

【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】	2021年6月7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 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【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】	S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）
【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】

SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）
愛称として「スゴ6」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】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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

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

(7) 【申込期間】

2021年 6月 8日から2021年12月 6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、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券（以下「J-REIT」「海外REIT」ということがあります。）に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

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。

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。

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

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。

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。

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。

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。

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 から 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 から 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。

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。

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

(5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

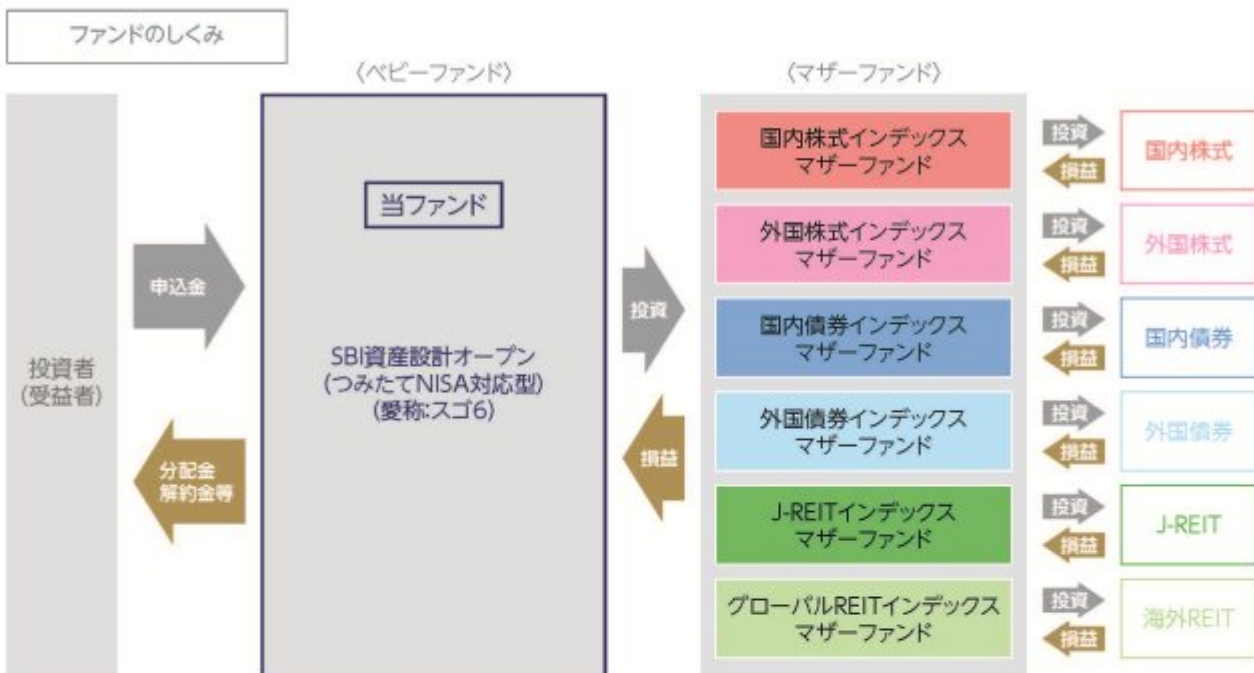
[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

1. 国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券の6資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。

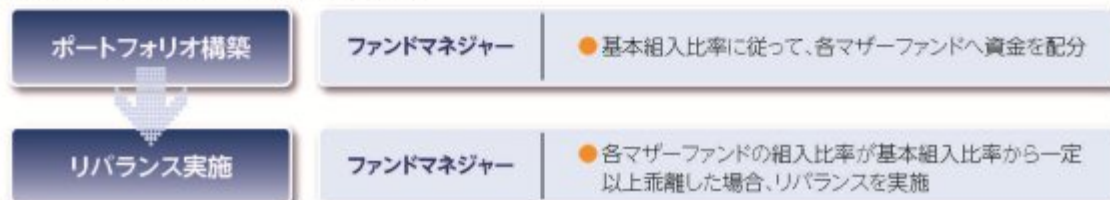


? ファミリーファンド方式とは

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

ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX(東証株価指数)
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
国内債券	NOMURA-BPI 総合
外国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
J-REIT	東証REIT指数(配当込み)
海外REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

* 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

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

「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数

で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）」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。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。

「NOMURA-BPI 総合」とは、野村證券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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。

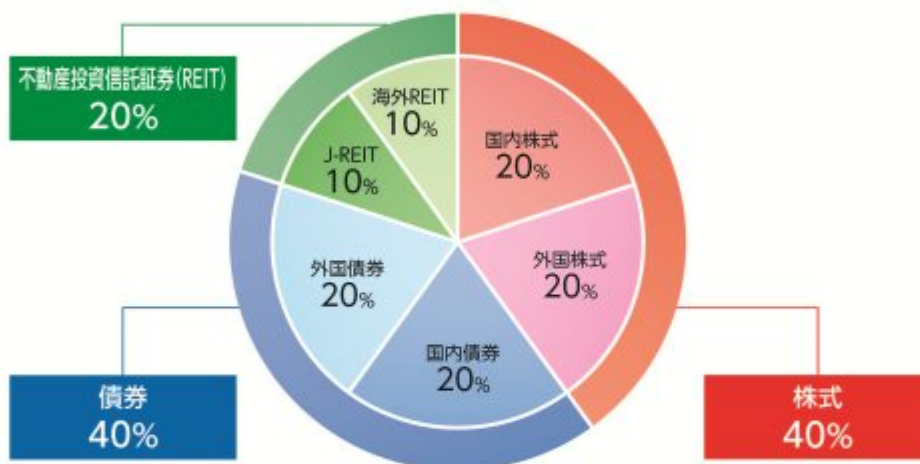
「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

「東証REIT指数」とは、東証が算出、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ものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」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。「円換算ベース」は、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。「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^(R) およびS&P^(R) 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^(R) 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またはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

3. 株式40%、債券40%、不動産投資信託証券(REIT) 20%を基本組入比率として運用します。

基本組入比率



- 組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

4. ノーロードファンドです。

- 購入時手数料が無料のノーロードファンドです。
(運用管理費用(信託報酬)は純資産総額に対して年率0.55%(税抜0.5%)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

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。

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】

2017年12月19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】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年 3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・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバルREITインデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券への投資を通じて、国内外の公社債、株式及び不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式及び不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

ロ．各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。また、各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド受益証券	インデックス	基本組入比率
国内債券インデックス マザーファンド 受益証券	NOMURA-BPI総合	20%
国内株式インデックス マザーファンド 受益証券	TOPIX（東証株価指数）	20%
外国債券インデックス マザーファンド 受益証券	FTSE世界国債インデックス （除く日本、円ベース）	20%
外国株式インデックス マザーファンド 受益証券	MSCIコクサイ・インデックス （円ベース）	20%
J-REITインデックス マザーファンド 受益証券	東証REIT指数（配当込み）	10%
グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券	S&P先進国REIT指数（除く日 本、配当込み、円換算ベ ース）	10%

ハ．各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

ニ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

ホ．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の70%以下とします。

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

るものをいいます。以下同じ。）

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
3. 金銭債権
4. 約束手形

ロ.次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

(参考) マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

NOMURA-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。

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。

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。

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。

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

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）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。

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。

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。

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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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。

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。

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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。

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。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

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

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。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）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（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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。

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。

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

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。

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。

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

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

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の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。

2. 運用方法

(1)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を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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。

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。

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「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。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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。

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券、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。

外貨建資産への投資は行いません。

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号口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。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界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. 運用方法

(1) 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を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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。

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。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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、円換算ベース）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、円換算ベース）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。

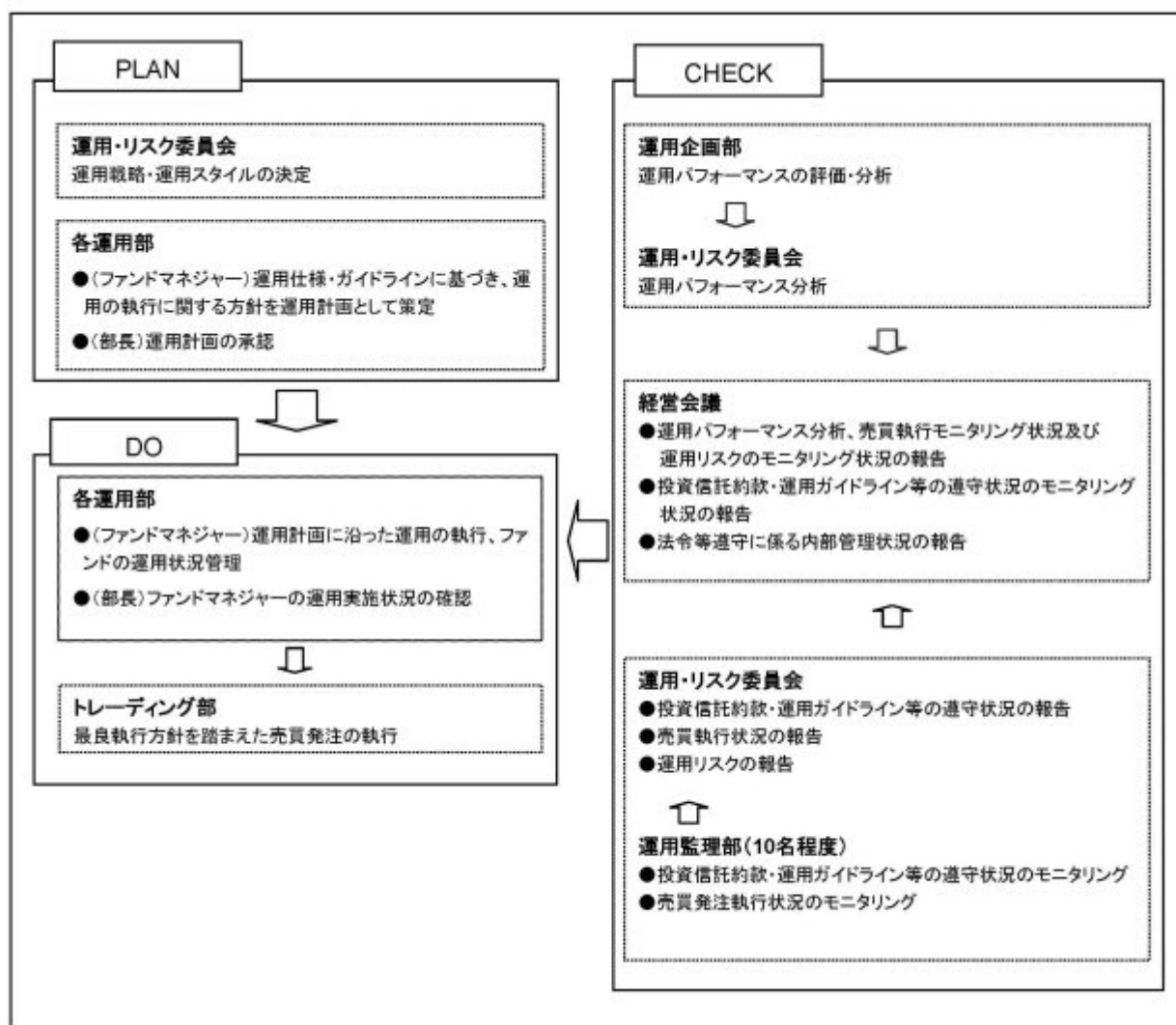
投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとし、

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

（３）【運用体制】

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



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行う

に当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

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

（４）【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。

ニ．投資する株式等の範囲

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

（ロ）上記（イ）の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ホ．信用取引の指図範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券

4. 売出しにより取得する株券

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

6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

へ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

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

（ロ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。

（ハ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。

（ロ）スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

（ハ）スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとしします。

（ニ）委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

チ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。

（ロ）金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期

間を超えないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。

(八) 金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとしします。

(二) 委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとしします。

b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとしします。

(ロ) 上記(イ)a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとしします。

(八) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとしします。

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとしします。

(ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内としします。

(八) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとしします。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

(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します。

(八) 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します。

(二) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨

建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ)上記(イ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

カ．資金の借入れ

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

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

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

(ニ)借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様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、全て投資者の皆様へ帰属します。

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。

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。

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。

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。

金利変動リスク

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

信用リスク

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

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。

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。

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>

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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。

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。

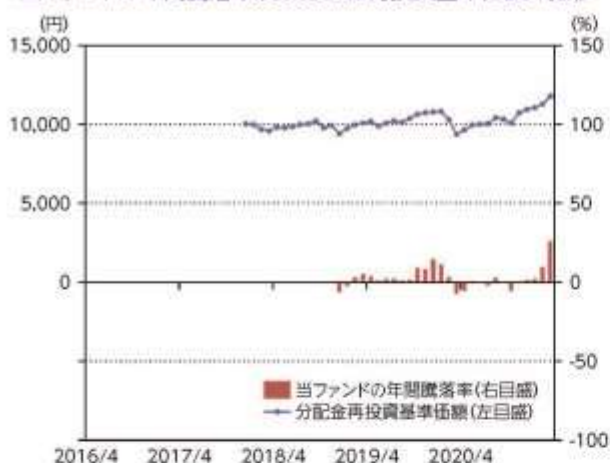
（2）リスクの管理体制

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



*当ファンドについては2018年12月～2021年3月の2年4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2016年4月～2021年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「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。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIロクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロ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、野村證券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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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 Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) (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】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.55%（税抜 0.5%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.22% (税抜 0.2%)	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 0.275% (税抜 0.25%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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。

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

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。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

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

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

（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。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニア NISA（ジュニアニーサ）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたて NISA（つみたてニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。つみたて
 NISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象
 です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所
 得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。

販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、同
 一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取
 扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

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「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。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2021年3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。

5【運用状況】

以下は、2021年3月31日現在の状況について記載してあります。

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	186,435,792	97.52
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,743,184	2.48
合計（純資産総額）		191,178,976	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】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	11,784,152	2.9101	34,293,418	3.5378	41,689,972	21.81
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	21,895,471	1.5461	33,853,383	1.8831	41,231,361	21.57
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	11,513,764	2.9970	34,507,114	3.0338	34,930,457	18.27
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	20,525,704	1.4061	28,861,322	1.4049	28,836,561	15.08
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	9,469,821	1.7575	16,643,309	2.1001	19,887,571	10.40
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	9,830,159	1.6664	16,381,612	2.0203	19,859,870	10.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.52
合計	97.52

(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。

【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。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2018年 9月 5日)	41,839,685	41,839,685	9,973	9,973
第2期計算期間末	(2019年 9月 5日)	87,957,030	87,957,030	10,188	10,188

第3期計算期間末	(2020年 9月 7日)	147,615,298	147,615,298	10,379	10,379
	2020年 3月末日	109,750,101		9,377	
	4月末日	118,717,673		9,648	
	5月末日	129,117,058		9,960	
	6月末日	135,595,044		10,009	
	7月末日	137,794,939		10,036	
	8月末日	146,589,549		10,425	
	9月末日	149,408,500		10,323	
	10月末日	150,229,298		10,083	
	11月末日	162,441,774		10,729	
	12月末日	167,864,405		10,948	
	2021年 1月末日	173,924,273		11,058	
	2月末日	180,494,354		11,289	
	3月末日	191,178,976		11,783	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	0
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	0
第3期計算期間	2019年 9月 6日～2020年 9月 7日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	0.3
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	2.2
第3期計算期間	2019年 9月 6日～2020年 9月 7日	1.9
第4期中間計算期間	2020年 9月 8日～2021年 3月 7日	9.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	44,509,649	2,557,562	41,952,087
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	54,949,184	10,565,823	86,335,448
第3期計算期間	2019年 9月 6日～2020年 9月 7日	68,964,944	13,069,234	142,231,158
第4期中間計算期間	2020年 9月 8日～2021年 3月 7日	29,452,494	9,589,811	162,093,841

(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)

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	518,597,744,100	83.63
地方債証券	日本	33,203,133,761	5.35
特殊債券	日本	40,892,469,726	6.59
社債券	日本	24,843,501,620	4.01
	フランス	1,299,973,000	0.21
	オーストラリア	399,696,000	0.06
	小計	26,543,170,620	4.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		884,586,310	0.14
合計(純資産総額)		620,121,104,517	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	8,520,000,000	100.99	8,605,145,300	100.94	8,600,343,600	0.100	2025/9/20	1.39
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	7,780,000,000	101.21	7,874,265,100	100.94	7,853,287,600	0.100	2028/3/20	1.27
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,790,000,000	100.98	7,866,880,700	100.80	7,852,475,800	0.100	2024/9/20	1.27
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	7,300,000,000	100.99	7,372,854,000	100.75	7,355,407,000	0.100	2024/6/20	1.19
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	7,050,000,000	100.91	7,114,155,000	100.66	7,097,164,500	0.100	2023/12/20	1.14
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,760,000,000	100.86	6,818,136,000	100.59	6,800,222,000	0.100	2023/9/20	1.10
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	6,720,000,000	100.98	6,786,395,200	100.91	6,781,219,200	0.100	2025/6/20	1.09
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	101.42	6,734,288,000	100.96	6,703,810,400	0.100	2026/9/20	1.08
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	6,550,000,000	100.74	6,598,958,600	100.18	6,562,314,000	0.100	2030/9/20	1.06
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	102.83	6,498,856,000	102.29	6,464,791,200	0.400	2025/9/20	1.04

日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	6,350,000,000	101.36	6,436,406,300	100.95	6,410,833,000	0.100	2027/3/20	1.03
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	5,850,000,000	100.67	5,889,195,000	100.39	5,873,166,000	0.100	2022/12/20	0.95
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	5,770,000,000	100.90	5,821,961,000	100.70	5,810,390,000	0.100	2024/3/20	0.94
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	5,540,000,000	101.07	5,599,278,000	100.84	5,586,591,400	0.100	2024/12/20	0.90
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	5,380,000,000	101.31	5,450,478,000	100.94	5,430,948,600	0.100	2026/3/20	0.88
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	5,090,000,000	102.76	5,230,672,400	102.37	5,210,938,400	0.600	2024/6/20	0.84
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	4,850,000,000	102.72	4,981,920,000	102.18	4,955,875,500	0.400	2025/6/20	0.80
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	4,880,000,000	101.50	4,953,361,200	100.94	4,925,920,800	0.100	2027/9/20	0.79
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	4,800,000,000	102.54	4,922,030,800	102.02	4,896,960,000	0.600	2023/12/20	0.79
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	4,820,000,000	101.26	4,881,165,000	100.96	4,866,705,800	0.100	2026/6/20	0.78
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	4,830,000,000	100.88	4,872,795,000	100.54	4,856,516,700	0.100	2029/9/20	0.78
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,790,000,000	101.23	4,849,085,500	100.67	4,822,380,400	0.100	2029/3/20	0.78
日本	国債証券	第416回利付国債（2年）	4,770,000,000	100.45	4,791,896,700	100.32	4,785,597,900	0.100	2022/9/1	0.77
日本	国債証券	第132回利付国債（5年）	4,770,000,000	100.54	4,795,996,500	100.27	4,783,069,800	0.100	2022/6/20	0.77
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,740,000,000	99.97	4,738,702,200	100.09	4,744,550,400	0.100	2030/12/20	0.77
日本	国債証券	第150回利付国債（20年）	4,040,000,000	116.73	4,716,165,000	115.21	4,654,564,800	1.400	2034/9/20	0.75
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	4,610,000,000	101.47	4,677,767,000	100.86	4,649,968,700	0.100	2028/6/20	0.75
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	4,570,000,000	101.22	4,625,754,000	100.61	4,598,105,500	0.100	2029/6/20	0.74
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	4,470,000,000	101.37	4,531,462,500	100.77	4,504,508,400	0.100	2028/12/20	0.73
日本	国債証券	第133回利付国債（5年）	4,380,000,000	100.61	4,406,805,600	100.33	4,394,497,800	0.100	2022/9/20	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.63
地方債証券	5.35
特殊債券	6.59
社債券	4.28
合計	99.86

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

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	463,280,295,000	98.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,587,444,147	1.61
合計(純資産総額)		470,867,739,147	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	7,347,040,000	1.56

(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	1,751,600	7,020.22	12,296,617,352	8,616.00	15,091,785,600	3.21
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,346,200	5,863.88	7,893,955,256	9,330.00	12,560,046,000	2.67
日本	株式	ソニー	電気機器	1,083,100	8,002.33	8,667,323,623	11,595.00	12,558,544,500	2.67
日本	株式	キーエンス	電気機器	169,700	47,672.26	8,089,982,522	50,270.00	8,530,819,000	1.81
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,665,200	458.53	5,348,844,156	591.70	6,902,298,840	1.47
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,183,600	3,990.37	4,723,001,932	5,401.00	6,392,623,600	1.36
日本	株式	任天堂	その他製品	99,000	48,463.65	4,797,901,350	61,810.00	6,119,190,000	1.30

日本	株式	信越化学工業	化学	313,100	14,130.06	4,424,121,786	18,610.00	5,826,791,000	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,438,500	4,053.68	5,831,218,680	3,985.00	5,732,422,500	1.22
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,984,500	2,502.47	4,966,151,715	2,842.00	5,639,949,000	1.20
日本	株式	日本電産	電気機器	416,200	8,341.63	3,471,786,406	13,435.00	5,591,647,000	1.19
日本	株式	ダイキン工業	機械	220,300	17,672.47	3,893,245,141	22,320.00	4,917,096,000	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	1,484,300	3,314.58	4,919,831,094	3,225.00	4,786,867,500	1.02
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	101,300	25,726.26	2,606,070,138	46,790.00	4,739,827,000	1.01
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,180,100	3,207.38	3,785,029,138	4,007.00	4,728,660,700	1.00
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,360,600	3,165.17	4,306,530,302	3,395.00	4,619,237,000	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,361,300	2,824.53	3,845,032,689	3,319.00	4,518,154,700	0.96
日本	株式	村田製作所	電気機器	508,000	6,774.19	3,441,288,520	8,842.00	4,491,736,000	0.95
日本	株式	HOYA	精密機器	340,200	10,771.46	3,664,450,692	13,005.00	4,424,301,000	0.94
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,191,100	2,497.65	2,974,950,915	3,587.00	4,272,475,700	0.91
日本	株式	日立製作所	電気機器	831,300	3,766.96	3,131,473,848	5,004.00	4,159,825,200	0.88
日本	株式	ファナック	電気機器	151,800	21,009.31	3,189,213,258	26,185.00	3,974,883,000	0.84
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,317,200	1,385.19	3,209,762,268	1,599.00	3,705,202,800	0.79
日本	株式	S M C	機械	50,600	56,714.42	2,869,749,652	64,310.00	3,254,086,000	0.69
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,036,800	2,575.04	2,669,801,472	3,130.00	3,245,184,000	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	1,382,600	1,727.39	2,388,289,414	2,302.00	3,182,745,200	0.68
日本	株式	花王	化学	414,000	8,386.04	3,471,820,560	7,313.00	3,027,582,000	0.64
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	565,200	4,854.15	2,743,565,580	5,265.00	2,975,778,000	0.63
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	666,200	3,770.10	2,511,640,620	4,463.00	2,973,250,600	0.63
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	175,700	15,951.29	2,802,641,653	16,625.00	2,921,012,500	0.62

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.17
		建設業	2.37
		食料品	3.28
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.26
		医薬品	5.42
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.60
		ガラス・土石製品	0.82
		鉄鋼	0.76

非鉄金属	0.75
金属製品	0.63
機械	5.58
電気機器	17.19
輸送用機器	7.24
精密機器	2.50
その他製品	2.34
電気・ガス業	1.34
陸運業	3.36
海運業	0.23
空運業	0.45
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	9.07
卸売業	4.71
小売業	4.63
銀行業	5.08
証券、商品先物取引業	0.78
保険業	1.82
その他金融業	1.10
不動産業	1.99
サービス業	5.49
小計	98.39
合計	98.39

(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	TOPIX先物	買建	376円		7,353,178,950	7,347,040,000	1.56

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	125,674,591,942	42.80
	フランス	30,117,501,813	10.26
	イタリア	27,767,139,279	9.46
	ドイツ	21,814,683,400	7.43
	イギリス	19,233,615,927	6.55
	スペイン	17,236,414,422	5.87
	ベルギー	7,194,948,174	2.45
	オーストラリア	6,648,346,305	2.26
	カナダ	5,773,375,377	1.97
	オランダ	5,446,816,545	1.85
	オーストリア	4,368,013,699	1.49
	アイルランド	2,462,967,655	0.84
	メキシコ	2,260,393,520	0.77
	フィンランド	1,849,296,503	0.63
	ポーランド	1,825,319,867	0.62
	デンマーク	1,444,885,839	0.49
	マレーシア	1,387,016,479	0.47
	イスラエル	1,276,759,775	0.43
	シンガポール	1,248,405,851	0.43
	スウェーデン	961,667,589	0.33
ノルウェー	725,466,895	0.25	
	小計	286,717,626,856	97.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,927,550,987	2.36
合計(純資産総額)		293,645,177,843	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,862,277,127	0.63
	買建	ドイツ	2,454,279,168	0.84

(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		4,417,065,800	1.50
--------	----	--	---------------	------

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	15,950,000	10,931.87	1,743,634,521	10,051.25	1,603,175,517	0.625	2030/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	11,020.64	1,553,910,260	10,094.50	1,423,324,959	0.625	2030/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	12,478.22	1,341,409,504	11,849.86	1,273,860,178	2.375	2027/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,946.15	1,293,320,447	11,994.73	1,198,274,182	2.625	2029/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	12,021.11	1,220,143,339	11,762.07	1,193,850,372	2.250	2024/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,133.55	1,240,049,473	11,634.06	1,189,001,360	2.000	2026/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	13,859.58	1,176,679,165	13,488.68	1,145,189,458	3.000	2022/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,801.46	1,204,362,812	10,257.10	1,143,667,605	0.875	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,554.49	1,155,449,139	11,400.10	1,140,010,275	2.000	2022/10/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	11,393.18	1,139,318,337	11,284.63	1,128,463,576	1.500	2022/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	11,092.92	1,125,931,439	11,091.75	1,125,813,450	0.250	2023/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	11,016.86	1,101,686,281	11,019.10	1,101,910,469	0.125	2024/1/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	13,093.18	1,167,912,311	12,197.12	1,087,983,843	2.875	2028/8/15	0.37
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000	23,507.02	1,109,531,684	22,972.78	1,084,315,347	4.500	2041/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	11,064.13	1,106,413,598	10,842.22	1,084,222,819	0.250	2025/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	11,418.69	1,090,485,715	11,285.93	1,077,806,607	1.750	2022/5/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	11,389.93	1,087,739,260	11,256.30	1,074,977,557	1.750	2022/3/31	0.37
フランス	国債証券	FRTR 0% 03/25/25	8,090,000	13,300.74	1,076,029,974	13,275.29	1,073,971,365	0.000	2025/3/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	11,367.20	1,079,884,606	11,295.44	1,073,067,489	1.500	2022/9/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,688.82	1,068,882,908	10,556.37	1,055,637,154	0.625	2027/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,348.48	1,105,189,824	11,775.91	1,053,944,068	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,364.77	1,122,640,916	12,400.38	1,041,632,338	3.125	2028/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	16,309.93	1,040,573,735	16,108.18	1,027,701,884	2.500	2030/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	11,615.80	1,045,422,352	11,404.85	1,026,437,386	1.375	2025/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	11,476.21	1,032,859,428	11,334.58	1,020,112,641	1.875	2022/7/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	12,418.54	1,061,785,877	11,751.69	1,004,769,799	2.250	2027/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,873.64	1,042,506,250	11,402.26	1,001,118,878	1.625	2026/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	11,018.19	1,046,728,177	10,474.63	995,090,452	0.375	2027/7/31	0.34
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	15,953.26	1,013,032,246	15,644.01	993,394,966	3.500	2026/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.25% 12/31/24	8,400,000	12,041.87	1,011,517,481	11,772.88	988,922,266	2.250	2024/12/31	0.34

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	97.64
合計	97.64

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	54	アメリカドル	6,716,401.28	743,572,785	6,672,375	738,698,636	0.25
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	36	アメリカドル	4,785,147.74	529,763,706	4,722,750	522,855,652	0.18
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	35	アメリカドル	5,542,973	613,662,541	5,426,093.75	600,722,839	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	24	ユーロ	2,690,680.4	349,250,316	2,690,160	349,182,768	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	34	ユーロ	4,592,101.4	596,054,762	4,590,000	595,782,000	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	68	ユーロ	11,653,042.8	1,512,564,955	11,628,000	1,509,314,400	0.51

(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	17,960,000.00	1,956,868,496	1,987,992,400	0.68
	カナダドル	買建	2,420,000.00	209,360,827	212,403,400	0.07
	ユーロ	買建	14,580,000.00	1,887,497,389	1,892,484,000	0.64
	イギリスポンド	買建	2,130,000.00	321,891,030	324,186,000	0.11

(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	330,879,033,827	66.02
	イギリス	22,306,613,860	4.45
	カナダ	17,637,607,057	3.52
	フランス	16,439,111,003	3.28
	スイス	16,316,776,731	3.26
	ドイツ	15,221,751,555	3.04
	オーストラリア	10,115,399,821	2.02
	オランダ	9,573,540,453	1.91
	アイルランド	9,260,382,029	1.85
	スウェーデン	5,493,679,152	1.10
	香港	3,994,374,305	0.80
	デンマーク	3,845,083,870	0.77
	スペイン	3,839,140,405	0.77
	イタリア	3,070,650,503	0.61
	フィンランド	1,953,993,749	0.39
	バミューダ	1,693,456,959	0.34
	シンガポール	1,563,417,064	0.31
	ジャージー	1,460,235,884	0.29
	ベルギー	1,408,503,928	0.28
	ノルウェー	1,053,835,419	0.21
	イスラエル	979,690,257	0.20
	ケイマン	947,562,582	0.19
	ニュージーランド	549,786,934	0.11
	ルクセンブルク	494,052,519	0.10
	キュラソー	369,657,205	0.07
	オーストリア	303,616,273	0.06
	ポルトガル	270,186,415	0.05
	パナマ	208,063,724	0.04
	リベリア	159,907,094	0.03
	マン島	115,745,279	0.02
パプアニューギニア	64,687,420	0.01	
	小計	481,589,543,276	96.09
投資信託受益証券	オーストラリア	229,287,233	0.05
	香港	85,134,979	0.02
	小計	314,422,212	0.06
投資証券	アメリカ	9,026,541,262	1.80
	オーストラリア	673,532,411	0.13
	イギリス	287,974,800	0.06
	フランス	254,561,520	0.05
	シンガポール	253,478,823	0.05

	香港	176,266,992	0.04
	カナダ	68,579,431	0.01
	小計	10,740,935,239	2.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,518,693,242	1.70
合計(純資産総額)		501,163,593,969	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,987,583,177	1.19
	買建	カナダ	468,955,872	0.09
	買建	ドイツ	1,251,092,310	0.25
	買建	イギリス	379,152,410	0.08
	買建	オーストラリア	198,119,460	0.04

(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		38,055,000	0.01

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,525,057	8,925.44	13,611,805,055	13,274.12	20,243,803,350	4.04
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	643,980	20,169.14	12,988,527,801	25,668.11	16,529,751,732	3.30
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	38,239	268,397.57	10,263,254,843	338,251.15	12,934,385,950	2.58

アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	215,390	25,113.45	5,409,187,374	31,884.47	6,867,598,147	1.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	26,929	157,362.08	4,237,603,638	226,564.69	6,101,160,637	1.22
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	26,594	157,214.84	4,180,971,524	227,568.83	6,051,965,555	1.21
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	67,937	18,971.26	1,288,850,871	70,369.49	4,780,692,056	0.95
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	272,941	11,054.39	3,017,197,216	17,102.48	4,667,968,212	0.93
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	235,697	16,277.69	3,836,603,007	18,268.25	4,305,773,394	0.86
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	151,432	21,545.27	3,262,643,796	23,459.44	3,552,511,281	0.71
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	84,864	33,662.48	2,856,732,923	41,356.82	3,509,705,817	0.70
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	122,653	20,638.55	2,531,381,079	28,584.21	3,505,939,710	0.70
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	161,985	12,982.96	2,103,045,051	20,540.02	3,327,176,160	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	221,818	12,926.49	2,867,330,288	14,995.66	3,326,309,417	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	96,287	27,275.62	2,626,287,883	33,746.62	3,249,361,012	0.65
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	257,722	12,107.92	3,120,477,487	12,442.65	3,206,745,416	0.64
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	55,706	38,271.33	2,131,943,260	57,001.25	3,175,312,061	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	79,568	33,608.23	2,674,140,019	39,656.32	3,155,374,229	0.63
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	696,115	2,754.46	1,917,424,264	4,316.58	3,004,838,105	0.60
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	99,576	16,604.28	1,653,388,362	26,187.34	2,607,630,906	0.52
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	366,338	6,786.52	2,486,161,262	7,059.97	2,586,337,744	0.52
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	38,356	38,363.68	1,471,477,616	67,015.73	2,570,455,723	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	410,677	4,406.25	1,809,548,817	6,086.83	2,499,723,466	0.50
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	372,585	6,187.58	2,305,400,203	6,486.49	2,416,772,193	0.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	380,565	4,956.48	1,886,265,361	6,276.14	2,388,482,987	0.48
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	63,299	40,049.27	2,535,079,090	35,687.18	2,258,962,965	0.45
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	39,733	46,049.82	1,829,697,677	56,837.40	2,258,320,688	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	43,204	42,419.64	1,832,698,282	51,531.07	2,226,348,633	0.44
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	641,081	3,430.90	2,199,486,662	3,402.11	2,181,033,402	0.44

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	379,822	5,029.55	1,910,335,753	5,731.45	2,176,933,347	0.43
------	----	---------------	--------------------	---------	----------	---------------	----------	---------------	------

(注1)国ノ地域は、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	3.33
		素材	4.43
		資本財	6.69
		商業・専門サービス	1.17
		運輸	2.04
		自動車・自動車部品	2.02
		耐久消費財・アパレル	1.91
		消費者サービス	1.68
		メディア・娯楽	7.00
		小売	5.66
		食品・生活必需品小売り	1.33
		食品・飲料・タバコ	3.97
		家庭用品・パーソナル用品	1.84
		ヘルスケア機器・サービス	5.11
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.29
		銀行	6.21
		各種金融	4.51
		保険	3.24
		不動産	0.49
		ソフトウェア・サービス	11.28
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.59		
電気通信サービス	1.82		
公益事業	3.05		
半導体・半導体製造装置	4.43		
	小計	96.09	
投資信託受益証券			0.06
投資証券			2.14
合計			98.30

