日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	117,291,679,009円
期中追加設定元本額	12,872,183,066円
期中一部解約元本額	11,520,873,048円
期末元本額	118,642,989,027円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,040,659,479円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	3,910,286円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	32,284,357,521円
世界経済インデックスファンド	16,489,674,709円
外国株式インデックス・オープン	778,221,672円
ＤＣマイセレクション２５	369,989,340円
ＤＣマイセレクション５０	2,355,761,781円
ＤＣマイセレクション７５	3,556,442,137円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	14,399,539,976円
ＤＣマイセレクションＳ２５	324,843,434円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,854,437,203円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,523,278,116円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	78,424,786円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	76,582,715円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	8,524,491,482円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	479,285,113円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,113,018円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,781,717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）	7,303,158円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,612,626円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,308,158円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,926,584円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	11,477,915円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	38,883,760円

区分	2026年 7月10日現在
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	66,722,966円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	552,121,348円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	35,075,229円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	5,657,945円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	52,955,989円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	17,362,433円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	611,383,225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）	445,078,381円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,257,450,129円
コア投資戦略ファンド（安定型）	35,761,344円
コア投資戦略ファンド（成長型）	96,742,634円
分散投資コア戦略ファンドＡ	998,324,283円
分散投資コア戦略ファンドＳ	4,986,497,646円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,797,356,664円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	820,257,482円
コア投資戦略ファンド（切替型）	38,140,465円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	374,703,451円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	17,435,233円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	78,065,026円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	20,166,770円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	2,746,432,546円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	315,794,836円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,672,717,041円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	227,690,799円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,998,283円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	6,019,246,855円
グローバル経済コア	2,071,536,452円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	15,904,577円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	6,358,052円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	40,590,185円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	12,814,316円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	204,632,613円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	267,575,550円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	141,065,688円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	193,340,058円
１０資産分散投資ファンド	45,713,590円
グローバル１０資産バランスファンド	31,160,683円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	83,874,174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	101,388,645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	38,717,050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	31,940,000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	28,485,451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	13,700,292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	4,485,905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	3,179,493円
ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型）	257,734,513円
ＤＣ全世界株式インデックスファンド（オール・カントリー）	3,221,607,919円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０６５	69,890円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０７０	40,647円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０７５	25,187円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０７０	251,253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）	65,909,381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）	427,555,391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）	84,801,459円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,685,672,240円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	85,878,932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）	34,526,129円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	69,537,783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）	100,728,986円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ１（適格機関投資家専用）	12,813円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ２（適格機関投資家専用）	10,971円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ３（適格機関投資家専用）	12,878円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ４（適格機関投資家専用）	15,616円

区分	2026年 7月10日現在
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ５（適格機関投資家専用）	11,466円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ６（適格機関投資家専用）	8,601円
外国株式インデックスファンドＴ（一般投資家私募／適格機関投資家転売制限付）	758,668,509円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	5,745,864,215
投資信託受益証券	△1,748,102
投資証券	△88,780,720
合計	5,655,335,393

(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

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	28,485,612,820	－	28,765,320,651	279,707,831
合計		28,485,612,820	－	28,765,320,651	279,707,831

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,266,637,887	－	1,266,028,811	△609,076
	アメリカドル	820,741,400	－	820,191,710	△549,690
	カナダドル	74,960,165	－	74,965,994	5,829
	ユーロ	178,096,388	－	178,026,046	△70,342
	イギリスポンド	93,138,992	－	93,115,709	△23,283
	スイスフラン	46,075,258	－	46,071,708	△3,550
	スウェーデンクローナ	53,625,684	－	53,657,644	31,960
合計		1,266,637,887	－	1,266,028,811	△609,076

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数（株）	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	83,242	57.20	4,761,442.40	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	261.29	4,729,087.71	
	CHEVRON CORP	154,582	174.05	26,904,997.10	
	CONOCOPHILLIPS	103,013	108.02	11,127,464.26	
	DEVON ENERGY CORPORATION	88,438	42.02	3,716,164.76	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	15,274	182.00	2,779,868.00	
	EOG RESOURCES INC	43,341	133.54	5,787,757.14	
	EQT CORPORATION	52,808	50.15	2,648,321.20	
	EXPAND ENERGY CORP	21,232	88.97	1,889,011.04	
	EXXONMOBIL HOLDINGS CORP	348,875	137.46	47,956,357.50	
	HALLIBURTON CO	70,302	34.12	2,398,704.24	
	KINDER MORGAN INC	160,038	32.40	5,185,231.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	25,448	283.30	7,209,418.40	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	63,797	52.30	3,336,583.10	
	ONEOK INC	52,881	89.50	4,732,849.50	
	PHILLIPS 66	33,656	189.82	6,388,581.92	
	SLB LTD	125,996	47.24	5,952,051.04	
	TARGA RESOURCES CORP	17,764	273.02	4,849,927.28	
	TECHNIPFMC PLC	33,570	70.53	2,367,692.10	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	4,797	390.77	1,874,523.69	
	VALERO ENERGY CORP	25,092	281.25	7,057,125.00	
	WILLIAMS COS	102,639	75.45	7,744,112.55	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	295.85	5,171,162.15	
	AMCOR PLC	36,258	42.70	1,548,216.60	
	AMRIZE LTD	42,259	50.28	2,124,782.52	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	159.07	1,055,906.66	
	BALL CORP	20,614	61.00	1,257,454.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,885	114.02	1,469,147.70	
	COEUR MINING INC	84,500	16.02	1,353,690.00	
	CORTEVA INC	58,239	83.86	4,883,922.54	
	CRH PLC	56,375	104.36	5,883,295.00	
	DOW INC	56,967	28.50	1,623,559.50	
	DUPONT DE NEMOURS INC	11,373	134.79	1,532,966.67	

ECOLAB INC	21,334	273.03	5,824,822.02	
FREEPORT-MCMORAN INC	120,630	60.53	7,301,733.90	
INT'L PAPER CO	39,891	37.18	1,483,147.38	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	78.53	1,516,178.71	
LINDE PLC	38,894	525.56	20,441,130.64	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	55.39	1,093,675.55	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	571.90	2,869,222.30	
NEWMONT CORPORATION	91,487	94.81	8,673,882.47	
NUCOR CORP	18,727	222.28	4,162,637.56	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,847	224.49	1,761,573.03	
PPG INDUSTRIES INC	18,784	115.96	2,178,192.64	
RELIANCE INC	4,126	376.50	1,553,439.00	
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	103.36	1,080,732.16	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,348	332.03	6,424,116.44	
SMURFIT WESTROCK PLC	40,860	42.99	1,756,571.40	
STEEL DYNAMICS INC	11,618	222.06	2,579,893.08	
VULCAN MATERIALS CO	11,702	288.73	3,378,718.46	
3 M COMPANY	43,663	155.34	6,782,610.42	
AERCAP HOLDINGS NV	14,679	151.03	2,216,969.37	
ALLEGION PLC	7,721	135.07	1,042,875.47	
AMETEK INC	19,226	232.99	4,479,465.74	
AXON ENTERPRISE INC	6,065	582.00	3,529,830.00	
BLOOM ENERGY CORP- A	22,661	257.02	5,824,330.22	
BOEING CO	62,661	223.11	13,980,295.71	
CARLISLE COS INC	3,456	330.00	1,140,480.00	
CARRIER GLOBAL CORP	61,321	67.81	4,158,177.01	
CATERPILLAR	39,053	938.39	36,646,944.67	
CNH INDUSTRIAL NV	57,961	10.28	595,839.08	
COMFORT SYSTEMS USA INC	2,953	1,781.42	5,260,533.26	
CUMMINS INC	11,413	673.39	7,685,400.07	
CURTISS-WRIGHT CORP	3,010	759.71	2,286,727.10	
DEERE&CO	20,992	592.90	12,446,156.80	
DOVER CORP	10,657	211.57	2,254,701.49	
EATON CORP	32,565	405.83	13,215,853.95	
EMCOR GROUP INC	3,640	783.41	2,851,612.40	
EMERSON ELECTRIC CO	47,171	137.80	6,500,163.80	
FASTENAL CO	100,872	46.35	4,675,417.20	
FERGUSON ENTERPRISES INC	16,260	224.62	3,652,321.20	
FORTIVE CORP	26,005	61.15	1,590,205.75	
FTAI AVIATION LTD	8,373	228.02	1,909,211.46	
GE AEROSPACE	87,696	359.04	31,486,371.84	
GE VERNOVA INC	22,623	1,075.26	24,325,606.98	

GENERAL DYNAMICS CORP	19,323	374.60	7,238,395.80	
GRACO INC	13,378	73.19	979,135.82	
GRAINGER (WW) INC	3,706	1,364.86	5,058,171.16	
HEICO CORP	3,640	352.13	1,281,753.20	
HEICO CORP-CLASS A	5,700	253.27	1,443,639.00	
HONEYWELL AEROSPACE INC	26,677	223.12	5,952,172.24	
HONEYWELL INTL INC	26,677	223.42	5,960,175.34	
HOWMET AEROSPACE INC	33,652	273.77	9,212,908.04	
HUBBELL INC	4,458	485.41	2,163,957.78	
IDEX CORP	5,916	219.74	1,299,981.84	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,905	265.48	6,080,819.40	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	77.05	2,431,852.10	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	61.36	779,272.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	51,373	140.53	7,219,447.69	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,677	289.87	4,544,291.99	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	537.50	1,357,725.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	17,409	518.26	9,022,388.34	
MASCO CORP	18,934	76.64	1,451,101.76	
MASTEC INC	5,128	384.72	1,972,844.16	
NORDSON CORP	4,121	286.37	1,180,130.77	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,325	532.23	6,027,504.75	
OTIS WORLDWIDE CORP	30,534	72.00	2,198,448.00	
PACCAR INC	43,301	123.28	5,338,147.28	
PARKER HANNIFIN CORP	10,443	949.17	9,912,182.31	
PENTAIR PLC	14,383	74.57	1,072,540.31	
QUANTA SERVICES INC	12,490	668.17	8,345,443.30	
ROCKET LAB CORP	43,666	82.55	3,604,628.30	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,907	467.48	4,631,324.36	
RTX CORP	112,973	195.20	22,052,329.60	
SNAP-ON INC	4,000	400.03	1,600,120.00	
TEXTRON	13,876	90.43	1,254,806.68	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,577	472.00	8,768,344.00	
TRANSDIGM GROUP INC	4,740	1,295.71	6,141,665.40	
UNITED RENTALS INC	5,364	1,088.67	5,839,625.88	
VERTIV HOLDINGS CO-A	30,507	323.92	9,881,827.44	
WABTEC CORP	14,283	259.77	3,710,294.91	
WATSCO INC	2,656	377.73	1,003,250.88	
XYLEM INC	19,668	118.89	2,338,328.52	
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,190	241.28	8,008,083.20	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,640	147.32	1,420,164.80	
CINTAS CORP	30,225	177.69	5,370,680.25	
COPART INC	76,214	28.33	2,159,142.62	

EQUIFAX INC	10,261	166.66	1,710,098.26	
JACOBS SOLUTIONS INC	11,026	125.84	1,387,511.84	
LEIDOS HOLDINGS	10,976	106.62	1,170,261.12	
PAYCHEX INC	26,671	106.26	2,834,060.46	
REPUBLIC SERVICES INC	18,062	218.69	3,949,978.78	
ROLLINS INC	25,466	44.77	1,140,112.82	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,331	66.73	1,289,957.63	
TRANSUNION	15,741	76.33	1,201,510.53	
VERALTO CORP	20,685	92.10	1,905,088.50	
VERISK ANALYTICS INC	10,892	187.01	2,036,912.92	
WASTE CONNECTIONS INC	21,460	170.14	3,651,204.40	
WASTE MANAGEMENT INC	33,818	231.67	7,834,616.06	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,892	192.76	1,906,781.92	
CSX CORP	156,116	49.35	7,704,324.60	
DELTA AIR LINES INC	15,193	89.00	1,352,177.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	170.62	2,095,213.60	
FEDEX CORP	18,843	310.84	5,857,158.12	
FEDEX FREIGHT HOLDING CO	9,421	154.25	1,453,189.25	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	190,364	3.88	738,612.32	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,352	282.61	1,795,138.72	
NORFOLK SOUTHERN CORP	18,844	323.77	6,101,121.88	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15,745	225.85	3,556,008.25	
UBER TECHNOLOGIES INC	149,588	74.35	11,121,867.80	
UNION PACIFIC CORP	49,830	285.04	14,203,543.20	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,611	129.05	853,149.55	
UNITED PARCEL SERVICE B	62,506	110.74	6,921,914.44	
XPO INC	9,607	208.03	1,998,544.21	
APTIV PLC	17,890	59.86	1,070,895.40	
FORD MOTOR COMPANY	320,913	13.61	4,367,625.93	
GENERAL MOTORS CO	78,250	76.65	5,997,862.50	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	75,764	18.12	1,372,843.68	
TESLA INC	236,217	406.55	96,034,021.35	
DECKERS OUTDOOR CORP	12,618	104.26	1,315,552.68	
DR HORTON INC	22,687	149.55	3,392,840.85	
GARMIN LTD	13,708	244.51	3,351,743.08	
LENNAR CORP-CL A	18,864	84.35	1,591,178.40	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,710	116.51	1,014,802.10	
NIKE B	100,678	42.78	4,307,004.84	
NVR INC	247	6,471.44	1,598,445.68	
PULTE GROUP INC	16,747	123.72	2,071,938.84	
SHARKNINJA INC	7,146	148.81	1,063,396.26	
TAPESTRY INC	16,749	139.93	2,343,687.57	

AIRBNB INC-CLASS A	34,827	146.89	5,115,738.03	
BOOKING HOLDINGS INC	66,050	175.52	11,593,096.00	
CARNIVAL CORP LTD	105,658	26.72	2,823,181.76	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	110,522	34.60	3,824,061.20	
COMPASS GROUP PLC	142,673	31.77	4,532,721.21	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	201.92	1,859,077.44	
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	300.88	856,906.24	
DOORDASH INC - A	30,886	192.35	5,940,922.10	
EXPEDIA GROUP INC	9,628	267.78	2,578,185.84	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	14,432	110.79	1,598,921.28	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	337.65	6,629,757.75	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	189.95	719,340.65	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,975	163.35	1,956,116.25	
LAS VEGAS SANDS CORP	25,065	46.45	1,164,269.25	
MARRIOTT INTL A	18,223	372.47	6,787,520.81	
MCDONALD'S CORP	59,626	276.49	16,485,992.74	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,538	288.08	5,916,587.04	
STARBUCKS CORP	95,626	106.41	10,175,562.66	
YUM BRANDS INC	22,162	162.39	3,598,887.18	
ALPHABET INC-CL A	488,662	358.89	175,375,905.18	
ALPHABET INC-CL C	387,967	356.24	138,209,364.08	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	134.35	966,245.20	
ECHOSTAR CORP-A	13,116	97.96	1,284,843.36	
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	206.56	4,076,048.48	
FOX CORP - CLASS A	20,639	53.74	1,109,139.86	
FOX CORP- CLASS B	10,345	48.44	501,111.80	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	17,869	95.91	1,713,815.79	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	14,157	182.58	2,584,785.06	
META PLATFORMS INC-CLASS A	184,322	631.48	116,395,656.56	
NETFLIX INC	353,428	75.47	26,673,211.16	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	27.49	920,337.71	
OMNICOM GROUP	25,739	80.83	2,080,483.37	
REDDIT INC-CL A	8,378	200.31	1,678,197.18	
ROBLOX CORP -CLASS A	47,263	56.43	2,667,051.09	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	12,442	485.88	6,045,318.96	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14,644	246.10	3,603,888.40	
THE WALT DISNEY CO	148,690	96.17	14,299,517.30	
WARNER BROS DISCOVERY INC	195,287	26.63	5,200,492.81	
AMAZON.COM	812,380	247.04	200,690,355.20	
AUTOZONE INC	1,383	3,010.39	4,163,369.37	
BEST BUY COMPANY INC	15,285	79.99	1,222,647.15	
BURLINGTON STORES INC	5,108	321.44	1,641,915.52	

CARVANA CO	52,500	67.12	3,523,800.00	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	217.32	1,075,734.00	
EBAY	36,732	117.33	4,309,765.56	
GENUINE PARTS CO	12,631	124.27	1,569,654.37	
HOME DEPOT	83,599	338.73	28,317,489.27	
LOWES COMPANIES	47,008	213.00	10,012,704.00	
MERCADOLIBRE INC	3,728	1,807.83	6,739,590.24	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	68,700	85.12	5,847,744.00	
ROSS STORES INC	26,819	220.60	5,916,271.40	
SEA LTD-ADR	30,978	109.11	3,380,009.58	
TJX COMPANIES INC	92,899	150.90	14,018,459.10	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	39,591	30.12	1,192,480.92	
ULTA BEAUTY INC	3,920	460.24	1,804,140.80	
WILLIAMS-SONOMA INC	10,460	219.77	2,298,794.20	
CASEY'S GENERAL STORES INC	3,026	822.00	2,487,372.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,237	912.97	33,996,263.89	
DOLLAR GENERAL CORP	18,484	115.73	2,139,153.32	
DOLLAR TREE INC	16,318	120.92	1,973,172.56	
KROGER CO	50,844	59.86	3,043,521.84	
SYSCO CORP	40,090	82.03	3,288,582.70	
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,356	132.27	4,941,078.12	
WALMART INC	368,034	112.21	41,297,095.14	
ALTRIA GROUP INC	140,280	71.59	10,042,645.20	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	78.98	3,208,009.64	
BUNGE GLOBAL SA	11,604	113.62	1,318,446.48	
COCA-COLA CO	325,137	82.63	26,866,070.31	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	18,127	105.09	1,904,966.43	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	132.44	1,738,407.44	
GENERAL MILLS INC	43,531	35.85	1,560,586.35	
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,890	171.65	2,212,568.50	
KEURIG DR PEPPER INC	104,376	30.72	3,206,430.72	
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	24.68	1,702,031.52	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,231	51.54	1,094,245.74	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,013	58.30	6,122,257.90	
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	96.55	5,633,499.40	
PEPSICO INC	114,718	137.86	15,815,023.48	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	130,813	181.17	23,699,391.21	
TYSON FOODS INC	23,306	57.71	1,344,989.26	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	95.67	1,850,831.82	
CLOROX COMPANY	9,570	93.07	890,679.90	
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	91.01	5,636,977.38	
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	81.99	1,541,412.00	

KENVUE INC	164,183	19.18	3,149,029.94	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	109.93	2,954,588.61	
PROCTER & GAMBLE CO	195,062	146.85	28,644,854.70	
ABBOTT LABORATORIES	146,184	94.40	13,799,769.60	
BECTON DICKINSON & CO	23,549	150.85	3,552,366.65	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	124,740	44.99	5,612,052.60	
CARDINAL HEALTH	19,867	233.77	4,644,308.59	
CENCORA INC	15,511	302.46	4,691,457.06	
CENTENE CORP	40,934	67.60	2,767,138.40	
COOPER COS INC/THE	16,443	71.02	1,167,781.86	
CVS HEALTH CORP	106,781	102.81	10,978,154.61	
DEXCOM INC	33,277	73.02	2,429,886.54	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,293	91.33	4,501,929.69	
ELEVANCE HEALTH INC	18,351	420.39	7,714,576.89	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	36,836	64.70	2,383,289.20	
HCA HEALTHCARE INC	13,503	409.01	5,522,862.03	
HUMANA INC	9,955	397.76	3,959,700.80	
IDEXX LABORATORIES INC	6,644	558.60	3,711,338.40	
INSULET CORP	5,246	158.29	830,389.34	
INTUITIVE SURGICAL INC	29,811	411.55	12,268,717.05	
LABCORP HOLDINGS INC	6,548	277.63	1,817,921.24	
MCKESSON CORP	10,179	792.81	8,070,012.99	
MEDLINE INC-CL A	31,008	40.85	1,266,676.80	
MEDTRONIC PLC	107,761	82.39	8,878,428.79	
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	208.05	1,805,665.95	
RESMED INC	12,254	208.45	2,554,346.30	
STERIS PLC	8,172	216.00	1,765,152.00	
STRYKER CORP	28,683	327.11	9,382,496.13	
THE CIGNA GROUP	21,912	291.80	6,393,921.60	
TPG INC-CVR-RTS	18,875	—	—	
UNITEDHEALTH GROUP INC	76,185	431.68	32,887,540.80	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	189.70	2,369,542.70	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	89.23	1,361,114.42	
ABBVIE INC	148,459	249.91	37,101,388.69	
AGILENT TECHNOLOGIES	23,720	133.59	3,168,754.80	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,039	312.79	3,452,888.81	
AMGEN	45,246	363.62	16,452,350.52	
BIOGEN INC	12,520	198.91	2,490,353.20	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	171,370	57.94	9,929,177.80	
DANAHER CORP	53,460	195.98	10,477,090.80	
ELI LILLY & CO	67,407	1,216.95	82,030,948.65	
GILEAD SCIENCES INC	104,180	134.84	14,047,631.20	

ILLUMINA INC	13,628	193.76	2,640,561.28	
INCYTE CORP	14,198	118.52	1,682,746.96	
INSMED INC	16,990	118.26	2,009,237.40	
IQVIA HOLDINGS INC	14,379	208.97	3,004,779.63	
JOHNSON & JOHNSON	202,164	259.10	52,380,692.40	
MERCK & CO	207,517	125.07	25,954,151.19	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,288.02	2,095,608.54	
NATERA INC	11,301	281.85	3,185,186.85	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,925	180.55	1,611,408.75	
PFIZER	477,445	24.25	11,578,041.25	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,604	667.95	5,747,041.80	
REVOLUTION MEDICINES INC	13,578	191.13	2,595,163.14	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	34,501	57.96	1,999,677.96	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	97,733	33.10	3,234,962.30	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,192	524.71	16,366,754.32	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	552.48	1,998,872.64	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,349	496.50	10,599,778.50	
WATERS CORP	7,936	377.13	2,992,903.68	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	357.66	2,062,625.22	
ZOETIS INC	35,994	75.08	2,702,429.52	
BANK OF AMERICA CORP	569,778	59.25	33,759,346.50	
CITIGROUP	143,157	139.57	19,980,422.49	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	35,671	69.86	2,491,976.06	
FIFTH THIRD BANCORP	76,007	56.54	4,297,435.78	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	2,083.00	1,595,578.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	162,712	17.76	2,889,765.12	
JPMORGAN CHASE & CO	225,129	335.47	75,524,025.63	
KEY CORP	71,223	23.10	1,645,251.30	
M & T BANK CORP	13,791	237.94	3,281,430.54	
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	12,100	100.37	1,214,477.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33,741	250.91	8,465,954.31	
REGIONS FINL CORP	70,810	30.58	2,165,369.80	
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	51.37	5,462,788.54	
US BANCORP	130,286	61.90	8,064,703.40	
WELLS FARGO & CO	259,495	86.91	22,552,710.45	
AFFIRM HOLDINGS INC	21,591	83.78	1,808,893.98	
AMERICAN EXPRESS	45,083	346.72	15,631,177.76	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	500.16	3,909,250.56	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	35,188	119.84	4,216,929.92	
ARES MANAGEMENT CORP - A	17,123	121.66	2,083,184.18	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	56,752	152.26	8,641,059.52	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	116,728	495.45	57,832,887.60	

BLACKROCK INC	12,388	1,019.68	12,631,795.84	
BLACKSTONE INC	61,541	122.15	7,517,233.15	
BLOCK INC	42,921	77.42	3,322,943.82	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	51,334	200.10	10,271,933.40	
CARLYLE GROUP INC/THE	21,978	44.18	970,988.04	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	267.85	2,357,883.55	
CME GROUP INC	30,452	239.71	7,299,648.92	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	17,785	158.44	2,817,855.40	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	30.30	583,244.70	
CORPAY INC	4,988	351.16	1,751,586.08	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	41,835	41.61	1,740,754.35	
FISERV INC	44,901	51.65	2,319,136.65	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	97.02	418,738.32	
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	74.38	1,543,310.62	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,760	1,055.97	26,145,817.20	
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	35,016	95.28	3,336,324.48	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,543	135.11	6,423,534.73	
KKR & CO INC	52,382	96.27	5,042,815.14	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,365	311.47	1,982,506.55	
MASTERCARD INC-CLASS A	69,075	523.20	36,140,040.00	
MOODY'S CORP	13,270	487.02	6,462,755.40	
MORGAN STANLEY	99,461	222.13	22,093,271.93	
MSCI INC	5,981	603.35	3,608,636.35	
NASDAQ INC	38,169	87.52	3,340,550.88	
NORTHERN TRUST CORP	15,902	182.86	2,907,839.72	
PAYPAL HOLDINGS INC	75,007	45.32	3,399,317.24	
PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	117.05	2,139,088.75	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	168.72	2,612,797.92	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	62,997	115.11	7,251,584.67	
ROCKET COS INC-CLASS A	73,400	14.56	1,068,704.00	
S&P GLOBAL INC	25,389	432.96	10,992,421.44	
SCHWAB (CHARLES) CORP	137,842	101.91	14,047,478.22	
SOFI TECHNOLOGIES INC	107,038	18.62	1,993,047.56	
STATE STREET CORP	22,335	180.16	4,023,873.60	
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	71.57	2,089,557.72	
TOAST INC-CLASS A	40,481	28.85	1,167,876.85	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	97.12	880,004.32	
VISA INC-CLASS A SHARES	141,100	348.20	49,131,020.00	
AFLAC	38,341	121.99	4,677,218.59	
ALLSTATE CORP	21,674	248.64	5,389,023.36	
AMERICAN INT'L GROUP	46,081	79.11	3,645,467.91	
AON PLC	17,084	355.56	6,074,387.04	

ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	101.70	3,024,252.90	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,082	253.76	5,349,768.32	
BROWN & BROWN INC	23,755	67.84	1,611,539.20	
CHUBB LTD	29,347	347.80	10,206,886.60	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,067	175.43	2,292,343.81	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	247.81	536,756.46	
EVEREST GROUP LTD	3,288	371.00	1,219,848.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	20,461	49.16	1,005,862.76	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	22,068	138.52	3,056,859.36	
LOEWS CORP	16,402	115.15	1,888,690.30	
MARKEL GROUP INC	1,007	1,949.44	1,963,086.08	
MARSH & MCLENNAN COS	40,107	179.00	7,179,153.00	
METLIFE INC	45,055	91.15	4,106,763.25	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	111.67	2,069,915.12	
PROGRESSIVE CORP	49,098	229.52	11,268,972.96	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,466	115.00	3,388,590.00	
TRAVELERS COS INC/THE	18,877	337.48	6,370,609.96	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	289.13	2,236,998.81	
WR BERKLEY CORP	22,485	71.82	1,614,872.70	
WEYERHAEUSER CO	63,311	22.50	1,424,497.50	
ACCENTURE PLC-CL A	50,746	139.06	7,056,738.76	
ADOBE INC	35,108	222.65	7,816,796.20	
APPLOVIN CORP-CLASS A	19,268	520.43	10,027,645.24	
ATLASSIAN CORP-CL A	13,277	90.71	1,204,356.67	
AUTODESK INC	17,030	208.58	3,552,117.40	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	23,173	385.95	8,943,619.35	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	138.16	975,133.28	
CIRCLE INTERNET GROUP INC	12,466	63.01	785,482.66	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	26,041	275.80	7,182,107.80	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	42,121	43.40	1,828,051.40	
COREWEAVE INC-CL A	22,830	89.70	2,047,851.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	85,172	198.40	16,898,124.80	
DATADOG INC - CLASS A	26,220	269.00	7,053,180.00	
FAIR ISAAC CORP	2,084	1,279.41	2,666,290.44	
FORTINET INC	53,845	163.73	8,816,041.85	
GEN DIGITAL INC	43,555	25.99	1,131,994.45	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,733	295.30	23,249,854.90	
INTUIT INC	22,648	273.38	6,191,510.24	
IREN LTD	26,801	41.72	1,118,137.72	
MICROSOFT CORP	592,097	384.36	227,578,402.92	
MONGODB INC	6,399	362.87	2,322,005.13	
NEBIUS GROUP NV	17,050	216.20	3,686,210.00	

OKTA INC	14,591	148.84	2,171,724.44	
ORACLE CORP	144,838	144.22	20,888,536.36	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	182,794	129.04	23,587,737.76	
PALO ALTO NETWORKS INC	67,345	338.31	22,783,486.95	
PTC INC	9,741	123.79	1,205,838.39	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	355.94	3,009,828.64	
SALESFORCE INC	66,946	162.50	10,878,725.00	
SAMSARA INC-CL A	29,377	36.99	1,086,655.23	
SERVICENOW INC	87,795	108.84	9,555,607.80	
SNOWFLAKE INC	27,565	267.49	7,373,361.85	
STRATEGY INC	21,911	93.89	2,057,223.79	
SYNOPSYS INC	16,020	443.37	7,102,787.40	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	52.71	933,915.78	
TWILIO INC - A	12,842	218.60	2,807,261.20	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	311.01	1,038,462.39	
VERISIGN INC	6,723	269.98	1,815,075.54	
WORKDAY INC-CLASS A	17,601	138.34	2,434,922.34	
ZOOM COMMUNICATIONS INC	20,869	89.88	1,875,705.72	
ZSCALER INC	8,789	147.12	1,293,037.68	
AMPHENOL CORPORATION	103,191	162.24	16,741,707.84	
APPLE INC	1,232,242	316.22	389,659,565.24	
ARISTA NETWORKS INC	89,646	184.69	16,556,719.74	
CDW CORP/DE	11,273	140.21	1,580,587.33	
CIENA CORP	11,868	462.34	5,487,051.12	
CISCO SYSTEMS	331,529	118.31	39,223,195.99	
COHERENT CORP	15,570	327.24	5,095,126.80	
CORNING	66,604	192.38	12,813,277.52	
DELL TECHNOLOGIES -C	25,710	450.22	11,575,156.20	
EVERPURE INC-A	26,350	80.96	2,133,296.00	
F5 INC	4,851	430.32	2,087,482.32	
FABRINET	3,007	482.78	1,451,719.46	
FLEX LTD	30,058	139.94	4,206,316.52	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,780	49.11	5,538,625.80	
HP INC	77,024	24.13	1,858,589.12	
IONQ INC	28,466	44.77	1,274,422.82	
JABIL INC	9,340	332.51	3,105,643.40	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,395	322.17	4,637,637.15	
LUMENTUM HOLDINGS INC	5,787	785.77	4,547,250.99	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,950	417.21	5,820,079.50	
NETAPP INC	16,563	171.73	2,844,363.99	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	18,333	890.09	16,318,019.97	
SUPER MICRO COMPUTER INC	42,160	28.24	1,190,598.40	

TE CONNECTIVITY PLC	24,629	198.91	4,898,954.39	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,888	631.52	2,455,349.76	
WESTERN DIGITAL CORP	29,308	578.05	16,941,489.40	
AST SPACEMOBILE INC	18,362	73.88	1,356,584.56	
AT&T INC	583,361	21.04	12,273,915.44	
COMCAST CORP-CL A	300,899	23.34	7,024,487.15	
MILLICOM INTL CELLULAR S.A.	7,802	94.43	736,742.86	
SPACE EXPLORATION TECHN-CL A	43,980	152.16	6,691,996.80	
T-MOBILE US INC	41,204	181.48	7,477,701.92	
VERIZON COMMUNICATIONS	350,843	42.24	14,819,608.32	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	75.70	1,572,894.60	
AMEREN CORPORATION	23,221	111.77	2,595,411.17	
AMERICAN ELECTRIC POWER	45,027	133.85	6,026,863.95	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,869	130.55	2,332,797.95	
ATMOS ENERGY CORP	13,886	174.72	2,426,161.92	
CENTERPOINT ENERGY INC	57,629	43.32	2,496,488.28	
CMS ENERGY CORP	23,697	75.00	1,777,275.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	30,923	110.27	3,409,879.21	
CONSTELLATION ENERGY	25,537	250.74	6,403,147.38	
DOMINION ENERGY INC	71,304	69.45	4,952,062.80	
DTE ENERGY COMPANY	17,461	149.27	2,606,403.47	
DUKE ENERGY CORP	65,319	125.26	8,181,857.94	
EDISON INTL	30,900	74.64	2,306,376.00	
ENTERGY CORP	37,180	113.93	4,235,917.40	
EVERGY INC	18,475	85.28	1,575,548.00	
EVERSOURCE ENERGY	31,546	73.93	2,332,195.78	
EXELON CORP	85,855	46.38	3,981,954.90	
FIRSTENERGY CORP	47,081	47.63	2,242,468.03	
NEXTERA ENERGY INC	175,027	87.10	15,244,851.70	
NISOURCE INC	40,714	46.66	1,899,715.24	
NRG ENERGY INC	16,549	140.48	2,324,803.52	
PG&E CORP	189,959	17.18	3,263,495.62	
PPL CORPORATION	63,132	35.66	2,251,287.12	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	80.17	3,228,125.22	
SEMPRA	54,659	94.62	5,171,834.58	
SOUTHERN CO	94,619	95.17	9,004,890.23	
VISTRA CORP	28,416	157.98	4,489,159.68	
WEC ENERGY GROUP INC	26,668	114.89	3,063,886.52	
XCEL ENERGY INC	52,388	79.02	4,139,699.76	
ADVANCED MICRO DEVICES	136,840	546.72	74,813,164.80	
ANALOG DEVICES	40,977	393.64	16,130,186.28	
APPLIED MATERIALS	66,611	588.66	39,211,231.26	

	ASTERA LABS INC	11,429	417.45	4,771,036.05	
	BROADCOM INC	377,528	401.11	151,430,256.08	
	CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDI	13,933	265.65	3,701,301.45	
	ENTEGRIS INC	12,389	146.10	1,810,032.90	
	FIRST SOLAR INC	7,921	228.50	1,809,948.50	
	INTEL CORP	368,753	112.54	41,499,462.62	
	KLA CORP	110,020	229.52	25,251,790.40	
	LAM RESEARCH CORP	104,814	353.17	37,017,160.38	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,769	243.27	17,215,974.63	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,977	88.26	3,969,670.02	
	MICRON TECHNOLOGY	94,655	991.64	93,863,684.20	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,911	1,374.13	5,374,222.43	
	NVIDIA CORP	1,937,609	202.78	392,908,353.02	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,641	290.54	5,997,036.14	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	33,013	97.87	3,230,982.31	
	QNITY ELECTRONICS INC	17,059	143.46	2,447,284.14	
	QUALCOMM	89,557	191.11	17,115,238.27	
	TERADYNE INC	13,141	362.75	4,766,897.75	
	TEXAS INSTRUMENTS	76,419	308.53	23,577,554.07	
	CBRE GROUP INC-A	24,774	141.06	3,494,620.44	
	COSTAR GROUP INC	33,027	29.19	964,058.13	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	7.18	708,666.00	
アメリカドル 小計		30,736,344		5,395,162,175.02 (874,771,595,057)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	40,448	30.91	1,250,247.68	
	CAMECO CORP	37,878	135.79	5,143,453.62	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	175,078	59.40	10,399,633.20	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	36.85	4,101,147.05	
	ENBRIDGE	183,129	77.33	14,161,365.57	
	IMPERIAL OIL	12,177	170.32	2,073,986.64	
	KEYERA CORP	18,607	58.25	1,083,857.75	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,941	67.93	3,120,772.13	
	SUNCOR ENERGY	98,973	82.97	8,211,789.81	
	TC ENERGY CORP	87,393	96.32	8,417,693.76	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	61.30	1,533,051.70	
	WHITECAP RESOURCES INC	98,000	15.28	1,497,440.00	
	AGNICO EAGLE MINES	42,014	211.29	8,877,138.06	
	ALAMOS GOLD INC-CLASS A	34,053	42.30	1,440,441.90	
	BARRICK MINING CORP	144,290	52.22	7,534,823.80	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	12,156	89.58	1,088,934.48	
	EQUINOX GOLD CORP	62,919	13.81	868,911.39	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,267	39.11	2,552,592.37	

FRANCO-NEVADA CORP	15,641	295.01	4,614,251.41	
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	10.64	551,652.08	
KINROSS GOLD CORP	108,451	34.30	3,719,869.30	
LUNDIN GOLD INC	8,772	80.65	707,461.80	
LUNDIN MINING CORP	54,579	34.49	1,882,429.71	
NUTRIEN LTD	40,384	91.50	3,695,136.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	37,635	62.54	2,353,692.90	
TECK RESOURCES LTD-CL B	38,429	84.00	3,228,036.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,991	156.83	5,801,298.53	
ATKINSREALIS GROUP INC	13,652	87.83	1,199,055.16	
BOMBARDIER INC-B	7,086	339.48	2,405,555.28	
CAE INC	25,999	36.57	950,783.43	
STANTEC INC	9,001	97.47	877,327.47	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,843	225.68	1,544,328.24	
WSP GLOBAL INC	11,316	171.29	1,938,317.64	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	29.80	970,854.20	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	21,771	56.84	1,237,463.64	
RB GLOBAL INC	14,445	157.77	2,278,987.65	
THOMSON REUTERS CORP	13,263	125.66	1,666,628.58	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	176.10	7,437,935.70	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	74,891	128.01	9,586,796.91	
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	211.95	1,237,152.15	
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	91.11	1,845,341.94	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,887	72.20	1,363,641.40	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	26,949	106.22	2,862,522.78	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	189.87	856,883.31	
DOLLARAMA INC	22,000	183.43	4,035,460.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	63,541	90.49	5,749,825.09	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	48.10	333,333.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	51,652	63.39	3,274,220.28	
METRO INC	18,840	91.56	1,724,990.40	
WESTON (GEORGE) LTD	15,678	99.42	1,558,706.76	
SAPUTO INC	20,898	41.41	865,386.18	
BANK MONTREAL	59,527	250.61	14,918,061.47	
BANK NOVA SCOTIA	105,212	121.90	12,825,342.80	
CANADIAN IMPERIAL BANK	77,158	163.53	12,617,647.74	
NATIONAL BANK OF CANADA	31,446	224.95	7,073,777.70	
ROYAL BANK OF CANADA	117,314	295.84	34,706,173.76	
TORONTO-DOMINION BANK	140,383	169.69	23,821,591.27	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	28,524	65.35	1,864,043.40	
BROOKFIELD CORP	167,235	61.02	10,204,679.70	
IGM FINANCIAL INC	7,685	81.23	624,252.55	

	TMX GROUP LTD	23,425	47.88	1,121,589.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,542	2,371.52	3,656,883.84	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	92.09	2,190,636.92	
	IA FINANCIAL CORP INC	6,977	204.77	1,428,680.29	
	INTACT FINANCIAL CORP	14,911	297.07	4,429,610.77	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	139,940	58.75	8,221,475.00	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	91.04	3,967,250.08	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	113.81	4,963,709.34	
	CGI INC - CL A	16,084	94.70	1,523,154.80	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,662	2,735.47	4,546,351.14	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	101.68	710,133.12	
	SHOPIFY INC - CLASS A	102,906	174.45	17,951,951.70	
	CELESTICA INC	9,356	502.54	4,701,764.24	
	BCE INC	26,064	30.21	787,393.44	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	46.54	1,297,581.74	
	TELUS CORP	32,908	14.76	485,722.08	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	53.97	1,316,598.15	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	11,295	50.40	569,268.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	52.61	543,145.64	
	EMERA INC	25,484	75.36	1,920,474.24	
	FORTIS INC	42,588	80.94	3,447,072.72	
	HYDRO ONE LTD	29,579	58.41	1,727,709.39	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	202.27	544,106.30	
カナダドル 小計		3,638,874		358,420,438.16 (41,028,387,556)	
ユーロ	BOLLORE SE	81,810	4.12	337,220.82	
	ENI	152,490	21.00	3,203,052.45	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	19.60	777,375.20	
	NESTE OIL OYJ	32,766	29.10	953,490.60	
	OMV AG	12,549	59.00	740,391.00	
	REPSOL SA	89,536	23.23	2,079,921.28	
	TENARIS SA	26,993	23.95	646,482.35	
	TOTALENERGIES SE	165,312	68.82	11,376,771.84	
	AIR LIQUIDE	53,484	172.96	9,250,592.64	
	AKZO NOBEL	12,357	57.10	705,584.70	
	ARCELORMITTAL	38,717	54.52	2,110,850.84	
	BASF SE	74,913	47.44	3,553,872.72	
	BUZZI SPA	6,467	43.38	280,538.46	
	DSM-FIRMENICH AG	16,194	84.00	1,360,296.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	16.39	262,846.43	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	166.45	1,791,834.25	
	STORA ENSO OYJ R	42,169	9.26	390,484.94	

SYENSQO SA	7,191	65.60	471,729.60	
SYMRISE AG	10,018	88.54	886,993.72	
UPM KYMMENE OYJ	42,324	22.85	967,103.40	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,638	120.60	2,006,542.80	
ACS ACTIVIDADES DE CONST RTS	16,638	1.73	28,817.01	
AIRBUS SE	49,874	196.52	9,801,238.48	
ALSTOM	24,388	15.63	381,184.44	
BOUYGUES ORD	16,606	46.70	775,500.20	
BRENNTAG SE	9,500	55.48	527,060.00	
CSG NV	16,100	13.51	217,511.00	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	41.85	1,643,784.30	
DASSAULT AVIATION SA	1,214	289.60	351,574.40	
EIFFAGE	5,924	121.10	717,396.40	
FERROVIAL NV	45,325	56.64	2,567,208.00	
GEA GROUP AG	13,382	59.75	799,574.50	
HENSOLDT AG	7,517	74.22	557,911.74	
HOCHTIEF AG	1,682	466.20	784,148.40	
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	78.75	976,342.50	
KNORR-BREMSE AG	5,022	102.00	512,244.00	
KONE OYJ-B	26,369	49.23	1,298,145.87	
LEGRAND SA	22,132	141.35	3,128,358.20	
LEONARDO SPA	31,340	52.19	1,635,634.60	
METSO CORPORATION	51,970	15.10	784,747.00	
MTU AERO ENGINES AG	4,525	362.00	1,638,050.00	
PRYSMIAN SPA	23,634	136.55	3,227,222.70	
RATIONAL AG	483	637.50	307,912.50	
REXEL SA	17,411	37.94	660,573.34	
RHEINMETALL AG	3,829	1,013.20	3,879,542.80	
SAFRAN SA	29,570	340.00	10,053,800.00	
SAINT-GOBAIN	36,177	74.32	2,688,674.64	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,018	270.00	12,424,860.00	
SIEMENS	61,849	273.80	16,934,256.20	
SIEMENS ENERGY AG	64,309	156.24	10,047,638.16	
THALES SA	7,942	226.80	1,801,245.60	
VINCI S.A.	39,327	119.35	4,693,677.45	
WARTSILA OYJ	41,917	30.28	1,269,246.76	
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.96	675,968.08	
VERISURE PLC	10,550	10.34	109,139.75	
WOLTERS KLUWER	19,155	59.92	1,147,767.60	
ADP	2,382	108.80	259,161.60	
AENA SME SA	62,950	26.82	1,688,319.00	
AYVENS SA	41,437	11.79	488,542.23	

DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	9.38	425,317.34	
DHL GROUP	75,420	56.72	4,277,822.40	
GETLINK	21,115	18.60	392,739.00	
INPOST SA	15,470	15.42	238,547.40	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	100,647	5.46	549,935.20	
RYANAIR HOLDINGS PLC	35,048	26.60	932,276.80	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29,608	58.28	1,725,554.24	
CONTINENTAL AG	8,168	71.90	587,279.20	
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	46.43	476,093.22	
FERRARI NV	10,026	327.45	3,283,013.70	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	58,663	43.90	2,575,305.70	
MICHELIN	57,385	34.25	1,965,436.25	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	27.21	319,581.45	
RENAULT SA	17,081	25.29	431,978.49	
STELLANTIS NV	166,407	4.67	778,035.92	
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	71.52	1,096,258.56	
ADIDAS AG	14,066	181.55	2,553,682.30	
HERMES INTERNATIONAL	2,171	1,624.50	3,526,789.50	
KERING	5,534	245.80	1,360,257.20	
LVMH	20,709	492.95	10,208,501.55	
MONCLER SPA	18,908	49.60	937,836.80	
ACCOR	14,436	48.66	702,455.76	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	50.08	1,841,541.76	
DELIVERY HERO SE	13,414	36.79	493,501.06	
SODEXO	6,173	53.80	332,107.40	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,827	53.60	258,727.20	
PUBLICIS GROUPE	19,211	85.64	1,645,230.04	
SCOUT24 SE	7,536	72.95	549,751.20	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	89,096	18.74	1,670,104.52	
D'IETEREN GROUP	2,217	170.80	378,663.60	
INDITEX	87,257	55.40	4,834,037.80	
PROSUS	109,821	39.67	4,357,148.17	
ZALANDO SE	17,664	27.05	477,811.20	
CARREFOUR	49,441	16.33	807,618.73	
JERONIMO MARTINS	21,861	16.47	360,050.67	
KESKO OYJ-B SHS	20,083	19.24	386,396.92	
KONINKLIJKE AHOLD NV	71,081	35.76	2,541,856.56	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	75,423	69.20	5,219,271.60	
DANONE (GROUPE)	51,810	72.42	3,752,080.20	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	78,177	5.54	433,725.99	
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	68.30	649,669.60	
HEINEKEN NV	23,160	74.96	1,736,073.60	

KERRY GROUP PLC-A	13,413	82.20	1,102,548.60	
LOTUS BAKERIES	38	11,320.00	430,160.00	
MAGNUM ICE CREAM CO NV/THE	39,306	15.92	625,987.35	
PERNOD-RICARD	15,339	63.60	975,560.40	
BEIERSDORF AG	7,430	76.72	570,029.60	
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	70.20	616,356.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,575	74.12	857,939.00	
LOREAL	20,161	379.65	7,654,123.65	
BIOMERIEUX	3,044	71.65	218,102.60	
ESSILORLUXOTTICA	25,496	171.65	4,376,388.40	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	41.84	710,652.40	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	42.22	1,422,349.58	
KONINKLIJKE PHILIPS	69,465	23.92	1,661,602.80	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	28,637	34.38	984,540.06	
ABIVAX SA	4,492	122.60	550,719.20	
ARGENX SE	4,935	796.80	3,932,208.00	
BAYER	82,458	50.70	4,180,620.60	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	68.80	703,136.00	
FINANCIERE DE TUBIZE	1,681	219.20	368,475.20	
IPSEN	3,532	168.80	596,201.60	
MERCK KGAA	10,703	139.60	1,494,138.80	
ORION OYJ-CLASS B	10,139	70.55	715,306.45	
QIAGEN N.V.	15,262	36.67	559,657.54	
RECORDATI SPA	8,597	51.30	441,026.10	
SANOFI	90,135	76.48	6,893,524.80	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	233.30	425,539.20	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	179.60	463,727.20	
UCB (GROUPE)	11,023	250.00	2,755,750.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	47,025	38.25	1,798,706.25	
AIB GROUP PLC	150,470	10.39	1,563,383.30	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	159,500	11.20	1,787,676.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA	472,883	22.14	10,469,629.62	
BANCO BPM SPA	84,059	15.47	1,300,813.02	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	670,356	1.03	695,829.52	
BANCO DE SABADELL SA	420,800	3.17	1,337,302.40	
BANCO SANTANDER SA	1,202,106	12.04	14,480,568.87	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	17.68	1,562,964.93	
BANKINTER SA	51,888	15.14	785,584.32	
BAWAG GROUP AG	7,199	176.40	1,269,903.60	
BNP PARIBAS	81,615	99.82	8,146,809.30	
BPER BANCA SPA	117,669	13.96	1,643,365.25	
CAIXABANK	294,797	12.55	3,699,702.35	

COMMERZBANK AG	56,622	37.90	2,145,973.80	
CREDIT AGRICOLE SA	87,162	17.42	1,518,797.85	
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	117.10	2,971,529.60	
FINECOBANK SPA	41,585	22.62	940,652.70	
ING GROEP NV-CVA	245,116	28.43	6,968,647.88	
INTESA SANPAOLO	1,198,681	6.18	7,418,636.70	
KBC GROEP NV	18,057	119.45	2,156,908.65	
NORDEA BANK ABP	257,724	16.84	4,340,072.16	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	5,288	54.25	286,874.00	
SOCIETE GENERALE	53,515	73.21	3,917,833.15	
UNICREDIT SPA	115,475	81.92	9,459,712.00	
ADYEN NV	2,044	834.50	1,705,718.00	
AMUNDI SA	4,626	87.25	403,618.50	
BANCA MEDIOLANUM SPA	22,661	22.17	502,394.37	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	15,281	13.29	203,084.49	
DEUTSCHE BANK NAMEN	152,344	30.93	4,711,999.92	
DEUTSCHE BOERSE	15,743	251.80	3,964,087.40	
EURONEXT NV	6,480	147.90	958,392.00	
EXOR NV	7,825	67.60	528,970.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,138	78.10	713,677.80	
POSTE ITALIANE SPA	42,677	28.73	1,226,110.21	
SOFINA	1,238	226.00	279,788.00	
AEGON LTD	101,846	7.70	784,214.20	
AGEAS	11,086	71.00	787,106.00	
ALLIANZ SE-REG	31,930	422.70	13,496,811.00	
ASR NEDERLAND NV	11,959	68.24	816,082.16	
AXA SA	131,605	44.30	5,830,101.50	
GENERALI	72,151	42.20	3,044,772.20	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	250.60	1,116,423.00	
MAPFRE SA	37,129	4.40	163,516.11	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,966	499.80	5,480,806.80	
NN GROUP NV	22,941	76.44	1,753,610.04	
SAMPO OYJ-A SHS	201,580	9.62	1,939,199.60	
TALANX AG	5,053	109.40	552,798.20	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	31,592	26.09	824,235.28	
CAPGEMINI SA	12,235	89.00	1,088,915.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	49,764	18.21	906,202.44	
INDRA SISTEMAS SA	6,302	49.60	312,579.20	
NEMETSCHEK SE	5,455	56.25	306,843.75	
SAP SE	87,646	137.74	12,072,360.04	
NOKIA OYJ	421,721	11.20	4,723,275.20	
CELLNEX TELECOM SA	42,906	24.71	1,060,207.26	

	DEUTSCHE TELEKOM	288,198	25.34	7,302,937.32	
	ELISA A	10,227	35.72	365,308.44	
	KPN (KON.)	290,883	4.22	1,229,271.55	
	ORANGE	153,281	15.86	2,431,803.06	
	TELECOM ITALIA SPA	149,053	8.02	1,196,448.43	
	TELEFONICA	297,657	3.47	1,034,655.73	
	ACCIONA SA	2,181	250.60	546,558.60	
	E.ON SE	197,271	19.24	3,795,494.04	
	EDP RENEWABLES SA	21,752	13.75	299,090.00	
	EDP SA	235,657	4.43	1,045,845.76	
	ELIA GROUP SA/NV	3,975	135.40	538,215.00	
	ENDESA	25,972	38.83	1,008,492.76	
	ENEL	640,374	10.08	6,454,969.92	
	ENGIE	146,393	27.10	3,967,250.30	
	FORTUM OYJ	32,550	19.61	638,305.50	
	IBERDROLA SA	520,859	21.06	10,969,290.54	
	IBERDROLA SA -RTS	520,859	0.42	218,760.78	
	ITALGAS SPA	49,743	9.94	494,445.42	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	25,245	28.24	712,918.80	
	REDEIA CORP SA	30,678	15.22	466,919.16	
	RWE STAMM	54,007	56.52	3,052,475.64	
	SNAM SPA	147,559	6.18	912,504.85	
	TERNA SPA	118,094	10.19	1,203,968.33	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	50,881	36.52	1,858,174.12	
	VERBUND AG	6,430	57.05	366,831.50	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,856	926.80	3,573,740.80	
	ASML HOLDING NV	32,579	1,602.80	52,217,621.20	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	254.80	1,619,763.60	
	INFINEON TECHNOLOGIES	109,611	73.35	8,039,966.85	
	STMICROELECTRONICS NV	53,041	62.68	3,324,609.88	
	VONOVIA SE	61,810	21.41	1,323,352.10	
ユーロ 小計		15,803,356		551,130,159.29 (102,218,110,643)	
イギリスポンド	BP PLC	1,317,833	4.81	6,349,319.39	
	SHELL PLC-NEW	475,509	30.41	14,460,228.69	
	ANGLO AMERICAN PLC	89,631	35.78	3,206,997.18	
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	37.16	1,109,448.96	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,904	37.09	664,059.36	
	FRESNILLO PLC	13,914	26.42	367,607.88	
	GLENCORE PLC	787,993	5.11	4,029,796.20	
	RIO TINTO PLC REG	93,321	66.75	6,229,176.75	
	BAE SYSTEMS PLC	240,047	18.39	4,414,464.33	