(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	274	アメリカドル	54,201,015.5	6,000,594,425	54,083,490	5,987,583,177	1.19
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	24	カナダドル	5,367,184	471,131,412	5,342,400	468,955,872	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	28	スイスフラン	3,014,706	354,077,220	3,078,040	361,515,798	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	177	ユーロ	6,713,396.5	871,398,866	6,853,440	889,576,512	0.18
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	14	オーストラリアドル	2,380,098	200,785,067	2,348,500	198,119,460	0.04
	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	37	イギリスポンド	2,490,758.75	379,168,204	2,490,655	379,152,410	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。

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	イギリスポンド	売建	250,000.00	38,052,300	38,055,000	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。

J - R E I T 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	108,055,539,470	96.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,686,891,996	3.30
合計(純資産総額)		111,742,431,466	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,680,262,000	3.29

(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	11,225	576,352.84	6,469,560,629	651,000	7,307,475,000	6.54
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,973	552,966.89	5,514,738,793	653,000	6,512,369,000	5.83
日本	投資証券	GLP投資法人	31,165	154,402.02	4,811,938,953	181,800	5,665,797,000	5.07
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	49,677	84,995.46	4,222,319,466	113,100	5,618,468,700	5.03
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	15,767	330,596.27	5,212,511,389	355,500	5,605,168,500	5.02
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	32,252	136,970.77	4,417,581,274	166,400	5,366,732,800	4.80
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,230	245,341.18	3,491,204,991	297,100	4,227,733,000	3.78
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	19,872	160,121.5	3,181,934,448	192,400	3,823,372,800	3.42
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	9,473	304,725.57	2,886,665,324	347,000	3,287,131,000	2.94
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	21,329	126,853.09	2,705,649,556	148,600	3,169,489,400	2.84
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	29,334	75,207.13	2,206,125,951	92,000	2,698,728,000	2.42
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,098	176,744.67	2,491,746,357	189,900	2,677,210,200	2.40
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,209	314,517.9	1,952,841,641	413,000	2,564,317,000	2.29
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,085	634,791.3	1,958,331,160	787,000	2,427,895,000	2.17
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	4,997	403,893.65	2,018,256,569	485,500	2,426,043,500	2.17
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,437	585,316.75	2,011,733,669	649,000	2,230,613,000	2.00
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,516	290,961.1	1,895,902,527	312,000	2,032,992,000	1.82
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	32,130	57,657.5	1,852,535,475	62,300	2,001,699,000	1.79
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	3,481	494,130.06	1,720,066,738	547,000	1,904,107,000	1.70
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	11,114	161,478.02	1,794,666,714	167,800	1,864,929,200	1.67
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,715	132,405.39	1,551,129,143	153,300	1,795,909,500	1.61
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	41,702	38,180.9	1,592,219,891	41,750	1,741,058,500	1.56
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,125	631,315.31	1,341,545,033	779,000	1,655,375,000	1.48
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,310	379,602.08	1,256,482,884	471,500	1,560,665,000	1.40
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,484	301,669.83	1,352,687,517	337,500	1,513,350,000	1.35
日本	投資証券	イオンリート投資法人	10,116	124,417.15	1,258,603,889	149,000	1,507,284,000	1.35
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,797	175,064.8	1,189,915,445	216,000	1,468,152,000	1.31

日本	投資証券	プレミア投資法人	9,008	121,634.21	1,095,680,963	158,100	1,424,164,800	1.27
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	13,023	100,296.05	1,306,155,459	108,600	1,414,297,800	1.27
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,029	143,976.54	1,155,987,639	173,300	1,391,425,700	1.25

(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	96.70
合計	96.70

(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	1,836	円	3,499,048,800	3,680,262,000	3.29

(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	66,129,162,535	73.56
	オーストラリア	6,283,080,706	6.99
	イギリス	4,940,674,163	5.50
	シンガポール	3,630,562,721	4.04
	フランス	2,098,831,896	2.33
	カナダ	1,725,369,021	1.92
	香港	1,472,873,247	1.64
	ベルギー	1,158,683,571	1.29
	スペイン	417,376,230	0.46
	ニュージーランド	406,356,441	0.45
	ドイツ	239,708,799	0.27

	ガーンジー	228,964,567	0.25
	オランダ	169,648,067	0.19
	韓国	118,172,340	0.13
	アイルランド	117,008,989	0.13
	イスラエル	67,431,293	0.08
	マン島	28,581,243	0.03
	イタリア	15,197,289	0.02
	小計	89,247,683,118	99.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		644,975,425	0.72
合計(純資産総額)		89,892,658,543	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		14,391,000	0.02
	売建		43,335,000	0.05

(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	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	441,203	11,025.60	4,864,531,724	11,819.39	5,214,754,562	5.80
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	53,271	82,194.42	4,378,579,231	74,711.53	3,979,958,256	4.43
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	167,183	15,281.30	2,554,773,795	15,636.68	2,614,187,139	2.91
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	195,991	8,770.44	1,718,928,521	12,774.82	2,503,751,099	2.79
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	90,727	24,594.22	2,231,360,388	27,348.69	2,481,264,716	2.76
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	248,074	7,382.14	1,831,317,693	8,074.08	2,002,969,396	2.23
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	83,246	18,232.82	1,517,810,157	20,743.73	1,726,832,772	1.92
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	203,639	6,571.74	1,338,263,702	8,063.00	1,641,943,151	1.83
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	222,642	6,818.45	1,518,074,253	7,098.72	1,580,474,376	1.76
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,000,928	1,684.66	1,686,232,573	1,521.85	1,523,266,681	1.69
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	75,791	17,177.18	1,301,876,064	18,407.75	1,395,141,909	1.55
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	222,379	5,186.76	1,153,427,281	6,058.05	1,347,183,368	1.50

香港	投資証券	LINK REIT	1,239,900	897.97	1,113,398,459	1,033.82	1,281,838,378	1.43
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	337,172	3,055.59	1,030,261,415	3,570.39	1,203,838,066	1.34
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	38,551	28,182.33	1,086,457,297	30,790.66	1,187,010,934	1.32
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	78,693	11,850.73	932,569,891	14,724.43	1,158,709,570	1.29
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	319,419	3,222.76	1,029,413,364	3,540.50	1,130,904,822	1.26
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	67,808	13,916.24	943,632,877	16,312.01	1,106,084,869	1.23
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	66,522	15,147.44	1,007,638,638	16,586.57	1,103,371,956	1.23
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	224,282	4,280.04	959,937,860	4,702.96	1,054,789,454	1.17
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	710,923	1,377.68	979,425,465	1,437.05	1,021,632,750	1.14
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	318,002	2,637.11	838,606,954	3,123.12	993,161,300	1.10
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	83,996	9,827.72	825,489,731	11,404.23	957,910,299	1.07
アメリカ	投資証券	UDR INC	177,322	4,223.58	748,934,806	4,915.52	871,630,547	0.97
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	103,987	7,386.57	768,107,379	7,826.08	813,811,610	0.91
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	423,452	1,510.08	639,448,259	1,915.28	811,030,417	0.90
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	344,913	2,135.59	736,594,789	2,350.37	810,674,306	0.90
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	82,108	5,550.24	455,719,763	8,984.75	737,720,346	0.82
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,085,179	203.30	627,240,338	237.05	731,346,618	0.81
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	101,906	6,441.10	656,387,531	7,165.15	730,171,898	0.81

(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	99.28
合計	99.28

(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	130,000.00	14,280,500	14,391,000	0.02
	アメリカドル	売建	280,000.00	30,996,000	30,996,000	0.03
	シンガポールドル	売建	150,000.00	12,337,800	12,339,000	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。

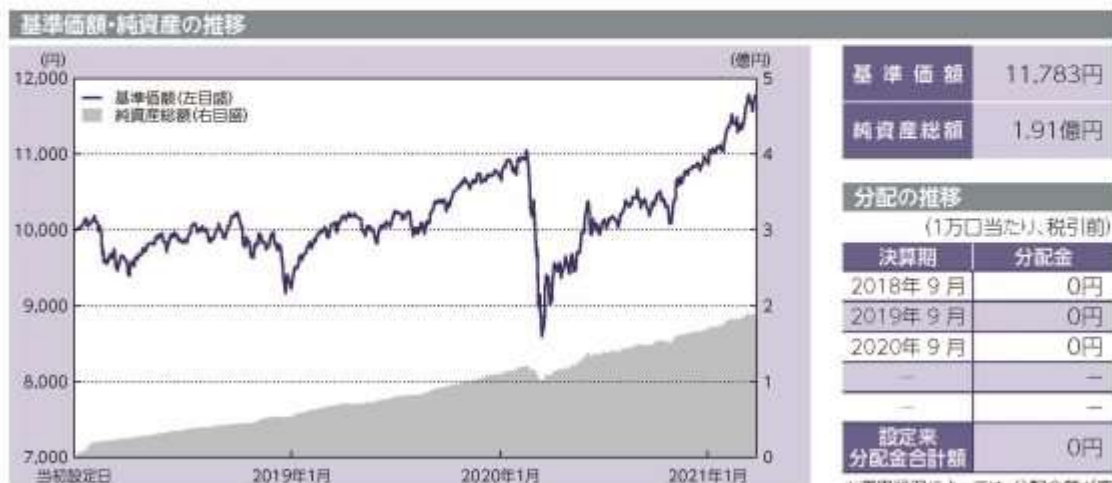
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2017年12月19日
作成基準日：2021年3月31日



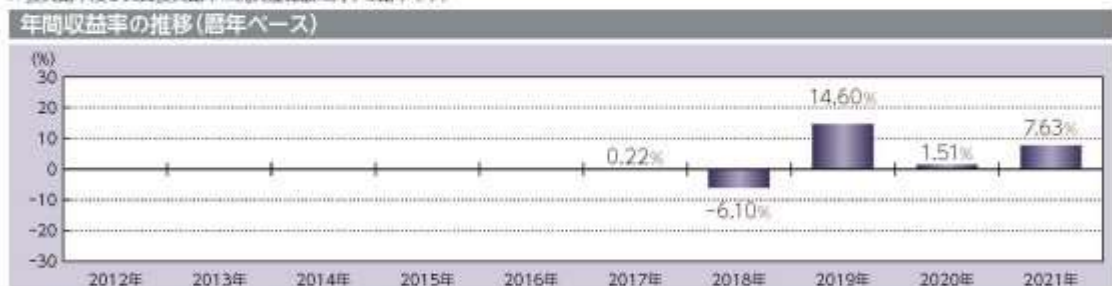
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 インデックス マザーファンド	21.8%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	-	-	0.9%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.7%
国内株式 インデックス マザーファンド	21.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.6%
外国債券 インデックス マザーファンド	18.3%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 0.625% 05/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/05/15	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	15.1%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.2%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/03/20	0.2%
J-REIT インデックス マザーファンド	10.4%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.6%
グローバル REITインデックス マザーファンド	10.4%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021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、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5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つき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

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。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（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。

(ロ) 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。

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。（2017年12月19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9月6日から翌年9月5日までとします。

ただし、第1計算期間は、2017年12月19日から2018年9月5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）

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ち、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

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

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。

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。

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）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。

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

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

上記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。

上記 から 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 から までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

上記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。

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。

上記からまでの規定は、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。

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 >

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

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っ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 >

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。

上記 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。

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。

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

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。

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

上記 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。

上記 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。

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

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。

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

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。

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3期計算期間(2019年9月6日から2020年9月7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】

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 （2019年 9月 5日現在）	第3期 （2020年 9月 7日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,205,669	5,793,897
親投資信託受益証券	85,959,198	142,226,210
未収入金	-	36,080
流動資産合計	88,164,867	148,056,187
資産合計	88,164,867	148,056,187
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,007	80,650
未払受託者報酬	20,487	35,678
未払委託者報酬	184,348	321,037
未払利息	4	14
その他未払費用	1,991	3,510
流動負債合計	207,837	440,889
負債合計	207,837	440,889
純資産の部		
元本等		
元本	86,335,448	142,231,158
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,621,582	5,384,140
（分配準備積立金）	2,215,367	4,729,476
元本等合計	87,957,030	147,615,298
純資産合計	87,957,030	147,615,298
負債純資産合計	88,164,867	148,056,187

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2018年 9月 6日	自	2019年 9月 6日
	至	2019年 9月 5日	至	2020年 9月 7日
営業収益				
受取利息		-		16
有価証券売買等損益		2,503,822		3,446,576
営業収益合計		2,503,822		3,446,592
営業費用				
支払利息		659		1,808
受託者報酬		34,448		64,194
委託者報酬		309,939		577,586
その他費用		3,323		6,311
営業費用合計		348,369		649,899
営業利益又は営業損失（ ）		2,155,453		2,796,693
経常利益又は経常損失（ ）		2,155,453		2,796,693
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,155,453		2,796,693
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（ ）		109,022		56,807
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		112,402		1,621,582
剰余金増加額又は欠損金減少額		58,210		1,298,966
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		58,210		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,298,966
剰余金減少額又は欠損金増加額		370,657		276,294
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		276,294
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		370,657		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,621,582		5,384,140

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年9月6日から翌年9月5日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第3期計算期間は2019年 9月 6日から2020年 9月 7日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 (2019年 9月 5日現在)	第3期 (2020年 9月 7日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	86,335,448口	142,231,158口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0188円 (10,188円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0379円 (10,379円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2018年 9月 6日 至 2019年 9月 5日			第3期 自 2019年 9月 6日 至 2020年 9月 7日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,271,977円	費用控除後の配当等収益額	A	2,023,572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	641,785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	716,314円
収益調整金額	C	565,103円	収益調整金額	C	2,652,249円
分配準備積立金額	D	301,605円	分配準備積立金額	D	1,989,590円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,780,470円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,381,725円
当ファンドの期末残存口数	F	86,335,448口	当ファンドの期末残存口数	F	142,231,158口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	322円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	518円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第3期 自 2019年 9月 6日 至 2020年 9月 7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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第3期 (2020年 9月 7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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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2期	第3期
	自 2018年 9月 6日 至 2019年 9月 5日	自 2019年 9月 6日 至 2020年 9月 7日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	41,952,087円	86,335,448円
期中追加設定元本額	54,949,184円	68,964,944円
期中一部解約元本額	10,565,823円	13,069,234円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 (2019年 9月 5日現在)	第3期 (2020年 9月 7日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,418,178	3,481,584
合計	2,418,178	3,481,584

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックス マザーファンド	7,936,827	13,827,539	
	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	8,195,234	13,561,473	
	国内株式インデックス マザーファンド	19,690,352	29,968,715	
	外国株式インデックス マザーファンド	11,023,896	31,844,728	
	国内債券インデックス マザーファンド	17,145,434	24,111,623	
	外国債券インデックス マザーファンド	9,633,845	28,912,132	
合計		73,625,588	142,226,210	

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2020年 9月 7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	572,076,444
国債証券	460,927,058,600
地方債証券	30,091,184,303
特殊債券	38,453,040,714
社債券	23,034,631,830
未収入金	993,702,600
未収利息	1,368,547,062
前払費用	43,841,894
流動資産合計	555,484,083,447
資産合計	555,484,083,447
負債の部	
流動負債	
未払金	1,201,804,000

	2020年 9月 7日現在
項目	金額（円）
未払解約金	287,722,459
未払利息	1,401
流動負債合計	1,489,527,860
負債合計	1,489,527,860
純資産の部	
元本等	
元本	393,927,301,623
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	160,067,253,964
元本等合計	553,994,555,587
純資産合計	553,994,555,587
負債純資産合計	555,484,083,447

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 9月 7日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 9月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	393,927,301,623口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 101,171,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4063円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,063円)</p>

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2020年 9月 7日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2020年 9月 7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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。

	2020年 9月 7日現在

（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	2020年 9月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	343,586,564,686円
期中追加設定元本額	89,660,853,179円
期中一部解約元本額	39,320,116,242円
期末元本額	393,927,301,623円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,677,342,780円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,341,834円
S M T 国内債券インデックス・オープン	19,260,998,573円
世界経済インデックスファンド	2,080,415,901円
D Cマイセレクション25	22,125,065,627円
D Cマイセレクション50	23,775,171,563円
D Cマイセレクション75	6,272,433,554円
D C日本債券インデックス・オープン	450,908,125円
D C日本債券インデックス・オープンS	91,246,588,549円
D C日本債券インデックス・オープンP	68,858,034,362円
D CマイセレクションS25	9,549,229,579円
D CマイセレクションS50	10,127,632,131円
D CマイセレクションS75	1,999,981,398円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	1,013,203,345円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	1,568,573,339円

区分	2020年 9月 7日現在
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	548,146,788円
D C世界経済インデックスファンド	2,671,000,115円
日本債券インデックス・オープン(S M A専用)	23,639,478円
国内バランス6 0 V A 1(適格機関投資家専用)	5,240,824円
マイセクション5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	41,067,263円
マイセクション7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	10,729,027円
国内バランス6 0 V A 2(適格機関投資家専用)	894,939円
バランス3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	144,932,774円
バランス5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	204,942,684円
バランス2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	54,072,649円
バランス5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	75,114,369円
バランスA(2 5) V A 1(適格機関投資家専用)	3,811,001,976円
バランスB(3 7 . 5) V A 1(適格機関投資家専用)	837,054,302円
バランスC(5 0) V A 1(適格機関投資家専用)	3,418,175,120円
世界バランスV A 1(適格機関投資家専用)	803,440,721円
世界バランスV A 2(適格機関投資家専用)	92,340,585円
バランスD(3 5) V A 1(適格機関投資家専用)	1,128,528,123円
バランスE(2 5) V A 1(適格機関投資家専用)	1,294,931,149円
バランスF(2 5) V A 1(適格機関投資家専用)	1,632,577,399円
国内バランス2 5 V A 1(適格機関投資家専用)	146,975,412円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,900,878,639円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,802,172,898円
分散投資コア戦略ファンドA	12,082,320,816円
分散投資コア戦略ファンドS	10,472,712,643円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	95,809,553円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,020,024,180円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	46,768,650円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	30,530,195円
S M T インデックスバランス・オープン	54,817,777円
S M T 世界経済インデックス・オープン	16,364,173円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	28,989,868円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	43,650,748円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	4,026,011円
グローバル経済コア	214,450,416円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	17,145,434円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 5 5	2,851,409円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2 0 3 0	436,646円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2 0 4 0	387,639円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2 0 5 0	146,078円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2 0 6 0	42,825円
F O F s用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	73,112,546,137円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	15,275,291円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 9月 7日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,694,973,500
地方債証券		71,100,727
特殊債券		123,529,697
社債券		15,098,260
合計		3,904,702,184

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第405回利付国債(2年)	470,000,000	471,250,200	
	第406回利付国債(2年)	780,000,000	782,238,600	
	第407回利付国債(2年)	360,000,000	361,108,800	
	第408回利付国債(2年)	690,000,000	692,270,100	
	第409回利付国債(2年)	2,610,000,000	2,619,135,000	
	第410回利付国債(2年)	390,000,000	391,470,300	
	第412回利付国債(2年)	780,000,000	783,728,400	
	第413回利付国債(2年)	1,640,000,000	1,647,380,000	
	第414回利付国債(2年)	2,400,000,000	2,410,656,000	
	第415回利付国債(2年)	100,000,000	100,456,000	
	第416回利付国債(2年)	400,000,000	401,824,000	
	第130回利付国債(5年)	3,160,000,000	3,169,732,800	
	第131回利付国債(5年)	4,990,000,000	5,008,313,300	

第132回利付国債(5年)	4,770,000,000	4,789,986,300	
第133回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,400,498,400	
第134回利付国債(5年)	5,850,000,000	5,880,069,000	
第135回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,103,256,000	
第136回利付国債(5年)	2,840,000,000	2,857,806,800	
第137回利付国債(5年)	6,900,000,000	6,947,196,000	
第138回利付国債(5年)	9,420,000,000	9,488,200,800	
第139回利付国債(5年)	4,760,000,000	4,797,080,400	
第140回利付国債(5年)	7,300,000,000	7,360,955,000	
第141回利付国債(5年)	7,420,000,000	7,486,112,200	
第142回利付国債(5年)	5,950,000,000	6,005,037,500	
第143回利付国債(5年)	3,950,000,000	3,985,905,500	
第144回利付国債(5年)	3,420,000,000	3,450,369,600	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	586,032,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,607,605,800	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	786,522,000	
第4回利付国債(40年)	1,200,000,000	1,726,584,000	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,490,884,500	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,731,731,400	
第7回利付国債(40年)	830,000,000	1,098,646,100	
第8回利付国債(40年)	800,000,000	991,560,000	
第9回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,048,459,200	
第10回利付国債(40年)	1,990,000,000	2,165,617,500	
第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,890,956,000	
第12回利付国債(40年)	1,710,000,000	1,633,477,500	
第13回利付国債(40年)	490,000,000	467,616,800	
第319回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,737,223,200	
第320回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,636,904,800	
第321回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,645,396,000	
第322回利付国債(10年)	750,000,000	761,947,500	
第323回利付国債(10年)	1,930,000,000	1,965,820,800	
第324回利付国債(10年)	2,740,000,000	2,785,977,200	
第325回利付国債(10年)	2,920,000,000	2,975,334,000	
第326回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,178,905,600	
第327回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,257,532,300	
第328回利付国債(10年)	3,400,000,000	3,462,526,000	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,307,735,000	
第330回利付国債(10年)	1,690,000,000	1,737,320,000	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	919,719,000	
第332回利付国債(10年)	3,110,000,000	3,183,769,200	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,389,438,300	
第334回利付国債(10年)	1,790,000,000	1,838,938,600	

第335回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,511,544,000	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	523,382,400	
第337回利付国債(10年)	2,950,000,000	3,002,038,000	
第338回利付国債(10年)	3,060,000,000	3,129,584,400	
第339回利付国債(10年)	5,050,000,000	5,168,776,000	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,476,546,400	
第341回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,204,107,200	
第342回利付国債(10年)	6,380,000,000	6,445,522,600	
第343回利付国債(10年)	3,250,000,000	3,284,905,000	
第344回利付国債(10年)	6,940,000,000	7,017,797,400	
第345回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,316,014,400	
第346回利付国債(10年)	5,200,000,000	5,261,412,000	
第347回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,023,840,000	
第348回利付国債(10年)	4,840,000,000	4,898,128,400	
第349回利付国債(10年)	3,630,000,000	3,673,814,100	
第350回利付国債(10年)	5,790,000,000	5,857,800,900	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	3,590,000,000	3,630,638,800	
第352回利付国債(10年)	4,190,000,000	4,235,545,300	
第353回利付国債(10年)	4,470,000,000	4,516,353,900	
第354回利付国債(10年)	4,580,000,000	4,624,975,600	
第355回利付国債(10年)	4,870,000,000	4,914,901,400	
第356回利付国債(10年)	4,640,000,000	4,677,676,800	
第357回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,689,784,700	
第358回利付国債(10年)	3,670,000,000	3,694,405,500	
第359回利付国債(10年)	1,580,000,000	1,589,227,200	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	137,572,600	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	195,832,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	146,263,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	141,598,600	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	61,208,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	238,136,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	224,998,200	
第8回利付国債(30年)	140,000,000	167,587,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	275,680,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	178,144,000	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	309,371,400	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	236,303,000	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	357,770,100	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	386,937,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	444,278,000	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	262,072,000	
第17回利付国債(30年)	570,000,000	741,034,200	

第18回利付国債(30年)	345,000,000	444,774,000
第19回利付国債(30年)	380,000,000	491,036,000
第20回利付国債(30年)	480,000,000	635,553,600
第21回利付国債(30年)	500,000,000	648,965,000
第22回利付国債(30年)	400,000,000	532,544,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	573,835,000
第24回利付国債(30年)	380,000,000	508,660,400
第25回利付国債(30年)	350,000,000	458,311,000
第26回利付国債(30年)	530,000,000	704,163,300
第27回利付国債(30年)	1,510,000,000	2,041,701,200
第28回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,907,061,600
第29回利付国債(30年)	1,520,000,000	2,048,534,400
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,366,454,600
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,459,216,000
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,108,340,000
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,366,655,200
第34回利付国債(30年)	1,735,000,000	2,331,874,700
第35回利付国債(30年)	2,010,000,000	2,631,371,400
第36回利付国債(30年)	1,950,000,000	2,560,818,000
第37回利付国債(30年)	2,000,000,000	2,594,300,000
第38回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,574,486,100
第39回利付国債(30年)	1,200,000,000	1,564,368,000
第40回利付国債(30年)	1,170,000,000	1,502,771,400
第41回利付国債(30年)	730,000,000	923,274,800
第42回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,709,032,500
第43回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,596,621,600
第44回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,547,374,800
第45回利付国債(30年)	820,000,000	1,004,073,600
第46回利付国債(30年)	1,660,000,000	2,033,798,800
第47回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,686,717,000
第48回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,189,296,200
第49回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,492,154,000
第50回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,178,709,000
第51回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,732,212,800
第52回利付国債(30年)	1,900,000,000	1,878,359,000
第53回利付国債(30年)	690,000,000	697,921,200
第54回利付国債(30年)	2,200,000,000	2,332,726,000
第55回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,101,973,600
第56回利付国債(30年)	1,940,000,000	2,054,130,200
第57回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,639,977,500
第58回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,810,035,000
第59回利付国債(30年)	120,000,000	123,889,200
第60回利付国債(30年)	2,530,000,000	2,738,396,100

第 6 1 回利付国債（ 3 0 年）	1,410,000,000	1,451,101,500	
第 6 2 回利付国債（ 3 0 年）	20,000,000	19,536,600	
第 6 3 回利付国債（ 3 0 年）	900,000,000	853,722,000	
第 6 4 回利付国債（ 3 0 年）	2,100,000,000	1,988,763,000	
第 6 5 回利付国債（ 3 0 年）	860,000,000	813,104,200	
第 6 6 回利付国債（ 3 0 年）	1,030,000,000	972,227,300	
第 6 7 回利付国債（ 3 0 年）	810,000,000	805,925,700	
第 5 3 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	82,301,600	
第 5 4 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	206,010,000	
第 5 5 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	144,597,600	
第 5 6 回利付国債（ 2 0 年）	150,000,000	155,716,500	
第 5 7 回利付国債（ 2 0 年）	240,000,000	248,716,800	
第 5 8 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	312,411,000	
第 5 9 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	208,352,000	
第 6 0 回利付国債（ 2 0 年）	350,000,000	362,215,000	
第 6 1 回利付国債（ 2 0 年）	240,000,000	246,847,200	
第 6 2 回利付国債（ 2 0 年）	320,000,000	328,211,200	
第 6 3 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	210,714,000	
第 6 4 回利付国債（ 2 0 年）	320,000,000	339,673,600	
第 6 5 回利付国債（ 2 0 年）	220,000,000	234,603,600	
第 6 6 回利付国債（ 2 0 年）	330,000,000	350,819,700	
第 6 7 回利付国債（ 2 0 年）	130,000,000	139,280,700	
第 6 8 回利付国債（ 2 0 年）	190,000,000	205,583,800	
第 6 9 回利付国債（ 2 0 年）	390,000,000	420,607,200	
第 7 0 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	438,200,000	
第 7 1 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	217,580,000	
第 7 2 回利付国債（ 2 0 年）	630,000,000	686,536,200	
第 7 3 回利付国債（ 2 0 年）	360,000,000	392,680,800	
第 7 4 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	219,016,000	
第 7 5 回利付国債（ 2 0 年）	130,000,000	143,010,400	
第 7 6 回利付国債（ 2 0 年）	270,000,000	294,564,600	
第 7 7 回利付国債（ 2 0 年）	290,000,000	317,703,700	
第 7 8 回利付国債（ 2 0 年）	170,000,000	186,197,600	
第 7 9 回利付国債（ 2 0 年）	270,000,000	297,021,600	
第 8 0 回利付国債（ 2 0 年）	220,000,000	243,073,600	
第 8 1 回利付国債（ 2 0 年）	390,000,000	431,098,200	
第 8 2 回利付国債（ 2 0 年）	600,000,000	666,264,000	
第 8 3 回利付国債（ 2 0 年）	290,000,000	323,535,600	
第 8 4 回利付国債（ 2 0 年）	470,000,000	521,855,100	
第 8 5 回利付国債（ 2 0 年）	290,000,000	325,107,400	
第 8 6 回利付国債（ 2 0 年）	210,000,000	237,753,600	
第 8 7 回利付国債（ 2 0 年）	550,000,000	619,635,500	

第 8 8 回利付国債(20年)	420,000,000	478,052,400
第 8 9 回利付国債(20年)	350,000,000	396,343,500
第 9 0 回利付国債(20年)	630,000,000	717,072,300
第 9 1 回利付国債(20年)	450,000,000	514,921,500
第 9 2 回利付国債(20年)	880,000,000	1,000,806,400
第 9 3 回利付国債(20年)	410,000,000	465,813,300
第 9 4 回利付国債(20年)	610,000,000	697,040,900
第 9 5 回利付国債(20年)	610,000,000	708,496,700
第 9 6 回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,825,065,600
第 9 7 回利付国債(20年)	400,000,000	464,008,000
第 9 8 回利付国債(20年)	440,000,000	507,302,400
第 9 9 回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,331,677,000
第 1 0 0 回利付国債(20年)	480,000,000	561,614,400
第 1 0 1 回利付国債(20年)	715,000,000	847,382,250
第 1 0 2 回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,499,954,400
第 1 0 3 回利付国債(20年)	400,000,000	473,052,000
第 1 0 4 回利付国債(20年)	360,000,000	420,127,200
第 1 0 5 回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,382,381,800
第 1 0 6 回利付国債(20年)	380,000,000	448,232,800
第 1 0 7 回利付国債(20年)	260,000,000	305,853,600
第 1 0 8 回利付国債(20年)	660,000,000	765,441,600
第 1 0 9 回利付国債(20年)	520,000,000	605,035,600
第 1 1 0 回利付国債(20年)	950,000,000	1,121,579,500
第 1 1 1 回利付国債(20年)	970,000,000	1,157,889,000
第 1 1 2 回利付国債(20年)	790,000,000	936,078,900
第 1 1 3 回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,723,484,500
第 1 1 4 回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,779,014,300
第 1 1 5 回利付国債(20年)	700,000,000	841,379,000
第 1 1 6 回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,797,208,200
第 1 1 7 回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,292,414,400
第 1 1 8 回利付国債(20年)	660,000,000	786,027,000
第 1 1 9 回利付国債(20年)	530,000,000	620,879,100
第 1 2 0 回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,808,608,600
第 1 2 1 回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,776,135,000
第 1 2 2 回利付国債(20年)	940,000,000	1,103,663,400
第 1 2 3 回利付国債(20年)	1,430,000,000	1,726,338,900
第 1 2 4 回利付国債(20年)	610,000,000	730,182,200
第 1 2 5 回利付国債(20年)	820,000,000	1,001,498,800
第 1 2 6 回利付国債(20年)	730,000,000	876,335,800
第 1 2 7 回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,213,820,400
第 1 2 8 回利付国債(20年)	970,000,000	1,157,452,500
第 1 2 9 回利付国債(20年)	890,000,000	1,052,496,200
第 1 3 0 回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,522,545,100

第131回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,173,950,000	
第132回利付国債（20年）	950,000,000	1,117,703,500	
第133回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,460,834,100	
第134回利付国債（20年）	1,130,000,000	1,345,106,800	
第135回利付国債（20年）	30,000,000	35,369,700	
第136回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,716,416,100	
第137回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,322,484,800	
第138回利付国債（20年）	620,000,000	717,718,200	
第139回利付国債（20年）	580,000,000	678,136,000	
第140回利付国債（20年）	2,050,000,000	2,425,560,000	
第141回利付国債（20年）	1,780,000,000	2,110,190,000	
第142回利付国債（20年）	640,000,000	766,425,600	
第143回利付国債（20年）	1,130,000,000	1,328,224,600	
第144回利付国債（20年）	1,740,000,000	2,023,881,000	
第145回利付国債（20年）	2,515,000,000	2,992,573,350	
第146回利付国債（20年）	2,260,000,000	2,694,010,400	
第147回利付国債（20年）	2,100,000,000	2,480,373,000	
第148回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,666,893,200	
第149回利付国債（20年）	3,010,000,000	3,525,312,000	
第150回利付国債（20年）	3,370,000,000	3,905,998,500	
第151回利付国債（20年）	1,255,000,000	1,420,383,900	
第152回利付国債（20年）	2,470,000,000	2,797,003,300	
第153回利付国債（20年）	2,570,000,000	2,948,329,700	
第154回利付国債（20年）	2,920,000,000	3,307,513,200	
第155回利付国債（20年）	2,050,000,000	2,262,974,500	
第156回利付国債（20年）	1,960,000,000	1,986,126,800	
第157回利付国債（20年）	2,820,000,000	2,767,068,600	
第158回利付国債（20年）	2,320,000,000	2,381,851,200	
第159回利付国債（20年）	2,760,000,000	2,872,911,600	
第160回利付国債（20年）	2,420,000,000	2,556,318,600	
第161回利付国債（20年）	1,970,000,000	2,048,051,400	
第162回利付国債（20年）	580,000,000	602,335,800	
第163回利付国債（20年）	2,610,000,000	2,707,509,600	
第164回利付国債（20年）	1,780,000,000	1,815,101,600	
第165回利付国債（20年）	1,640,000,000	1,669,995,600	
第166回利付国債（20年）	900,000,000	946,998,000	
第167回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,786,662,200	
第168回利付国債（20年）	1,390,000,000	1,387,595,300	
第169回利付国債（20年）	760,000,000	744,769,600	
第170回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,359,028,500	
第171回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,261,258,800	
第172回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,353,866,400	

	第173回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,551,466,800
	国債証券合計	427,920,000,000	460,927,058,600
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,899,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,958,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	133,217,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	132,088,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,060,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	125,912,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,306,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,413,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,496,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,094,000
	第702回東京都公募公債	100,000,000	101,310,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	101,712,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	101,543,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	102,361,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,068,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,605,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,909,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,708,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	301,506,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	198,716,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,880,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,735,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,999,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,964,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	136,264,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,858,000
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,314,000
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	203,690,000
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,684,000
	第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,812,000
	第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,708,000
	第243回神奈川県公募公債	200,000,000	198,624,000
	第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	235,208,000
	第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,596,000
	第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,432,000
	第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,377,000
	第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,048,000
	第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	153,796,520
	第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,452,000
	第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,181,000

第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	156,131,040	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,132,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	500,000,000	502,790,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	118,400,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	117,216,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	102,364,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,545,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	98,534,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	102,992,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	104,041,000	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	115,964,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	102,414,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	438,780,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	108,218,000	
平成24年度第15回兵庫県公募公債	200,000,000	202,772,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	102,308,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,897,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	101,681,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	299,721,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	119,591,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	103,639,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	117,110,000	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,136,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,668,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,775,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,910,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,978,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	118,717,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,212,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,579,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,348,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,691,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,028,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	201,916,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	307,710,000	

平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,720,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	102,515,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,788,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	117,916,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,756,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,914,931	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,667,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	115,855,000	
第5回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	116,982,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	234,554,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	106,762,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	235,534,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	197,146,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,681,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,976,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,251,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,133,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,120,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,152,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,776,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	115,940,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	115,978,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	108,336,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	119,077,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	108,804,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	131,119,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	112,378,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,107,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	102,515,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	102,966,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	300,141,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	234,554,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	118,301,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	117,110,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	102,428,000	

平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,826,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,487,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,120,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,838,800	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	297,897,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,923,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,360,000	
第107回共同発行市場公募地方債	800,000,000	811,624,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,529,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,678,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,489,000	
第112回共同発行市場公募地方債	220,000,000	223,388,000	
第113回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,944,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,204,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,844,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,369,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,065,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,055,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,004,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,801,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,290,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,159,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,043,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,570,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,012,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,657,892	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,248,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,193,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,084,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,056,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,824,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,880,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,876,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,699,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,126,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,486,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,252,070	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,993,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,046,000	
平成23年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	101,116,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	203,326,000	

平成29年度第1回熊本県公募公債（5年）	100,000,000	99,981,000	
平成23年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	101,246,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,246,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,040,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	237,506,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	296,769,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	103,408,000	
平成29年度第1回大阪市公募公債（5年）	100,000,000	99,982,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	130,515,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	135,393,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	116,142,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	124,929,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,653,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,010,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	300,141,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,351,000	
平成24年度第2回京都市公募公債	122,500,000	124,504,100	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	101,655,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,000,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,398,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	137,107,200	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	235,102,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	119,411,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	117,405,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	99,598,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	110,275,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,749,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	101,378,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,666,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	101,090,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,793,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	202,982,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	300,141,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	109,114,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,781,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,755,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	116,656,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,562,000	

	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,762,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,097,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,972,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	117,943,000	
	平成23年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	101,116,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	115,581,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	204,292,000	
	平成28年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	100,000,000	
	平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,463,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	153,373,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,872,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,624,750	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	171,844,500	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	547,943,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	202,530,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	198,598,000	
	平成24年度第1回岡山市公募公債（10年）	100,000,000	101,976,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,724,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	115,291,000	
	地方債証券合計	28,709,430,000	30,091,184,303	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	104,590,800	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	417,154,500	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,188,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,406,000	
	第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,778,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	97,820,000	
	第14回道路債券	100,000,000	104,292,000	
	第17回道路債券	100,000,000	103,448,000	
	第21回道路債券	100,000,000	130,170,000	
	第28回道路債券	200,000,000	264,156,000	
	第33回道路債券	200,000,000	267,870,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,757,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	152,968,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,561,000	
	第42回道路債券	100,000,000	109,867,000	

第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,275,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,310,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,617,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	145,170,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	236,336,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,363,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	700,000,000	712,124,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,549,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,468,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	511,385,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,116,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,842,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,326,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,865,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,564,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,349,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	304,961,160	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,776,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	223,536,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,254,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,694,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,666,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,253,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,117,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,062,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,243,000	
	200,000,000	203,498,000	

第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	613,122,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	302,000,000	306,505,840	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	638,782,760	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,096,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	151,627,480	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,943,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,293,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,234,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	104,485,740	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,450,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,341,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,235,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,983,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,158,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,701,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,090,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,234,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,683,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,562,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,866,250	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	317,292,440	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	206,242,300	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,819,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,592,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,941,000	
	120,000,000	121,351,200	

第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,384,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,279,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	216,709,240	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	100,702,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	379,395,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	100,734,000	
第3回公営企業債券（20年）	210,000,000	215,378,100	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	108,588,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	395,928,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,705,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	132,340,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	43,152,400	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	130,073,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	235,906,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	196,662,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	235,086,000	
第21回地方公共団体金融機構債券（5年）	400,000,000	399,996,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	116,713,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,156,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,903,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	507,785,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,736,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,682,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,056,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,498,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,482,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,692,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,523,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,544,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,553,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,261,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,662,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,890,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,999,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,879,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,406,000	

第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,604,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,985,410	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,958,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,934,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,238,600	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	157,773,720	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,294,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,124,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,179,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,876,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,214,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,435,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	109,536,000	
第19回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
第22回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,872,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	120,317,000	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	204,144,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,998,740	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,960,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,884,100	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,300,100	
第85回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,946,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	212,062,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	172,752,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	94,547,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	109,227,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	103,971,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,599,800	
第59回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	507,265,000	
第59回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,933,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,609,000	13,028,627	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,054,000	13,502,535	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,393,000	13,907,291	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	205,761,000	205,604,621	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	145,352,000	145,338,918	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,327,000	13,804,906	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,224,000	14,789,688	
	262,245,000	261,505,469	

第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券			
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,554,000	11,740,828	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,958,000	24,577,793	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,966,000	14,511,651	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	279,051,000	277,906,890	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	98,650,000	98,544,444	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,613,000	13,007,660	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,761,000	15,410,484	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,598,000	12,994,207	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,734,000	15,400,566	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,590,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,345,000	11,429,747	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,649,000	11,736,833	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,448,000	20,683,336	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,926,000	21,308,665	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,373,000	24,081,626	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,881,000	25,512,549	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,519,000	28,471,063	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,508,000	29,459,692	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,698,000	62,857,927	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,877,000	13,254,939	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,329,000	28,936,491	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,900,000	13,281,840	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,711,000	13,184,484	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,400,000	32,332,528	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,879,000	12,193,674	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,895,000	32,941,484	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,892,000	30,752,355	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,889,000	14,560,533	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,046,000	62,472,439	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,039,000	33,923,533	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,479,000	13,988,640	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,194,000	44,626,906	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,989,000	42,226,384	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,151,000	42,425,152	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,756,000	90,367,957	
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,277,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,766,000	96,930,265	

第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,382,000	49,448,329	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,309,000	49,787,045	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,036,000	50,613,131	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,788,000	43,860,684	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,806,000	43,562,688	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,148,000	49,718,037	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	179,209,500	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,791,000	133,140,331	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,720,000	178,879,006	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,373,000	50,329,687	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,057,000	52,114,843	
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,694,000	52,634,059	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,699,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,715,000	167,855,318	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,272,000	57,136,324	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	115,010,000	118,124,470	
第 9 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,349,000	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,505,000	66,460,146	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,872,000	69,720,154	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,378,000	69,553,635	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	208,485,000	216,063,429	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,488,000	144,400,767	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,467,000	70,759,275	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,523,000	76,035,280	
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,999,000	79,238,366	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,494,000	83,897,276	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,724,000	83,944,194	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,844,000	84,425,038	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,365,000	85,380,754	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,763,000	85,655,554	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,921,000	87,718,065	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,530,000	88,436,810	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,307,000	87,968,787	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,587,000	88,247,405	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,142,000	88,855,068	

第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,660,000	178,711,747	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,398,000	89,050,377	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,094,000	180,872,403	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,620,000	90,293,046	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,866,000	180,921,813	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,400,000	91,056,304	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,134,000	184,024,031	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,294,000	184,168,312	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	130,243,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,576,000	93,608,222	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,057,000	94,293,727	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,102,000	93,515,372	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,938,000	188,890,765	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,442,000	94,323,947	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,722,000	94,741,891	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,678,000	190,378,635	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,154,000	95,255,921	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,782,000	285,562,774	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,848,000	190,984,865	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,346,000	98,395,173	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,702,000	98,425,634	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,332,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,131,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	95,715,000	
第58回日本学生支援債券	100,000,000	99,986,000	
第59回日本学生支援債券	200,000,000	199,966,000	
第60回日本学生支援債券	200,000,000	199,962,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	109,548,000	
い第800号商工債	200,000,000	200,068,000	
い第802号商工債	100,000,000	100,007,000	

	い第804号商工債	300,000,000	300,024,000	
	い第829号商工債	200,000,000	200,226,000	
	い第832号商工債	200,000,000	199,676,000	
	い第833号商工債	100,000,000	99,794,000	
	第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,184,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,190,000	
	第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,394,000	
	第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,187,000	
	第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,118,000	
	第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,578,000	
	第236号商工債（3年）	300,000,000	299,721,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	102,289,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	117,624,000	
	第39回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,024,000	
	第48回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,816,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,275,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,906,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	498,305,000	
	第42回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,406,000	
	第59回中日本高速道路株式会社社債	400,000,000	401,484,000	
	第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,025,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,534,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,955,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,822,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	197,700,000	
	特殊債券合計	36,961,697,000	38,453,040,714	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,488,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	98,602,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	294,786,000	
	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,301,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,297,000	
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,490,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,217,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,525,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,515,000	

第12回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	200,000,000	199,728,000	
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	100,000,000	99,522,000	
第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グ ループ・インク円貨社債	200,000,000	203,840,000	
第12回ウエストパック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	400,000,000	400,836,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,620,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,268,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,516,000	
第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,645,000	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	99,789,000	
第11回アサヒグループホールディングス株 式会社無担保社債	100,000,000	99,729,000	
第10回麒麟ホールディングス株式会社無 担保社債	100,000,000	101,437,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,593,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,430,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,282,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,647,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	102,087,000	
第11回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	99,960,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	99,683,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	100,412,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,928,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	100,045,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,578,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,563,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,582,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディ ングス無担保社債	100,000,000	100,006,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディ ングス無担保社債	200,000,000	198,434,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディ ングス無担保社債	200,000,000	200,018,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,750,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	398,580,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,961,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,001,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	99,551,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	99,773,000	

第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,616,000	
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,294,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,493,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,912,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,619,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,926,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,714,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,346,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,811,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,381,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,587,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,855,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,913,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,340,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,310,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,782,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,379,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,386,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,188,000	
第11回J.A.三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,770,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,146,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	197,648,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,244,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,129,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,059,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	95,140,000	
第14回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,794,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,115,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,213,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,180,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,940,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,434,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	97,230,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	118,871,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	113,790,000	
	100,000,000	101,683,000	

第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債			
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	101,241,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,500,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	303,921,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,794,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	98,990,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,962,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,985,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,731,000	
第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,184,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,385,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,829,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,167,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,856,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,884,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	200,080,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,544,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,587,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	98,834,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,426,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,316,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,294,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,738,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,160,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,962,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,191,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,971,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,674,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,462,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,682,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,041,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,638,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,237,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,356,000	

第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,420,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,806,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	235,086,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,532,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,194,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,960,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,660,250	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,512,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,802,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,062,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,724,800	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,007,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,265,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,519,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	108,696,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	94,915,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	95,024,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	194,186,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,202,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,589,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,132,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,026,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,124,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	101,455,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,100,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,959,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,236,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,028,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,115,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	96,908,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,323,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,744,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	201,878,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,376,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,675,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,114,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,483,000	

第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,472,000	
第416回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,332,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,188,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,690,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,734,000	
第330回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,120,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	130,338,180	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,988,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,197,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,552,000	
第521回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,843,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,560,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,184,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,688,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,306,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,696,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,908,000	
第317回北海道電力株式会社社債	200,000,000	206,358,000	
第320回北海道電力株式会社社債	201,000,000	202,326,600	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,765,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,037,000	
第344回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,346,000	
第351回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,282,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,677,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,749,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,653,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,713,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,159,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,023,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,989,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	98,197,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	199,794,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	102,005,000	
第6回SCK株式会社無担保社債	100,000,000	99,761,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,652,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	199,636,000	
社債券合計	22,766,000,000	23,034,631,830	
合計		552,505,915,447	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 9月 7日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,204,390,064
株式	341,705,922,460
未収入金	18,008,293
未収配当金	208,718,149
前払金	21,107,000
差入委託証拠金	108,733,000
流動資産合計	351,266,878,966
資産合計	351,266,878,966
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,107,550
未払金	6,428,432,494
未払解約金	121,870,776
未払利息	22,546
流動負債合計	6,571,433,366
負債合計	6,571,433,366
純資産の部	
元本等	
元本	226,469,579,366
剰余金	
剰余金又は欠損金()	118,225,866,234
元本等合計	344,695,445,600
純資産合計	344,695,445,600
負債純資産合計	351,266,878,966

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 9月 7日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	2020年 9月 7日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(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。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 9月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	226,469,579,366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 1.5220円 (1万口当たり純資産額) (15,220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

	2020年 9月 7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。

2020年 9月 7日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月 7日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 9月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	207,624,577,796円
期中追加設定元本額	61,952,460,233円
期中一部解約元本額	43,107,458,663円
期末元本額	226,469,579,366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）	531,799,802円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,085,609,717円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,351,328円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,378,432,840円
世界経済インデックスファンド	2,350,177,772円
日本株式インデックス・オープン	4,035,029,496円
D C マイセレクション 2 5	6,932,453,827円
D C マイセレクション 5 0	19,545,276,557円
D C マイセレクション 7 5	18,208,920,570円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,832,983,466円
D C マイセレクション S 2 5	2,980,147,076円
D C マイセレクション S 5 0	8,335,682,232円
D C マイセレクション S 7 5	5,392,548,028円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,158,823,883円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	309,470,449円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	692,704,824円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	474,328,465円
D C 世界経済インデックスファンド	2,993,886,943円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,042,456,766円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	15,312,268円

区分	2020年 9月 7日現在
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	34,140,400円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	31,881,137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)	252,598,317円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,628,611円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	65,653,636円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	243,998,549円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	52,165,557円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	248,429,146円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,478,022,682円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	649,810,079円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,729,915,773円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	619,972,009円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	38,868,409円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	691,472,445円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	396,431,133円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	496,170,084円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	51,792,398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)	828,683,465円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,453,815,279円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,950,004,329円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,687,113,627円
コア投資戦略ファンド(成長型)	7,132,578,799円
分散投資コア戦略ファンドA	5,542,279,535円
分散投資コア戦略ファンドS	15,223,595,648円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	344,106,400円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	356,524,774円
コア投資戦略ファンド(切替型)	2,476,493,092円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	209,539,944円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,649,828円
SMT インデックスバランス・オープン	66,108,298円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	21,148,078,044円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	25,736,900円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	83,472,455円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	14,771,489円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,187,770円
グローバル経済コア	258,169,149円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	19,690,352円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	46,968,685円
DCターゲット・イヤーフンド2055	5,285,379円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	815,925,174円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	117,182,858円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	308,141円

区分	2020年 9月 7日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	382,225円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	203,232円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	137,396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)	49,843,851,019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)	1,829,036,541円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	72,798,791円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	12,487,969円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 9月 7日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	9,022,950,236	
合計	9,022,950,236	

(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

(2020年 9月 7日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,807,982,000	-	2,786,875,000	21,107,000
合計		2,807,982,000	-	2,786,875,000	21,107,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	

極洋	7,200	2,702.00	19,454,400
日本水産	205,700	454.00	93,387,800
マルハニチロ	29,700	2,336.00	69,379,200
カネコ種苗	6,200	1,395.00	8,649,000
サカタのタネ	24,500	3,475.00	85,137,500
ホクト	15,700	2,152.00	33,786,400
ホクリヨウ	3,200	648.00	2,073,600
住石ホールディングス	41,500	118.00	4,897,000
日鉄鉱業	4,700	4,210.00	19,787,000
三井松島ホールディングス	8,000	764.00	6,112,000
国際石油開発帝石	756,400	640.10	484,171,640
石油資源開発	26,900	1,801.00	48,446,900
K & O エナジーグループ	10,000	1,514.00	15,140,000
ヒノキヤグループ	5,100	1,749.00	8,919,900
ショーボンドホールディングス	32,000	5,080.00	162,560,000
ミライト・ホールディングス	61,100	1,506.00	92,016,600
タマホーム	11,100	1,272.00	14,119,200
サンヨーホームズ	1,800	636.00	1,144,800
日本アクア	8,200	622.00	5,100,400
ファーストコーポレーション	6,300	619.00	3,899,700
ベステラ	3,500	983.00	3,440,500
T A T E R U	38,200	175.00	6,685,000
キャンディル	3,400	749.00	2,546,600
スペースバリューホールディングス	25,100	385.00	9,663,500
ダイセキ環境ソリューション	4,000	682.00	2,728,000
第一カッター興業	2,500	2,218.00	5,545,000
明豊ファシリティワークス	6,600	650.00	4,290,000
安藤・間	122,500	706.00	86,485,000
東急建設	60,200	477.00	28,715,400
コムシスホールディングス	72,900	2,842.00	207,181,800
ビーアールホールディングス	22,400	710.00	15,904,000
高松コンストラクショングループ	12,800	2,208.00	28,262,400
東建コーポレーション	6,300	7,020.00	44,226,000
ソネック	2,100	845.00	1,774,500
ヤマウラ	8,900	815.00	7,253,500
大成建設	158,400	3,595.00	569,448,000
大林組	475,000	998.00	474,050,000
清水建設	482,000	798.00	384,636,000
飛鳥建設	13,600	1,070.00	14,552,000
長谷工コーポレーション	183,900	1,443.00	265,367,700
松井建設	18,700	670.00	12,529,000
銭高組	2,100	3,645.00	7,654,500

鹿島建設	372,900	1,299.00	484,397,100
不動テトラ	12,400	1,469.00	18,215,600
大末建設	5,500	883.00	4,856,500
鉄建建設	10,300	2,026.00	20,867,800
西松建設	36,600	1,987.00	72,724,200
三井住友建設	114,700	427.00	48,976,900
大豊建設	10,700	2,806.00	30,024,200
前田建設工業	119,000	729.00	86,751,000
佐田建設	10,200	419.00	4,273,800
ナカノフドー建設	13,000	373.00	4,849,000
奥村組	22,400	2,487.00	55,708,800
東鉄工業	20,400	2,649.00	54,039,600
イチケン	3,400	1,562.00	5,310,800
富士ピー・エス	7,000	634.00	4,438,000
浅沼組	5,300	4,265.00	22,604,500
戸田建設	197,200	676.00	133,307,200
熊谷組	22,000	2,656.00	58,432,000
北野建設	2,900	2,488.00	7,215,200
植木組	2,100	2,639.00	5,541,900
矢作建設工業	21,000	852.00	17,892,000
ピーエス三菱	15,600	590.00	9,204,000
日本ハウスホールディングス	32,400	264.00	8,553,600
大東建託	51,900	9,404.00	488,067,600
新日本建設	20,200	843.00	17,028,600
N I P P O	39,300	2,709.00	106,463,700
東亜道路工業	2,900	3,350.00	9,715,000
前田道路	41,900	1,932.00	80,950,800
日本道路	4,600	7,500.00	34,500,000
東亜建設工業	14,800	1,612.00	23,857,600
日本国土開発	46,200	593.00	27,396,600
若築建設	8,500	1,198.00	10,183,000
東洋建設	53,300	400.00	21,320,000
五洋建設	188,300	685.00	128,985,500
世紀東急工業	22,800	803.00	18,308,400
福田組	5,500	4,880.00	26,840,000
住友林業	120,300	1,652.00	198,735,600
日本基礎技術	16,000	421.00	6,736,000
巴コーポレーション	21,100	351.00	7,406,100
大和ハウス工業	469,900	2,837.00	1,333,106,300
ライト工業	27,200	1,591.00	43,275,200
積水ハウス	515,200	2,052.00	1,057,190,400
日特建設	12,400	790.00	9,796,000

北陸電気工事	8,200	1,029.00	8,437,800
ユアテック	27,200	615.00	16,728,000
日本リーテック	9,900	2,635.00	26,086,500
四電工	2,600	2,200.00	5,720,000
中電工	19,100	2,246.00	42,898,600
関電工	67,600	831.00	56,175,600
きんでん	112,800	1,752.00	197,625,600
東京エネシス	15,800	735.00	11,613,000
トーエネック	4,800	3,525.00	16,920,000
住友電設	13,400	2,285.00	30,619,000
日本電設工業	26,000	2,150.00	55,900,000
協和エクシオ	72,000	2,650.00	190,800,000
新日本空調	12,600	2,017.00	25,414,200
九電工	33,300	2,988.00	99,500,400
三機工業	34,200	1,165.00	39,843,000
日揮ホールディングス	146,200	1,136.00	166,083,200
中外炉工業	5,100	1,468.00	7,486,800
ヤマト	15,200	637.00	9,682,400
太平電業	11,500	2,215.00	25,472,500
高砂熱学工業	40,000	1,496.00	59,840,000
三晃金属工業	2,000	2,045.00	4,090,000
朝日工業社	3,200	2,767.00	8,854,400
明星工業	30,700	790.00	24,253,000
大気社	23,100	2,877.00	66,458,700
ダイダン	11,300	2,591.00	29,278,300
日比谷総合設備	15,300	1,750.00	26,775,000
フィル・カンパニー	2,700	1,847.00	4,986,900
OSJBホールディングス	74,900	236.00	17,676,400
東洋エンジニアリング	19,900	319.00	6,348,100
レイズネクスト	25,500	1,268.00	32,334,000
日本製粉	44,500	1,658.00	73,781,000
日清製粉グループ本社	171,700	1,666.00	286,052,200
日東富士製粉	1,100	6,080.00	6,688,000
昭和産業	14,000	3,480.00	48,720,000
鳥越製粉	13,500	936.00	12,636,000
中部飼料	18,600	1,583.00	29,443,800
フィード・ワン	102,100	181.00	18,480,100
東洋精糖	2,600	1,246.00	3,239,600
日本甜菜製糖	7,900	1,755.00	13,864,500
三井製糖	13,300	1,906.00	25,349,800
塩水港精糖	16,500	224.00	3,696,000
日新製糖	7,200	1,789.00	12,880,800

森永製菓	35,700	3,845.00	137,266,500
中村屋	3,900	3,895.00	15,190,500
江崎グリコ	41,900	4,485.00	187,921,500
名糖産業	7,300	1,495.00	10,913,500
井村屋グループ	8,600	2,204.00	18,954,400
不二家	9,700	2,247.00	21,795,900
山崎製パン	113,900	1,714.00	195,224,600
第一屋製パン	2,900	982.00	2,847,800
モロゾフ	2,600	5,390.00	14,014,000
亀田製菓	8,700	5,110.00	44,457,000
寿スピリッツ	14,600	4,740.00	69,204,000
カルビー	69,300	3,270.00	226,611,000
森永乳業	28,100	5,020.00	141,062,000
六甲バター	10,100	1,725.00	17,422,500
ヤクルト本社	104,600	5,610.00	586,806,000
明治ホールディングス	100,500	7,970.00	800,985,000
雪印メグミルク	36,600	2,279.00	83,411,400
プリマハム	23,800	2,972.00	70,733,600
日本ハム	58,100	4,700.00	273,070,000
林兼産業	5,000	570.00	2,850,000
丸大食品	16,200	1,855.00	30,051,000
S Foods	12,100	2,849.00	34,472,900
柿安本店	5,300	2,496.00	13,228,800
伊藤ハム米久ホールディングス	97,900	680.00	66,572,000
サッポロホールディングス	51,900	1,814.00	94,146,600
アサヒグループホールディングス	318,400	3,461.00	1,101,982,400
キリンホールディングス	644,700	2,004.50	1,292,301,150
宝ホールディングス	112,700	1,017.00	114,615,900
オエノンホールディングス	43,200	413.00	17,841,600
養命酒製造	4,700	1,801.00	8,464,700
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	116,400	1,749.00	203,583,600
サントリー食品インターナショナル	101,700	3,805.00	386,968,500
ダイトーグループホールディングス	7,800	5,010.00	39,078,000
伊藤園	46,100	6,410.00	295,501,000
キーコーヒー	14,900	2,178.00	32,452,200
ユニカフェ	4,600	970.00	4,462,000
ジャパンフーズ	2,200	1,220.00	2,684,000
日清オイリオグループ	19,600	3,115.00	61,054,000
不二製油グループ本社	37,100	3,045.00	112,969,500
かどや製油	1,700	3,590.00	6,103,000
J - オイルミルズ	7,900	3,735.00	29,506,500
キッコーマン	109,400	5,740.00	627,956,000

味の素	335,700	1,978.50	664,182,450
キューピー	84,600	1,996.00	168,861,600
ハウス食品グループ本社	56,900	3,460.00	196,874,000
カゴメ	62,100	3,275.00	203,377,500
焼津水産化学工業	7,400	918.00	6,793,200
アリアケジャパン	13,900	7,330.00	101,887,000
ピエトロ	2,000	1,690.00	3,380,000
エバラ食品工業	3,700	2,241.00	8,291,700
やまみ	1,300	2,070.00	2,691,000
ニチレイ	72,400	2,704.00	195,769,600
東洋水産	78,200	5,690.00	444,958,000
イトアンド	5,300	1,901.00	10,075,300
大冷	2,000	2,255.00	4,510,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,400	937.00	7,870,800
日清食品ホールディングス	64,600	10,180.00	657,628,000
永谷園ホールディングス	7,400	2,235.00	16,539,000
一正蒲鉾	5,900	1,021.00	6,023,900
フジッコ	16,500	1,997.00	32,950,500
ロック・フィールド	16,400	1,316.00	21,582,400
日本たばこ産業	815,100	1,963.50	1,600,448,850
ケンコーマヨネーズ	8,500	1,774.00	15,079,000
わらべや日洋ホールディングス	9,900	1,476.00	14,612,400
なとり	8,500	1,856.00	15,776,000
イフジ産業	2,600	874.00	2,272,400
ピククルスコーポレーション	3,300	2,576.00	8,500,800
北の達人コーポレーション	53,100	537.00	28,514,700
ユーグレナ	65,700	799.00	52,494,300
ミヨシ油脂	5,300	1,141.00	6,047,300
理研ビタミン	14,400	2,095.00	30,168,000
片倉工業	20,300	1,199.00	24,339,700
ゲンゼ	11,000	3,815.00	41,965,000
東洋紡	58,900	1,538.00	90,588,200
ユニチカ	44,700	376.00	16,807,200
富士紡ホールディングス	7,300	3,505.00	25,586,500
倉敷紡績	15,000	1,972.00	29,580,000
シキボウ	7,800	975.00	7,605,000
日本毛織	49,300	967.00	47,673,100
トーア紡コーポレーション	5,900	465.00	2,743,500
帝国繊維	16,900	2,619.00	44,261,100
帝人	121,300	1,661.00	201,479,300
東レ	1,075,000	501.50	539,112,500
サカイオーベックス	4,200	1,945.00	8,169,000

住江織物	3,300	1,766.00	5,827,800
日本フェルト	9,400	469.00	4,408,600
イチカワ	2,500	1,288.00	3,220,000
日東製網	1,700	1,416.00	2,407,200
アツギ	12,600	509.00	6,413,400
ダイニック	5,600	780.00	4,368,000
セーレン	36,800	1,554.00	57,187,200
ソトー	6,100	954.00	5,819,400
東海染工	2,200	1,130.00	2,486,000
小松マテーレ	24,600	793.00	19,507,800
ワコールホールディングス	37,100	1,842.00	68,338,200
ホギメディカル	17,000	3,280.00	55,760,000
T S Iホールディングス	45,700	310.00	14,167,000
マツオカコーポレーション	4,400	2,071.00	9,112,400
ワールド	21,200	1,509.00	31,990,800
三陽商会	7,700	601.00	4,627,700
ナイガイ	6,000	370.00	2,220,000
オンワードホールディングス	89,900	271.00	24,362,900
ルックホールディングス	5,300	848.00	4,494,400
ゴールドウイン	26,900	7,790.00	209,551,000
デサント	29,100	1,857.00	54,038,700
キング	7,400	557.00	4,121,800
ヤマトインターナショナル	13,700	340.00	4,658,000
特種東海製紙	9,100	4,415.00	40,176,500
王子ホールディングス	620,100	487.00	301,988,700
日本製紙	65,600	1,321.00	86,657,600
三菱製紙	16,800	347.00	5,829,600
北越コーポレーション	88,400	364.00	32,177,600
中越パルプ工業	6,300	1,446.00	9,109,800
巴川製紙所	4,400	804.00	3,537,600
大王製紙	65,400	1,437.00	93,979,800
阿波製紙	3,800	470.00	1,786,000
レンゴー	140,200	783.00	109,776,600
トーモク	9,100	1,724.00	15,688,400
ザ・パック	11,200	2,805.00	31,416,000
クラレ	233,600	1,096.00	256,025,600
旭化成	983,200	928.20	912,606,240
共和レザー	8,100	565.00	4,576,500
昭和電工	112,600	2,008.00	226,100,800
住友化学	1,089,900	360.00	392,364,000
住友精化	6,600	3,375.00	22,275,000
日産化学	82,400	5,560.00	458,144,000

ラサ工業	5,200	1,668.00	8,673,600
クレハ	12,700	4,615.00	58,610,500
多木化学	5,800	5,960.00	34,568,000
テイカ	10,900	1,397.00	15,227,300
石原産業	26,600	757.00	20,136,200
片倉コープアグリ	3,800	1,216.00	4,620,800
日本曹達	22,000	3,035.00	66,770,000
東ソー	229,300	1,667.00	382,243,100
トクヤマ	42,800	2,567.00	109,867,600
セントラル硝子	30,300	2,111.00	63,963,300
東亜合成	93,100	1,056.00	98,313,600
大阪ソーダ	15,100	2,542.00	38,384,200
関東電化工業	35,200	757.00	26,646,400
デンカ	54,100	3,095.00	167,439,500
信越化学工業	254,700	13,490.00	3,435,903,000
日本カーバイド工業	5,200	1,195.00	6,214,000
堺化学工業	9,600	1,994.00	19,142,400
第一稀元素化学工業	16,100	779.00	12,541,900
エア・ウォーター	138,000	1,459.00	201,342,000
大陽日酸	142,600	1,769.00	252,259,400
日本化学工業	4,600	2,255.00	10,373,000
東邦アセチレン	2,200	1,260.00	2,772,000
日本パーカライズング	74,800	982.00	73,453,600
高压ガス工業	23,500	796.00	18,706,000
チタン工業	1,900	1,710.00	3,249,000
四国化成工業	21,700	1,119.00	24,282,300
戸田工業	3,400	2,471.00	8,401,400
ステラ ケミファ	8,100	2,863.00	23,190,300
保土谷化学工業	5,500	4,875.00	26,812,500
日本触媒	23,000	5,640.00	129,720,000
大日精化工業	13,100	2,201.00	28,833,100
カネカ	38,400	2,823.00	108,403,200
三菱瓦斯化学	138,000	1,925.00	265,650,000
三井化学	137,600	2,636.00	362,713,600
J S R	138,200	2,401.00	331,818,200
東京応化工業	25,400	5,040.00	128,016,000
大阪有機化学工業	13,700	2,397.00	32,838,900
三菱ケミカルホールディングス	991,700	653.50	648,075,950
K Hネオケム	24,500	2,396.00	58,702,000
ダイセル	193,100	787.00	151,969,700
住友ベークライト	23,300	3,010.00	70,133,000
積水化学工業	313,700	1,685.00	528,584,500

日本ゼオン	133,800	1,159.00	155,074,200
アイカ工業	44,500	3,630.00	161,535,000
宇部興産	74,900	1,918.00	143,658,200
積水樹脂	26,700	2,137.00	57,057,900
タキロンシーアイ	32,100	695.00	22,309,500
旭有機材	8,400	1,252.00	10,516,800
ニチバン	7,800	1,634.00	12,745,200
リケンテクノス	37,300	387.00	14,435,100
大倉工業	7,000	1,540.00	10,780,000
積水化成成品工業	19,900	560.00	11,144,000
群栄化学工業	3,400	2,321.00	7,891,400
タイガースポリマー	7,800	418.00	3,260,400
ミライアル	5,200	1,001.00	5,205,200
ダイキアクシス	5,300	843.00	4,467,900
ダイキョーニシカワ	31,300	572.00	17,903,600
竹本容器	5,300	969.00	5,135,700
森六ホールディングス	8,000	1,690.00	13,520,000
日本化薬	91,800	979.00	89,872,200
カーリットホールディングス	15,800	488.00	7,710,400
日本精化	11,900	1,502.00	17,873,800
扶桑化学工業	15,000	3,550.00	53,250,000
トリケミカル研究所	3,300	10,100.00	33,330,000
A D E K A	68,300	1,536.00	104,908,800
日油	55,900	4,060.00	226,954,000
新日本理化	24,500	159.00	3,895,500
ハリマ化成グループ	12,300	955.00	11,746,500
花王	362,700	7,860.00	2,850,822,000
第一工業製薬	5,500	4,235.00	23,292,500
石原ケミカル	4,000	2,037.00	8,148,000
日華化学	5,000	866.00	4,330,000
ニイタカ	3,100	2,997.00	9,290,700
三洋化成工業	8,900	4,955.00	44,099,500
有機合成薬品工業	11,400	334.00	3,807,600
大日本塗料	16,800	880.00	14,784,000
日本ペイントホールディングス	122,400	9,060.00	1,108,944,000
関西ペイント	166,700	2,575.00	429,252,500
神東塗料	11,700	186.00	2,176,200
中国塗料	42,200	1,005.00	42,411,000
日本特殊塗料	11,100	956.00	10,611,600
藤倉化成	20,000	522.00	10,440,000
太陽ホールディングス	10,900	5,440.00	59,296,000
D I C	62,600	2,512.00	157,251,200

サカティンクス	32,400	1,028.00	33,307,200
東洋インキSCホールディングス	31,400	1,906.00	59,848,400
T&K TOKA	11,500	778.00	8,947,000
富士フィルムホールディングス	290,400	4,985.00	1,447,644,000
資生堂	301,000	6,013.00	1,809,913,000
ライオン	196,900	2,195.00	432,195,500
高砂香料工業	9,500	2,037.00	19,351,500
マンダム	34,000	1,775.00	60,350,000
ミルボン	20,200	5,630.00	113,726,000
ファンケル	61,300	3,560.00	218,228,000
コーセー	28,500	12,230.00	348,555,000
コタ	8,700	1,220.00	10,614,000
シーボン	2,000	1,854.00	3,708,000
ポーラ・オルビスホールディングス	64,700	1,945.00	125,841,500
ノエビアホールディングス	12,800	5,030.00	64,384,000
アジュバンコスメジャパン	3,400	972.00	3,304,800
エステー	9,700	2,041.00	19,797,700
アグロ カネショウ	5,700	1,547.00	8,817,900
コニシ	24,900	1,450.00	36,105,000
長谷川香料	26,100	2,069.00	54,000,900
星光PMC	8,700	643.00	5,594,100
小林製薬	42,400	9,370.00	397,288,000
荒川化学工業	13,600	1,219.00	16,578,400
メック	10,400	1,790.00	18,616,000
日本高純度化学	4,200	2,582.00	10,844,400
タカラバイオ	39,600	2,796.00	110,721,600
JCU	18,300	3,370.00	61,671,000
新田ゼラチン	9,500	681.00	6,469,500
OATアグリオ	2,900	1,128.00	3,271,200
デクセリアルズ	39,100	1,079.00	42,188,900
アース製薬	10,500	7,740.00	81,270,000
北興化学工業	14,100	699.00	9,855,900
大成ラミック	5,000	2,725.00	13,625,000
クミアイ化学工業	62,600	979.00	61,285,400
日本農薬	27,000	502.00	13,554,000
アキレス	10,400	1,744.00	18,137,600
有沢製作所	24,000	931.00	22,344,000
日東電工	104,500	6,490.00	678,205,000
レック	16,200	1,582.00	25,628,400
三光合成	17,300	265.00	4,584,500
きもと	25,800	160.00	4,128,000
藤森工業	13,600	3,925.00	53,380,000