BUNZL PLC	29,337	26.48	776,843.76	
MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	4.75	480,503.23	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	704,950	14.36	10,125,901.80	
SMITHS GROUP PLC	26,476	24.93	660,046.68	
SPIRAX GROUP PLC	5,514	63.95	352,620.30	
SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC	33,317	53.40	1,779,127.80	
EXPERIAN PLC	70,884	26.08	1,848,654.72	
INTERTEK GROUP PLC	13,890	58.10	807,009.00	
RELX PLC	146,201	23.75	3,472,273.75	
RENTOKIL INITIAL PLC	212,020	4.49	952,393.84	
PEARSON	55,305	12.63	698,502.15	
INFORMA PLC	110,598	8.84	977,686.32	
KINGFISHER PLC	153,717	2.72	419,186.25	
NEXT PLC	8,464	145.35	1,230,242.40	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	179,339	3.73	669,472.48	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	3.37	501,075.63	
TESCO PLC	525,585	4.67	2,457,109.87	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.57	503,731.80	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	168,549	44.97	7,579,648.53	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	48.92	878,603.20	
DIAGEO	186,883	15.05	2,813,523.56	
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	27.43	1,878,351.54	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,356	49.97	2,716,169.32	
UNILEVER PLC	183,391	45.51	8,346,124.41	
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.30	775,466.47	
ASTRAZENECA	126,382	133.54	16,877,052.28	
GSK PLC	335,128	19.59	6,566,833.16	
HALEON PLC	747,630	3.60	2,692,963.26	
BARCLAYS	1,134,161	5.07	5,750,196.27	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,442,279	14.56	21,005,351.35	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	1.11	5,393,407.69	
NATWEST GROUP PLC	669,848	6.63	4,441,092.24	
STANDARD CHARTERED PLC	161,358	21.05	3,396,585.90	
3I GROUP PLC	75,987	26.58	2,019,734.46	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	37,924	87.68	3,325,176.32	
M&G PLC	131,539	3.45	454,861.86	
SCHRODERS PLC	39,932	5.86	234,201.18	
WISE GROUP PLC-CL A	49,048	9.47	464,484.56	
ADMIRAL GROUP PLC	24,854	36.74	913,135.96	
AVIVA PLC	247,334	6.58	1,628,447.05	
LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.90	1,445,278.20	
PRUDENTIAL	212,226	10.28	2,181,683.28	

	STANDARD LIFE PLC	51,001	8.69	443,198.69	
	THE SAGE GROUP PLC	76,660	8.30	636,737.96	
	HALMA PLC	31,069	36.40	1,130,911.60	
	AIRTEL AFRICA PLC	37,221	3.21	119,702.73	
	BT GROUP PLC	464,863	1.87	869,293.81	
	VODAFONE GROUP PLC	1,570,550	0.97	1,535,369.68	
	CENTRICA PLC	453,631	1.71	779,111.24	
	NATIONAL GRID PLC	417,438	12.30	5,134,487.40	
	SEVERN TRENT PLC	22,744	29.54	671,857.76	
	SSE PLC	107,749	24.17	2,604,293.33	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	13.35	675,243.00	
イギリスポンド 小計		20,410,820		187,922,059.77 (40,895,598,647)	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	684.50	392,903.00	
	GIVAUDAN-REG	742	3,419.00	2,536,898.00	
	HOLCIM LTD	42,259	72.82	3,077,300.38	
	SIKA AG-BR	12,257	161.15	1,975,215.55	
	ABB LTD	130,941	84.68	11,088,083.88	
	BELIMO HOLDING AG-REG	749	812.50	608,562.50	
	GEBERIT AG-REG	2,530	516.60	1,306,998.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	254.00	520,192.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	262.20	810,722.40	
	VAT GROUP AG	2,266	677.80	1,535,894.80	
	SGS SA	12,959	94.10	1,219,441.90	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	204.40	772,836.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	45,121	184.00	8,302,264.00	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	203.10	504,297.30	
	AVOLTA AG	7,820	52.30	408,986.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,135.00	317,800.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	95,400.00	763,200.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,345.00	766,290.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	216,257	83.31	18,016,370.67	
	ALCON INC	41,942	54.04	2,266,545.68	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	202.20	785,951.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	103.65	885,171.00	
	GALDERMA GROUP AG	14,992	174.40	2,614,604.80	
	LONZA GROUP AG-REG	5,661	582.60	3,298,098.60	
	NOVARTIS	156,121	124.30	19,405,840.30	
	ROCHE HOLDING AG	58,969	335.50	19,784,099.50	
	ROCHE HOLDING AG-BR	3,271	340.40	1,113,448.40	
	SANDOZ GROUP AG	37,337	68.60	2,561,318.20	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	122.20	303,911.40	

	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	71.62	1,094,998.18	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	675.40	1,232,605.00	
	UBS GROUP AG	266,448	41.88	11,158,842.24	
	HELVETIA BALOISE HOLDING AG	7,269	213.40	1,551,204.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,514	927.60	2,331,986.40	
	SWISS RE LTD	24,330	131.15	3,190,879.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,557	612.60	7,692,418.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	81.10	973,686.60	
	SWISSCOM	2,174	611.00	1,328,314.00	
	BKW AG	1,744	131.90	230,033.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,734	130.10	876,093.40	
スイスフラン 小計		1,172,346		139,604,307.78 (28,084,198,596)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	22,252	522.00	11,615,544.00	
	SCA SV CELLULOSA B	59,490	98.26	5,845,487.40	
	ADDTECH AB-B SHARES	20,615	325.40	6,708,121.00	
	ALFA LAVAL AB	25,134	560.20	14,080,066.80	
	ASSA ABLOY AB-B	81,977	333.10	27,306,538.70	
	ATLAS COPCO A	211,360	190.80	40,327,488.00	
	ATLAS COPCO B	135,444	166.80	22,592,059.20	
	BEIJER REF AB	52,981	136.90	7,253,098.90	
	EPIROC AB-A	53,479	255.60	13,669,232.40	
	EPIROC AB-B	28,804	217.40	6,261,989.60	
	INDUTRADE AB	22,644	208.80	4,728,067.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	189.05	2,647,078.10	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	318.60	5,725,242.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	34.48	4,235,799.04	
	SAAB AB-B	25,552	564.00	14,411,328.00	
	SANDVIK AB	87,594	389.00	34,074,066.00	
	SKANSKA B	25,507	255.70	6,522,139.90	
	SKF AB-B	21,050	257.60	5,422,480.00	
	TRELLEBORG AB-B SHS	16,653	410.00	6,827,730.00	
	VOLVO B	124,872	334.40	41,757,196.80	
	SECURITAS B	29,769	162.70	4,843,416.30	
	EVOLUTION AB	10,297	682.00	7,022,554.00	
	HENNES & MAURITZ B	32,696	165.10	5,398,109.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	44,340	277.20	12,291,048.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	478.80	6,863,598.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	114,774	201.20	23,092,528.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	144.25	17,416,168.00	
	SWEDBANK AB-A	71,421	368.70	26,332,922.70	
	EQT AB	47,121	279.20	13,156,183.20	

	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	536.00	6,334,448.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	527.20	5,887,769.60	
	INVESTOR AB-B SHS	152,677	396.80	60,582,233.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	554.50	4,036,760.00	
	OCTAVE INTELLIGENCE PLC-SDR	17,209	162.05	2,788,718.45	
	ERICSSON (LM) B	214,689	112.35	24,120,309.15	
	HEXAGON AB-B SHS	172,099	80.38	13,833,317.62	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	166.20	7,771,844.40	
	TELIA CO AB	198,022	45.26	8,962,475.72	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	52.42	2,972,214.00	
	SAGAX AB-B	17,402	161.60	2,812,163.20	
スウェーデンクローナ 小計		2,561,543		538,529,535.38 (9,041,910,899)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	29,320	309.00	9,059,880.00	
	EQUINOR ASA	66,436	333.80	22,176,336.80	
	VAR ENERGI ASA	78,000	42.67	3,328,260.00	
	NORSK HYDRO	100,517	84.84	8,527,862.28	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	441.20	5,514,117.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	39,970	312.60	12,494,622.00	
	MOWI ASA	31,968	183.80	5,875,718.40	
	ORKLA	53,335	105.50	5,626,842.50	
	SALMAR ASA	5,423	463.00	2,510,849.00	
	DNB BANK ASA	71,795	298.40	21,423,628.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	272.00	5,052,128.00	
	TELENOR ASA	51,193	144.20	7,382,030.60	
ノルウェークローネ 小計		559,029		108,972,275.18 (1,820,926,718)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	422.40	12,719,308.80	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	7,550	203.00	1,532,650.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	83,415	180.30	15,039,724.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	15,510.00	3,396,690.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	15,900.00	4,865,400.00	
	DSV A/S	16,193	1,660.00	26,880,380.00	
	PANDORA A/S	6,512	781.00	5,085,872.00	
	CARLSBERG AS-B	6,817	918.20	6,259,369.40	
	COLOPLAST-B	9,737	400.50	3,899,668.50	
	DEMANT A/S	8,512	271.60	2,311,859.20	
	GENMAB A/S	4,878	1,930.00	9,414,540.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	270,319	320.15	86,542,627.85	
	DANSKE BANK A/S	53,617	369.60	19,816,843.20	
	TRYG A/S	29,772	154.00	4,584,888.00	
	ORSTED A/S	37,341	147.85	5,520,866.85	

デンマーククローネ 小計		565,300		207,870,688.30 (5,157,271,776)	
オーストラリアドル	SANTOS	292,069	7.65	2,234,327.85	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	159,719	29.30	4,679,766.70	
	BHP GROUP LTD	426,500	56.87	24,255,055.00	
	EVOLUTION MINING LTD	162,152	11.25	1,824,210.00	
	FORTESCUE LTD	137,312	18.11	2,486,720.32	
	LYNAS RARE EARTHS LTD	76,032	16.86	1,281,899.52	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	107,682	20.13	2,167,638.66	
	PLS GROUP LTD	263,674	4.61	1,215,537.14	
	RIO TINTO LTD	32,909	158.52	5,216,734.68	
	SOUTH32 LTD	346,773	3.82	1,324,672.86	
	SGH LTD	12,630	44.35	560,140.50	
	BRAMBLES LTD	108,007	19.25	2,079,134.75	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	39.43	1,749,745.68	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	10.39	883,150.00	
	TRANSURBAN GROUP	261,181	14.69	3,836,748.89	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	62.40	2,883,504.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.50	1,001,071.50	
	CAR GROUP LTD	29,334	26.17	767,670.78	
	REA GROUP LTD	3,586	148.35	531,983.10	
	WESFARMERS LTD	95,288	90.87	8,658,820.56	
	COLES GROUP LTD	108,486	23.67	2,567,863.62	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	102,533	40.44	4,146,434.52	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	123.68	591,561.44	
	PRO MEDICUS LTD	5,485	210.42	1,154,153.70	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	444,126	2.87	1,274,641.62	
	SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	21.36	893,467.44	
	CSL LIMITED	39,224	125.53	4,923,788.72	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	257,131	35.76	9,195,004.56	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	140,460	168.11	23,612,730.60	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	254,446	39.28	9,994,638.88	
	WESTPAC BANKING	287,079	36.20	10,392,259.80	
	ASX LTD	14,549	54.21	788,701.29	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	31,627	252.20	7,976,329.40	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON	27,812	44.06	1,225,396.72	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	8.21	1,368,295.02	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	5.04	1,170,202.32	
	QBE INSURANCE GROUP	127,819	25.58	3,269,610.02	
	SUNCORP GROUP LTD	80,738	18.90	1,525,948.20	
	WISETECH GLOBAL LTD	19,625	34.63	679,613.75	
	XERO LTD	11,340	74.34	843,015.60	

	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.98	1,536,165.66	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	10.52	1,636,228.20	
オーストラリアドル 小計		5,734,386		160,404,583.57 (18,059,952,064)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	157,673	8.85	1,395,406.05	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	49,293	40.25	1,984,043.25	
	INFRATIL LTD	73,511	15.50	1,139,420.50	
	CONTACT ENERGY LTD	68,904	9.20	633,916.80	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.67	626,784.48	
ニュージーランドドル 小計		459,925		5,779,571.08 (540,794,465)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	237,496	65.10	15,460,989.60	
	SWIRE PACIFIC A	44,500	82.85	3,686,825.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	126.70	13,556,900.00	
	MTR CORP	125,000	31.08	3,885,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	33.10	3,972,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	30.66	5,334,840.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	13.20	2,613,600.00	
	WH GROUP LTD	658,301	7.76	5,108,415.76	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	45.34	12,763,210.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,300	380.40	36,632,520.00	
	AIA GROUP LTD	861,800	72.30	62,308,140.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	60.05	2,251,875.00	
	CLP HOLDINGS	136,500	76.30	10,414,950.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.58	5,952,643.06	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	57.85	6,479,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	194,496	44.76	8,705,640.96	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	24.90	3,118,177.20	
	SINO LAND CO	315,400	10.19	3,213,926.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	115.20	12,096,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	22.62	2,782,260.00	
香港ドル 小計		4,957,678		220,337,112.58 (4,558,774,859)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	112,800	10.89	1,228,392.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	10.92	1,609,608.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	206,800	3.41	705,188.00	
	SINGAPORE AIRLINES	135,932	7.68	1,043,957.76	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.81	680,466.00	
	DBS GROUP	173,360	70.23	12,175,072.80	
	OCBC BANK	289,400	27.32	7,906,408.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	95,400	44.34	4,230,036.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	24.62	1,624,920.00	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	4.39	2,731,207.77	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.60	470,960.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	189,800	2.49	472,602.00	
シンガポールドル 小計		2,301,735		34,878,818.33 (4,377,640,488)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	14.68	872,388.36	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	2,312.70	4,963,054.20	
	BANK HAPOALIM BM	109,957	70.22	7,721,180.54	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	68.34	7,689,070.08	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	30.65	3,049,675.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	211.00	2,638,133.00	
	HAREL INSURANCE INVESTMENTS	9,931	159.00	1,579,029.00	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	18,222	166.50	3,033,963.00	
	ENLIGHT RENEWABLE ENERGY LTD	11,683	245.50	2,868,176.50	
	OPC ENERGY LTD	14,309	96.59	1,382,106.31	
	NOVA LTD	2,440	1,430.00	3,489,200.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	9,380	683.50	6,411,230.00	
	AZRIELI GROUP	5,718	408.00	2,332,944.00	
イスラエルシェケル 小計		467,728		48,030,149.99 (2,578,522,617)	
合　計		89,369,064		1,133,133,684,385 (1,133,133,684,385)	

(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	111,107	1,104,403.58	
	オーストラリアドル 小計		111,107	1,104,403.58 (124,344,799)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,764,250.00	
	香港ドル 小計		315,000	3,764,250.00 (77,882,332)	
投資信託受益証券合計			426,107	202,227,131 (202,227,131)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	39,120	6,454,800.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	58,442	1,328,386.66	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,211,566.58	
		CROWN CASTLE INC	36,601	2,806,564.68	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,829	4,990,574.57	

	EQUINIX INC	8,139	8,422,806.93	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	34,627	2,357,752.43	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,515,279.60	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	17,564	2,506,031.52	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	24,610	1,059,214.40	
	INVITATION HOMES INC	45,008	1,321,884.96	
	IRON MOUNTAIN INC	24,968	2,983,176.64	
	KIMCO REALTY CORP	56,577	1,410,464.61	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,250,520.00	
	PROLOGIS INC	77,581	10,966,850.16	
	PUBLIC STORAGE	12,826	4,095,983.10	
	REALTY INCOME CORP	75,597	4,775,462.49	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	993,873.84	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	1,630,093.84	
	SIMON PROPERTY GROUP	27,265	5,990,393.15	
	SUN COMMUNITIES INC	10,890	1,293,078.60	
	VENTAS INC	38,069	3,492,450.06	
	VICI PROPERTIES INC	91,691	2,377,547.63	
	WELLTOWER INC	59,134	13,726,184.08	
	WP CAREY INC	16,024	1,137,063.04	
アメリカドル 小計		830,079	91,098,003.57 (14,770,630,298)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	263,482.20	
	GECINA SA	3,139	218,945.25	
	KLEPIERRE	17,225	617,344.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	1,071,114.75	
ユーロ 小計		35,781	2,170,886.20 (402,634,263)	
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	68,516	450,835.28	
	SEGRO PLC	103,047	895,272.33	
イギリスポンド 小計		171,563	1,346,107.61 (292,939,938)	
オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	172,354	5,156,831.68	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,467,939.55	
	STOCKLAND	207,412	817,203.28	
	VICINITY CENTERS	305,149	793,387.40	
オーストラリアドル 小計		1,066,198	8,235,361.91 (927,219,397)	
香港ドル	LINK REIT	246,000	9,303,720.00	
香港ドル 小計		246,000	9,303,720.00 (192,493,966)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	707,503.62	
		549,912	1,330,787.04	

	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST			
	シンガポールドル 小計	834,050	2,038,290.66 (255,825,860)	
投資証券合計		3,183,671	16,841,743,722 (16,841,743,722)	
合計			17,043,970,853 (17,043,970,853)	

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　517銘柄	98.3%	—	—	—	76.1%
	投資証券　25銘柄	—	—	—	1.7%	1.3%
カナダドル	株式　83銘柄	100.0%	—	—	—	3.6%
	新株予約権証券　1銘柄	—	—	—	—	—
ユーロ	株式　216銘柄	99.6%	—	—	—	8.9%
	投資証券　4銘柄	—	—	—	0.4%	0.0%
イギリスポンド	株式　62銘柄	99.3%	—	—	—	3.6%
	投資証券　2銘柄	—	—	—	0.7%	0.0%
スイスフラン	株式　40銘柄	100.0%	—	—	—	2.4%
スウェーデンクローナ	株式　40銘柄	100.0%	—	—	—	0.8%
ノルウェークローネ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	—	0.2%
デンマークローネ	株式　15銘柄	100.0%	—	—	—	0.4%
オーストラリアドル	株式　42銘柄	94.5%	—	—	—	1.6%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	—	0.7%	—	0.0%
	投資証券　4銘柄	—	—	—	4.9%	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　20銘柄	94.4%	—	—	—	0.4%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	—	4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式　12銘柄	94.5%	—	—	—	0.4%
	投資証券　2銘柄	—	—	—	5.5%	0.0%

イスラエル シェケル	株式　13銘柄	100.0%	―	―	―	0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,074,995,811
コール・ローン	170,489,622
株式	33,992,900,510
投資信託受益証券	8,874,816
投資証券	534,016,053
派生商品評価勘定	11,666,376
未収配当金	17,090,433
未収利息	4,507
差入委託証拠金	279,923,591
流動資産合計	36,089,961,719
資産合計	36,089,961,719
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	479,771
前受金	11,194,130
未払解約金	161,144,726
流動負債合計	172,818,627
負債合計	172,818,627
純資産の部	
元本等	
元本	13,971,984,418
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	21,945,158,674
元本等合計	35,917,143,092
純資産合計	35,917,143,092
負債純資産合計	36,089,961,719

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券

	2026年 7月10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。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2026年 7月10日現在	
1.　計算期間の末日における受益権の総数		13,971,984,418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	2.5707円
	(1万口当たり純資産額)	(25,707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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2026年 7月10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

	2026年 7月10日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	11,684,306,264円
期中追加設定元本額	3,794,617,248円
期中一部解約元本額	1,506,939,094円
期末元本額	13,971,984,418円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	137,560,071円
コア投資戦略ファンド（成長型）	372,355,375円
コア投資戦略ファンド（切替型）	147,081,388円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	77,609,479円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	10,566,125,159円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	156,604,457円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	45,840,939円
ＤＣ外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスファンド	2,409,830,050円
ＦＯＦｓ用　外国株式ＥＳＧリーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	58,977,500円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	700,533,699

投資信託受益証券	△446,419
投資証券	△10,362,728
合計	689,724,552

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,318,526,545	－	1,329,720,675	11,194,130
合計		1,318,526,545	－	1,329,720,675	11,194,130

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	12,136,100	－	12,128,575	△7,525
	アメリカドル	8,112,500	－	8,104,737	△7,763
	スイスフラン	4,023,600	－	4,023,838	238
合計		12,136,100	－	12,128,575	△7,525

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘 柄	株式数(株)	評価額 単価	評価額 金額	備考
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	4,760	57.20	272,272.00	
	CHENIERE ENERGY INC	996	261.29	260,244.84	
	HALLIBURTON CO	4,192	34.12	143,031.04	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,403	283.30	397,469.90	

ONEOK INC	3,027	89.50	270,916.50	
PHILLIPS 66	1,945	189.82	369,199.90	
SLB LTD	7,204	47.24	340,316.96	
TARGA RESOURCES CORP	983	273.02	268,378.66	
TECHNIPFMC PLC	1,935	70.53	136,475.55	
VALERO ENERGY CORP	1,416	281.25	398,250.00	
WILLIAMS COS	6,022	75.45	454,359.90	
AVERY DENNISON CORP	421	159.07	66,968.47	
BALL CORP	1,123	61.00	68,503.00	
CRH PLC	3,283	104.36	342,613.88	
ECOLAB INC	1,226	273.03	334,734.78	
INT'L PAPER CO	2,361	37.18	87,781.98	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,335	78.53	104,837.55	
LINDE PLC	2,235	525.56	1,174,626.60	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	276	571.90	157,844.40	
NEWMONT CORPORATION	5,297	94.81	502,208.57	
NUCOR CORP	1,054	222.28	234,283.12	
PPG INDUSTRIES INC	1,167	115.96	135,325.32	
SMURFIT WESTROCK PLC	2,424	42.99	104,207.76	
STEEL DYNAMICS INC	696	222.06	154,553.76	
3 M COMPANY	2,602	155.34	404,194.68	
AERCAP HOLDINGS NV	771	151.03	116,444.13	
ALLEGION PLC	408	135.07	55,108.56	
AXON ENTERPRISE INC	386	582.00	224,652.00	
CARLISLE COS INC	198	330.00	65,340.00	
CARRIER GLOBAL CORP	3,766	67.81	255,372.46	
CATERPILLAR	2,261	938.39	2,121,699.79	
CNH INDUSTRIAL NV	3,795	10.28	39,012.60	
COMFORT SYSTEMS USA INC	170	1,781.42	302,841.40	
CUMMINS INC	683	673.39	459,925.37	
DEERE&CO	1,176	592.90	697,250.40	
DOVER CORP	655	211.57	138,578.35	
EATON CORP	1,859	405.83	754,437.97	
EMCOR GROUP INC	207	783.41	162,165.87	
FERGUSON ENTERPRISES INC	957	224.62	214,961.34	
FORTIVE CORP	1,357	61.15	82,980.55	
GE AEROSPACE	5,050	359.04	1,813,152.00	
GE VERNOVA INC	1,304	1,075.26	1,402,139.04	
GRACO INC	861	73.19	63,016.59	
GRAINGER (WW) INC	207	1,364.86	282,526.02	
HUBBELL INC	266	485.41	129,119.06	
IDEX CORP	385	219.74	84,599.90	

INGERSOLL-RAND INC	1,884	77.05	145,162.20	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,943	140.53	413,579.79	
LENNOX INTERNATIONAL INC	149	537.50	80,087.50	
PENTAIR PLC	784	74.57	58,462.88	
QUANTA SERVICES INC	728	668.17	486,427.76	
ROCKWELL AUTOMATION INC	560	467.48	261,788.80	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	1,086	472.00	512,592.00	
UNITED RENTALS INC	300	1,088.67	326,601.00	
XYLEM INC	1,103	118.89	131,135.67	
AUTOMATIC DATA PROCESS	1,977	241.28	477,010.56	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	538	147.32	79,258.16	
JACOBS SOLUTIONS INC	568	125.84	71,477.12	
PAYCHEX INC	1,464	106.26	155,564.64	
TRANSUNION	1,017	76.33	77,627.61	
VERALTO CORP	1,220	92.10	112,362.00	
VERISK ANALYTICS INC	634	187.01	118,564.34	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	608	192.76	117,198.08	
CSX CORP	9,107	49.35	449,430.45	
DELTA AIR LINES INC	876	89.00	77,964.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	641	170.62	109,367.42	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	8,539	3.88	33,131.32	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	390	282.61	110,217.90	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	869	225.85	196,263.65	
UNION PACIFIC CORP	2,843	285.04	810,368.72	
XPO INC	554	208.03	115,248.62	
APTIV PLC	979	59.86	58,602.94	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	4,216	18.12	76,393.92	
TESLA INC	13,616	406.55	5,535,584.80	
DECKERS OUTDOOR CORP	756	104.26	78,820.56	
DR HORTON INC	1,294	149.55	193,517.70	
GARMIN LTD	804	244.51	196,586.04	
LULULEMON ATHLETICA INC	489	116.51	56,973.39	
NVR INC	12	6,471.44	77,657.28	
PULTE GROUP INC	904	123.72	111,842.88	
BOOKING HOLDINGS INC	3,742	175.52	656,795.84	
CARNIVAL CORP LTD	6,185	26.72	165,263.20	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6,301	34.60	218,014.60	
COMPASS GROUP PLC	8,227	31.77	261,371.79	
DARDEN RESTAURANTS INC	526	201.92	106,209.92	
DOMINO'S PIZZA INC	146	300.88	43,928.48	
EXPEDIA GROUP INC	566	267.78	151,563.48	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	1,120	337.65	378,168.00	

HYATT HOTELS CORP - CL A	188	189.95	35,710.60	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	731	163.35	119,408.85	
MCDONALD'S CORP	3,409	276.49	942,554.41	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,233	288.08	355,202.64	
YUM BRANDS INC	1,363	162.39	221,337.57	
ALPHABET INC-CL A	28,167	358.89	10,108,854.63	
ALPHABET INC-CL C	22,363	356.24	7,966,595.12	
ELECTRONIC ARTS INC	1,109	206.56	229,075.04	
FOX CORP - CLASS A	864	53.74	46,431.36	
FOX CORP- CLASS B	742	48.44	35,942.48	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	703	485.88	341,573.64	
THE WALT DISNEY CO	8,546	96.17	821,868.82	
AUTOZONE INC	81	3,010.39	243,841.59	
BEST BUY COMPANY INC	1,076	79.99	86,069.24	
BURLINGTON STORES INC	283	321.44	90,967.52	
CARVANA CO	3,113	67.12	208,944.56	
DICK'S SPORTING GOODS INC	338	217.32	73,454.16	
EBAY	2,059	117.33	241,582.47	
GENUINE PARTS CO	602	124.27	74,810.54	
HOME DEPOT	4,827	338.73	1,635,049.71	
LOWES COMPANIES	2,698	213.00	574,674.00	
MERCADOLIBRE INC	223	1,807.83	403,146.09	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,133	85.12	351,800.96	
ROSS STORES INC	1,521	220.60	335,532.60	
TJX COMPANIES INC	5,316	150.90	802,184.40	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,382	30.12	71,745.84	
ULTA BEAUTY INC	206	460.24	94,809.44	
WILLIAMS-SONOMA INC	553	219.77	121,532.81	
COSTCO WHOLESALE CORP	2,146	912.97	1,959,233.62	
DOLLAR GENERAL CORP	1,029	115.73	119,086.17	
KROGER CO	2,604	59.86	155,875.44	
SYSCO CORP	2,215	82.03	181,696.45	
TARGET (DAYTON HUDSON)	2,230	132.27	294,962.10	
BUNGE GLOBAL SA	562	113.62	63,854.44	
COCA-COLA CO	18,741	82.63	1,548,568.83	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	947	105.09	99,520.23	
GENERAL MILLS INC	2,329	35.85	83,494.65	
HERSHEY FOODS CORPORATION	716	171.65	122,901.40	
KEURIG DR PEPPER INC	5,973	30.72	183,490.56	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,205	51.54	62,105.70	
MONSTER BEVERAGE CORP	3,419	96.55	330,104.45	
PEPSICO INC	6,676	137.86	920,353.36	

CHURCH & DWIGHT CO INC	1,205	95.67	115,282.35	
CLOROX COMPANY	562	93.07	52,305.34	
COLGATE-PALMOLIVE CO	3,716	91.01	338,193.16	
ESTEE LAUDER CO-CL A	1,101	81.99	90,270.99	
KENVUE INC	8,848	19.18	169,704.64	
KIMBERLY-CLARK CORP	1,525	109.93	167,643.25	
PROCTER & GAMBLE CO	11,186	146.85	1,642,664.10	
CENCORA INC	888	302.46	268,584.48	
COOPER COS INC/THE	921	71.02	65,409.42	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,878	91.33	262,847.74	
ELEVANCE HEALTH INC	1,075	420.39	451,919.25	
HUMANA INC	611	397.76	243,031.36	
IDEXX LABORATORIES INC	374	558.60	208,916.40	
INSULET CORP	323	158.29	51,127.67	
LABCORP HOLDINGS INC	385	277.63	106,887.55	
QUEST DIAGNOSTICS	513	208.05	106,729.65	
STERIS PLC	490	216.00	105,840.00	
STRYKER CORP	1,668	327.11	545,619.48	
THE CIGNA GROUP	1,270	291.80	370,586.00	
TPG INC-CVR-RTS	919	—	—	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	695	189.70	131,841.50	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	904	89.23	80,663.92	
AGILENT TECHNOLOGIES	1,431	133.59	191,167.29	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	646	312.79	202,062.34	
AMGEN	2,635	363.62	958,138.70	
BIOGEN INC	726	198.91	144,408.66	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	9,806	57.94	568,159.64	
DANAHER CORP	3,061	195.98	599,894.78	
ELI LILLY & CO	3,885	1,216.95	4,727,850.75	
GILEAD SCIENCES INC	5,939	134.84	800,814.76	
INCYTE CORP	913	118.52	108,208.76	
IQVIA HOLDINGS INC	779	208.97	162,787.63	
JOHNSON & JOHNSON	11,653	259.10	3,019,292.30	
MERCK & CO	11,882	125.07	1,486,081.74	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	97	1,288.02	124,937.94	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	2,008	57.96	116,383.68	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,236	496.50	613,674.00	
WATERS CORP	490	377.13	184,793.70	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	331	357.66	118,385.46	
ZOETIS INC	2,161	75.08	162,247.88	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	2,065	69.86	144,260.90	
FIFTH THIRD BANCORP	4,381	56.54	247,701.74	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	10,026	17.76	178,061.76	
KEY CORP	4,185	23.10	96,673.50	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,948	250.91	488,772.68	
REGIONS FINL CORP	4,455	30.58	136,233.90	
TRUIST FINANCIAL CORP	5,969	51.37	306,627.53	
US BANCORP	7,675	61.90	475,082.50	
AMERICAN EXPRESS	2,571	346.72	891,417.12	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	427	500.16	213,568.32	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	2,028	119.84	243,035.52	
ARES MANAGEMENT CORP - A	1,015	121.66	123,484.90	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	3,344	152.26	509,157.44	
BLACKROCK INC	706	1,019.68	719,894.08	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2,894	200.10	579,089.40	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	492	267.85	131,782.20	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	2,360	41.61	98,199.60	
FISERV INC	2,489	51.65	128,556.85	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,683	135.11	362,500.13	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	361	311.47	112,440.67	
MASTERCARD INC-CLASS A	3,962	523.20	2,072,918.40	
MOODY'S CORP	726	487.02	353,576.52	
MORGAN STANLEY	5,777	222.13	1,283,245.01	
NASDAQ INC	2,156	87.52	188,693.12	
NORTHERN TRUST CORP	874	182.86	159,819.64	
PAYPAL HOLDINGS INC	4,244	45.32	192,338.08	
PRICE T ROWE GROUP INC	1,119	117.05	130,978.95	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	859	168.72	144,930.48	
S&P GLOBAL INC	1,487	432.96	643,811.52	
SCHWAB (CHARLES) CORP	8,081	101.91	823,534.71	
STATE STREET CORP	1,400	180.16	252,224.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	1,710	71.57	122,384.70	
VISA INC-CLASS A SHARES	8,133	348.20	2,831,910.60	
AFLAC	2,308	121.99	281,552.92	
ALLSTATE CORP	1,274	248.64	316,767.36	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,684	101.70	171,262.80	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	1,276	138.52	176,751.52	
MARSH & MCLENNAN COS	2,320	179.00	415,280.00	
METLIFE INC	2,681	91.15	244,373.15	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,022	111.67	114,126.74	
PROGRESSIVE CORP	2,860	229.52	656,427.20	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,590	115.00	182,850.00	
TRAVELERS COS INC/THE	1,014	337.48	342,204.72	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	472	289.13	136,469.36	

WEYERHAEUSER CO	3,258	22.50	73,305.00	
ACCENTURE PLC-CL A	2,965	139.06	412,312.90	
ADOBE INC	1,948	222.65	433,722.20	
ATLASSIAN CORP-CL A	757	90.71	68,667.47	
AUTODESK INC	1,035	208.58	215,880.30	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	1,339	385.95	516,787.05	
FAIR ISAAC CORP	110	1,279.41	140,735.10	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	4,551	295.30	1,343,910.30	
INTUIT INC	1,344	273.38	367,422.72	
MICROSOFT CORP	34,129	384.36	13,117,822.44	
PALO ALTO NETWORKS INC	3,949	338.31	1,335,986.19	
PTC INC	639	123.79	79,101.81	
SALESFORCE INC	3,859	162.50	627,087.50	
SERVICENOW INC	5,023	108.84	546,703.32	
SYNOPSYS INC	880	443.37	390,165.60	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	1,083	52.71	57,084.93	
TWILIO INC - A	699	218.60	152,801.40	
WORKDAY INC-CLASS A	979	138.34	135,434.86	
ZSCALER INC	462	147.12	67,969.44	
F5 INC	273	430.32	117,477.36	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	6,630	49.11	325,599.30	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	826	322.17	266,112.42	
NETAPP INC	1,028	171.73	176,538.44	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	1,050	890.09	934,594.50	
WESTERN DIGITAL CORP	1,674	578.05	967,655.70	
AT&T INC	33,780	21.04	710,731.20	
COMCAST CORP-CL A	17,585	23.34	410,521.82	
VERIZON COMMUNICATIONS	20,184	42.24	852,572.16	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	903	130.55	117,886.65	
ATMOS ENERGY CORP	825	174.72	144,144.00	
CMS ENERGY CORP	1,453	75.00	108,975.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	1,755	110.27	193,523.85	
EDISON INTL	1,867	74.64	139,352.88	
EVERSOURCE ENERGY	1,948	73.93	144,015.64	
EXELON CORP	5,013	46.38	232,502.94	
NISOURCE INC	2,342	46.66	109,277.72	
NRG ENERGY INC	941	140.48	132,191.68	
SEMPRA	3,204	94.62	303,162.48	
ADVANCED MICRO DEVICES	7,888	546.72	4,312,527.36	
ANALOG DEVICES	2,344	393.64	922,692.16	
APPLIED MATERIALS	3,840	588.66	2,260,454.40	
FIRST SOLAR INC	463	228.50	105,795.50	

	LAM RESEARCH CORP	6,013	353.17	2,123,611.21	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	4,125	243.27	1,003,488.75	
	NVIDIA CORP	111,686	202.78	22,647,687.08	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	1,222	290.54	355,039.88	
	CBRE GROUP INC-A	1,460	141.06	205,947.60	
アメリカドル 小計		861,161		162,000,368.73 (26,266,739,785)	
カナダドル	CAMECO CORP	2,122	135.79	288,146.38	
	ENBRIDGE	10,636	77.33	822,481.88	
	IMPERIAL OIL	693	170.32	118,031.76	
	KEYERA CORP	1,319	58.25	76,831.75	
	PEMBINA PIPELINE CORP	2,788	67.93	189,388.84	
	AGNICO EAGLE MINES	2,378	211.29	502,447.62	
	KINROSS GOLD CORP	5,857	34.30	200,895.10	
	LUNDIN MINING CORP	3,677	34.49	126,819.73	
	NUTRIEN LTD	2,254	91.50	206,241.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	2,197	156.83	344,555.51	
	ATKINSREALIS GROUP INC	792	87.83	69,561.36	
	CAE INC	1,167	36.57	42,677.19	
	WSP GLOBAL INC	648	171.29	110,995.92	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	1,892	29.80	56,381.60	
	RB GLOBAL INC	871	157.77	137,417.67	
	THOMSON REUTERS CORP	599	125.66	75,270.34	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,441	176.10	429,860.10	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	851	72.20	61,442.20	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	267	189.87	50,695.29	
	DOLLARAMA INC	1,353	183.43	248,180.79	
	LOBLAW COMPANIES LTD	2,914	63.39	184,718.46	
	METRO INC	904	91.56	82,770.24	
	WESTON (GEORGE) LTD	750	99.42	74,565.00	
	BANK MONTREAL	3,305	250.61	828,266.05	
	BANK NOVA SCOTIA	5,917	121.90	721,282.30	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	4,443	163.53	726,563.79	
	NATIONAL BANK OF CANADA	1,928	224.95	433,703.60	
	TORONTO-DOMINION BANK	8,088	169.69	1,372,452.72	
	TMX GROUP LTD	1,340	47.88	64,159.20	
	INTACT FINANCIAL CORP	903	297.07	268,254.21	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	2,610	113.81	297,044.10	
	CGI INC - CL A	921	94.70	87,218.70	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	416	101.68	42,298.88	
	SHOPIFY INC - CLASS A	5,853	174.45	1,021,055.85	
	CELESTICA INC	556	502.54	279,412.24	

	BCE INC	1,502	30.21	45,375.42	
	TELUS CORP	1,700	14.76	25,092.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	669	50.40	33,717.60	
	FORTIS INC	2,364	80.94	191,342.16	
	HYDRO ONE LTD	1,760	58.41	102,801.60	
	FIRSTSERVICE CORP	180	202.27	36,408.60	
カナダドル 小計		93,825		11,076,824.75 (1,267,964,129)	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	2,191	19.60	42,943.60	
	NESTE OIL OYJ	1,709	29.10	49,731.90	
	OMV AG	668	59.00	39,412.00	
	REPSOL SA	4,629	23.23	107,531.67	
	TOTALENERGIES SE	9,507	68.82	654,271.74	
	AIR LIQUIDE	3,065	172.96	530,122.40	
	AKZO NOBEL	827	57.10	47,221.70	
	DSM-FIRMENICH AG	783	84.00	65,772.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,987	16.39	32,566.93	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	638	166.45	106,195.10	
	STORA ENSO OYJ R	3,708	9.26	34,336.08	
	SYENSQO SA	293	65.60	19,220.80	
	SYMRISE AG	635	88.54	56,222.90	
	UPM KYMMENE OYJ	2,489	22.85	56,873.65	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	734	120.60	88,520.40	
	ACS ACTIVIDADES DE CONST RTS	734	1.73	1,271.28	
	BOUYGUES ORD	976	46.70	45,579.20	
	EIFFAGE	297	121.10	35,966.70	
	FERROVIAL NV	2,164	56.64	122,568.96	
	GEA GROUP AG	897	59.75	53,595.75	
	HOCHTIEF AG	71	466.20	33,100.20	
	KINGSPAN GROUP PLC	542	78.75	42,682.50	
	KNORR-BREMSE AG	220	102.00	22,440.00	
	KONE OYJ-B	1,317	49.23	64,835.91	
	LEGRAND SA	1,179	141.35	166,651.65	
	METSO CORPORATION	2,473	15.10	37,342.30	
	MTU AERO ENGINES AG	306	362.00	110,772.00	
	PRYSMIAN SPA	1,422	136.55	194,174.10	
	REXEL SA	1,226	37.94	46,514.44	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,625	270.00	708,750.00	
	BUREAU VERITAS SA	1,600	26.96	43,136.00	
	VERISURE PLC	1,390	10.34	14,379.55	
	WOLTERS KLUWER	1,075	59.92	64,414.00	
	ADP	211	108.80	22,956.80	

AENA SME SA	4,273	26.82	114,601.86	
AYVENS SA	1,612	11.79	19,005.48	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,004	9.38	9,417.52	
GETLINK	1,366	18.60	25,407.60	
INPOST SA	967	15.42	14,911.14	
MICHELIN	3,081	34.25	105,524.25	
ADIDAS AG	689	181.55	125,087.95	
HERMES INTERNATIONAL	125	1,624.50	203,062.50	
KERING	338	245.80	83,080.40	
LVMH	1,193	492.95	588,089.35	
MONCLER SPA	786	49.60	38,985.60	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	2,419	50.08	121,143.52	
PUBLICIS GROUPE	1,071	85.64	91,720.44	
SCOUT24 SE	520	72.95	37,934.00	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	4,892	18.74	91,700.54	
D'IETEREN GROUP	104	170.80	17,763.20	
PROSUS	6,467	39.67	256,578.22	
ZALANDO SE	729	27.05	19,719.45	
CARREFOUR	3,038	16.33	49,625.73	
JERONIMO MARTINS	1,323	16.47	21,789.81	
KESKO OYJ-B SHS	1,816	19.24	34,939.84	
KONINKLIJKE AHOLD NV	4,159	35.76	148,725.84	
DANONE (GROUPE)	3,166	72.42	229,281.72	
KERRY GROUP PLC-A	877	82.20	72,089.40	
LOTUS BAKERIES	2	11,320.00	22,640.00	
MAGNUM ICE CREAM CO NV/THE	2,370	15.92	37,744.62	
BEIERSDORF AG	599	76.72	45,955.28	
HENKEL AG & CO KGAA	374	70.20	26,254.80	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	900	74.12	66,708.00	
LOREAL	1,173	379.65	445,329.45	
ESSILORLUXOTTICA	1,442	171.65	247,519.30	
EUROFINS SCIENTIFIC	631	68.80	43,412.80	
IPSEN	162	168.80	27,345.60	
MERCK KGAA	528	139.60	73,708.80	
ORION OYJ-CLASS B	530	70.55	37,391.50	
QIAGEN N.V.	1,496	36.67	54,858.32	
SARTORIUS AG-VORZUG	63	233.30	14,697.90	
UCB (GROUPE)	588	250.00	147,000.00	
AIB GROUP PLC	10,258	10.39	106,580.62	
BANCO DE SABADELL SA	27,931	3.17	88,764.71	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	4,599	17.68	81,333.31	
BAWAG GROUP AG	354	176.40	62,445.60	

	BNP PARIBAS	4,858	99.82	484,925.56	
	CAIXABANK	16,992	12.55	213,249.60	
	CREDIT AGRICOLE SA	4,373	17.42	76,199.52	
	ING GROEP NV-CVA	14,328	28.43	407,345.04	
	INTESA SANPAOLO	69,591	6.18	430,698.69	
	KBC GROEP NV	1,090	119.45	130,200.50	
	SOCIETE GENERALE	2,999	73.21	219,556.79	
	DEUTSCHE BOERSE	855	251.80	215,289.00	
	AEGON LTD	5,898	7.70	45,414.60	
	AGEAS	708	71.00	50,268.00	
	ALLIANZ SE-REG	1,840	422.70	777,768.00	
	AXA SA	7,445	44.30	329,813.50	
	GENERALI	3,836	42.20	161,879.20	
	MUENCHENER RUECKVERSICH.	662	499.80	330,867.60	
	NN GROUP NV	1,220	76.44	93,256.80	
	SAMPO OYJ-A SHS	13,139	9.62	126,397.18	
	DASSAULT SYSTEMES SA	3,590	18.21	65,373.90	
	NOKIA OYJ	24,308	11.20	272,249.60	
	CELLNEX TELECOM SA	2,855	24.71	70,547.05	
	ELISA A	901	35.72	32,183.72	
	KPN (KON.)	17,777	4.22	75,125.60	
	ACCIONA SA	119	250.60	29,821.40	
	EDP SA	12,698	4.43	56,353.72	
	ELIA GROUP SA/NV	254	135.40	34,391.60	
	ENDESA	1,157	38.83	44,926.31	
	IBERDROLA SA	29,425	21.06	619,690.50	
	IBERDROLA SA -RTS	29,425	0.42	12,358.50	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	1,990	28.24	56,197.60	
	REDEIA CORP SA	1,155	15.22	17,579.10	
	TERNA SPA	6,807	10.19	69,397.36	
	VERBUND AG	301	57.05	17,172.05	
	ASML HOLDING NV	1,878	1,602.80	3,010,058.40	
	VONOVIA SE	2,754	21.41	58,963.14	
ユーロ 小計		441,831		16,547,469.31 (3,069,059,132)	
イギリスポンド	ANGLO AMERICAN PLC	4,864	35.78	174,033.92	
	ANTOFAGASTA PLC	1,590	37.16	59,084.40	
	ENDEAVOUR MINING PLC	1,032	37.09	38,276.88	
	BUNZL PLC	1,324	26.48	35,059.52	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	8,304	4.75	39,460.60	
	SMITHS GROUP PLC	1,063	24.93	26,500.59	
	SPIRAX GROUP PLC	179	63.95	11,447.05	

	SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC	2,220	53.40	118,548.00	
	INTERTEK GROUP PLC	637	58.10	37,009.70	
	RELX PLC	9,125	23.75	216,718.75	
	RENTOKIL INITIAL PLC	13,820	4.49	62,079.44	
	PEARSON	1,043	12.63	13,173.09	
	INFORMA PLC	4,506	8.84	39,833.04	
	KINGFISHER PLC	11,202	2.72	30,547.85	
	SAINSBURY (J) PLC	4,120	3.37	13,917.36	
	TESCO PLC	33,401	4.67	156,149.67	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	2,067	19.57	40,451.19	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	1,284	48.92	62,813.28	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3,283	49.97	164,051.51	
	UNILEVER PLC	10,826	45.51	492,691.26	
	ASTRAZENECA	7,316	133.54	976,978.64	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	83,231	14.56	1,212,176.28	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	274,329	1.11	306,425.49	
	3I GROUP PLC	4,339	26.58	115,330.62	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	2,157	87.68	189,125.76	
	SCHRODERS PLC	4,736	5.86	27,776.64	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,016	36.74	37,327.84	
	AVIVA PLC	12,969	6.58	85,387.89	
	LEGAL & GENERAL GROUP	22,823	2.90	66,209.52	
	STANDARD LIFE PLC	2,284	8.69	19,847.96	
	AIRTEL AFRICA PLC	4,162	3.21	13,384.99	
	BT GROUP PLC	21,804	1.87	40,773.48	
	VODAFONE GROUP PLC	97,169	0.97	94,992.41	
	NATIONAL GRID PLC	25,060	12.30	308,238.00	
	SSE PLC	6,203	24.17	149,926.51	
イギリスポンド 小計		685,488		5,475,749.13 (1,191,632,525)	
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	41	3,419.00	140,179.00	
	SIKA AG-BR	804	161.15	129,564.60	
	ABB LTD	7,680	84.68	650,342.40	
	BELIMO HOLDING AG-REG	48	812.50	39,000.00	
	GEBERIT AG-REG	146	516.60	75,423.60	
	VAT GROUP AG	144	677.80	97,603.20	
	SGS SA	946	94.10	89,018.60	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	286	204.40	58,458.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	17	1,135.00	19,295.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	9	9,345.00	84,105.00	
	ALCON INC	2,147	54.04	116,023.88	
	SONOVA HOLDING AG-REG	167	202.20	33,767.40	

	STRAUMANN HOLDING AG-REG	540	103.65	55,971.00	
	GALDERMA GROUP AG	892	174.40	155,564.80	
	LONZA GROUP AG-REG	337	582.60	196,336.20	
	NOVARTIS	8,860	124.30	1,101,298.00	
	HELVETIA BALOISE HOLDING AG	373	213.40	79,598.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	124	927.60	115,022.40	
	SWISS RE LTD	1,340	131.15	175,741.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	738	612.60	452,098.80	
	SWISSCOM	137	611.00	83,707.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	461	130.10	59,976.10	
スイスフラン 小計		26,237		4,008,094.58 (806,308,386)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	1,577	522.00	823,194.00	
	SCA SV CELLULOSA B	1,498	98.26	147,193.48	
	ADDTECH AB-B SHARES	939	325.40	305,550.60	
	ALFA LAVAL AB	1,194	560.20	668,878.80	
	ASSA ABLOY AB-B	4,731	333.10	1,575,896.10	
	ATLAS COPCO A	12,172	190.80	2,322,417.60	
	ATLAS COPCO B	6,148	166.80	1,025,486.40	
	BEIJER REF AB	1,979	136.90	270,925.10	
	EPIROC AB-A	3,610	255.60	922,716.00	
	EPIROC AB-B	2,470	217.40	536,978.00	
	INDUTRADE AB	629	208.80	131,335.20	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,839	34.48	166,848.72	
	SANDVIK AB	5,422	389.00	2,109,158.00	
	SKANSKA B	2,071	255.70	529,554.70	
	SKF AB-B	2,356	257.60	606,905.60	
	VOLVO B	7,188	334.40	2,403,667.20	
	SECURITAS B	2,682	162.70	436,361.40	
	EVOLUTION AB	371	682.00	253,022.00	
	HENNES & MAURITZ B	3,085	165.10	509,333.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	2,126	277.20	589,327.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	865	478.80	414,162.00	
	EQT AB	1,644	279.20	459,004.80	
	TELE2 AB-B SHS	3,468	166.20	576,381.60	
	TELIA CO AB	11,552	45.26	522,843.52	
スウェーデンクローナ 小計		84,616		18,307,141.52 (307,376,906)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	1,123	309.00	347,007.00	
	EQUINOR ASA	3,349	333.80	1,117,896.20	
	NORSK HYDRO	7,409	84.84	628,579.56	
	MOWI ASA	1,564	183.80	287,463.20	

	ORKLA	4,299	105.50	453,544.50	
	SALMAR ASA	328	463.00	151,864.00	
	DNB BANK ASA	3,354	298.40	1,000,833.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1,575	272.00	428,400.00	
	TELENOR ASA	4,080	144.20	588,336.00	
ノルウェークローネ 小計		27,081		5,003,924.06 (83,615,571)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	1,500	422.40	633,600.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	500	203.00	101,500.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	4,655	180.30	839,296.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	12	15,510.00	186,120.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	18	15,900.00	286,200.00	
	DSV A/S	954	1,660.00	1,583,640.00	
	PANDORA A/S	377	781.00	294,437.00	
	COLOPLAST-B	598	400.50	239,499.00	
	DEMANT A/S	496	271.60	134,713.60	
	GENMAB A/S	287	1,930.00	553,910.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	15,496	320.15	4,961,044.40	
	ORSTED A/S	2,141	147.85	316,546.85	
デンマーククローネ 小計		27,034		10,130,507.35 (251,337,887)	
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	8,597	29.30	251,892.10	
	EVOLUTION MINING LTD	7,796	11.25	87,705.00	
	FORTESCUE LTD	6,688	18.11	121,119.68	
	LYNAS RARE EARTHS LTD	3,356	16.86	56,582.16	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	7,569	20.13	152,363.97	
	PLS GROUP LTD	15,198	4.61	70,062.78	
	SOUTH32 LTD	25,524	3.82	97,501.68	
	BRAMBLES LTD	7,725	19.25	148,706.25	
	COMPUTERSHARE LIMITED	3,139	39.43	123,770.77	
	TRANSURBAN GROUP	14,099	14.69	207,114.31	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	3,032	62.40	189,196.80	
	CAR GROUP LTD	929	26.17	24,311.93	
	REA GROUP LTD	121	148.35	17,950.35	
	COLES GROUP LTD	7,387	23.67	174,850.29	
	COCHLEAR LIMITED	563	123.68	69,631.84	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	25,132	2.87	72,128.84	
	SONIC HEALTHCARE LTD	2,212	21.36	47,248.32	
	CSL LIMITED	2,163	125.53	271,521.39	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	8,096	168.11	1,361,018.56	
	ASX LTD	571	54.21	30,953.91	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	1,742	252.20	439,332.40	