前澤化成工業	9,600	1,050.00	10,080,000
未来工業	8,100	1,920.00	15,552,000
ウェーブロックホールディングス	5,200	768.00	3,993,600
J S P	8,900	1,600.00	14,240,000
エフピコ	16,700	7,970.00	133,099,000
天馬	10,100	1,951.00	19,705,100
信越ポリマー	27,200	878.00	23,881,600
東リ	37,700	242.00	9,123,400
ニフコ	55,600	2,869.00	159,516,400
バルカー	12,300	1,860.00	22,878,000
ユニ・チャーム	321,100	4,456.00	1,430,821,600
ショーエイコーポレーション	2,300	1,193.00	2,743,900
協和キリン	152,400	2,809.00	428,091,600
武田薬品工業	1,260,200	3,800.00	4,788,760,000
アステラス製薬	1,313,200	1,618.50	2,125,414,200
大日本住友製薬	112,300	1,295.00	145,428,500
塩野義製薬	190,500	5,777.00	1,100,518,500
わかもと製薬	18,000	251.00	4,518,000
あすか製薬	17,200	1,175.00	20,210,000
日本新薬	39,600	8,340.00	330,264,000
ピオフェルミン製薬	2,600	2,386.00	6,203,600
中外製薬	473,700	4,708.00	2,230,179,600
科研製薬	25,900	4,825.00	124,967,500
エーザイ	181,300	9,405.00	1,705,126,500
ロート製薬	77,700	3,440.00	267,288,000
小野薬品工業	347,800	3,139.00	1,091,744,200
久光製薬	40,000	4,825.00	193,000,000
持田製薬	21,000	3,850.00	80,850,000
参天製薬	282,300	1,958.00	552,743,400
扶桑薬品工業	5,300	2,694.00	14,278,200
日本ケミファ	2,000	2,470.00	4,940,000
ツムラ	46,900	2,904.00	136,197,600
日医工	42,900	1,190.00	51,051,000
キッセイ薬品工業	26,800	2,282.00	61,157,600
生化学工業	29,400	1,063.00	31,252,200
栄研化学	26,600	1,957.00	52,056,200
日水製薬	6,400	1,129.00	7,225,600
鳥居薬品	9,500	2,813.00	26,723,500
J C R ファーマ	10,700	11,670.00	124,869,000
東和薬品	19,400	2,062.00	40,002,800
富士製薬工業	10,300	1,079.00	11,113,700
沢井製薬	31,100	5,480.00	170,428,000

ゼリア新薬工業	27,500	1,960.00	53,900,000
第一三共	433,400	9,294.00	4,028,019,600
キョーリン製薬ホールディングス	33,400	2,061.00	68,837,400
大幸薬品	18,600	2,485.00	46,221,000
ダイト	9,500	3,375.00	32,062,500
大塚ホールディングス	314,800	4,454.00	1,402,119,200
大正製薬ホールディングス	32,000	6,450.00	206,400,000
ペプチドリーム	77,000	4,235.00	326,095,000
日本コークス工業	128,000	61.00	7,808,000
ニチレキ	17,900	1,612.00	28,854,800
ユシロ化学工業	8,500	1,245.00	10,582,500
ビーピー・カストロール	5,400	1,179.00	6,366,600
富士石油	40,400	185.00	7,474,000
MORESCO	5,500	921.00	5,065,500
出光興産	168,100	2,318.00	389,655,800
ENEOSホールディングス	2,278,500	408.20	930,083,700
コスモエネルギーホールディングス	43,800	1,601.00	70,123,800
横浜ゴム	87,700	1,731.00	151,808,700
TOYO TIRE	79,700	1,799.00	143,380,300
ブリヂストン	402,700	3,368.00	1,356,293,600
住友ゴム工業	136,100	1,020.00	138,822,000
藤倉コンポジット	13,200	355.00	4,686,000
オカモト	9,200	4,135.00	38,042,000
フコク	6,600	636.00	4,197,600
ニッタ	17,100	2,265.00	38,731,500
住友理工	29,400	557.00	16,375,800
三ツ星ベルト	19,900	1,648.00	32,795,200
バンドー化学	26,600	584.00	15,534,400
日東紡績	22,600	4,090.00	92,434,000
A G C	139,100	3,015.00	419,386,500
日本板硝子	72,500	413.00	29,942,500
石塚硝子	2,800	1,853.00	5,188,400
日本山村硝子	6,400	871.00	5,574,400
日本電気硝子	56,200	2,026.00	113,861,200
オハラ	6,100	1,014.00	6,185,400
住友大阪セメント	28,700	3,510.00	100,737,000
太平洋セメント	95,700	2,834.00	271,213,800
日本ヒューム	15,300	780.00	11,934,000
日本コンクリート工業	32,900	299.00	9,837,100
三谷セキサン	7,100	5,690.00	40,399,000
アジアパイルホールディングス	21,700	474.00	10,285,800
東海カーボン	148,200	1,036.00	153,535,200

日本カーボン	8,400	3,535.00	29,694,000
東洋炭素	8,900	1,685.00	14,996,500
ノリタケカンパニーリミテド	8,400	3,270.00	27,468,000
TOTO	108,200	4,740.00	512,868,000
日本碍子	181,900	1,519.00	276,306,100
日本特殊陶業	115,300	1,869.00	215,495,700
MARUWA	5,800	9,170.00	53,186,000
品川リフラクトリーズ	4,000	2,298.00	9,192,000
黒崎播磨	3,000	3,120.00	9,360,000
ヨータイ	12,200	706.00	8,613,200
イソライト工業	8,000	436.00	3,488,000
東京窯業	19,500	345.00	6,727,500
ニッカトー	7,000	631.00	4,417,000
フジインコーポレーテッド	13,500	3,465.00	46,777,500
クニミネ工業	6,200	976.00	6,051,200
エーアンドエーマテリアル	2,600	1,039.00	2,701,400
ニチアス	41,500	2,441.00	101,301,500
ニチハ	21,100	2,657.00	56,062,700
日本製鉄	670,400	1,108.00	742,803,200
神戸製鋼所	274,300	428.00	117,400,400
中山製鋼所	20,900	346.00	7,231,400
合同製鐵	8,100	2,042.00	16,540,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	404,600	851.00	344,314,600
東京製鐵	73,000	719.00	52,487,000
共英製鋼	16,900	1,310.00	22,139,000
大和工業	31,800	2,591.00	82,393,800
東京鐵鋼	6,200	1,557.00	9,653,400
大阪製鐵	8,000	1,042.00	8,336,000
淀川製鋼所	20,300	1,847.00	37,494,100
丸一鋼管	48,600	2,805.00	136,323,000
モリ工業	4,500	2,212.00	9,954,000
大同特殊鋼	24,500	3,390.00	83,055,000
日本高周波鋼業	5,700	337.00	1,920,900
日本冶金工業	12,400	1,563.00	19,381,200
山陽特殊製鋼	10,300	942.00	9,702,600
愛知製鋼	8,400	2,536.00	21,302,400
日立金属	161,400	1,634.00	263,727,600
日本金属	3,500	623.00	2,180,500
大平洋金属	10,200	1,819.00	18,553,800
新日本電工	96,900	211.00	20,445,900
栗本鐵工所	7,400	1,844.00	13,645,600
虹技	2,300	1,302.00	2,994,600

三菱製鋼	11,200	560.00	6,272,000
日亜鋼業	22,100	272.00	6,011,200
日本精線	2,500	3,300.00	8,250,000
エンビプロ・ホールディングス	6,500	543.00	3,529,500
シンニッタン	23,600	213.00	5,026,800
新家工業	3,500	1,040.00	3,640,000
大紀アルミニウム工業所	24,900	543.00	13,520,700
日本軽金属ホールディングス	379,700	191.00	72,522,700
三井金属鉱業	40,500	2,711.00	109,795,500
東邦亜鉛	7,700	1,992.00	15,338,400
三菱マテリアル	99,000	2,263.00	224,037,000
住友金属鉱山	191,500	3,444.00	659,526,000
D O W Aホールディングス	37,900	3,345.00	126,775,500
古河機械金属	26,800	1,087.00	29,131,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,700	965.00	15,150,500
東邦チタニウム	27,000	708.00	19,116,000
U A C J	22,800	2,058.00	46,922,400
C Kサンエツ	3,200	3,295.00	10,544,000
古河電気工業	46,600	2,498.00	116,406,800
住友電気工業	560,100	1,233.50	690,883,350
フジクラ	180,900	309.00	55,898,100
昭和電線ホールディングス	17,500	1,105.00	19,337,500
東京特殊電線	2,300	2,300.00	5,290,000
タツタ電線	29,900	617.00	18,448,300
カナレ電気	2,600	1,640.00	4,264,000
平河ヒューテック	7,600	932.00	7,083,200
リョービ	18,500	1,171.00	21,663,500
アーレスティ	20,000	332.00	6,640,000
アサヒホールディングス	26,300	3,515.00	92,444,500
稲葉製作所	8,400	1,323.00	11,113,200
宮地エンジニアリンググループ	4,600	1,600.00	7,360,000
トーカロ	41,600	1,063.00	44,220,800
アルファC o	5,300	929.00	4,923,700
S U M C O	191,700	1,415.00	271,255,500
川田テクノロジーズ	3,100	4,925.00	15,267,500
R S Technologies	4,900	3,150.00	15,435,000
信和	8,600	700.00	6,020,000
東洋製罐グループホールディングス	95,400	1,167.00	111,331,800
ホッカンホールディングス	8,200	1,472.00	12,070,400
コロナ	8,300	1,011.00	8,391,300
横河ブリッジホールディングス	27,900	1,930.00	53,847,000
駒井ハルテック	2,800	1,428.00	3,998,400

高田機工	1,400	2,411.00	3,375,400
三和ホールディングス	141,200	1,140.00	160,968,000
文化シャッター	44,100	755.00	33,295,500
三協立山	19,300	931.00	17,968,300
アルインコ	10,900	918.00	10,006,200
東洋シャッター	3,600	739.00	2,660,400
L I X I Lグループ	221,000	1,979.00	437,359,000
日本フィルコン	10,400	550.00	5,720,000
ノーリツ	31,100	1,341.00	41,705,100
長府製作所	15,200	2,067.00	31,418,400
リンナイ	29,100	9,510.00	276,741,000
ダイニチ工業	8,100	687.00	5,564,700
日東精工	18,800	441.00	8,290,800
三洋工業	2,000	1,918.00	3,836,000
岡部	30,400	789.00	23,985,600
ジーテクト	18,600	1,255.00	23,343,000
東プレ	27,900	1,226.00	34,205,400
高周波熱錬	28,800	502.00	14,457,600
東京製網	10,700	530.00	5,671,000
サンコール	11,200	431.00	4,827,200
モリテック スチール	11,700	285.00	3,334,500
パイオラックス	22,200	1,584.00	35,164,800
エイチワン	14,700	552.00	8,114,400
日本発條	160,700	685.00	110,079,500
中央発條	1,800	2,660.00	4,788,000
アドバネクス	2,100	1,397.00	2,933,700
立川ブラインド工業	6,600	1,226.00	8,091,600
三益半導体工業	11,700	2,140.00	25,038,000
日本ドライケミカル	3,800	1,537.00	5,840,600
日本製鋼所	45,600	1,537.00	70,087,200
三浦工業	64,800	4,210.00	272,808,000
タクマ	50,800	1,657.00	84,175,600
ツガミ	31,200	1,180.00	36,816,000
オークマ	17,500	5,250.00	91,875,000
芝浦機械	17,000	2,185.00	37,145,000
アマダ	185,900	989.00	183,855,100
アイダエンジニアリング	39,400	695.00	27,383,000
滝澤鉄工所	4,700	1,011.00	4,751,700
F U J I	64,400	1,879.00	121,007,600
牧野フライス製作所	17,600	3,830.00	67,408,000
オーエスジー	74,000	1,643.00	121,582,000
ダイジェット工業	1,800	1,400.00	2,520,000

旭ダイヤモンド工業	39,600	509.00	20,156,400
D M G 森精機	94,900	1,510.00	143,299,000
ソディック	32,700	733.00	23,969,100
ディスコ	20,300	23,610.00	479,283,000
日東工器	8,200	1,996.00	16,367,200
日進工具	5,900	2,267.00	13,375,300
パンチ工業	13,700	410.00	5,617,000
富士ダイス	6,700	647.00	4,334,900
豊和工業	8,500	828.00	7,038,000
O K K	6,100	370.00	2,257,000
東洋機械金属	10,900	402.00	4,381,800
津田駒工業	2,900	777.00	2,253,300
エンシュウ	3,800	920.00	3,496,000
島精機製作所	23,700	1,552.00	36,782,400
オプトラン	18,800	2,089.00	39,273,200
N C ホールディングス	4,600	593.00	2,727,800
イワキポンプ	9,600	933.00	8,956,800
フリー	14,700	1,036.00	15,229,200
ヤマシンフィルタ	32,600	1,205.00	39,283,000
日阪製作所	18,600	805.00	14,973,000
やまびこ	29,100	1,205.00	35,065,500
平田機工	7,100	5,820.00	41,322,000
ペガサスミシン製造	15,400	283.00	4,358,200
マルマエ	5,600	886.00	4,961,600
タツモ	6,400	1,343.00	8,595,200
ナプテスコ	88,300	3,375.00	298,012,500
三井海洋開発	16,000	1,779.00	28,464,000
レオン自動機	14,800	1,083.00	16,028,400
S M C	47,500	57,710.00	2,741,225,000
ホソカワミクロン	5,300	5,540.00	29,362,000
ユニオンツール	5,600	2,781.00	15,573,600
オイレス工業	19,400	1,430.00	27,742,000
日精エー・エス・ビー機械	4,300	4,010.00	17,243,000
サトーホールディングス	21,400	2,032.00	43,484,800
技研製作所	13,200	3,825.00	50,490,000
日本エアーテック	4,900	1,299.00	6,365,100
カワタ	4,500	894.00	4,023,000
日精樹脂工業	12,800	862.00	11,033,600
オカダアイヨン	4,800	980.00	4,704,000
ワイエイシイホールディングス	6,400	641.00	4,102,400
小松製作所	686,100	2,326.50	1,596,211,650
住友重機械工業	86,800	2,394.00	207,799,200

日立建機	60,700	3,715.00	225,500,500
日工	20,900	641.00	13,396,900
巴工業	6,000	1,883.00	11,298,000
井関農機	15,300	1,275.00	19,507,500
TOWA	15,400	1,066.00	16,416,400
丸山製作所	3,200	1,266.00	4,051,200
北川鉄工所	6,900	1,403.00	9,680,700
ローツェ	6,700	4,630.00	31,021,000
タカキタ	5,400	661.00	3,569,400
クボタ	803,600	1,929.00	1,550,144,400
荏原実業	3,800	2,804.00	10,655,200
三菱化工機	5,300	1,724.00	9,137,200
月島機械	28,000	1,186.00	33,208,000
帝国電機製作所	12,500	1,114.00	13,925,000
新東工業	36,200	694.00	25,122,800
澁谷工業	13,300	3,210.00	42,693,000
アイチ コーポレーション	26,400	825.00	21,780,000
小森コーポレーション	38,600	721.00	27,830,600
鶴見製作所	11,700	1,834.00	21,457,800
住友精密工業	2,300	2,295.00	5,278,500
日本ギア工業	6,300	278.00	1,751,400
酒井重工業	2,900	2,340.00	6,786,000
荏原製作所	62,800	2,695.00	169,246,000
石井鐵工所	2,000	2,605.00	5,210,000
西島製作所	15,500	825.00	12,787,500
北越工業	15,700	1,037.00	16,280,900
ダイキン工業	193,000	19,900.00	3,840,700,000
オルガノ	5,500	5,520.00	30,360,000
トーヨーカネツ	6,600	2,237.00	14,764,200
栗田工業	82,000	3,330.00	273,060,000
椿本チエイン	21,700	2,384.00	51,732,800
大同工業	7,500	574.00	4,305,000
木村化工機	13,000	411.00	5,343,000
アネスト岩田	23,600	820.00	19,352,000
ダイフク	77,400	9,220.00	713,628,000
サムコ	3,800	2,583.00	9,815,400
加藤製作所	8,400	1,118.00	9,391,200
油研工業	2,700	1,455.00	3,928,500
タダノ	73,300	839.00	61,498,700
フジテック	55,100	2,173.00	119,732,300
C K D	41,600	1,495.00	62,192,000
キトー	11,500	1,183.00	13,604,500

平和	42,300	1,805.00	76,351,500
理想科学工業	13,400	1,421.00	19,041,400
SANKYO	33,700	2,979.00	100,392,300
日本金銭機械	16,900	537.00	9,075,300
マースグループホールディングス	9,700	1,654.00	16,043,800
フクシマガリレイ	9,400	3,375.00	31,725,000
オーイズミ	6,600	366.00	2,415,600
ダイコク電機	7,000	1,025.00	7,175,000
竹内製作所	25,400	2,245.00	57,023,000
アマノ	39,700	2,247.00	89,205,900
JUKI	21,100	454.00	9,579,400
蛇の目マシン工業	13,900	631.00	8,770,900
マックス	23,200	1,575.00	36,540,000
グローリー	38,900	2,325.00	90,442,500
新晃工業	14,100	1,382.00	19,486,200
大和冷機工業	24,400	895.00	21,838,000
セガサミーホールディングス	150,300	1,196.00	179,758,800
日本ピストンリング	5,600	1,045.00	5,852,000
リケン	7,000	2,677.00	18,739,000
T P R	20,400	1,366.00	27,866,400
ツバキ・ナカシマ	29,100	898.00	26,131,800
ホシザキ	47,700	7,980.00	380,646,000
大豊工業	12,500	534.00	6,675,000
日本精工	285,200	853.00	243,275,600
NTN	350,500	210.00	73,605,000
ジェイテクト	145,400	865.00	125,771,000
不二越	14,100	3,490.00	49,209,000
日本トムソン	45,100	378.00	17,047,800
THK	94,400	2,553.00	241,003,200
ユーシン精機	11,800	680.00	8,024,000
前澤給装工業	5,500	2,095.00	11,522,500
イーグル工業	18,800	786.00	14,776,800
前澤工業	10,200	468.00	4,773,600
日本ピラー工業	15,400	1,473.00	22,684,200
キッツ	61,500	610.00	37,515,000
マキタ	197,500	4,935.00	974,662,500
日立造船	120,500	423.00	50,971,500
三菱重工業	253,900	2,605.00	661,409,500
I H I	109,200	1,572.00	171,662,400
スター精密	23,400	1,349.00	31,566,600
日清紡ホールディングス	92,800	724.00	67,187,200
イビデン	92,900	3,485.00	323,756,500

コニカミノルタ	332,900	329.00	109,524,100
ブラザー工業	185,300	1,712.00	317,233,600
ミネベアミツミ	281,500	1,881.00	529,501,500
日立製作所	727,800	3,565.00	2,594,607,000
三菱電機	1,514,700	1,467.50	2,222,822,250
富士電機	91,300	3,385.00	309,050,500
東洋電機製造	5,600	1,064.00	5,958,400
安川電機	163,100	3,955.00	645,060,500
シンフォニアテクノロジー	19,700	1,096.00	21,591,200
明電舎	27,900	1,633.00	45,560,700
オリジン	4,200	1,314.00	5,518,800
山洋電気	7,500	4,690.00	35,175,000
デンヨー	13,000	2,183.00	28,379,000
東芝テック	19,000	4,545.00	86,355,000
芝浦メカトロニクス	2,900	2,989.00	8,668,100
マブチモーター	42,100	3,680.00	154,928,000
日本電産	364,600	8,896.00	3,243,481,600
トレックス・セミコンダクター	9,300	1,149.00	10,685,700
東光高岳	9,100	998.00	9,081,800
ダイヘン	16,600	3,960.00	65,736,000
ヤーマン	25,100	1,455.00	36,520,500
JVCケンウッド	127,600	160.00	20,416,000
ミマキエンジニアリング	15,300	390.00	5,967,000
I - P E X	7,400	2,153.00	15,932,200
日新電機	35,600	1,106.00	39,373,600
大崎電気工業	30,400	581.00	17,662,400
オムロン	135,800	7,920.00	1,075,536,000
日東工業	22,300	1,908.00	42,548,400
I D E C	21,900	1,826.00	39,989,400
正興電機製作所	4,200	975.00	4,095,000
不二電機工業	3,000	1,320.00	3,960,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	50,900	1,768.00	89,991,200
サクサホールディングス	3,600	1,390.00	5,004,000
メルコホールディングス	5,500	2,504.00	13,772,000
テクノメディカ	3,800	1,748.00	6,642,400
日本電気	183,800	5,270.00	968,626,000
富士通	146,000	13,490.00	1,969,540,000
沖電気工業	61,600	998.00	61,476,800
岩崎通信機	6,600	836.00	5,517,600
電気興業	7,300	2,411.00	17,600,300
サンケン電気	16,600	2,245.00	37,267,000
ナカヨ	3,000	1,364.00	4,092,000

アイホン	8,700	1,337.00	11,631,900
ルネサスエレクトロニクス	648,400	689.00	446,747,600
セイコーエプソン	188,000	1,251.00	235,188,000
ワコム	102,700	677.00	69,527,900
アルバック	27,900	3,860.00	107,694,000
アクセル	7,100	862.00	6,120,200
E I Z O	11,800	3,870.00	45,666,000
日本信号	38,700	1,023.00	39,590,100
京三製作所	35,700	487.00	17,385,900
能美防災	20,300	2,100.00	42,630,000
ホーチキ	11,500	1,190.00	13,685,000
星和電機	8,600	575.00	4,945,000
エレコム	17,300	4,880.00	84,424,000
パナソニック	1,730,600	951.50	1,646,665,900
シャープ	175,400	1,373.00	240,824,200
アンリツ	97,600	2,255.00	220,088,000
富士通ゼネラル	41,200	2,861.00	117,873,200
ソニー	948,800	8,198.00	7,778,262,400
T D K	73,200	11,350.00	830,820,000
帝国通信工業	7,200	1,178.00	8,481,600
タムラ製作所	50,800	535.00	27,178,000
アルプスアルパイン	134,400	1,652.00	222,028,800
池上通信機	4,800	802.00	3,849,600
鈴木	8,400	672.00	5,644,800
日本トリム	2,200	3,815.00	8,393,000
ローランド ディー . ジー .	9,400	1,315.00	12,361,000
フォスター電機	16,000	1,200.00	19,200,000
S M K	3,900	2,578.00	10,054,200
ヨコオ	10,100	2,635.00	26,613,500
ホシデン	42,100	916.00	38,563,600
ヒロセ電機	23,300	12,270.00	285,891,000
日本航空電子工業	34,800	1,366.00	47,536,800
T O A	16,400	768.00	12,595,200
マクセルホールディングス	33,200	1,072.00	35,590,400
古野電気	20,200	945.00	19,089,000
ユニデンホールディングス	4,200	1,551.00	6,514,200
スミダコーポレーション	13,900	651.00	9,048,900
アイコム	8,400	2,659.00	22,335,600
リオン	6,700	2,236.00	14,981,200
本多通信工業	14,500	435.00	6,307,500
横河電機	139,000	1,755.00	243,945,000
新電元工業	5,400	2,012.00	10,864,800

アズビル	95,600	3,380.00	323,128,000
東亜ディーケーケー	8,300	850.00	7,055,000
日本光電工業	62,800	3,480.00	218,544,000
チノー	5,300	1,335.00	7,075,500
共和電業	16,100	419.00	6,745,900
日本電子材料	6,000	2,132.00	12,792,000
堀場製作所	30,000	5,820.00	174,600,000
アドバンテスト	112,600	5,020.00	565,252,000
小野測器	7,700	490.00	3,773,000
エスベック	13,800	1,780.00	24,564,000
キーエンス	137,200	43,470.00	5,964,084,000
日置電機	7,400	3,715.00	27,491,000
シスメックス	108,300	9,137.00	989,537,100
日本マイクロニクス	26,900	1,059.00	28,487,100
メガチップス	14,400	2,163.00	31,147,200
O B A R A G R O U P	9,000	3,665.00	32,985,000
澤藤電機	2,200	1,636.00	3,599,200
原田工業	7,900	863.00	6,817,700
コーセル	20,900	866.00	18,099,400
イリソ電子工業	12,900	4,125.00	53,212,500
オブテックスグループ	25,300	1,353.00	34,230,900
千代田インテグレ	6,800	1,568.00	10,662,400
アイ・オー・データ機器	5,500	1,006.00	5,533,000
レーザーテック	66,600	7,690.00	512,154,000
スタンレー電気	106,400	3,050.00	324,520,000
岩崎電気	6,300	1,415.00	8,914,500
ウシオ電機	84,100	1,359.00	114,291,900
岡谷電機産業	14,100	328.00	4,624,800
ハリオス テクノ ホールディング	16,200	291.00	4,714,200
エノモト	5,200	994.00	5,168,800
日本セラミック	15,600	2,523.00	39,358,800
遠藤照明	8,700	629.00	5,472,300
古河電池	11,400	1,059.00	12,072,600
双信電機	8,900	413.00	3,675,700
山一電機	11,400	1,377.00	15,697,800
図研	10,100	2,532.00	25,573,200
日本電子	30,100	2,946.00	88,674,600
カシオ計算機	134,100	1,763.00	236,418,300
ファナック	142,400	20,640.00	2,939,136,000
日本シイエムケイ	37,000	474.00	17,538,000
エンプラス	8,000	2,153.00	17,224,000
大真空	5,900	1,677.00	9,894,300

ローム	63,100	7,110.00	448,641,000
浜松ホトニクス	108,800	4,905.00	533,664,000
三井ハイテック	17,100	1,647.00	28,163,700
新光電気工業	51,300	1,578.00	80,951,400
京セラ	213,200	6,115.00	1,303,718,000
太陽誘電	67,600	2,984.00	201,718,400
村田製作所	445,000	6,507.00	2,895,615,000
双葉電子工業	24,700	852.00	21,044,400
北陸電気工業	6,800	893.00	6,072,400
ニチコン	52,200	783.00	40,872,600
日本ケミコン	11,500	1,448.00	16,652,000
K O A	23,500	1,060.00	24,910,000
市光工業	24,000	483.00	11,592,000
小糸製作所	90,900	5,350.00	486,315,000
ミツバ	27,900	377.00	10,518,300
S C R E E Nホールディングス	26,300	5,180.00	136,234,000
キャノン電子	14,300	1,451.00	20,749,300
キャノン	752,700	1,750.00	1,317,225,000
リコー	385,500	777.00	299,533,500
象印マホービン	41,400	1,576.00	65,246,400
M U T O Hホールディングス	2,300	1,508.00	3,468,400
東京エレクトロン	96,100	26,400.00	2,537,040,000
トヨタ紡織	44,200	1,507.00	66,609,400
芦森工業	3,200	899.00	2,876,800
ユニプレス	29,400	895.00	26,313,000
豊田自動織機	122,600	6,330.00	776,058,000
モリタホールディングス	26,500	1,864.00	49,396,000
三櫻工業	19,300	644.00	12,429,200
デンソー	333,500	4,493.00	1,498,415,500
東海理化電機製作所	39,900	1,560.00	62,244,000
三井E & Sホールディングス	54,700	425.00	23,247,500
川崎重工業	117,900	1,490.00	175,671,000
名村造船所	48,700	154.00	7,499,800
日本車輛製造	5,500	2,580.00	14,190,000
三菱ロジスネクスト	20,000	987.00	19,740,000
近畿車輛	2,300	1,237.00	2,845,100
日産自動車	1,786,300	419.90	750,067,370
いすゞ自動車	438,900	1,024.50	449,653,050
トヨタ自動車	1,690,000	6,966.00	11,772,540,000
日野自動車	189,100	700.00	132,370,000
三菱自動車工業	560,600	258.00	144,634,800
エフテック	10,700	500.00	5,350,000

レシップホールディングス	5,900	581.00	3,427,900
G M B	2,800	625.00	1,750,000
ファルテック	2,800	601.00	1,682,800
武蔵精密工業	33,800	1,091.00	36,875,800
日産車体	29,600	983.00	29,096,800
新明和工業	40,800	921.00	37,576,800
極東開発工業	28,100	1,270.00	35,687,000
日信工業	30,800	2,246.00	69,176,800
トピー工業	12,500	1,149.00	14,362,500
ティラド	5,600	1,261.00	7,061,600
曙ブレーキ工業	83,100	163.00	13,545,300
タチエス	24,900	878.00	21,862,200
N O K	81,500	1,154.00	94,051,000
フタバ産業	42,300	548.00	23,180,400
K Y B	17,000	2,122.00	36,074,000
大同メタル工業	29,200	522.00	15,242,400
プレス工業	75,300	303.00	22,815,900
ミクニ	19,500	264.00	5,148,000
太平洋工業	31,800	1,048.00	33,326,400
ケーヒン	34,800	2,595.00	90,306,000
河西工業	20,600	374.00	7,704,400
アイシン精機	124,700	3,645.00	454,531,500
マツダ	445,700	680.00	303,076,000
今仙電機製作所	14,200	641.00	9,102,200
本田技研工業	1,192,500	2,743.50	3,271,623,750
スズキ	300,200	4,668.00	1,401,333,600
S U B A R U	470,200	2,247.50	1,056,774,500
安永	7,400	1,033.00	7,644,200
ヤマハ発動機	214,000	1,700.00	363,800,000
ショーワ	35,800	2,295.00	82,161,000
T B K	18,200	414.00	7,534,800
エクセディ	20,600	1,421.00	29,272,600
豊田合成	48,900	2,376.00	116,186,400
愛三工業	23,900	472.00	11,280,800
盟和産業	2,400	897.00	2,152,800
日本プラスト	12,000	438.00	5,256,000
ヨロズ	14,200	1,000.00	14,200,000
エフ・シー・シー	24,800	2,083.00	51,658,400
シマノ	56,700	21,790.00	1,235,493,000
テイ・エス テック	35,200	3,235.00	113,872,000
ジャムコ	7,700	685.00	5,274,500
テルモ	428,600	4,295.00	1,840,837,000

クリエートメディック	5,000	993.00	4,965,000
日機装	48,900	1,077.00	52,665,300
日本エム・ディ・エム	8,700	2,060.00	17,922,000
島津製作所	181,000	3,300.00	597,300,000
JMS	12,800	869.00	11,123,200
長野計器	11,000	842.00	9,262,000
ブイ・テクノロジー	7,100	3,935.00	27,938,500
東京計器	9,700	921.00	8,933,700
愛知時計電機	2,000	4,405.00	8,810,000
インターアクション	8,100	1,780.00	14,418,000
オーバル	13,700	219.00	3,000,300
東京精密	27,500	3,175.00	87,312,500
マニー	60,300	2,709.00	163,352,700
ニコン	231,300	783.00	181,107,900
トプコン	76,300	929.00	70,882,700
オリンパス	838,100	2,051.50	1,719,362,150
理研計器	13,400	2,525.00	33,835,000
タムロン	12,200	1,701.00	20,752,200
HOYA	300,500	10,500.00	3,155,250,000
シード	6,500	701.00	4,556,500
ノーリツ鋼機	10,200	1,522.00	15,524,400
エー・アンド・デイ	13,900	646.00	8,979,400
朝日インテック	171,600	3,055.00	524,238,000
シチズン時計	177,500	322.00	57,155,000
リズム時計工業	4,800	625.00	3,000,000
大研医器	10,600	548.00	5,808,800
メニコン	21,500	6,580.00	141,470,000
シンシア	1,700	391.00	664,700
松風	6,800	1,437.00	9,771,600
セイコーホールディングス	21,400	1,508.00	32,271,200
ニプロ	104,900	1,211.00	127,033,900
中本パックス	3,800	1,508.00	5,730,400
スノーピーク	9,000	1,603.00	14,427,000
パラマウントベッドホールディングス	16,000	4,210.00	67,360,000
トランザクション	8,300	1,128.00	9,362,400
粧美堂	4,400	392.00	1,724,800
ニホンフラッシュ	14,100	1,395.00	19,669,500
前田工織	16,700	2,534.00	42,317,800
永大産業	19,800	294.00	5,821,200
アートネイチャー	16,200	614.00	9,946,800
バンダイナムコホールディングス	156,600	6,609.00	1,034,969,400
アイフィスジャパン	3,900	772.00	3,010,800

共立印刷	25,300	132.00	3,339,600	
SHOEI	13,300	3,185.00	42,360,500	
フランスベッドホールディングス	21,400	866.00	18,532,400	
パイロットコーポレーション	26,800	3,085.00	82,678,000	
萩原工業	8,400	1,489.00	12,507,600	
トッパン・フォームズ	32,400	965.00	31,266,000	
フジシールインターナショナル	33,900	1,891.00	64,104,900	
タカラトミー	67,900	845.00	57,375,500	
廣済堂	10,500	671.00	7,045,500	
エステールホールディングス	4,000	642.00	2,568,000	
タカノ	5,900	620.00	3,658,000	
プロネクサス	13,000	1,093.00	14,209,000	
ホクシン	9,300	112.00	1,041,600	
ウッドワン	5,100	1,181.00	6,023,100	
大建工業	10,200	1,712.00	17,462,400	
凸版印刷	213,800	1,525.00	326,045,000	
大日本印刷	198,200	2,147.00	425,535,400	
共同印刷	4,700	2,583.00	12,140,100	
NISSHA	31,100	1,197.00	37,226,700	
光村印刷	1,300	1,589.00	2,065,700	
TAKARA & COMPANY	7,300	2,770.00	20,221,000	
アシックス	133,900	1,496.00	200,314,400	
ツツミ	4,700	2,028.00	9,531,600	
小松ウオール工業	4,600	1,732.00	7,967,200	
ヤマハ	90,100	5,000.00	450,500,000	
河合楽器製作所	4,700	2,664.00	12,520,800	
クリナップ	14,100	507.00	7,148,700	
ピジョン	97,300	4,855.00	472,391,500	
オリバー	3,200	2,453.00	7,849,600	
兼松サステック	1,000	1,614.00	1,614,000	
キングジム	12,600	895.00	11,277,000	
リンテック	36,000	2,483.00	89,388,000	
イトーキ	30,100	358.00	10,775,800	
任天堂	92,900	58,950.00	5,476,455,000	
三菱鉛筆	24,900	1,275.00	31,747,500	
タカラスタANDARD	31,300	1,301.00	40,721,300	
コクヨ	72,600	1,225.00	88,935,000	
ナカバヤシ	14,900	625.00	9,312,500	
グローブライド	6,800	3,210.00	21,828,000	
オカムラ	52,900	742.00	39,251,800	
美津濃	13,700	1,938.00	26,550,600	
東京電力ホールディングス	1,209,100	310.00	374,821,000	

中部電力	463,400	1,303.00	603,810,200
関西電力	573,900	1,047.50	601,160,250
中国電力	218,500	1,293.00	282,520,500
北陸電力	138,500	761.00	105,398,500
東北電力	378,400	1,067.00	403,752,800
四国電力	136,400	801.00	109,256,400
九州電力	312,200	946.00	295,341,200
北海道電力	141,700	450.00	63,765,000
沖縄電力	29,400	1,669.00	49,068,600
電源開発	120,500	1,600.00	192,800,000
エフオン	8,100	644.00	5,216,400
イーレックス	21,600	1,267.00	27,367,200
レノバ	25,300	1,158.00	29,297,400
東京瓦斯	291,300	2,330.50	678,874,650
大阪瓦斯	293,900	2,028.00	596,029,200
東邦瓦斯	74,500	4,520.00	336,740,000
北海道瓦斯	8,100	1,585.00	12,838,500
広島ガス	31,200	359.00	11,200,800
西部瓦斯	17,100	2,488.00	42,544,800
静岡ガス	43,000	876.00	37,668,000
メタウォーター	7,300	4,550.00	33,215,000
SBSホールディングス	11,200	1,993.00	22,321,600
東武鉄道	157,900	3,345.00	528,175,500
相鉄ホールディングス	48,500	2,920.00	141,620,000
東急	382,000	1,423.00	543,586,000
京浜急行電鉄	194,500	1,601.00	311,394,500
小田急電鉄	225,300	2,601.00	586,005,300
京王電鉄	78,600	6,450.00	506,970,000
京成電鉄	105,400	3,100.00	326,740,000
富士急行	20,600	3,520.00	72,512,000
新京成電鉄	3,900	2,255.00	8,794,500
東日本旅客鉄道	266,600	6,866.00	1,830,475,600
西日本旅客鉄道	135,000	5,614.00	757,890,000
東海旅客鉄道	125,900	15,815.00	1,991,108,500
西武ホールディングス	197,700	1,257.00	248,508,900
鴻池運輸	24,100	1,099.00	26,485,900
西日本鉄道	42,000	3,020.00	126,840,000
ハマキョウレックス	11,600	3,365.00	39,034,000
サカイ引越センター	8,000	4,800.00	38,400,000
近鉄グループホールディングス	143,500	4,690.00	673,015,000
阪急阪神ホールディングス	191,300	3,445.00	659,028,500
南海電気鉄道	68,000	2,331.00	158,508,000

京阪ホールディングス	63,900	4,575.00	292,342,500
神戸電鉄	3,400	3,730.00	12,682,000
名古屋鉄道	117,900	2,976.00	350,870,400
山陽電気鉄道	10,200	2,088.00	21,297,600
日本通運	49,700	6,190.00	307,643,000
ヤマトホールディングス	251,500	2,725.00	685,337,500
山九	39,900	4,320.00	172,368,000
丸運	8,200	232.00	1,902,400
丸全昭和運輸	11,600	3,295.00	38,222,000
センコーグループホールディングス	79,100	943.00	74,591,300
トナミホールディングス	3,400	5,760.00	19,584,000
ニッコンホールディングス	51,300	2,253.00	115,578,900
日本石油輸送	1,600	2,640.00	4,224,000
福山通運	18,400	5,110.00	94,024,000
セイノーホールディングス	107,400	1,492.00	160,240,800
エスライン	4,300	926.00	3,981,800
神奈川中央交通	3,600	4,005.00	14,418,000
日立物流	26,300	3,640.00	95,732,000
丸和運輸機関	15,100	3,985.00	60,173,500
C & F ロジホールディングス	14,500	1,570.00	22,765,000
九州旅客鉄道	125,700	2,346.00	294,892,200
S Gホールディングス	150,600	4,825.00	726,645,000
日本郵船	120,500	1,700.00	204,850,000
商船三井	91,300	2,014.00	183,878,200
川崎汽船	44,200	1,162.00	51,360,400
N S ユナイテッド海運	8,600	1,424.00	12,246,400
飯野海運	70,700	353.00	24,957,100
共栄タンカー	3,800	770.00	2,926,000
乾汽船	8,300	814.00	6,756,200
日本航空	253,700	2,224.00	564,228,800
A N Aホールディングス	262,200	2,709.50	710,430,900
パスコ	2,800	1,380.00	3,864,000
トランコム	4,000	7,070.00	28,280,000
日新	12,400	1,542.00	19,120,800
三菱倉庫	45,500	3,180.00	144,690,000
三井倉庫ホールディングス	16,400	1,787.00	29,306,800
住友倉庫	51,600	1,310.00	67,596,000
澁澤倉庫	7,900	1,994.00	15,752,600
東陽倉庫	25,900	318.00	8,236,200
日本トランスシティ	31,600	503.00	15,894,800
ケイヒン	2,800	1,290.00	3,612,000
中央倉庫	8,700	1,030.00	8,961,000

川西倉庫	2,600	1,115.00	2,899,000
安田倉庫	11,800	934.00	11,021,200
ファイブホールディングス	3,100	1,094.00	3,391,400
東洋埠頭	4,400	1,409.00	6,199,600
宇徳	12,300	470.00	5,781,000
上組	80,000	2,127.00	170,160,000
サンリツ	3,400	612.00	2,080,800
キムラユニティー	3,800	1,074.00	4,081,200
キューソー流通システム	3,600	1,505.00	5,418,000
近鉄エクスプレス	30,500	2,151.00	65,605,500
東海運	8,200	285.00	2,337,000
エーアイティー	10,100	996.00	10,059,600
内外トランスライン	5,000	1,131.00	5,655,000
日本コンセプト	4,600	1,315.00	6,049,000
N E C ネットズエスアイ	42,300	1,870.00	79,101,000
クロスキャット	4,300	1,276.00	5,486,800
システナ	53,200	1,743.00	92,727,600
デジタルアーツ	7,400	7,760.00	57,424,000
日鉄ソリューションズ	22,400	3,055.00	68,432,000
キューブシステム	8,300	1,159.00	9,619,700
エイジア	2,900	2,015.00	5,843,500
コア	6,600	1,337.00	8,824,200
ラクーンホールディングス	7,300	1,929.00	14,081,700
ソリトンシステムズ	7,700	1,809.00	13,929,300
ソフトクリエイトホールディングス	6,600	2,628.00	17,344,800
T I S	148,800	2,062.00	306,825,600
J N S ホールディングス	5,900	627.00	3,699,300
電算システム	5,300	3,650.00	19,345,000
グリー	92,000	449.00	41,308,000
コーエーテクモホールディングス	30,500	4,095.00	124,897,500
三菱総合研究所	6,500	4,035.00	26,227,500
電算	1,800	2,204.00	3,967,200
A G S	8,900	825.00	7,342,500
ファインデックス	12,800	1,311.00	16,780,800
ブレインパッド	3,900	3,995.00	15,580,500
K L a b	27,000	915.00	24,705,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	18,300	947.00	17,330,100
イーブックイニシアティブジャパン	2,300	3,145.00	7,233,500
ネクソン	374,600	2,506.00	938,747,600
アイスタイル	42,900	304.00	13,041,600
エムアップホールディングス	4,400	3,535.00	15,554,000
エイチーム	10,700	932.00	9,972,400

エニグモ	14,300	1,533.00	21,921,900
テクノスジャパン	12,100	781.00	9,450,100
コロプラ	49,200	950.00	46,740,000
ブロードリーフ	74,500	505.00	37,622,500
クロス・マーケティンググループ	7,800	330.00	2,574,000
デジタルハーツホールディングス	8,300	1,004.00	8,333,200
システム情報	11,500	1,222.00	14,053,000
メディアドゥ	4,800	6,900.00	33,120,000
じげん	38,000	356.00	13,528,000
エンカレッジ・テクノロジー	3,800	841.00	3,195,800
サイバーリンクス	2,600	1,876.00	4,877,600
フィックスターズ	16,200	1,023.00	16,572,600
CARTA HOLDINGS	6,400	1,166.00	7,462,400
オブティム	7,900	2,856.00	22,562,400
セレス	5,100	1,851.00	9,440,100
SHIFT	6,000	12,330.00	73,980,000
ティーガイア	13,400	2,055.00	27,537,000
セック	2,300	3,055.00	7,026,500
日本アジアグループ	15,700	292.00	4,584,400
テクマトリックス	21,100	2,122.00	44,774,200
プロシップ	4,600	1,515.00	6,969,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,000	2,169.00	78,084,000
GMOペイメントゲートウェイ	31,500	10,340.00	325,710,000
ザッパラス	7,400	445.00	3,293,000
システムリサーチ	4,200	1,684.00	7,072,800
インターネットイニシアティブ	22,100	4,105.00	90,720,500
さくらインターネット	16,600	636.00	10,557,600
ヴィンクス	4,500	1,220.00	5,490,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	8,060.00	26,598,000
SRAホールディングス	8,100	2,349.00	19,026,900
システムインテグレータ	5,300	713.00	3,778,900
朝日ネット	11,000	901.00	9,911,000
eBASE	18,100	1,156.00	20,923,600
アバント	14,500	1,017.00	14,746,500
アドソル日進	5,400	2,503.00	13,516,200
フリービット	8,200	839.00	6,879,800
コムチュア	16,900	2,504.00	42,317,600
サイバーコム	2,900	1,846.00	5,353,400
アステリア	9,500	810.00	7,695,000
アイル	8,500	1,355.00	11,517,500
マークライنز	6,400	2,166.00	13,862,400
メディカル・データ・ビジョン	17,200	1,906.00	32,783,200

ショーケース	3,700	790.00	2,923,000
モバイルファクトリー	3,600	1,265.00	4,554,000
テラスカイ	5,400	4,595.00	24,813,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,200	1,214.00	7,526,800
P C Iホールディングス	6,000	1,149.00	6,894,000
パイプドHD	2,200	1,718.00	3,779,600
アイビーシー	2,800	929.00	2,601,200
ネオジャパン	2,900	2,845.00	8,250,500
P R T I M E S	2,700	2,326.00	6,280,200
ランドコンピュータ	2,700	1,036.00	2,797,200
ダブルスタンダード	2,000	4,500.00	9,000,000
オープンドア	7,700	1,366.00	10,518,200
マイネット	4,900	1,304.00	6,389,600
アカツキ	5,400	4,050.00	21,870,000
ベネフィットジャパン	1,300	1,838.00	2,389,400
U b i c o mホールディングス	3,500	1,923.00	6,730,500
L I N E	45,500	5,410.00	246,155,000
カナミックネットワーク	14,100	771.00	10,871,100
ノムラシステムコーポレーション	7,500	398.00	2,985,000
チェンジ	10,400	8,220.00	85,488,000
シンクロ・フード	7,500	335.00	2,512,500
オークネット	8,200	1,280.00	10,496,000
セグエグループ	4,100	1,186.00	4,862,600
エイトレッド	2,700	1,941.00	5,240,700
A O I T Y O H o l d i n g s	16,000	410.00	6,560,000
マクロミル	30,800	845.00	26,026,000
ビーグリー	3,200	1,537.00	4,918,400
オロ	4,800	2,999.00	14,395,200
ユーザーローカル	1,600	4,065.00	6,504,000
テモナ	3,400	1,517.00	5,157,800
ニーズウェル	3,400	732.00	2,488,800
サインポスト	3,400	1,306.00	4,440,400
ソルクシーズ	6,100	1,022.00	6,234,200
フェイス	5,600	1,032.00	5,779,200
プロトコーポレーション	13,600	1,207.00	16,415,200
ハイマックス	1,900	2,384.00	4,529,600
野村総合研究所	210,800	2,764.00	582,651,200
サイバネットシステム	11,000	850.00	9,350,000
C Eホールディングス	8,600	562.00	4,833,200
日本システム技術	2,600	1,748.00	4,544,800
インテージホールディングス	19,000	910.00	17,290,000
東邦システムサイエンス	4,300	968.00	4,162,400

ソースネクスト	71,900	297.00	21,354,300
インフォコム	16,400	3,620.00	59,368,000
HEROZ	2,200	3,630.00	7,986,000
ラクスル	12,100	3,145.00	38,054,500
F I G	17,800	238.00	4,236,400
システムサポート	3,600	1,606.00	5,781,600
イーソル	8,400	1,182.00	9,928,800
アルテリア・ネットワークス	16,700	1,797.00	30,009,900
東海ソフト	1,400	1,236.00	1,730,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,900	1,061.00	3,076,900
東名	1,100	1,287.00	1,415,700
ヴィッツ	700	3,305.00	2,313,500
トピラシステムズ	1,700	1,960.00	3,332,000
L i n k - U	1,200	2,087.00	2,504,400
フォーカスシステムズ	9,700	824.00	7,992,800
クレスコ	9,400	1,233.00	11,590,200
フジ・メディア・ホールディングス	143,600	1,038.00	149,056,800
オービック	51,500	18,410.00	948,115,000
ジャストシステム	24,200	7,240.00	175,208,000
T D C ソフト	13,400	927.00	12,421,800
Zホールディングス	2,041,700	658.00	1,343,438,600
トレンドマイクロ	79,400	6,480.00	514,512,000
I Dホールディングス	6,000	1,372.00	8,232,000
日本オラクル	30,200	11,730.00	354,246,000
アルファシステムズ	4,700	3,660.00	17,202,000
フューチャー	18,100	1,899.00	34,371,900
C A C H o l d i n g s	10,000	1,306.00	13,060,000
S Bテクノロジー	5,500	3,020.00	16,610,000
トーセ	4,500	892.00	4,014,000
オービックビジネスコンサルタント	15,200	6,130.00	93,176,000
伊藤忠テクノソリューションズ	67,800	3,755.00	254,589,000
アイティフォー	18,500	796.00	14,726,000
東計電算	2,300	4,425.00	10,177,500
エクスネット	2,800	968.00	2,710,400
大塚商会	80,500	5,050.00	406,525,000
サイボウズ	17,500	3,050.00	53,375,000
ソフトブレーン	12,100	866.00	10,478,600
電通国際情報サービス	9,300	5,840.00	54,312,000
A C C E S S	14,300	925.00	13,227,500
デジタルガレージ	26,900	3,180.00	85,542,000
E Mシステムズ	21,500	831.00	17,866,500
ウェザーニューズ	5,100	4,890.00	24,939,000

C I J	10,600	841.00	8,914,600
ビジネスエンジニアリング	1,800	2,968.00	5,342,400
日本エンタープライズ	16,400	315.00	5,166,000
WOWOW	7,300	2,776.00	20,264,800
スカラ	10,400	806.00	8,382,400
インテリジェント ウェイブ	9,200	767.00	7,056,400
I M A G I C A G R O U P	13,700	391.00	5,356,700
ネットワンシステムズ	56,700	4,060.00	230,202,000
システムソフト	36,400	93.00	3,385,200
アルゴグラフィックス	12,700	3,450.00	43,815,000
マーベラス	23,200	779.00	18,072,800
エイベックス	26,000	899.00	23,374,000
日本ユニシス	46,500	2,945.00	136,942,500
兼松エレクトロニクス	8,200	3,980.00	32,636,000
都築電気	4,900	1,581.00	7,746,900
東京放送ホールディングス	90,600	1,755.00	159,003,000
日本テレビホールディングス	124,400	1,197.00	148,906,800
朝日放送グループホールディングス	15,300	708.00	10,832,400
テレビ朝日ホールディングス	41,100	1,610.00	66,171,000
スカパーJ S A Tホールディングス	98,600	461.00	45,454,600
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,298.00	28,495,200
日本BS放送	5,400	1,084.00	5,853,600
ビジョン	18,900	884.00	16,707,600
スマートバリュー	4,300	1,069.00	4,596,700
ワイヤレスゲート	6,500	823.00	5,349,500
コネクシオ	8,700	1,232.00	10,718,400
クロップス	3,200	780.00	2,496,000
日本電信電話	1,986,900	2,370.50	4,709,946,450
K D D I	1,083,700	2,910.00	3,153,567,000
ソフトバンク	1,351,000	1,353.00	1,827,903,000
光通信	15,300	24,550.00	375,615,000
N T T ドコモ	1,062,900	2,825.00	3,002,692,500
エムティーアイ	14,900	673.00	10,027,700
G M O インターネット	53,400	2,651.00	141,563,400
ファイバーゲート	5,000	1,820.00	9,100,000
アйдママーケティングコミュニケーション	5,400	451.00	2,435,400
K A D O K A W A	40,200	2,475.00	99,495,000
学研ホールディングス	20,200	1,572.00	31,754,400
ゼンリン	30,000	1,140.00	34,200,000
昭文社ホールディングス	7,700	464.00	3,572,800
インプレスホールディングス	12,300	157.00	1,931,100
アイネット	7,900	1,518.00	11,992,200

松竹	9,900	14,320.00	141,768,000
東宝	87,800	4,105.00	360,419,000
東映	5,600	16,510.00	92,456,000
エヌ・ティ・ティ・データ	396,100	1,216.00	481,657,600
ピー・シー・エー	2,600	4,625.00	12,025,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,400	1,343.00	7,252,200
D T S	33,400	2,188.00	73,079,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	63,400	6,900.00	437,460,000
シーイーシー	16,200	1,549.00	25,093,800
カプコン	70,100	5,230.00	366,623,000
アイ・エス・ピー	3,300	2,350.00	7,755,000
ジャステック	9,800	1,294.00	12,681,200
S C S K	34,400	5,610.00	192,984,000
日本システムウエア	5,100	1,956.00	9,975,600
アイネス	14,900	1,460.00	21,754,000
T K C	12,600	5,960.00	75,096,000
富士ソフト	15,900	4,685.00	74,491,500
N S D	48,000	1,817.00	87,216,000
コナミホールディングス	54,100	4,205.00	227,490,500
福井コンピュータホールディングス	6,000	2,760.00	16,560,000
J B C Cホールディングス	10,300	1,627.00	16,758,100
ミロク情報サービス	13,300	2,163.00	28,767,900
ソフトバンクグループ	1,179,300	5,881.00	6,935,463,300
ハウスイ	1,200	918.00	1,101,600
高千穂交易	5,800	940.00	5,452,000
カワニシホールディングス	1,800	1,366.00	2,458,800
伊藤忠食品	3,700	5,300.00	19,610,000
エレマテック	14,000	895.00	12,530,000
J A L U X	4,200	1,595.00	6,699,000
あらた	11,900	5,100.00	60,690,000
トーメンデバイス	2,200	3,760.00	8,272,000
東京エレクトロン デバイス	5,400	2,906.00	15,692,400
フィールズ	11,400	328.00	3,739,200
双日	823,900	240.00	197,736,000
アルフレッサ ホールディングス	165,800	2,152.00	356,801,600
横浜冷凍	39,000	897.00	34,983,000
ラサ商事	7,900	941.00	7,433,900
アルコニックス	15,900	1,412.00	22,450,800
神戸物産	51,500	5,780.00	297,670,000
ハイパー	2,300	557.00	1,281,100
あい ホールディングス	21,300	1,793.00	38,190,900
ディービーエックス	5,300	900.00	4,770,000

ダイワボウホールディングス	12,700	6,170.00	78,359,000
マクニカ・富士エレホールディングス	35,600	1,837.00	65,397,200
ラクト・ジャパン	6,500	3,545.00	23,042,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,100	1,054.00	29,617,400
八洲電機	11,600	968.00	11,228,800
メディアスホールディングス	8,500	845.00	7,182,500
レスターホールディングス	15,600	2,027.00	31,621,200
ジューテックホールディングス	3,400	997.00	3,389,800
大光	6,400	681.00	4,358,400
OCHIホールディングス	4,300	1,504.00	6,467,200
TOKAIホールディングス	78,800	1,017.00	80,139,600
黒谷	4,100	500.00	2,050,000
Cominix	2,600	712.00	1,851,200
三洋貿易	15,000	1,023.00	15,345,000
ビューティガレージ	2,400	2,052.00	4,924,800
ウイン・パートナーズ	10,800	932.00	10,065,600
ミタチ産業	4,500	562.00	2,529,000
シップヘルスケアホールディングス	23,900	4,940.00	118,066,000
明治電機工業	4,700	1,343.00	6,312,100
デリカフーズホールディングス	5,300	682.00	3,614,600
スターティアホールディングス	3,400	608.00	2,067,200
コメダホールディングス	32,500	1,867.00	60,677,500
ピーバンドットコム	1,500	970.00	1,455,000
アセンテック	3,200	1,952.00	6,246,400
富士興産	4,600	639.00	2,939,400
協栄産業	1,700	1,276.00	2,169,200
小野建	13,400	1,126.00	15,088,400
南陽	3,300	1,556.00	5,134,800
佐島電機	10,200	827.00	8,435,400
エコートレーディング	3,500	552.00	1,932,000
伯東	9,100	1,106.00	10,064,600
コンドーテック	11,600	1,189.00	13,792,400
中山福	8,600	469.00	4,033,400
ナガイレーベン	19,800	2,685.00	53,163,000
三菱食品	16,400	2,711.00	44,460,400
松田産業	10,900	1,497.00	16,317,300
第一興商	22,200	3,435.00	76,257,000
メディバルホールディングス	161,000	2,050.00	330,050,000
SPK	6,400	1,375.00	8,800,000
萩原電気ホールディングス	5,500	2,087.00	11,478,500
アズワン	9,700	13,880.00	134,636,000
スズデン	5,200	1,140.00	5,928,000

尾家産業	4,400	1,469.00	6,463,600
シモジマ	9,100	1,253.00	11,402,300
ドウシシャ	14,100	2,038.00	28,735,800
小津産業	3,300	1,777.00	5,864,100
高速	8,900	1,484.00	13,207,600
たけびし	5,200	1,475.00	7,670,000
リックス	3,400	1,478.00	5,025,200
丸文	13,300	475.00	6,317,500
ハピネット	12,500	1,306.00	16,325,000
橋本総業ホールディングス	3,000	2,196.00	6,588,000
日本ライフライン	44,200	1,416.00	62,587,200
タカショー	9,700	620.00	6,014,000
マルカ	4,800	1,991.00	9,556,800
I D O M	40,300	572.00	23,051,600
進和	8,800	2,057.00	18,101,600
エスケイジャパン	3,300	291.00	960,300
ダイトロン	6,300	1,403.00	8,838,900
シークス	19,000	941.00	17,879,000
田中商事	4,600	714.00	3,284,400
オーハシテクニカ	7,700	1,442.00	11,103,400
白銅	5,400	1,225.00	6,615,000
ダイコー通産	1,000	1,208.00	1,208,000
伊藤忠商事	1,043,400	2,802.00	2,923,606,800
丸紅	1,552,800	652.30	1,012,891,440
高島	2,400	1,789.00	4,293,600
長瀬産業	83,900	1,369.00	114,859,100
蝶理	9,500	1,560.00	14,820,000
豊田通商	166,500	3,160.00	526,140,000
三共生興	22,600	400.00	9,040,000
兼松	55,600	1,347.00	74,893,200
ツカモトコーポレーション	2,700	1,160.00	3,132,000
三井物産	1,291,600	1,953.00	2,522,494,800
日本紙パルプ商事	8,500	3,675.00	31,237,500
カメイ	19,500	996.00	19,422,000
東都水産	1,900	3,060.00	5,814,000
O U G ホールディングス	2,400	2,822.00	6,772,800
スターゼン	5,500	4,035.00	22,192,500
山善	58,300	998.00	58,183,400
椿本興業	2,800	3,120.00	8,736,000
住友商事	941,200	1,380.00	1,298,856,000
内田洋行	5,900	5,150.00	30,385,000
三菱商事	978,100	2,589.00	2,532,300,900

第一実業	7,300	3,650.00	26,645,000
キヤノンマーケティングジャパン	37,000	1,875.00	69,375,000
西華産業	8,500	1,306.00	11,101,000
佐藤商事	12,300	893.00	10,983,900
菱洋エレクトロ	15,100	2,657.00	40,120,700
東京産業	13,500	516.00	6,966,000
ユアサ商事	14,200	3,110.00	44,162,000
神鋼商事	3,800	1,775.00	6,745,000
トルク	9,000	299.00	2,691,000
阪和興業	27,900	2,138.00	59,650,200
正栄食品工業	9,700	4,230.00	41,031,000
カナデン	12,100	1,382.00	16,722,200
菱電商事	10,800	1,438.00	15,530,400
フルサト工業	8,200	1,333.00	10,930,600
岩谷産業	33,400	4,040.00	134,936,000
ナイス	6,400	1,275.00	8,160,000
昭光通商	4,800	578.00	2,774,400
ニチモウ	2,300	1,905.00	4,381,500
極東貿易	4,300	1,318.00	5,667,400
イワキ	19,700	479.00	9,436,300
三愛石油	36,800	952.00	35,033,600
稲畑産業	32,900	1,325.00	43,592,500
G S Iクレオス	3,700	1,821.00	6,737,700
明和産業	13,800	488.00	6,734,400
クワザワ	5,400	516.00	2,786,400
ヤマエ久野	10,900	1,152.00	12,556,800
ワキタ	31,800	941.00	29,923,800
東邦ホールディングス	47,900	2,138.00	102,410,200
サンゲツ	40,300	1,604.00	64,641,200
ミツウロコグループホールディングス	22,000	1,170.00	25,740,000
シナネンホールディングス	6,100	3,015.00	18,391,500
伊藤忠エネクス	33,000	949.00	31,317,000
サンリオ	41,900	1,795.00	75,210,500
サンワテクノス	10,600	850.00	9,010,000
リョーサン	16,500	1,958.00	32,307,000
新光商事	23,400	820.00	19,188,000
トーホー	6,700	1,804.00	12,086,800
三信電気	8,000	1,825.00	14,600,000
東陽テクニカ	16,000	944.00	15,104,000
モスフードサービス	19,600	2,881.00	56,467,600
加賀電子	14,900	2,129.00	31,722,100
ソーダニッカ	15,400	520.00	8,008,000

立花エレテック	11,000	1,700.00	18,700,000
フォーバル	6,600	945.00	6,237,000
PALTAC	23,900	5,790.00	138,381,000
三谷産業	19,700	350.00	6,895,000
西本Wismettacホールディングス	3,400	1,889.00	6,422,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,512.00	1,965,600
コア商事ホールディングス	1,400	1,827.00	2,557,800
国際紙パルプ商事	35,400	274.00	9,699,600
ヤマタネ	7,500	1,269.00	9,517,500
丸紅建材リース	1,500	1,711.00	2,566,500
日鉄物産	10,600	3,140.00	33,284,000
泉州電業	4,200	2,860.00	12,012,000
トラスコ中山	34,200	2,445.00	83,619,000
オートバックスセブン	55,400	1,380.00	76,452,000
モリト	10,900	593.00	6,463,700
加藤産業	21,500	3,585.00	77,077,500
北恵	3,800	1,031.00	3,917,800
イノテック	7,800	1,013.00	7,901,400
イエローハット	28,200	1,717.00	48,419,400
JKホールディングス	13,500	717.00	9,679,500
日伝	13,500	2,093.00	28,255,500
北沢産業	11,300	260.00	2,938,000
杉本商事	8,100	1,861.00	15,074,100
因幡電機産業	42,500	2,603.00	110,627,500
東テク	4,900	2,293.00	11,235,700
ミスミグループ本社	187,000	2,798.00	523,226,000
アルテック	11,000	245.00	2,695,000
タキヒヨー	4,500	1,614.00	7,263,000
蔵王産業	2,900	1,436.00	4,164,400
スズケン	63,200	4,005.00	253,116,000
ジェコス	10,300	917.00	9,445,100
グローセル	15,000	400.00	6,000,000
ローソン	37,800	5,120.00	193,536,000
サンエー	12,500	4,280.00	53,500,000
カワチ薬品	11,600	2,781.00	32,259,600
エービーシー・マート	23,300	5,430.00	126,519,000
ハードオフコーポレーション	6,300	663.00	4,176,900
アスクル	15,700	3,430.00	53,851,000
ゲオホールディングス	27,000	1,717.00	46,359,000
アダストリア	20,800	1,675.00	34,840,000
ジーフット	9,000	482.00	4,338,000
くら寿司	8,800	4,940.00	43,472,000

キャンドウ	7,200	2,142.00	15,422,400
パルグループホールディングス	15,500	1,148.00	17,794,000
エディオン	68,700	1,130.00	77,631,000
サーラコーポレーション	30,700	577.00	17,713,900
ワッツ	6,800	886.00	6,024,800
ハローズ	5,700	3,890.00	22,173,000
フジオフードグループ本社	12,600	1,350.00	17,010,000
あみやき亭	3,300	2,960.00	9,768,000
ひらまつ	27,400	200.00	5,480,000
大黒天物産	3,600	5,320.00	19,152,000
ハニーズホールディングス	13,400	1,051.00	14,083,400
ファーマライズホールディングス	3,900	750.00	2,925,000
アルペン	11,600	1,824.00	21,158,400
ハブ	4,700	635.00	2,984,500
クオールホールディングス	22,200	1,161.00	25,774,200
ジーンズホールディングス	7,900	7,520.00	59,408,000
ビックカメラ	88,700	1,111.00	98,545,700
D C Mホールディングス	86,400	1,231.00	106,358,400
MonotaRO	106,100	4,200.00	445,620,000
東京一番フーズ	4,200	558.00	2,343,600
きちりホールディングス	4,400	640.00	2,816,000
アークランドサービスホールディングス	12,600	2,110.00	26,586,000
J．フロント リテイリング	178,500	727.00	129,769,500
ドトール・日レスホールディングス	21,600	1,648.00	35,596,800
マツモトキヨシホールディングス	61,700	3,610.00	222,737,000
ブロンコビリー	7,900	2,240.00	17,696,000
Z O Z O	102,700	2,837.00	291,359,900
トレジャー・ファクトリー	4,700	763.00	3,586,100
物語コーポレーション	4,000	9,780.00	39,120,000
ココカラファイン	15,600	6,130.00	95,628,000
三越伊勢丹ホールディングス	261,300	563.00	147,111,900
H a m e e	5,400	2,397.00	12,943,800
ウエルシアホールディングス	88,800	4,190.00	372,072,000
クリエイトSDホールディングス	25,200	3,600.00	90,720,000
丸善C H Iホールディングス	17,400	376.00	6,542,400
ティーライフ	2,400	1,301.00	3,122,400
チムニー	4,700	1,425.00	6,697,500
シュッピン	10,400	846.00	8,798,400
オイシックス・ラ・大地	14,800	3,280.00	48,544,000
ネクステージ	25,200	1,071.00	26,989,200
ジョイフル本田	43,900	1,441.00	63,259,900
鳥貴族	4,500	1,492.00	6,714,000

キリン堂ホールディングス	6,000	2,544.00	15,264,000
ホットランド	11,400	1,171.00	13,349,400
すかいらーくホールディングス	167,300	1,648.00	275,710,400
SFPホールディングス	8,700	1,390.00	12,093,000
綿半ホールディングス	5,700	2,756.00	15,709,200
ヨシックス	2,600	1,932.00	5,023,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	43,600	1,172.00	51,099,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,200	572.00	4,690,400
B E E N O S	7,000	1,743.00	12,201,000
あさひ	11,200	1,779.00	19,924,800
日本調剤	9,200	1,591.00	14,637,200
コスモス薬品	13,200	17,280.00	228,096,000
トーエル	7,500	763.00	5,722,500
オンリー	3,000	506.00	1,518,000
セブン&アイ・ホールディングス	583,600	3,333.00	1,945,138,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	80,200	647.00	51,889,400
ツルハホールディングス	32,500	14,170.00	460,525,000
サンマルクホールディングス	11,900	1,651.00	19,646,900
フェリシモ	3,600	991.00	3,567,600
トリドールホールディングス	37,100	1,412.00	52,385,200
T O K Y O B A S E	14,100	367.00	5,174,700
ウイルプラスホールディングス	2,300	584.00	1,343,200
J Mホールディングス	11,400	3,210.00	36,594,000
サツドラホールディングス	2,400	1,985.00	4,764,000
アレンザホールディングス	7,600	1,338.00	10,168,800
串カツ田中ホールディングス	4,100	1,726.00	7,076,600
パロックジャパンリミテッド	10,800	632.00	6,825,600
クスリのアオキホールディングス	13,400	8,870.00	118,858,000
力の源ホールディングス	6,800	688.00	4,678,400
スシローグローバルホールディングス	82,000	2,705.00	221,810,000
メディカルシステムネットワーク	14,900	474.00	7,062,600
はるやまホールディングス	7,300	715.00	5,219,500
ノジマ	26,600	3,010.00	80,066,000
カッパ・クリエイト	20,900	1,502.00	31,391,800
ライトオン	11,100	559.00	6,204,900
良品計画	198,200	1,778.00	352,399,600
三城ホールディングス	16,700	283.00	4,726,100
アドヴァン	23,000	1,259.00	28,957,000
アルビス	5,800	2,676.00	15,520,800
コナカ	18,500	291.00	5,383,500
ハウス オブ ローゼ	2,000	1,599.00	3,198,000

G - 7ホールディングス	8,900	2,963.00	26,370,700
イオン北海道	19,900	785.00	15,621,500
コジマ	26,100	564.00	14,720,400
ヒマラヤ	5,500	919.00	5,054,500
コーナン商事	21,300	3,735.00	79,555,500
エコス	5,600	2,116.00	11,849,600
ワタミ	17,900	1,070.00	19,153,000
マルシェ	4,400	598.00	2,631,200
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	328,000	2,400.00	787,200,000
西松屋チェーン	32,900	1,241.00	40,828,900
ゼンショーホールディングス	71,600	2,522.00	180,575,200
幸楽苑ホールディングス	9,500	1,727.00	16,406,500
ハークスレイ	3,400	980.00	3,332,000
サイゼリヤ	22,300	2,009.00	44,800,700
V Tホールディングス	62,400	385.00	24,024,000
魚力	4,300	1,850.00	7,955,000
フジ・コーポレーション	4,100	2,101.00	8,614,100
ユナイテッドアローズ	15,800	1,568.00	24,774,400
ハイデイ日高	21,700	1,794.00	38,929,800
京都きもの友禅	10,600	232.00	2,459,200
コロワイド	49,600	1,700.00	84,320,000
ピーシーデポコーポレーション	20,200	688.00	13,897,600
壱番屋	10,600	5,340.00	56,604,000
P L A N T	4,100	785.00	3,218,500
スギホールディングス	29,800	7,510.00	223,798,000
薬王堂ホールディングス	6,600	2,418.00	15,958,800
スクロール	23,200	877.00	20,346,400
ヨンドシーホールディングス	15,300	1,799.00	27,524,700
ファミリーマート	119,200	2,364.00	281,788,800
木曽路	19,600	2,450.00	48,020,000
S R Sホールディングス	17,800	973.00	17,319,400
タカキュー	11,500	131.00	1,506,500
リテールパートナーズ	19,900	1,738.00	34,586,200
ケーヨー	30,800	817.00	25,163,600
上新電機	17,600	2,333.00	41,060,800
日本瓦斯	23,600	4,400.00	103,840,000
ロイヤルホールディングス	26,000	1,855.00	48,230,000
いなげや	18,600	1,793.00	33,349,800
島忠	28,100	2,811.00	78,989,100
チヨダ	15,900	967.00	15,375,300
ライフコーポレーション	11,300	4,510.00	50,963,000
リンガーハット	18,400	2,503.00	46,055,200