	QBE INSURANCE GROUP	7,231	25.58	184,968.98	
	SUNCORP GROUP LTD	6,512	18.90	123,076.80	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,533	34.63	53,087.79	
	XERO LTD	755	74.34	56,126.70	
オーストラリアドル 小計		167,670		4,432,223.60 (499,024,055)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	5,166	8.85	45,719.10	
	CONTACT ENERGY LTD	8,825	9.20	81,190.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	2,111	5.67	11,969.37	
ニュージーランドドル 小計		16,102		138,878.47 (12,994,858)	
香港ドル	SWIRE PACIFIC A	1,500	82.85	124,275.00	
	MTR CORP	7,000	31.08	217,560.00	
	WH GROUP LTD	27,500	7.76	213,400.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	18,000	45.34	816,120.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	5,900	380.40	2,244,360.00	
	AIA GROUP LTD	51,600	72.30	3,730,680.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	3,000	60.05	180,150.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	53,000	6.58	348,740.00	
	SINO LAND CO	16,000	10.19	163,040.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	6,500	115.20	748,800.00	
香港ドル 小計		190,000		8,787,125.00 (181,805,616)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	6,500	10.89	70,785.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	4,900	24.62	120,638.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	7,200	5.60	40,320.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	6,600	2.49	16,434.00	
シンガポールドル 小計		25,200		248,177.00 (31,148,695)	
イスラエルシェケル	BANK HAPOALIM BM	6,338	70.22	445,054.36	
イスラエルシェケル 小計		6,338		445,054.36 (23,892,965)	
合　計		2,652,583		33,992,900,510 (33,992,900,510)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	7,930	78,824.20	
	オーストラリアドル 小計		7,930	78,824.20 (8,874,816)	
投資信託受益証券合計			7,930	8,874,816 (8,874,816)	

投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	2,289	377,685.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	3,340	75,918.20	
		CROWN CASTLE INC	2,170	166,395.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,620	290,514.60	
		EQUINIX INC	476	492,598.12	
		IRON MOUNTAIN INC	1,463	174,799.24	
		PROLOGIS INC	4,490	634,706.40	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	483	88,137.84	
		WELLTOWER INC	3,409	791,297.08	
	アメリカドル 小計		19,740	3,092,052.08 (501,345,324)	
	イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	4,441	29,221.78	
		SEGRO PLC	5,022	43,631.13	
	イギリスポンド 小計		9,463	72,852.91 (15,854,250)	
	オーストラリアドル	STOCKLAND	11,719	46,172.86	
		VICINITY CENTERS	19,083	49,615.80	
	オーストラリアドル 小計		30,802	95,788.66 (10,784,845)	
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	19,300	48,057.00	
	シンガポールドル 小計		19,300	48,057.00 (6,031,634)	
投資証券合計			79,305	534,016,053 (534,016,053)	
合計				542,890,869 (542,890,869)	

(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　261銘柄	98.1%	—	—	76.1%
	投資証券　9銘柄	—	—	1.9%	1.5%
カナダドル	株式　41銘柄	100.0%	—	—	3.7%
ユーロ	株式　109銘柄	100.0%	—	—	8.9%
イギリスポンド	株式　35銘柄	98.7%	—	—	3.5%
	投資証券　2銘柄	—	—	1.3%	0.0%
スイスフラン	株式　22銘柄	100.0%	—	—	2.3%
スウェーデンクローナ	株式　24銘柄	100.0%	—	—	0.9%

ノルウェークローネ	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.7%
オーストラリアドル	株式　25銘柄	96.2%	—	—	1.4%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	1.7%	—	0.0%
	投資証券　2銘柄	—	—	2.1%	0.0%
ニュージーランドドル	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式　10銘柄	100.0%	—	—	0.5%
シンガポールドル	株式　4銘柄	83.8%	—	—	0.1%
	投資証券　1銘柄	—	—	16.2%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　1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。

世界債券総合インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	420,822,966
コール・ローン	1,349,639,727
国債証券	48,358,353,876
地方債証券	2,390,434,990
特殊債券	9,592,757,319
社債券	20,391,889,991
投資信託受益証券	10,357,803,217
派生商品評価勘定	17,051,651
未収利息	780,960,941
前払金	2,710,698
前払費用	87,932,981
差入委託証拠金	79,888,194
流動資産合計	93,830,246,551
資産合計	93,830,246,551
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,864,321
未払金	892,253,371
未払解約金	106,119,308
流動負債合計	1,007,237,000
負債合計	1,007,237,000
純資産の部	
元本等	
元本	68,108,644,858
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	24,714,364,693
元本等合計	92,823,009,551

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
純資産合計	92,823,009,551
負債純資産合計	93,830,246,551

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		68,108,644,858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	1.3629円
	(1万口当たり純資産額)	(13,629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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2026年 7月10日現在
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

	2026年 7月10日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	113,163,718,012円
期中追加設定元本額	12,030,915,049円
期中一部解約元本額	57,085,988,203円
期末元本額	68,108,644,858円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	909,768,361円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,199,098,763円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,246,714,540円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	61,200,669,145円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	547,766,407円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	155,171,539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）	259,350,586円
ＦＯＦｓ用　世界債券総合インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	590,105,517円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△316,701,755
地方債証券	△5,709,039
特殊債券	△13,869,232
社債券	△149,282,188
投資信託受益証券	△152,064,252
合計	△637,626,466

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	402,470,928	－	399,760,230	△2,710,698
合計		402,470,928	－	399,760,230	△2,710,698

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,131,963,455	－	3,145,847,142	13,883,687
	アメリカドル	1,546,964,163	－	1,555,158,097	8,193,934
	カナダドル	104,667,804	－	104,698,025	30,221
	ユーロ	846,268,788	－	848,939,138	2,670,350
	イギリスポンド	164,182,342	－	165,700,913	1,518,571
	オーストラリアドル	62,027,433	－	62,202,955	175,522
	オフショア人民元	407,852,925	－	409,148,014	1,295,089
	売建	1,927,662,767	－	1,930,648,426	△2,985,659
	アメリカドル	986,000,229	－	988,670,310	△2,670,081
	カナダドル	64,122,260	－	64,090,544	31,716
	ユーロ	508,311,939	－	508,086,146	225,793
	イギリスポンド	90,866,082	－	91,364,490	△498,408

	オーストラリアドル	33,771,796	－	33,760,560	11,236
	オフショア人民元	244,590,461	－	244,676,376	△85,915
合計		5,059,626,222	－	5,076,495,568	10,898,028

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	ADGB 1.625% 06/02/28	200,000.00	189,354.15	
		ADGB 4.25% 10/02/35	200,000.00	190,773.02	
		BGARIA 5% 03/05/37	200,000.00	193,296.82	
		CHILE 4.85% 01/22/29	200,000.00	201,200.00	
		CHINA 3.5% 10/19/28	200,000.00	198,414.82	
		CHINA 3.75% 11/13/30	200,000.00	198,088.35	
		HKINTL 4.625% 01/11/33	200,000.00	201,302.12	
		INDON 4.3% 03/31/52	200,000.00	156,446.41	
		INDON 4.35% 01/11/48	200,000.00	161,049.36	
		INDON 5.6% 01/15/35	200,000.00	202,462.60	
		ISRAEL 4.5% 01/17/33	200,000.00	191,943.83	
		ITALY 3.875% 05/06/51	200,000.00	145,559.75	
		KOREA 2.5% 06/19/29	200,000.00	190,281.71	
		KSA 2.75% 02/03/32	200,000.00	178,747.20	
		KSA 3.25% 10/22/30	200,000.00	187,492.95	
		KSA 4.5% 10/26/46	200,000.00	163,715.31	
		KSA 4.875% 07/18/33	200,000.00	197,430.08	
		KSA 5% 01/18/53	200,000.00	170,259.98	
		MEX 3.25% 04/16/30	200,000.00	186,115.00	
		MEX 3.75% 04/19/71	200,000.00	112,800.00	
		MEX 4.28% 08/14/41	200,000.00	155,100.00	
		MEX 4.4% 02/12/52	200,000.00	141,350.00	
		MEX 6.4% 05/07/54	200,000.00	185,350.00	
		PANAMA 2.252% 09/29/32	200,000.00	167,100.00	
		PANAMA 6.4% 02/14/35	200,000.00	210,200.00	
		PARGUY 6% 02/09/36	200,000.00	206,530.00	

		PERU 3.3% 03/11/41	200,000.00	153,550.00	
		PHILIP 4.2% 03/29/47	200,000.00	159,326.35	
		PHILIP 5.17% 10/13/27	200,000.00	202,286.90	
		POLAND 4.625% 03/18/29	200,000.00	201,132.97	
		QATAR 3.75% 04/16/30	200,000.00	194,177.79	
		QATAR 4.817% 03/14/49	200,000.00	180,169.14	
		REPHUN 5.5% 03/26/36	200,000.00	199,243.83	
		T 0.5% 10/31/27	1,000,000.00	953,867.19	
		T 0.625% 05/15/30	1,000,000.00	872,539.06	
		T 0.625% 08/15/30	730,000.00	631,193.36	
		T 0.625% 11/30/27	1,200,000.00	1,143,281.25	
		T 0.625% 12/31/27	400,000.00	379,968.75	
		T 0.75% 01/31/28	1,000,000.00	948,789.06	
		T 0.875% 11/15/30	400,000.00	346,710.93	
		T 1.125% 02/15/31	1,000,000.00	870,605.47	
		T 1.125% 02/29/28	1,000,000.00	952,148.44	
		T 1.125% 05/15/40	100,000.00	62,375.00	
		T 1.125% 08/15/40	100,000.00	61,730.46	
		T 1.25% 03/31/28	1,000,000.00	951,757.81	
		T 1.25% 04/30/28	1,150,000.00	1,091,938.47	
		T 1.25% 05/15/50	400,000.00	186,148.43	
		T 1.25% 05/31/28	1,050,000.00	994,526.36	
		T 1.25% 08/15/31	750,000.00	646,303.71	
		T 1.25% 09/30/28	1,250,000.00	1,172,631.83	
		T 1.375% 08/15/50	350,000.00	167,897.45	
		T 1.375% 10/31/28	1,600,000.00	1,501,531.24	
		T 1.375% 11/15/31	550,000.00	473,386.71	
		T 1.375% 11/15/40	500,000.00	318,564.45	
		T 1.375% 12/31/28	1,000,000.00	934,238.28	
		T 1.5% 02/15/30	500,000.00	454,941.40	
		T 1.625% 11/15/50	300,000.00	153,457.03	
		T 1.75% 01/31/29	1,900,000.00	1,787,669.92	
		T 1.75% 08/15/41	400,000.00	264,015.62	
		T 1.875% 02/15/32	230,000.00	202,161.91	
		T 1.875% 02/15/41	100,000.00	68,392.57	
		T 1.875% 02/15/51	300,000.00	163,183.59	
		T 1.875% 02/28/29	1,000,000.00	942,402.34	
		T 1.875% 11/15/51	100,000.00	53,755.85	
		T 1% 07/31/28	970,000.00	909,659.18	
		T 2.25% 02/15/52	500,000.00	294,667.97	
		T 2.25% 05/15/41	260,000.00	186,839.45	
		T 2.25% 08/15/46	300,000.00	192,117.18	

		T 2.25% 08/15/49	500,000.00	304,785.15	
		T 2.375% 02/15/42	100,000.00	71,826.17	
		T 2.375% 03/31/29	1,310,000.00	1,248,696.08	
		T 2.375% 05/15/29	350,000.00	333,012.69	
		T 2.375% 05/15/51	450,000.00	275,625.00	
		T 2.375% 11/15/49	450,000.00	280,968.75	
		T 2.5% 02/15/45	200,000.00	137,804.68	
		T 2.5% 02/15/46	100,000.00	67,722.65	
		T 2.5% 05/15/46	100,000.00	67,451.17	
		T 2.625% 02/15/29	1,500,000.00	1,442,314.45	
		T 2.75% 05/31/29	1,620,000.00	1,556,244.13	
		T 2.75% 08/15/32	1,000,000.00	914,414.06	
		T 2.75% 08/15/42	200,000.00	150,484.37	
		T 2.75% 08/15/47	500,000.00	347,167.97	
		T 2.75% 11/15/42	100,000.00	74,812.50	
		T 2.875% 05/15/32	800,000.00	739,734.37	
		T 2.875% 05/15/43	300,000.00	226,593.75	
		T 2.875% 05/15/49	200,000.00	139,320.31	
		T 2.875% 05/15/52	600,000.00	406,757.81	
		T 2.875% 08/15/28	400,000.00	389,539.06	
		T 2.875% 08/15/45	220,000.00	160,453.90	
		T 2.875% 11/15/46	100,000.00	71,750.00	
		T 2% 02/15/50	500,000.00	285,439.45	
		T 2% 08/15/51	500,000.00	278,662.11	
		T 2% 11/15/41	350,000.00	238,792.96	
		T 3.125% 02/15/42	200,000.00	160,250.00	
		T 3.125% 02/15/43	300,000.00	236,156.25	
		T 3.125% 05/15/48	500,000.00	368,789.06	
		T 3.125% 08/15/44	250,000.00	192,402.34	
		T 3.125% 08/31/27	1,000,000.00	988,906.25	
		T 3.125% 08/31/29	1,000,000.00	968,144.53	
		T 3.125% 11/15/28	1,500,000.00	1,464,404.29	
		T 3.125% 11/15/41	100,000.00	80,511.71	
		T 3.25% 05/15/42	720,000.00	584,100.00	
		T 3.375% 05/15/33	150,000.00	140,941.40	
		T 3.375% 05/15/44	300,000.00	240,714.84	
		T 3.375% 08/15/42	400,000.00	328,703.12	
		T 3.375% 11/15/48	450,000.00	345,498.04	
		T 3.5% 02/15/33	950,000.00	901,906.25	
		T 3.5% 03/15/29	1,000,000.00	982,382.81	
		T 3.5% 10/15/28	1,400,000.00	1,379,000.00	
		T 3.5% 10/31/27	2,000,000.00	1,983,437.50	
		T 3.5% 11/30/30	400,000.00	387,812.50	

		T 3.625% 02/15/44	100,000.00	83,398.43	
		T 3.625% 02/15/53	220,000.00	172,472.26	
		T 3.625% 03/31/30	1,000,000.00	978,828.12	
		T 3.625% 05/15/53	400,000.00	313,343.75	
		T 3.625% 08/15/43	350,000.00	293,617.18	
		T 3.625% 08/31/29	500,000.00	491,318.36	
		T 3.625% 09/30/30	1,000,000.00	975,664.06	
		T 3.625% 10/31/30	2,650,000.00	2,583,698.24	
		T 3.75% 04/15/28	2,100,000.00	2,084,578.12	
		T 3.75% 06/30/30	1,150,000.00	1,128,954.10	
		T 3.75% 08/15/41	250,000.00	219,208.98	
		T 3.75% 08/31/31	1,200,000.00	1,169,835.93	
		T 3.75% 10/31/32	500,000.00	482,968.75	
		T 3.75% 11/15/43	100,000.00	85,109.37	
		T 3.875% 02/15/43	600,000.00	523,664.06	
		T 3.875% 03/31/31	1,000,000.00	982,890.62	
		T 3.875% 04/30/30	750,000.00	740,375.97	
		T 3.875% 04/30/31	1,600,000.00	1,572,124.99	
		T 3.875% 05/15/43	600,000.00	522,304.68	
		T 3.875% 06/15/28	2,750,000.00	2,734,423.83	
		T 3.875% 06/30/30	750,000.00	739,775.39	
		T 3.875% 08/15/34	1,000,000.00	959,707.03	
		T 3.875% 08/15/40	100,000.00	90,093.75	
		T 3.875% 08/31/32	400,000.00	389,625.00	
		T 3.875% 09/30/32	500,000.00	486,699.22	
		T 3.875% 12/31/29	1,150,000.00	1,136,837.89	
		T 3% 02/15/49	500,000.00	357,714.84	
		T 3% 05/15/42	100,000.00	78,433.59	
		T 3% 05/15/45	170,000.00	127,114.84	
		T 3% 05/15/47	220,000.00	160,376.56	
		T 3% 08/15/48	400,000.00	287,609.37	
		T 3% 08/15/52	100,000.00	69,492.18	
		T 3% 11/15/44	100,000.00	75,199.21	
		T 3% 11/15/45	200,000.00	148,453.12	
		T 4.125% 02/15/36	800,000.00	774,250.00	
		T 4.125% 03/31/29	2,080,000.00	2,075,571.86	
		T 4.125% 03/31/32	1,500,000.00	1,484,267.58	
		T 4.125% 04/30/33	450,000.00	442,757.81	
		T 4.125% 06/30/31	1,000,000.00	993,085.94	
		T 4.125% 07/31/31	1,400,000.00	1,389,472.65	
		T 4.125% 08/15/44	720,000.00	640,842.17	
		T 4.125% 08/15/53	790,000.00	676,730.66	

		T 4.125% 09/30/27	1,020,000.00	1,019,840.62	
		T 4.125% 10/31/27	1,900,000.00	1,899,332.03	
		T 4.125% 10/31/29	1,100,000.00	1,096,519.53	
		T 4.125% 11/15/27	870,000.00	869,575.19	
		T 4.125% 11/15/32	1,100,000.00	1,085,175.78	
		T 4.125% 11/30/31	750,000.00	743,247.06	
		T 4.25% 02/15/54	1,100,000.00	962,478.51	
		T 4.25% 02/28/29	1,000,000.00	1,001,210.94	
		T 4.25% 02/28/31	1,100,000.00	1,098,839.84	
		T 4.25% 05/15/35	1,500,000.00	1,471,845.70	
		T 4.25% 05/15/39	100,000.00	95,511.71	
		T 4.25% 05/31/33	500,000.00	495,546.87	
		T 4.25% 08/15/35	1,000,000.00	980,000.00	
		T 4.25% 08/15/54	380,000.00	332,574.21	
		T 4.25% 11/15/34	750,000.00	737,709.96	
		T 4.25% 11/15/40	100,000.00	93,691.40	
		T 4.375% 01/31/32	700,000.00	701,750.00	
		T 4.375% 05/15/34	700,000.00	696,144.53	
		T 4.375% 05/15/36	500,000.00	493,164.06	
		T 4.375% 05/15/41	230,000.00	217,538.67	
		T 4.375% 08/15/43	100,000.00	92,634.76	
		T 4.375% 11/30/30	1,000,000.00	1,004,101.56	
		T 4.375% 12/31/29	1,280,000.00	1,285,950.00	
		T 4.5% 02/15/36	670,000.00	672,957.42	
		T 4.5% 02/15/44	450,000.00	421,998.04	
		T 4.5% 05/31/29	1,100,000.00	1,108,486.32	
		T 4.5% 11/15/33	500,000.00	502,177.73	
		T 4.5% 11/15/54	800,000.00	729,984.37	
		T 4.625% 02/15/35	1,600,000.00	1,614,593.74	
		T 4.625% 02/15/46	200,000.00	188,921.87	
		T 4.625% 02/15/55	1,100,000.00	1,024,890.62	
		T 4.625% 05/15/44	900,000.00	856,195.30	
		T 4.625% 05/15/54	500,000.00	465,732.42	
		T 4.625% 05/31/31	830,000.00	842,174.41	
		T 4.625% 11/15/44	500,000.00	474,355.47	
		T 4.625% 11/15/45	700,000.00	661,718.75	
		T 4.625% 11/15/55	500,000.00	466,250.00	
		T 4.75% 02/15/41	200,000.00	197,562.50	
		T 4.75% 02/15/45	400,000.00	385,187.50	
		T 4.75% 02/15/56	600,000.00	571,406.25	
		T 4.75% 05/15/55	500,000.00	475,371.09	
		T 4.75% 08/15/55	600,000.00	570,726.56	
		T 4.75% 11/15/43	100,000.00	96,898.43	

		T 4.75% 11/15/53	900,000.00	854,208.98	
		T 4.875% 08/15/45	400,000.00	390,742.18	
		T 4% 01/31/33	700,000.00	684,769.53	
		T 4% 02/15/34	700,000.00	679,970.70	
		T 4% 02/28/30	2,000,000.00	1,984,296.88	
		T 4% 03/31/30	1,600,000.00	1,586,843.74	
		T 4% 04/30/32	1,000,000.00	982,812.50	
		T 4% 06/30/28	2,200,000.00	2,192,523.43	
		T 4% 07/31/29	500,000.00	496,972.65	
		T 4% 10/31/29	900,000.00	893,742.19	
		T 4% 11/15/35	610,000.00	585,504.68	
		T 4% 11/15/42	200,000.00	177,839.84	
		T 4% 11/15/52	140,000.00	117,485.15	
		T 5.0% 05/15/37	100,000.00	104,041.01	
		T 5% 05/15/45	400,000.00	397,187.50	
		T 5% 05/15/56	420,000.00	416,128.11	
		URUGUA 4.375% 10/27/27	66,666.66	66,793.32	
	アメリカドル 小計		133,676,666.66	124,388,807.16 (20,168,401,192)	
	カナダドル	CAN 0.5% 12/01/30	350,000.00	313,178.91	
		CAN 1.25% 06/01/30	470,000.00	439,047.33	
		CAN 1.5% 06/01/31	260,000.00	240,806.06	
		CAN 1.5% 12/01/31	110,000.00	100,893.91	
		CAN 1.75% 12/01/53	330,000.00	209,592.83	
		CAN 2.25% 06/01/29	200,000.00	196,446.05	
		CAN 2.25% 12/01/29	420,000.00	410,128.50	
		CAN 2.5% 05/01/28	110,000.00	109,423.43	
		CAN 2.5% 11/01/27	150,000.00	149,648.90	
		CAN 2.5% 12/01/32	400,000.00	382,564.78	
		CAN 2.75% 03/01/30	390,000.00	386,182.66	
		CAN 2.75% 03/01/31	500,000.00	492,030.17	
		CAN 2.75% 06/01/33	190,000.00	183,611.80	
		CAN 2.75% 09/01/27	100,000.00	100,133.36	
		CAN 2.75% 09/01/30	370,000.00	365,223.89	
		CAN 2.75% 12/01/48	180,000.00	150,016.96	
		CAN 2.75% 12/01/55	350,000.00	278,081.71	
		CAN 2% 06/01/28	60,000.00	59,129.37	
		CAN 2% 06/01/32	270,000.00	252,404.35	
		CAN 2% 12/01/51	300,000.00	207,538.02	
		CAN 3.25% 06/01/35	200,000.00	197,058.81	
		CAN 3.25% 06/01/36	250,000.00	244,426.73	
		CAN 3.25% 09/01/28	50,000.00	50,417.08	

		CAN 3.25% 12/01/33	200,000.00	198,866.83	
		CAN 3.25% 12/01/34	350,000.00	346,027.24	
		CAN 3.25% 12/01/35	400,000.00	392,580.54	
		CAN 3.5% 03/01/28	100,000.00	101,180.81	
		CAN 3.5% 03/01/34	100,000.00	101,008.88	
		CAN 3.5% 09/01/29	400,000.00	406,214.43	
		CAN 3.5% 12/01/45	170,000.00	162,889.97	
		CAN 3.5% 12/01/57	240,000.00	221,391.50	
		CAN 3% 06/01/34	430,000.00	418,912.18	
		CAN 4.0% 06/01/41	40,000.00	41,322.42	
		CAN 4% 03/01/29	100,000.00	102,747.04	
		CAN 5.75% 06/01/29	150,000.00	161,719.70	
		CAN 5% 06/01/37	430,000.00	485,277.93	
	カナダドル 小計		9,120,000.00	8,658,125.08 (991,095,577)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	1,300,000.00	1,378,245.21	
		MBONO 7.5% 05/26/33	2,700,000.00	2,519,212.45	
		MBONO 7.75% 05/29/31	3,650,000.00	3,549,156.66	
		MBONO 7.75% 11/13/42	4,400,000.00	3,746,015.37	
		MBONO 7.75% 11/23/34	3,400,000.00	3,155,659.78	
		MBONO 8.5% 02/28/30	2,900,000.00	2,921,859.06	
		MBONO 8.5% 03/01/29	3,420,000.00	3,470,950.95	
		MBONO 8.5% 05/31/29	6,600,000.00	6,690,006.51	
		MBONO 8.5% 11/18/38	2,150,000.00	2,015,566.88	
		MBONO 8% 02/21/36	1,550,000.00	1,440,678.50	
		MBONO 8% 04/15/32	2,100,000.00	2,030,405.91	
		MBONO 8% 04/29/55	500,000.00	422,384.89	
		MBONO 8% 05/24/35	700,000.00	651,857.54	
		MBONO 8% 07/31/53	3,830,000.00	3,245,361.30	
		MBONO 8% 11/07/47	2,120,000.00	1,815,611.24	
	メキシコペソ 小計		41,320,000.00	39,052,972.25 (360,993,959)	
	ユーロ	BGARIA 4.125% 09/23/29	100,000.00	103,220.81	
		BGB 0.1% 06/22/30	200,000.00	179,336.23	
		BGB 0.35% 06/22/32	80,000.00	68,050.06	
		BGB 0.4% 06/22/40	150,000.00	93,565.07	
		BGB 0.65% 06/22/71	60,000.00	17,400.32	
		BGB 0.8% 06/22/28	220,000.00	212,220.00	
		BGB 0.9% 06/22/29	200,000.00	189,488.52	
		BGB 0% 10/22/27	200,000.00	193,501.71	
		BGB 0% 10/22/31	70,000.00	59,693.83	
		BGB 1.25% 04/22/33	110,000.00	97,128.62	
		BGB 1.4% 06/22/53	70,000.00	37,025.17	

		BGB 1.45% 06/22/37	50,000.00	40,049.13	
		BGB 1.6% 06/22/47	120,000.00	76,010.55	
		BGB 1.7% 06/22/50	100,000.00	60,764.39	
		BGB 1.9% 06/22/38	80,000.00	65,637.09	
		BGB 1% 06/22/31	130,000.00	118,084.86	
		BGB 2.15% 06/22/66	70,000.00	40,148.37	
		BGB 2.25% 06/22/57	110,000.00	69,219.38	
		BGB 2.6% 10/22/30	70,000.00	68,983.37	
		BGB 2.7% 10/22/29	30,000.00	29,875.96	
		BGB 2.75% 04/22/39	80,000.00	71,300.15	
		BGB 2.85% 10/22/34	150,000.00	143,970.51	
		BGB 3.1% 06/22/35	200,000.00	193,891.98	
		BGB 3.3% 06/22/54	70,000.00	57,387.48	
		BGB 3.4% 06/22/36	100,000.00	98,267.55	
		BGB 3.45% 06/22/42	60,000.00	55,590.63	
		BGB 3.45% 06/22/43	90,000.00	82,716.95	
		BGB 3.5% 06/22/55	80,000.00	67,554.02	
		BGB 3.75% 06/22/45	20,000.00	18,862.40	
		BGB 3% 06/22/33	120,000.00	118,124.00	
		BGB 3% 06/22/34	140,000.00	136,529.59	
		BGB 4.25% 03/28/41	110,000.00	113,337.26	
		BGB 4.35% 06/22/56	60,000.00	58,635.59	
		BGB 4% 03/28/32	140,000.00	146,539.87	
		BGB 5.5% 03/28/28	70,000.00	73,218.52	
		BGB 5% 03/28/35	50,000.00	55,688.70	
		BKO 2% 12/16/27	360,000.00	356,866.20	
		BTPS 0.25% 03/15/28	190,000.00	182,310.22	
		BTPS 0.45% 02/15/29	200,000.00	188,090.10	
		BTPS 0.5% 07/15/28	210,000.00	200,764.46	
		BTPS 0.6% 08/01/31	150,000.00	132,071.40	
		BTPS 0.9% 04/01/31	170,000.00	153,409.95	
		BTPS 0.95% 03/01/37	250,000.00	187,250.00	
		BTPS 0.95% 06/01/32	170,000.00	148,913.15	
		BTPS 0.95% 08/01/30	200,000.00	184,062.80	
		BTPS 0.95% 09/15/27	90,000.00	88,230.15	
		BTPS 0.95% 12/01/31	230,000.00	204,321.70	
		BTPS 1.35% 04/01/30	150,000.00	141,385.83	
		BTPS 1.45% 03/01/36	200,000.00	163,070.50	
		BTPS 1.5% 04/30/45	270,000.00	172,087.06	
		BTPS 1.65% 03/01/32	70,000.00	64,269.39	
		BTPS 1.65% 12/01/30	100,000.00	94,073.65	
		BTPS 1.7% 09/01/51	190,000.00	110,433.41	
		BTPS 1.8% 03/01/41	190,000.00	141,271.88	

		BTPS 2.05% 08/01/27	290,000.00	288,225.78	
		BTPS 2.15% 03/01/72	110,000.00	63,336.18	
		BTPS 2.15% 09/01/52	100,000.00	63,969.75	
		BTPS 2.25% 09/01/36	210,000.00	183,089.13	
		BTPS 2.35% 01/15/29	100,000.00	98,708.40	
		BTPS 2.45% 09/01/33	100,000.00	93,774.30	
		BTPS 2.45% 09/01/50	190,000.00	133,248.71	
		BTPS 2.5% 12/01/32	290,000.00	275,909.77	
		BTPS 2.65% 06/15/28	100,000.00	99,695.60	
		BTPS 2.65% 12/01/27	540,000.00	539,381.16	
		BTPS 2.7% 03/01/47	140,000.00	108,028.20	
		BTPS 2.7% 10/01/30	300,000.00	295,163.25	
		BTPS 2.7% 10/15/27	150,000.00	149,926.91	
		BTPS 2.8% 03/01/67	40,000.00	27,548.84	
		BTPS 2.8% 06/15/29	280,000.00	279,090.98	
		BTPS 2.8% 12/01/28	300,000.00	299,941.50	
		BTPS 2.85% 02/01/31	200,000.00	197,416.20	
		BTPS 2.95% 07/01/30	400,000.00	398,214.80	
		BTPS 2.95% 09/01/38	180,000.00	162,649.35	
		BTPS 2% 02/01/28	200,000.00	197,773.35	
		BTPS 3.1% 03/01/40	160,000.00	143,815.84	
		BTPS 3.15% 03/15/33	200,000.00	196,710.20	
		BTPS 3.15% 06/01/31	110,000.00	109,765.22	
		BTPS 3.15% 11/15/31	150,000.00	149,333.96	
		BTPS 3.25% 03/01/38	140,000.00	131,147.10	
		BTPS 3.25% 07/15/32	100,000.00	99,506.82	
		BTPS 3.25% 09/01/46	130,000.00	110,388.81	
		BTPS 3.25% 11/15/32	100,000.00	99,232.02	
		BTPS 3.3% 06/15/33	50,000.00	49,515.19	
		BTPS 3.35% 03/01/35	180,000.00	176,298.39	
		BTPS 3.35% 07/01/29	200,000.00	202,273.60	
		BTPS 3.4% 04/01/28	200,000.00	202,057.70	
		BTPS 3.45% 03/01/48	130,000.00	112,666.19	
		BTPS 3.45% 07/15/31	350,000.00	354,037.95	
		BTPS 3.5% 02/15/31	280,000.00	284,073.58	
		BTPS 3.5% 03/01/30	100,000.00	101,745.85	
		BTPS 3.6% 10/01/35	200,000.00	198,037.70	
		BTPS 3.65% 08/01/35	200,000.00	199,152.10	
		BTPS 3.7% 06/15/30	180,000.00	184,180.62	
		BTPS 3.8% 07/01/36	100,000.00	99,973.23	
		BTPS 3.8% 08/01/28	100,000.00	101,936.92	
		BTPS 3.85% 02/01/35	200,000.00	202,890.80	

		BTPS 3.85% 07/01/34	280,000.00	285,102.72	
		BTPS 3.85% 09/01/49	150,000.00	137,263.61	
		BTPS 3.85% 10/01/40	100,000.00	96,964.50	
		BTPS 3.85% 12/15/29	150,000.00	154,133.55	
		BTPS 3.95% 10/01/41	100,000.00	97,167.90	
		BTPS 3% 08/01/29	280,000.00	280,770.00	
		BTPS 3% 10/01/29	220,000.00	220,174.61	
		BTPS 4.05% 10/30/37	70,000.00	71,040.62	
		BTPS 4.1% 02/01/29	100,000.00	102,945.17	
		BTPS 4.1% 04/30/46	80,000.00	77,120.70	
		BTPS 4.15% 10/01/39	100,000.00	100,930.37	
		BTPS 4.2% 03/01/34	240,000.00	250,488.24	
		BTPS 4.3% 10/01/54	80,000.00	76,588.40	
		BTPS 4.35% 11/01/33	100,000.00	105,434.75	
		BTPS 4.4% 05/01/33	150,000.00	158,846.43	
		BTPS 4.45% 09/01/43	110,000.00	112,234.70	
		BTPS 4.5% 10/01/53	180,000.00	178,497.45	
		BTPS 4.65% 10/01/55	30,000.00	30,242.99	
		BTPS 4.75% 09/01/28	100,000.00	103,974.80	
		BTPS 4.75% 09/01/44	110,000.00	116,404.55	
		BTPS 4% 02/01/37	240,000.00	244,083.00	
		BTPS 4% 04/30/35	290,000.00	297,459.72	
		BTPS 4% 10/30/31	150,000.00	155,707.00	
		BTPS 4% 11/15/30	150,000.00	155,267.77	
		BTPS 5.0% 08/01/39	280,000.00	307,540.57	
		BTPS 5.25% 11/01/29	130,000.00	139,329.77	
		BTPS 5.75% 02/01/33	250,000.00	284,251.00	
		BTPS 5% 08/01/34	100,000.00	109,894.40	
		BTPS 5% 09/01/40	110,000.00	120,700.25	
		BTPS 6.5% 11/01/27	100,000.00	104,762.52	
		BTPS 6% 05/01/31	100,000.00	112,604.30	
		CHILE 1.3% 07/26/36	100,000.00	78,995.76	
		DBR 0.25% 02/15/29	500,000.00	470,597.50	
		DBR 0.25% 08/15/28	150,000.00	142,899.00	
		DBR 0% 02/15/31	560,000.00	494,842.88	
		DBR 0% 02/15/32	120,000.00	102,801.75	
		DBR 0% 05/15/35	400,000.00	307,237.50	
		DBR 0% 05/15/36	100,000.00	74,050.00	
		DBR 0% 08/15/30	400,000.00	358,701.39	
		DBR 0% 08/15/31	400,000.00	348,061.80	
		DBR 0% 08/15/50	360,000.00	152,410.50	
		DBR 0% 08/15/50	70,000.00	29,743.35	
		DBR 0% 08/15/52	100,000.00	39,376.60	

		DBR 1.25% 08/15/48	200,000.00	129,386.40	
		DBR 1.7% 08/15/32	320,000.00	300,132.80	
		DBR 1.8% 08/15/53	340,000.00	233,787.57	
		DBR 1.8% 08/15/53	100,000.00	68,971.55	
		DBR 1% 05/15/38	300,000.00	234,534.75	
		DBR 2.1% 11/15/29	830,000.00	814,439.16	
		DBR 2.2% 02/15/34	400,000.00	379,945.50	
		DBR 2.3% 02/15/33	300,000.00	289,701.75	
		DBR 2.4% 11/15/30	500,000.00	492,984.74	
		DBR 2.5% 02/15/35	120,000.00	115,518.06	
		DBR 2.5% 08/15/46	510,000.00	434,562.20	
		DBR 2.5% 08/15/54	150,000.00	120,541.24	
		DBR 2.5% 11/15/32	860,000.00	842,160.81	
		DBR 2.6% 05/15/41	100,000.00	90,767.72	
		DBR 2.6% 08/15/33	240,000.00	235,284.72	
		DBR 2.6% 08/15/34	730,000.00	710,684.20	
		DBR 2.6% 08/15/35	300,000.00	289,958.51	
		DBR 2.9% 02/15/36	600,000.00	592,321.80	
		DBR 2.9% 08/15/56	300,000.00	260,336.25	
		DBR 3.25% 07/04/42	220,000.00	215,014.80	
		DBR 4.0% 01/04/37	330,000.00	355,890.81	
		DBR 4.25% 07/04/39	370,000.00	407,584.60	
		DBR 4.75% 07/04/28	100,000.00	104,068.25	
		DBR 4.75% 07/04/34	100,000.00	112,787.30	
		DBR 4.75% 07/04/40	100,000.00	115,643.25	
		DBR 5.5% 01/04/31	400,000.00	445,935.40	
		DBR 5.625% 01/04/28	300,000.00	312,943.50	
		FRTR 0.5% 05/25/29	450,000.00	420,804.56	
		FRTR 0.5% 05/25/40	350,000.00	216,940.32	
		FRTR 0.5% 05/25/72	190,000.00	46,312.64	
		FRTR 0.5% 06/25/44	290,000.00	153,295.37	
		FRTR 0.75% 02/25/28	400,000.00	387,281.80	
		FRTR 0.75% 05/25/28	540,000.00	520,098.30	
		FRTR 0.75% 05/25/52	280,000.00	119,932.40	
		FRTR 0.75% 05/25/53	230,000.00	95,388.76	
		FRTR 0.75% 11/25/28	520,000.00	495,342.12	
		FRTR 0% 05/25/32	370,000.00	305,995.36	
		FRTR 0% 11/25/29	400,000.00	362,690.60	
		FRTR 0% 11/25/30	490,000.00	429,282.00	
		FRTR 0% 11/25/31	490,000.00	413,468.86	
		FRTR 1.25% 05/25/34	520,000.00	438,383.40	
		FRTR 1.25% 05/25/36	400,000.00	316,985.00	

		FRTR 1.25% 05/25/38	280,000.00	207,991.21	
		FRTR 1.5% 05/25/31	550,000.00	509,844.50	
		FRTR 1.5% 05/25/50	290,000.00	163,729.94	
		FRTR 1.75% 05/25/66	140,000.00	67,958.41	
		FRTR 1.75% 06/25/39	300,000.00	231,151.87	
		FRTR 2.4% 09/24/28	510,000.00	505,379.40	
		FRTR 2.4% 09/24/29	220,000.00	216,429.84	
		FRTR 2.5% 05/25/30	560,000.00	549,797.50	
		FRTR 2.5% 05/25/43	200,000.00	157,560.15	
		FRTR 2.5% 09/24/27	370,000.00	369,041.51	
		FRTR 2.7% 02/25/31	630,000.00	618,644.25	
		FRTR 2.75% 02/25/29	420,000.00	418,653.69	
		FRTR 2.75% 02/25/30	420,000.00	416,557.78	
		FRTR 2.75% 10/25/27	530,000.00	530,029.62	
		FRTR 2% 05/25/48	160,000.00	105,532.00	
		FRTR 2% 11/25/32	430,000.00	396,930.09	
		FRTR 3.2% 05/25/35	420,000.00	404,809.02	
		FRTR 3.25% 02/25/32	100,000.00	99,926.17	
		FRTR 3.25% 05/25/45	360,000.00	309,909.60	
		FRTR 3.25% 05/25/55	200,000.00	156,672.40	
		FRTR 3.5% 11/25/33	420,000.00	419,961.46	
		FRTR 3.5% 11/25/35	500,000.00	490,381.36	
		FRTR 3.6% 05/25/42	100,000.00	92,620.00	
		FRTR 3.75% 05/25/56	200,000.00	171,490.44	
		FRTR 3.8% 06/25/37	100,000.00	99,128.90	
		FRTR 3% 05/25/33	380,000.00	370,051.88	
		FRTR 3% 05/25/54	220,000.00	165,241.17	
		FRTR 3% 06/25/49	200,000.00	158,198.00	
		FRTR 3% 11/25/34	570,000.00	544,651.81	
		FRTR 4.1% 05/25/46	100,000.00	96,182.50	
		FRTR 4.4% 05/25/57	130,000.00	124,561.45	
		FRTR 4.5% 04/25/41	350,000.00	363,097.24	
		FRTR 4.75% 04/25/35	350,000.00	378,251.82	
		FRTR 4% 04/25/55	180,000.00	162,723.60	
		FRTR 4% 04/25/60	180,000.00	159,873.66	
		FRTR 4% 10/25/38	220,000.00	219,961.94	
		FRTR 5.5% 04/25/29	370,000.00	395,617.13	
		FRTR 5.75% 10/25/32	390,000.00	442,930.68	
		GGB 0.75% 06/18/31	70,000.00	62,572.82	
		GGB 3.875% 06/15/28	170,000.00	173,563.88	
		GGB 4.125% 06/15/54	80,000.00	75,900.41	
		GGB 4.2% 01/30/42	100,000.00	101,309.00	
		GGB 4.25% 06/15/33	200,000.00	210,771.00	

		GGB 4.375% 07/18/38	50,000.00	52,334.25	
		IRISH 0.2% 10/18/30	60,000.00	53,821.74	
		IRISH 0.35% 10/18/32	40,000.00	34,086.20	
		IRISH 0.4% 05/15/35	50,000.00	39,498.32	
		IRISH 0.55% 04/22/41	60,000.00	39,645.34	
		IRISH 0.9% 05/15/28	60,000.00	58,196.05	
		IRISH 0% 10/18/31	50,000.00	43,091.47	
		IRISH 1.1% 05/15/29	90,000.00	86,122.28	
		IRISH 1.3% 05/15/33	110,000.00	98,713.56	
		IRISH 1.35% 03/18/31	60,000.00	56,201.30	
		IRISH 1.5% 05/15/50	70,000.00	45,724.57	
		IRISH 1.7% 05/15/37	60,000.00	51,272.15	
		IRISH 2.4% 05/15/30	100,000.00	98,637.10	
		IRISH 2% 02/18/45	70,000.00	54,758.55	
		IRISH 3.1% 06/18/36	50,000.00	49,436.50	
		IRISH 3.15% 10/18/55	20,000.00	17,686.58	
		IRISH 3% 10/18/43	90,000.00	83,080.03	
		ISRAEL 1.5% 01/16/29	100,000.00	95,362.70	
		ISRAEL 2.5% 01/16/49	100,000.00	69,151.43	
		KSA 0.75% 07/09/27	100,000.00	97,779.65	
		MEX 2.125% 10/25/51	100,000.00	53,081.07	
		MEX 5.125% 03/19/38	100,000.00	98,215.57	
		NETHER 0.25% 07/15/29	170,000.00	158,078.02	
		NETHER 0.5% 01/15/40	90,000.00	61,871.35	
		NETHER 0.5% 07/15/32	130,000.00	112,878.11	
		NETHER 0.75% 07/15/27	140,000.00	137,514.76	
		NETHER 0.75% 07/15/28	100,000.00	96,350.90	
		NETHER 0% 01/15/29	140,000.00	131,079.73	
		NETHER 0% 01/15/38	160,000.00	109,735.55	
		NETHER 0% 01/15/52	170,000.00	67,810.62	
		NETHER 0% 07/15/30	60,000.00	53,756.59	
		NETHER 0% 07/15/31	120,000.00	104,242.62	
		NETHER 2.5% 01/15/30	120,000.00	118,990.53	
		NETHER 2.5% 01/15/31	150,000.00	147,932.92	
		NETHER 2.5% 01/15/33	120,000.00	116,851.38	
		NETHER 2.5% 07/15/33	110,000.00	106,642.44	
		NETHER 2.5% 07/15/34	90,000.00	86,516.66	
		NETHER 2.5% 07/15/35	100,000.00	95,245.88	
		NETHER 2.75% 01/15/47	180,000.00	158,001.32	
		NETHER 2.75% 07/15/36	50,000.00	48,201.00	
		NETHER 2% 01/15/54	150,000.00	107,457.13	
		NETHER 3.25% 01/15/44	120,000.00	115,461.26	

		NETHER 3.5% 01/15/56	90,000.00	87,449.91	
		NETHER 3.75% 01/15/42	170,000.00	175,131.87	
		NETHER 4% 01/15/37	140,000.00	149,657.83	
		NETHER 5.5% 01/15/28	170,000.00	177,166.35	
		OBL 2.1% 04/12/29	340,000.00	334,968.68	
		OBL 2.4% 04/18/30	730,000.00	721,857.58	
		OBL 2.4% 10/19/28	420,000.00	417,691.26	
		PGB 0.3% 10/17/31	70,000.00	61,119.53	
		PGB 0.475% 10/18/30	80,000.00	72,532.68	
		PGB 0.7% 10/15/27	70,000.00	68,391.37	
		PGB 0.9% 10/12/35	40,000.00	32,298.24	
		PGB 1.15% 04/11/42	70,000.00	48,138.33	
		PGB 1.65% 07/16/32	80,000.00	74,054.82	
		PGB 1.95% 06/15/29	100,000.00	97,887.75	
		PGB 1% 04/12/52	70,000.00	36,281.64	
		PGB 2.125% 10/17/28	100,000.00	98,896.64	
		PGB 2.25% 04/18/34	180,000.00	168,333.48	
		PGB 2.875% 10/20/34	30,000.00	29,190.00	
		PGB 3.25% 06/13/36	60,000.00	59,104.57	
		PGB 3.5% 06/18/38	50,000.00	49,559.20	
		PGB 3.625% 06/12/54	30,000.00	27,634.86	
		PGB 3.875% 02/15/30	90,000.00	93,360.87	
		PGB 3% 06/15/35	100,000.00	97,598.16	
		PGB 4.1% 02/15/45	80,000.00	81,847.33	
		PGB 4.1% 04/15/37	120,000.00	126,544.21	
		POLAND 2.375% 01/18/36	100,000.00	90,266.64	
		POLAND 3.875% 02/14/33	100,000.00	102,782.24	
		RAGB 0.25% 10/20/36	50,000.00	36,636.20	
		RAGB 0.5% 02/20/29	150,000.00	141,576.48	
		RAGB 0.7% 04/20/71	70,000.00	23,407.37	
		RAGB 0.75% 02/20/28	90,000.00	87,286.61	
		RAGB 0.75% 03/20/51	60,000.00	30,579.27	
		RAGB 0.85% 06/30/20	50,000.00	14,780.25	
		RAGB 0.9% 02/20/32	80,000.00	71,450.50	
		RAGB 0% 02/20/30	120,000.00	108,517.44	
		RAGB 0% 02/20/31	110,000.00	96,380.02	
		RAGB 0% 10/20/28	130,000.00	122,261.81	
		RAGB 0% 10/20/40	80,000.00	48,104.00	
		RAGB 1.5% 02/20/47	50,000.00	33,677.80	
		RAGB 1.5% 11/02/86	20,000.00	9,064.75	
		RAGB 1.85% 05/23/49	140,000.00	98,395.74	
		RAGB 2.1% 09/20/17	40,000.00	22,701.60	
		RAGB 2.4% 05/23/34	130,000.00	123,091.93	

		RAGB 2.5% 10/20/29	100,000.00	99,053.65	
		RAGB 2.8% 09/20/32	140,000.00	138,148.85	
		RAGB 2.9% 02/20/33	100,000.00	98,928.42	
		RAGB 2.9% 02/20/34	100,000.00	98,263.50	
		RAGB 2.9% 05/23/29	60,000.00	60,254.83	
		RAGB 2.95% 02/20/35	80,000.00	78,274.34	
		RAGB 3.15% 06/20/44	120,000.00	111,078.15	
		RAGB 3.15% 10/20/53	90,000.00	78,963.98	
		RAGB 3.2% 02/20/36	50,000.00	49,534.52	
		RAGB 3.2% 07/15/39	100,000.00	96,588.45	
		RAGB 3.45% 10/20/30	120,000.00	122,734.35	
		RAGB 3.75% 03/20/56	20,000.00	19,398.62	
		RAGB 3.8% 01/26/62	40,000.00	39,120.50	
		RAGB 4.15% 03/15/37	90,000.00	96,117.25	
		RAGB 6.25% 07/15/27	100,000.00	103,575.83	
		RFGB 0.125% 04/15/36	50,000.00	36,567.68	
		RFGB 0.125% 04/15/52	20,000.00	7,679.09	
		RFGB 0.125% 09/15/31	60,000.00	51,882.93	
		RFGB 0.25% 09/15/40	30,000.00	18,665.41	
		RFGB 0.5% 04/15/43	60,000.00	35,620.02	
		RFGB 0.5% 09/15/27	50,000.00	48,773.37	
		RFGB 0.5% 09/15/28	70,000.00	66,799.80	
		RFGB 0.5% 09/15/29	50,000.00	46,551.67	
		RFGB 0.75% 04/15/31	50,000.00	45,229.80	
		RFGB 0% 09/15/30	50,000.00	44,405.97	
		RFGB 1.125% 04/15/34	80,000.00	68,709.82	
		RFGB 1.375% 04/15/47	50,000.00	32,098.57	
		RFGB 1.5% 09/15/32	90,000.00	82,087.94	
		RFGB 2.5% 04/15/30	60,000.00	59,289.89	
		RFGB 2.625% 07/04/42	40,000.00	34,618.16	
		RFGB 2.75% 04/15/38	30,000.00	27,775.25	
		RFGB 2.75% 07/04/28	40,000.00	40,056.68	
		RFGB 2.875% 04/15/29	40,000.00	40,123.96	
		RFGB 2.95% 04/15/55	60,000.00	49,255.17	
		RFGB 3.2% 04/15/45	20,000.00	18,313.83	
		RFGB 3.55% 04/15/41	30,000.00	29,436.41	
		RFGB 3% 09/15/33	100,000.00	99,120.17	
		RFGB 3% 09/15/34	50,000.00	49,147.50	
		RFGB 3% 09/15/35	40,000.00	38,975.92	
		ROMANI 2.125% 03/07/28	100,000.00	98,088.69	
		ROMANI 2.75% 04/14/41	100,000.00	67,079.04	
		ROMANI 2% 01/28/32	100,000.00	86,515.55	