MrMaxHD	20,800	817.00	16,993,600
テンアライド	13,700	393.00	5,384,100
AOKIホールディングス	30,300	579.00	17,543,700
オークワ	23,500	1,340.00	31,490,000
コメリ	23,100	3,150.00	72,765,000
青山商事	31,200	605.00	18,876,000
しまむら	17,400	8,550.00	148,770,000
はせがわ	8,800	286.00	2,516,800
高島屋	108,900	845.00	92,020,500
松屋	30,300	623.00	18,876,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	70,900	724.00	51,331,600
近鉄百貨店	5,800	2,819.00	16,350,200
丸井グループ	136,800	1,885.00	257,868,000
アクシアル リテイリング	12,400	4,635.00	57,474,000
イオン	574,100	2,646.50	1,519,355,650
イズミ	30,400	3,840.00	116,736,000
平和堂	30,400	2,127.00	64,660,800
フジ	18,100	1,780.00	32,218,000
ヤオコー	17,000	7,770.00	132,090,000
ゼビオホールディングス	18,400	748.00	13,763,200
ケーズホールディングス	144,100	1,443.00	207,936,300
Olympicグループ	8,000	843.00	6,744,000
日産東京販売ホールディングス	22,900	251.00	5,747,900
シルバーライフ	2,100	2,092.00	4,393,200
Genky DrugStores	6,600	3,510.00	23,166,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,800	570.00	2,166,000
ブックオフグループホールディングス	8,700	859.00	7,473,300
アインホールディングス	18,400	6,740.00	124,016,000
元気寿司	3,900	2,426.00	9,461,400
ヤマダ電機	455,000	550.00	250,250,000
アークランドサカモト	23,500	2,015.00	47,352,500
ニトリホールディングス	64,600	21,325.00	1,377,595,000
グルメ杵屋	10,900	1,049.00	11,434,100
愛眼	11,900	221.00	2,629,900
ケーユーホールディングス	8,100	798.00	6,463,800
吉野家ホールディングス	49,100	2,101.00	103,159,100
松屋フーズホールディングス	7,200	3,580.00	25,776,000
サガミホールディングス	20,100	1,398.00	28,099,800
関西スーパーマーケット	12,600	1,243.00	15,661,800
王将フードサービス	11,000	6,030.00	66,330,000
プレナス	16,800	1,750.00	29,400,000
ミニストップ	11,200	1,458.00	16,329,600

アークス	30,600	2,498.00	76,438,800
パローホールディングス	33,100	2,603.00	86,159,300
ベルク	7,400	7,010.00	51,874,000
大庄	8,200	1,203.00	9,864,600
ファーストリテイリング	20,000	66,070.00	1,321,400,000
サンドラッグ	56,200	3,850.00	216,370,000
サクスパー ホールディングス	13,100	537.00	7,034,700
ヤマザワ	3,600	1,751.00	6,303,600
やまや	3,100	2,205.00	6,835,500
ペルーナ	32,300	953.00	30,781,900
島根銀行	3,900	679.00	2,648,100
じもとホールディングス	100,900	115.00	11,603,500
めぶきフィナンシャルグループ	776,200	259.00	201,035,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	20,200	1,158.00	23,391,600
九州フィナンシャルグループ	326,900	488.00	159,527,200
ゆうちょ銀行	423,200	848.00	358,873,600
富山第一銀行	35,600	298.00	10,608,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	853,200	373.00	318,243,600
西日本フィナンシャルホールディングス	99,400	732.00	72,760,800
関西みらいフィナンシャルグループ	87,700	463.00	40,605,100
三十三フィナンシャルグループ	13,800	1,384.00	19,099,200
第四北越フィナンシャルグループ	25,900	2,106.00	54,545,400
新生銀行	109,600	1,345.00	147,412,000
あおぞら銀行	89,000	1,910.00	169,990,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,219,000	443.40	4,531,104,600
りそなホールディングス	1,624,100	394.60	640,869,860
三井住友トラスト・ホールディングス	282,400	3,061.00	864,426,400
三井住友フィナンシャルグループ	1,033,200	3,140.00	3,244,248,000
千葉銀行	498,500	578.00	288,133,000
群馬銀行	287,000	357.00	102,459,000
武蔵野銀行	22,300	1,616.00	36,036,800
千葉興業銀行	41,000	272.00	11,152,000
筑波銀行	62,100	222.00	13,786,200
七十七銀行	50,500	1,594.00	80,497,000
青森銀行	11,600	2,374.00	27,538,400
秋田銀行	9,600	1,622.00	15,571,200
山形銀行	16,800	1,332.00	22,377,600
岩手銀行	9,800	2,546.00	24,950,800
東邦銀行	133,600	229.00	30,594,400
東北銀行	7,200	1,035.00	7,452,000
みちのく銀行	9,600	1,154.00	11,078,400
ふくおかフィナンシャルグループ	125,800	1,856.00	233,484,800

静岡銀行	363,800	755.00	274,669,000
十六銀行	18,700	1,964.00	36,726,800
スルガ銀行	152,800	397.00	60,661,600
八十二銀行	360,500	416.00	149,968,000
山梨中央銀行	17,300	833.00	14,410,900
大垣共立銀行	29,500	2,210.00	65,195,000
福井銀行	12,800	1,695.00	21,696,000
北國銀行	14,900	2,999.00	44,685,100
清水銀行	6,200	1,779.00	11,029,800
富山銀行	2,900	2,439.00	7,073,100
滋賀銀行	30,000	2,507.00	75,210,000
南都銀行	24,800	1,951.00	48,384,800
百五銀行	134,400	319.00	42,873,600
京都銀行	53,500	4,735.00	253,322,500
紀陽銀行	52,900	1,569.00	83,000,100
ほくほくフィナンシャルグループ	99,400	992.00	98,604,800
広島銀行	220,500	560.00	123,480,000
山陰合同銀行	88,600	542.00	48,021,200
中国銀行	128,600	976.00	125,513,600
鳥取銀行	5,100	1,185.00	6,043,500
伊予銀行	213,200	682.00	145,402,400
百十四銀行	15,900	1,808.00	28,747,200
四国銀行	22,700	770.00	17,479,000
阿波銀行	24,400	2,439.00	59,511,600
大分銀行	8,600	2,508.00	21,568,800
宮崎銀行	10,000	2,397.00	23,970,000
佐賀銀行	9,100	1,336.00	12,157,600
沖縄銀行	13,700	2,946.00	40,360,200
琉球銀行	34,500	884.00	30,498,000
セブン銀行	499,100	261.00	130,265,100
みずほフィナンシャルグループ	20,299,200	143.00	2,902,785,600
高知銀行	5,400	769.00	4,152,600
山口フィナンシャルグループ	186,500	713.00	132,974,500
長野銀行	4,900	1,184.00	5,801,600
名古屋銀行	11,200	2,421.00	27,115,200
北洋銀行	225,200	232.00	52,246,400
愛知銀行	5,400	3,020.00	16,308,000
中京銀行	6,100	2,041.00	12,450,100
大光銀行	5,100	1,304.00	6,650,400
愛媛銀行	20,900	1,155.00	24,139,500
トマト銀行	5,800	1,030.00	5,974,000
京葉銀行	63,700	501.00	31,913,700

栃木銀行	72,200	205.00	14,801,000
北日本銀行	4,700	1,745.00	8,201,500
東和銀行	26,200	721.00	18,890,200
福島銀行	14,100	258.00	3,637,800
大東銀行	7,800	670.00	5,226,000
トモニホールディングス	115,500	339.00	39,154,500
フィデアホールディングス	145,000	114.00	16,530,000
池田泉州ホールディングス	171,800	176.00	30,236,800
F P G	46,400	605.00	28,072,000
マーキュリアインベストメント	6,100	657.00	4,007,700
S B Iホールディングス	166,900	2,683.00	447,792,700
ジャフコ	23,000	4,275.00	98,325,000
大和証券グループ本社	1,199,100	470.70	564,416,370
野村ホールディングス	2,628,900	539.70	1,418,817,330
岡三証券グループ	127,900	331.00	42,334,900
丸三証券	44,800	428.00	19,174,400
東洋証券	55,200	110.00	6,072,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	172,300	263.00	45,314,900
光世証券	3,900	580.00	2,262,000
水戸証券	44,200	200.00	8,840,000
いちよし証券	28,400	454.00	12,893,600
松井証券	85,500	953.00	81,481,500
マネックスグループ	110,300	267.00	29,450,100
極東証券	20,400	579.00	11,811,600
岩井コスモホールディングス	14,300	1,262.00	18,046,600
藍澤証券	27,100	691.00	18,726,100
マネーパートナーズグループ	16,800	210.00	3,528,000
スパークス・グループ	70,000	198.00	13,860,000
かんぽ生命保険	52,900	1,653.00	87,443,700
S O M P Oホールディングス	280,900	3,877.00	1,089,049,300
アニコム ホールディングス	12,400	4,230.00	52,452,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	390,600	2,929.00	1,144,067,400
第一生命ホールディングス	845,300	1,576.50	1,332,615,450
東京海上ホールディングス	528,200	4,817.00	2,544,339,400
T & Dホールディングス	446,500	1,120.00	500,080,000
アドバンスクリエイト	3,100	2,170.00	6,727,000
全国保証	42,100	3,915.00	164,821,500
イントラスト	5,400	841.00	4,541,400
日本モーゲージサービス	6,100	1,101.00	6,716,100
C a s a	5,300	1,147.00	6,079,100
アルヒ	23,800	1,656.00	39,412,800
プレミアグループ	8,200	1,956.00	16,039,200

クレディセゾン	104,700	1,188.00	124,383,600
芙蓉総合リース	15,700	6,620.00	103,934,000
みずほリース	23,100	2,701.00	62,393,100
東京センチュリー	30,100	5,640.00	169,764,000
日本証券金融	66,000	549.00	36,234,000
アイフル	228,300	256.00	58,444,800
リコーリース	11,800	2,726.00	32,166,800
イオンフィナンシャルサービス	91,500	953.00	87,199,500
アコム	300,500	413.00	124,106,500
ジャックス	16,600	1,751.00	29,066,600
オリエントコーポレーション	404,900	117.00	47,373,300
日立キャピタル	35,300	2,550.00	90,015,000
アプラスフィナンシャル	73,000	73.00	5,329,000
オリックス	926,900	1,364.50	1,264,755,050
三菱UFJリース	379,300	510.00	193,443,000
九州リースサービス	7,500	593.00	4,447,500
日本取引所グループ	428,800	2,795.00	1,198,496,000
イー・ギャランティ	16,400	2,186.00	35,850,400
アサックス	7,900	716.00	5,656,400
NECキャピタルソリューション	6,100	1,845.00	11,254,500
いちご	197,100	284.00	55,976,400
日本駐車場開発	162,300	132.00	21,423,600
スター・マイカ・ホールディングス	9,300	1,250.00	11,625,000
ADワークスグループ	27,700	159.00	4,404,300
ヒューリック	318,900	973.00	310,289,700
三栄建築設計	7,500	1,444.00	10,830,000
野村不動産ホールディングス	91,700	2,066.00	189,452,200
三重交通グループホールディングス	34,600	450.00	15,570,000
サムティ	22,600	1,479.00	33,425,400
ディア・ライフ	24,600	574.00	14,120,400
日本商業開発	10,600	1,688.00	17,892,800
ハウスコム	4,200	1,232.00	5,174,400
日本管理センター	9,700	1,218.00	11,814,600
サンセイランディック	7,100	717.00	5,090,700
フージャースホールディングス	29,800	627.00	18,684,600
オープンハウス	47,600	3,515.00	167,314,000
東急不動産ホールディングス	410,500	468.00	192,114,000
飯田グループホールディングス	125,500	2,085.00	261,667,500
イーランド	5,200	725.00	3,770,000
ムゲンエステート	13,400	473.00	6,338,200
ハウズドゥ	7,300	1,011.00	7,380,300
シーアールイー	5,200	1,436.00	7,467,200

グッドコムアセット	4,600	2,105.00	9,683,000
ジェイ・エス・ビー	3,400	2,873.00	9,768,200
テンポイノベーション	6,100	729.00	4,446,900
パーク24	81,200	1,810.00	146,972,000
パラカ	5,000	1,723.00	8,615,000
三井不動産	737,800	1,926.50	1,421,371,700
三菱地所	1,047,900	1,650.50	1,729,558,950
平和不動産	28,100	2,788.00	78,342,800
東京建物	149,100	1,327.00	197,855,700
ダイビル	40,200	1,130.00	45,426,000
京阪神ビルディング	25,200	1,532.00	38,606,400
住友不動産	336,400	3,175.00	1,068,070,000
テオオーシー	32,300	669.00	21,608,700
東京楽天地	3,000	4,020.00	12,060,000
スターツコーポレーション	21,200	2,238.00	47,445,600
フジ住宅	21,200	514.00	10,896,800
空港施設	19,700	431.00	8,490,700
明和地所	12,100	534.00	6,461,400
ゴールドクレスト	13,100	1,461.00	19,139,100
エスリード	7,300	1,301.00	9,497,300
日神グループホールディングス	27,100	401.00	10,867,100
日本エスコン	27,000	789.00	21,303,000
タカラレーベン	68,300	344.00	23,495,200
A V A N T I A	11,100	770.00	8,547,000
イオンモール	76,300	1,403.00	107,048,900
毎日コムネット	6,400	761.00	4,870,400
ファースト住建	8,400	1,005.00	8,442,000
カチタス	37,700	2,868.00	108,123,600
トーセイ	22,700	976.00	22,155,200
穴吹興産	4,600	1,475.00	6,785,000
サンフロンティア不動産	23,100	822.00	18,988,200
エフ・ジェー・ネクスト	15,500	832.00	12,896,000
インテリックス	4,200	491.00	2,062,200
ランドビジネス	5,000	363.00	1,815,000
サンネクスタグループ	6,800	910.00	6,188,000
グランディハウス	17,400	357.00	6,211,800
日本空港ビルデング	48,100	4,870.00	234,247,000
日本工営	9,800	2,676.00	26,224,800
L I F U L L	51,100	460.00	23,506,000
ミクシィ	27,700	2,569.00	71,161,300
ジェイエシーリクルートメント	9,900	1,279.00	12,662,100
日本M&Aセンター	110,800	5,200.00	576,160,000

メンバーズ	4,400	1,636.00	7,198,400
中広	2,500	548.00	1,370,000
UTグループ	22,900	3,310.00	75,799,000
アイティメディア	5,900	2,300.00	13,570,000
タケエイ	16,100	968.00	15,584,800
E・Jホールディングス	2,700	2,323.00	6,272,100
ビーネックスグループ	18,400	1,184.00	21,785,600
コシダカホールディングス	35,500	436.00	15,478,000
アルトナー	3,800	1,029.00	3,910,200
パソナグループ	15,900	1,456.00	23,150,400
CDS	3,800	1,305.00	4,959,000
リンクアンドモチベーション	26,600	363.00	9,655,800
GCA	19,000	643.00	12,217,000
エス・エム・エス	45,100	2,885.00	130,113,500
サニーサイドアップグループ	5,400	712.00	3,844,800
パーソルホールディングス	144,900	1,713.00	248,213,700
リニカル	7,300	788.00	5,752,400
クックパッド	46,200	356.00	16,447,200
アイ・ケイ・ケイ	7,500	583.00	4,372,500
学情	5,400	1,046.00	5,648,400
スタジオアリス	7,500	1,622.00	12,165,000
シミックホールディングス	7,300	1,280.00	9,344,000
エプコ	3,800	957.00	3,636,600
NJS	3,700	1,799.00	6,656,300
総合警備保障	57,600	5,000.00	288,000,000
カカクコム	107,000	2,654.00	283,978,000
アイロムグループ	5,200	1,944.00	10,108,800
セントケア・ホールディング	9,800	670.00	6,566,000
サイネックス	2,800	770.00	2,156,000
ルネサンス	8,300	957.00	7,943,100
ディップ	19,900	2,338.00	46,526,200
デジタルホールディングス	10,300	1,269.00	13,070,700
ツクイ	34,500	621.00	21,424,500
キャリアデザインセンター	3,600	897.00	3,229,200
ベネフィット・ワン	52,800	2,451.00	129,412,800
エムスリー	319,200	6,340.00	2,023,728,000
ツカダ・グローバルホールディング	11,500	280.00	3,220,000
アウトソーシング	83,200	950.00	79,040,000
ウェルネット	15,000	620.00	9,300,000
ワールドホールディングス	5,100	1,891.00	9,644,100
ディー・エヌ・エー	61,400	1,762.00	108,186,800
博報堂DYホールディングス	201,500	1,360.00	274,040,000

ぐるなび	25,600	747.00	19,123,200
タカミヤ	15,900	526.00	8,363,400
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	961.00	10,955,400
ファンコミュニケーションズ	40,400	459.00	18,543,600
ライク	4,900	1,808.00	8,859,200
ビジネス・ブレイクスルー	6,700	398.00	2,666,600
エスプール	37,500	729.00	27,337,500
WDBホールディングス	6,700	2,889.00	19,356,300
手間いらず	1,000	5,180.00	5,180,000
ティア	9,100	459.00	4,176,900
C D G	1,700	1,724.00	2,930,800
バリューコマース	9,800	3,270.00	32,046,000
インフォーマート	146,800	719.00	105,549,200
J Pホールディングス	46,400	284.00	13,177,600
エコナックホールディングス	29,200	90.00	2,628,000
E P Sホールディングス	19,900	1,011.00	20,118,900
レグス	3,900	976.00	3,806,400
プレステージ・インターナショナル	54,500	904.00	49,268,000
アミューズ	8,000	2,347.00	18,776,000
ドリームインキュベータ	4,600	1,400.00	6,440,000
クイック	9,200	1,230.00	11,316,000
T A C	10,000	230.00	2,300,000
ケネディクス	125,000	526.00	65,750,000
電通グループ	162,800	2,952.00	480,585,600
イオンファンタジー	5,700	1,740.00	9,918,000
シーティーエス	16,600	907.00	15,056,200
ネクシィーズグループ	4,700	936.00	4,399,200
H . U . グループホールディングス	40,600	2,692.00	109,295,200
アルプス技研	13,000	1,846.00	23,998,000
ダイオーズ	3,100	1,028.00	3,186,800
日本空調サービス	15,500	723.00	11,206,500
オリエンタルランド	153,900	14,465.00	2,226,163,500
ダスキン	36,100	2,713.00	97,939,300
明光ネットワークジャパン	18,700	752.00	14,062,400
ファルコホールディングス	8,200	1,506.00	12,349,200
ラウンドワン	40,700	825.00	33,577,500
リゾートトラスト	66,500	1,540.00	102,410,000
ビー・エム・エル	18,700	2,826.00	52,846,200
りらいあコミュニケーションズ	26,400	1,260.00	33,264,000
リソー教育	67,100	286.00	19,190,600
早稲田アカデミー	6,600	958.00	6,322,800
ユー・エス・エス	162,200	1,791.00	290,500,200

東京個別指導学院	5,600	556.00	3,113,600
サイバーエージェント	89,200	5,580.00	497,736,000
楽天	674,900	982.00	662,751,800
クリーク・アンド・リバー社	7,800	1,244.00	9,703,200
テー・オー・ダブリュー	24,000	313.00	7,512,000
山田コンサルティンググループ	9,600	1,062.00	10,195,200
セントラルスポーツ	5,500	2,375.00	13,062,500
フルキャストホールディングス	12,800	1,667.00	21,337,600
エン・ジャパン	25,800	2,963.00	76,445,400
リソルホールディングス	1,700	3,425.00	5,822,500
テクノプロ・ホールディングス	28,900	5,830.00	168,487,000
アトラ	3,300	281.00	927,300
インターワークス	3,600	340.00	1,224,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,900	13,210.00	77,939,000
Keeper 技研	5,400	2,765.00	14,931,000
ファーストロジック	3,100	782.00	2,424,200
三機サービス	3,000	1,053.00	3,159,000
Gunosy	9,300	906.00	8,425,800
デザインワン・ジャパン	5,100	285.00	1,453,500
イー・ガーディアン	6,400	3,100.00	19,840,000
リブセンス	8,900	283.00	2,518,700
ジャパンマテリアル	44,700	1,400.00	62,580,000
ベクトル	18,300	905.00	16,561,500
ウチヤマホールディングス	8,000	302.00	2,416,000
チャーム・ケア・コーポレーション	12,600	1,068.00	13,456,800
キャリアリンク	5,100	784.00	3,998,400
I B J	12,100	1,043.00	12,620,300
アサンテ	6,000	1,525.00	9,150,000
N・フィールド	10,400	641.00	6,666,400
バリューHR	5,900	1,508.00	8,897,200
M&Aキャピタルパートナーズ	11,800	3,755.00	44,309,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,700	2,198.00	12,528,600
E R Iホールディングス	4,500	602.00	2,709,000
アビスト	2,300	3,035.00	6,980,500
シグマクシス	10,100	1,498.00	15,129,800
ウィルグループ	9,800	784.00	7,683,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	22,300	312.00	6,957,600
リクルートホールディングス	1,036,800	3,971.00	4,117,132,800
エラン	10,100	2,446.00	24,704,600
土木管理総合試験所	7,800	359.00	2,800,200
ネットマーケティング	6,000	603.00	3,618,000
日本郵政	1,186,600	761.10	903,121,260

ベルシステム24ホールディングス	24,400	1,733.00	42,285,200	
鎌倉新書	11,200	894.00	10,012,800	
S MN	3,400	902.00	3,066,800	
L I T A L I C O	5,100	2,676.00	13,647,600	
グローバルキッズCOMPANY	3,000	699.00	2,097,000	
エアトリ	7,600	1,351.00	10,267,600	
ハイアス・アンド・カンパニー	9,100	281.00	2,557,100	
アトラエ	4,500	3,255.00	14,647,500	
ストライク	5,500	4,640.00	25,520,000	
ソラスト	40,100	1,303.00	52,250,300	
セラク	4,700	1,666.00	7,830,200	
インソース	6,100	2,656.00	16,201,600	
ベikalレント・コンサルティング	8,800	12,190.00	107,272,000	
Orchestra Holdings	3,200	1,668.00	5,337,600	
アイモバイル	5,400	879.00	4,746,600	
キャリアインデックス	6,500	465.00	3,022,500	
MS - J a p a n	5,000	803.00	4,015,000	
船場	3,200	893.00	2,857,600	
グレイステクノロジー	6,700	4,420.00	29,614,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	16,200	3,660.00	59,292,000	
フルテック	2,200	1,304.00	2,868,800	
グリーンズ	3,900	508.00	1,981,200	
GameWith	4,700	653.00	3,069,100	
ソウルドアウト	3,600	1,535.00	5,526,000	
MS&Consulting	3,100	778.00	2,411,800	
エル・ティー・エス	1,100	4,285.00	4,713,500	
ミダック	2,000	2,126.00	4,252,000	
日総工産	10,000	794.00	7,940,000	
キュービーネットホールディングス	6,100	1,947.00	11,876,700	
RPAホールディングス	11,400	811.00	9,245,400	
スプリックス	4,400	885.00	3,894,000	
マネジメントソリューションズ	7,300	1,312.00	9,577,600	
プロレド・パートナーズ	2,000	5,510.00	11,020,000	
and factory	1,400	923.00	1,292,200	
ピアラ	900	1,863.00	1,676,700	
ギークス	1,700	1,264.00	2,148,800	
カーブスホールディングス	40,200	681.00	27,376,200	
フォーラムエンジニアリング	7,900	733.00	5,790,700	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,700	738.00	5,682,600	
リログループ	79,200	2,323.00	183,981,600	
東祥	9,200	1,384.00	12,732,800	
エイチ・アイ・エス	22,600	1,990.00	44,974,000	

ラックランド	4,200	2,255.00	9,471,000	
共立メンテナンス	24,000	3,980.00	95,520,000	
イチネンホールディングス	16,400	1,208.00	19,811,200	
建設技術研究所	9,500	1,906.00	18,107,000	
スペース	9,700	782.00	7,585,400	
長大	6,000	1,288.00	7,728,000	
燦ホールディングス	6,500	1,107.00	7,195,500	
スバル興業	900	7,740.00	6,966,000	
東京テアトル	5,900	1,280.00	7,552,000	
タナベ経営	3,000	1,380.00	4,140,000	
ナガワ	4,700	6,780.00	31,866,000	
よみうりランド	3,200	3,980.00	12,736,000	
東京都競馬	9,500	5,040.00	47,880,000	
カナモト	25,600	2,263.00	57,932,800	
東京ドーム	58,900	807.00	47,532,300	
西尾レントオール	13,500	2,384.00	32,184,000	
トランス・コスモス	13,900	2,712.00	37,696,800	
乃村工藝社	62,400	782.00	48,796,800	
藤田観光	5,700	1,579.00	9,000,300	
KNT-CTホールディングス	9,000	1,173.00	10,557,000	
日本管財	15,600	2,000.00	31,200,000	
トーカイ	14,100	2,094.00	29,525,400	
セコム	153,600	9,835.00	1,510,656,000	
セントラル警備保障	7,000	3,490.00	24,430,000	
丹青社	27,700	716.00	19,833,200	
メイテック	17,800	5,220.00	92,916,000	
応用地質	17,100	1,216.00	20,793,600	
船井総研ホールディングス	30,000	2,089.00	62,670,000	
進学会ホールディングス	6,300	431.00	2,715,300	
オオバ	10,700	740.00	7,918,000	
いであ	3,700	1,904.00	7,044,800	
学究社	4,500	1,086.00	4,887,000	
ベネッセホールディングス	48,300	2,639.00	127,463,700	
イオンディライト	17,900	2,991.00	53,538,900	
ナック	8,300	979.00	8,125,700	
ダイセキ	24,400	2,591.00	63,220,400	
ステップ	5,500	1,558.00	8,569,000	
合 計	177,322,700		341,705,922,460	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 9月 7日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	222,570,925
コール・ローン	2,432,505,692
国債証券	287,116,614,599
派生商品評価勘定	5,737,826
未収入金	19,969,764
未収利息	1,645,342,238
前払金	4,173,719
前払費用	97,264,698
差入委託証拠金	518,884,845
流動資産合計	292,063,064,306
資産合計	292,063,064,306
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,685,688
未払金	43,327,608
未払解約金	380,709,879
未払利息	5,958
流動負債合計	430,729,133
負債合計	430,729,133
純資産の部	
元本等	
元本	97,174,191,513
剰余金	
剰余金又は欠損金()	194,458,143,660
元本等合計	291,632,335,173
純資産合計	291,632,335,173
負債純資産合計	292,063,064,306

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 9月 7日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2020年 9月 7日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月 7日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,174,191,513口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0011円 (1万口当たり純資産額) (30,011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

	2020年 9月 7日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2020年 9月 7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。

	2020年 9月 7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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 9月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	138,627,060,591円
期中追加設定元本額	19,454,147,365円
期中一部解約元本額	60,907,016,443円
期末元本額	97,174,191,513円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,594,631,147円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	621,733,109円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,048,926,351円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,985,257円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,628,903,962円
世界経済インデックスファンド	7,139,568,434円
D C マイセレクション 2 5	1,778,450,733円
D C マイセレクション 5 0	1,431,512,177円
D C マイセレクション 7 5	872,693,259円

区分	2020年 9月 7日現在
D C 外国債券インデックス・オープン	2,039,550,136円
D C マイセレクション S 2 5	760,669,511円
D C マイセレクション S 5 0	610,746,642円
D C マイセレクション S 7 5	279,852,678円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	39,615,957円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	70,390,265円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	34,436,965円
D C 世界経済インデックスファンド	9,112,616,876円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	561,758,618円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	8,907,481円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,486,344円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,500,041円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	38,329,003円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	78,248,030円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	118,169,571円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	126,905,610円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	201,481,022円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,773,855,177円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	507,660,221円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,934,865,927円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	785,726,371円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	68,953,554円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	532,583,853円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	203,633,788円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	254,905,769円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	859,041,669円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1（適格機関投資家専用）	764,305,172円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	763,704,356円
外国債券ファンド・シリーズ 1	591,774,139円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,079,149,805円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,644,409,609円
分散投資コア戦略ファンド A	1,712,055,191円
分散投資コア戦略ファンド S	6,362,492,684円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	331,298,254円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,073,506,869円
コア投資戦略ファンド（切替型）	848,320,875円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	198,543,448円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	96,395,682円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,072,755,903円
S M T インデックスバランス・オープン	189,265,662円
外国債券 S M T B セレクション（SMA専用）	20,698,305,550円
S M T 世界経済インデックス・オープン	118,039,133円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	114,856,729円

区分	2020年 9月 7日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	204,903,215円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,106,863円
グローバル経済コア	793,886,784円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,633,845円
DCターゲット・イヤーフンド2055	298,560円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	222,038,578円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	21,200,031円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	284,047円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	411,998円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	245,056円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	180,914円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	625,865,756円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	10,312,957,449円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	343,739,187円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	358,481,944円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	68,012,955円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 9月 7日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		727,089,538
合計		727,089,538

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2020年 9月 7日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	2,453,150,904	-	2,448,977,185	4,173,719
	合計	2,453,150,904	-	2,448,977,185	4,173,719

(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

（2020年 9月 7日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,163,120,071	-	2,166,345,000	3,224,929
	アメリカドル	912,701,500	-	915,587,400	2,885,900
	カナダドル	117,675,658	-	118,727,200	1,051,542
	ユーロ	951,686,913	-	951,652,800	34,113
	イギリスポンド	181,056,000	-	180,377,600	678,400
	売建	6,572,149	-	6,571,221	928
	シンガポールドル	6,572,149	-	6,571,221	928
合計		2,169,692,220	-	2,172,916,221	3,225,857

(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。

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。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,491,503.92	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,172,996.14	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,017,500.00	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	997,968.75	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	8,035,000.00	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,293,892.22	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,946,201.57	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,505,195.33	

T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	7,107,210.97	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	14,008,570.38	
T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	7,916,431.25	
T 1.125% 08/15/40	2,300,000.00	2,251,125.00	
T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,829,148.44	
T 1.25% 05/15/50	6,850,000.00	6,498,402.37	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,691,121.11	
T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,126,562.50	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,168,554.70	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,588,671.87	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,145,468.76	
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,128,710.95	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,584,726.58	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,962,832.06	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,057,765.66	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,136,406.24	
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,261,523.40	
T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,942,062.50	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,930,644.51	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,654,976.60	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,634,531.25	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,850,515.21	
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,039,609.38	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,571,337.90	
T 1.625% 08/15/29	14,650,000.00	15,912,418.04	
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,145,898.45	
T 1.625% 10/31/23	5,000,000.00	5,225,390.65	
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,834,667.98	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,539,654.26	
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,426,839.10	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,836,664.06	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,559,082.02	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,788,190.46	
T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,644,697.24	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,902,273.42	
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,846,248.43	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,813,371.14	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,202,480.46	
T 1.75% 06/30/24	7,600,000.00	8,039,078.14	
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,565,862.48	
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,319,789.06	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,295,781.25	

T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,168,873.06
T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,168,300.79
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,563,671.87
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,647,812.50
T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,576,199.24
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,293,906.25
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,638,651.15
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,136,171.88
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,388,593.78
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,754,242.97
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,725,009.74
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,514,644.53
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,438,671.87
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,902,101.54
T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,915,987.90
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,605,406.25
T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,453,617.16
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,213,867.18
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,151,937.48
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,516,460.98
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,607,500.00
T 2.125% 11/30/23	5,680,000.00	6,032,781.27
T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,590,576.18
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,561,270.29
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,277,187.52
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,975,753.95
T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,134,375.00
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,515,703.16
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,576,000.00
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	8,590,239.88
T 2.25% 08/15/49	10,200,000.00	12,131,625.00
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,819,750.00
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,996,494.16
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,835,015.63
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,589,515.62
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,804,453.12
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,117,281.29
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,264,648.45
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,192,450.02
T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,453,515.64
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	12,100,468.75
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	9,197,732.81
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,548,828.12

T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	9,159,375.00	
T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,706,298.82	
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,789,480.45	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,488,281.25	
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,062,945.33	
T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,418,098.43	
T 2.5% 02/15/46	8,500,000.00	10,470,273.48	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,291,892.56	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,562,242.22	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	6,226,097.68	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,859,257.81	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,261,960.17	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,650,057.08	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,485,257.81	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	8,022,011.75	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,236,875.00	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,780,410.16	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,521,128.12	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,261,796.89	
T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,648,125.00	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,845,109.38	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,152,206.25	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,145,175.79	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,074,257.81	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,833,671.89	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,412,957.05	
T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	8,072,167.95	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,733,121.11	
T 2.75% 09/15/21	12,000,000.00	12,318,750.00	
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,617,250.00	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	5,363,531.25	
T 2.75% 11/15/47	6,050,000.00	7,849,402.37	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,478,750.00	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,530,500.00	
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,705,058.61	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,456,837.50	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,284,368.75	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,143,139.85	
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,518,631.25	
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,638,375.00	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,139,648.43	
T 2.875% 10/15/21	7,250,000.00	7,468,066.44	

T 2.875% 10/31/23	5,500,000.00	5,962,773.46
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,619,907.23
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,366,567.97
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,566,455.07
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,223,046.90
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,106,396.87
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,658,203.15
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,633,733.21
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,527,500.00
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,869,960.96
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,104,941.41
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,461,654.68
T 2% 08/31/21	3,740,000.00	3,808,079.70
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,770,062.50
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,395,703.10
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,452,828.12
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,204,074.19
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,082,109.38
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,253,453.13
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,175,437.50
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,729,921.87
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,527,859.37
T 3.125% 08/15/44	2,490,000.00	3,381,731.25
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	10,106,250.00
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,358,261.72
T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	6,349,586.74
T 3.375% 11/15/48	7,300,000.00	10,614,085.97
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,078,240.62
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,497,812.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,908,906.26
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,928,750.00
T 3.75% 11/15/43	5,500,000.00	8,149,882.84
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,140,789.06
T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,780,437.50
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	6,040,179.68
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	9,565,937.50
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,148,271.87
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,677,148.45
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,719,652.37
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	7,421,367.18
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,767,328.14
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,683,007.80
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	8,065,878.93