		ROMANI 2% 04/14/33	100,000.00	82,040.25	
		ROMANI 3.875% 10/29/35	100,000.00	88,436.97	
		ROMANI 5.875% 07/11/32	200,000.00	208,974.82	
		ROMANI 6.375% 09/18/33	100,000.00	106,215.52	
		ROMANI 6.625% 09/27/29	100,000.00	107,867.99	
		SPGB 0.1% 04/30/31	320,000.00	279,831.44	
		SPGB 0.5% 04/30/30	250,000.00	229,142.01	
		SPGB 0.5% 10/31/31	270,000.00	237,361.86	
		SPGB 0.6% 10/31/29	190,000.00	176,936.68	
		SPGB 0.7% 04/30/32	340,000.00	297,956.83	
		SPGB 0.8% 07/30/27	210,000.00	206,049.84	
		SPGB 0.8% 07/30/29	260,000.00	244,897.90	
		SPGB 0.85% 07/30/37	190,000.00	142,586.64	
		SPGB 0% 01/31/28	250,000.00	240,136.65	
		SPGB 1.2% 10/31/40	190,000.00	135,629.77	
		SPGB 1.25% 10/31/30	300,000.00	280,274.85	
		SPGB 1.4% 04/30/28	260,000.00	254,247.21	
		SPGB 1.4% 07/30/28	370,000.00	360,548.08	
		SPGB 1.45% 04/30/29	220,000.00	212,450.55	
		SPGB 1.45% 10/31/27	230,000.00	226,541.42	
		SPGB 1.45% 10/31/71	70,000.00	31,642.05	
		SPGB 1.85% 07/30/35	210,000.00	185,086.05	
		SPGB 1.9% 10/31/52	180,000.00	115,169.66	
		SPGB 1.95% 07/30/30	280,000.00	270,371.97	
		SPGB 1% 07/30/42	170,000.00	111,463.63	
		SPGB 1% 10/31/50	240,000.00	125,642.18	
		SPGB 2.35% 07/30/33	200,000.00	189,469.93	
		SPGB 2.4% 05/31/28	200,000.00	198,922.52	
		SPGB 2.55% 10/31/32	260,000.00	251,693.97	
		SPGB 2.6% 05/31/31	150,000.00	147,484.47	
		SPGB 2.7% 01/31/30	170,000.00	169,126.17	
		SPGB 2.7% 10/31/48	220,000.00	175,808.04	
		SPGB 2.9% 10/31/46	230,000.00	193,987.75	
		SPGB 3.1% 07/30/31	250,000.00	251,427.95	
		SPGB 3.15% 04/30/33	290,000.00	289,440.30	
		SPGB 3.15% 04/30/35	190,000.00	186,579.28	
		SPGB 3.2% 10/31/35	260,000.00	255,101.94	
		SPGB 3.25% 04/30/34	280,000.00	279,005.72	
		SPGB 3.3% 04/30/36	280,000.00	275,865.09	
		SPGB 3.4% 10/31/36	50,000.00	49,438.81	
		SPGB 3.45% 07/30/43	200,000.00	187,254.70	
		SPGB 3.45% 07/30/66	160,000.00	135,580.29	
		SPGB 3.45% 10/31/34	210,000.00	211,591.52	

		SPGB 3.5% 01/31/41	150,000.00	143,979.53	
		SPGB 3.5% 05/31/29	400,000.00	407,860.40	
		SPGB 3.55% 10/31/33	320,000.00	326,281.01	
		SPGB 3.9% 07/30/39	220,000.00	223,366.41	
		SPGB 3.95% 10/31/56	70,000.00	66,342.75	
		SPGB 3% 01/31/33	150,000.00	148,559.48	
		SPGB 4.2% 01/31/37	270,000.00	285,090.75	
		SPGB 4.7% 07/30/41	260,000.00	284,788.79	
		SPGB 4.9% 07/30/40	260,000.00	290,799.64	
		SPGB 4% 10/31/54	150,000.00	144,780.83	
		SPGB 5.15% 10/31/28	530,000.00	558,199.97	
		SPGB 5.15% 10/31/44	170,000.00	195,679.03	
		SPGB 5.75% 07/30/32	250,000.00	286,606.55	
	ユーロ 小計		74,870,000.00	68,957,749.99 (12,789,593,890)	
	イギリスポンド	UKT 0.125% 01/31/28	330,000.00	310,974.15	
		UKT 0.25% 07/31/31	300,000.00	244,542.48	
		UKT 0.375% 10/22/30	490,000.00	415,352.51	
		UKT 0.5% 01/31/29	350,000.00	318,947.04	
		UKT 0.5% 10/22/61	210,000.00	48,552.00	
		UKT 0.625% 07/31/35	150,000.00	103,919.31	
		UKT 0.625% 10/22/50	330,000.00	113,249.59	
		UKT 0.875% 01/31/46	190,000.00	84,591.13	
		UKT 0.875% 07/31/33	360,000.00	278,554.26	
		UKT 0.875% 10/22/29	430,000.00	385,878.66	
		UKT 1.125% 01/31/39	160,000.00	100,835.60	
		UKT 1.125% 10/22/73	110,000.00	31,218.00	
		UKT 1.25% 07/22/27	180,000.00	174,908.28	
		UKT 1.25% 07/31/51	260,000.00	107,398.39	
		UKT 1.25% 10/22/41	260,000.00	149,997.03	
		UKT 1.5% 07/22/47	220,000.00	109,267.39	
		UKT 1.5% 07/31/53	140,000.00	59,699.90	
		UKT 1.625% 10/22/28	330,000.00	311,786.80	
		UKT 1.625% 10/22/54	130,000.00	56,537.09	
		UKT 1.625% 10/22/71	230,000.00	84,567.03	
		UKT 1.75% 01/22/49	260,000.00	132,429.31	
		UKT 1.75% 07/22/57	240,000.00	104,276.71	
		UKT 1.75% 09/07/37	270,000.00	194,520.64	
		UKT 1% 01/31/32	470,000.00	389,744.52	
		UKT 2.5% 07/22/65	180,000.00	92,706.84	
		UKT 3.25% 01/22/44	240,000.00	179,592.00	
		UKT 3.25% 01/31/33	290,000.00	267,805.72	

		UKT 3.5% 01/22/45	350,000.00	268,345.00	
		UKT 3.5% 07/22/68	190,000.00	127,034.00	
		UKT 3.75% 01/29/38	300,000.00	264,208.29	
		UKT 3.75% 07/22/52	170,000.00	126,693.34	
		UKT 3.75% 10/22/53	150,000.00	110,470.23	
		UKT 4.125% 03/07/31	200,000.00	197,405.69	
		UKT 4.125% 03/07/33	260,000.00	252,632.96	
		UKT 4.125% 07/22/29	350,000.00	347,962.35	
		UKT 4.25% 03/07/36	280,000.00	265,384.98	
		UKT 4.25% 06/07/32	340,000.00	335,848.60	
		UKT 4.25% 07/31/34	300,000.00	289,646.62	
		UKT 4.25% 09/07/39	230,000.00	208,932.00	
		UKT 4.25% 12/07/27	270,000.00	270,524.17	
		UKT 4.25% 12/07/40	270,000.00	241,734.32	
		UKT 4.25% 12/07/46	240,000.00	202,122.63	
		UKT 4.25% 12/07/49	190,000.00	156,933.10	
		UKT 4.25% 12/07/55	130,000.00	104,377.83	
		UKT 4.375% 01/31/40	260,000.00	237,908.22	
		UKT 4.375% 03/07/28	420,000.00	420,866.33	
		UKT 4.375% 03/07/30	310,000.00	310,048.17	
		UKT 4.375% 07/31/54	310,000.00	254,537.63	
		UKT 4.5% 03/07/35	250,000.00	244,030.88	
		UKT 4.5% 06/07/28	160,000.00	160,693.76	
		UKT 4.5% 09/07/34	210,000.00	206,377.30	
		UKT 4.5% 12/07/42	180,000.00	162,209.43	
		UKT 4.625% 01/31/34	370,000.00	367,739.14	
		UKT 4.625% 03/07/37	130,000.00	125,548.26	
		UKT 4.75% 10/22/35	220,000.00	217,470.04	
		UKT 4.75% 10/22/43	190,000.00	174,574.43	
		UKT 4.75% 12/07/30	410,000.00	416,838.01	
		UKT 4.75% 12/07/38	290,000.00	279,250.34	
		UKT 4.875% 07/31/36	320,000.00	317,362.19	
		UKT 4% 01/22/60	160,000.00	121,472.00	
		UKT 4% 05/22/29	440,000.00	436,178.33	
		UKT 4% 10/22/31	240,000.00	234,624.70	
		UKT 4% 10/22/63	190,000.00	142,766.00	
		UKT 5.375% 01/31/56	100,000.00	96,310.50	
		UKT 6.0% 12/07/28	280,000.00	291,774.78	
	イギリスポンド 小計		16,770,000.00	13,840,688.93 (3,012,010,724)	
	スイスフラン	SWISS 0.25% 06/23/35	120,000.00	119,215.45	
		SWISS 0.5% 05/24/55	20,000.00	19,726.06	
		SWISS 0.5% 05/27/30	540,000.00	547,490.44	

	SWISS 0.5% 05/28/40	50,000.00	49,826.70	
	SWISS 0.5% 05/30/58	40,000.00	39,520.20	
	SWISS 0.5% 06/27/32	220,000.00	223,368.42	
	SWISS 0.5% 06/28/45	40,000.00	39,285.92	
	SWISS 0.875% 05/22/47	50,000.00	52,421.87	
	SWISS 0% 06/22/29	500,000.00	498,726.83	
	SWISS 0% 06/26/34	210,000.00	205,573.79	
	SWISS 0% 07/24/39	50,000.00	46,808.35	
	SWISS 1.25% 06/27/37	70,000.00	76,080.20	
	SWISS 1.25% 06/28/43	50,000.00	55,365.68	
	SWISS 1.5% 04/30/42	70,000.00	79,911.09	
	SWISS 1.5% 10/26/38	130,000.00	145,782.71	
	SWISS 2.25% 06/22/31	180,000.00	197,976.96	
	SWISS 2.5% 03/08/36	90,000.00	108,296.48	
	SWISS 2% 06/25/64	30,000.00	45,350.73	
	SWISS 3.5% 04/08/33	100,000.00	121,547.12	
	SWISS 4% 01/06/49	30,000.00	51,570.76	
	SWISS 4% 04/08/28	30,000.00	32,047.76	
スイスフラン 小計		2,620,000.00	2,755,893.52 (554,403,099)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	1,070,000.00	956,193.78	
	SGB 0.75% 05/12/28	590,000.00	574,140.59	
	SGB 0.75% 11/12/29	3,630,000.00	3,444,070.39	
	SGB 1.75% 11/11/33	450,000.00	422,968.53	
	SGB 2.25% 05/11/35	950,000.00	912,964.25	
	SGB 3.5% 03/30/39	1,600,000.00	1,696,949.76	
スウェーデンクローナ 小計		8,290,000.00	8,007,287.30 (134,442,353)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	400,000.00	342,536.12	
	NGB 1.375% 08/19/30	870,000.00	770,941.80	
	NGB 1.75% 09/06/29	750,000.00	690,366.79	
	NGB 2.125% 05/18/32	450,000.00	398,230.69	
	NGB 2% 04/26/28	1,040,000.00	994,294.21	
	NGB 3.5% 10/06/42	160,000.00	143,634.24	
	NGB 3.625% 04/13/34	520,000.00	495,483.82	
	NGB 3.625% 05/31/39	360,000.00	333,251.10	
	NGB 3.75% 06/12/35	580,000.00	554,204.23	
	NGB 3% 08/15/33	460,000.00	422,640.24	
	NGB 4.125% 06/03/36	300,000.00	294,015.00	
ノルウェークローネ 小計		5,890,000.00	5,439,598.24 (90,895,686)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	770,000.00	364,698.95	

		DGB 0.5% 11/15/27	2,460,000.00	2,401,122.97	
		DGB 0.5% 11/15/29	2,780,000.00	2,606,041.89	
		DGB 0% 11/15/31	570,000.00	496,592.55	
		DGB 2.25% 11/15/33	870,000.00	840,655.43	
		DGB 2.25% 11/15/35	270,000.00	255,422.83	
		DGB 4.5% 11/15/39	900,000.00	1,038,650.94	
	デンマーククローネ 小計		8,620,000.00	8,003,185.56 (198,559,033)	
	チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	1,600,000.00	1,403,439.98	
		CZGB 0.95% 05/15/30	1,120,000.00	1,000,116.42	
		CZGB 1.2% 03/13/31	1,550,000.00	1,363,933.83	
		CZGB 1.5% 04/24/40	300,000.00	199,550.89	
		CZGB 1.75% 06/23/32	650,000.00	566,377.01	
		CZGB 1.95% 07/30/37	1,400,000.00	1,068,053.12	
		CZGB 2.5% 08/25/28	1,500,000.00	1,461,322.14	
		CZGB 2.75% 07/23/29	1,400,000.00	1,352,243.99	
		CZGB 2% 10/13/33	600,000.00	509,009.96	
		CZGB 3.5% 05/30/35	1,450,000.00	1,335,996.57	
		CZGB 3.6% 06/03/36	600,000.00	549,385.51	
		CZGB 3% 03/03/33	300,000.00	275,963.17	
		CZGB 4.2% 12/04/36	630,000.00	604,622.70	
		CZGB 4.25% 10/24/34	600,000.00	586,264.79	
		CZGB 4.5% 11/11/32	1,050,000.00	1,058,420.89	
		CZGB 4.85% 11/26/57	250,000.00	230,313.06	
		CZGB 4.9% 04/14/34	2,300,000.00	2,359,133.00	
		CZGB 4.95% 02/27/37	500,000.00	507,902.35	
		CZGB 4% 04/04/44	500,000.00	438,609.45	
		CZGB 5.3% 09/19/35	830,000.00	867,056.76	
		CZGB 5.5% 12/12/28	700,000.00	725,852.96	
		CZGB 5% 09/30/30	1,000,000.00	1,036,549.90	
		CZGB 6.2% 06/16/31	1,000,000.00	1,090,753.70	
	チェココルナ 小計		21,830,000.00	20,590,872.15 (157,373,976)	
	ハンガリーフォリント	HGB 2.25% 04/20/33	10,000,000.00	8,364,200.00	
		HGB 2.25% 06/22/34	16,000,000.00	12,987,245.12	
		HGB 2% 05/23/29	20,000,000.00	18,350,600.00	
		HGB 3.25% 10/22/31	30,000,000.00	27,407,700.00	
		HGB 3% 04/25/41	3,000,000.00	2,314,083.15	
		HGB 3% 08/21/30	17,000,000.00	15,689,993.94	
		HGB 3% 10/27/27	6,000,000.00	5,852,669.28	
		HGB 3% 10/27/38	2,000,000.00	1,604,744.34	
		HGB 4.5% 03/23/28	21,000,000.00	20,793,162.18	
		HGB 4.75% 11/24/32	12,000,000.00	11,716,080.00	

		HGB 4% 04/28/51	6,000,000.00	4,939,792.62	
		HGB 6.25% 09/23/37	6,000,000.00	6,530,507.40	
		HGB 6.75% 10/22/28	11,000,000.00	11,366,628.90	
		HGB 6% 11/28/29	5,000,000.00	5,123,502.00	
		HGB 7% 10/24/35	14,000,000.00	15,799,000.00	
	ハンガリーフォリント 小計		179,000,000.00	168,839,908.93 (87,653,576)	
	ポーランドズロチ	POLGB 1.25% 10/25/30	420,000.00	368,015.59	
		POLGB 1.75% 04/25/32	580,000.00	493,300.66	
		POLGB 2.5% 07/25/27	430,000.00	425,139.61	
		POLGB 2.75% 04/25/28	450,000.00	441,957.25	
		POLGB 2.75% 10/25/29	550,000.00	526,167.99	
		POLGB 4.5% 01/25/31	1,000,000.00	997,633.48	
		POLGB 4.5% 07/25/30	550,000.00	551,470.48	
		POLGB 4.75% 07/25/29	570,000.00	579,581.13	
		POLGB 4% 07/25/31	400,000.00	387,427.03	
		POLGB 5.75% 04/25/29	200,000.00	208,455.20	
		POLGB 5% 01/25/30	470,000.00	480,355.79	
		POLGB 5% 10/25/34	410,000.00	406,200.91	
		POLGB 5% 10/25/35	700,000.00	686,290.77	
		POLGB 6% 10/25/33	510,000.00	540,787.17	
		POLGB 7.5% 07/25/28	400,000.00	427,205.16	
	ポーランドズロチ 小計		7,640,000.00	7,519,988.22 (321,761,495)	
	オーストラリアドル	ACGB 1.25% 05/21/32	490,000.00	406,793.10	
		ACGB 1.5% 06/21/31	370,000.00	321,111.90	
		ACGB 1.75% 06/21/51	230,000.00	115,055.20	
		ACGB 1.75% 11/21/32	300,000.00	252,759.00	
		ACGB 1% 11/21/31	460,000.00	383,235.20	
		ACGB 1% 12/21/30	470,000.00	404,646.50	
		ACGB 2.25% 05/21/28	150,000.00	144,082.50	
		ACGB 2.5% 05/21/30	440,000.00	409,701.60	
		ACGB 2.75% 05/21/41	190,000.00	143,560.20	
		ACGB 2.75% 06/21/35	220,000.00	186,942.80	
		ACGB 2.75% 11/21/27	100,000.00	97,705.00	
		ACGB 2.75% 11/21/28	580,000.00	557,948.40	
		ACGB 2.75% 11/21/29	380,000.00	359,886.60	
		ACGB 3.25% 04/21/29	340,000.00	329,310.40	
		ACGB 3.25% 06/21/39	220,000.00	182,888.20	
		ACGB 3.5% 12/21/34	310,000.00	282,251.90	
		ACGB 3.75% 04/21/37	90,000.00	81,207.90	
		ACGB 3.75% 05/21/34	50,000.00	46,741.00	
		ACGB 3% 03/21/47	110,000.00	78,158.30	

		ACGB 3% 11/21/33	70,000.00	62,615.70	
		ACGB 4.25% 03/21/36	420,000.00	399,924.00	
		ACGB 4.25% 06/21/34	100,000.00	96,646.00	
		ACGB 4.25% 10/21/36	180,000.00	170,618.40	
		ACGB 4.25% 12/21/35	260,000.00	248,110.20	
		ACGB 4.5% 04/21/33	150,000.00	148,608.00	
		ACGB 4.75% 06/21/54	160,000.00	144,689.60	
		ACGB 4.75% 10/21/37	160,000.00	157,276.80	
	オーストラリアドル 小計		7,000,000.00	6,212,474.40 (699,462,492)	
	ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	250,000.00	235,635.02	
		NZGB 1.5% 05/15/31	170,000.00	151,223.08	
		NZGB 1.75% 05/15/41	60,000.00	39,841.06	
		NZGB 2.75% 04/15/37	120,000.00	100,477.72	
		NZGB 2.75% 05/15/51	50,000.00	32,901.76	
		NZGB 2% 05/15/32	220,000.00	195,265.29	
		NZGB 3.5% 04/14/33	150,000.00	143,082.77	
		NZGB 3% 04/20/29	220,000.00	216,004.41	
		NZGB 4.25% 05/15/34	140,000.00	138,659.26	
		NZGB 4.25% 05/15/36	90,000.00	87,613.38	
		NZGB 4.5% 05/15/30	160,000.00	163,561.32	
		NZGB 4.5% 05/15/35	120,000.00	120,037.53	
		NZGB 5% 05/15/54	60,000.00	57,947.96	
	ニュージーランドドル 小計		1,810,000.00	1,682,250.56 (157,408,184)	
	シンガポールドル	SIGB 1.625% 07/01/31	175,000.00	173,110.02	
		SIGB 1.875% 03/01/50	40,000.00	37,840.00	
		SIGB 1.875% 10/01/51	50,000.00	46,850.00	
		SIGB 2.25% 08/01/36	100,000.00	101,058.50	
		SIGB 2.375% 07/01/39	60,000.00	61,169.99	
		SIGB 2.5% 04/01/30	70,000.00	71,897.00	
		SIGB 2.625% 05/01/28	70,000.00	71,322.99	
		SIGB 2.625% 08/01/32	60,000.00	62,310.00	
		SIGB 2.75% 03/01/35	60,000.00	63,090.00	
		SIGB 2.75% 03/01/46	90,000.00	98,010.00	
		SIGB 2.75% 04/01/42	60,000.00	64,607.99	
		SIGB 2.875% 07/01/29	120,000.00	124,008.00	
		SIGB 2.875% 08/01/28	110,000.00	112,876.50	
		SIGB 2.875% 09/01/27	60,000.00	60,881.99	
		SIGB 2.875% 09/01/30	90,000.00	93,937.50	
		SIGB 3.25% 06/01/54	60,000.00	72,659.10	
		SIGB 3.375% 05/01/34	70,000.00	76,510.00	

		SIGB 3.375% 09/01/33	80,000.00	87,080.00	
		SIGB 3% 04/01/29	40,000.00	41,399.99	
		SIGB 3% 08/01/72	60,000.00	71,459.95	
	シンガポールドル 小計		1,525,000.00	1,592,079.52 (199,821,900)	
	マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	820,000.00	791,726.29	
		MGS 3.582% 07/15/32	200,000.00	200,912.60	
		MGS 3.733% 06/15/28	580,000.00	585,719.90	
		MGS 3.757% 05/22/40	440,000.00	433,440.61	
		MGS 3.766% 01/15/41	70,000.00	69,500.38	
		MGS 3.828% 07/05/34	700,000.00	710,723.79	
		MGS 3.844% 04/15/33	630,000.00	641,310.89	
		MGS 3.899% 11/16/27	410,000.00	414,151.29	
		MGS 3.917% 07/15/55	390,000.00	378,952.95	
		MGS 4.054% 04/18/39	200,000.00	203,332.58	
		MGS 4.065% 06/15/50	190,000.00	192,691.29	
		MGS 4.18% 05/16/44	410,000.00	422,169.66	
		MGS 4.232% 06/30/31	230,000.00	238,696.69	
		MGS 4.254% 05/31/35	190,000.00	198,860.40	
		MGS 4.457% 03/31/53	540,000.00	577,690.97	
		MGS 4.498% 04/15/30	850,000.00	883,357.31	
		MGS 4.504% 04/30/29	700,000.00	723,110.15	
		MGS 4.642% 11/07/33	400,000.00	427,203.28	
		MGS 4.696% 10/15/42	590,000.00	643,313.16	
		MGS 4.736% 03/15/46	90,000.00	99,557.87	
		MGS 4.762% 04/07/37	690,000.00	750,743.59	
		MGS 4.893% 06/08/38	220,000.00	241,993.37	
		MGS 4.921% 07/06/48	420,000.00	481,281.27	
	マレーシアリンギット 小計		9,960,000.00	10,310,440.29 (410,595,756)	
	タイバーツ	THAIGB 1.34% 03/17/31	2,000,000.00	1,985,465.52	
		THAIGB 1.585% 12/17/35	3,800,000.00	3,679,352.01	
		THAIGB 1.6% 06/17/35	2,000,000.00	1,954,339.76	
		THAIGB 1.6% 12/17/29	4,000,000.00	4,035,996.40	
		THAIGB 1.66% 03/17/30	3,000,000.00	3,029,551.50	
		THAIGB 2.05% 04/17/28	5,300,000.00	5,387,487.63	
		THAIGB 2.4% 03/17/29	3,000,000.00	3,092,480.40	
		THAIGB 2.5% 06/17/71	1,500,000.00	1,207,159.86	
		THAIGB 2.65% 06/17/28	4,000,000.00	4,119,768.40	
		THAIGB 2.7% 06/17/40	3,500,000.00	3,590,063.75	
		THAIGB 2.75% 06/17/52	1,200,000.00	1,141,593.00	
		THAIGB 2.8% 06/17/34	2,000,000.00	2,144,034.20	
		THAIGB 2.875% 06/17/46	3,600,000.00	3,548,647.65	

		THAIGB 2.875% 12/17/28	500,000.00	520,436.65	
		THAIGB 2.98% 06/17/45	1,600,000.00	1,609,154.24	
		THAIGB 2% 06/17/42	2,000,000.00	1,831,714.48	
		THAIGB 2% 12/17/31	7,000,000.00	7,159,539.10	
		THAIGB 3.15% 06/17/50	1,700,000.00	1,743,442.65	
		THAIGB 3.3% 06/17/38	3,000,000.00	3,323,194.20	
		THAIGB 3.35% 06/17/33	3,300,000.00	3,652,091.85	
		THAIGB 3.39% 06/17/37	3,400,000.00	3,804,896.48	
		THAIGB 3.45% 06/17/43	1,200,000.00	1,297,773.24	
		THAIGB 3.6% 06/17/67	3,100,000.00	3,385,377.63	
		THAIGB 3.8% 06/14/41	2,000,000.00	2,325,956.80	
		THAIGB 4% 06/17/55	1,000,000.00	1,176,320.60	
		THAIGB 4% 06/17/72	1,800,000.00	2,118,686.04	
	タイバーツ 小計		70,500,000.00	72,864,524.04 (354,121,586)	
	インドネシアルピア	INDOGB 6.25% 06/15/36	2,000,000,000.00	1,858,140,000.00	
		INDOGB 6.375% 04/15/32	1,000,000,000.00	948,183,000.00	
		INDOGB 6.375% 08/15/28	4,000,000,000.00	3,939,080,000.00	
		INDOGB 6.5% 02/15/31	3,000,000,000.00	2,900,733,090.00	
		INDOGB 6.625% 02/15/34	5,500,000,000.00	5,268,951,820.00	
		INDOGB 6.75% 07/15/35	2,000,000,000.00	1,938,000,000.00	
		INDOGB 6.875% 04/15/29	2,000,000,000.00	1,977,907,260.00	
		INDOGB 6.875% 08/15/51	1,000,000,000.00	950,508,790.00	
		INDOGB 7.125% 06/15/42	2,000,000,000.00	1,963,569,140.00	
		INDOGB 7.125% 06/15/43	500,000,000.00	490,584,025.00	
		INDOGB 7.125% 08/15/40	1,000,000,000.00	985,050,000.00	
		INDOGB 7.125% 08/15/45	1,500,000,000.00	1,472,265,000.00	
		INDOGB 7.375% 05/15/48	2,500,000,000.00	2,513,000,000.00	
		INDOGB 7.5% 04/15/40	1,000,000,000.00	1,008,224,600.00	
		INDOGB 7.5% 05/15/38	2,000,000,000.00	2,034,720,000.00	
		INDOGB 7% 02/15/33	3,000,000,000.00	2,942,408,970.00	
		INDOGB 7% 09/15/30	1,500,000,000.00	1,481,392,110.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/29	2,500,000,000.00	2,556,911,750.00	
		INDOGB 8.375% 04/15/39	1,100,000,000.00	1,200,364,000.00	
	インドネシアルピア 小計		39,100,000,000.00	38,429,993,555.00 (345,869,941)	
	韓国ウォン	KTB 1.125% 09/10/39	100,000,000.00	68,319,252.00	
		KTB 1.375% 06/10/30	280,000,000.00	254,085,582.80	
		KTB 1.375% 12/10/29	400,000,000.00	368,154,172.00	
		KTB 1.5% 03/10/50	300,000,000.00	170,163,891.00	
		KTB 1.5% 09/10/36	200,000,000.00	154,942,848.00	
		KTB 1.5% 09/10/40	200,000,000.00	139,976,886.00	
		KTB 1.5% 12/10/30	200,000,000.00	179,957,728.00	

		KTB 1.875% 03/10/51	200,000,000.00	122,175,704.00	
		KTB 1.875% 06/10/29	100,000,000.00	94,883,647.00	
		KTB 1.875% 09/10/41	200,000,000.00	144,732,406.00	
		KTB 2.125% 03/10/47	200,000,000.00	137,579,234.00	
		KTB 2.25% 06/10/28	700,000,000.00	681,931,971.00	
		KTB 2.25% 09/10/37	100,000,000.00	82,216,501.00	
		KTB 2.375% 12/10/27	300,000,000.00	295,287,837.00	
		KTB 2.5% 03/10/52	400,000,000.00	278,805,932.00	
		KTB 2.5% 09/10/30	200,000,000.00	188,779,242.00	
		KTB 2.625% 03/10/30	400,000,000.00	382,434,136.00	
		KTB 2.625% 03/10/48	200,000,000.00	149,508,844.00	
		KTB 2.625% 03/10/55	200,000,000.00	140,622,038.00	
		KTB 2.625% 06/10/35	300,000,000.00	264,795,771.00	
		KTB 2.625% 09/10/55	200,000,000.00	140,068,090.00	
		KTB 2.75% 09/10/54	300,000,000.00	216,866,061.00	
		KTB 2.75% 12/10/28	200,000,000.00	195,550,730.00	
		KTB 2.75% 12/10/44	200,000,000.00	157,641,878.00	
		KTB 2.875% 09/10/44	200,000,000.00	161,119,570.00	
		KTB 2% 03/10/46	100,000,000.00	68,113,629.00	
		KTB 2% 03/10/49	200,000,000.00	130,055,276.00	
		KTB 2% 06/10/31	200,000,000.00	181,503,740.00	
		KTB 3.25% 03/10/28	700,000,000.00	695,728,572.00	
		KTB 3.25% 03/10/29	100,000,000.00	98,657,922.00	
		KTB 3.25% 03/10/53	500,000,000.00	403,343,220.00	
		KTB 3.25% 06/10/33	200,000,000.00	189,443,900.00	
		KTB 3.25% 09/10/42	100,000,000.00	86,620,743.00	
		KTB 3.25% 12/10/35	300,000,000.00	277,049,910.00	
		KTB 3.375% 06/10/32	200,000,000.00	192,390,994.00	
		KTB 3.5% 06/10/34	100,000,000.00	95,426,740.00	
		KTB 3.5% 09/10/28	100,000,000.00	99,616,420.00	
		KTB 3.625% 09/10/53	600,000,000.00	518,478,804.00	
		KTB 3.75% 12/10/33	300,000,000.00	292,020,273.00	
		KTB 3% 12/10/34	100,000,000.00	91,644,395.00	
		KTB 4.25% 12/10/32	200,000,000.00	201,706,820.00	
	韓国ウォン 小計		10,280,000,000.00	8,792,401,309.80 (944,532,503)	
	イスラエルシェケル	ILGOV 1.3% 04/30/32	440,000.00	390,040.80	
		ILGOV 1.5% 05/31/37	330,000.00	262,079.68	
		ILGOV 1% 03/31/30	280,000.00	256,997.51	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	100,000.00	97,725.97	
		ILGOV 2.8% 11/29/52	260,000.00	197,124.86	
		ILGOV 3.75% 02/28/29	380,000.00	383,842.82	

		ILGOV 3.75% 03/31/47	230,000.00	216,749.94	
		ILGOV 3.75% 07/31/31	140,000.00	142,030.32	
		ILGOV 3.75% 09/30/27	300,000.00	301,829.31	
		ILGOV 4.1% 07/31/28	100,000.00	101,542.08	
		ILGOV 4.15% 10/31/35	100,000.00	103,217.99	
		ILGOV 4.6% 08/31/29	160,000.00	165,848.97	
		ILGOV 4% 03/30/35	370,000.00	378,376.72	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	250,000.00	293,208.42	
	イスラエルシェケル 小計		3,440,000.00	3,290,615.39 (176,658,332)	
	オフショア人民元	CGB 1.29% 03/15/28	2,600,000.00	2,603,344.12	
		CGB 1.36% 12/15/27	2,500,000.00	2,505,156.50	
		CGB 1.42% 08/15/28	10,400,000.00	10,438,879.36	
		CGB 1.43% 01/25/30	5,500,000.00	5,515,748.70	
		CGB 1.45% 02/25/28	7,000,000.00	7,033,578.30	
		CGB 1.46% 05/25/28	3,000,000.00	3,015,431.40	
		CGB 1.54% 01/25/31	4,600,000.00	4,623,085.10	
		CGB 1.55% 07/25/30	5,500,000.00	5,542,859.30	
		CGB 1.61% 02/15/35	5,000,000.00	4,981,937.30	
		CGB 1.63% 10/25/30	3,500,000.00	3,533,431.30	
		CGB 1.65% 05/15/35	3,000,000.00	2,993,885.88	
		CGB 1.67% 05/25/35	2,000,000.00	2,001,052.00	
		CGB 1.72% 05/15/36	3,000,000.00	2,995,546.29	
		CGB 1.74% 10/15/29	2,000,000.00	2,025,993.60	
		CGB 1.75% 02/25/36	4,200,000.00	4,205,725.02	
		CGB 1.78% 09/15/32	6,000,000.00	6,095,889.00	
		CGB 1.78% 11/15/35	5,700,000.00	5,722,088.07	
		CGB 1.79% 03/25/32	5,000,000.00	5,082,317.50	
		CGB 1.83% 08/25/35	3,500,000.00	3,533,498.50	
		CGB 1.87% 09/15/31	4,000,000.00	4,085,463.20	
		CGB 1.92% 01/15/55	2,000,000.00	1,857,381.74	
		CGB 2.04% 11/25/34	6,000,000.00	6,192,739.80	
		CGB 2.05% 04/15/29	1,500,000.00	1,531,741.80	
		CGB 2.11% 08/25/34	4,300,000.00	4,462,914.53	
		CGB 2.12% 06/25/31	2,000,000.00	2,065,867.20	
		CGB 2.27% 05/25/34	4,530,000.00	4,754,891.39	
		CGB 2.28% 03/25/31	2,000,000.00	2,077,963.60	
		CGB 2.35% 02/25/34	6,000,000.00	6,332,263.20	
		CGB 2.37% 01/15/29	5,000,000.00	5,139,825.50	
		CGB 2.38% 01/15/56	1,000,000.00	1,022,932.10	
		CGB 2.4% 07/15/28	3,700,000.00	3,789,224.76	
		CGB 2.44% 10/15/27	8,600,000.00	8,732,600.82	
		CGB 2.48% 09/25/28	2,500,000.00	2,569,952.50	

		CGB 2.5% 07/25/27	6,500,000.00	6,585,590.70	
		CGB 2.52% 08/25/33	3,000,000.00	3,198,491.10	
		CGB 2.54% 12/25/30	1,800,000.00	1,889,270.64	
		CGB 2.55% 10/15/28	2,000,000.00	2,060,009.40	
		CGB 2.6% 09/15/30	5,500,000.00	5,774,231.65	
		CGB 2.62% 04/15/28	3,800,000.00	3,900,399.80	
		CGB 2.62% 06/25/30	4,400,000.00	4,614,183.20	
		CGB 2.62% 09/25/29	1,200,000.00	1,250,327.76	
		CGB 2.64% 01/15/28	1,000,000.00	1,023,379.20	
		CGB 2.65% 03/25/74	1,000,000.00	1,100,212.60	
		CGB 2.67% 05/25/33	2,200,000.00	2,365,768.68	
		CGB 2.67% 11/25/33	4,600,000.00	4,961,289.06	
		CGB 2.68% 05/21/30	3,000,000.00	3,146,668.50	
		CGB 2.69% 08/15/32	1,000,000.00	1,067,236.60	
		CGB 2.75% 02/17/32	3,000,000.00	3,210,268.80	
		CGB 2.75% 06/15/29	1,500,000.00	1,565,891.40	
		CGB 2.76% 05/15/32	6,300,000.00	6,758,706.78	
		CGB 2.79% 12/15/29	2,000,000.00	2,101,494.60	
		CGB 2.8% 03/24/29	5,000,000.00	5,217,818.50	
		CGB 2.8% 11/15/32	2,500,000.00	2,700,635.00	
		CGB 2.88% 02/25/33	1,700,000.00	1,851,454.87	
		CGB 2.91% 10/14/28	4,400,000.00	4,580,469.52	
		CGB 3.01% 05/13/28	3,600,000.00	3,732,413.76	
		CGB 3.02% 05/27/31	3,000,000.00	3,238,479.60	
		CGB 3.12% 10/25/52	2,000,000.00	2,339,254.60	
		CGB 3.13% 11/21/29	3,600,000.00	3,834,936.00	
		CGB 3.19% 04/15/53	1,200,000.00	1,423,557.96	
		CGB 3.27% 03/25/73	1,000,000.00	1,279,563.60	
		CGB 3.27% 11/19/30	2,000,000.00	2,173,085.00	
		CGB 3.32% 04/15/52	800,000.00	968,287.92	
		CGB 3.39% 03/16/50	2,700,000.00	3,261,528.72	
		CGB 3.4% 07/15/72	1,400,000.00	1,833,121.78	
		CGB 3.53% 10/18/51	3,000,000.00	3,741,436.20	
		CGB 3.72% 04/12/51	400,000.00	510,807.92	
		CGB 3.73% 05/25/70	1,050,000.00	1,465,366.24	
		CGB 3.76% 03/22/71	1,960,000.00	2,747,884.72	
		CGB 3.81% 09/14/50	2,000,000.00	2,563,577.40	
		CGB 3.82% 11/19/68	1,000,000.00	1,389,092.00	
		CGB 3.86% 07/22/49	3,700,000.00	4,767,871.43	
		CGB 3% 10/15/53	1,500,000.00	1,734,893.70	
		CGB 4.08% 10/22/48	3,700,000.00	4,905,810.02	
		CGB 4% 06/24/69	1,500,000.00	2,179,968.60	

	オフショア人民元 小計		245,640,000.00	260,079,944.91 (6,202,698,622)	
国債証券合計				48,358,353,876 (48,358,353,876)	
地方債証券	アメリカドル	ALTA 1.3% 07/22/30	200,000.00	178,005.84	
		BRCOL 4.2% 07/06/33	500,000.00	488,793.94	
		BRCOL 4.75% 06/12/34	200,000.00	200,768.49	
		CADEPO 4.625% 01/24/30	250,000.00	252,504.98	
		MP 4.3% 07/27/33	300,000.00	294,010.71	
		ONT 5.05% 04/24/34	200,000.00	205,431.00	
		Q 1.9% 04/21/31	300,000.00	268,173.51	
		Q 4.5% 09/08/33	400,000.00	397,139.94	
	アメリカドル 小計		2,350,000.00	2,284,828.41 (370,462,078)	
	カナダドル	ALTA 1.65% 06/01/31	100,000.00	92,679.79	
		ALTA 2.9% 09/20/29	100,000.00	99,489.41	
		ALTA 2.95% 06/01/52	200,000.00	148,465.43	
		ALTA 4.15% 06/01/33	100,000.00	103,671.32	
		BRCOL 1.55% 06/18/31	200,000.00	184,217.93	
		BRCOL 3.2% 06/18/44	100,000.00	82,790.53	
		BRCOL 4.45% 12/18/55	100,000.00	95,500.92	
		BRCOL 5.62% 08/17/28	100,000.00	105,488.65	
		MP 2.85% 09/05/46	100,000.00	75,763.64	
		MP 6.3% 03/05/31	100,000.00	112,798.44	
		NBRNS 2.9% 08/14/52	100,000.00	72,279.53	
		NBRNS 3.05% 06/03/30	200,000.00	198,941.66	
		NBRNS 4.55% 12/03/56	100,000.00	96,576.39	
		NBRNS 5.5% 01/27/34	100,000.00	111,790.38	
		NF 2.65% 10/17/50	100,000.00	69,018.16	
		NF 3.15% 12/02/52	200,000.00	150,314.59	
		NF 3.7% 10/17/48	200,000.00	169,233.45	
		NS 3.9% 06/01/36	200,000.00	198,954.52	
		NS 4.4% 06/01/42	100,000.00	98,622.13	
		NS 4.6% 12/01/55	200,000.00	194,219.71	
		ONT 1.55% 11/01/29	300,000.00	285,648.71	
		ONT 1.9% 12/02/51	200,000.00	118,472.48	
		ONT 2.25% 12/02/31	100,000.00	94,592.50	
		ONT 2.55% 12/02/52	100,000.00	68,194.46	
		ONT 2.65% 12/02/50	100,000.00	70,860.59	
		ONT 2.8% 06/02/48	200,000.00	149,276.30	
		ONT 2.9% 06/02/49	200,000.00	150,447.83	
		ONT 3.4% 09/08/28	200,000.00	201,953.67	

		ONT 3.45% 06/02/45	200,000.00	171,367.34	
		ONT 3.65% 06/02/33	100,000.00	100,617.88	
		ONT 3.75% 06/02/32	100,000.00	101,736.18	
		ONT 3.8% 12/02/34	200,000.00	200,915.42	
		ONT 4.15% 06/02/34	200,000.00	206,523.82	
		ONT 4.45% 12/02/56	100,000.00	96,698.18	
		ONT 4.65% 06/02/41	200,000.00	205,925.94	
		ONT 4.7% 06/02/37	100,000.00	105,825.37	
		ONT 4% 03/08/29	200,000.00	205,047.36	
		ONT 5.6% 06/02/35	300,000.00	341,132.91	
		ONT 6.2% 06/02/31	100,000.00	113,077.56	
		ONT 6.5% 03/08/29	100,000.00	108,923.51	
		PRINCE 3.95% 06/15/35	100,000.00	100,472.47	
		Q 1.9% 09/01/30	100,000.00	94,967.75	
		Q 3.5% 12/01/45	300,000.00	255,301.67	
		Q 3.6% 09/01/33	100,000.00	99,934.10	
		Q 5% 12/01/41	200,000.00	211,480.48	
		QHEL 3.6% 09/01/33	100,000.00	99,707.60	
		SCDA 3.75% 03/05/54	100,000.00	85,688.98	
		SCDA 4.2% 12/02/54	100,000.00	92,643.94	
		SCDA 4.4% 12/02/56	200,000.00	191,913.76	
		SCDA 4.75% 06/01/40	100,000.00	104,794.01	
	カナダドル 小計		7,400,000.00	6,894,959.35 (789,265,996)	
	ユーロ	ALTA 3.125% 10/16/34	200,000.00	196,319.23	
		BAYERN 0.01% 05/07/29	100,000.00	92,299.54	
		BERGER 0.01% 07/02/30	100,000.00	89,042.18	
		BERGER 0.125% 11/24/45	100,000.00	50,908.64	
		BERGER 0.625% 01/26/52	100,000.00	47,841.48	
		BERGER 0.625% 07/15/39	100,000.00	69,589.42	
		BERGER 3.6% 01/16/46	100,000.00	97,754.03	
		BRCOL 3.5% 05/29/40	100,000.00	96,071.92	
		HESLAN 2.625% 08/24/27	100,000.00	99,548.32	
		HESLAN 4% 02/04/30	100,000.00	102,663.49	
		HESSEN 1.3% 10/10/33	100,000.00	87,898.49	
		HESSEN 2.875% 01/10/33	100,000.00	98,524.12	
		HESSEN 2.875% 10/14/30	100,000.00	99,596.85	
		KOMINS 0.875% 09/01/29	100,000.00	94,109.04	
		KOMINS 2.875% 05/23/30	100,000.00	99,881.60	
		KOMINS 3% 02/20/30	200,000.00	200,626.80	
		KOMMUN 0.625% 11/21/39	200,000.00	137,894.06	
		KOMMUN 0% 11/17/29	100,000.00	90,924.30	
		LANDER 0.01% 02/04/31	100,000.00	87,028.44	

		LANDER 1.25% 05/04/29	100,000.00	95,519.25	
		LANDER 2.625% 02/27/30	100,000.00	98,727.84	
		MADRID 0.827% 07/30/27	100,000.00	98,137.45	
		MADRID 3.596% 04/30/33	100,000.00	101,993.79	
		NIESA 0.05% 03/09/35	100,000.00	76,010.52	
		NIESA 1.125% 09/12/33	100,000.00	87,054.54	
		NIESA 3.125% 01/10/36	100,000.00	98,454.26	
		NRW 0.375% 09/02/50	100,000.00	45,809.81	
		NRW 0.5% 11/25/39	100,000.00	68,000.21	
		NRW 0.6% 06/04/41	100,000.00	65,512.18	
		NRW 0% 10/12/35	100,000.00	74,088.94	
		NRW 1.45% 01/19/22	200,000.00	79,874.89	
		NRW 2.25% 06/14/52	100,000.00	73,947.77	
		NRW 2.75% 01/15/32	300,000.00	295,818.62	
		ONT 0.01% 11/25/30	100,000.00	87,789.55	
		ONT 0.25% 06/09/31	100,000.00	87,295.27	
		Q 3.125% 03/27/34	200,000.00	197,372.12	
		Q 3.875% 04/23/41	100,000.00	99,567.87	
		Q 3% 01/24/33	100,000.00	98,442.64	
		QTC 3.25% 05/21/35	100,000.00	98,345.76	
		SACHAN 0.125% 06/21/29	100,000.00	92,216.30	
	ユーロ 小計		4,700,000.00	4,058,501.53 (752,730,278)	
	オーストラリアドル	NSWTC 1.25% 11/20/30	200,000.00	172,536.00	
		NSWTC 1.5% 02/20/32	100,000.00	83,334.00	
		NSWTC 2.25% 05/07/41	100,000.00	64,556.00	
		NSWTC 2% 03/08/33	100,000.00	82,746.00	
		NSWTC 3% 04/20/29	200,000.00	191,374.00	
		NSWTC 3% 11/15/28	100,000.00	96,360.00	
		NSWTC 4.25% 02/20/36	100,000.00	91,196.00	
		NSWTC 4.75% 02/20/35	200,000.00	192,294.00	
		NSWTC 4.75% 02/20/37	100,000.00	93,633.00	
		NSWTC 5.25% 02/24/38	100,000.00	96,562.00	
		NZLGFA 4.4% 09/08/27	200,000.00	199,190.00	
		QTC 1.5% 03/02/32	100,000.00	83,286.00	
		QTC 1.75% 07/20/34	100,000.00	76,968.00	
		QTC 2.25% 10/28/50	100,000.00	51,092.00	
		QTC 3.25% 07/21/28	200,000.00	194,650.00	
		QTC 4.5% 03/09/33	100,000.00	97,133.00	
		QTC 4.5% 08/22/35	200,000.00	187,048.00	
		QTC 4.75% 02/02/34	200,000.00	194,958.00	
		QTC 5.25% 08/13/38	100,000.00	95,961.00	

		TCV 1.25% 11/19/27	100,000.00	95,647.00	
		TCV 1.5% 09/10/31	300,000.00	253,746.00	
		TCV 1.5% 11/20/30	200,000.00	174,230.00	
		TCV 2.25% 09/15/33	200,000.00	164,986.00	
		TCV 2.5% 10/22/29	200,000.00	186,670.00	
		TCV 2% 11/20/37	100,000.00	69,204.00	
		TCV 5.5% 09/15/39	200,000.00	193,616.00	
		WATC 1.5% 10/22/30	100,000.00	87,577.00	
		WATC 4.25% 07/20/33	200,000.00	190,956.00	
		WATC 4.5% 07/21/32	200,000.00	195,648.00	
		WATC 4.75% 10/24/35	200,000.00	192,358.00	
		WATC 5% 10/21/37	100,000.00	95,770.00	
	オーストラリアドル 小計		4,700,000.00	4,245,285.00 (477,976,638)	
地方債証券合計				2,390,434,990 (2,390,434,990)	
特殊債券	アメリカドル	AFDB 3.875% 06/12/28	100,000.00	99,400.06	
		AFDB 4.375% 03/14/28	100,000.00	100,273.86	
		AFDB 5.75% PERP	200,000.00	197,952.38	
		AGFRNC 4.875% 01/16/30	200,000.00	202,157.90	
		AIIB 4.125% 01/18/29	200,000.00	199,595.80	
		ASIA 1.5% 03/04/31	200,000.00	176,822.29	
		ASIA 1.75% 09/19/29	100,000.00	92,688.68	
		ASIA 1.875% 01/24/30	200,000.00	184,650.94	
		ASIA 4% 01/12/33	100,000.00	97,785.52	
		BNG 4.25% 01/14/36	200,000.00	194,138.12	
		CADES 4.5% 05/22/29	200,000.00	200,728.48	
		CADES 4% 03/03/33	200,000.00	191,957.16	
		CAF 4.625% 01/15/36	100,000.00	97,829.50	
		CAF 5% 01/22/30	100,000.00	101,659.95	
		CM 4.876% 01/14/30	200,000.00	202,955.99	
		COE 3.625% 01/26/28	100,000.00	99,142.64	
		COE 4.125% 01/24/29	100,000.00	99,762.96	
		CPPIBC 3.625% 10/15/28	250,000.00	246,770.90	
		DBJJP 4.125% 04/21/31	200,000.00	197,276.83	
		DBJJP 4.5% 01/30/34	200,000.00	197,981.69	
		EBRD 4.375% 03/09/28	100,000.00	100,287.57	
		EDC 4.75% 06/05/34	200,000.00	203,630.83	
		EIB 1.75% 03/15/29	100,000.00	93,827.76	
		EIB 4.375% 10/10/31	200,000.00	200,646.85	
		EIB 4.5% 03/14/30	100,000.00	100,862.64	
		EIB 4.625% 02/12/35	100,000.00	100,887.96	
		EIBKOR 2.5% 06/29/41	200,000.00	143,440.79	

		EIBKOR 5% 01/11/28	200,000.00	202,034.69	
		EXIMBK 5.5% 01/13/35	200,000.00	202,292.54	
		FNMA 0.75% 10/08/27	200,000.00	191,610.05	
		FNMA 5.625% 07/15/37	200,000.00	215,642.28	
		FNMA 7.125% 01/15/30	200,000.00	218,552.07	
		IADB 1.125% 01/13/31	100,000.00	87,184.27	
		IADB 3.5% 09/14/29	100,000.00	97,821.16	
		IADB 4.5% 02/15/30	100,000.00	100,847.18	
		IADB 4.5% 09/13/33	100,000.00	100,412.65	
		IBRD 1.125% 09/13/28	200,000.00	187,391.31	
		IBRD 1.375% 04/20/28	100,000.00	95,234.89	
		IBRD 3.5% 07/12/28	100,000.00	98,697.34	
		IBRD 4.7% 11/08/34	200,000.00	199,006.70	
		IDAWBG 3.875% 09/17/32	100,000.00	97,228.17	
		IDBINV 4.125% 02/15/28	100,000.00	99,802.86	
		IFC 0.75% 08/27/30	100,000.00	86,902.23	
		JBIC 4.375% 01/24/31	500,000.00	498,954.04	
		JICA 4.25% 05/22/30	200,000.00	198,941.25	
		KBN 4% 01/19/28	200,000.00	199,276.85	
		KDB 4.25% 09/08/32	200,000.00	196,707.57	
		KFW 0.75% 09/30/30	100,000.00	86,783.51	
		KFW 3.75% 02/15/28	200,000.00	198,788.04	
		KFW 4% 03/15/29	200,000.00	199,154.71	
		KOHNPW 4.625% 07/29/29	200,000.00	200,536.23	
		KORELE 4.75% 02/13/28	200,000.00	200,775.89	
		NIB 3.375% 09/08/27	200,000.00	198,099.19	
		NIB 4.25% 02/28/29	200,000.00	200,118.63	
		OKB 3.625% 09/09/27	200,000.00	198,831.97	
		OKB 4.125% 01/18/29	200,000.00	199,653.82	
		SDBC 1.625% 10/27/30	200,000.00	178,563.95	
		TVA 3.875% 03/15/28	200,000.00	199,220.03	
	アメリカドル 小計		9,750,000.00	9,560,182.12 (1,550,087,928)	
	カナダドル	ASIA 1.5% 05/04/28	100,000.00	97,609.27	
		CANHOU 1.4% 03/15/31	100,000.00	92,221.49	
		CANHOU 1.75% 06/15/30	300,000.00	284,888.43	
		CANHOU 2.15% 12/15/31	100,000.00	94,393.54	
		CANHOU 2.65% 12/15/28	100,000.00	99,376.71	
		CANHOU 3.1% 06/15/28	100,000.00	100,474.42	
		CANHOU 3.2% 06/15/31	200,000.00	199,753.27	
		CANHOU 3.5% 03/15/36	100,000.00	98,394.56	
		CANHOU 3.5% 12/15/34	400,000.00	397,218.59	
		CANHOU 3.55% 09/15/32	200,000.00	202,055.84	

		CANHOU 3.6% 12/15/27	300,000.00	303,671.17	
		CANHOU 3.65% 06/15/33	100,000.00	101,265.65	
		CANHOU 3.95% 06/15/28	200,000.00	204,126.84	
		CANHOU 4.15% 06/15/33	200,000.00	208,703.50	
		CANHOU 4.25% 03/15/34	200,000.00	209,696.05	
		IBRD 4.25% 09/18/30	100,000.00	104,128.04	
		IFC 2.55% 01/22/29	100,000.00	99,000.31	
		KFW 4.25% 09/19/28	100,000.00	102,649.30	
		QHEL 2% 09/01/28	100,000.00	98,063.39	
		QHEL 4% 02/15/55	100,000.00	88,225.76	
		QHEL 4% 02/15/63	200,000.00	174,661.54	
		QHEL 5% 02/15/50	100,000.00	103,378.21	
	カナダドル 小計		3,500,000.00	3,463,955.88 (396,519,029)	
	ユーロ	AGFRNC 0.125% 09/29/31	100,000.00	84,396.89	
		AGFRNC 3.625% 01/20/35	200,000.00	197,005.41	
		ASFING 0.125% 06/02/31	100,000.00	87,046.28	
		BNG 0.125% 07/09/35	100,000.00	75,300.79	
		BNG 0.75% 01/24/29	100,000.00	94,942.97	
		BNG 0.805% 06/28/49	100,000.00	52,556.43	
		BNG 1.25% 03/30/37	100,000.00	80,486.90	
		BNG 2.75% 10/04/27	100,000.00	100,038.98	
		BNG 3.375% 04/02/40	100,000.00	96,337.12	
		BNG 3% 04/23/30	100,000.00	100,281.93	
		CADES 0.45% 01/19/32	300,000.00	257,809.34	
		CADES 0% 05/25/29	100,000.00	92,009.27	
		CADES 2.875% 05/25/30	100,000.00	99,368.65	
		CADES 3.125% 03/01/30	200,000.00	200,470.84	
		CAF 3.625% 02/13/30	200,000.00	203,574.38	
		COE 0.25% 01/19/32	100,000.00	85,884.15	
		CPPIBC 2.875% 01/30/32	250,000.00	246,546.88	
		DBHNGR 1.875% 05/24/30	100,000.00	96,004.54	
		DBHNGR 3.25% 05/19/33	200,000.00	200,578.44	
		EDC 2.625% 01/18/29	200,000.00	198,819.06	
		EDF 4.375% 10/12/29	200,000.00	206,496.02	
		EFSF 0.05% 10/17/29	100,000.00	91,352.85	
		EFSF 0.7% 01/17/53	200,000.00	95,911.84	
		EFSF 0.875% 04/10/35	100,000.00	81,595.08	
		EFSF 0.875% 09/05/28	100,000.00	96,185.18	
		EFSF 0% 01/20/31	100,000.00	87,499.77	
		EFSF 2.875% 02/13/34	300,000.00	292,829.85	
		EFSF 2.875% 02/16/33	200,000.00	196,717.80	

		EFSF 3.125% 02/01/36	200,000.00	195,408.98	
		EIB 0.01% 11/15/35	100,000.00	74,151.30	
		EIB 0.05% 10/13/34	100,000.00	77,855.37	
		EIB 0.05% 11/15/29	100,000.00	91,297.49	
		EIB 0.2% 03/17/36	300,000.00	224,232.86	
		EIB 0.25% 01/20/32	100,000.00	86,251.50	
		EIB 0.25% 06/15/40	100,000.00	63,623.48	
		EIB 0.375% 09/15/27	100,000.00	97,432.98	
		EIB 0.625% 01/22/29	100,000.00	94,839.09	
		EIB 0% 09/09/30	100,000.00	88,909.05	
		EIB 2.625% 06/16/31	100,000.00	98,566.20	
		EIB 2.75% 01/16/34	200,000.00	195,039.80	
		EIB 2.75% 07/28/28	100,000.00	100,041.48	
		EIB 3.125% 05/15/37	200,000.00	196,026.11	
		EIB 3% 07/15/33	300,000.00	298,221.65	
		EIBKOR 2.625% 11/10/30	200,000.00	195,709.26	
		ESM 0.01% 10/15/31	100,000.00	86,033.22	
		ESM 3% 03/15/28	200,000.00	200,938.12	
		ESM 3% 08/23/33	100,000.00	99,443.72	
		EU 0.25% 04/22/36	100,000.00	74,122.25	
		EU 0.3% 11/04/50	200,000.00	87,568.33	
		EU 0.4% 02/04/37	100,000.00	72,859.50	
		EU 0.45% 05/02/46	300,000.00	158,109.00	
		EU 0.45% 07/04/41	200,000.00	123,447.60	
		EU 0.75% 01/04/47	100,000.00	55,868.85	
		EU 0% 07/04/31	500,000.00	432,062.50	
		EU 0% 07/04/35	100,000.00	74,678.77	
		EU 0% 10/04/28	400,000.00	376,360.58	
		EU 0% 10/04/30	100,000.00	88,674.77	
		EU 1.25% 02/04/43	200,000.00	135,877.10	
		EU 1.625% 12/04/29	500,000.00	480,437.00	
		EU 1% 07/06/32	100,000.00	88,842.20	
		EU 2.375% 07/12/29	200,000.00	197,391.60	
		EU 2.5% 10/04/52	100,000.00	73,425.75	
		EU 2.5% 12/04/31	200,000.00	194,820.40	
		EU 2.625% 02/04/48	100,000.00	79,304.10	
		EU 2.625% 07/04/28	300,000.00	299,288.70	
		EU 2.75% 12/04/37	200,000.00	184,898.99	
		EU 2.75% 12/13/32	500,000.00	489,176.25	
		EU 2% 10/04/27	100,000.00	99,211.50	
		EU 3.125% 12/04/30	200,000.00	201,465.00	
		EU 3.375% 10/05/54	200,000.00	172,850.54	
		EU 3.375% 11/04/42	200,000.00	186,843.55	

		EU 3.625% 12/12/40	300,000.00	292,890.60	
		EU 4% 04/04/44	200,000.00	200,507.46	
		EU 4% 10/12/55	100,000.00	96,384.83	
		EUROF 0.01% 06/23/28	100,000.00	94,498.72	
		EUROF 0.15% 10/10/34	100,000.00	77,330.50	
		IBRD 0.01% 04/24/28	300,000.00	285,877.34	
		IBRD 0.1% 09/17/35	100,000.00	75,135.49	
		IBRD 0.2% 01/21/61	100,000.00	31,525.14	
		IBRD 0.25% 01/10/50	200,000.00	90,369.47	
		IBRD 0.5% 04/16/30	100,000.00	91,568.27	
		IBRD 0.7% 10/22/46	100,000.00	56,611.44	
		IBRD 2.9% 01/19/33	100,000.00	99,029.95	
		ICO 3.05% 10/31/27	200,000.00	200,939.34	
		IDAWBG 0.7% 01/17/42	100,000.00	64,830.76	
		IDAWBG 1.75% 05/05/37	100,000.00	84,719.87	
		IDBINV 3.125% 11/15/27	100,000.00	100,389.49	
		KDB 3.375% 05/23/28	200,000.00	201,915.50	
		KFW 0.125% 01/09/32	300,000.00	257,025.60	
		KFW 0.375% 05/20/36	100,000.00	75,916.07	
		KFW 0% 01/10/31	200,000.00	175,725.73	
		KFW 2.375% 04/11/28	200,000.00	198,857.70	
		KFW 2.375% 06/29/29	200,000.00	197,590.11	
		KFW 2.5% 10/15/31	300,000.00	293,331.37	
		KFW 2.75% 02/14/33	100,000.00	98,164.23	
		KFW 2.75% 02/20/31	200,000.00	198,544.08	
		KFW 2.75% 03/15/28	300,000.00	300,240.00	
		KFW 2% 11/15/29	100,000.00	97,416.50	
		KFW 3% 01/04/36	100,000.00	97,852.30	
		LBANK 0.75% 03/16/32	100,000.00	87,509.43	
		NEDWBK 0.5% 04/26/51	100,000.00	45,718.21	
		NEDWBK 0.75% 10/04/41	100,000.00	65,303.68	
		NEDWBK 0% 02/16/37	300,000.00	209,217.51	
		NRWBK 0.1% 07/09/35	100,000.00	75,247.05	
		NRWBK 0.75% 06/30/28	100,000.00	95,976.98	
		NRWBK 0% 05/14/29	100,000.00	92,146.44	
		NRWBK 1.25% 05/13/49	100,000.00	59,203.26	
		NRWBK 1.625% 08/03/32	100,000.00	91,953.46	
		NRWBK 2.875% 04/05/33	100,000.00	98,340.73	
		RENTEN 0.01% 11/26/40	100,000.00	60,037.23	
		RENTEN 2.75% 02/16/32	200,000.00	197,165.07	
		RESFER 3.125% 10/25/28	100,000.00	100,166.48	
		SBAB 3.25% 02/06/30	100,000.00	100,434.65	

	SBAB 3.375% 05/21/31	200,000.00	199,247.30	
	SDBC 2.25% 07/02/28	100,000.00	98,799.55	
	SNCF 1% 01/19/61	100,000.00	35,246.41	
	SNCF 3.625% 04/03/35	100,000.00	98,764.10	
ユーロ 小計		18,950,000.00	16,735,319.53 (3,103,899,713)	
イギリスポンド	EIB 0.75% 07/22/27	100,000.00	96,659.31	
	EIB 3.875% 04/12/28	100,000.00	99,288.20	
	EIB 4.875% 12/16/30	100,000.00	101,479.37	
	EIB 5.625% 06/07/32	100,000.00	105,287.84	
	IADB 2.125% 12/15/28	100,000.00	94,906.00	
	IADB 5% 07/20/30	100,000.00	101,947.90	
	KFW 3.75% 07/30/27	100,000.00	99,558.64	
	KFW 4.875% 02/03/31	100,000.00	101,579.00	
	RENTEN 2.125% 12/15/28	100,000.00	94,882.35	
	SNCF 5.875% 01/29/55	100,000.00	94,997.28	
イギリスポンド 小計		1,000,000.00	990,585.89 (215,571,301)	
オーストラリアドル	AFDB 3.3% 07/27/27	100,000.00	98,490.00	
	ASIA 4.25% 01/17/28	100,000.00	99,325.00	
	BNG 1.6% 11/27/30	100,000.00	86,852.00	
	EDC 4.5% 09/06/28	100,000.00	99,493.00	
	EIB 4.55% 06/02/33	100,000.00	96,712.00	
	EUROF 3.35% 05/21/29	100,000.00	95,754.00	
	IBRD 4.4% 01/13/28	100,000.00	99,543.00	
	IFC 1.25% 02/06/31	100,000.00	85,445.00	
	KBN 5.25% 04/18/34	100,000.00	99,565.00	
	NEDWBK 3.3% 05/02/29	100,000.00	95,968.00	
	NIB 4.1% 06/08/28	100,000.00	98,606.00	
	NIB 4.7% 02/06/31	200,000.00	198,616.00	
	RENTEN 4.7% 07/29/31	200,000.00	198,658.00	
オーストラリアドル 小計		1,500,000.00	1,453,027.00 (163,596,309)	
オフショア人民元	ADBCH 1.59% 05/13/30	9,000,000.00	9,024,064.20	
	ADBCH 1.69% 08/07/30	7,000,000.00	7,043,783.60	
	ADBCH 1.82% 08/07/35	1,000,000.00	1,002,890.70	
	ADBCH 2.3% 07/04/34	2,000,000.00	2,083,927.60	
	ADBCH 2.5% 08/24/27	5,000,000.00	5,062,467.00	
	ADBCH 2.57% 09/13/28	5,000,000.00	5,120,552.00	
	ADBCH 2.85% 10/20/33	2,000,000.00	2,159,141.60	
	ADBCH 2.9% 03/08/28	2,000,000.00	2,048,387.60	
	ADBCH 2.91% 02/21/29	2,000,000.00	2,075,777.40	
	ADBCH 2.97% 10/14/32	2,000,000.00	2,157,184.00	

		ADBCH 3.1% 02/27/33	5,000,000.00	5,452,149.50	
		ADBCH 3.19% 08/12/28	2,000,000.00	2,072,608.60	
		ADBCH 3.3% 11/05/31	2,000,000.00	2,175,127.40	
		ADBCH 3.52% 05/24/31	1,000,000.00	1,091,546.50	
		ADBCH 3.79% 10/26/30	2,000,000.00	2,185,373.00	
		ADBCH 3.92% 06/18/51	1,000,000.00	1,333,210.60	
		ADBCH 3.95% 02/26/36	1,000,000.00	1,191,406.80	
		EXIMCH 2.44% 04/12/34	4,000,000.00	4,209,692.00	
		EXIMCH 2.5% 08/04/28	3,000,000.00	3,064,326.90	
		EXIMCH 2.87% 02/06/28	5,000,000.00	5,112,930.00	
		EXIMCH 2.9% 08/19/32	3,000,000.00	3,220,410.90	
		EXIMCH 3.1% 02/13/33	2,000,000.00	2,179,887.20	
		EXIMCH 3.23% 03/23/30	6,000,000.00	6,367,294.20	
		EXIMCH 3.86% 05/20/29	5,000,000.00	5,335,513.00	
		SDBC 1.27% 01/06/30	10,000,000.00	9,925,079.60	
		SDBC 1.57% 01/03/35	3,000,000.00	2,956,891.41	
		SDBC 1.65% 06/18/35	2,000,000.00	1,979,711.76	
		SDBC 1.79% 09/12/28	5,000,000.00	5,039,251.00	
		SDBC 1.79% 10/22/30	3,100,000.00	3,132,943.08	
		SDBC 1.8% 04/02/35	4,000,000.00	4,011,904.40	
		SDBC 1.8% 09/02/27	2,000,000.00	2,009,835.00	
		SDBC 1.87% 09/05/35	1,600,000.00	1,609,795.36	
		SDBC 2.26% 07/19/34	4,000,000.00	4,159,240.80	
		SDBC 2.3% 02/22/29	4,000,000.00	4,088,212.40	
		SDBC 2.63% 01/08/34	3,000,000.00	3,196,781.40	
		SDBC 2.73% 01/11/28	3,000,000.00	3,059,071.20	
		SDBC 2.82% 05/22/33	5,000,000.00	5,378,200.00	
		SDBC 2.96% 07/18/32	7,000,000.00	7,536,886.70	
		SDBC 2.98% 04/22/32	2,000,000.00	2,150,794.60	
		SDBC 2.99% 03/01/29	2,000,000.00	2,079,759.40	
		SDBC 3.03% 07/24/43	1,000,000.00	1,136,602.70	
		SDBC 3.09% 06/18/30	2,000,000.00	2,119,987.20	
		SDBC 3.4% 01/08/28	5,000,000.00	5,147,326.00	
		SDBC 3.41% 06/07/31	4,000,000.00	4,347,783.20	
		SDBC 3.49% 11/08/41	2,000,000.00	2,383,650.20	
		SDBC 3.5% 11/04/46	1,000,000.00	1,210,326.50	
		SDBC 3.66% 03/01/31	2,000,000.00	2,187,448.00	
		SDBC 3.8% 01/25/36	2,000,000.00	2,349,657.00	
		SDBC 3% 01/17/32	8,000,000.00	8,591,812.00	
	オフショア人民元 小計		166,700,000.00	174,558,603.21 (4,163,083,039)	
				9,592,757,319	

特殊債券合計				(9,592,757,319)	
社債券	アメリカドル	AALLN 5.75% 04/05/34	200,000.00	205,289.86	
		AAPL 1.4% 08/05/28	100,000.00	94,458.65	
		AAPL 2.65% 05/11/50	100,000.00	60,199.37	
		AAPL 2.7% 08/05/51	200,000.00	119,511.83	
		AAPL 3.35% 08/08/32	100,000.00	94,112.07	
		AAPL 3.75% 11/13/47	100,000.00	76,006.12	
		AAPL 4.1% 08/08/62	100,000.00	74,733.70	
		ABBV 4.3% 05/14/36	100,000.00	93,789.85	
		ABBV 4.45% 05/14/46	100,000.00	84,635.80	
		ABBV 5.35% 03/15/44	100,000.00	96,363.20	
		ABBV 5.5% 03/15/64	100,000.00	94,324.79	
		ABC 2.7% 03/15/31	100,000.00	91,055.61	
		ABIBB 4.7% 02/01/36	100,000.00	96,639.64	
		ABIBB 4.9% 02/01/46	100,000.00	89,950.32	
		ABIBB 5.55% 01/23/49	100,000.00	96,873.64	
		ABIBB 5% 06/15/34	100,000.00	100,442.21	
		ABNANV 2.47% 12/13/29	200,000.00	189,485.06	
		ABT 1.15% 01/30/28	100,000.00	95,461.43	
		ABT 1.4% 06/30/30	100,000.00	88,749.31	
		ACAFP 5.862% 01/09/36	250,000.00	255,763.78	
		ACGL 3.635% 06/30/50	100,000.00	71,715.46	
		ADBE 5.3% 01/17/35	100,000.00	100,940.75	
		ADM 4.5% 08/15/33	100,000.00	98,041.03	
		AEE 3.9% 04/01/52	100,000.00	74,637.18	
		AEE 5.2% 04/01/34	200,000.00	201,703.23	
		AEP 3.75% 07/01/47	100,000.00	74,471.48	
		AEP 5.45% 01/15/36	100,000.00	100,427.38	
		AEP 5.85% 10/15/55	100,000.00	96,583.72	
		AEP 6.2% 03/15/40	100,000.00	104,288.32	
		AER 3.4% 10/29/33	150,000.00	132,641.25	
		AER 3.85% 10/29/41	150,000.00	119,705.59	
		AER 4.625% 09/10/29	150,000.00	149,134.66	
		AES 5.45% 06/01/28	100,000.00	101,082.87	
		AFL 3.6% 04/01/30	100,000.00	96,312.34	
		AGCO 5.8% 03/21/34	100,000.00	101,523.80	
		AIA 5.375% 04/05/34	200,000.00	202,542.82	
		AJG 5.5% 03/02/33	100,000.00	101,709.28	
		AL 3.125% 12/01/30	100,000.00	92,605.77	
		ALL 1.45% 12/15/30	100,000.00	86,864.60	
		ALLY 5.737% 05/15/29	100,000.00	101,380.02	
		AMG 3.3% 06/15/30	100,000.00	94,283.75	

		AMGN 2% 01/15/32	100,000.00	86,235.03	
		AMGN 3.15% 02/21/40	100,000.00	77,164.98	
		AMGN 5.15% 03/02/28	100,000.00	100,917.06	
		AMGN 5.75% 03/02/63	100,000.00	95,428.39	
		AMP 5.15% 05/15/33	100,000.00	100,696.66	
		AMT 2.95% 01/15/51	100,000.00	61,497.93	
		AMT 3.8% 08/15/29	100,000.00	97,308.78	
		AMT 5.65% 03/15/33	100,000.00	102,618.91	
		AMZN 3.875% 08/22/37	100,000.00	88,178.21	
		AMZN 4.05% 08/22/47	100,000.00	77,348.82	
		AMZN 4.25% 08/22/57	100,000.00	74,422.65	
		AMZN 4.55% 12/01/27	100,000.00	100,335.89	
		AMZN 4.7% 12/01/32	100,000.00	99,756.44	
		AMZN 4.875% 03/13/36	100,000.00	96,998.08	
		AN 1.95% 08/01/28	100,000.00	94,445.83	
		ANZNZ 3.45% 01/21/28	200,000.00	197,239.67	
		AON 4.75% 05/15/45	100,000.00	86,633.90	
		APH 2.2% 09/15/31	100,000.00	88,451.92	
		APP 5.125% 12/01/29	100,000.00	100,796.52	
		ARE 4.75% 04/15/35	100,000.00	94,576.92	
		ATH 3.95% 05/25/51	100,000.00	67,937.15	
		ATH 5.875% 01/15/34	200,000.00	201,572.26	
		ATH 6.15% 04/03/30	100,000.00	103,475.21	
		ATO 5.75% 10/15/52	100,000.00	99,191.36	
		AVB 1.9% 12/01/28	100,000.00	94,138.97	
		AVGO 3.469% 04/15/34	200,000.00	177,880.40	
		AVGO 4.15% 04/15/32	100,000.00	95,948.56	
		AVGO 4.8% 04/15/28	200,000.00	201,159.55	
		AVGO 5.2% 07/15/35	100,000.00	99,327.35	
		AVOL 5.75% 03/01/29	200,000.00	203,836.50	
		AZN 4.85% 02/26/29	100,000.00	100,909.66	
		AZN 4.875% 03/03/33	100,000.00	100,243.20	
		AZO 4% 04/15/30	100,000.00	97,185.42	
		BA 3.25% 02/01/28	100,000.00	98,012.15	
		BA 5.15% 05/01/30	100,000.00	101,102.59	
		BA 5.805% 05/01/50	100,000.00	97,298.44	
		BA 6.388% 05/01/31	100,000.00	105,977.92	
		BABA 2.125% 02/09/31	200,000.00	179,928.25	
		BAC 1.898% 07/23/31	100,000.00	89,149.48	
		BAC 2.087% 06/14/29	100,000.00	95,197.24	
		BAC 2.572% 10/20/32	300,000.00	266,167.23	
		BAC 2.687% 04/22/32	200,000.00	180,606.65	

		BAC 3.483% 03/13/52	100,000.00	69,809.64	
		BAC 3.946% 01/23/49	100,000.00	77,023.96	
		BAC 4.083% 03/20/51	100,000.00	77,855.54	
		BAC 5.468% 01/23/35	200,000.00	202,887.74	
		BAC 5.819% 09/15/29	200,000.00	204,591.07	
		BACR 5.088% 06/20/30	200,000.00	200,391.74	
		BACR 6.036% 03/12/55	200,000.00	204,330.83	
		BATSLN 3.734% 09/25/40	100,000.00	80,100.09	
		BATSLN 4.906% 04/02/30	100,000.00	100,347.86	
		BAYNGR 4.7% 07/15/64	100,000.00	77,495.04	
		BDX 4.298% 08/22/32	100,000.00	96,648.08	
		BDX 4.693% 02/13/28	100,000.00	100,184.32	
		BFB 4.75% 04/15/33	100,000.00	98,750.05	
		BFCM 4.753% 07/13/27	200,000.00	200,731.98	
		BFCM 5.538% 01/22/30	200,000.00	203,840.89	
		BHF 5.625% 05/15/30	100,000.00	100,964.25	
		BHI 4.08% 12/15/47	100,000.00	78,317.95	
		BHP 5.3% 02/21/35	100,000.00	101,195.82	
		BIIB 3.15% 05/01/50	100,000.00	64,214.27	
		BK 4.596% 07/26/30	100,000.00	99,903.32	
		BK 5.188% 03/14/35	200,000.00	200,907.06	
		BK 5.834% 10/25/33	100,000.00	104,649.86	
		BKH 3.875% 10/15/49	100,000.00	72,919.81	
		BLK 1.9% 01/28/31	100,000.00	89,077.50	
		BMO 4.7% 09/14/27	100,000.00	100,340.57	
		BMW 4.65% 03/19/31	100,000.00	98,552.68	
		BMY 2.95% 03/15/32	100,000.00	91,025.15	
		BMY 4.25% 10/26/49	100,000.00	79,952.23	
		BMY 4.625% 05/15/44	100,000.00	87,721.38	
		BMY 5.5% 02/22/44	100,000.00	98,467.44	
		BNP 2.159% 09/15/29	200,000.00	189,036.67	
		BNP 5.738% 02/20/35	200,000.00	204,381.38	
		BNSF 2.875% 06/15/52	100,000.00	61,239.92	
		BNSF 3.05% 02/15/51	100,000.00	64,328.78	
		BNSF 4.05% 06/15/48	100,000.00	78,467.57	
		BOCAVI 4.875% 05/03/33	200,000.00	200,881.76	
		BPCEGP 6.347% 01/13/47	250,000.00	242,229.27	
		BPLN 3.001% 03/17/52	100,000.00	62,788.70	
		BPLN 3.06% 06/17/41	100,000.00	74,604.24	
		BPLN 4.893% 09/11/33	100,000.00	99,043.03	
		BRKHEC 2.85% 05/15/51	100,000.00	59,917.36	
		BRKHEC 3.7% 07/15/30	100,000.00	96,422.54	
		BRKHEC 3.95% 08/01/47	100,000.00	77,353.51	

		BRKHEC 5.3% 02/01/55	100,000.00	92,238.91	
		BRKHEC 5.35% 01/15/34	100,000.00	102,136.93	
		BRKHEC 5.8% 01/15/55	100,000.00	93,535.03	
		BRO 4.2% 03/17/32	200,000.00	189,586.36	
		BX 2.55% 03/30/32	200,000.00	176,334.44	
		BXP 3.25% 01/30/31	100,000.00	92,726.32	
		BXP 3.4% 06/21/29	100,000.00	96,028.82	
		C 2.904% 11/03/42	81,000.00	58,206.19	
		C 3.668% 07/24/28	100,000.00	99,061.78	
		C 4.503% 09/11/31	100,000.00	98,419.96	
		C 4.786% 03/04/29	200,000.00	200,388.19	
		C 5.592% 11/19/34	200,000.00	202,226.57	
		C 6.27% 11/17/33	200,000.00	212,307.34	
		C 6.675% 09/13/43	100,000.00	108,860.91	
		CAG 1.375% 11/01/27	100,000.00	95,879.27	
		CAG 5.3% 11/01/38	100,000.00	94,416.47	
		CARGIL 3.25% 05/23/29	100,000.00	96,654.58	
		CARR 3.577% 04/05/50	100,000.00	71,528.93	
		CAT 3.25% 04/09/50	100,000.00	69,215.45	
		CAT 3.6% 08/12/27	100,000.00	99,360.42	
		CAT 4.85% 02/27/29	100,000.00	101,177.56	
		CB 1.375% 09/15/30	100,000.00	87,478.37	
		CB 2.85% 12/15/51	100,000.00	62,359.42	
		CBAAU 3.305% 03/11/41	200,000.00	151,925.84	
		CBAAU 3.9% 03/16/28	200,000.00	198,637.71	
		CCI 4.8% 09/01/28	100,000.00	100,256.39	
		CCI 5.1% 05/01/33	100,000.00	98,583.56	
		CDW 5.55% 08/22/34	100,000.00	98,711.19	
		CEG 5.6% 06/15/42	100,000.00	97,746.38	
		CENEXP 4.124% 02/25/31	200,000.00	195,906.64	
		CHD 5.6% 11/15/32	100,000.00	104,114.93	
		CHH 3.7% 01/15/31	100,000.00	94,009.20	
		CHTR 2.25% 01/15/29	100,000.00	93,286.64	
		CHTR 2.8% 04/01/31	100,000.00	88,741.26	
		CHTR 3.5% 06/01/41	100,000.00	69,213.21	
		CHTR 3.9% 06/01/52	100,000.00	62,616.77	
		CHTR 5.75% 04/01/48	100,000.00	82,984.93	
		CI 2.375% 03/15/31	100,000.00	89,856.90	
		CI 4.8% 07/15/46	100,000.00	86,820.44	
		CL 4.6% 03/01/33	100,000.00	100,290.62	
		CLR 5.75% 01/15/31	100,000.00	101,695.23	
		CLX 5.25% 05/15/36	100,000.00	99,035.39	

		CM 3.6% 04/07/32	100,000.00	93,570.47	
		CMCSA 2.65% 02/01/30	100,000.00	92,513.91	
		CMCSA 3.9% 03/01/38	100,000.00	83,197.77	
		CMCSA 5.35% 05/15/53	100,000.00	83,870.93	
		CMI 4.7% 02/15/31	100,000.00	100,114.77	
		CMS 4.75% 06/01/50	100,000.00	98,214.34	
		CNA 2.05% 08/15/30	100,000.00	89,471.39	
		CNP 7% 02/15/55	100,000.00	103,558.60	
		COF 3.273% 03/01/30	100,000.00	96,205.46	
		COF 4.493% 09/11/31	100,000.00	98,004.85	
		COP 3.8% 03/15/52	100,000.00	72,256.66	
		COP 4.875% 10/01/47	100,000.00	87,718.65	
		CP 3% 12/02/41	100,000.00	73,401.88	
		CP 4.95% 08/15/45	100,000.00	90,825.08	
		CPB 2.375% 04/24/30	100,000.00	90,772.30	
		CSCO 5.05% 02/26/34	200,000.00	200,775.52	
		CSX 4.1% 11/15/32	100,000.00	96,466.29	
		CVS 1.75% 08/21/30	100,000.00	88,581.87	
		CVS 5.125% 02/21/30	100,000.00	101,002.11	
		CVS 5.125% 07/20/45	100,000.00	89,393.04	
		CVS 6% 06/01/44	100,000.00	99,688.46	
		CVS 6% 06/01/63	100,000.00	95,981.54	
		CVX 4.819% 04/15/32	100,000.00	100,647.11	
		CVX 6% 03/01/41	100,000.00	107,288.86	
		D 2.4% 03/30/32	100,000.00	88,038.22	
		D 3.3% 04/15/41	100,000.00	75,455.00	
		D 4.9% 09/15/35	100,000.00	97,345.45	
		D 6.2% 02/15/56	100,000.00	100,101.00	
		D 7% 06/01/54	100,000.00	105,569.40	
		DAL 3.75% 10/28/29	100,000.00	96,615.92	
		DANBNK 4.999% 03/27/32	200,000.00	199,670.45	
		DB 5.882% 07/08/31	200,000.00	202,992.16	
		DB 7.079% 02/10/34	200,000.00	214,439.50	
		DBSSP 3.989% 08/28/28	200,000.00	198,347.60	
		DE 2% 06/17/31	100,000.00	88,328.91	
		DE 4.75% 01/20/28	100,000.00	100,695.19	
		DE 4.85% 06/11/29	100,000.00	101,154.16	
		DELL 5.1% 02/15/36	100,000.00	97,976.67	
		DFS 7.964% 11/02/34	100,000.00	114,472.67	
		DG 4.125% 04/03/50	100,000.00	77,043.94	
		DGX 2.8% 06/30/31	100,000.00	91,232.87	
		DHR 3.25% 11/15/39	100,000.00	79,740.54	
		DIS 3.5% 05/13/40	100,000.00	80,984.48	

		DIS 3.6% 01/13/51	100,000.00	71,532.56	
		DIS 6.65% 11/15/37	100,000.00	111,078.30	
		DKS 4.1% 01/15/52	100,000.00	71,414.08	
		DLTR 4.2% 05/15/28	100,000.00	99,241.58	
		DOW 6.3% 03/15/33	100,000.00	104,901.97	
		DT 4.75% 06/21/38	150,000.00	142,089.11	
		DTE 3% 03/01/32	100,000.00	91,658.36	
		DTE 5.4% 04/01/53	100,000.00	94,563.79	
		DTRGR 4.95% 01/13/28	150,000.00	150,790.69	
		DUK 3.3% 06/15/41	200,000.00	150,815.50	
		DUK 3.64% 11/01/46	100,000.00	72,507.31	
		DUK 3.7% 09/01/28	100,000.00	98,509.81	
		DUK 5.25% 03/15/33	100,000.00	101,497.00	
		DUK 5.25% 04/01/33	100,000.00	101,478.79	
		DUK 5.55% 03/15/55	100,000.00	95,558.79	
		DUK 5% 08/15/52	100,000.00	86,237.73	
		DVN 4.5% 01/15/30	100,000.00	99,117.86	
		DVN 5.4% 02/15/35	100,000.00	99,871.78	
		EBAY 5.95% 11/22/27	100,000.00	101,782.23	
		ECL 5.25% 01/15/28	100,000.00	101,149.57	
		ED 5.15% 06/15/36	100,000.00	99,223.13	
		EDF 6.9% 05/23/53	200,000.00	213,322.62	
		EFX 2.35% 09/15/31	100,000.00	87,701.11	
		EIX 2.25% 06/01/30	100,000.00	90,518.06	
		EIX 4.125% 03/01/48	100,000.00	74,500.25	
		EIX 5.95% 11/01/32	100,000.00	103,910.77	
		EL 4.375% 05/15/28	100,000.00	99,803.22	
		ELV 4.75% 02/15/33	100,000.00	98,015.40	
		ELV 5.125% 02/15/53	100,000.00	88,084.69	
		EMR 2.2% 12/21/31	100,000.00	88,200.11	
		ENBCN 3.4% 08/01/51	100,000.00	66,761.32	
		ENBCN 5.7% 03/08/33	100,000.00	102,848.58	
		ENELIM 2.875% 07/12/41	200,000.00	140,091.19	
		EOG 4.375% 04/15/30	100,000.00	98,931.88	
		EPD 3.7% 01/31/51	100,000.00	72,461.33	
		EPD 4.25% 02/15/48	100,000.00	80,674.56	
		EPD 4.95% 02/15/35	100,000.00	98,661.57	
		EPD 7.55% 04/15/38	100,000.00	117,615.60	
		EQH 4.35% 04/20/28	34,000.00	33,802.18	
		EQIX 2.5% 05/15/31	100,000.00	89,383.73	
		EQNR 3.7% 04/06/50	200,000.00	147,881.84	
		EQNR 4.75% 11/14/35	200,000.00	193,735.84	

		EQR 4% 08/01/47	100,000.00	79,150.15	
		ES 3.45% 01/15/50	100,000.00	68,371.49	
		ES 5.45% 03/01/28	100,000.00	101,156.52	
		ES 5.95% 02/01/29	100,000.00	102,757.58	
		ET 4.15% 09/15/29	100,000.00	98,191.20	
		ET 5.55% 02/15/28	100,000.00	101,365.16	
		ET 5.7% 04/01/35	100,000.00	101,929.32	
		ET 5.75% 02/15/33	100,000.00	103,085.96	
		ETR 1.9% 06/15/28	100,000.00	95,018.64	
		ETR 2.4% 06/15/31	100,000.00	88,846.52	
		EXC 4.1% 03/15/52	100,000.00	75,196.95	
		EXC 5.15% 03/15/28	100,000.00	100,901.65	
		EXPE 4.625% 08/01/27	100,000.00	100,034.50	
		F 5.8% 03/08/29	200,000.00	201,687.25	
		F 7.35% 11/04/27	200,000.00	205,361.75	
		FANG 5.9% 04/18/64	100,000.00	95,951.23	
		FDX 2.4% 05/15/31	100,000.00	89,944.29	
		FDX 3.1% 08/05/29	100,000.00	95,772.20	
		FE 5.95% 12/15/36	100,000.00	102,943.86	
		FE 5% 01/15/31	100,000.00	100,622.09	
		FI 5.6% 03/02/33	100,000.00	100,879.90	
		FIS 2.25% 03/01/31	100,000.00	88,537.86	
		FIS 3.1% 03/01/41	100,000.00	71,912.16	
		FISV 5.45% 03/02/28	100,000.00	101,030.68	
		FITB 4.772% 07/28/30	100,000.00	99,710.28	
		FLEX 6% 01/15/28	100,000.00	101,670.80	
		FNF 2.45% 03/15/31	100,000.00	88,366.48	
		FUKOKU 6.8% PERP	200,000.00	209,920.00	
		GBLATL 6.75% 03/15/54	100,000.00	94,359.78	
		GD 2.85% 06/01/41	100,000.00	73,898.56	
		GE 4.35% 05/01/50	100,000.00	83,384.76	
		GILD 5.25% 10/15/33	100,000.00	102,148.26	
		GIS 4.95% 03/29/33	100,000.00	98,999.53	
		GIS 5.5% 10/17/28	100,000.00	102,059.10	
		GLENLN 5.371% 04/04/29	100,000.00	101,397.60	
		GLENLN 6.141% 04/01/55	100,000.00	100,839.41	
		GM 3.1% 01/12/32	100,000.00	90,278.26	
		GM 5.05% 04/04/28	100,000.00	100,562.53	
		GM 5.15% 04/01/38	100,000.00	94,487.08	
		GM 5.4% 10/15/29	100,000.00	101,918.35	
		GM 5.9% 01/07/35	100,000.00	102,059.06	
		GMT 3.5% 06/01/32	100,000.00	92,363.60	
		GMT 5.45% 09/15/33	100,000.00	101,778.74	

		GOOGL 1.9% 08/15/40	100,000.00	65,511.56	
		GOOGL 2.05% 08/15/50	100,000.00	51,789.41	
		GOOGL 4.8% 02/15/36	100,000.00	97,068.51	
		GOOGL 5.65% 02/15/56	200,000.00	190,626.80	
		GOOGL 5.7% 11/15/75	100,000.00	92,796.24	
		GPN 4.95% 08/15/27	100,000.00	100,322.43	
		GPN 5.95% 08/15/52	100,000.00	93,267.26	
		GS 1.992% 01/27/32	100,000.00	87,664.98	
		GS 2.6% 02/07/30	100,000.00	92,785.25	
		GS 3.8% 03/15/30	200,000.00	193,114.81	
		GS 4.482% 08/23/28	500,000.00	499,443.94	
		GS 6.45% 05/01/36	100,000.00	106,037.85	
		GS 6.75% 10/01/37	100,000.00	108,463.90	
		HAL 2.92% 03/01/30	100,000.00	93,808.24	
		HAS 6.05% 05/14/34	100,000.00	103,851.76	
		HBAN 4.443% 08/04/28	100,000.00	99,812.18	
		HCA 2.375% 07/15/31	100,000.00	88,662.10	
		HCA 4.375% 03/15/42	100,000.00	84,072.88	
		HCA 5.6% 04/01/34	100,000.00	101,722.69	
		HCA 5.625% 09/01/28	100,000.00	101,570.24	
		HD 0.9% 03/15/28	100,000.00	94,659.07	
		HD 3.3% 04/15/40	100,000.00	79,388.35	
		HD 3.625% 04/15/52	100,000.00	71,163.75	
		HD 4.95% 06/25/34	100,000.00	99,803.59	
		HIG 4.4% 03/15/48	100,000.00	82,451.92	
		HNDA 1.8% 01/13/31	100,000.00	87,136.57	
		HNDA 4.7% 01/12/28	100,000.00	100,147.22	
		HNDA 4.9% 01/10/34	100,000.00	97,410.73	
		HON 4.5% 01/15/34	100,000.00	97,082.64	
		HPE 5% 10/15/34	100,000.00	97,462.06	
		HPQ 4% 04/15/29	100,000.00	98,049.94	
		HSBC 6.5% 05/02/36	200,000.00	210,781.74	
		HSBC 6.8% 06/01/38	200,000.00	217,943.38	
		HUM 5.75% 12/01/28	200,000.00	204,080.02	
		HYNMTR 5.4% 03/29/32	100,000.00	101,245.75	
		HYNMTR 5.8% 04/01/30	100,000.00	102,828.12	
		IBM 3.5% 05/15/29	100,000.00	97,132.78	
		IBM 4.15% 07/27/27	100,000.00	99,866.89	
		IBM 4.75% 02/06/33	100,000.00	99,056.12	
		ICE 2.65% 09/15/40	100,000.00	71,848.00	
		IFCCN 5.459% 09/22/32	100,000.00	101,915.14	
		INTC 5.125% 02/10/30	100,000.00	101,059.49	

		INTC 5.15% 02/21/34	100,000.00	99,314.34	
		INTC 5.7% 02/10/53	100,000.00	92,563.36	
		IR 5.7% 08/14/33	100,000.00	103,275.80	
		ISPIM 4% 09/23/29	200,000.00	195,419.08	
		J 5.9% 03/01/33	100,000.00	102,807.53	
		JEF 5.125% 04/28/31	100,000.00	98,702.26	
		JNJ 1.3% 09/01/30	100,000.00	88,408.52	
		JNJ 2.1% 09/01/40	100,000.00	69,244.92	
		JPM 2.963% 01/25/33	200,000.00	180,186.23	
		JPM 4.26% 02/22/48	200,000.00	163,737.88	
		JPM 4.979% 07/22/28	400,000.00	401,676.34	
		JPM 5.012% 01/23/30	500,000.00	502,738.78	
		JPM 5.625% 08/16/43	200,000.00	199,955.17	
		KDP 3.95% 04/15/29	100,000.00	97,881.63	
		KHC 5.2% 03/15/32	100,000.00	101,120.33	
		KHC 6.5% 02/09/40	100,000.00	104,951.97	
		KIM 1.9% 03/01/28	100,000.00	96,073.69	
		KLAC 5% 03/15/49	100,000.00	90,223.61	
		KMB 3.2% 04/25/29	100,000.00	96,616.80	
		KMI 3.6% 02/15/51	100,000.00	69,380.74	
		KMI 5.15% 06/01/30	100,000.00	101,518.43	
		KMI 5.2% 03/01/48	100,000.00	89,701.94	
		KMI 5.2% 06/01/33	100,000.00	101,028.53	
		KO 1.375% 03/15/31	100,000.00	86,990.72	
		KO 3% 03/05/51	100,000.00	65,161.91	
		KR 4.45% 02/01/47	100,000.00	81,690.12	
		KR 5.5% 09/15/54	100,000.00	92,492.97	
		LH 2.95% 12/01/29	100,000.00	94,538.72	
		LHX 5.35% 06/01/34	100,000.00	101,250.84	
		LIN 1.1% 08/10/30	100,000.00	87,569.13	
		LIN 2% 08/10/50	100,000.00	52,655.50	
		LLY 3.375% 03/15/29	100,000.00	97,460.09	
		LLY 4.15% 03/15/59	100,000.00	77,502.96	
		LLY 5.1% 02/09/64	100,000.00	89,496.61	
		LMT 5.2% 02/15/64	100,000.00	90,412.95	
		LMT 5.7% 11/15/54	100,000.00	98,771.32	
		LNC 5.35% 11/15/35	100,000.00	97,421.34	
		LOW 4.05% 05/03/47	100,000.00	77,232.79	
		LOW 5.15% 07/01/33	100,000.00	100,602.32	
		LOW 5.625% 04/15/53	100,000.00	94,821.08	
		LRCX 4% 03/15/29	100,000.00	98,834.26	
		LVS 6% 08/15/29	100,000.00	102,507.77	
		LYB 3.375% 10/01/40	100,000.00	73,191.91	

		LYB 4.2% 05/01/50	100,000.00	71,869.14	
		MA 2.95% 03/15/51	100,000.00	63,801.99	
		MAERSK 4.5% 06/20/29	100,000.00	99,683.45	
		MAR 2.75% 10/15/33	100,000.00	86,609.84	
		MBGGR 2.45% 03/02/31	150,000.00	134,770.86	
		MCD 3.5% 07/01/27	100,000.00	99,188.18	
		MCD 4.2% 04/01/50	100,000.00	78,844.80	
		MCD 4.6% 09/09/32	100,000.00	99,615.66	
		MCD 5.15% 09/09/52	100,000.00	90,136.82	
		MCO 2.75% 08/19/41	100,000.00	70,718.79	
		MDLZ 1.5% 02/04/31	100,000.00	86,877.21	
		MDT 4.25% 03/30/28	100,000.00	99,762.57	
		MET 2.4% 01/11/32	200,000.00	175,992.39	
		META 4.55% 08/15/31	200,000.00	197,724.34	
		META 4.65% 08/15/62	100,000.00	73,591.01	
		META 4.8% 05/15/30	100,000.00	100,737.70	
		META 5.5% 11/15/45	100,000.00	90,496.59	
		META 6.2% 05/15/46	100,000.00	97,248.29	
		MFCCN 3.703% 03/16/32	100,000.00	94,690.48	
		MITCO 5.125% 07/17/34	200,000.00	200,833.58	
		MIZUHO 5.422% 05/13/36	200,000.00	200,660.24	
		MKC 2.5% 04/15/30	100,000.00	92,402.63	
		MLM 4.25% 12/15/47	100,000.00	79,969.36	
		MMC 4.75% 03/15/39	100,000.00	93,592.40	
		MMM 2.375% 08/26/29	100,000.00	93,705.14	
		MO 3.4% 02/04/41	100,000.00	75,736.62	
		MO 5.8% 02/14/39	100,000.00	100,597.05	
		MPC 3.8% 04/01/28	100,000.00	98,774.80	
		MPLX 2.65% 08/15/30	100,000.00	91,857.58	
		MPLX 5.2% 12/01/47	100,000.00	88,544.29	
		MQGAU 2.871% 01/14/33	100,000.00	89,040.19	
		MRK 2.15% 12/10/31	100,000.00	87,957.11	
		MRK 3.4% 03/07/29	100,000.00	97,483.07	
		MRK 4.9% 05/17/44	100,000.00	91,310.67	
		MRKGR 4.125% 08/15/28	150,000.00	148,527.85	
		MRVL 5.3% 04/15/36	100,000.00	98,859.83	
		MS 3.217% 04/22/42	100,000.00	75,422.54	
		MS 3.622% 04/01/31	200,000.00	190,947.59	
		MS 4.457% 04/22/39	100,000.00	91,188.61	
		MS 4.493% 01/16/32	200,000.00	195,543.18	
		MS 5.073% 01/30/37	100,000.00	97,084.52	
		MS 5.449% 07/20/29	200,000.00	202,521.15	

		MS 5.516% 11/19/55	200,000.00	189,331.87	
		MS 5.597% 03/24/51	100,000.00	96,190.68	
		MS 6.296% 10/18/28	100,000.00	102,097.04	
		MSCI 3.25% 08/15/33	100,000.00	87,696.34	
		MSFT 1.35% 09/15/30	100,000.00	88,575.83	
		MSFT 2.675% 06/01/60	100,000.00	53,775.17	
		MSFT 2.921% 03/17/52	100,000.00	61,911.12	
		MSFT 4.1% 02/06/37	100,000.00	93,263.17	
		MTB 6.082% 03/13/32	100,000.00	104,046.24	
		MTNA 4.25% 07/16/29	100,000.00	98,570.06	
		MUFG 4.286% 07/26/38	100,000.00	92,323.51	
		MUFG 4.7% 03/10/44	200,000.00	179,815.87	
		MUFG 4.847% 04/21/32	200,000.00	198,442.58	
		MUNRE 5.875% 05/23/42	200,000.00	203,998.42	
		NDAQ 1.65% 01/15/31	100,000.00	87,582.03	
		NEE 2.45% 02/03/32	100,000.00	88,999.11	
		NEE 4.9% 03/15/29	200,000.00	201,586.41	
		NEE 5.05% 04/01/28	100,000.00	101,121.65	
		NEE 5.25% 02/28/53	100,000.00	89,301.96	
		NEE 5.45% 03/15/35	100,000.00	100,966.44	
		NEM 5.875% 04/01/35	100,000.00	104,868.92	
		NESNVX 2.5% 09/14/41	150,000.00	105,240.67	
		NESNVX 4.8% 03/18/36	200,000.00	196,987.51	
		NFG 3.95% 09/15/27	100,000.00	99,223.32	
		NFLX 4.875% 06/15/30	100,000.00	100,413.09	
		NFLX 5.875% 11/15/28	100,000.00	103,102.73	
		NI 4.375% 05/15/47	100,000.00	81,211.63	
		NI 5.35% 07/15/35	100,000.00	100,294.90	
		NIPLIF 2.9% 09/16/51	200,000.00	177,250.07	
		NNN 3.5% 04/15/51	100,000.00	69,783.98	
		NOC 4.9% 06/01/34	100,000.00	99,035.51	
		NOC 5.15% 05/01/40	100,000.00	97,223.83	
		NOMURA 5.491% 06/29/35	200,000.00	201,493.24	
		NOMURA 6.087% 07/12/33	200,000.00	209,834.28	
		NOV 3.6% 12/01/29	100,000.00	96,169.22	
		NOVNVX 2.2% 08/14/30	100,000.00	91,276.34	
		NOVNVX 5.3% 11/05/55	100,000.00	94,726.95	
		NRG 2.45% 12/02/27	100,000.00	96,799.09	
		NRUC 4.3% 03/15/49	100,000.00	81,577.10	
		NRUC 4.3% 12/10/30	100,000.00	98,466.67	
		NSC 3% 03/15/32	100,000.00	91,388.97	
		NSC 4.15% 02/28/48	100,000.00	79,544.90	
		NTRCN 5.8% 03/27/53	100,000.00	97,943.88	

		NTRS 3.65% 08/03/28	100,000.00	98,616.46	
		NTT 2.065% 04/03/31	200,000.00	175,511.19	
		NUE 3.85% 04/01/52	100,000.00	75,021.82	
		NVDA 4.5% 06/15/31	200,000.00	198,405.09	
		NWIDE 4.85% 07/27/27	200,000.00	201,052.14	
		NYLIFE 4.2% 04/20/29	200,000.00	198,074.19	
		OC 3.95% 08/15/29	100,000.00	97,698.20	
		OGS 2% 05/15/30	100,000.00	90,459.90	
		OGS 4.25% 09/01/32	100,000.00	97,143.28	
		OHI 3.625% 10/01/29	100,000.00	95,870.69	
		OKE 5.05% 11/01/34	100,000.00	97,296.64	
		OKE 5.2% 07/15/48	100,000.00	87,229.42	
		OKE 6.1% 11/15/32	100,000.00	104,921.08	
		OMC 2.6% 08/01/31	100,000.00	89,460.86	
		OMC 3.375% 03/01/41	100,000.00	74,045.96	
		ORCL 2.875% 03/25/31	200,000.00	177,900.50	
		ORCL 3.65% 03/25/41	100,000.00	69,906.07	
		ORCL 4.5% 05/06/28	100,000.00	99,344.02	
		ORCL 5.2% 09/26/35	100,000.00	92,426.09	
		ORCL 5.7% 02/04/36	200,000.00	190,238.38	
		ORCL 6.15% 11/09/29	100,000.00	102,749.01	
		ORCL 6.9% 11/09/52	100,000.00	92,725.63	
		ORIX 2.25% 03/09/31	100,000.00	88,880.08	
		ORIX 5% 09/13/27	100,000.00	100,629.45	
		OTIS 3.112% 02/15/40	100,000.00	76,269.01	
		OXY 6.45% 09/15/36	100,000.00	106,616.96	
		PCG 3.3% 08/01/40	100,000.00	74,297.67	
		PCP 4.375% 06/15/45	100,000.00	85,222.76	
		PEAK 2.125% 12/01/28	100,000.00	94,296.85	
		PEG 4.05% 05/01/48	100,000.00	78,543.34	
		PEG 5.05% 03/01/35	100,000.00	99,487.82	
		PEG 5.2% 08/01/33	100,000.00	101,656.41	
		PEP 1.95% 10/21/31	100,000.00	87,744.20	
		PEP 4.65% 02/15/53	100,000.00	86,522.03	
		PERTIJ 2.3% 02/09/31	200,000.00	175,679.38	
		PERTIJ 3.1% 01/21/30	200,000.00	186,408.88	
		PETMK 4.95% 01/03/31	200,000.00	202,188.07	
		PFE 2.55% 05/28/40	100,000.00	71,854.95	
		PFE 2.625% 04/01/30	100,000.00	93,231.68	
		PFE 4.45% 05/19/28	100,000.00	100,038.40	
		PFE 4.65% 05/19/30	100,000.00	100,072.62	
		PFG 3.7% 05/15/29	100,000.00	97,494.96	

		PG 3.55% 03/25/40	100,000.00	84,874.93	
		PG 4.35% 01/29/29	100,000.00	100,338.95	
		PH 4.5% 09/15/29	100,000.00	99,782.29	
		PKG 4.05% 12/15/49	100,000.00	76,626.91	
		PLD 4.75% 06/15/33	100,000.00	98,577.53	
		PLD 5.25% 06/15/53	100,000.00	93,227.93	
		PLNIJ 4% 06/30/50	200,000.00	137,840.68	
		PM 4.625% 10/29/35	100,000.00	95,806.63	
		PM 4.625% 11/01/29	100,000.00	99,969.24	
		PM 5.375% 02/15/33	100,000.00	102,208.52	
		PNC 2.55% 01/22/30	100,000.00	92,928.44	
		PNC 5.354% 12/02/28	200,000.00	202,056.85	
		PNC 5.401% 07/23/35	100,000.00	100,726.14	
		PPL 4.125% 04/15/30	100,000.00	97,635.02	
		PRU 4.65% 08/27/31	150,000.00	148,647.93	
		PRUFIN 3.625% 03/24/32	100,000.00	93,556.71	
		PSA 5.1% 08/01/33	100,000.00	100,723.60	
		PSX 3.3% 03/15/52	100,000.00	64,611.84	
		PSX 4.95% 12/01/27	100,000.00	100,623.76	
		PTTEPT 2.993% 01/15/30	200,000.00	188,450.94	
		PWR 4.75% 08/09/27	100,000.00	100,300.12	
		PXD 2.15% 01/15/31	100,000.00	89,463.50	
		PYPL 4.4% 06/01/32	100,000.00	97,018.25	
		QCOM 6% 05/20/53	100,000.00	100,487.70	
		R 4.3% 12/01/30	100,000.00	98,342.01	
		RCICN 4.5% 03/15/42	200,000.00	167,945.49	
		RDSALN 2.75% 04/06/30	100,000.00	93,686.66	
		RDSALN 2.875% 11/26/41	100,000.00	72,420.35	
		RDSALN 5.125% 10/15/41	100,000.00	95,025.77	
		RECLIN 5.625% 04/11/28	200,000.00	201,824.24	
		RGA 6% 09/15/33	100,000.00	103,674.00	
		RIOLN 5.25% 03/14/35	100,000.00	100,944.36	
		ROP 4.9% 10/15/34	100,000.00	96,313.74	
		ROSW 4.075% 12/02/30	200,000.00	195,563.37	
		ROSW 5.218% 03/08/54	200,000.00	188,408.13	
		RPRX 2.2% 09/02/30	100,000.00	90,134.70	
		RRX 6.3% 02/15/30	100,000.00	104,123.46	
		RSG 5% 04/01/34	100,000.00	99,989.81	
		RTX 4.35% 04/15/47	100,000.00	82,696.94	
		RTX 5.75% 01/15/29	100,000.00	102,832.16	
		RVTY 2.55% 03/15/31	100,000.00	89,909.34	
		SANTAN 6.033% 01/17/35	200,000.00	208,638.56	
		SANUSA 6.499% 03/09/29	100,000.00	102,528.17	