	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,376,859.37	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,639,378.91	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,535,859.38	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,973,500.00	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	3,078,105.47	
	T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,962,942.19	
	T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,403,881.25	
	T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,494,500.00	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,680,023.44	
	T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,821,945.32	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,234,101.56	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,780,453.12	
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,730,664.06	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,788,515.62	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,871,984.37	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,662,187.50	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,216,242.19	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	2,029,433.60	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,602,070.31	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,944,228.51	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,858,378.90	
	アメリカドル 小計	1,061,380,000.00	1,179,385,121.06 (125,439,401,475)	
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	4,030,000.00	4,046,160.30	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	4,013,720.55	
	CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,714,566.50	
	CAN 1.25% 06/01/30	4,190,000.00	4,449,905.70	
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,902,306.20	
	CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,231,447.25	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,106,984.55	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,447,271.20	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	628,155.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,754,790.70	
	CAN 1% 06/01/27	500,000.00	518,937.50	
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,537,175.00	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,456,526.50	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,963,413.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	2,190,000.00	2,511,557.70	
	CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,934,877.60	
	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,830,654.25	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,980,000.00	2,783,375.10	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	890,920.80	

	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,460,826.85
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,217,620.55
	CAN 2% 12/01/51	2,000,000.00	2,474,740.00
	CAN 3.5% 12/01/45	2,140,000.00	3,302,223.30
	CAN 4.0% 06/01/41	1,550,000.00	2,427,486.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,688,713.65
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,577,848.00
	CAN 5% 06/01/37	1,330,000.00	2,185,402.80
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,775,582.75
	カナダドル 小計	59,770,000.00	68,833,189.30 (5,598,203,285)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,512,703.25
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	35,392,091.60
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	26,322,522.60
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	27,117,492.05
	MBONO 6.75% 03/09/23	31,500,000.00	33,094,057.50
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	31,217,286.60
	MBONO 7.5% 06/03/27	45,890,000.00	51,129,720.20
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	19,078,608.30
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	26,549,855.45
	MBONO 7.75% 11/23/34	15,580,000.00	17,652,529.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	44,700,352.10
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	26,344,851.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	38,393,030.70
	MBONO 8% 11/07/47	21,480,000.00	24,076,824.60
	MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,652,911.00
	メキシコペソ 小計	400,630,000.00	446,234,836.45 (2,204,400,092)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,412,620.70
	BGB 0.2% 10/22/23	1,510,000.00	1,550,460.45
	BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	702,678.75
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,695,459.60
	BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,327,313.50
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,833,971.10
	BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,704,760.20
	BGB 0.9% 06/22/29	1,550,000.00	1,714,858.00
	BGB 0% 10/22/27	2,310,000.00	2,377,544.40
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	992,783.00
	BGB 1.45% 06/22/37	530,000.00	642,057.90
	BGB 1.6% 06/22/47	1,480,000.00	1,903,087.60
	BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,331,300.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,280,000.00	1,657,331.20
BGB 1% 06/22/26	2,380,000.00	2,591,415.40	

BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,675,989.25
BGB 2.15% 06/22/66	940,000.00	1,524,280.50
BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	2,001,496.50
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,201,115.30
BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,742,389.20
BGB 3.75% 06/22/45	1,300,000.00	2,321,078.50
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,455,338.50
BGB 4.25% 03/28/41	2,310,000.00	4,112,781.75
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,471,083.75
BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,314,452.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,463,532.00
BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,309,053.90
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,596,331.80
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,035,962.30
BGB 5% 03/28/35	2,920,000.00	5,024,429.40
BKO 0% 03/11/22	6,040,000.00	6,103,118.00
BKO 0% 09/10/21	1,470,000.00	1,480,069.50
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,032,801.40
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	579,884.00
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,596,344.30
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,207,953.30
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,277,168.75
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,240,563.10
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,046,180.00
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,640,449.40
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,217,010.25
BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,051,677.35
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,025,679.50
BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	1,033,190.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,967,990.50
BTPS 1.45% 03/01/36	1,250,000.00	1,253,212.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,409,963.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,050,515.90
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,514,720.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,531,343.50
BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,365,791.50
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,171,802.55
BTPS 1.65% 12/01/30	1,820,000.00	1,920,955.40
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,380,832.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,119,850.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,879,118.00
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,204,290.80
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,982,161.20

BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,474,032.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,574,587.50	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,505,150.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,546,472.30	
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,774,938.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,845,837.50	
BTPS 2.45% 09/01/50	870,000.00	963,129.15	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,960,000.00	3,172,616.80	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,254,027.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,217,034.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	2,924,965.75	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,555,950.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,181,504.15	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,750,000.00	3,324,392.50	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,793,566.50	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,253,114.05	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,745,542.10	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,489,457.75	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,310,000.00	2,896,612.95	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,809,328.60	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,863,493.80	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,442,797.75	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,590,000.00	3,670,651.60	
BTPS 3% 08/01/29	4,960,000.00	5,838,540.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,161,180.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,521,584.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	4,003,209.70	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,790,000.00	6,577,642.65	
BTPS 4.75% 09/01/21	1,040,000.00	1,090,809.20	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,722,085.50	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,432,374.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,210,000.00	5,696,087.90	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,091,982.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,901,710.60	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,388,293.75	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,858,531.75	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,659,932.20	
BTPS 5% 03/01/22	3,250,000.00	3,499,388.75	
BTPS 5% 03/01/25	4,400,000.00	5,302,748.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	4,982,803.20	
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	4,955,393.85	
BTPS 6.5% 11/01/27	5,240,000.00	7,307,311.00	

BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,860,474.20
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,958,824.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,023,400.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,392,705.60
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,171,169.20
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,332,273.00
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,167,160.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,201,405.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,596,029.95
DBR 0.5% 08/15/27	4,690,000.00	5,075,588.35
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,747,304.05
DBR 0% 05/15/35	810,000.00	842,857.65
DBR 0% 08/15/26	4,470,000.00	4,658,522.25
DBR 0% 08/15/29	4,640,000.00	4,873,856.00
DBR 0% 08/15/30	1,490,000.00	1,562,935.50
DBR 0% 08/15/50	1,980,000.00	2,001,423.60
DBR 1.25% 08/15/48	3,270,000.00	4,467,964.50
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,124,457.60
DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,312,827.40
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,482,199.70
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,925,258.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,793,962.50
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,184,823.30
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,139,290.00
DBR 1% 08/15/25	4,120,000.00	4,476,194.60
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,006,852.25
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,808,325.80
DBR 2.5% 08/15/46	4,020,000.00	6,750,946.80
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,421,242.00
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,092,918.40
DBR 3.25% 07/04/42	2,940,000.00	5,187,791.70
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	5,041,797.50
DBR 4.25% 07/04/39	3,010,000.00	5,626,623.10
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,650,975.25
DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,432,363.60
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,697,016.40
DBR 5.5% 01/04/31	3,580,000.00	5,863,950.50
DBR 5.625% 01/04/28	4,360,000.00	6,416,241.40
DBR 6.25% 01/04/24	5,440,000.00	6,721,745.60
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,066,668.75
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,471,063.30
FRTR 0.25% 11/25/26	6,320,000.00	6,611,194.00
FRTR 0.5% 05/25/25	5,980,000.00	6,289,166.00

FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,391,658.85	
FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,282,260.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	1,210,000.00	1,266,144.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,476,174.45	
FRTR 0.75% 05/25/52	1,820,000.00	1,937,117.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	7,590,000.00	8,278,944.30	
FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,018,690.00	
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,082,308.00	
FRTR 0% 02/25/26	3,110,000.00	3,198,121.85	
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,377,073.40	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,081,852.00	
FRTR 0% 03/25/25	5,090,000.00	5,225,546.70	
FRTR 0% 05/25/22	4,050,000.00	4,095,218.25	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,382,715.80	
FRTR 0% 11/25/30	2,160,000.00	2,199,938.40	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,985,879.55	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,226,691.20	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,397,578.30	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,690,000.00	4,725,967.50	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,890,300.75	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	2,597,224.70	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,459,386.40	
FRTR 1.75% 11/25/24	5,810,000.00	6,395,560.85	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,108,001.75	
FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,932,401.40	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,542,205.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,098,434.30	
FRTR 2.5% 05/25/30	6,200,000.00	7,868,265.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,787,321.50	
FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	4,877,838.80	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,630,495.75	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,650,000.00	5,899,701.75	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,816,627.75	
FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	8,994,985.20	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,798,100.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000.00	8,968,851.15	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,240,709.60	
FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	5,030,232.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,960,000.00	4,328,709.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,698,383.55	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,812,180.20	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,461,089.30	

FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,553,362.50
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,243,780.00
IRISH 0.2% 05/15/27	1,270,000.00	1,318,501.30
IRISH 0.2% 10/18/30	830,000.00	858,033.25
IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	500,275.20
IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	837,347.10
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,170,815.40
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	536,791.95
IRISH 1.1% 05/15/29	920,000.00	1,027,437.60
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	781,176.45
IRISH 1.35% 03/18/31	630,000.00	727,300.35
IRISH 1.5% 05/15/50	630,000.00	803,240.55
IRISH 1.7% 05/15/37	890,000.00	1,112,842.65
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,539,890.60
IRISH 2.4% 05/15/30	1,400,000.00	1,752,730.00
IRISH 2% 02/18/45	1,170,000.00	1,620,327.15
IRISH 3.4% 03/18/24	1,160,000.00	1,324,783.80
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,126,710.55
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,919,172.25
NETHER 0.25% 07/15/25	2,400,000.00	2,505,276.00
NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,815,378.75
NETHER 0.5% 01/15/40	1,250,000.00	1,393,518.75
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,471,565.60
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,298,665.65
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,780,947.00
NETHER 0% 01/15/22	1,490,000.00	1,503,216.30
NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,891,393.75
NETHER 0% 01/15/27	800,000.00	828,536.00
NETHER 0% 07/15/30	1,610,000.00	1,669,159.45
NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,274,873.20
NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	696,078.90
NETHER 2.5% 01/15/33	1,930,000.00	2,606,947.50
NETHER 2.75% 01/15/47	2,220,000.00	3,853,520.40
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,198,054.50
NETHER 3.75% 01/15/23	2,940,000.00	3,250,375.80
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,766,843.90
NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,574,086.80
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,509,278.50
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	239,017.00
OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,978,300.00
OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,679,706.50
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,875,775.00
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,262,912.60

OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,222,712.00	
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,619,591.00	
OBL 0% 10/10/25	2,240,000.00	2,321,334.40	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,545,371.75	
OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,421,181.50	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,259,317.80	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	950,408.75	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,768,311.00	
RAGB 0.75% 03/20/51	560,000.00	642,348.00	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,140,000.00	2,314,153.20	
RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,163,866.10	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,528,335.00	
RAGB 0% 07/15/24	1,740,000.00	1,783,212.90	
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	324,484.80	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,660,000.00	1,817,401.20	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,245,065.40	
RAGB 1.5% 11/02/86	450,000.00	707,620.50	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,085,792.40	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,431,266.20	
RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,556,073.40	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,387,446.05	
RAGB 3.15% 06/20/44	960,000.00	1,644,532.80	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,990,000.00	3,261,940.50	
RAGB 3.5% 09/15/21	1,730,000.00	1,803,395.25	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,241,414.60	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,101,188.85	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	3,082,925.30	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,713,224.55	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,735,372.90	
RFGB 0.125% 04/15/36	510,000.00	524,098.95	
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	416,008.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	657,562.70	
RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,401,700.00	
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	720,574.95	
RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	700,355.50	
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	554,882.50	
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	742,288.20	
RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	394,151.55	
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	550,810.80	
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	430,974.60	
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	750,025.60	
RFGB 1.375% 04/15/47	540,000.00	719,612.10	

RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	686,962.25
RFGB 1.625% 09/15/22	1,250,000.00	1,308,450.00
RFGB 2.625% 07/04/42	570,000.00	890,171.85
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	526,524.60
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	800,992.50
RFGB 4% 07/04/25	1,050,000.00	1,289,552.25
SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,941,792.30
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,343,460.05
SPGB 0.35% 07/30/23	3,390,000.00	3,464,749.50
SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,424,858.15
SPGB 0.45% 10/31/22	2,360,000.00	2,406,810.60
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,960,131.50
SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,872,184.80
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,107,980.00
SPGB 0% 01/31/25	1,550,000.00	1,567,863.75
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,405,692.10
SPGB 1.2% 10/31/40	1,700,000.00	1,788,808.00
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,323,722.25
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,748,632.00
SPGB 1.4% 04/30/28	3,970,000.00	4,368,270.40
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,636,385.50
SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,167,392.80
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,862,080.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,364,882.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,314,877.25
SPGB 1.85% 07/30/35	2,110,000.00	2,465,503.35
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,144,699.10
SPGB 1.95% 07/30/30	2,510,000.00	2,912,804.80
SPGB 1% 10/31/50	1,600,000.00	1,537,416.00
SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,648,451.00
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,992,086.60
SPGB 2.7% 10/31/48	2,070,000.00	2,864,145.15
SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,061,412.00
SPGB 2.9% 10/31/46	2,170,000.00	3,080,759.85
SPGB 3.45% 07/30/66	1,800,000.00	3,052,881.00
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,904,854.40
SPGB 4.2% 01/31/37	2,720,000.00	4,199,979.20
SPGB 4.4% 10/31/23	3,490,000.00	4,020,654.50
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,522,977.40
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,558,725.60
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,824,932.00
SPGB 4.9% 07/30/40	2,590,000.00	4,518,669.40
SPGB 5.15% 10/31/28	4,630,000.00	6,508,228.95

	SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,497,332.50
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,900,000.00	3,308,030.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,206,401.90
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,660,813.00
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,720,446.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,561,271.25
	ユーロ 小計	784,540,000.00	943,906,058.40 (118,809,455,570)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/31/23	2,790,000.00	2,801,494.80
	UKT 0.125% 01/31/28	1,250,000.00	1,248,118.75
	UKT 0.375% 10/22/30	1,410,000.00	1,419,179.10
	UKT 0.5% 07/22/22	3,540,000.00	3,577,400.10
	UKT 0.5% 10/22/61	340,000.00	308,682.60
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,507,083.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,800,000.00	1,698,975.00
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,981,382.30
	UKT 0.875% 10/22/29	2,760,000.00	2,923,861.20
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,232,354.45
	UKT 1.25% 10/22/41	1,500,000.00	1,632,120.00
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,178,100.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,980,000.00	3,461,717.00
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,465,474.00
	UKT 1.625% 10/22/54	1,100,000.00	1,363,884.50
	UKT 1.625% 10/22/71	1,150,000.00	1,624,053.00
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,603,439.50
	UKT 1.75% 07/22/57	2,180,000.00	2,848,824.00
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,234,644.40
	UKT 1.75% 09/07/37	3,280,000.00	3,836,878.40
	UKT 1% 04/22/24	3,100,000.00	3,222,062.50
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,675,837.50
	UKT 2.5% 07/22/65	2,130,000.00	3,534,969.30
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,804,185.90
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,963,482.40
	UKT 3.25% 01/22/44	2,910,000.00	4,416,477.90
	UKT 3.5% 01/22/45	3,030,000.00	4,821,593.55
	UKT 3.5% 07/22/68	2,140,000.00	4,506,840.00
	UKT 3.75% 07/22/52	2,090,000.00	3,815,587.60
	UKT 3.75% 09/07/21	2,820,000.00	2,926,610.10
	UKT 4.25% 03/07/36	2,490,000.00	3,834,263.85
	UKT 4.25% 06/07/32	3,100,000.00	4,472,695.50
UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,063,225.00	
UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,784,685.30	

	UKT 4.25% 12/07/40	2,270,000.00	3,762,502.30	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,938,998.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,890,000.00	3,573,772.65	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,310,000.00	4,759,870.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,720,773.20	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,460,000.00	4,326,475.80	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,900,000.00	4,213,801.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,233,116.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,920,000.00	4,020,528.00	
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,068,998.75	
	UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,431,440.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,843,600.00	
イギリスポンド 小計		101,740,000.00	135,684,059.60 (19,121,954,519)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,570,000.00	3,605,521.50	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,579,024.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	6,700,000.00	7,196,168.50	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,235,812.50	
	SGB 1% 11/12/26	9,920,000.00	10,681,608.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,170,000.00	10,390,206.05	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,900,000.00	9,231,287.50	
	SGB 3.5% 06/01/22	12,850,000.00	13,714,291.00	
スウェーデンクローナ 小計		66,760,000.00	74,633,919.05 (909,041,134)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.375% 08/19/30	4,130,000.00	4,418,232.70	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,204,207.20	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,250,000.00	4,603,408.75	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,190,000.00	5,520,992.25	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,500,000.00	8,252,662.50	
	NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,441,940.00	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,806,954.50	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	8,065,529.60	
ノルウェークローネ 小計		49,500,000.00	53,313,927.50 (634,968,876)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	4,120,000.00	4,199,207.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,492,044.60	
	DGB 0.5% 11/15/29	12,460,000.00	13,474,991.60	
	DGB 1.5% 11/15/23	8,130,000.00	8,685,888.75	
	DGB 1.75% 11/15/25	8,930,000.00	10,023,165.95	
	DGB 3% 11/15/21	10,860,000.00	11,322,581.70	
	DGB 4.5% 11/15/39	17,180,000.00	32,405,173.70	
デンマーククローネ 小計		72,410,000.00	91,603,053.30 (1,549,923,661)	

ポーランド ズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	2,100,000.00	2,110,258.50	
	POLGB 1.25% 10/25/30	210,000.00	207,365.55	
	POLGB 2.25% 04/25/22	5,470,000.00	5,666,072.15	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,207,340.10	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,191,558.80	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,760,000.00	4,043,504.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,598,006.80	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,492,768.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,692,154.30	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,311,919.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,730,000.00	7,547,425.80	
	POLGB 4% 10/25/23	3,730,000.00	4,162,251.05	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	828,144.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,513,053.25	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,621,238.00	
ポーランドズロチ 小計		60,750,000.00	66,193,059.50 (1,869,953,930)	
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	4,370,000.00	4,350,881.25	
	ACGB 0.25% 11/21/25	3,590,000.00	3,549,397.10	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	1,980,982.50	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,850,000.00	2,993,896.50	
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,160,000.00	2,122,761.60	
	ACGB 1% 12/21/30	3,720,000.00	3,733,708.20	
	ACGB 2.25% 05/21/28	4,160,000.00	4,621,656.00	
	ACGB 2.25% 11/21/22	4,050,000.00	4,226,073.75	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,341,066.00	
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,573,380.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	960,060.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,478,865.90	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,807,971.55	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,960,000.00	4,567,820.40	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,410,135.50	
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,974,930.40	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,935,392.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,916,269.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,320,000.00	1,693,170.60	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,190,750.30	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,132,230.80	
ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,468,305.00		
ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,682,891.05		
ACGB 4.75% 04/21/27	4,150,000.00	5,257,240.75		
ACGB 5.5% 04/21/23	4,690,000.00	5,330,302.25		
ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,690,410.25		

オーストラリアドル 小計		80,730,000.00	90,990,549.45 (7,051,767,582)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	1,440,000.00	1,455,984.00
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	828,140.00
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	297,031.05
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	804,927.60
	SIGB 2.25% 08/01/36	730,000.00	839,751.85
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	534,070.60
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	304,268.90
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,192,878.75
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,618,956.40
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	769,810.85
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,142,941.90
	SIGB 2.875% 07/01/29	840,000.00	982,581.60
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	900,056.60
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	432,769.35
	SIGB 3.125% 09/01/22	640,000.00	676,704.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,100,000.00	1,404,436.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,037,326.40
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,345,660.00
シンガポールドル 小計		14,570,000.00	16,568,295.85 (1,291,001,612)
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,547,925.00
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	739,609.50
	MGS 3.48% 03/15/23	2,840,000.00	2,958,300.20
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,624,140.90
	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,269,753.80
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,094,532.50
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,144,200.25
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	580,962.25
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,561,470.00
	MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,751,939.10
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,542,394.50
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	774,101.25
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,111,936.50
	MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	808,245.05
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,237,248.30
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,172,447.05
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,580,191.20
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	656,751.00
MGS 3.955% 09/15/25	1,630,000.00	1,779,071.65	
MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,101,537.00	

	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,055,040.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	810,597.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	430,000.00	482,711.55	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,384,870.40	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,270,280.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	906,835.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,730,677.20	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,755,504.50	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,980,000.00	2,309,996.70	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,720,366.80	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,697,901.20	
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	962,484.00	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,259,149.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	2,550,000.00	3,034,232.25	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,768,851.60	
	マレーシアリングット 小計	51,820,000.00	57,186,255.20 (1,466,255,583)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 04/30/25	630,000.00	635,272.59	
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,836,867.10	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,100,000.00	1,154,374.65	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	930,000.00	998,554.39	
	ILGOV 1% 03/31/30	1,770,000.00	1,824,722.02	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,160,000.00	2,447,808.12	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,587,191.32	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,420,000.00	3,562,026.07	
	ILGOV 5.5% 01/31/22	2,110,000.00	2,271,413.52	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,606,459.19	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	6,020,000.00	8,144,911.30	
	イスラエルシェケル 小計	30,550,000.00	37,069,600.27 (1,170,287,280)	
	合計		287,116,614,599 (287,116,614,599)	

有価証券明細表注記

- 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。
- 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。
- 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。
- 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 199銘柄	100.0%	43.7%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	1.9%

メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	319銘柄	100.0%	41.4%
イギリスポンド	国債証券	46銘柄	100.0%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券	26銘柄	100.0%	2.5%
シンガポールドル	国債証券	18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	35銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	11銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 9月 7日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	15,345,444,287
コール・ローン	145,134,536
株式	398,625,261,572
投資信託受益証券	273,279,288
投資証券	9,573,339,463
派生商品評価勘定	118,000,806
未収入金	23,892,399
未収配当金	703,656,398
前払金	50,035,611
差入委託証拠金	2,113,087,788
流動資産合計	426,971,132,148
資産合計	426,971,132,148
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	172,340,667
未払株式払込金	3,820,188
未払解約金	6,376,346,154
未払利息	355
流動負債合計	6,552,507,364
負債合計	6,552,507,364

	2020年 9月 7日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	145,539,517,095
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	274,879,107,689
元本等合計	420,418,624,784
純資産合計	420,418,624,784
負債純資産合計	426,971,132,148

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 9月 7日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2020年 9月 7日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月 7日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	145,539,517,095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 2.8887円 (1万口当たり純資産額) (28,887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

2020年 9月 7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。

	2020年 9月 7日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

	2020年 9月 7日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 9月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	137,809,914,504円
期中追加設定元本額	41,175,416,732円
期中一部解約元本額	33,445,814,141円
期末元本額	145,539,517,095円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,314,193,128円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,796,494円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,845,197,329円
世界経済インデックスファンド	7,997,093,084円
外国株式インデックス・オープン	757,237,150円
D C マイセレクション 2 5	997,931,895円
D C マイセレクション 5 0	4,728,243,728円
D C マイセレクション 7 5	4,966,251,892円
D C 外国株式インデックス・オープン	9,843,264,834円
D C マイセレクション S 2 5	421,588,741円
D C マイセレクション S 5 0	2,010,127,438円
D C マイセレクション S 7 5	1,476,552,870円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	82,995,102円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	184,084,215円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	126,042,612円
D C 世界経済インデックスファンド	10,314,923,941円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	2,074,015,740円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,240,554円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	8,261,727円

区分	2020年 9月 7日現在
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	34,770,573円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	35,370,416円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	129,579,355円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	26,808,828円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	127,683,995円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	550,110,005円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	301,986,524円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,987,863,678円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,600,867,981円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	60,209,311円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	285,461,385円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	98,197,845円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,657,830,069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)	1,768,740,310円
外国株式ファンド・シリーズ1	978,249,505円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,132,681,149円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,353,753,092円
分散投資コア戦略ファンドA	2,124,081,592円
分散投資コア戦略ファンドS	6,051,875,092円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,172,363,875円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,179,688,658円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,407,310,544円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	726,492,994円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	37,087,691円
SMT インデックスバランス・オープン	209,359,960円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,120,452,834円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	32,261,106,664円
SMT 世界経済インデックス・オープン	130,991,335円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	426,733,326円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	77,666,549円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,453,958円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	74,857,782円
グローバル経済コア	906,816,581円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,023,896円
DCターゲット・イヤーフンド2055	1,403,411円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	456,833,550円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	74,732,824円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	969,899円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	1,198,636円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	650,105円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	433,504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)	1,028,469,405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)	1,481,865,412円

区分	2020年 9月 7日現在
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）	979,330,593円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	358,205,922円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	64,151,184円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 01（適格機関投資家専用）	368,096,231円
S M T A Mバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	794,988,771円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 05（適格機関投資家専用）	364,516,757円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 08（適格機関投資家専用）	349,101,065円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 9月 7日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	38,070,541,039
投資信託受益証券	15,153,247
投資証券	290,610,316
合計	38,345,998,108

(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

（2020年 9月 7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	11,701,350,756	-	11,651,315,145	50,035,611
	合計	11,701,350,756	-	11,651,315,145	50,035,611

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2020年 9月 7日現在）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	6,518,706,750	-	6,523,011,000	4,304,250
	アメリカドル	4,897,246,250	-	4,902,735,000	5,488,750
	カナダドル	162,702,000	-	162,640,000	62,000
	ユーロ	590,833,200	-	591,589,000	755,800
	イギリスポンド	297,412,500	-	295,932,000	1,480,500
	スイスフラン	139,714,800	-	139,728,000	13,200
	スウェーデンクローナ	87,552,000	-	87,696,000	144,000
	デンマーククローネ	42,290,000	-	42,300,000	10,000
	オーストラリアドル	186,682,000	-	185,976,000	706,000
	香港ドル	75,383,000	-	75,460,000	77,000
	シンガポールドル	38,891,000	-	38,955,000	64,000
合計		6,518,706,750	-	6,523,011,000	4,304,250

(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。

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。

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	57,980	14.53	842,449.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	18.33	657,662.07	
	CHENIERE ENERGY INC	21,976	52.05	1,143,850.80	
	CHEVRON CORP	169,184	81.93	13,861,245.12	
	CONCHO RESOURCES INC	19,245	50.65	974,759.25	
	CONOCOPHILLIPS	100,048	35.86	3,587,721.28	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	16,913	35.53	600,918.89	
	EOG RESOURCES INC	51,157	43.14	2,206,912.98	
	EXXON MOBIL	383,325	39.08	14,980,341.00	
	HALLIBURTON CO	77,539	15.99	1,239,848.61	
	HESS CORP	24,844	47.15	1,171,394.60	
	KINDER MORGAN INC	179,301	13.52	2,424,149.52	

MARATHON PETROLEUM CORP	56,097	33.64	1,887,103.08
NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,162	12.15	451,518.30
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	80,482	12.25	985,904.50
ONEOK INC	41,832	26.76	1,119,424.32
PHILLIPS 66	39,493	58.98	2,329,297.14
PIONEER NATURAL RESOURCES	15,844	99.10	1,570,140.40
SCHLUMBERGER	121,975	19.31	2,355,337.25
VALERO ENERGY CORP	35,525	51.22	1,819,590.50
WILLIAMS COS	114,214	20.69	2,363,087.66
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	20,350	298.43	6,073,050.50
ALBEMARLE CORP	10,180	94.72	964,249.60
AMCOR PLC	136,584	11.02	1,505,155.68
AVERY DENNISON CORP	7,457	119.08	887,979.56
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	23.07	406,170.42
BALL CORP	29,987	82.47	2,473,027.89
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	106.18	1,173,607.54
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	33.18	632,775.78
CORTEVA INC	70,180	29.32	2,057,677.60
CROWN HOLDINGS INC	12,992	77.35	1,004,931.20
DOW INC	66,023	48.60	3,208,717.80
DUPONT DE NEMOURS INC	67,267	58.80	3,955,299.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,891	78.93	938,556.63
ECOLAB INC	23,561	204.76	4,824,350.36
FMC CORP	12,118	108.48	1,314,560.64
FREEMONT-MCMORAN INC	138,927	16.02	2,225,610.54
INT'L PAPER CO	33,803	39.03	1,319,331.09
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,504	123.12	923,892.48
LINDE PLC	47,825	247.70	11,846,252.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,513	72.06	1,838,466.78
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,981	215.11	1,286,572.91
MOSAIC CO/THE	31,911	18.53	591,310.83
NEWMONT CORPORATION	74,251	65.35	4,852,302.85
NUCOR CORP	29,015	46.90	1,360,803.50
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	106.55	947,229.50
PPG INDUSTRIES INC	22,118	122.61	2,711,887.98
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	84.48	1,050,086.40
SEALED AIR CORP	14,689	39.78	584,328.42
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,519	679.62	5,110,062.78
STEEL DYNAMICS INC	18,273	30.66	560,250.18
VULCAN MATERIALS CO	12,657	125.00	1,582,125.00
WESTROCK CO	24,734	32.54	804,844.36
3 M COMPANY	52,857	165.77	8,762,104.89

AERCAP HOLDINGS NV	10,498	29.87	313,575.26
ALLEGION PLC	8,963	99.67	893,342.21
AMETEK INC	20,674	99.47	2,056,442.78
BOEING CO	49,265	171.05	8,426,778.25
CARRIER GLOBAL CORP	75,551	30.00	2,266,530.00
CATERPILLAR	49,665	148.18	7,359,359.70
CUMMINS INC	13,804	204.36	2,820,985.44
DEERE&CO	26,686	211.34	5,639,819.24
DOVER CORP	13,872	109.62	1,520,648.64
EATON CORP	36,458	102.58	3,739,861.64
EMERSON ELECTRIC CO	53,227	69.54	3,701,405.58
FASTENAL CO	51,828	46.27	2,398,081.56
FORTIVE CORP	28,503	74.21	2,115,207.63
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	82.56	1,057,593.60
GENERAL DYNAMICS CORP	22,742	151.70	3,449,961.40
GENERAL ELECTRIC CO	783,830	6.42	5,032,188.60
GRAINGER (WW) INC	3,907	358.08	1,399,018.56
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	39.30	598,381.80
HEICO CORP	3,640	111.44	405,641.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	91.67	591,179.83
HONEYWELL INTL INC	64,573	166.69	10,763,673.37
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	17.70	646,935.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	147.51	519,530.22
IDEX CORP	6,916	177.62	1,228,419.92
ILLINOIS TOOL WORKS	28,939	193.90	5,611,272.10
INGERSOLL-RAND INC	31,562	35.31	1,114,454.22
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	91.96	1,105,910.96
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	40.19	807,819.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	20.17	413,485.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	69,045	41.31	2,852,248.95
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,203	181.73	3,489,761.19
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	277.53	849,796.86
LOCKHEED MARTIN CORP	23,202	385.02	8,933,234.04
MASCO CORP	23,467	56.42	1,324,008.14
NORDSON CORP	4,880	186.88	911,974.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,186	339.03	4,809,479.58
OTIS WORLDWIDE CORP	37,519	61.49	2,307,043.31
OWENS CORNING	10,458	65.99	690,123.42
PACCAR INC	32,395	85.62	2,773,659.90
PARKER HANNIFIN CORP	11,596	207.30	2,403,850.80
PENTAIR PLC	14,533	44.87	652,095.71
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	139,047	61.17	8,505,504.99

ROCKWELL AUTOMATION INC	10,474	228.25	2,390,690.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,528	422.53	4,025,865.84
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	42.53	588,104.84
SMITH (A.O.) CORP	12,146	48.61	590,417.06
SNAP-ON INC	4,900	151.22	740,978.00
STANLEY BLACK&DECKER	13,516	160.13	2,164,317.08
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,501	318.07	1,113,563.07
TEXTRON	21,534	38.94	838,533.96
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,896	117.77	2,578,691.92
TRANSDIGM GROUP INC	4,664	503.32	2,347,484.48
UNITED RENTALS INC	6,643	176.43	1,172,024.49
WABTEC CORP	17,764	69.04	1,226,426.56
XYLEM INC	17,545	81.87	1,436,409.15
CINTAS CORP	8,272	331.11	2,738,941.92
COPART INC	19,784	103.49	2,047,446.16
COSTAR GROUP INC	3,584	826.89	2,963,573.76
EQUIFAX INC	10,553	166.39	1,755,913.67
IHS MARKIT LTD	35,672	79.19	2,824,865.68
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,849	15.28	532,492.72
REPUBLIC SERVICES INC	20,007	93.50	1,870,654.50
ROBERT HALF INTL INC	9,566	53.20	508,911.20
ROLLINS INC	14,566	54.59	795,157.94
TRANSUNION	17,091	84.06	1,436,669.46
VERISK ANALYTICS INC	14,560	182.77	2,661,131.20
WASTE CONNECTIONS INC	24,629	99.22	2,443,689.38
WASTE MANAGEMENT INC	37,718	111.21	4,194,618.78
AMERCO	650	363.05	235,982.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,186	97.90	1,290,909.40
CSX CORP	70,066	75.51	5,290,683.66
DELTA AIR LINES INC	12,549	31.77	398,681.73
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	87.80	1,393,210.40
FEDEX CORP	22,696	226.12	5,132,019.52
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,319	136.62	1,136,541.78
KANSAS CITY SOUTHERN	8,711	188.00	1,637,668.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	45.34	485,138.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,949	209.10	4,798,635.90
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,175	196.26	1,604,425.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	39.39	451,606.35
UBER TECHNOLOGIES INC	87,546	33.24	2,910,029.04
UNION PACIFIC CORP	61,417	191.14	11,739,245.38
UNITED PARCEL SERVICE B	64,771	160.78	10,413,881.38
XPO LOGISTICS INC	8,001	87.47	699,847.47