		SBUX 4.45% 08/15/49	100,000.00	81,271.46	
		SBUX 4.8% 02/15/33	100,000.00	99,233.15	
		SCHW 3.25% 05/22/29	100,000.00	96,666.98	
		SCHW 5.853% 05/19/34	100,000.00	103,913.82	
		SF 4% 05/15/30	100,000.00	96,507.70	
		SHBASS 4.375% 06/11/29	250,000.00	248,803.65	
		SHW 4.5% 08/15/30	100,000.00	99,099.99	
		SIEGR 5.9% 05/28/65	200,000.00	201,319.53	
		SLB 2.65% 06/26/30	100,000.00	92,714.23	
		SNX 5.3% 10/10/35	100,000.00	97,686.79	
		SO 3.7% 04/30/30	100,000.00	96,417.01	
		SO 3.7% 12/01/47	100,000.00	74,068.43	
		SO 4.25% 07/01/36	200,000.00	183,534.34	
		SO 5.1% 09/15/35	100,000.00	98,475.73	
		SOCGEN 3.653% 07/08/35	200,000.00	186,497.04	
		SOCGEN 5.634% 01/19/30	200,000.00	203,303.93	
		SON 2.85% 02/01/32	100,000.00	89,617.22	
		SPG 2.45% 09/13/29	100,000.00	93,521.63	
		SPGI 4.75% 08/01/28	100,000.00	100,529.18	
		SPLLLC 5.9% 09/15/37	94,397.00	98,077.35	
		SRE 3.7% 04/01/29	100,000.00	97,521.68	
		SRE 4% 02/01/48	100,000.00	74,609.61	
		SRE 5.35% 04/01/53	100,000.00	91,603.14	
		STANLN 5.005% 10/15/30	200,000.00	200,886.81	
		STLD 1.65% 10/15/27	100,000.00	96,472.31	
		STT 4.784% 10/23/36	100,000.00	96,421.40	
		STT 5.684% 11/21/29	100,000.00	102,495.25	
		STZ 2.25% 08/01/31	100,000.00	88,059.56	
		SUCN 3.75% 03/04/51	100,000.00	71,164.03	
		SUMI 5.55% 03/09/28	200,000.00	202,908.69	
		SUMIBK 2.296% 01/12/41	200,000.00	136,127.54	
		SUMIBK 5.716% 09/14/28	200,000.00	204,396.32	
		SUMIFL 5.353% 04/25/28	200,000.00	202,005.70	
		SWK 6% 03/06/28	100,000.00	102,203.25	
		SYF 3.95% 12/01/27	200,000.00	198,100.48	
		SYK 1.95% 06/15/30	100,000.00	90,298.59	
		SYK 2.9% 06/15/50	100,000.00	64,239.90	
		SYY 6.6% 04/01/50	100,000.00	104,937.95	
		T(AT&T) 05/15/35	100,000.00	93,355.31	
		T(AT&T) 2.25% 02/01/32	100,000.00	86,649.06	
		T(AT&T) 2.55% 12/01/33	100,000.00	83,329.07	
		T(AT&T) 4.35% 03/01/29	100,000.00	99,204.06	

		T(AT&T) 4.85% 07/15/45	100,000.00	84,864.33	
		T(AT&T) 4.9% 08/15/37	100,000.00	94,528.41	
		T(AT&T) 5.125% 04/30/36	100,000.00	96,907.95	
		TACHEM 5.25% 06/23/45	100,000.00	93,022.97	
		TAISEM 4.5% 04/22/52	200,000.00	183,471.95	
		TDY 2.25% 04/01/28	100,000.00	96,219.95	
		TELEFO 5.52% 03/01/49	150,000.00	135,208.41	
		TEMASE 2.75% 08/02/61	250,000.00	150,443.33	
		TENCNT 3.68% 04/22/41	200,000.00	166,706.20	
		TFC 1.95% 06/05/30	100,000.00	90,163.19	
		TFC 4.873% 01/26/29	100,000.00	100,381.56	
		TFC 5.711% 01/24/35	100,000.00	102,417.63	
		TGT 4.8% 01/15/53	100,000.00	87,459.33	
		TMO 4.794% 10/07/35	100,000.00	97,534.46	
		TMUS 3.375% 04/15/29	100,000.00	96,557.54	
		TMUS 3.4% 10/15/52	100,000.00	64,238.40	
		TMUS 3.6% 11/15/60	100,000.00	63,251.56	
		TMUS 4.5% 04/15/50	100,000.00	79,083.75	
		TMUS 4.95% 03/15/28	100,000.00	100,578.75	
		TMUS 5.75% 01/15/54	100,000.00	93,538.38	
		TOYOTA 1.9% 09/12/31	100,000.00	86,813.78	
		TOYOTA 5.053% 06/30/35	100,000.00	100,154.49	
		TRMB 6.1% 03/15/33	100,000.00	104,031.25	
		TRPCN 7% 06/01/65	100,000.00	103,320.90	
		TRV 4.05% 03/07/48	100,000.00	78,891.57	
		TSN 4.35% 03/01/29	100,000.00	99,143.68	
		TTEFP 2.986% 06/29/41	100,000.00	73,951.00	
		TTEFP 3.386% 06/29/60	100,000.00	64,308.30	
		TTWO 4.95% 03/28/28	100,000.00	100,533.16	
		TXN 4.6% 02/08/29	100,000.00	100,506.08	
		UBER 4.8% 09/15/34	100,000.00	97,277.69	
		UBS 5.01% 03/23/37	200,000.00	193,240.18	
		UBS 6.442% 08/11/28	250,000.00	254,962.69	
		UCGIM 3.127% 06/03/32	200,000.00	183,618.30	
		UDR 2.1% 08/01/32	100,000.00	84,900.00	
		UNH 2.9% 05/15/50	100,000.00	62,805.56	
		UNH 4.25% 06/15/48	100,000.00	80,124.92	
		UNH 4.5% 04/15/33	200,000.00	194,587.18	
		UNH 4.75% 05/15/52	100,000.00	84,633.46	
		UNH 5.2% 04/15/63	100,000.00	88,070.85	
		UNH 5% 04/15/34	100,000.00	99,379.06	
		UNM 4% 06/15/29	100,000.00	97,688.01	
		UNM 6% 06/15/54	100,000.00	96,395.52	

		UNP 2.891% 04/06/36	100,000.00	83,751.09	
		UNP 3.799% 04/06/71	100,000.00	67,571.40	
		UNP 4.95% 05/15/53	100,000.00	88,750.06	
		UPS 5.25% 05/14/35	100,000.00	101,408.65	
		UPS 6.05% 05/14/65	100,000.00	100,608.43	
		USB 4.548% 07/22/28	200,000.00	200,069.10	
		USB 5.424% 02/12/36	100,000.00	101,169.58	
		V 4.7% 02/12/36	100,000.00	98,016.63	
		VALEBZ 3.75% 07/08/30	100,000.00	95,291.84	
		VLO 2.15% 09/15/27	100,000.00	97,391.23	
		VLO 3.65% 12/01/51	100,000.00	68,377.16	
		VOD 5.625% 02/10/53	100,000.00	91,259.25	
		VOYA 4.7% 01/23/48	100,000.00	98,688.36	
		VTR 2.5% 09/01/31	100,000.00	88,821.15	
		VTR 3% 01/15/30	100,000.00	94,099.10	
		VTRS 4.55% 04/15/28	100,000.00	99,447.68	
		VTRS 5.2% 04/15/48	100,000.00	82,471.30	
		VW 5.8% 03/27/35	200,000.00	200,456.22	
		VZ 2.55% 03/21/31	100,000.00	90,499.63	
		VZ 3.15% 03/22/30	100,000.00	94,676.32	
		VZ 3.4% 03/22/41	100,000.00	76,312.36	
		VZ 4.862% 08/21/46	100,000.00	85,356.83	
		VZ 5.75% 11/30/45	100,000.00	95,655.73	
		WCNCN 2.95% 01/15/52	100,000.00	63,201.66	
		WDAY 3.8% 04/01/32	100,000.00	92,951.05	
		WELL 5.125% 07/01/35	100,000.00	99,874.14	
		WFC 2.572% 02/11/31	100,000.00	92,421.09	
		WFC 4.611% 04/25/53	100,000.00	82,662.88	
		WFC 4.808% 07/25/28	100,000.00	100,238.62	
		WFC 5.15% 04/23/31	300,000.00	302,347.57	
		WFC 5.95% 12/15/36	200,000.00	203,192.69	
		WLK 2.875% 08/15/41	100,000.00	68,100.02	
		WM 4.875% 02/15/34	100,000.00	99,931.50	
		WMB 3.95% 05/15/50	100,000.00	75,461.54	
		WMB 4% 03/15/28	100,000.00	98,980.67	
		WMB 5.15% 03/15/36	100,000.00	97,787.56	
		WMT 2.5% 09/22/41	100,000.00	71,012.89	
		WMT 2.65% 09/22/51	100,000.00	60,776.15	
		WMT 3.95% 06/28/38	100,000.00	91,070.52	
		WPC 2.4% 02/01/31	100,000.00	89,866.71	
		WSTP 3.133% 11/18/41	100,000.00	73,330.33	
		WSTP 5.457% 11/18/27	100,000.00	101,503.58	

		WSTP 5.618% 11/20/35	200,000.00	200,408.76	
		WTRG 5.3% 05/01/52	100,000.00	90,607.66	
		WY 4% 04/15/30	100,000.00	97,110.81	
		XEL 4.1% 06/01/32	200,000.00	192,005.18	
		XEL 4% 06/15/28	100,000.00	98,896.73	
		XOM 3.482% 03/19/30	100,000.00	96,666.35	
		XOM 4.327% 03/19/50	100,000.00	81,895.20	
		ZBH 5.35% 12/01/28	100,000.00	101,627.83	
		ZTS 3.9% 08/20/28	100,000.00	98,853.97	
	アメリカドル 小計		81,859,397.00	76,044,923.86 (12,329,923,954)	
	カナダドル	AMZN 3.4% 06/12/29	300,000.00	300,448.82	
		BCECN 5.15% 02/09/53	100,000.00	95,565.33	
		BMO 4.537% 12/18/28	100,000.00	102,519.93	
		BMO 4.709% 12/07/27	100,000.00	101,982.56	
		BNP 2.538% 07/13/29	200,000.00	196,248.20	
		BNS 3.807% 11/15/28	100,000.00	100,716.75	
		BNS 5.679% 08/02/33	100,000.00	104,266.88	
		CAECN 5.541% 06/12/28	100,000.00	103,465.88	
		CM 3.65% 12/10/28	100,000.00	100,523.21	
		CNQCN 2.5% 01/17/28	100,000.00	98,899.30	
		CNQCN 4.85% 05/30/47	100,000.00	94,327.41	
		CNRCN 3.6% 02/08/49	100,000.00	81,234.27	
		CP 2.54% 02/28/28	100,000.00	98,933.99	
		CPXCN 4.424% 02/08/30	100,000.00	101,921.37	
		CUCN 4.851% 06/03/52	200,000.00	192,412.45	
		CVECN 3.5% 02/07/28	100,000.00	100,103.23	
		ENBCN 3.9% 02/25/30	100,000.00	100,621.64	
		ENBCN 6.1% 11/09/32	100,000.00	110,530.13	
		FFHCN 3.95% 03/03/31	100,000.00	100,280.42	
		FTSCN 4.09% 03/26/32	100,000.00	100,700.54	
		GS 4.34% 03/05/37	100,000.00	97,990.53	
		GWOCN 2.981% 07/08/50	100,000.00	72,066.57	
		HYDONE 4.17% 06/06/44	100,000.00	91,720.28	
		HYDONE 4.25% 01/04/35	100,000.00	101,085.50	
		LCN 2.284% 05/07/30	100,000.00	96,168.34	
		MFCCN 5.409% 03/10/33	100,000.00	103,277.14	
		MGCN 4.95% 01/31/31	100,000.00	104,311.45	
		MRUCN 4.27% 12/04/47	100,000.00	89,014.71	
		NACN 5.279% 02/15/34	100,000.00	103,901.29	
		NGGLN 5.221% 09/16/31	100,000.00	105,697.48	
		PLD 4.2% 02/15/33	100,000.00	100,314.16	
		PPLCN 5.02% 01/12/32	100,000.00	104,542.81	

		PPLCN 5.21% 01/12/34	100,000.00	105,420.99	
		RCICN 5.25% 04/15/52	100,000.00	97,465.41	
		RCICN 6.75% 11/09/39	100,000.00	115,363.61	
		REIUCN 4.623% 10/03/31	100,000.00	101,714.06	
		REIUCN 4.628% 05/01/29	100,000.00	102,274.74	
		SLFCN 4.56% 12/03/40	100,000.00	99,657.88	
		STNCN 4.374% 06/10/32	100,000.00	100,493.74	
		TCN 2.35% 01/27/28	100,000.00	98,714.52	
		TD 3.857% 04/07/32	100,000.00	100,173.01	
		TD 4.68% 01/08/29	100,000.00	103,012.67	
		TD 5.177% 04/09/34	200,000.00	207,752.87	
		TOYOTA 3.74% 05/21/30	200,000.00	200,370.60	
	カナダドル 小計		5,000,000.00	4,988,206.67 (571,000,017)	
	ユーロ	AAPL 0.5% 11/15/31	100,000.00	87,704.52	
		ABBV 0.75% 11/18/27	100,000.00	97,159.57	
		ABBV 2.125% 06/01/29	100,000.00	97,705.77	
		ABESM 1.25% 02/07/28	100,000.00	97,172.81	
		ABIBB 2.875% 04/02/32	100,000.00	97,347.84	
		ABNANV 0.375% 01/14/35	100,000.00	78,526.07	
		ABNANV 5.125% 02/22/33	100,000.00	102,272.75	
		ACACB 0.01% 04/12/28	100,000.00	95,126.96	
		ACACB 3.25% 09/28/32	100,000.00	99,836.50	
		ACAFP 1% 07/03/29	100,000.00	94,114.80	
		ACAFP 2% 07/17/30	100,000.00	93,768.25	
		ACAFP 3.875% 02/16/38	100,000.00	97,612.32	
		ACAFP 4.125% 03/07/30	100,000.00	103,008.00	
		ACEIM 3.875% 01/24/31	100,000.00	101,988.01	
		ADNA 3.5% 04/04/28	100,000.00	100,734.82	
		ADPFP 1% 12/13/27	100,000.00	97,438.34	
		AEMSPA 0.625% 07/15/31	100,000.00	87,011.17	
		AIB 5.75% 02/16/29	100,000.00	104,028.57	
		AIFP 2.875% 09/16/32	100,000.00	97,116.64	
		AIRFP 1.625% 06/09/30	100,000.00	94,456.45	
		AKEFP 0.75% 12/03/29	100,000.00	92,397.16	
		AKERBP 1.125% 05/12/29	100,000.00	93,920.97	
		AKZANA 1.5% 03/28/28	100,000.00	97,306.36	
		AL 3.7% 04/15/30	100,000.00	99,777.00	
		ALOFP 0.125% 07/27/27	100,000.00	97,284.99	
		ALVGR 4.252% 07/05/52	100,000.00	101,468.51	
		AMT 0.875% 05/21/29	100,000.00	93,649.25	
		AMZN 4.05% 03/16/39	200,000.00	198,194.31	

		ANNGR 5% 11/23/30	100,000.00	105,505.65	
		APD 2.95% 05/14/31	100,000.00	97,742.22	
		ARRFP 3.125% 01/20/32	100,000.00	98,091.34	
		ASRNED 7% 12/07/43	100,000.00	116,418.98	
		ASSGEN 3.875% 01/29/29	100,000.00	102,008.83	
		ATDBCN 4.011% 02/12/36	100,000.00	99,198.73	
		ATIM 1.5% 01/25/30	100,000.00	93,721.19	
		ATOSTR 4.75% 01/24/31	100,000.00	104,799.47	
		AXASA 1.875% 07/10/42	100,000.00	89,593.48	
		AXASA 3.625% 01/10/33	100,000.00	100,995.21	
		AXP 3.433% 05/20/32	100,000.00	99,614.45	
		BAC 0.694% 03/22/31	100,000.00	90,632.20	
		BACR 4.973% 05/31/36	200,000.00	207,450.10	
		BASGR 3.75% 06/29/32	100,000.00	101,700.37	
		BATSLN 3.125% 04/07/28	100,000.00	100,169.81	
		BAYNGR 1.125% 01/06/30	100,000.00	92,806.05	
		BAYNGR 1% 01/12/36	100,000.00	76,331.96	
		BBVASM 3.875% 01/15/34	100,000.00	102,400.14	
		BBVASM 5.75% 09/15/33	100,000.00	104,373.06	
		BERTEL 2% 04/01/28	100,000.00	98,402.90	
		BFCM 3.375% 06/10/32	200,000.00	197,467.90	
		BFCM 4% 11/21/29	100,000.00	102,226.24	
		BHI 3.226% 03/11/30	100,000.00	99,652.82	
		BHP 3.25% 09/24/27	100,000.00	100,425.62	
		BKNG 4.125% 05/12/33	100,000.00	102,030.94	
		BKTSM 1.25% 12/23/32	100,000.00	97,868.76	
		BMO 0.05% 06/08/29	100,000.00	91,915.83	
		BMO 3.625% 03/24/32	100,000.00	100,237.14	
		BMW 0.2% 01/11/33	100,000.00	82,192.24	
		BMW 0.375% 09/24/27	100,000.00	97,016.84	
		BMW 1% 05/22/28	100,000.00	96,359.25	
		BNP 0.625% 12/03/32	100,000.00	82,817.43	
		BNS 0.01% 09/14/29	100,000.00	91,054.35	
		BNS 3.25% 01/18/28	200,000.00	201,186.98	
		BPCECB 1.75% 05/27/32	100,000.00	91,889.23	
		BPCECB 3.125% 07/20/27	200,000.00	200,624.34	
		BPCECB 3.25% 04/12/28	200,000.00	201,146.90	
		BPCECB 3% 10/17/29	100,000.00	99,943.71	
		BPCEGP 0.75% 03/03/31	100,000.00	88,189.39	
		BPCEGP 3.875% 01/25/36	100,000.00	100,515.20	
		BPCEGP 4.125% 03/08/33	200,000.00	202,467.64	
		BRITEL 3.75% 05/13/31	100,000.00	101,159.59	
		BRK 1.625% 03/16/35	100,000.00	85,038.23	

		BYLAN 1.375% 11/22/32	100,000.00	97,576.69	
		BYLAN 2.75% 05/28/32	200,000.00	196,191.50	
		C 3.713% 09/22/28	100,000.00	100,868.27	
		CABKSM 5.375% 11/14/30	100,000.00	106,486.66	
		CABKSM 6.125% 05/30/34	100,000.00	105,829.03	
		CABKSM 6.25% 02/23/33	100,000.00	103,724.81	
		CAFFIL 0.01% 02/22/28	100,000.00	95,506.43	
		CAFFIL 0.01% 03/18/31	300,000.00	258,828.09	
		CAFFIL 0.125% 06/30/31	100,000.00	85,932.29	
		CAFFIL 0.5% 10/01/46	100,000.00	51,222.42	
		CAFFIL 3.125% 05/17/39	400,000.00	370,467.48	
		CAFFIL 3.375% 01/16/36	100,000.00	98,214.96	
		CAFP 3.75% 05/24/33	100,000.00	99,144.51	
		CARLB 4.25% 10/05/33	100,000.00	103,907.48	
		CCEP 3.25% 03/21/32	100,000.00	98,949.35	
		CFF 0.01% 10/25/27	100,000.00	96,454.19	
		CFF 0.01% 10/29/35	100,000.00	72,050.08	
		CFF 0.6% 10/25/41	100,000.00	62,294.97	
		CFF 3.375% 09/16/31	100,000.00	100,605.98	
		CKHH 2% 04/13/30	100,000.00	95,252.79	
		CMCSA 3.55% 09/26/36	100,000.00	95,887.89	
		CMZB 3.125% 04/20/29	100,000.00	100,522.49	
		CMZB 3.625% 01/14/32	200,000.00	200,200.02	
		CMZB 3.875% 03/03/37	100,000.00	98,586.43	
		CNH 3.75% 06/11/31	100,000.00	100,499.86	
		CNPFP 1.25% 01/27/29	100,000.00	94,878.62	
		CNPFP 5.25% 07/18/53	100,000.00	105,643.91	
		COLSM 0.75% 06/22/29	100,000.00	93,379.16	
		CONGR 3.625% 11/30/27	100,000.00	100,761.87	
		CRH 3% 01/11/30	100,000.00	99,795.75	
		DANBNK 0.75% 06/09/29	100,000.00	95,638.28	
		DB 3.375% 02/13/31	100,000.00	99,334.50	
		DEKA 3.25% 02/08/29	100,000.00	100,590.37	
		DELL 4.5% 10/18/27	100,000.00	101,534.50	
		DEXGRP 0% 01/21/28	100,000.00	95,778.84	
		DGELN 1.875% 06/08/34	100,000.00	87,847.09	
		DGFP 0% 11/27/28	100,000.00	93,415.76	
		DHLGR 3.375% 07/03/33	100,000.00	100,129.62	
		DHR 0.75% 09/18/31	100,000.00	87,582.02	
		DNBNO 5% 09/13/33	200,000.00	205,519.32	
		DSFIR 3.625% 07/02/34	100,000.00	99,197.67	
		DWNIGY 1.5% 04/30/30	100,000.00	92,447.64	

		DZHYP 3.125% 02/28/36	200,000.00	196,082.94	
		EDPPL 1.5% 11/22/27	100,000.00	98,385.78	
		EFFP 2.875% 03/05/29	100,000.00	99,557.52	
		EJRAIL 1.85% 04/13/33	100,000.00	90,069.39	
		EJRAIL 4.11% 02/22/43	100,000.00	97,010.11	
		ENBW 2.125% 08/31/2081	100,000.00	88,403.51	
		ENELIM 1.25% 01/17/35	100,000.00	81,514.53	
		ENELIM 6.625% PERP	100,000.00	109,955.52	
		ENGIFP 2.125% 03/30/32	100,000.00	93,193.66	
		ENGIFP 3.625% 01/11/30	100,000.00	101,145.68	
		ENIIM 2.75% PERP	100,000.00	95,646.95	
		ENIIM 4.25% 05/19/33	100,000.00	102,840.24	
		ENXFP 0.75% 05/17/31	100,000.00	89,694.48	
		EOANGR 3.875% 01/12/35	100,000.00	100,850.01	
		EOANGR 4.125% 03/25/44	100,000.00	97,890.06	
		EOANGR 4% 01/16/40	100,000.00	97,998.12	
		ERFFP 4% 07/06/29	100,000.00	101,619.43	
		ERSTBK 4% 01/16/31	100,000.00	102,290.44	
		EXOIM 0.875% 01/19/31	100,000.00	90,098.17	
		F 5.125% 02/20/29	100,000.00	103,356.58	
		FMEGR 1.5% 05/29/30	100,000.00	93,207.94	
		FREGR 0.5% 10/01/28	100,000.00	94,487.42	
		GBLBBB 0.125% 01/28/31	100,000.00	86,180.93	
		GFCFP 0.875% 01/25/33	100,000.00	83,619.98	
		GM 4.5% 11/22/27	100,000.00	101,817.35	
		GS 4% 09/21/29	100,000.00	102,415.68	
		GSK 1.75% 05/21/30	100,000.00	94,778.10	
		HEIANA 2.25% 03/30/30	100,000.00	96,822.98	
		HEIGR 3.75% 05/31/32	100,000.00	101,133.77	
		HERIM 0.25% 12/03/30	100,000.00	87,586.48	
		HERIM 4.25% 04/20/33	100,000.00	103,123.72	
		HOLNSW 0.5% 09/03/30	100,000.00	88,990.87	
		HSBC 3.313% 05/13/30	100,000.00	99,931.15	
		HSBC 4.787% 03/10/32	100,000.00	105,173.00	
		HSBC 6.364% 11/16/32	100,000.00	103,847.26	
		HVB 0.375% 01/17/33	100,000.00	83,264.12	
		IBESM 3.625% 07/13/33	100,000.00	100,665.51	
		IBESM 3.75% PERP	100,000.00	98,450.82	
		IBM 3.75% 02/06/35	100,000.00	99,549.91	
		IBM 3.8% 02/10/45	100,000.00	90,163.00	
		IFXGR 2% 06/24/32	100,000.00	92,085.08	
		IGIM 3.125% 02/08/29	100,000.00	99,804.61	
		IMBLN 3.875% 08/02/33	100,000.00	98,329.42	

		INTNED 3.5% 08/17/36	100,000.00	96,894.65	
		INTNED 3.75% 02/10/37	100,000.00	98,101.03	
		INTNED 3.875% 08/20/37	200,000.00	197,799.07	
		INTNED 3% 02/15/33	100,000.00	98,868.55	
		ISPIM 5.625% 03/08/33	150,000.00	166,535.40	
		ITW 3% 05/19/34	100,000.00	95,951.72	
		JAPTOB 3.87% 09/04/55	200,000.00	196,703.24	
		JDEPNA 0.5% 01/16/29	100,000.00	92,907.84	
		JPM 1.963% 03/23/30	100,000.00	96,844.50	
		KBCBB 0.125% 01/14/29	100,000.00	95,780.97	
		KERFP 3.375% 02/27/33	100,000.00	97,379.42	
		KO 0.95% 05/06/36	100,000.00	78,014.95	
		KPN 3.875% 02/16/36	100,000.00	99,097.35	
		LBBW 0.375% 02/21/31	100,000.00	87,164.87	
		LBBW 0.375% 02/28/28	100,000.00	95,788.45	
		LBBW 0.375% 05/07/29	100,000.00	92,614.22	
		LEGGR 3.875% 01/20/35	100,000.00	96,957.21	
		LIFP 2% 05/12/29	100,000.00	96,750.17	
		LIN 1% 09/30/51	100,000.00	48,586.33	
		LLOYDS 3.125% 08/24/30	100,000.00	99,372.63	
		LLOYDS 3.75% 02/12/37	100,000.00	98,848.50	
		LRFP 0.75% 05/20/30	100,000.00	91,093.92	
		LSELN 1.75% 12/06/27	100,000.00	98,374.77	
		MBGGR 3.25% 09/15/27	200,000.00	200,808.98	
		MCD 4% 05/15/38	100,000.00	98,417.59	
		MCFP 0.375% 02/11/31	100,000.00	88,380.20	
		MDT 4.15% 10/15/53	100,000.00	92,199.15	
		MET 4% 04/05/28	100,000.00	101,459.17	
		MIZUHO 4.157% 05/20/28	100,000.00	101,964.53	
		MRKGR 3.875% 08/27/54	100,000.00	100,174.58	
		MS 2.95% 05/07/32	200,000.00	194,209.28	
		NAB 0.01% 01/06/29	100,000.00	93,024.17	
		NAB 3.146% 02/05/31	500,000.00	499,695.84	
		NACN 3.5% 04/25/28	200,000.00	201,854.12	
		NDAFH 3.25% 04/29/31	100,000.00	99,532.95	
		NDAFH 3.375% 06/11/29	100,000.00	100,876.26	
		NDASS 1% 03/30/29	200,000.00	190,171.65	
		NDB 2.25% 09/20/27	500,000.00	496,887.71	
		NDB 2.625% 10/20/28	300,000.00	298,211.59	
		NDB 2.875% 03/19/30	200,000.00	199,134.54	
		NESNVX 0.875% 06/14/41	100,000.00	65,923.50	
		NESNVX 3.5% 12/13/27	100,000.00	100,953.80	

		NGGLN 0.163% 01/20/28	100,000.00	95,739.50	
		NK 1% 07/15/31	100,000.00	87,005.51	
		NNGRNV 0.875% 11/23/31	100,000.00	88,206.77	
		NNGRNV 6% 11/03/43	100,000.00	109,956.81	
		NOKIA 4.375% 08/21/31	100,000.00	103,537.18	
		NTGYSM 3.25% 10/02/30	100,000.00	99,194.12	
		NTT 0.399% 12/13/28	100,000.00	93,626.89	
		NWG 3.625% 01/09/29	200,000.00	202,405.98	
		O 5.125% 07/06/34	100,000.00	107,055.24	
		OMVAV 2.375% 04/09/32	100,000.00	95,662.95	
		OPBANK 0.375% 06/16/28	200,000.00	190,130.54	
		ORAFP 3.625% 11/16/31	100,000.00	100,934.30	
		ORAFP 3.875% PERP	100,000.00	98,283.56	
		ORAFP 5.375% PERP	100,000.00	104,776.65	
		ORFP 3.375% 11/23/29	100,000.00	101,088.64	
		ORIX 4.477% 06/01/28	100,000.00	102,368.08	
		PEP 0.5% 05/06/28	100,000.00	95,794.44	
		PHIANA 2.625% 05/05/33	100,000.00	93,576.33	
		PLD 1.5% 02/08/34	100,000.00	84,760.42	
		PLD 4.25% 01/31/43	100,000.00	96,158.82	
		POWFIN 1.841% 09/21/28	100,000.00	96,608.14	
		PROXBB 4.125% 11/17/33	100,000.00	102,251.92	
		PRXNA 2.031% 08/03/32	100,000.00	89,817.56	
		PSA 0.5% 09/09/30	100,000.00	88,714.59	
		RABOBK 3.064% 02/01/34	200,000.00	197,718.53	
		RABOBK 3.822% 07/26/34	200,000.00	202,762.30	
		RABOBK 3.875% 11/30/32	100,000.00	100,720.93	
		RBIAV 7.375% 12/20/32	100,000.00	104,268.56	
		RDSALN 1.5% 04/07/28	100,000.00	97,724.06	
		REESM 4.625% PERP	100,000.00	101,914.54	
		RIFP 1.375% 04/07/29	100,000.00	95,537.75	
		RWE 2.75% 05/24/30	100,000.00	98,653.97	
		RY 0.01% 10/05/28	100,000.00	93,778.02	
		RY 2.375% 09/13/27	600,000.00	597,191.08	
		SABSM 3.25% 06/05/34	200,000.00	198,128.99	
		SANFP 1.5% 04/01/30	100,000.00	94,662.13	
		SANTAN 3.25% 04/02/29	100,000.00	100,172.70	
		SANTAN 3.5% 01/09/30	100,000.00	100,738.55	
		SANTAN 4.25% 06/12/30	100,000.00	103,344.35	
		SAPGR 0.375% 05/18/29	100,000.00	92,838.96	
		SEB 3.25% 05/04/28	100,000.00	100,706.72	
		SEB 4.5% 11/27/34	100,000.00	102,931.11	
		SHBASS 3.75% 11/01/27	100,000.00	101,133.32	

		SIEGR 3.375% 08/24/31	200,000.00	201,757.74	
		SIEGR 3.5% 02/24/36	100,000.00	98,800.50	
		SMINLN 3.625% 11/13/33	100,000.00	97,633.44	
		SOCGEN 3.75% 05/17/35	200,000.00	198,530.81	
		SOCGEN 5.25% 09/06/32	100,000.00	102,145.76	
		SOCSFH 1.75% 05/05/34	100,000.00	88,724.84	
		SOCSFH 3.125% 02/24/32	100,000.00	99,308.52	
		SOCSFH 3.375% 07/31/30	500,000.00	504,369.60	
		SRGIM 1% 09/12/34	100,000.00	80,903.58	
		SSELN 3.5% 03/18/32	100,000.00	99,585.89	
		SSELN 4% PERP	100,000.00	100,415.40	
		STLA 1.25% 06/20/33	100,000.00	79,885.26	
		SUFP 3.375% 04/13/34	100,000.00	98,868.40	
		SVTLN 3.875% 08/04/37	100,000.00	96,665.90	
		SWEDA 3.125% 07/05/28	100,000.00	100,567.25	
		SWFP 1% 07/17/28	100,000.00	96,139.11	
		T(AT&T) 1.6% 05/19/28	100,000.00	97,452.33	
		T(AT&T) 4.3% 11/18/34	100,000.00	102,365.68	
		TACHEM 0.75% 07/09/27	100,000.00	97,973.98	
		TCLAU 4.225% 04/26/33	100,000.00	102,829.30	
		TD 3.191% 02/16/29	500,000.00	502,530.55	
		TD 3.715% 03/13/30	200,000.00	204,541.10	
		TELBSS 0.75% 03/23/31	100,000.00	88,734.66	
		TELEFO 1.788% 03/12/29	100,000.00	96,756.65	
		TELNO 1.75% 05/31/34	100,000.00	87,022.09	
		TELNO 3.375% 04/01/32	100,000.00	99,419.89	
		TENN 0.125% 12/09/27	100,000.00	96,485.48	
		TENN 0.875% 06/16/35	100,000.00	81,717.35	
		TENN 2.125% 11/17/29	200,000.00	195,014.81	
		TMO 1.875% 10/01/49	100,000.00	62,232.93	
		TMO 3.65% 11/21/34	100,000.00	100,261.16	
		TOYOTA 4.05% 09/13/29	100,000.00	102,368.69	
		TRNIM 0.375% 06/23/29	100,000.00	92,280.91	
		TTEFP 1.618% 05/18/40	200,000.00	146,601.20	
		TTEFP 3.25% PERP	100,000.00	89,199.58	
		UBS 4.375% 01/11/31	200,000.00	206,230.00	
		UBS 7.75% 03/01/29	200,000.00	214,348.28	
		UCGIM 1.625% 01/18/32	100,000.00	91,031.95	
		ULFP 0.875% 03/29/32	100,000.00	85,816.90	
		UNANA 3.3% 06/06/29	100,000.00	100,995.29	
		UNANA 3.5% 02/15/37	100,000.00	97,208.73	
		URWFP 1.75% 07/01/49	100,000.00	57,940.14	

		V 3.875% 05/15/44	100,000.00	96,522.61	
		VATFAL 0.125% 02/12/29	100,000.00	92,760.80	
		VIEFP 1.94% 01/07/30	100,000.00	95,795.62	
		VOD 2.5% 05/24/39	100,000.00	82,491.66	
		VW 3.75% 09/28/27	100,000.00	100,756.35	
		VW 3.875% PERP	100,000.00	97,961.51	
		VW 4.125% 09/02/35	100,000.00	98,019.79	
		VW 4.125% 11/16/38	100,000.00	95,599.27	
		VW 4.25% 02/15/28	100,000.00	101,579.81	
		VW 4.75% 09/25/31	100,000.00	104,104.32	
		VZ 0.375% 03/22/29	100,000.00	93,013.71	
		VZ 0.75% 03/22/32	100,000.00	85,272.61	
		WFC 1.741% 05/04/30	100,000.00	95,888.14	
	ユーロ 小計		35,450,000.00	34,221,541.94 (6,347,069,383)	
	イギリスポンド	ALVGR 4.5% 03/13/43	100,000.00	84,383.09	
		ANNGR 5.5% 01/18/36	100,000.00	96,109.19	
		ARNDTN 3% 10/16/29	100,000.00	92,532.41	
		AVLN 4% 06/03/55	100,000.00	85,637.24	
		BACR 5.851% 03/21/35	100,000.00	100,306.23	
		BATSLN 5.75% 07/05/40	100,000.00	94,588.80	
		BPLN 6% PERP	100,000.00	101,500.77	
		BRK 2.625% 06/19/59	100,000.00	50,168.93	
		CDTFIN 2.125% 09/22/28	100,000.00	94,451.14	
		CDTFIN 5.625% 01/11/36	100,000.00	97,206.13	
		CMCSA 5.25% 09/26/40	100,000.00	89,576.24	
		CMCSA 5.5% 11/23/29	100,000.00	101,482.18	
		CPGLN 4.375% 09/08/32	100,000.00	97,044.02	
		EDF 5.5% 01/25/35	100,000.00	97,068.98	
		EJRAIL 4.75% 12/08/31	100,000.00	99,040.45	
		ENELIM 1% 10/20/27	100,000.00	95,593.86	
		ENGIFP 5.625% 04/03/53	100,000.00	86,454.92	
		EQNR 4.25% 04/10/41	100,000.00	84,145.30	
		GOOGL 5.875% 02/13/58	100,000.00	92,753.88	
		GS 3.625% 10/29/29	100,000.00	97,343.07	
		GSK 5.25% 04/10/42	100,000.00	91,655.55	
		HSBC 3% 05/29/30	100,000.00	94,614.14	
		HSBC 5.29% 09/16/32	100,000.00	99,986.66	
		HSBC 8.201% 11/16/34	100,000.00	107,474.38	
		HTHROW 4.625% 10/31/46	100,000.00	78,346.64	
		LLOYDS 6.625% 06/02/33	100,000.00	102,168.60	
		MGNLN 6.34% 12/19/63	100,000.00	93,387.70	
		MS 5.213% 10/24/35	100,000.00	97,412.49	

		NGGLN 2.75% 02/06/35	100,000.00	80,340.43	
		NGGLN 2% 04/17/40	100,000.00	61,662.23	
		NGGLN 5.272% 01/18/43	100,000.00	88,772.34	
		NWG 3.619% 03/29/29	100,000.00	97,867.61	
		O 5.75% 12/05/31	100,000.00	102,307.73	
		RTOLN 5% 06/27/32	100,000.00	98,467.22	
		SANTAN 4.75% 08/30/28	100,000.00	100,022.99	
		SGOFP 4.625% 10/09/29	100,000.00	99,189.21	
		STANLN 4.375% 01/18/38	100,000.00	87,087.68	
		VIEFP 5.375% 12/02/30	100,000.00	101,497.76	
	イギリスポンド 小計		3,800,000.00	3,519,648.19 (765,945,839)	
	スウェーデンクローナ	LANSBK 0.5% 09/20/28	2,000,000.00	1,914,092.90	
		LANSBK 1% 09/15/27	2,500,000.00	2,461,832.47	
		LANSBK 3% 09/19/29	2,000,000.00	2,019,004.20	
		LFBANK 3.5% 09/10/31	2,000,000.00	2,051,504.80	
		SHBASS 2% 09/01/28	1,000,000.00	988,783.54	
		SWEDA 3% 03/28/29	2,000,000.00	2,019,400.20	
		SWEDA 3% 12/27/29	1,000,000.00	1,008,780.80	
	スウェーデンクローナ 小計		12,500,000.00	12,463,398.91 (209,260,467)	
	オーストラリアドル	ABIBB 4.1% 09/06/27	100,000.00	98,980.00	
		ANZ 5.906% 08/12/32	100,000.00	100,490.00	
		ANZ 6.124% 07/25/39	200,000.00	200,170.00	
		ANZ 6.405% 09/20/34	100,000.00	102,279.00	
		CBAAU 5% 01/13/28	200,000.00	200,060.00	
		CPPIBC 4.45% 09/01/27	100,000.00	99,834.00	
		LBBW 5.25% 08/02/29	200,000.00	199,716.00	
		LLOYDS 5.189% 05/28/31	100,000.00	98,784.00	
		QANAU 2.95% 11/27/29	100,000.00	91,710.00	
		TLSAU 5.65% 03/06/34	200,000.00	200,956.00	
		WSTP 6.934% 06/23/38	100,000.00	105,292.00	
	オーストラリアドル 小計		1,500,000.00	1,498,271.00 (168,690,331)	
社債券合計				20,391,889,991 (20,391,889,991)	
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES MBS ETF	680,898	63,881,850.36	
	アメリカドル 小計		680,898	63,881,850.36 (10,357,803,217)	
投資信託受益証券合計			680,898	10,357,803,217 (10,357,803,217)	
				91,091,239,393	

合計		(91,091,239,393)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	組入投資信託受益証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	国債証券　213銘柄	45.0%	—	22.1%
	地方債証券　8銘柄	0.8%	—	0.4%
	特殊債券　58銘柄	3.5%	—	1.7%
	社債券　687銘柄	27.5%	—	13.5%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	23.1%	11.4%
カナダドル	国債証券　36銘柄	36.1%	—	1.1%
	地方債証券　50銘柄	28.7%	—	0.9%
	特殊債券　22銘柄	14.4%	—	0.4%
	社債券　44銘柄	20.8%	—	0.6%
メキシコペソ	国債証券　15銘柄	100.0%	—	0.4%
ユーロ	国債証券　407銘柄	55.6%	—	14.0%
	地方債証券　40銘柄	3.3%	—	0.8%
	特殊債券　117銘柄	13.5%	—	3.4%
	社債券　296銘柄	27.6%	—	7.0%
イギリスポンド	国債証券　65銘柄	75.4%	—	3.3%
	特殊債券　10銘柄	5.4%	—	0.2%
	社債券　38銘柄	19.2%	—	0.8%
スイスフラン	国債証券　21銘柄	100.0%	—	0.6%
スウェーデンクローナ	国債証券　6銘柄	39.1%	—	0.1%
	社債券　7銘柄	60.9%	—	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券　11銘柄	100.0%	—	0.1%
デンマーククローネ	国債証券　7銘柄	100.0%	—	0.2%
チェココルナ	国債証券　23銘柄	100.0%	—	0.2%
ハンガリーフォリント	国債証券　15銘柄	100.0%	—	0.1%
ポーランドズロチ	国債証券　15銘柄	100.0%	—	0.4%
オーストラリアドル	国債証券　27銘柄	46.3%	—	0.8%
	地方債証券　31銘柄	31.7%	—	0.5%
	特殊債券　13銘柄	10.8%	—	0.2%
	社債券　11銘柄	11.2%	—	0.2%
ニュージーランドドル	国債証券　13銘柄	100.0%	—	0.2%
シンガポールドル	国債証券　20銘柄	100.0%	—	0.2%
マレーシアリンギット	国債証券　23銘柄	100.0%	—	0.5%
タイバーツ	国債証券　26銘柄	100.0%	—	0.4%

インドネシアルピア	国債証券　19銘柄	100.0%	―	0.4%
韓国ウォン	国債証券　41銘柄	100.0%	―	1.0%
イスラエルシェケル	国債証券　14銘柄	100.0%	―	0.2%
オフショア人民元	国債証券　75銘柄	59.8%	―	6.8%
	特殊債券　49銘柄	40.2%	―	4.6%

(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

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	5,942,140,482
コール・ローン	710,620,514
株式	368,208,445,655
投資信託受益証券	736,349,127
投資証券	283,192,995
派生商品評価勘定	15,138,202
未収入金	16,761,955
未収配当金	1,225,193,101
未収利息	18,787
前払金	416,069,075
差入委託証拠金	3,083,628,425
流動資産合計	380,637,558,318
資産合計	380,637,558,318
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	432,331,569
未払金	56,364
未払解約金	229,545,715
流動負債合計	661,933,648
負債合計	661,933,648
純資産の部	
元本等	
元本	48,538,498,342
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	331,437,126,328
元本等合計	379,975,624,670
純資産合計	379,975,624,670
負債純資産合計	380,637,558,318

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	2026年 7月10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)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2026年 7月10日現在	
1.　計算期間の末日における受益権の総数		48,538,498,342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)	7.8283円 (78,283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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2026年 7月10日現在
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

	2026年 7月10日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	50,833,427,807円
期中追加設定元本額	5,079,577,965円
期中一部解約元本額	7,374,507,430円
期末元本額	48,538,498,342円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン	6,166,723,038円
世界経済インデックスファンド	12,934,511,959円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	7,290,432,327円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	6,815,467,520円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	13,788,999円
コア投資戦略ファンド（安定型）	44,754,757円
コア投資戦略ファンド（成長型）	121,360,827円
分散投資コア戦略ファンドＡ	194,086,285円
分散投資コア戦略ファンドＳ	899,533,603円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,409,805,693円

区分	2026年 7月10日現在
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	650,485,215円
コア投資戦略ファンド（切替型）	47,915,296円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	298,832,719円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	13,770,468円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	61,106,691円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	24,706,560円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,441,490,735円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	310,682,459円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,632,225,777円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	220,042,834円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,324,888円
グローバル経済コア	1,643,608,804円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	1,247,934,956円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	49,994,402円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	14,946,516円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	124,773,212円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	161,928,223円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	85,017,362円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	117,588,398円
１０資産分散投資ファンド	10,834,111円
グローバル１０資産バランスファンド	37,891,825円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	67,020,650円
ＤＣ全世界株式インデックスファンド（オール・カントリー）	581,828,072円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０７０	152,519円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,614,023,266円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	82,474,701円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	67,322,748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）	13,793,820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）	18,240,716円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ１（適格機関投資家専用）	10,019円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ２（適格機関投資家専用）	12,861円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ３（適格機関投資家専用）	16,287円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ４（適格機関投資家専用）	17,574円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ５（適格機関投資家専用）	9,222円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ６（適格機関投資家専用）	9,428円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	70,054,991,893
投資信託受益証券	44,937,888
投資証券	14,144,905
合計	70,114,074,686

(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

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,664,118,118	－	11,248,049,043	△416,069,075
合計		11,664,118,118	－	11,248,049,043	△416,069,075

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	868,664,880	－	867,540,588	△1,124,292
	アメリカドル	868,664,880	－	867,540,588	△1,124,292
合計		868,664,880	－	867,540,588	△1,124,292

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘 柄	株式数(株)	評価額 単価	評価額 金額	備考
アメリカドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	209,500	2.70	565,859.50	
	AURA MINERALS INC	6,351	63.37	402,462.87	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	30,342	29.55	896,606.10	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	－	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	－	
	SOUTHERN COPPER CORP	16,991	174.43	2,963,740.13	
	KANZHUN LTD	75,108	14.26	1,071,040.08	
	FULL TRUCK ALLIANCE -SPN ADR	132,534	8.58	1,137,141.72	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	39,256	40.95	1,607,533.20	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	10.32	818,045.76	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	110,347	8.85	976,570.95	
	VK CO LTD	19,368	0.00	－	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	107,610	85.88	9,241,546.80	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	13.85	757,262.60	
	JBS NV-A	70,000	11.73	821,100.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	27.38	404,895.44	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	537,603	2.66	1,430,023.98	
	CREDICORP LTD	12,412	391.92	4,864,511.04	

	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	690,942	13.67	9,445,177.14	
	STONECO LTD-A	34,178	10.96	374,590.88	
	XP INC - CLASS A	84,873	16.41	1,392,765.93	
アメリカドル 小計		2,364,924		39,170,874.12 (6,351,165,529)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,824,261	21.71	61,314,706.31	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	574,892	195.34	112,299,403.28	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	774.38	27,103,300.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	125.77	12,828,540.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	496.60	16,673,345.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	238.00	12,637,800.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	71,080	413.72	29,407,217.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	34,885	280.17	9,773,730.45	
	WALMART DE MEXICO-SER V	957,180	49.02	46,920,963.60	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	94,975	202.08	19,192,548.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	315,140	222.37	70,077,681.80	
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	282.60	7,336,296.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	246,200	55.93	13,769,966.00	
	SIGMA FOODS SAB DE CV	691,623	16.27	11,252,706.21	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	38.44	6,988,392.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	465,800	185.35	86,336,030.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	288,700	41.22	11,900,214.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,850,855	22.64	64,543,357.20	
メキシコペソ 小計		9,847,026		620,356,197.45 (5,734,386,582)	
ブラジルレアル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	684,629	43.53	29,801,900.37	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	841,840	39.21	33,008,546.40	
	PRIO SA	152,500	55.61	8,480,525.00	
	GERDAU SA-PREF	275,023	22.48	6,182,517.04	
	SUZANO SA	133,779	41.03	5,488,952.37	
	VALE SA	678,975	73.15	49,667,021.25	
	EMBRAER SA	135,200	83.86	11,337,872.00	
	WEG SA	314,144	45.74	14,368,946.56	
	LOCALIZA RENT A CAR	169,308	39.40	6,670,735.20	
	MOTIVA INFRAESTRUTURA DE MOB	185,825	14.67	2,726,052.75	
	RUMO SA	244,300	13.75	3,359,125.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	133,445	30.10	4,016,694.50	
	VIBRA ENERGIA SA	185,300	32.10	5,948,130.00	
	RAIA DROGASIL SA	264,465	18.13	4,794,750.45	
	AMBEV SA	884,457	15.72	13,903,664.04	
	MBRF GLOBAL FOODS COMPANY SA	101,655	15.41	1,566,503.55	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	82,637	35.15	2,904,690.55	
	BANCO BRADESCO S.A.	292,750	15.70	4,596,175.00	

	BANCO BRADESCO SA-PREF	972,938	18.00	17,512,884.00	
	BANCO DO BRASIL S.A.	313,000	20.00	6,260,000.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	995,197	42.59	42,385,440.23	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	95,811	44.86	4,298,081.46	
	ITAUSA SA	1,070,253	13.59	14,544,738.27	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	968,956	14.79	14,330,859.24	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	39.28	4,277,592.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	110,391	21.59	2,383,341.69	
	PORTO SEGURO SA	45,000	53.35	2,400,750.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	148,409	34.50	5,120,110.50	
	TIM SA	162,800	22.29	3,628,812.00	
	AXIA ENERGIA SA	222,180	51.63	11,471,153.40	
	AXIA ENERGIA-PR SA C	67,905	50.54	3,431,918.70	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	275,375	11.08	3,051,155.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	440,878	30.00	13,226,340.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	384,600	15.05	5,788,230.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	46.29	1,259,088.00	
	ENEVA SA	154,000	26.20	4,034,800.00	
	ENGIE BRASIL SA	64,750	32.62	2,112,145.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	225,100	39.51	8,893,701.00	
ブラジルレアル 小計		12,613,875		379,233,942.52 (12,007,305,088)	
チリペソ	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	27,145	69,100.00	1,875,719,500.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	60,166,632	26.40	1,588,399,084.80	
	EMPRESAS COPEC SA	71,746	6,020.00	431,910,920.00	
	FALABELLA SA	114,533	5,851.00	670,132,583.00	
	CENCOSUD SA	245,832	2,056.50	505,553,508.00	
	BANCO DE CHILE	8,683,203	187.00	1,623,758,961.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	14,760	64,080.00	945,820,800.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	77.50	895,138,097.50	
	ENEL CHILE SA	5,361,278	82.00	439,624,796.00	
	PLAZA SA Y FILIALES	146,000	3,900.00	569,400,000.00	
チリペソ 小計		86,381,298		9,545,458,250.30 (1,666,207,464)	
コロンビアペソ	GRUPO CIBEST SA	50,698	81,080.00	4,110,593,840.00	
	GRUPO CIBEST SA-PREF	84,565	66,500.00	5,623,572,500.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	85,511	30,440.00	2,602,954,840.00	
コロンビアペソ 小計		220,774		12,337,121,180.00 (606,320,157)	
ユーロ	GEK TERNA SA	11,269	44.80	504,851.20	
	ALLWYN AG	34,643	13.35	462,484.05	
	JUMBO SA	19,341	22.40	433,238.40	
	ALPHA BANK SA	308,606	4.03	1,245,533.81	

	EUROBANK SA	467,700	4.34	2,029,818.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	161,569	15.52	2,508,358.72	
	PIRAEUS BANK SA	204,657	9.22	1,886,937.54	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	31,807	19.05	605,923.35	
	PUBLIC POWER CORP	35,892	23.62	847,769.04	
ユーロ 小計		1,275,484		10,524,914.11 (1,952,055,819)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	180,590	264.25	47,720,907.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	517,736	40.06	20,740,504.16	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	251,691	358.75	90,294,146.25	
	KOC HOLDING AS	139,884	185.10	25,892,528.40	
	TURK HAVA YOLLARI AO	103,615	338.25	35,047,773.75	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	162,456	365.00	59,296,440.00	
	AKBANK T.A.S.	586,183	70.20	41,150,046.60	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	89.15	18,843,813.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	1,876,733	13.90	26,086,588.70	
	YAPI VE KREDI BANKASI	611,127	35.86	21,915,014.22	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	223,091	104.90	23,402,245.90	
トルコリラ 小計		4,864,478		410,390,009.28 (1,419,374,886)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	981.50	13,056,894.50	
	MONETA MONEY BANK AS	47,008	192.80	9,063,142.40	
	CEZ AS	25,883	1,262.00	32,664,346.00	
チェココルナ 小計		86,194		54,784,382.90 (418,711,560)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	78,018	4,000.00	312,072,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	14,572	12,000.00	174,864,000.00	
	OTP BANK NYRT	41,213	46,420.00	1,913,107,460.00	
ハンガリーフォリント 小計		133,803		2,400,043,460.00 (1,245,987,362)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	106,798	139.44	14,891,913.12	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	25,758	304.60	7,845,886.80	
	BUDIMEX	2,800	710.40	1,989,120.00	
	LPP SA	205	18,800.00	3,854,000.00	
	CD PROJEKT SA	12,492	231.50	2,891,898.00	
	ALLEGRO.EU SA	163,627	38.95	6,374,089.78	
	DINO POLSKA SA	94,710	27.75	2,628,202.50	
	ZABKA GROUP SA	55,000	27.25	1,498,750.00	
	BANK MILLENNIUM SA	111,598	20.16	2,249,815.68	
	BANK PEKAO SA	33,684	235.40	7,929,213.60	
	ERSTE BANK POLSKA SA	7,343	679.20	4,987,365.60	
	M BANK SA	2,923	1,395.00	4,077,585.00	
	PKO BANK POLSKI SA	160,987	107.68	17,335,080.16	

	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	111,213	67.56	7,513,550.28	
	ASSECO POLAND SA	11,270	176.45	1,988,591.50	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	169,800	9.31	1,580,838.00	
ポーランドズロチ 小計		1,070,208		89,635,900.02 (3,835,296,072)	
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	39,690	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		5,353,071		0.48 (1)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	9.99	3,286,710.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	374,000	6.53	2,442,220.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,717,400	4.09	19,294,166.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	625,500	41.14	25,733,070.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	228,000	13.24	3,018,720.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	3,994,000	9.04	36,105,760.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	557,700	10.66	5,945,082.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	738,000	7.52	5,549,760.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	16.75	3,978,125.00	
	CHINA GOLD INTERNATIONAL RES	56,500	137.00	7,740,500.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	645,500	20.12	12,987,460.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	4.27	3,108,560.00	
	CHINA NONFERROUS MINING CORP	277,000	11.86	3,285,220.00	
	CMOC GROUP LTD-H	777,000	14.68	11,406,360.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	84,800	43.08	3,653,184.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	216,000	30.12	6,505,920.00	
	MMG LTD	1,120,000	6.95	7,784,000.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	178,250	18.08	3,222,760.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	321,000	18.04	5,790,840.00	
	ZIJIN GOLD INTERNATIONAL CO	65,900	99.70	6,570,230.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,169,000	29.42	34,391,980.00	
	BOC AVIATION LTD	45,000	79.20	3,564,000.00	

CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	3.29	2,322,740.00	
CITIC LTD	703,000	10.92	7,676,760.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-H	32,800	637.50	20,910,000.00	
CRRC CORP LTD-H	936,000	4.54	4,249,440.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	149,000	19.29	2,874,210.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	149,500	40.36	6,033,820.00	
UBTECH ROBOTICS CORP LTD-H	34,200	87.70	2,999,340.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	393,800	34.90	13,743,620.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	118,800	35.90	4,264,920.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	261,547	13.12	3,431,496.64	
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	13.92	7,211,256.00	
J&T GLOBAL EXPRESS LTD	450,000	9.00	4,050,000.00	
JD LOGISTICS INC	326,200	12.48	4,070,976.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	28,500	127.10	3,622,350.00	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	80,881	182.80	14,785,046.80	
BYD CO LTD-H	693,900	82.65	57,350,835.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	134,000	50.60	6,780,400.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	1,243,000	18.13	22,535,590.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	442,250	8.49	3,754,702.50	
HESAI GROUP	25,420	128.80	3,274,096.00	
LI AUTO INC-CLASS A	234,842	46.76	10,981,211.92	
NIO INC-CLASS A	344,401	38.04	13,101,014.04	
XPENG INC - CLASS A SHARES	247,462	50.85	12,583,442.70	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	9.41	2,201,940.00	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	35.34	3,063,978.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	240,200	71.75	17,234,350.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	738,000	4.72	3,483,360.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	460,600	19.78	9,110,668.00	
LAOPU GOLD CO L-H	5,500	383.00	2,106,500.00	
LI NING CO LTD	430,000	14.35	6,170,500.00	
MIDEA GROUP CO LTD	67,000	88.45	5,926,150.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	43.28	6,872,864.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	314,000	10.89	3,419,460.00	
MEITUAN-CLASS B	934,950	78.50	73,393,575.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	257,900	38.16	9,841,464.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	236,800	12.51	2,962,368.00	
TRIP.COM GROUP LTD	118,057	322.80	38,108,799.60	
YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	334.20	22,208,258.40	
BAIDU INC-CLASS A	395,700	114.40	45,268,080.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	137.90	5,736,640.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	2,396,000	1.56	3,737,760.00	
KINGSOFT CORP LTD	171,200	23.98	4,105,376.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	474,200	42.10	19,963,820.00	

NETEASE INC	340,330	212.60	72,354,158.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	1,167,300	469.60	548,164,080.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	3,174,288	108.00	342,823,104.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	382,000	11.41	4,358,620.00	
JD.COM INC - CL A	451,811	107.70	48,660,044.70	
MINISO GROUP HOLDING LTD	72,904	22.72	1,656,378.88	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	102,400	151.00	15,462,400.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	1,184,000	3.40	4,025,600.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	36.50	7,060,925.00	
CHINA FEIHE LTD	564,000	3.01	1,697,640.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	17.40	10,039,800.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	359,000	22.18	7,962,620.00	
HUISHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
NONGFU SPRING CO LTD-H	390,600	40.28	15,733,368.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	393,000	7.62	2,994,660.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	11.06	4,600,960.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	43.12	5,001,920.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	3.30	3,220,800.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	90,600	25.18	2,281,308.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	22.90	2,003,750.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	256,800	16.66	4,278,288.00	
3SBIO INC	370,000	17.00	6,290,000.00	
AKESO INC	127,000	94.65	12,020,550.00	
BEONE MEDICINES LTD	160,805	181.90	29,250,429.50	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,558,160	7.84	12,215,974.40	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	13.20	2,930,400.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	272,000	31.16	8,475,520.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	273,500	86.35	23,616,725.00	
REMEGEN CO LTD-H	48,000	81.95	3,933,600.00	
SICHUAN KELUN-BIOTECH BIOP-H	9,500	475.00	4,512,500.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	5.00	9,855,000.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	90,388	149.00	13,467,812.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	711,500	37.06	26,368,190.00	
WUXI XDC CAYMAN INC	58,000	59.40	3,445,200.00	
XTALPI HOLDINGS LTD	399,000	7.82	3,120,180.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,135,000	5.49	28,191,150.00	
BANK OF CHINA LTD-H	12,677,200	5.01	63,512,772.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,682,475	6.77	11,390,355.75	
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	6.80	10,643,360.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	15,945,620	8.07	128,681,153.40	
CHINA MERCHANTS BANK-H	725,423	44.98	32,629,526.54	
CHINA MINSHENG BANKING-H	1,266,900	3.22	4,079,418.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	400,000	6.04	2,416,000.00	

IND&COMM BK OF CHINA-H	12,476,515	6.65	82,968,824.75	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,746,000	4.66	8,136,360.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	733,000	7.39	5,416,870.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	22.04	7,740,448.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	27.64	7,898,821.00	
FAR EAST HORIZON LTD	703,000	5.83	4,098,490.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	233,200	17.02	3,969,064.00	
GUOTAI HAITONG SECURITIES-H	371,464	14.95	5,553,386.80	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	16.83	4,476,780.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,441,000	28.90	41,644,900.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	490,200	27.38	13,421,676.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	349,024	18.44	6,436,002.56	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	176,900	47.96	8,484,124.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,770,000	4.95	8,761,500.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,293,288	14.28	18,468,152.64	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,283,500	53.25	68,346,375.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	202,000	32.14	6,492,280.00	
HORIZON ROBOTICS INC	950,400	4.36	4,143,744.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	528,000	6.97	3,680,160.00	
PONY AI INC-CLASS A	44,300	52.95	2,345,685.00	
SENSETIME GROUP INC-CLASS B	5,320,000	1.38	7,341,600.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	155,500	39.16	6,089,380.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	21.56	3,460,380.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	193,000	67.70	13,066,100.00	
LENOVO GROUP LTD	1,540,000	24.04	37,021,600.00	
SUNNY OPTICAL TECH	132,500	56.70	7,512,750.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	3,280,200	25.00	82,005,000.00	
YANGTZE OPTICAL FIBRE AND-H	76,500	160.20	12,255,300.00	
ZTE CORP-H	132,908	24.70	3,282,827.60	
CHINA TOWER CORP LTD-H	708,200	9.01	6,380,882.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	98,000	29.18	2,859,640.00	
CGN POWER CO LTD-H	2,028,000	2.73	5,536,440.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	5.41	2,523,224.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	614,000	5.10	3,131,400.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.74	1,824,840.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	15.07	2,965,776.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	407,400	17.39	7,084,686.00	
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	157,000	41.44	6,506,080.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	582,000	7.53	4,382,460.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	5.48	3,857,920.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	748,000	6.61	4,944,280.00	
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,999,000	0.62	2,479,380.00	

	HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR LTD	142,000	201.80	28,655,600.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	1.97	1,765,094.39	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	99,844	13.79	1,376,848.76	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	757,540	12.54	9,499,551.60	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	604,111	31.64	19,114,072.04	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	37.20	4,426,800.00	
	KE HOLDINGS INC-CL A	379,344	39.80	15,097,891.20	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	6.04	2,074,740.00	
香港ドル 小計		143,016,916		2,899,320,234.11 (59,986,935,643)	
マレーシアリンギット	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	4.35	1,811,340.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	722,200	7.56	5,459,832.00	
	GAMUDA BHD	837,090	4.05	3,390,214.50	
	SUNWAY BHD	454,600	5.03	2,286,638.00	
	MISC BHD	217,540	7.85	1,707,689.00	
	IOI CORPORATION BHD	484,440	4.36	2,112,158.40	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	101,262	21.22	2,148,779.64	
	SD GUTHRIE BHD	399,246	6.16	2,459,355.36	
	IHH HEALTHCARE BHD	435,800	8.32	3,625,856.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	477,600	6.47	3,090,072.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,503,202	7.60	11,424,335.20	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	21.70	2,632,036.40	
	MALAYAN BANKING BHD	991,505	10.86	10,767,744.30	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,714,500	4.85	13,165,325.00	
	RHB BANK BHD	429,647	8.31	3,570,366.57	
	CELCOMDIGI BHD	638,000	2.92	1,862,960.00	
	MAXIS BHD	427,900	3.55	1,519,045.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	211,852	7.47	1,582,534.44	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	17.48	2,594,032.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	504,775	14.30	7,218,282.50	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	599,280	4.33	2,594,882.40	
マレーシアリンギット 小計		12,836,531		87,023,478.71 (3,465,562,099)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	258,100	139.50	36,004,950.00	
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	37.00	62,330,200.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	241.00	31,426,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	804,900	63.00	50,708,700.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	573,738	23.60	13,540,216.80	
	CP ALL PCL-NVDR	991,700	47.25	46,857,825.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	22.30	12,407,720.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	19.50	36,817,950.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	112,700	185.50	20,905,850.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	109,000	230.00	25,070,000.00	

	KRUNG THAI BANK - NVDR	658,650	40.50	26,675,325.00	
	SCB X PCL-NVDR	151,200	155.00	23,436,000.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	4,727,200	2.64	12,479,808.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	628,900	310.00	194,959,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	191,500	378.00	72,387,000.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	13.30	26,807,719.40	
	GULF DEVELOPMENT PCL-NVDR	586,778	63.00	36,967,014.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	66.50	25,163,600.00	
タイバーツ 小計		16,447,884		754,945,278.20 (3,669,034,052)	
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	54,410	468.00	25,463,880.00	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	585.00	21,226,725.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	185,130	971.50	179,853,795.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	334,802	101.00	33,815,002.00	
	BDO UNIBANK INC	467,498	123.00	57,502,254.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	345,077	65.10	22,464,512.70	
	PLDT INC	13,915	1,156.00	16,085,740.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	9,220	576.00	5,310,720.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	15.10	19,341,590.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	523,650	18.10	9,478,065.00	
フィリピンペソ 小計		3,250,887		390,542,283.70 (1,026,852,826)	
インドネシアルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	4,312,011	1,600.00	6,899,217,600.00	
	BUMI RESOURCES MINERALS TBK	10,049,700	492.00	4,944,452,400.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,580,800	4,880.00	12,594,304,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	184,639,904	50.00	9,231,995,200.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	10,206,300	6,200.00	63,279,060,000.00	
	BANK MANDIRI	6,951,792	4,040.00	28,085,239,680.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	3,420.00	8,839,332,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	12,548,102	2,780.00	34,883,723,560.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,898,500	2,510.00	22,335,235,000.00	
インドネシアルピア 小計		242,771,709		191,092,559,440.00 (1,719,833,034)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	8,180	189,400.00	1,549,292,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	133,500.00	852,664,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	12,441	99,000.00	1,231,659,000.00	
	LG CHEM LTD	9,272	251,500.00	2,331,908,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	13,401	297,000.00	3,980,097,000.00	
	DOOSAN CO LTD	1,341	1,203,000.00	1,613,223,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	73,200.00	6,002,619,600.00	
	ECOPRO BM CO LTD	11,985	111,500.00	1,336,327,500.00	
	ECOPRO CO LTD	19,478	79,400.00	1,546,553,200.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	6,166	953,000.00	5,876,198,000.00	

HANWHA OCEAN CO LTD	26,249	78,600.00	2,063,171,400.00	
HANWHA SYSTEMS CO LTD	15,000	64,700.00	970,500,000.00	
HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	4,311	815,000.00	3,513,465,000.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	6,759	507,000.00	3,426,813,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	8,015	327,500.00	2,624,912,500.00	
HYOSUNG HEAVY INDUSTRIES COR	1,029	2,770,000.00	2,850,330,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	15,000	98,900.00	1,483,500,000.00	
HYUNDAI ROTEM COMPANY	14,500	160,600.00	2,328,700,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	150,000.00	2,012,400,000.00	
LG CORP	16,658	101,300.00	1,687,455,400.00	
LG ENERGY SOLUTION	8,760	313,500.00	2,746,260,000.00	
LIG DEFENSE&AEROSPACE CO LTD	2,429	694,000.00	1,685,726,000.00	
LS ELECTRIC CO LTD	13,799	189,400.00	2,613,530,600.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	5,322	146,000.00	777,012,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	48,700.00	421,108,900.00	
SAMSUNG C&T CORP	15,406	378,500.00	5,831,171,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	122,169	20,950.00	2,559,440,550.00	
SK INC	6,394	610,000.00	3,900,340,000.00	
SK SQUARE CO LTD	17,656	1,327,000.00	23,429,512,000.00	
HMM CO LTD	49,545	19,320.00	957,209,400.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	5,586	184,300.00	1,029,499,800.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	26,700.00	716,147,400.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	13,675	70,700.00	966,822,500.00	
HYUNDAI MOBIS	10,851	465,000.00	5,045,715,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	25,607	445,500.00	11,407,918,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	200,000.00	1,208,400,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	201,500.00	694,973,500.00	
KIA CORP	43,098	144,800.00	6,240,590,400.00	
LG ELECTRONICS INC	19,480	178,000.00	3,467,440,000.00	
HYBE CO LTD	4,308	216,000.00	930,528,000.00	
KAKAO CORP	57,020	33,650.00	1,918,723,000.00	
KRAFTON INC	5,233	238,500.00	1,248,070,500.00	
NAVER CORP	25,973	184,400.00	4,789,421,200.00	
KT&G CORP	17,365	176,400.00	3,063,186,000.00	
SAMYANG FOODS CO LTD	800	1,103,000.00	882,400,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	5,381	116,300.00	625,810,300.00	
APR CORP/KOREA	3,582	365,500.00	1,309,221,000.00	
HLB CO LTD	23,903	52,200.00	1,247,736,600.00	
ALTEOGEN INC	7,383	300,000.00	2,214,900,000.00	
CELLTRION INC	29,002	173,100.00	5,020,246,200.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,186	1,325,000.00	2,896,450,000.00	
SAMSUNG EPISHOLDINGS CO LTD	1,450	368,500.00	534,325,000.00	
YUHAN CORPORATION	10,299	67,400.00	694,152,600.00	

	HANA FINANCIAL GROUP	51,208	122,600.00	6,278,100,800.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	51,330	20,500.00	1,052,265,000.00	
	KAKAOBANK CORP	35,459	21,600.00	765,914,400.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	66,674	171,400.00	11,427,923,600.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	80,543	105,000.00	8,457,015,000.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	121,553	30,050.00	3,652,667,650.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	7,154	222,500.00	1,591,765,000.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	14,507	112,900.00	1,637,840,300.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	38,091	40,250.00	1,533,162,750.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	27,607	29,250.00	807,504,750.00	
	DB INSURANCE CO LTD	8,467	146,500.00	1,240,415,500.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	5,502	622,000.00	3,422,244,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	15,131	326,000.00	4,932,706,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	188,300.00	1,371,577,200.00	
	LG DISPLAY CO LTD	51,846	10,680.00	553,715,280.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	10,934	1,493,000.00	16,324,462,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	886,304	278,000.00	246,392,512,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	153,699	185,600.00	28,526,534,400.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	11,505	401,500.00	4,619,257,500.00	
	LG UPLUS CORP	20,125	15,200.00	305,900,000.00	
	SK TELECOM	20,063	86,700.00	1,739,462,100.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	62,208	35,200.00	2,189,721,600.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	215,500.00	1,559,789,000.00	
	SK HYNIX INC	104,670	2,186,000.00	228,808,620,000.00	
韓国ウォン 小計		2,749,315		731,546,852,880.00 (78,587,152,217)	
新台湾ドル	CHINA STEEL	2,171,261	18.55	40,276,891.55	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	60.00	32,523,660.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	702,824	54.80	38,514,755.20	
	NAN YA PLASTICS CORP	950,752	181.50	172,561,488.00	
	TCC GROUP HOLDINGS	1,268,419	22.70	28,793,111.30	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	23,557	1,280.00	30,152,960.00	
	BIZLINK HOLDING INC	33,000	1,865.00	61,545,000.00	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	24,200	721.00	17,448,200.00	
	EVA AIRWAYS CORP	566,000	39.60	22,413,600.00	
	EVERGREEN MARINE	199,215	194.50	38,747,317.50	
	WAN HAI LINES LIMITED	151,635	80.40	12,191,454.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	337,000	51.60	17,389,200.00	
	INTERNATIONAL GAMES SYSTEM C	44,000	744.00	32,736,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	476.50	25,759,590.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	93,544	241.00	22,544,104.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	896,395	78.40	70,277,368.00	
	CALIWAY BIOPHARMACEUTICALS C	195,000	107.50	20,962,500.00	

PHARMAESSENTIA CORP	54,163	1,285.00	69,599,455.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	1,289,238	24.05	31,006,173.90	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,319,237	69.90	232,014,666.30	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,678,324	34.75	93,071,759.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,116,633	33.60	71,118,868.80	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,749,869	38.85	67,982,410.65	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,241,069	46.70	104,657,922.30	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,152,191	40.45	87,056,125.95	
TAIWAN BUSINESS BANK	1,236,526	17.95	22,195,641.70	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	2,019,446	25.15	50,789,066.90	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	42.80	29,531,358.00	
TS FINANCIAL HOLDING CO LTD	3,888,287	36.85	143,283,375.95	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	303,198	114.50	34,716,171.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,961,964	68.30	134,002,141.20	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,754,057	96.30	168,915,689.10	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,546,088	124.50	192,487,956.00	
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,966,988	30.05	89,157,989.40	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	99,000	2,470.00	244,530,000.00	
ADVANTECH CO LTD	93,261	540.00	50,360,940.00	
ASIA VITAL COMPONENTS	61,000	2,350.00	143,350,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	132,092	684.00	90,350,928.00	
CHROMA ATE INC	70,000	1,820.00	127,400,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	368,903	1,880.00	693,537,640.00	
E INK HOLDINGS INC	162,000	200.50	32,481,000.00	
ELITE MATERIAL CO LTD	56,000	5,295.00	296,520,000.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	99,000	336.50	33,313,500.00	
GOLD CIRCUIT ELECTRONICS LTD	61,000	1,075.00	65,575,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,316,248	237.50	550,108,900.00	
INNOLUX CORP	1,496,106	65.30	97,695,721.80	
INVENTEC CO LTD	455,511	69.80	31,794,667.80	
KING SLIDE WORKS CO LTD	11,000	8,250.00	90,750,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	18,040	3,950.00	71,258,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	375,452	213.50	80,159,002.00	
LOTES CO LTD	16,000	1,955.00	31,280,000.00	
PEGATRON CORP	340,474	82.70	28,157,199.80	
QUANTA COMPUTER INC	503,270	373.50	187,971,345.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	247,683	875.00	216,722,625.00	
WISTRON CORP	575,000	144.50	83,087,500.00	
WIWYNN CORP	21,000	5,040.00	105,840,000.00	
YAGEO CORPORATION	308,688	900.00	277,819,200.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	588.00	81,098,136.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	699,315	133.50	93,358,552.50	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	336,000	95.00	31,920,000.00	

	TAIWAN MOBILE CO LTD	345,200	108.50	37,454,200.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	14,000	4,210.00	58,940,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	638,315	677.00	432,139,255.00	
	ASPEED TECHNOLOGY INC	6,600	13,665.00	90,189,000.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,605.00	31,260,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	16,000	4,340.00	69,440,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	1,350.00	56,700,000.00	
	HON PRECISION INC	15,000	6,660.00	99,900,000.00	
	JENTECH PRECISION INDUSTRIAL	17,000	3,205.00	54,485,000.00	
	KING YUAN ELECTRONICS CO LTD	210,000	308.50	64,785,000.00	
	MEDIATEK INC	273,804	3,925.00	1,074,680,700.00	
	MPI CORP	16,000	7,080.00	113,280,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	106,045	542.00	57,476,390.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	840.00	72,192,960.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,668,389	2,415.00	11,274,159,435.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	2,096,000	156.00	326,976,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	205,205	173.00	35,500,465.00	
新台湾ドル 小計		58,047,653		20,092,422,233.60 (101,082,967,015)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	299,904	308.25	92,445,408.00	
	COAL INDIA LTD	345,479	430.20	148,625,065.80	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	188,229	392.20	73,823,413.80	
	INDIAN OIL CORP LTD	535,621	138.35	74,103,165.35	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	468,956	243.70	114,284,577.20	
	OIL INDIA LTD	92,949	423.20	39,336,016.80	
	PETRONET LNG LTD	146,153	277.00	40,484,381.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,125,227	1,279.70	1,439,952,991.90	
	AMBUJA CEMENTS LTD	115,533	428.65	49,523,220.45	
	APL APOLLO TUBES LTD	35,431	1,785.90	63,276,222.90	
	ASIAN PAINTS LTD	64,703	2,672.50	172,918,767.50	
	COROMANDEL INTERNATIONAL LTD	25,000	2,014.30	50,357,500.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	50,816	3,191.75	162,191,968.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	246,890	963.65	237,915,548.50	
	JINDAL STAINLESS LTD	54,371	708.80	38,538,164.80	
	JINDAL STEEL LTD	69,774	1,030.45	71,898,618.30	
	JSW STEEL LTD	113,332	1,224.40	138,763,700.80	
	NATIONAL ALUMINIUM CO LTD	156,620	349.50	54,738,690.00	
	NMDC LTD	438,783	84.38	37,024,509.54	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	2,599.60	33,267,081.20	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	58,320	1,591.45	92,813,364.00	
	SHREE CEMENT LTD	1,387	26,304.65	36,484,549.55	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	5,739	17,377.75	99,730,907.25	
	SRF LTD	25,773	2,751.45	70,913,120.85	

TATA STEEL LTD	1,497,157	187.80	281,166,084.60	
ULTRATECH CEMENT LTD	22,996	11,515.90	264,819,636.40	
UNITED PHOSPHORUS LTD	84,651	581.85	49,254,184.35	
VEDANTA ALUMINIUM METAL LTD	252,749	444.45	112,334,293.05	
VEDANTA LTD	252,749	271.40	68,596,078.60	
ABB LTD INDIA	9,747	6,820.25	66,476,976.75	
ADANI ENTERPRISES LTD	29,729	3,085.30	91,722,883.70	
ASHOK LEYLAND LIMITED	483,946	155.25	75,132,616.50	
ASTRAL LTD	19,918	1,318.25	26,256,903.50	
BHARAT ELECTRONICS LTD	672,444	406.05	273,045,886.20	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	151,803	381.55	57,920,434.65	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	117,125	910.50	106,642,312.50	
CUMMINS INDIA LTD	26,968	5,539.85	149,398,674.80	
GE VERNOVA T&D INDIA LTD	18,655	4,643.00	86,615,165.00	
HAVELLS INDIA LTD	45,666	1,191.50	54,411,039.00	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	36,913	4,375.80	161,523,905.40	
HITACHI ENERGY INDIA LTD	2,600	32,607.50	84,779,500.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	124,012	3,887.30	482,071,847.60	
POLYCAB INDIA LTD	9,354	9,072.95	84,868,374.30	
SIEMENS ENERGY INDIA LTD	17,000	3,439.15	58,465,550.00	
SIEMENS INDIA LTD	16,262	3,476.05	56,527,525.10	
SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	3,222.35	32,262,168.20	
SUZLON ENERGY LTD	1,850,000	53.64	99,234,000.00	
TATA MOTORS LTD /NEW	389,775	419.80	163,627,545.00	
VOLTAS LTD	40,000	1,268.85	50,754,000.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	99,358	1,799.30	178,774,849.40	
GMR AIRPORTS LTD	394,498	111.85	44,124,601.30	
INTERGLOBE AVIATION LTD	34,852	5,228.60	182,227,167.20	
BAJAJ AUTO LTD	13,012	10,153.35	132,115,390.20	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	14,831	2,200.60	32,637,098.60	
BHARAT FORGE LTD	43,981	2,130.35	93,694,923.35	
BOSCH LTD	1,235	42,251.35	52,180,417.25	
EICHER MOTORS LTD	26,253	7,365.40	193,363,846.20	
HERO MOTOCORP LTD	21,431	4,898.30	104,975,467.30	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	171,593	3,085.25	529,407,303.25	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	23,138	13,728.40	317,647,719.20	
MRF LTD	432	133,919.90	57,853,396.80	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	776,716	142.80	110,915,044.80	
TATA MOTORS PASSENGER VEHICL	389,775	331.70	129,288,367.50	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	2,916.00	61,679,232.00	
TVS MOTOR CO LTD	41,254	3,625.45	149,564,314.30	
DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	6,680	13,490.00	90,113,200.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	886	40,581.80	35,955,474.80	

TITAN CO LTD	65,336	4,555.45	297,634,881.20	
ETERNAL LTD	464,742	292.25	135,820,849.50	
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	731.35	120,304,880.95	
SWIGGY LTD	170,000	280.90	47,753,000.00	
INFO EDGE INDIA LTD	71,780	1,202.70	86,329,806.00	
FSN E-COMMERCE VENTURES LTD	220,000	323.95	71,269,000.00	
TRENT LTD	50,034	2,903.80	145,288,729.20	
VISHAL MEGA MART LTD	404,000	116.70	47,146,800.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	31,322	4,079.20	127,768,702.40	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	20,738	5,362.15	111,200,266.70	
ITC LTD	555,447	281.95	156,608,281.65	
MARICO LTD	81,711	859.40	70,222,433.40	
NESTLE INDIA LIMITED	133,197	1,463.20	194,893,850.40	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	110,239	1,106.75	122,007,013.25	
UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,380.05	80,843,329.00	
VARUN BEVERAGES LTD	260,895	481.30	125,568,763.50	
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	2,062.10	53,614,600.00	
DABUR INDIA LTD	102,837	443.25	45,582,500.25	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	77,376	1,087.60	84,154,137.60	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	133,575	2,144.10	286,398,157.50	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	19,562	8,842.95	172,985,787.90	
FORTIS HEALTHCARE LTD	50,425	951.50	47,979,387.50	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	153,459	1,100.90	168,943,013.10	
ALKEM LABORATORIES LTD	8,000	5,647.95	45,183,600.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	47,415	1,586.50	75,223,897.50	
CIPLA LTD	109,546	1,441.70	157,932,468.20	
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	6,811.45	149,388,721.40	
DR. REDDY'S LABORATORIES	101,419	1,269.80	128,781,846.20	
LUPIN LTD	48,134	2,502.90	120,474,588.60	
MANKIND PHARMA LTD	18,295	2,531.35	46,311,048.25	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	159,643	1,938.85	309,523,830.55	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	22,220	4,896.65	108,803,563.00	
ZYDUS LIFESCIENCES LTD	23,065	1,159.85	26,751,940.25	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	92,107	1,047.40	96,472,871.80	
AXIS BANK LTD	422,772	1,299.00	549,180,828.00	
BANK OF BARODA	190,290	244.55	46,535,419.50	
CANARA BANK	305,000	124.80	38,064,000.00	
FEDERAL BANK LTD	345,583	327.90	113,316,665.70	
HDFC BANK LTD	2,158,632	817.70	1,765,113,386.40	
ICICI BANK LTD	1,008,033	1,381.60	1,392,698,392.80	
IDFC FIRST BANK LTD	531,028	79.47	42,200,795.16	
INDIAN BANK	52,585	792.95	41,697,275.75	
INDUSIND BANK LTD	108,365	1,015.00	109,990,475.00	

KOTAK MAHINDRA BANK LTD	1,006,401	377.05	379,463,497.05	
PUNJAB NATIONAL BANK	422,906	103.45	43,749,625.70	
STATE BANK OF INDIA	339,659	1,021.65	347,012,617.35	
UNION BANK OF INDIA	238,889	157.45	37,613,073.05	
YES BANK LTD	2,352,478	23.65	55,636,104.70	
ADITYA BIRLA CAPITAL LTD	144,469	397.45	57,419,204.05	
BAJAJ FINANCE LTD	517,543	1,003.30	519,250,891.90	
BAJAJ FINSERV LTD	70,554	1,894.25	133,646,914.50	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	5,145	10,577.60	54,421,752.00	
BSE LTD	36,719	3,805.70	139,741,498.30	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	79,029	1,792.85	141,687,142.65	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	35,436	2,737.05	96,990,103.80	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	525,997	233.40	122,767,699.80	
L&T FINANCE LTD	161,178	321.05	51,746,196.90	
MULTI COMMODITY EXCH INDIA	23,677	2,785.35	65,948,731.95	
MUTHOOT FINANCE LTD	22,423	3,055.25	68,507,870.75	
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	63,644	1,262.95	80,379,189.80	
POWER FINANCE CORPORATION	265,755	403.90	107,338,444.50	
REC LTD	218,013	352.05	76,751,476.65	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	588.10	35,694,729.50	
SHRIRAM FINANCE LTD	259,693	1,032.60	268,158,991.80	
SUNDARAM FINANCE LTD	11,164	4,615.10	51,522,976.40	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	186,570	552.80	103,135,896.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	45,631	1,794.45	81,882,547.95	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	67,316	490.45	33,015,132.20	
PB FINTECH LTD	63,844	1,573.00	100,426,612.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	84,736	1,821.65	154,359,334.40	
HCL TECHNOLOGIES LTD	180,446	1,149.60	207,440,721.60	
INFOSYS LTD	610,259	1,050.05	640,802,462.95	
LTM LTD	15,699	3,852.85	60,485,892.15	
MPHASIS LTD	19,317	2,261.50	43,685,395.50	
ORACLE FINANCIAL SERVICES	4,194	11,130.10	46,679,639.40	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	21,691	4,829.00	104,745,839.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	171,173	2,047.75	350,519,510.75	
TECH MAHINDRA LTD	103,850	1,424.25	147,908,362.50	
WIPRO LTD	494,016	172.75	85,341,264.00	
BHARTI AIRTEL LTD	519,596	1,930.50	1,003,080,078.00	
INDUS TOWERS LTD	220,428	398.10	87,752,386.80	
TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,871.60	37,102,598.40	
VODAFONE IDEA LTD	4,326,724	14.04	60,747,204.96	
ADANI POWER LTD	449,405	216.30	97,206,301.50	
GAIL INDIA LTD	463,221	170.40	78,932,858.40	
JSW ENERGY LTD	63,163	533.20	33,678,511.60	

	NHPC LTD	546,313	78.58	42,929,275.54	
	NTPC LTD	830,043	343.50	285,119,770.50	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	734,632	281.15	206,541,786.80	
	TATA POWER CO LTD	285,870	375.40	107,315,598.00	
	TORRENT POWER LTD	28,990	1,412.20	40,939,678.00	
	WAAREE ENERGIES LTD	16,600	2,862.50	47,517,500.00	
	DLF LTD	148,017	659.95	97,683,819.15	
	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	2,030.45	60,430,252.90	
	LODHA DEVELOPERS LTD	54,942	1,195.30	65,672,172.60	
	OBEROI REALTY LTD	25,000	1,873.80	46,845,000.00	
	PHOENIX MILLS LTD	34,560	2,088.60	72,182,016.00	
	PRESTIGE ESTATES PROJECTS	28,897	1,675.45	48,415,478.65	
インドルピー 小計		39,897,107		24,747,769,768.50 (42,318,686,304)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	109,914	13.92	1,530,002.88	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.27	2,005,747.10	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	1,307,286	1.13	1,483,769.61	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	10.80	3,055,525.20	
	AL RAYAN BANK	1,143,101	2.00	2,288,488.20	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	4.05	2,152,133.55	
	DUKHAN BANK	319,751	3.35	1,071,805.35	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	181,022	11.20	2,027,446.40	
	QATAR ISLAMIC BANK	335,301	20.99	7,037,967.99	
	QATAR NATIONAL BANK	849,682	17.40	14,784,466.80	
	OOREDOO QSC	192,800	13.15	2,535,320.00	
	NEBRAS ENERGY	96,512	14.36	1,385,912.32	
カタールリアル 小計		5,819,409		41,358,585.40 (1,843,352,151)	
南アフリカランド	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	97,402	1,335.94	130,123,227.88	
	GOLD FIELDS LTD	175,524	556.33	97,649,266.92	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	245.19	24,484,918.59	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	166,390	178.60	29,717,254.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	67,979	234.43	15,936,316.97	
	SASOL LTD	121,115	170.00	20,589,550.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	545,200	34.25	18,673,100.00	
	VALTERRA PLATINUM LIMITED	48,810	1,077.62	52,598,632.20	
	BIDVEST GROUP LTD	59,475	233.00	13,857,675.00	
	NASPERS LTD-N SHS	144,168	865.28	124,745,687.04	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	684,578	21.16	14,485,670.48	
	BID CORP LTD	58,066	428.00	24,852,248.00	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	223.66	7,922,484.52	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	90,002	282.80	25,452,565.60	
	ABSA GROUP LTD	156,324	213.29	33,342,345.96	

	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	16,020	4,700.00	75,294,000.00	
	NEDBANK GROUP LTD	88,111	266.24	23,458,672.64	
	STANDARD BANK GROUP LTD	242,949	319.87	77,712,096.63	
	FIRSTRAND LTD	1,009,542	95.97	96,885,745.74	
	REINET INVESTMENTS SCA	26,187	442.23	11,580,677.01	
	REMGRO LTD	94,679	187.67	17,768,407.93	
	DISCOVERY LIMITED	98,779	256.58	25,344,715.82	
	OUTSURANCE GROUP LTD	163,864	79.41	13,012,440.24	
	SANLAM LTD	347,490	88.25	30,665,992.50	
	MTN GROUP LTD	320,501	225.80	72,369,125.80	
	VODACOM GROUP	116,454	150.02	17,470,429.08	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	114,897	146.34	16,814,026.98	
南アフリカランド 小計		5,189,789		1,112,807,273.53 (11,061,304,298)	
アラブ首長国連邦ディルハム	ADNOC DRILLING CO PJSC	588,752	5.79	3,408,874.08	
	ADNOC GAS PLC	1,170,000	3.43	4,013,100.00	
	ADNOC LOGISTICS & SERVICES	352,600	6.02	2,122,652.00	
	AIR ARABIA PJSC	435,300	5.45	2,372,385.00	
	SALIK CO PJSC	344,972	5.60	1,931,843.20	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	574,953	3.98	2,288,312.94	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	531,430	14.86	7,897,049.80	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	280,781	21.86	6,137,872.66	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	7.54	3,959,585.76	
	EMIRATES NBD PJSC	357,699	30.90	11,052,899.10	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	813,037	17.80	14,472,058.60	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	640,029	19.66	12,582,970.14	
	DUBAI ELECTRICITY & WATER AU	1,103,909	2.78	3,068,867.02	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	8.10	5,879,231.10	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	190,000	13.86	2,633,400.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,219,653	11.86	14,465,084.58	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		9,854,090		98,286,185.98 (4,347,198,005)	
クウェートディナール	BOUBYAN BANK K.S.C	316,566	0.63	200,702.84	
	GULF BANK	400,136	0.35	141,248.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	2,182,486	0.77	1,689,244.16	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,604,515	0.80	1,293,239.09	
	WARBA BANK KSCP	494,718	0.28	138,521.04	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.59	176,910.68	
	MABANEE CO KPSC	144,330	0.91	132,639.27	
クウェートディナール 小計		5,439,581		3,772,505.08 (1,982,753,219)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	115,200	16.10	1,854,720.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	587,200	4.81	2,824,432.00	

CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	76,100	42.13	3,206,093.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	15.93	1,019,520.00	
PETROCHINA CO LTD-A	358,000	9.40	3,365,200.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	22.81	2,194,322.00	
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	6.09	484,764.00	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	14.77	146,223.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	40,365	17.88	721,726.20	
YANTAI JEREH OILFIELD-A	24,500	168.00	4,116,000.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	8.10	1,330,830.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	16.74	492,825.60	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	289,500	5.46	1,580,670.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	75,700	58.70	4,443,590.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	90,300	42.98	3,881,094.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	55.99	627,088.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	41.46	1,029,285.96	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	178,500	16.28	2,905,980.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	43.43	972,832.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	2.09	963,490.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.42	265,200.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	12.48	278,304.00	
LB GROUP CO LTD-A	15,300	15.82	242,046.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	20.10	1,591,920.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	26.09	1,241,884.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	285,750	10.98	3,137,535.00	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	22.74	1,261,501.50	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	59,052	24.28	1,433,782.56	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	24.27	435,403.80	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	185,200	4.01	742,652.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	25.46	413,470.40	
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	49.79	567,606.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	246,000	6.02	1,480,920.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	68.88	2,775,864.00	
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	54.37	896,289.45	
ZANGGE MINING CO LTD-A	31,700	68.84	2,182,228.00	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	113,800	46.00	5,234,800.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	28.69	999,789.12	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	251,400	27.62	6,943,668.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	35.75	407,550.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	16.70	140,280.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	162,890	36.06	5,873,813.40	
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	433,200	2.53	1,095,996.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	67,400	7.32	493,368.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	4.56	2,564,544.00	

CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	14,420	39.55	570,311.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	53,480	375.50	20,081,740.00	
CRRC CORP LTD-A	185,800	5.40	1,003,320.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	27.87	1,203,984.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	32,073	56.89	1,824,632.97	
GEM CO LTD-A	56,500	6.50	367,250.00	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	20.33	408,856.63	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	25.82	149,756.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	107.70	1,233,811.20	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	47.14	1,937,454.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	35,200	29.56	1,040,512.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	2.51	830,559.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	21.68	1,820,686.40	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY COR-A	16,298	86.19	1,404,724.62	
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	15,040	39.00	586,560.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	4.71	768,672.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	168,500	18.57	3,129,045.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	433,400	6.73	2,916,782.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	20,893	64.32	1,343,837.76	
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	8.50	213,010.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	35,880	124.01	4,449,478.80	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	17.34	705,738.00	
TBEA CO LTD-A	29,274	20.04	586,650.96	
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	27.84	1,202,688.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	144,600	8.35	1,207,410.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	24.04	759,664.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	57,370	42.19	2,420,440.30	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	42.85	312,805.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	7.10	568,710.00	
AIR CHINA LTD-A	225,900	5.93	1,339,587.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	724,800	4.62	3,348,576.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.61	144,400.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	149,400	13.92	2,079,648.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	4.81	772,005.00	
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	31.91	1,694,421.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	22.48	119,571.12	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	16.66	927,962.00	
BYD CO LTD -A	60,900	86.87	5,290,383.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	3,200	94.93	303,776.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	6.94	300,862.88	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	50.68	937,580.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	15.79	541,597.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	88.38	742,392.00	

NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	36,765	55.83	2,052,589.95	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	87,536	9.91	867,481.76	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	50.81	142,268.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	38.24	1,663,440.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	43,700	79.33	3,466,721.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	76,100	20.01	1,522,761.00	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	18.72	458,640.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	4.74	660,756.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	14.88	242,544.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	203,400	13.89	2,825,226.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	50.99	1,056,512.80	
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	36.50	390,550.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	76.00	121,600.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	33.33	1,801,719.81	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	44.60	758,200.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	61,080	23.06	1,408,504.80	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	75,302	24.85	1,871,254.70	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	37.64	342,524.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	14,600	1,182.19	17,259,974.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	74.91	1,378,344.00	
MUYUAN FOODS GROUP CO LTD-A	81,858	37.11	3,037,750.38	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	7.06	189,208.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	25,480	105.08	2,677,438.40	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	13.15	501,804.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	70.90	2,942,350.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	8.18	750,506.82	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	28.81	280,033.20	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	139.50	2,078,550.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	23.12	656,608.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	27.85	292,062.95	
CHANGCHUN HIGH -TECH INDUST -A	2,200	65.89	144,958.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	17,238	23.66	407,851.08	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	11.37	168,844.50	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	43.57	348,560.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,912	85.89	250,111.68	
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUT-A	109,602	55.61	6,094,967.22	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	4.48	287,168.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	35.21	246,470.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	42.70	479,606.40	
WUXI APPTEC CO LTD-A	31,764	121.07	3,845,667.48	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	48.36	480,698.40	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	19,900	110.31	2,195,169.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	962,700	6.11	5,882,097.00	

BANK OF BEIJING CO LTD -A	308,000	5.11	1,573,880.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	128,800	18.89	2,433,032.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	6.68	3,419,492.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	15.22	1,715,294.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	11.37	2,612,143.80	
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.64	1,569,400.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	30.75	1,792,725.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	195,500	8.95	1,749,725.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	381,081	7.13	2,717,107.53	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	244,900	9.89	2,422,061.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	659,600	3.04	2,005,184.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	264,600	37.55	9,935,730.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.31	905,616.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.71	1,087,197.80	
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.73	803,562.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	678,600	7.27	4,933,422.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	17.19	3,532,545.00	
PING AN BANK CO LTD-A	269,400	10.49	2,826,006.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	332,000	5.00	1,660,000.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	385,000	8.98	3,457,300.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	11.96	949,624.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	8.72	499,917.60	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	9.36	186,264.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.16	381,072.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	118,630	21.75	2,580,202.50	
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	28.68	4,046,174.40	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	103,000	29.30	3,017,900.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	177,427	20.59	3,653,221.93	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	15.14	54,504.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	22.52	1,364,712.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	178,300	10.26	1,829,358.00	
GUOTAI HAITONG SECURITIES CO	182,300	18.87	3,440,001.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	48,150	7.44	358,236.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	7,560	230.30	1,741,068.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	86,500	20.39	1,763,735.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.13	700,475.10	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	9.27	376,139.52	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.59	951,048.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	54,800	8.13	445,524.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	9.63	420,831.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	87,400	5.37	469,338.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	84,400	29.29	2,472,076.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	139,300	49.49	6,893,957.00	

360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	86,900	8.84	768,196.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	227.60	1,097,714.80	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	10,266	28.60	293,607.60	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	21.15	350,286.30	
IFLYTEK CO LTD - A	25,800	42.37	1,093,146.00	
RANGE INTELLIGENT COMPUTI-A	31,300	80.08	2,506,504.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	11,437	20.19	230,913.03	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	37,770	9.43	356,171.10	
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	12,700	238.49	3,028,823.00	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	31,000	95.38	2,956,780.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	475,100	8.15	3,872,065.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	133.81	3,746,680.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	19.88	691,824.00	
EOPTOLINK TECHNOLOGY INC L-A	15,820	545.50	8,629,810.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	157,600	69.53	10,957,928.00	
GOERTEK INC -A	128,500	21.37	2,746,045.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	39,600	80.06	3,170,376.00	
HGTECH CO LTD-A	18,400	159.00	2,925,600.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	85.99	1,695,034.88	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	56,800	46.73	2,654,264.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	269,400	15.60	4,202,640.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	118,250	64.46	7,622,395.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	92.83	160,410.24	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	157.40	3,824,820.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	6,188	442.56	2,738,561.28	
SHENZHEN LONGSYS ELECTRONI-A	5,300	620.00	3,286,000.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	9,009	66.37	597,927.33	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	25,800	261.32	6,742,056.00	
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNI-A	12,320	271.50	3,344,880.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	594,600	5.36	3,187,056.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18,340	35.68	654,371.20	
VICTORY GIANT TECHNOLOGY -A	9,900	296.70	2,937,330.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	13.31	714,880.10	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	29,000	137.30	3,981,700.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	34.26	539,595.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	17.25	522,675.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	12,180	1,194.90	14,553,882.00	
ZTE CORP-A	61,300	40.33	2,472,229.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.10	1,733,480.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	293,800	8.91	2,617,758.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	3.68	887,984.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	309,280	27.77	8,588,705.60	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	15.42	857,352.00	

	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.73	1,493,261.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	134,000	13.73	1,839,820.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	14.68	1,354,964.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	10,574	471.59	4,986,592.66	
	AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	102.40	1,038,131.20	
	CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	7,144	1,535.01	10,966,111.44	
	CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	92.70	1,949,666.40	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	663.49	4,161,409.28	
	HANGZHOU CHANG CHUAN TECHN-A	12,400	374.00	4,637,600.00	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	29,635	14.69	435,338.15	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	18,400	48.40	890,560.00	
	HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	26,452	363.46	9,614,243.92	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	236.02	1,770,150.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	7.50	256,515.00	
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	103.52	3,084,896.00	
	JINKO SOLAR CO LTD-A	122,986	4.29	527,609.94	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	11.83	1,187,022.20	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	18,806	285.80	5,374,754.80	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	8,235	878.43	7,233,871.05	
	OMNIVISION INTEGRATED CIRCUITS-A	15,290	107.14	1,638,170.60	
	PIOTECH INC-A	4,717	832.00	3,924,544.00	
	SG MICRO CORP-A	5,323	134.86	717,859.78	
	SHENZHEN TECHWINSEMI TECHN-A	4,400	860.48	3,786,112.00	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	11.03	406,731.25	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	23.73	777,157.50	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	72.17	1,621,371.22	
	TONGWEI CO LTD-A	66,600	11.09	738,594.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	12.55	318,995.90	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	87.09	597,350.31	
	VERISILICON MICROELECTRONI-A	10,159	328.56	3,337,841.04	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	49.50	842,589.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	6.39	349,533.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	126,100	2.71	341,731.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	4.60	376,280.00	
オフショア人民元 小計		25,399,633		533,847,680.24 (12,731,840,095)	
サウジアラビアリアル	ADES HOLDING CO	62,319	19.28	1,201,510.32	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	1,158,228	26.72	30,947,852.16	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	42,916	125.00	5,364,500.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	221,078	57.75	12,767,254.50	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	165,586	51.55	8,535,958.30	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	30.70	1,568,125.30	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	6,159	173.80	1,070,434.20	

	JABAL OMAR DEVELOPMENT CO	102,723	15.37	1,578,852.51	
	JARIR MARKETING CO	125,000	17.61	2,201,250.00	
	ALMARAI CO	90,153	46.76	4,215,554.28	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	16,399	213.50	3,501,186.50	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	62.10	988,880.40	
	AL RAJHI BANK	565,523	65.20	36,872,099.60	
	ALINMA BANK	270,458	24.50	6,626,221.00	
	ARAB NATIONAL BANK	165,586	21.19	3,508,767.34	
	BANK AL-JAZIRA	115,508	11.87	1,371,079.96	
	BANK ALBILAD	134,552	24.27	3,265,577.04	
	BANQUE SAUDI FRANSI	196,694	19.65	3,865,037.10	
	RIYAD BANK	360,610	20.60	7,428,566.00	
	SAUDI AWWAL BANK	191,132	32.10	6,135,337.20	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	88,300	13.66	1,206,178.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	540,916	38.38	20,760,356.08	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	133.10	1,458,376.70	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	162.90	2,316,926.70	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	13,523	142.30	1,924,322.90	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	202.10	892,675.70	
	ELM CO	4,641	663.00	3,076,983.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	71,844	62.25	4,472,289.00	
	SAUDI TELECOM CO	405,649	43.50	17,645,731.50	
	ACWA POWER CO	43,575	192.00	8,366,400.00	
	SAUDI ENERGY CO	162,109	18.05	2,926,067.45	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	18.69	1,887,521.79	
	MAKKAH CONSTRUCTION & DEVEPL	16,801	87.65	1,472,607.65	
サウジアラビアリアル 小計		5,535,573		211,420,480.18 (9,148,164,177)	
合　計		700,467,212		368,208,445,655 (368,208,445,655)	

(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	17,612,424.00	
	メキシコペソ 小計		97,360	17,612,424.00 (162,803,963)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	220,516	12,278,330.88	
		ENERGISA SA-UNITS	61,140	3,063,114.00	
		KLABIN SA-UNIT	159,378	2,773,177.20	
	ブラジルレアル 小計		441,034	18,114,622.08 (573,545,164)	
投資信託受益証券合計			538,394	736,349,127 (736,349,127)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	525,800	15,605,744.00	

		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	195,177	15,030,580.77	
	メキシコペソ 小計		720,977	30,636,324.77 (283,192,995)	
投資証券合計			720,977	283,192,995 (283,192,995)	
合計				1,019,542,122 (1,019,542,122)	

(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　21銘柄	100.0%	—	—	1.7%
メキシコペソ	株式　18銘柄	92.8%	—	—	1.6%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	2.6%	—	0.0%
	投資証券　2銘柄	—	—	4.6%	0.1%
ブラジルレアル	株式　38銘柄	95.4%	—	—	3.3%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	4.6%	—	0.2%
チリペソ	株式　10銘柄	100.0%	—	—	0.5%
コロンビアペソ	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ユーロ	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.5%
トルコリラ	株式　11銘柄	100.0%	—	—	0.4%
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　16銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ロシアルーブル	株式　14銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式　159銘柄	100.0%	—	—	16.2%
マレーシアリンギット	株式　21銘柄	100.0%	—	—	0.9%
タイバーツ	株式　18銘柄	100.0%	—	—	1.0%
フィリピンペソ	株式　10銘柄	100.0%	—	—	0.3%
インドネシアルピア	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.5%
韓国ウォン	株式　77銘柄	100.0%	—	—	21.3%
新台湾ドル	株式　77銘柄	100.0%	—	—	27.4%
インドルピー	株式　165銘柄	100.0%	—	—	11.5%
カタールリアル	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.5%
南アフリカランド	株式　27銘柄	100.0%	—	—	3.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　16銘柄	100.0%	—	—	1.2%
クウェートディナール	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.5%
オフショア人民元	株式　251銘柄	100.0%	—	—	3.4%
サウジアラビアリアル	株式　33銘柄	100.0%	—	—	2.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,751,508,304
投資証券	118,903,695,950
派生商品評価勘定	68,677,580
未収配当金	1,196,950,725
未収利息	46,306
差入委託証拠金	121,527,461
流動資産合計	122,042,406,326
資産合計	122,042,406,326
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	117,260
前受金	68,915,620
未払金	64,188,529
未払解約金	74,999,038
流動負債合計	208,220,447
負債合計	208,220,447
純資産の部	
元本等	
元本	51,221,160,142
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	70,613,025,737
元本等合計	121,834,185,879
純資産合計	121,834,185,879
負債純資産合計	122,042,406,326

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
２.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。

	2026年 7月10日現在
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		51,221,160,142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	2.3786円
	(1万口当たり純資産額)	(23,786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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2026年 7月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	44,725,322,251円
期中追加設定元本額	10,811,426,163円
期中一部解約元本額	4,315,588,272円
期末元本額	51,221,160,142円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,881,276,716円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,855,965円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	12,827,366,592円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	24,623,072,243円
コア投資戦略ファンド（安定型）	489,902,181円
コア投資戦略ファンド（成長型）	891,165,329円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,174,303,448円
分散投資コア戦略ファンドＳ	3,039,854,721円
コア投資戦略ファンド（切替型）	390,967,356円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	24,061,234円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	129,389,649円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	25,539,478円
グローバル経済コア	2,247,851,946円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	24,529,576円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	284,450,348円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	72,653,624円
Ｍｙ　ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	2,582,679,085円
１０資産分散投資ファンド	37,108,165円
グローバル１０資産バランスファンド	128,476,234円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	163,584,020円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	10,398,366円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	73,568,746円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ１（適格機関投資家専用）	28,997円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ２（適格機関投資家専用）	27,081円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ３（適格機関投資家専用）	40,799円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ４（適格機関投資家専用）	58,362円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ５（適格機関投資家専用）	39,546円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ６（適格機関投資家専用）	25,741円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	90,884,594円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△10,421,323,316
合計	△10,421,323,316

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	2,842,121,880	－	2,911,037,500	68,915,620
合計		2,842,121,880	－	2,911,037,500	68,915,620

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,454	289,081,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,553	405,042,000	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	5,533	621,909,200	
	東海道リート投資法人	2,781	288,111,600	
	三井不動産アコモデーションファンド投資法人	19,146	2,349,214,200	
	森ヒルズリート投資法人	12,836	1,662,262,000	
	産業ファンド投資法人	20,242	2,892,581,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	22,835	3,436,667,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	17,122	2,344,001,800	
	ＧＬＰ投資法人	36,489	5,079,268,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	16,801	1,765,785,100	
	日本プロロジスリート投資法人	57,087	5,006,529,900	
	星野リゾート・リート投資法人	4,456	1,063,201,600	
	Ｏｎｅリート投資法人	6,611	499,791,600	
	イオンリート投資法人	13,466	1,679,210,200	
	ヒューリックリート投資法人	9,799	1,528,644,000	
	日本リート投資法人	14,630	1,217,216,000	
	積水ハウス・リート投資法人	32,734	2,500,877,600	
	トーセイ・リート投資法人	2,411	320,663,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	2,878	318,306,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	3,072	291,532,800	
	野村不動産マスターファンド投資法人	35,338	5,364,308,400	
	いちごホテルリート投資法人	1,835	218,915,500	
	ラサールロジポート投資法人	13,905	2,037,082,500	
	スターアジア不動産投資法人	20,436	1,136,241,600	
	マリモ地方創生リート投資法人	2,028	216,387,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	24,488	2,666,743,200	
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	3,244	215,726,000	
	投資法人みらい	15,271	640,618,450	
	三菱地所物流リート投資法人	11,294	1,364,315,200	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	4,665	662,896,500	

	セントラル・リート投資法人	1,799	189,434,700	
	ＭＩＲＡＲＴＨ不動産投資法人	8,073	670,059,000	
	霞ヶ関ホテルリート投資法人	1,380	134,136,000	
	日本ビルファンド投資法人	66,986	8,694,782,800	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	58,247	6,902,269,500	
	日本都市ファンド投資法人	57,584	6,564,576,000	
	オリックス不動産投資法人	44,192	4,317,558,400	
	日本プライムリアルティ投資法人	30,750	2,896,650,000	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	11,167	1,505,311,600	
	東急リアル・エステート投資法人	7,312	1,380,505,600	
	グローバル・ワン不動産投資法人	8,716	967,476,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	25,567	4,126,513,800	
	森トラストリート投資法人	21,376	1,598,924,800	
	インヴィンシブル投資法人	61,216	3,703,568,000	
	三井不動産商業ファンド投資法人	19,490	1,586,486,000	
	平和不動産リート投資法人	9,114	1,224,010,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	21,985	2,121,552,500	
	福岡リート投資法人	6,260	1,096,752,000	
	ＫＤＸ不動産投資法人	32,337	5,034,870,900	
	いちごオフィスリート投資法人	7,950	736,170,000	
	大和証券オフィス投資法人	4,490	1,474,965,000	
	阪急阪神リート投資法人	5,288	738,204,800	
	スターツプロシード投資法人	1,854	348,366,600	
	大和ハウスリート投資法人	34,528	4,184,793,600	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	47,266	3,738,740,600	
	大和証券リビング投資法人	16,237	1,589,602,300	
	ジャパンエクセレント投資法人	9,298	1,294,281,600	
合計		1,059,902	118,903,695,950	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	195,565,635
コール・ローン	1,441,276,141
投資証券	190,216,239,774

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	3,546,002
未収入金	2,675,396
未収配当金	770,492,629
未収利息	38,104
前払金	249,696
差入委託証拠金	443,949,401
流動資産合計	193,074,032,778
資産合計	193,074,032,778
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,904,590
未払解約金	1,384,658,977
流動負債合計	1,388,563,567
負債合計	1,388,563,567
純資産の部	
元本等	
元本	47,644,619,650
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	144,040,849,561
元本等合計	191,685,469,211
純資産合計	191,685,469,211
負債純資産合計	193,074,032,778

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益

	2026年 7月10日現在
	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）

	2026年 7月10日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		47,644,619,650口
2． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	4.0232円
	(1万口当たり純資産額)	(40,232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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、不動産投信指数先物取引及び為替予約取引を行っております。不動産投信指数先物取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。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

	2026年 7月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日

区分	2026年 7月10日現在
期首元本額	44,973,888,461円
期中追加設定元本額	8,161,382,268円
期中一部解約元本額	5,490,651,079円
期末元本額	47,644,619,650円
期末元本額の内訳	
グローバル３資産バランスオープン	39,487,683円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	57,044,847円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,324,787,484円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	4,676,400円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	10,166,284,227円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	25,505,009,035円
コア投資戦略ファンド（安定型）	306,885,771円
コア投資戦略ファンド（成長型）	981,954,162円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,162,571,953円
分散投資コア戦略ファンドＳ	3,396,853,327円
コア投資戦略ファンド（切替型）	382,334,477円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	96,248,120円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	132,735,680円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	15,299,377円
グローバル経済コア	1,330,851,542円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	19,470,021円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	347,052,224円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	102,367,970円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	736,433,109円
１０資産分散投資ファンド	13,480,983円
グローバル１０資産バランスファンド	75,693,284円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,122,858,901円
ＦＯＦｓ用　グローバルＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	139,233,082円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	93,868,465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）	36,397,223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）	54,616,707円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ１（適格機関投資家専用）	23,432円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ２（適格機関投資家専用）	20,212円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ３（適格機関投資家専用）	20,108円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ４（適格機関投資家専用）	11,985円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ５（適格機関投資家専用）	27,133円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ６（適格機関投資家専用）	20,726円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	16,459,149,100
合計	16,459,149,100

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	1,536,456,475	－	1,536,206,779	△249,696

合計	1,536,456,475	―	1,536,206,779	△249,696

(注)1.時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、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.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	181,663,468	―	181,554,576	△108,892
	アメリカドル	181,663,468	―	181,554,576	△108,892
合計		181,663,468	―	181,554,576	△108,892

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	88,310	1,876,587.50	
		AGREE REALTY CORP	83,011	6,462,406.35	
		AH REALTY TRUST INC	52,451	371,353.08	
		ALEXANDER'S INC	1,640	445,522.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	106,466	5,164,665.66	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	116,565.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	34,706	870,079.42	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	132,635	7,141,068.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	218,004	7,181,051.76	
		AMERICOLD REALTY TRUST	196,451	3,088,209.72	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	150,653	2,472,215.73	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	95,609	18,114,081.14	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	59,122.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	107,083	327,673.98	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	212,107	6,562,590.58	

		BROADSTONE NET LEASE INC-A	130,085	2,811,136.85
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	74,250.00
		BXP INC	100,695	6,739,516.35
		CAMDEN PROPERTY TRUST	69,180	7,837,402.20
		CARETRUST REIT INC	162,585	6,643,223.10
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,932	622,731.08
		CENTERSPACE	12,403	684,397.54
		CHATHAM LODGING TRUST	32,047	404,112.67
		CHIRON REAL ESTATE INC	7,558	275,111.20
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,980	266,793.80
		COPT DEFENSE PROPERTIES	77,689	2,829,433.38
		COUSINS PROPERTIES INC	114,954	3,479,657.58
		CTO REALTY GROWTH INC	17,709	379,503.87
		CUBESMART	153,987	6,127,142.73
		CURBLINE PROPERTIES CORP	65,598	2,000,739.00
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	137,584	1,630,370.40
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	779,700	389,850.00
		DIGITAL REALTY TRUST INC	238,858	42,834,405.14
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	156,749	1,420,145.94
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	111,006	1,318,751.28
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	31,854	788,386.50
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	36,813	7,746,559.59
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	85,931	463,168.09
		EPR PROPERTIES	51,889	3,091,027.73
		EQUINIX INC	67,586	69,942,723.82
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	132,933	8,421,305.55
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	234,244	15,949,673.96
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	148,824	4,643,308.80
		ESSEX PROPERTY TRUST	44,322	12,903,020.64
		EXTRA SPACE STORAGE INC	144,335	20,593,717.80
		FARMLAND PARTNERS INC	28,000	265,440.00
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	54,353	6,562,037.69
		FERMI INC	20,897	152,966.04
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	90,044	5,842,955.16
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	73,198	1,808,722.58
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	23,400.25
		FRONTVIEW REIT INC	17,292	362,613.24
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	194,809	8,384,579.36
		GETTY REALTY CORP	37,558	1,287,112.66
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	34,599	429,373.59
		GLADSTONE LAND CORP	24,504	209,754.24

		GLOBAL NET LEASE INC	132,132	1,190,509.32	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	238,350	4,931,461.50	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	471,382	10,167,709.74	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	75,541	2,383,318.55	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	434,483	10,062,626.28	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	36,193	557,734.13	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	160,604	2,685,298.88	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	47,642	425,919.48	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	18,973	1,195,868.19	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	51,968	1,836,029.44	
		INVITATION HOMES INC	376,124	11,046,761.88	
		IRON MOUNTAIN INC	204,553	24,439,992.44	
		JBG SMITH PROPERTIES	40,564	584,121.60	
		KILROY REALTY CORPORATION	74,945	2,866,646.25	
		KIMCO REALTY CORP	464,057	11,568,941.01	
		KITE REALTY GROUP TRUST	139,754	3,938,267.72	
		LAMAR ADVERTISING CO-A	59,965	9,729,321.25	
		LINEAGE INC	40,723	1,790,997.54	
		LTC PROPERTIES INC	33,480	1,310,407.20	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	40,748	2,243,584.88	
		MACERICH CO/THE	195,083	4,863,419.19	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	42,593.36	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	345,266	1,588,223.60	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	80,226	10,910,736.00	
		MILLROSE PROPERTIES	105,679	2,992,829.28	
		MODIV INDUSTRIAL INC	6,921	121,325.13	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	48,296	2,155,450.48	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	31,955	2,433,053.70	
		NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,552	94,499.60	
		NETSTREIT CORP	66,074	1,431,162.84	
		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	19,790	103,897.50	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	13,856	377,991.68	
		NNN REIT INC	129,590	6,027,230.90	
		NTT DC REIT	554,000	520,760.00	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	205,527	10,035,883.41	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	12,485	309,628.00	
		ORION PROPERTIES INC	34,844	96,866.32	
		OUTFRONT MEDIA INC	102,471	3,464,544.51	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	139,131	1,967,312.34	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	77,664	1,397,952.00	
		PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	85,377	3,585,834.00	
		PIEDMONT REALTY TRUST INC	85,893	801,381.69	
		POSTAL REALTY TRUST INC- A	19,545	473,379.90	

		PRIME US REIT	694,500	110,425.50	
		PROLOGIS INC	639,277	90,368,196.72	
		PUBLIC STORAGE	108,495	34,647,878.25	
		REALTY INCOME CORP	639,275	40,383,001.75	
		REGENCY CENTERS CORP	112,892	8,968,140.48	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	154,128	5,244,975.84	
		RLJ LODGING TRUST	100,534	1,141,060.90	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	42,910	5,434,122.40	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	172,444	3,428,186.72	
		SAFEHOLD INC	35,108	572,962.56	
		SAUL CENTERS INC	10,215	366,820.65	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	78,408	686,070.00	
		SIMON PROPERTY GROUP	222,408	48,865,261.68	
		SITE CENTERS CORP	43,332	182,427.72	
		SL GREEN REALTY CORP	49,009	2,368,604.97	
		SMARTSTOP SELF STORAGE REIT	38,515	1,252,507.80	
		STAG INDUSTRIAL INC	130,029	5,060,728.68	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	67,952	440,328.96	
		SUN COMMUNITIES INC	79,418	9,430,093.32	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	130,128	1,461,337.44	
		TANGER INC	78,689	3,105,854.83	
		TERRENO REALTY CORP	73,435	5,033,234.90	
		UDR INC	203,488	8,076,438.72	
		UMH PROPERTIES INC	57,370	876,613.60	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,811	340,637.71	
		URBAN EDGE PROPERTIES	87,233	1,981,933.76	
		VENTAS INC	332,858	30,536,392.92	
		VICI PROPERTIES INC	752,113	19,502,290.09	
		VORNADO REALTY TRUST	109,652	4,176,644.68	
		WELLTOWER INC	484,097	112,368,595.64	
		WHITESTONE REIT	27,912	529,490.64	
		WP CAREY INC	153,293	10,877,671.28	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,467	1,280,129.39	
	アメリカドル 小計		18,134,748	938,744,247.35 (152,207,992,265)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	57,109	583,653.98	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	16,372	1,085,954.76	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	51,383	1,807,140.11	
		CHOICE PROPERTIES REIT	108,232	1,786,910.32	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,196	709,861.36	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	34,070	628,932.20	
			97,402	1,387,004.48	

		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR			
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,669	50,283.96	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	73,393	1,715,928.34	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,766	2,010,564.12	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	93,406	1,035,872.54	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	42,842	579,652.26	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	38,865	735,325.80	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	197,469.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,956	221,547.60	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	24,488	198,352.80	
		PRIMARIS REIT	36,771	820,361.01	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	97,997	2,219,632.05	
		SLATE GROCERY REIT	16,578	292,435.92	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	49,393	1,498,089.69	
		VITAL INFRASTRUCTURE PROPERT	83,623	464,943.88	
	カナダドル 小計		1,009,611	20,029,916.18 (2,292,824,505)	
	ユーロ	AEDIFICA	63,105	4,370,021.25	
		ALTAREA	4,368	420,201.60	
		ASCENCIO	4,026	208,144.20	
		CARE PROPERTY INVEST	30,913	390,740.32	
		CARMILA	44,780	746,034.80	
		COLONIAL SFL SOCIMI SA	224,583	1,201,519.05	
		COVIVIO(FP)	37,606	1,996,878.60	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	30,767	824,555.60	
		GECINA SA	36,790	2,566,102.50	
		HAMBORNER REIT AG	63,804	282,970.74	
		ICADE	19,349	353,893.21	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	137,863.20	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	363,595	407,953.59	
		KLEPIERRE	153,165	5,489,433.60	
		MERCIALYS	62,242	725,741.72	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	295,334	4,400,476.60	
		MONTEA NV	15,867	1,059,915.60	
		NSI NV	9,048	157,435.20	
		RETAIL ESTATES	9,104	622,713.60	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	20,778	545,422.50	
		STONEWEG EUROPE STAPLED TRUS	233,500	368,930.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	83,340	8,538,183.00	
		VASTNED NV	5,521	161,489.25	

	WAREHOUSES DE PAUW SCA	128,239	2,798,174.98	
	WERELDHAVE NV	25,580	492,670.80	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	25,694	704,015.60	
ユーロ 小計		2,024,888	39,971,481.11 (7,413,510,601)	
イギリスポンド	AEW UK REIT PLC	116,000	126,440.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	141,302	1,219,436.26	
	BRITISH LAND CO PLC	697,520	2,924,003.84	
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	36,721.27	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	282,925	254,066.65	
	DERWENT LONDON PLC	76,939	1,543,396.34	
	GRAINGER PLC	503,000	869,184.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	289,598	974,786.86	
	HAMMERSON PLC	367,968	1,361,481.60	
	HELICAL PLC	65,400	127,922.40	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	0.05	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	508,620	3,346,719.60	
	LIVING REIT PLC	203,286	152,464.50	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,638,690	3,077,459.82	
	NEWRIVER REIT PL	243,258	195,092.91	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	348,000	250,908.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	1,741,079	1,620,944.54	
	REGIONAL REIT LTD	91,200	86,731.20	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	148,184	882,435.72	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	345,000	159,390.00	
	SEGRO PLC	932,791	8,104,088.20	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,339,331	1,872,384.73	
	SIRIUS REAL ESTATE LTD	1,148,389	1,082,356.63	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	855,140	755,943.76	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	391,425	436,830.30	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,688,094	2,741,464.65	
	UNITE GROUP PLC	340,133	1,758,487.61	
	WORKSPACE GROUP PLC	97,321	322,716.43	
イギリスポンド 小計		15,198,189	36,283,857.87 (7,896,093,149)	
オーストラリアドル	ABACUS GROUP	292,392	271,924.56	
	ARENA REIT	262,754	848,695.42	
	BWP PROPERTY GROUP LTD	400,528	1,542,032.80	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	570,045	1,023,230.77	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	349,004	1,036,541.88	
	CENTURIA OFFICE REIT	265,798	236,560.22	
	CHARTER HALL GROUP	329,248	7,194,068.80	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	442,365	1,601,361.30	

		CHARTER HALL RETAIL REIT	331,778	1,280,663.08	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	210,134	550,551.08	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	1,081,957	454,421.94	
		DEXUS	737,499	4,137,369.39	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	182,790	444,179.70	
		DIGICO INFRASTRUCTURE REIT	283,375	705,603.75	
		GOODMAN GROUP	1,405,715	42,058,992.80	
		GPT GROUP	1,307,880	6,330,139.20	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	177,646	381,938.90	
		HEALTHCO REIT	300,321	208,723.09	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	1,237,561	1,571,702.47	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	269,063	1,173,114.68	
		MIRVAC GROUP	2,702,704	4,581,083.28	
		REGION GROUP	772,407	1,815,156.45	
		RURAL FUNDS GROUP	283,235	563,637.65	
		SCENTRE GROUP	3,602,158	13,868,308.30	
		STOCKLAND	1,703,304	6,711,017.76	
		STORAGE KING GROUP	272,015	352,259.42	
		VICINITY CENTERS	2,678,511	6,964,128.60	
		WAYPOINT REIT LTD	439,735	1,064,158.70	
	オーストラリアドル 小計		22,891,922	108,971,565.99 (12,269,108,614)	
	ニュージーランドドル	GOODMAN NEW ZEALAND LTD & GO	789,830	1,658,643.00	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	365,271	699,493.96	
	ニュージーランドドル 小計		1,155,101	2,358,136.96 (220,650,875)	
	香港ドル	CHAMPION REIT	1,300,000	2,743,000.00	
		FORTUNE REIT	1,036,000	4,693,080.00	
		LINK REIT	1,797,200	67,970,104.00	
		PROSPERITY REIT	716,000	1,045,360.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,239,810.00	
		YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,756,660	1,159,395.60	
	香港ドル 小計		7,166,860	78,850,749.60 (1,631,422,009)	
	シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	475,900	775,717.00	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,864,192	7,131,838.08	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,878,877	1,690,989.30	
		CAPITALAND CHINA TRUST	898,421	583,973.65	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	4,158,996	10,064,770.32	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	547,900	416,404.00	
		CENTURION ACCOMMODATION REIT	667,100	733,810.00	

		EC WORLD REIT	180,000	46,704.60	
		ESR-REIT	368,246	850,648.26	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	821,600	468,312.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	962,007	2,154,895.68	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,969,896	1,910,799.12	
		KEPPEL DC REIT	1,367,686	3,036,262.92	
		KEPPEL REIT	2,331,206	2,051,461.28	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	1,768,750	1,017,031.25	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,470,263	2,822,904.96	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,354,185	2,895,647.55	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,540,773	2,003,004.90	
		OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,716,500	617,940.00	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	282,000	1,153,380.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	199,665.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	1,109,300	599,022.00	
		SUNTEC REIT	1,480,800	2,176,776.00	
	シンガポールドル 小計		31,510,398	45,401,957.87 (5,698,399,732)	
	韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	135,171	431,195,490.00	
		HANWHA REIT CO LTD	82,620	385,009,200.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	62,099	210,826,105.00	
		JR REIT XXVII	117,405	138,772,710.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	27,961	112,403,220.00	
		LOTTE REIT CO LTD	102,278	352,859,100.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	82,163	424,782,710.00	
		SK REITS CO LTD	133,844	772,279,880.00	
	韓国ウォン 小計		743,541	2,828,128,415.00 (303,814,523)	
	イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	574,392	1,076,985.00	
		REIT 1 LTD	121,300	2,609,163.00	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	178,097	1,574,555.57	
	イスラエルシェケル 小計		873,789	5,260,703.57 (282,423,501)	
合計			100,709,047	190,216,239,774 (190,216,239,774)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率

アメリカドル	投資証券	133銘柄	100.0%	80.0%
カナダドル	投資証券	21銘柄	100.0%	1.2%
ユーロ	投資証券	26銘柄	100.0%	3.9%
イギリスポンド	投資証券	28銘柄	100.0%	4.2%
オーストラリアドル	投資証券	28銘柄	100.0%	6.5%
ニュージーランドドル	投資証券	2銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	投資証券	6銘柄	100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券	23銘柄	100.0%	3.0%
韓国ウォン	投資証券	8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	3銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	345,071,273
コール・ローン	647,128,874
社債券	42,586,054,786
未収利息	17,108
流動資産合計	43,578,272,041
資産合計	43,578,272,041
負債の部	
流動負債	
未払解約金	210,212,634
流動負債合計	210,212,634
負債合計	210,212,634
純資産の部	
元本等	
元本	48,854,408,588
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△5,486,349,181
元本等合計	43,368,059,407
純資産合計	43,368,059,407
負債純資産合計	43,578,272,041

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

	2026年 7月10日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		48,854,408,588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	5,486,349,181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 (1万口当たり純資産額)	0.8877円 (8,877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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2026年 7月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	47,793,990,102円
期中追加設定元本額	11,838,683,719円
期中一部解約元本額	10,778,265,233円
期末元本額	48,854,408,588円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（ＳＭＡ専用）	38,108,591,835円
コア投資戦略ファンド（安定型）	961,774,057円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,850,815,273円
コア投資戦略ファンド（切替型）	684,863,010円
ＳＭＴＡＭコモディティ・オープン	4,711,861,668円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	544,059,998円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	162,692,231円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	1,435,026,523円
ＦＯＦｓ用　グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	320,260,416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）	74,463,577円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	△2,146,247,180
合計	△2,146,247,180

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 044 02/26/27	12,000,000.00	11,738,400.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000.00	6,012,000.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000.00	6,789,000.00	
		MS SPACE II 001 03/29/30	20,000,000.00	24,990,000.00	
		SG ISSUER 046 08/28/26	23,000,000.00	27,117,000.00	
		SG ISSUER 047 10/30/26	29,000,000.00	32,709,100.00	
		SG ISSUER 048 12/30/26	24,000,000.00	25,740,000.00	
		SG ISSUER 050 05/28/27	23,000,000.00	21,339,400.00	
		STAR HELIOS 008 10/26/26	50,000,000.00	106,215,000.00	

	アメリカドル 小計	236,000,000.00	262,649,900.00 (42,586,054,786)	
合計			42,586,054,786 (42,586,054,786)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券　　9銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	14,017,684
コール・ローン	158,325,215
投資信託受益証券	70,903,768,748
派生商品評価勘定	49,737,581
未収利息	4,185
流動資産合計	71,125,853,413
資産合計	71,125,853,413
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	220,951
未払解約金	1,744,897
流動負債合計	1,965,848
負債合計	1,965,848
純資産の部	
元本等	
元本	31,417,902,911
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	39,705,984,654
元本等合計	71,123,887,565
純資産合計	71,123,887,565
負債純資産合計	71,125,853,413

注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2026年 7月10日現在	
1.　計算期間の末日における受益権の総数		31,417,902,911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	2.2638円
	(1万口当たり純資産額)	(22,638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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、当該規定に従い為替ヘッジを目的とした為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2026年 7月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2026年 7月10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	(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。 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	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	25,485,442,582円
期中追加設定元本額	10,766,018,235円
期中一部解約元本額	4,833,557,906円
期末元本額	31,417,902,911円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	760,534,380円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,472,273,565円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,933,102,553円
分散投資コア戦略ファンドＳ	10,111,521,606円
コア投資戦略ファンド（切替型）	565,241,185円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	164,080,230円
グローバル経済コア	9,491,021,052円
ＳＭＴ　ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	4,984,049,287円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	432,818,039円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	123,831,422円
１０資産分散投資ファンド	64,345,177円
グローバル１０資産バランスファンド	136,454,735円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	109,103,845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）	69,284,240円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ１（適格機関投資家専用）	34,005円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ２（適格機関投資家専用）	33,027円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ３（適格機関投資家専用）	41,821円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ４（適格機関投資家専用）	47,069円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ５（適格機関投資家専用）	46,990円
グローバル１０資産バランス・アクティブ型ファンドＮ６（適格機関投資家専用）	38,683円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	9,406,463,792
合計	9,406,463,792

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	227,168,631	－	227,749,130	580,499
	アメリカドル	227,168,631	－	227,749,130	580,499
	売建	69,223,042,367	－	69,174,106,236	48,936,131
	アメリカドル	69,223,042,367	－	69,174,106,236	48,936,131
合計		69,450,210,998	－	69,401,855,366	49,516,630

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST MICRO	3,982,547	163,563,205.29	
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST	3,357,082	273,736,466.28	
	アメリカドル 小計		7,339,629	437,299,671.57 (70,903,768,748)	
合計			7,339,629	70,903,768,748 (70,903,768,748)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券2銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	72,132,638
社債券	23,739,141,000
未収利息	1,907
流動資産合計	23,811,275,545
資産合計	23,811,275,545
負債の部	
流動負債	
未払解約金	19,891
流動負債合計	19,891
負債合計	19,891
純資産の部	
元本等	
元本	20,934,954,951
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,876,300,703
元本等合計	23,811,255,654
純資産合計	23,811,255,654
負債純資産合計	23,811,275,545

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 7月10日現在
１．　計算期間の末日における受益権の総数		20,934,954,951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	1.1374円
	(1万口当たり純資産額)	(11,374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

	2026年 7月10日現在
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
３.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2026年 7月10日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	10,449,715,264円
期中追加設定元本額	10,912,233,914円
期中一部解約元本額	426,994,227円
期末元本額	20,934,954,951円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	851,536,321円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,015,328,943円
コア投資戦略ファンド（切替型）	512,961,321円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	397,701,043円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	17,579,393,009円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	246,422,454円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	58,170,555円
ＦＯＦｓ用　コモディティＬＳアルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	273,441,305円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	1,222,465,000
合計	1,222,465,000

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「コモディティＬＳアルファ・マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	ソシエテ・ジェネラル　０％　２０２７／０２／２６	6,800,000,000	6,445,720,000	
	ＭＳ　ＳＰＡＣＥ　ＩＩ　０％　２０３０／０３／２９	7,600,000,000	6,764,760,000	
	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　０７／１６／２７	9,230,000,000	10,528,661,000	
合計		23,630,000,000	23,739,141,000	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

貸借対照表

	2026年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,733,911,273
国債証券	13,612,964,600
派生商品評価勘定	292,108,722
未収利息	151,592
前払金	43,363,197
差入委託証拠金	2,659,063,792
流動資産合計	22,341,563,176
資産合計	22,341,563,176
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	338,233,713
未払解約金	19,987
流動負債合計	338,253,700
負債合計	338,253,700
純資産の部	
元本等	
元本	20,576,674,425
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,426,635,051
元本等合計	22,003,309,476
純資産合計	22,003,309,476
負債純資産合計	22,341,563,176

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 7月10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 (1)先物取引

	2026年 7月10日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場)によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2026年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		20,576,674,425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	1.0693円
	(1万口当たり純資産額)	(10,693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

	2026年 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2026年 7月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2026年 7月10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	(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。 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	2026年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	21,206,036,229円
期中追加設定元本額	5,049,427,568円
期中一部解約元本額	5,678,789,372円
期末元本額	20,576,674,425円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	557,838,252円
コア投資戦略ファンド（成長型）	643,408,736円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,509,745,973円
分散投資コア戦略ファンドＳ	4,548,566,830円
コア投資戦略ファンド（切替型）	288,138,243円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	238,045,191円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	12,194,940,386円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	141,553,087円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	36,757,716円
ＳＭＴＡＭ・ＦＯＦｓ用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド（４％目標コース）（適格機関投資家専用）	161,428,109円
ＦＯＦｓ用　ＧＢＣＡファンドＳ（ミドルリスク型）（適格機関投資家専用）	256,251,902円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	35,593,800
合計	35,593,800

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	26,114,950,883	－	25,994,423,697	△120,527,186

	売建	14,367,022,910	—	14,289,858,921	77,163,989
合計		40,481,973,793	—	40,284,282,618	△43,363,197

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2026年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	29,759,792,196	—	29,889,993,709	130,201,513
	アメリカドル	5,010,905,329	—	5,029,738,638	18,833,309
	カナダドル	1,839,609,713	—	1,843,404,267	3,794,554
	ユーロ	7,112,559,400	—	7,120,067,057	7,507,657
	イギリスポンド	2,872,358,723	—	2,903,432,969	31,074,246
	スイスフラン	1,387,049,224	—	1,387,256,068	206,844
	スウェーデンクローナ	176,024,786	—	175,841,697	△183,089
	ノルウェークローネ	3,767,785,512	—	3,734,244,199	△33,541,313
	オーストラリアドル	2,352,062,657	—	2,364,927,224	12,864,567
	ニュージーランドドル	5,241,436,852	—	5,331,081,590	89,644,738
	売建	33,270,092,260	—	33,403,015,637	△132,923,377
	アメリカドル	894,667,682	—	896,448,435	△1,780,753
	カナダドル	3,562,247,031	—	3,552,332,845	9,914,186
	ユーロ	9,533,260,253	—	9,573,715,186	△40,454,933
	イギリスポンド	4,604,441,684	—	4,678,514,489	△74,072,805
	スイスフラン	5,802,306,734	—	5,806,959,355	△4,652,621
	スウェーデンクローナ	3,634,828,795	—	3,628,728,714	6,100,081
	ノルウェークローネ	1,474,240,578	—	1,482,727,870	△8,487,292
	オーストラリアドル	488,978,514	—	487,502,483	1,476,031
	ニュージーランドドル	3,275,120,989	—	3,296,086,260	△20,965,271
合計		63,029,884,456	—	63,293,009,346	△2,721,864

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第１３１９回国庫短期証券	3,000,000,000	2,999,373,000	
	第１３６３回国庫短期証券	2,000,000,000	1,986,890,000	
	第１３６９回国庫短期証券	1,700,000,000	1,687,076,600	
	第１３７５回国庫短期証券	7,000,000,000	6,939,625,000	
合計		13,700,000,000	13,612,964,600	

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】

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

【純資産額計算書】

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	22,885,635,887円
Ⅱ　負債総額	40,900,219円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,844,735,668円
Ⅳ　発行済口数	12,991,305,447口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7585円
（1万口当たり純資産額）	（17,585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

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	1,024,268,178,397円
Ⅱ　負債総額	21,180,835,037円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,003,087,343,360円
Ⅳ　発行済口数	229,814,088,866口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.3648円
（1万口当たり純資産額）	（43,648円）

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	31,086,590,182円
Ⅱ　負債総額	28,436,346円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	31,058,153,836円
Ⅳ　発行済口数	13,071,661,157口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3760円
（1万口当たり純資産額）	（23,760円）

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

純資産額計算書

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	159,132,301,124円
Ⅱ　負債総額	719,119,883円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	158,413,181,241円
Ⅳ　発行済口数	15,258,036,810口

Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	10.3823円
（1万口当たり純資産額）	（103,823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

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	1,166,132,333,510円
Ⅱ　負債総額	231,157,436円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,165,901,176,074円
Ⅳ　発行済口数	119,037,313,000口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	9.7944円
（1万口当たり純資産額）	（97,944円）

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	35,760,579,873円
Ⅱ　負債総額	11,713,120円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	35,748,866,753円
Ⅳ　発行済口数	14,113,460,842口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5330円
（1万口当たり純資産額）	（25,330円）

世界債券総合インデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	93,656,346,666円
Ⅱ　負債総額	392,978,327円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	93,263,368,339円
Ⅳ　発行済口数	69,062,656,738口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3504円
（1万口当たり純資産額）	（13,504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

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	360,475,810,398円
Ⅱ　負債総額	1,101,387,903円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	359,374,422,495円
Ⅳ　発行済口数	49,456,341,989口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	7.2665円

（1万口当たり純資産額）	（72,665円）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	125,719,132,726円
Ⅱ　負債総額	663,377,783円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	125,055,754,943円
Ⅳ　発行済口数	51,493,647,455口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4286円
（1万口当たり純資産額）	（24,286円）

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	181,260,919,386円
Ⅱ　負債総額	11,176,274,147円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	170,084,645,239円
Ⅳ　発行済口数	41,542,519,354口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.0942円
（1万口当たり純資産額）	（40,942円）

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

純資産額計算書

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	44,675,835,559円
Ⅱ　負債総額	210,634,185円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	44,465,201,374円
Ⅳ　発行済口数	49,503,614,162口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8982円
（1万口当たり純資産額）	（8,982円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	74,109,383,435円
Ⅱ　負債総額	99,712,407円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	74,009,671,028円
Ⅳ　発行済口数	32,845,098,163口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2533円
（1万口当たり純資産額）	（22,533円）

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

純資産額計算書

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	23,800,141,777円
Ⅱ　負債総額	30,381円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	23,800,111,396円
Ⅳ　発行済口数	21,779,666,242口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0928円
（1万口当たり純資産額）	（10,928円）

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

純資産額計算書

（2026年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	22,853,391,718円
Ⅱ　負債総額	380,360,968円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,473,030,750円
Ⅳ　発行済口数	20,986,413,880口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0708円
（1万口当たり純資産額）	（10,708円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2026年 7月31日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

おいて、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

［DO（実行）］

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

各運用部の部長は、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・リスク委員会に報告されます。なお、運用・リスク委員会での報告のうち重要なものについては、経営会議（議長は社長）に報告されます。

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

委託会社の機構は2026年 7月31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。

2026年7月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	517	18,029,380
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	32	101,927
単位型公社債投資信託	48	141,168
合計	597	18,272,475

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　2025年4月1日　至　2026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 （2025年3月31日）		当事業年度 （2026年3月31日）
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		18,950		19,266
金銭の信託		18,214		22,627
前払費用		238		313
未収委託者報酬		12,164		14,109
未収運用受託報酬		6,523		8,501
未収収益		198		232
短期差入証拠金		2,476		3,061
その他		3,072		3,961
流動資産合計		61,839		72,073
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	189	※1	156
器具備品	※1	338	※1	261
その他	※1	4	※1	9
有形固定資産合計		532		428
無形固定資産				
ソフトウェア		7,143		6,735
その他		78		85
無形固定資産合計		7,221		6,820
投資その他の資産				
投資有価証券		7,241		6,387
関係会社株式		6,077		6,416
繰延税金資産		1,184		1,767
その他		31		36
投資その他の資産合計		14,534		14,608
固定資産合計		22,289		21,856
資産合計		84,128		93,930

（単位：百万円）

	前事業年度 （2025年3月31日）	当事業年度 （2026年3月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	66	72
未払金	8,472	9,776
未払収益分配金	0	0
未払手数料	6,159	7,277

その他未払金	2,313	2,498
未払費用	993	929
未払法人税等	1,743	2,484
賞与引当金	769	850
その他	705	1,664
流動負債合計	12,751	15,778
固定負債		
退職給付引当金	1,104	1,180
資産除去債務	154	154
その他	60	48
固定負債合計	1,319	1,384
負債合計	14,071	17,162
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	48,819	55,588
利益剰余金合計	51,419	58,188
株主資本合計	70,658	77,428
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	454	494
繰延ヘッジ損益	△1,056	△1,155
評価・換算差額等合計	△601	△660
純資産合計	70,057	76,767
負債・純資産合計	84,128	93,930

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）	当事業年度 （自　2025年4月1日 至　2026年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	50,052	53,621
運用受託報酬	12,144	13,510
その他営業収益	369	424
営業収益合計	62,566	67,556
営業費用		

支払手数料	25,372	27,383
広告宣伝費	258	466
公告費	1	―
調査費	6,470	6,679
調査費	1,511	1,684
委託調査費	4,945	4,981
図書費	13	12
営業雑経費	6,296	6,203
通信費	126	119
印刷費	406	356
協会費	57	56
諸会費	45	35
情報機器関連費	5,570	5,568
その他営業雑経費	89	66
営業費用合計	38,399	40,733
一般管理費		
給料	7,585	8,015
役員報酬	476	478
給料・手当	5,753	6,020
賞与	1,355	1,517
退職給付費用	305	289
福利費	812	883
交際費	13	13
旅費交通費	175	171
租税公課	300	357
不動産賃借料	324	323
減価償却費	2,501	2,257
業務委託費	1,399	1,529
諸経費	1,394	1,467
一般管理費合計	14,813	15,309
営業利益	9,353	11,513

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）	当事業年度 （自　2025年4月1日 至　2026年3月31日）
営業外収益		
受取利息	64	88
収益分配金	1	28
金銭の信託運用益	―	4,713
投資有価証券売却益	150	54
投資有価証券償還益	0	93
その他	27	98
営業外収益合計	243	5,075
営業外費用		
金銭の信託運用損	207	―
投資有価証券売却損	17	29

投資有価証券償還損	257	1
為替差損	660	873
デリバティブ費用	47	3,472
その他	107	3
営業外費用合計	1,296	4,380
経常利益	8,300	12,208
特別損失		
システム移行関連費用	147	1,417
特別損失合計	147	1,417
税引前当期純利益	8,153	10,791
法人税、住民税及び事業税	2,519	3,728
法人税等還付税額	△129	―
過年度法人税等	―	△150
法人税等調整額	△25	△555
法人税等合計	2,364	3,021
当期純利益	5,788	7,769

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2024年4月1日　至　2025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	45,974	48,574	67,813
当期変動額					
剰余金の配当			△2,943	△2,943	△2,943
当期純利益			5,788	5,788	5,788
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	―	―	2,845	2,845	2,845
当期末残高	500	2,100	48,819	51,419	70,658

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	360	△1,071	△710	67,103
当期変動額				
剰余金の配当				△2,943
当期純利益				5,788
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	94	14	108	108
当期変動額合計	94	14	108	2,954
当期末残高	454	△1,056	△601	70,057

当事業年度（自　2025年4月1日　至　2026年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本	
		資本剰余金

	資本金	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	48,819	51,419	70,658
当期変動額					
剰余金の配当			△999	△999	△999
当期純利益			7,769	7,769	7,769
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	―	―	6,769	6,769	6,769
当期末残高	500	2,100	55,588	58,188	77,428

	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	454	△1,056	△601	70,057
当期変動額				
剰余金の配当				△999
当期純利益				7,769
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	39	△98	△59	△59
当期変動額合計	39	△98	△59	6,710
当期末残高	494	△1,155	△660	76,767

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) 子会社株式及び関連会社株式

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直近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

7．収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

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

計算され、契約期間にわたり認識されます。

（2）投資一任業務

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

（3）投資助言業務

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

（4）成功報酬

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

８．ヘッジ会計の会計処理

（1）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

（2）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は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。

（未適用の会計基準等）

リースに関する会計基準等

・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年９月13日）

・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年９月13日）

ほか、関連する企業会計基準、企業会計基準適用指針、実務対応報告及び移管指針の改正

（1）概要

国際的な会計基準と同様に、借手のすべてのリースについて資産・負債を計上する等の取扱いを定めるもの。

（2）適用予定日

2028年３月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

（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 （2025年3月31日）		当事業年度 （2026年3月31日）	
建　　物	253	百万円	286	百万円
器具備品	942	〃	1,027	〃
その他	1	〃	4	〃
計	1,197	〃	1,318	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2024年4月1日　至 2025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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

（2）基準日が当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
2025年6月20日 定時株主総会	普通株式	999	利益剰余金	333,333	2025年3月31日	2025年6月23日

当事業年度（自 2025年4月1日　至 2026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
2025年6月20日 定時株主総会	普通株式	999	333,333	2025年3月31日	2025年6月23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
2026年6月19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
2026年6月19日 定時株主総会	普通株式	4,827	利益剰余金	1,609,052	2026年3月31日	2026年6月22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、市場価格のない株式等、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31 号 2021年6月17日。以下、「時価算定適用指針」という。）第24-3項を適用した投資信託及び第24-16項を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2及び（注2）、（注4）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（2025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	2,551	15,662	－	18,214
投資有価証券(*2)				
その他有価証券	－	3,785	－	3,785
資産計	2,551	19,448	－	21,999
デリバティブ取引(*3)				
株式関連取引	(128)	235	－	106
通貨関連取引	－	78	－	78
デリバティブ取引計	(128)	314	－	185

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額887百万円）、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（貸借対照表計上額1,976百万円）及び第24-16項を適用した組合出資金等（貸借対照表計上額592百万円）は上記に含めておりません。
(*3) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2026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	3,166	19,460	－	22,627
投資有価証券(*2)				
その他有価証券	－	2,764	－	2,764
資産計	3,166	22,224	－	25,391
デリバティブ取引(*3)				
株式関連取引	548	596	－	1,144
通貨関連取引	－	(60)	－	(60)
デリバティブ取引計	548	535	－	1,083

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額961百万円）、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（貸借対照表計上額1,974百万円）及び第24-16項を適用した組合出資金等（貸借対照表計上額687百万円）は上記に含めておりません。
(*3) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

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

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場

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

（注2）市場価格のない株式等の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 （2025年3月31日）	当事業年度 （2026年3月31日）
投資有価証券	887	961
関係会社株式	6,077	6,416

（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（2025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	18,950	―	―	―
未収委託者報酬	12,164	―	―	―
未収運用受託報酬	6,523	―	―	―
投資有価証券 投資信託	―	2,053	2,400	―

当事業年度（2026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	19,266	―	―	―
未収委託者報酬	14,109	―	―	―
未収運用受託報酬	8,501	―	―	―
投資有価証券 投資信託	0	1,787	1,997	―

（注4） 時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報

前事業年度（2025年3月31日）

第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

（単位：百万円）

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券 (その他有価証券)	-	-	△23	2,000	1,976	-	1,976	-

（注）決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,976百万円であります。

当事業年度（2026年3月31日）

第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

（単位：百万円）

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券 (その他有価証券)	1,976	-	△2	-	1,974	-	1,974	-

（注）決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,974百万円であります。

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

市場価格のある子会社株式及び関連会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式及び関連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 （2025年3月31日）	当事業年度 （2026年3月31日）
子会社株式	6,077	6,077
関連会社株式	-	338
合計	6,077	6,416

２．その他有価証券

前事業年度（2025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	3,110	2,402	708
小計	3,110	2,402	708
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,651	2,712	△61
小計	2,651	2,712	△61
合計	5,762	5,115	647

当事業年度（2026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	2,169	1,505	663
小計	2,169	1,505	663
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,569	2,602	△33
小計	2,569	2,602	△33
合計	4,738	4,108	630

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（2025年3月31日）	当事業年度（2026年3月31日）
非上場株式	887	961
組合出資金等	592	687

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自　2024年4月1日　至　2025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	528	150	17

当事業年度（自　2025年4月1日　至　2026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	1,231	54	29

（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（2025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	5,575	－	37	37
	英ポンド	141	－	0	0
	カナダドル	118	－	0	0
	スイスフラン	52	－	0	0
	香港ドル	166	－	1	1
	ユーロ	425	－	1	1
	買建				
	米ドル	139	－	△0	△0
	英ポンド	5	－	△0	△0
	カナダドル	6	－	△0	△0
	スイスフラン	5	－	△0	△0
	香港ドル	1	－	△0	△0
	ユーロ	16	－	0	0
合計		6,654	－	41	41

（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（2026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	7,470	－	△64	△64
	英ポンド	296	－	2	2
	カナダドル	139	－	0	0
	スイスフラン	38	－	0	0
	オーストラリアドル	119	－	0	0
	香港ドル	189	－	△1	△1
	ユーロ	1,193	－	2	2
	人民元	469	－	△2	△2
	買建				
	米ドル	50	－	0	0
	カナダドル	2	－	△0	△0
	オーストラリアドル	11	－	△0	△0
	香港ドル	0	－	0	0
	ユーロ	7	－	△0	△0
合計		9,987	－	△61	△61

（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（2025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	9,848	－	△128	△128
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	6,179	－	235	235
合計		16,027	－	106	106

（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（2026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	14,034	―	548	548
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	6,825	―	596	596
合計		20,860	―	1,144	1,144

（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（2025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	投資有価証券関係会社株式			
	売建				
	米ドル		1,947	―	13
	英ポンド		4,700	―	19
	スイスフラン		47	―	0
	香港ドル		122	―	0
	ユーロ		40	―	0
	シンガポールドル		449	―	3
	買建				
	米ドル		16	―	△0
	香港ドル		94	―	△0
合計			7,419	―	36

当事業年度（2026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	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		730	―	△6
	英ポンド		882	―	6
	スイスフラン		42	―	0
	オーストラリアドル		18		0
	香港ドル		3	―	△0
	ユーロ		55	―	0
合計			1,732	―	0

（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　2024年4月1日　至　2025年3月31日）	当事業年度（自　2025年4月1日　至　2026年3月31日）
退職給付債務の期首残高	993	970
勤務費用	165	138

利息費用	3	19
数理計算上の差異の発生額	△150	△40
退職給付の支払額	△42	△68
簡便法で計算した退職給付費用	0	―
退職給付債務の期末残高	970	1,019

（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 （2025年3月31日）	当事業年度 （2026年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	970	1,019
未認識数理計算上の差異	134	161
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,104	1,180
退職給付引当金	1,104	1,180
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,104	1,180

（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　2024年4月1日 至　2025年3月31日）	当事業年度 （自　2025年4月1日 至　2026年3月31日）
勤務費用	165	138
利息費用	3	19
数理差異償却	1	△13
簡便法で計算した退職給付費用	0	―
確定給付制度に係る退職給付費用	171	143

（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　2024年4月1日 至　2025年3月31日）	当事業年度 （自　2025年4月1日 至　2026年3月31日）
割引率	2.0%	2.0%

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134百万円、当事業年度145百万円であります。

（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 （2025年3月31日）		当事業年度 （2026年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	104	百万円	155	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	235	〃	267	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	348	〃	372	〃
税務上の収益認識差額	84	〃	482	〃
税務上の費用認識差額	94	〃	183	〃
繰延ヘッジ損益	486	〃	531	〃
その他	84	〃	74	〃
繰延税金資産　合計	1,437	〃	2,066	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△209	〃	△227	〃
その他	△43	〃	△71	〃
繰延税金負債　合計	△252	〃	△299	〃
繰延税金資産の純額	1,184	〃	1,767	〃

（表示方法の変更）
前事業年度において、「繰延税金資産」の「その他」に含めていた「税務上の収益認識差額」は金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の「繰延税金資産」の「その他」に表示していた169百万円は、「税務上の収益認識差額」84百万円、「その他」84百万円として組み替えております。

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主な項目別の内訳

	前事業年度 （2025年3月31日）	当事業年度 （2026年3月31日）
法定実効税率	30.62%	30.62%
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.14%	0.23%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.06%	△0.02%
法人税額の特別控除額	―	△1.24%
法人税等還付税額	△1.59%	―
過年度法人税等	―	△1.40%
その他	△0.10%	△0.19%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.01%	28.00%

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針７．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

［関連情報］
1．製品及びサービスごとの情報
単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報
（1）営業収益
内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

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

3．主要な顧客ごとの情報
前事業年度（自 2024年4月1日　至 2025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	11,023百万円

当事業年度（自 2025年4月1日　至 2026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	11,381百万円

［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。

（持分法損益等）

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）	当事業年度 （自　2025年4月1日 至　2026年3月31日）
関連会社に対する投資の金額	―	338
持分法を適用した場合の投資の金額	―	2,294
持分法を適用した場合の投資利益の金額	―	1,956

（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 2024年4月1日　至 2025年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引	運用受託報酬	10,721	未収運用受託報酬	5,856
							投信販売代行手数料等	11,500	未払手数料	2,813

（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 2025年4月1日　至 2026年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引	運用受託報酬	11,085	未収運用受託報酬	6,573
							投信販売代行手数料等	12,957	未払手数料	3,385

（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（2025年3月31日）
三井住友トラストグループ株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2026年3月31日）
三井住友トラストグループ株式会社（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　2024年4月1日 至　2025年3月31日）	当事業年度 （自　2025年4月1日 至　2026年3月31日）
1株当たり純資産額	23,352,414円83銭	25,589,114円14銭
1株当たり当期純利益金額	1,929,475円95銭	2,589,795円05銭

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

	前事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）	当事業年度 （自　2025年4月1日 至　2026年3月31日）
当期純利益	5,788百万円	7,769百万円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	5,788百万円	7,769百万円
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

2026年10月 9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（2026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） （2026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（2026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【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

⑥ファンド名を「コア投資戦略ファンド」と表示する場合があります。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやＳＮＳのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2026年６月１日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　三　上　和　彦

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　成 田 慎 一 郎

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2025年４月１日から2026年３月31日までの第40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2026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

2026年9月17日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　中島紀子

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2025年7月11日から2026年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2026年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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