APTIV PLC	24,462	86.21	2,108,869.02
AUTOLIV INC	6,776	77.83	527,376.08
BORGWARNER INC	19,890	42.07	836,772.30
FORD MOTOR COMPANY	343,439	6.90	2,369,729.10
GENERAL MOTORS CO	119,364	30.00	3,580,920.00
LEAR CORP	5,287	120.45	636,819.15
TESLA INC	67,467	418.32	28,222,795.44
DR HORTON INC	32,171	68.23	2,195,027.33
GARMIN LTD	12,854	101.73	1,307,637.42
HASBRO INC	12,468	79.05	985,657.74
LENNAR CORP-CL A	24,928	73.62	1,835,199.36
LULULEMON ATHLETICA INC	11,527	361.41	4,165,973.07
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	92.43	467,880.66
NEWELL BRANDS INC	37,563	16.32	613,028.16
NIKE B	112,281	112.40	12,620,384.40
NVR INC	337	3,931.93	1,325,060.41
PELOTON INTERACTIVE INC-A	17,278	80.63	1,393,125.14
PULTE GROUP INC	23,283	43.21	1,006,058.43
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	74.05	339,000.90
VF CORP	29,715	68.22	2,027,157.30
WHIRLPOOL CORP	6,079	168.00	1,021,272.00
ARAMARK	24,034	28.30	680,162.20
CARNIVAL CORPORATION	40,341	18.53	747,518.73
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,444	1,313.73	3,210,756.12
DARDEN RESTAURANTS INC	11,347	89.28	1,013,060.16
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	381.81	1,420,715.01
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	25,491	90.94	2,318,151.54
LAS VEGAS SANDS CORP	33,100	51.96	1,719,876.00
MARRIOTT INTL A	24,933	104.82	2,613,477.06
MCDONALD'S CORP	67,386	211.73	14,267,637.78
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	19.04	336,284.48
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,847	23.52	960,721.44
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,603	71.95	1,122,635.85
STARBUCKS CORP	107,361	86.27	9,262,033.47
VAIL RESORTS INC	3,574	219.72	785,279.28
WYNN RESORTS LTD	9,302	87.72	815,971.44
YUM BRANDS INC	27,266	95.22	2,596,268.52
ACTIVISION BLIZZARD INC	69,210	79.01	5,468,282.10
ALPHABET INC-CL A	27,303	1,581.21	43,171,776.63
ALPHABET INC-CL C	27,531	1,591.04	43,802,922.24
ALTICE USA INC- A	29,505	26.65	786,308.25
CABLE ONE INC	401	1,845.01	739,849.01

CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,276	604.02	8,018,969.52
COMCAST CORP-CL A	413,328	44.43	18,364,163.04
DISCOVERY INC - A	12,804	22.81	292,059.24
DISCOVERY INC-C	28,190	20.44	576,203.60
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	33.78	814,199.34
ELECTRONIC ARTS INC	26,822	130.13	3,490,346.86
FACEBOOK INC-A	218,932	282.73	61,898,644.36
FOX CORP - CLASS A	33,968	27.66	939,554.88
FOX CORP- CLASS B	15,092	27.76	418,953.92
IAC/INTERACTIVECORP	7,821	126.20	987,010.20
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	17.84	603,598.56
LIBERTY BROADBAND-A	1,669	135.38	225,949.22
LIBERTY BROADBAND-C	10,201	136.80	1,395,496.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	37.98	709,960.14
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	35.48	612,526.72
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	35.67	227,717.28
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	57.58	800,822.64
MATCH GROUP INC	21,635	105.94	2,292,011.90
NETFLIX INC	39,935	516.05	20,608,456.75
NEWS CORP-CLASS A	33,479	14.95	500,511.05
OMNICOM GROUP	20,835	54.08	1,126,756.80
PINTEREST INC- CLASS A	35,703	34.38	1,227,469.14
ROKU INC	8,355	159.91	1,336,048.05
SIRIUS XM HOLDINGS INC	89,917	5.72	514,325.24
SNAP INC - A	79,559	22.44	1,785,303.96
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,751	161.71	1,738,544.21
THE WALT DISNEY CO	164,024	131.99	21,649,527.76
TWITTER INC	71,690	39.87	2,858,280.30
VIACOMCBS INC-CLASS B	53,976	28.75	1,551,810.00
ZILLOW GROUP INC-C	12,368	83.88	1,037,427.84
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	153.75	951,097.50
AMAZON.COM	38,628	3,294.62	127,264,581.36
AUTOZONE INC	2,114	1,206.79	2,551,154.06
BEST BUY COMPANY INC	21,012	106.31	2,233,785.72
BOOKING HOLDINGS INC	3,756	1,917.74	7,203,031.44
BURLINGTON STORES INC	5,808	211.83	1,230,308.64
CARMAX INC	14,029	105.58	1,481,181.82
DOLLAR GENERAL CORP	22,521	195.72	4,407,810.12
DOLLAR TREE INC	22,651	91.23	2,066,450.73
EBAY	64,038	52.54	3,364,556.52
EXPEDIA GROUP INC	11,468	99.80	1,144,506.40
GENUINE PARTS CO	13,937	97.47	1,358,439.39

HOME DEPOT	97,754	269.66	26,360,343.64
LKQ CORP	29,351	31.80	933,361.80
LOWES COMPANIES	68,310	156.39	10,683,000.90
MERCADOLIBRE INC	4,093	1,083.38	4,434,274.34
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,747	471.01	3,177,904.47
ROSS STORES INC	32,265	93.32	3,010,969.80
TARGET (DAYTON HUDSON)	45,015	147.23	6,627,558.45
TIFFANY & CO	10,426	121.79	1,269,782.54
TJX COMPANIES INC	107,633	55.18	5,939,188.94
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	142.08	1,593,000.96
ULTA BEAUTY INC	4,505	240.51	1,083,497.55
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	260.94	1,565,640.00
COSTCO WHOLESALE CORP	40,006	346.57	13,864,879.42
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	4.06	137,634.00
KROGER CO	71,185	35.47	2,524,931.95
SYSCO CORP	45,437	60.14	2,732,581.18
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,566	36.89	2,492,509.74
WALMART INC	128,553	142.83	18,361,224.99
ALTRIA GROUP INC	167,451	43.49	7,282,443.99
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,189	46.49	2,426,266.61
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	29,010	80.12	2,324,281.20
BUNGE LIMITED	13,606	46.48	632,406.88
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	47.58	755,047.02
COCA-COLA CO	370,245	51.04	18,897,304.80
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	16,995	44.34	753,558.30
CONAGRA BRANDS INC	45,992	37.13	1,707,682.96
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,835	191.52	2,841,199.20
GENERAL MILLS INC	55,196	63.15	3,485,627.40
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,896	148.80	2,067,724.80
HORMEL FOODS CORP	27,157	51.08	1,387,179.56
INGREDION INC	5,835	81.51	475,610.85
JM SMUCKER CO	10,802	117.56	1,269,883.12
KELLOGG CO	24,092	69.22	1,667,648.24
KEURIG DR PEPPER INC	31,200	29.54	921,648.00
KRAFT HEINZ CO/THE	58,798	33.47	1,967,969.06
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	62.44	806,974.56
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,853	201.85	2,190,678.05
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	38.32	697,538.96
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	128,663	57.88	7,447,014.44
MONSTER BEVERAGE CORP	37,118	82.27	3,053,697.86
PEPSICO INC	125,883	138.76	17,467,525.08
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	140,881	79.15	11,150,731.15

TYSON FOODS INC	28,214	62.42	1,761,117.88
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,454	93.30	2,188,258.20
CLOROX COMPANY	11,095	212.52	2,357,909.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	73,095	77.21	5,643,664.95
ESTEE LAUDER CO-CL A	20,102	216.22	4,346,454.44
KIMBERLY-CLARK CORP	30,500	152.23	4,643,015.00
PROCTER & GAMBLE CO	225,083	137.96	31,052,450.68
ABBOTT LABORATORIES	160,478	104.16	16,715,388.48
ABIOMED INC	4,421	275.89	1,219,709.69
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,113	309.00	2,197,917.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,604	96.60	1,410,746.40
ANTHEM INC	23,196	276.22	6,407,199.12
BAXTER INTERNATIONAL	47,484	82.30	3,907,933.20
BECTON DICKINSON & CO	26,584	234.08	6,222,782.72
BOSTON SCIENTIFIC CORP	128,150	41.48	5,315,662.00
CARDINAL HEALTH	27,968	49.72	1,390,568.96
CENTENE CORP	52,655	59.67	3,141,923.85
CERNER CORP	27,382	72.01	1,971,777.82
CIGNA CORP	33,153	178.61	5,921,457.33
CVS HEALTH CORP	117,776	60.24	7,094,826.24
DANAHER CORP	57,712	196.58	11,345,024.96
DAVITA INC	7,259	87.06	631,968.54
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	44.76	903,614.88
DEXCOM INC	8,490	398.24	3,381,057.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	56,623	83.71	4,739,911.33
HCA HEALTHCARE INC	24,569	137.05	3,367,181.45
HENRY SCHEIN INC	14,096	65.64	925,261.44
HOLOGIC INC	24,459	58.24	1,424,492.16
HUMANA INC	12,091	413.19	4,995,880.29
IDEXX LABORATORIES INC	7,712	370.66	2,858,529.92
INSULET CORP	5,923	204.83	1,213,208.09
INTUITIVE SURGICAL INC	10,514	735.28	7,730,733.92
LABORATORY CRP OF AMER	8,614	175.72	1,513,652.08
MASIMO CORP	4,504	213.72	962,594.88
MCKESSON CORP	14,193	152.43	2,163,438.99
MEDTRONIC PLC	121,463	105.74	12,843,497.62
MOLINA HEALTHCARE INC	5,020	183.00	918,660.00
QUEST DIAGNOSTICS	12,894	108.89	1,404,027.66
RESMED INC	13,491	173.56	2,341,497.96
STERIS PLC	8,111	157.92	1,280,889.12
STRYKER CORP	30,954	197.62	6,117,129.48
TELADOC HEALTH INC	6,315	198.29	1,252,201.35

TELEFLEX INC	4,427	389.39	1,723,829.53
THE COOPER COS INC	4,688	323.49	1,516,521.12
UNITEDHEALTH GROUP INC	86,189	312.00	26,890,968.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	113.57	823,155.36
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	173.85	1,432,002.45
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,325	269.59	3,322,696.75
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,406	263.66	1,689,005.96
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,240	139.80	2,549,952.00
ABBVIE INC	160,123	91.87	14,710,500.01
AGILENT TECHNOLOGIES	27,370	96.84	2,650,510.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,726	112.97	2,341,416.22
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	122.83	1,309,981.95
AMGEN	53,290	248.40	13,237,236.00
AVANTOR INC	37,516	21.21	795,714.36
BEIGENE LTD-ADR	3,859	240.17	926,816.03
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	484.23	1,036,736.43
BIOGEN INC	14,895	276.00	4,111,020.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	76.00	1,304,996.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	204,901	59.95	12,283,814.95
CATALENT INC	13,739	83.95	1,153,389.05
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	28.10	1,013,314.10
EXACT SCIENCES CORP	13,278	74.70	991,866.60
GILEAD SCIENCES INC	115,172	66.01	7,602,503.72
ILLUMINA INC	13,438	342.39	4,601,036.82
INCYTE CORP	17,504	90.49	1,583,936.96
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	55.61	712,753.37
IQVIA HOLDINGS INC	17,736	160.21	2,841,484.56
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	131.70	654,680.70
JOHNSON & JOHNSON	239,636	148.59	35,607,513.24
LILLY (ELI) & CO	77,946	150.91	11,762,830.86
MERCK & CO	229,111	85.24	19,529,421.64
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	949.26	2,146,276.86
MODERNA INC	25,034	62.60	1,567,128.40
MYLAN NV	49,481	15.81	782,294.61
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	110.06	932,648.44
PERKINELMER INC	10,645	114.30	1,216,723.50
PERRIGO CO PLC	10,773	50.86	547,914.78
PFIZER	504,152	36.36	18,330,966.72
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,239	580.36	5,361,946.04
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	132.75	948,764.25
SEATTLE GENETICS INC	11,471	149.21	1,711,587.91
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108,484	9.19	996,967.96

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	35,807	409.98	14,680,153.86
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23,329	266.50	6,217,178.50
WATERS CORP	5,276	206.07	1,087,225.32
ZOETIS INC	42,761	157.24	6,723,739.64
BANK OF AMERICA CORP	708,508	26.54	18,803,802.32
CITIGROUP	191,460	52.52	10,055,479.20
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	27.36	1,094,673.60
COMERICA INC	14,360	41.47	595,509.20
EAST WEST BANCORP INC	13,827	37.71	521,416.17
FIFTH THIRD BANCORP	67,941	21.63	1,469,563.83
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	114.53	1,817,820.16
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,012	9.93	983,684.22
JPMORGAN CHASE & CO	276,938	103.52	28,668,621.76
KEY CORP	94,322	12.89	1,215,810.58
M & T BANK CORP	11,721	105.90	1,241,253.90
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	11.02	404,838.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,902	113.10	4,286,716.20
REGIONS FINL CORP	92,434	11.80	1,090,721.20
SIGNATURE BANK	5,223	101.23	528,724.29
SVB FINANCIAL GROUP	4,943	259.73	1,283,845.39
TRUIST FINANCIAL CORP	123,198	39.16	4,824,433.68
US BANCORP	121,220	38.31	4,643,938.20
WELLS FARGO & CO	357,974	24.79	8,874,175.46
ZIONS BANCORPORATION	15,186	33.68	511,464.48
ALLY FINANCIAL INC	36,028	25.24	909,346.72
AMERICAN EXPRESS	61,530	105.67	6,501,875.10
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,602	156.54	1,659,637.08
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	46.61	706,281.33
BANK NEW YORK CO	73,913	37.50	2,771,737.50
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	126,396	218.32	27,594,774.72
BLACKROCK INC	13,698	564.63	7,734,301.74
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	62,438	52.99	3,308,589.62
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,052	73.99	3,111,427.48
CARLYLE GROUP INC/THE	16,087	25.82	415,366.34
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,612	91.03	966,010.36
CME GROUP INC	32,848	169.62	5,571,677.76
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,704	57.12	1,582,452.48
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	54.53	1,151,019.24
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,215	20.97	843,308.55
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	332.47	1,207,863.51
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	21.30	555,291.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,946	210.94	6,316,809.24

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,077	100.08	4,911,626.16
INVESCO LTD	44,943	11.39	511,900.77
KKR & CO INC	47,403	35.70	1,692,287.10
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,593	454.45	1,632,838.85
MOODY'S CORP	15,637	282.47	4,416,983.39
MORGAN STANLEY	108,232	52.71	5,704,908.72
MSCI INC	7,815	348.18	2,721,026.70
NASDAQ INC	10,979	130.29	1,430,453.91
NORTHERN TRUST CORP	17,625	84.45	1,488,431.25
PRICE T ROWE GROUP INC	20,125	132.27	2,661,933.75
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,968	76.62	916,988.16
S&P GLOBAL INC	22,125	345.18	7,637,107.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	105,609	36.20	3,823,045.80
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	51.80	635,119.80
STATE STREET CORP	31,754	68.35	2,170,385.90
SYNCHRONY FINANCIAL	46,378	26.17	1,213,712.26
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,877	39.09	1,011,531.93
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	53.19	481,954.59
VOYA FINANCIAL INC	12,505	50.78	635,003.90
AFLAC	62,907	37.86	2,381,659.02
ALLEGHANY CORP	1,276	551.73	704,007.48
ALLSTATE CORP	29,185	93.81	2,737,844.85
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	68.63	433,672.97
AMERICAN INT'L GROUP	77,792	29.80	2,318,201.60
AON PLC	21,468	202.74	4,352,422.32
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,796	31.87	1,236,428.52
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,833	103.68	1,848,925.44
ASSURANT INC	5,819	122.67	713,816.73
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	37.29	380,619.03
BROWN & BROWN INC	22,945	45.25	1,038,261.25
CHUBB LTD	40,459	125.56	5,080,032.04
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,851	81.08	1,204,119.08
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	209.94	454,730.04
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	215.55	846,249.30
FNF GROUP	24,961	33.27	830,452.47
GLOBE LIFE INC	9,867	83.89	827,742.63
HARTFORD FINANCIAL SVCS	34,481	40.94	1,411,652.14
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	38.22	625,432.08
LOEWS CORP	25,707	36.87	947,817.09
MARKEL CORP	1,312	1,068.62	1,402,029.44
MARSH & MCLENNAN COS	46,842	115.41	5,406,035.22
METLIFE INC	69,923	39.15	2,737,485.45

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,615	43.42	1,155,623.30
PROGRESSIVE CORP	53,536	92.94	4,975,635.84
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,736	69.71	2,421,446.56
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	96.51	524,145.81
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,087	179.78	734,760.86
TRAVELERS COS INC/THE	22,306	116.57	2,600,210.42
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,016	208.43	2,504,494.88
WR BERKLEY CORP	14,085	62.94	886,509.90
CBRE GROUP INC-A	30,111	48.22	1,451,952.42
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.89	383,943.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	103.03	461,986.52
WEYERHAEUSER CO	69,607	29.04	2,021,387.28
ACCENTURE PLC-CL A	57,718	236.07	13,625,488.26
ADOBE INC	43,758	491.94	21,526,310.52
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	15,447	108.43	1,674,918.21
ANSYS INC	8,044	321.21	2,583,813.24
AUTODESK INC	20,053	233.88	4,689,995.64
AUTOMATIC DATA PROCESS	38,561	138.53	5,341,855.33
AVALARA INC	6,485	123.37	800,054.45
BLACK KNIGHT INC	14,413	81.57	1,175,668.41
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,438	84.98	1,141,961.24
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	10,971	135.41	1,485,583.11
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,674	105.88	2,612,483.12
CDK GLOBAL INC	10,687	45.41	485,296.67
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	119.98	1,258,110.28
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	137.14	1,432,290.16
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	49,173	66.81	3,285,248.13
COUPA SOFTWARE INC	6,059	285.81	1,731,722.79
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	12,709	125.19	1,591,039.71
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	101.98	316,138.00
DATADOG INC - CLASS A	11,555	79.57	919,431.35
DOCUSIGN INC	15,817	216.26	3,420,584.42
DROPBOX INC-CLASS A	24,217	19.75	478,285.75
DYNATRACE INC	14,169	39.99	566,618.31
EPAM SYSTEMS INC	5,266	316.30	1,665,635.80
FAIR ISAAC CORP	2,615	419.43	1,096,809.45
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	55,755	148.00	8,251,740.00
FISERV INC	52,068	99.03	5,156,294.04
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,297	238.04	1,736,977.88
FORTINET INC	12,295	117.64	1,446,383.80
GARTNER INC	8,569	131.18	1,124,081.42
GLOBAL PAYMENTS INC	27,817	172.56	4,800,101.52

GODADDY INC - CLASS A	14,033	79.52	1,115,904.16
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	115.61	915,978.03
INTL BUSINESS MACHINES CORP	81,671	122.30	9,988,363.30
INTUIT INC	23,525	333.11	7,836,412.75
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	163.17	1,200,931.20
LEIDOS HOLDINGS	12,829	88.49	1,135,238.21
MASTERCARD INC-CLASS A	81,242	335.01	27,216,882.42
MICROSOFT CORP	656,440	214.25	140,642,270.00
MONGODB INC	4,623	214.51	991,679.73
NORTONLIFELOCK INC	50,376	23.39	1,178,294.64
OKTA INC	10,381	203.44	2,111,910.64
ORACLE CORP	188,587	55.73	10,509,953.51
PALO ALTO NETWORKS INC	8,711	235.65	2,052,747.15
PAYCHEX INC	30,214	76.06	2,298,076.84
PAYCOM SOFTWARE INC	4,755	270.75	1,287,416.25
PAYPAL HOLDINGS INC	101,274	191.84	19,428,404.16
PTC INC	9,984	87.69	875,496.96
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,372	266.45	1,697,819.40
SALESFORCE.COM INC	81,684	254.70	20,804,914.80
SERVICENOW INC	17,208	450.35	7,749,622.80
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	31,963	29.07	929,164.41
SPLUNK INC	14,752	200.14	2,952,465.28
SQUARE INC - A	33,186	146.39	4,858,098.54
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	21,775	61.24	1,333,609.87
SYNOPSYS INC	13,357	208.98	2,791,345.86
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3,705	441.26	1,634,868.30
TWILIO INC - A	11,282	233.50	2,634,347.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	329.81	1,224,584.53
VERISIGN INC	9,078	203.54	1,847,736.12
VISA INC-CLASS A SHARES	153,409	204.66	31,396,685.94
VMWARE INC-CLASS A	7,867	137.47	1,081,476.49
WESTERN UNION CO	38,757	23.03	892,573.71
WIX.COM LTD	5,010	258.49	1,295,034.90
WORKDAY INC-CLASS A	15,669	215.80	3,381,370.20
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	14,532	369.89	5,375,241.48
ZSCALER INC	6,234	134.34	837,475.56
AMPHENOL CORPORATION	27,456	108.45	2,977,603.20
APPLE INC	1,580,000	120.96	191,116,800.00
ARISTA NETWORKS INC	5,179	211.10	1,093,286.90
ARROW ELECTRONICS INC	7,839	77.95	611,050.05
CDW CORP/DE	13,742	114.25	1,570,023.50
CISCO SYSTEMS	382,903	40.82	15,630,100.46

COGNEX CORP	16,230	63.19	1,025,573.70
CORNING	72,399	32.05	2,320,387.95
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	64.65	1,391,914.50
F5 NETWORKS INC	5,350	127.14	680,199.00
FLIR SYSTEMS INC	11,686	35.16	410,879.76
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	123,779	9.59	1,187,040.61
HP INC	126,556	19.23	2,433,671.88
IPG PHOTONICS CORP	3,207	162.65	521,618.55
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	23.24	727,504.96
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,624	94.95	1,673,398.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,946	153.04	2,287,335.84
NETAPP INC	20,586	46.40	955,190.40
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	47.01	1,073,520.36
TE CONNECTIVITY LTD	29,926	98.75	2,955,192.50
TRIMBLE IMS HOLDINGS	23,884	49.96	1,193,244.64
WESTERN DIGITAL CORP	28,454	38.16	1,085,804.64
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,162	260.55	1,344,959.10
AT&T INC	646,693	29.42	19,025,708.06
CENTURYLINK INC	93,962	10.76	1,011,031.12
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	22.53	349,653.06
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	22.01	741,296.80
T-MOBILE US INC	51,428	114.29	5,877,706.12
VERIZON COMMUNICATIONS	375,807	60.48	22,728,807.36
AES CORP	61,761	17.57	1,085,140.77
ALLIANT ENERGY CORPORATION	24,156	53.29	1,287,273.24
AMEREN CORPORATION	23,120	78.96	1,825,555.20
AMERICAN ELECTRIC POWER	45,143	79.05	3,568,554.15
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,922	143.17	2,422,722.74
ATMOS ENERGY CORP	11,419	97.22	1,110,155.18
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	19.87	956,978.94
CMS ENERGY CORP	26,742	61.66	1,648,911.72
CONSOLIDATED EDISON INC	31,745	73.04	2,318,654.80
DOMINION ENERGY INC	75,413	78.44	5,915,395.72
DTE ENERGY COMPANY	18,360	118.81	2,181,351.60
DUKE ENERGY CORP	66,920	80.97	5,418,512.40
EDISON INTL	33,630	52.26	1,757,503.80
ENERGY CORP	18,696	97.90	1,830,338.40
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	41.59	866,486.06
EVERGY INC	21,330	51.87	1,106,387.10
EVERSOURCE ENERGY	30,920	86.08	2,661,593.60
EXELON CORP	88,634	37.09	3,287,435.06
FIRSTENERGY CORP	50,559	29.40	1,486,434.60

	NEXTERA ENERGY INC	44,314	277.32	12,289,158.48
	NISOURCE INC	35,781	22.28	797,200.68
	NRG ENERGY INC	23,078	33.38	770,343.64
	OGE ENERGY CORP	19,225	31.54	606,356.50
	PG&E CORP	92,713	9.19	852,032.47
	PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	72.40	779,892.80
	PPL CORPORATION	69,904	28.29	1,977,584.16
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	47,290	52.52	2,483,670.80
	SEMPRA ENERGY	27,061	120.89	3,271,404.29
	SOUTHERN CO	94,614	52.29	4,947,366.06
	UGI CORP	18,019	34.17	615,709.23
	VISTRA CORP	37,797	18.23	689,039.31
	WEC ENERGY GROUP INC	27,839	96.49	2,686,185.11
	XCEL ENERGY INC	47,772	70.02	3,344,995.44
	ADVANCED MICRO DEVICES	105,826	82.01	8,678,790.26
	ANALOG DEVICES	33,614	117.44	3,947,628.16
	APPLIED MATERIALS	84,668	60.96	5,161,361.28
	BROADCOM INC	36,201	362.95	13,139,152.95
	INTEL CORP	384,321	50.08	19,246,795.68
	KLA CORP	14,078	193.37	2,722,262.86
	LAM RESEARCH CORP	13,269	333.12	4,420,169.28
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	61,408	37.36	2,294,202.88
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,044	68.68	1,582,661.92
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,844	108.15	2,470,578.60
	MICRON TECHNOLOGY	101,637	46.48	4,724,087.76
	NVIDIA CORP	55,909	504.90	28,228,454.10
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,742	126.33	3,251,986.86
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	22.68	816,389.28
	QORVO INC	10,609	118.89	1,261,304.01
	QUALCOMM	101,835	115.97	11,809,804.95
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,613	139.01	2,031,353.13
	TERADYNE INC	16,048	78.60	1,261,372.80
	TEXAS INSTRUMENTS	83,066	140.47	11,668,281.02
	XILINX INC	21,957	101.64	2,231,709.48
	アメリカドル 小計	28,234,344		2,701,683,570.41 (287,351,064,548)
カナダドル	CAMECO CORP	41,062	14.18	582,259.16
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	106,748	25.71	2,744,491.08
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	6.06	585,795.96
	ENBRIDGE	181,929	41.24	7,502,751.96
	IMPERIAL OIL	24,763	20.91	517,794.33
	INTER PIPELINE LTD	35,455	14.20	503,461.00

KEYERA CORP	18,607	23.95	445,637.65
PARKLAND CORP	17,004	35.63	605,852.52
PEMBINA PIPELINE CORP	53,816	32.02	1,723,188.32
SUNCOR ENERGY	137,891	20.24	2,790,913.84
TC ENERGY CORP	86,686	59.50	5,157,817.00
AGNICO EAGLE MINES	23,423	102.87	2,409,524.01
B2GOLD CORP	90,243	8.42	759,846.06
BARRICK GOLD CORP	163,443	37.90	6,194,489.70
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	47.36	622,263.04
FRANCO-NEVADA CORP	17,244	190.11	3,278,256.84
KINROSS GOLD CORP	125,340	11.27	1,412,581.80
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	67.45	1,580,218.60
LUNDIN MINING CORP	62,243	8.23	512,259.89
NUTRIEN LTD	49,869	49.21	2,454,053.49
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	45.01	828,679.11
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	15.35	701,141.95
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	40,391	67.40	2,722,353.40
YAMANA GOLD INC	81,672	7.84	640,308.48
CAE INC	25,999	19.86	516,340.14
WSP GLOBAL INC	9,471	88.24	835,721.04
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	9,110	74.61	679,697.10
THOMSON REUTERS CORP	15,191	99.29	1,508,314.39
AIR CANADA	19,591	18.63	364,980.33
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64,013	135.38	8,666,079.94
CP RAILWAY LIMITED	12,360	379.13	4,686,046.80
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	63.59	1,779,121.02
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,923	26.54	342,976.42
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,357	73.18	1,855,625.26
QUEBECOR INC -CL B	15,200	32.52	494,304.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	24.21	1,091,556.27
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	134.93	729,836.37
DOLLARAMA INC	26,700	49.42	1,319,514.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	77,803	44.58	3,468,457.74
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	32.96	502,738.88
LOBLAW COMPANIES LTD	17,907	66.78	1,195,829.46
METRO INC	24,937	58.75	1,465,048.75
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	93.89	646,244.87
SAPUTO INC	24,489	32.31	791,239.59
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	21.24	590,472.00
CANOPY GROWTH CORP	25,606	21.11	540,542.66
CRONOS GROUP INC	15,900	7.02	111,618.00
BANK MONTREAL	58,260	81.37	4,740,616.20

	BANK NOVA SCOTIA	112,518	55.34	6,226,746.12	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	40,437	104.09	4,209,087.33	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,995	72.58	2,177,037.10	
	ROYAL BANK OF CANADA	130,906	96.91	12,686,100.46	
	TORONTO-DOMINION BANK	163,213	63.42	10,350,968.46	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	119,329	43.42	5,181,265.18	
	CI FINANCIAL CORP	18,671	18.34	342,426.14	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	31.79	244,306.15	
	ONEX CORP	6,603	63.52	419,422.56	
	TMX GROUP LTD	4,685	134.65	630,835.25	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,663	399.40	1,063,602.20	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	25.76	612,778.88	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,230	46.96	386,480.80	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	136.82	1,784,543.26	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	178,574	19.16	3,421,477.84	
	POWER CORP OF CANADA	51,551	25.65	1,322,283.15	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	52,771	54.38	2,869,686.98	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.66	262,404.00	
	CGI INC - CL A	20,486	91.04	1,865,045.44	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,845	1,472.81	2,717,334.45	
	OPEN TEXT CORP	24,643	56.90	1,402,186.70	
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,799	1,270.00	12,444,730.00	
	BCE INC	15,355	55.84	857,423.20	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	35,018	55.52	1,944,199.36	
	TELUS CORP	32,908	23.80	783,210.40	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	17.89	927,024.02	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	16.78	409,348.10	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	39.20	205,447.20	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.35	333,981.40	
	EMERA INC	23,704	53.12	1,259,156.48	
	FORTIS INC	42,633	52.01	2,217,342.33	
	HYDRO ONE LTD	32,299	27.06	874,010.94	
	カナダドル 小計	3,498,907		168,630,752.30 (13,714,739,084)	
ユーロ	ENI	229,512	7.64	1,754,619.24	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	8.88	437,137.88	
	NESTE OIL OYJ	40,117	44.96	1,803,660.32	
	OMV AG	14,984	27.02	404,867.68	
	REPSOL SA	140,401	6.44	905,305.64	
	TENARIS SA	40,648	4.82	196,207.89	
	TOTAL SE	227,194	32.96	7,489,450.21	
	VOPAK	6,360	46.19	293,768.40	

AIR LIQUIDE	42,640	138.80	5,918,432.00
AKZO NOBEL	17,285	81.66	1,411,493.10
ARCELORMITTAL	66,229	10.74	711,829.29
ARKEMA	5,949	93.62	556,945.38
BASF SE	85,260	52.12	4,443,751.20
COVESTRO AG	15,098	43.30	653,743.40
CRH PLC	72,257	30.54	2,206,728.78
EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	23.23	458,885.42
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	38.28	220,569.36
HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	52.76	782,589.08
KONINKLIJKE DSM NV	15,650	132.75	2,077,537.50
LANXESS	7,293	49.04	357,648.72
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	30.46	595,949.90
SOLVAY SA	6,906	76.38	527,480.28
STORA ENSO OYJ R	54,792	13.20	723,254.40
SYMRISE AG	11,104	113.55	1,260,859.20
THYSSEN KRUPP	33,044	6.12	202,361.45
UMICORE	17,605	38.93	685,362.65
UPM KYMMENE OYJ	50,623	26.30	1,331,384.90
VOESTALPINE AG	12,422	21.63	268,687.86
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	23,394	20.68	483,787.92
AIRBUS SE	53,734	69.78	3,749,558.52
ALSTOM	18,760	47.09	883,408.40
ANDRITZ AG	5,242	27.80	145,727.60
BOUYGUES ORD	19,381	33.62	651,589.22
BRENTAG AG	15,254	52.72	804,190.88
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	6.86	638,902.56
DASSAULT AVIATION SA	213	785.50	167,311.50
EIFFAGE	7,209	78.30	564,464.70
FERROVIAL SA	46,711	22.75	1,062,675.25
GEA GROUP AG	13,382	31.00	414,842.00
HOCHTIEF AG	2,222	73.45	163,205.90
KINGSPAN GROUP PLC	13,031	67.35	877,637.85
KION GROUP AG	5,887	70.38	414,327.06
KNORR-BREMSE AG	4,123	108.66	448,005.18
KONE OYJ-B	29,981	70.30	2,107,664.30
LEGRAND SA	24,584	69.32	1,704,162.88
LEONARDO SPA	35,425	5.66	200,505.50
MTU AERO ENGINES AG	4,753	158.95	755,489.35
PRYSMIAN SPA	21,155	23.49	496,930.95
SAFRAN SA	29,413	97.24	2,860,120.12
SAINT-GOBAIN	46,472	34.24	1,591,201.28

SCHNEIDER ELECTRIC SE	49,710	103.10	5,125,101.00
SIEMENS	69,121	115.70	7,997,299.70
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	25,102	20.83	522,874.66
THALES SA	9,665	65.34	631,511.10
VINCI S.A.	47,088	79.62	3,749,146.56
WARTSILA OYJ	34,386	6.96	239,326.56
BUREAU VERITAS SA	25,073	18.59	466,232.43
RANDSTAD NV	12,365	43.98	543,812.70
TELEPERFORMANCE	5,074	249.90	1,267,992.60
WOLTERS KLUWER	25,709	68.20	1,753,353.80
ADP	2,382	88.55	210,926.10
AENA SME SA	6,542	126.10	824,946.20
ATLANTIA SPA	41,427	14.21	588,677.67
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	9.09	211,682.11
DEUTSCHE POST AG-REG	91,113	37.68	3,433,137.84
FRAPORT AG	3,561	37.40	133,181.40
GETLINK	44,101	12.59	555,231.59
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,984	61.38	1,779,037.92
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	47.18	235,475.38
CONTINENTAL AG	9,928	94.12	934,423.36
DAIMLER AG	78,738	43.48	3,423,528.24
FAURECIA	5,945	40.88	243,031.60
FERRARI NV	11,392	160.70	1,830,694.40
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,640	9.43	911,411.84
MICHELIN	14,707	95.30	1,401,577.10
PEUGEOT SA	52,883	15.14	800,913.03
PIRELLI & C SPA	39,097	3.69	144,580.70
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	52.28	733,383.84
RENAULT SA	17,362	24.45	424,500.90
VALEO SA	19,350	28.31	547,798.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	16,822	143.00	2,405,546.00
VOLKSWAGEN STAMM	3,251	151.20	491,551.20
ADIDAS AG	17,675	262.70	4,643,222.50
ESSILORLUXOTTICA	25,885	111.10	2,875,823.50
HERMES INTERNATIONAL	2,864	738.20	2,114,204.80
KERING	6,916	555.00	3,838,380.00
LVMH	25,140	402.85	10,127,649.00
MONCLER SPA	16,489	33.77	556,833.53
PUMA SE	7,720	68.34	527,584.80
SEB SA	2,075	144.00	298,800.00
ACCOR	17,931	27.11	486,109.41
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,932	125.00	1,741,500.00

LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,508	30.28	166,782.24
SODEXO	8,135	63.84	519,338.40
BOLLORE	61,805	3.18	196,787.12
JC DECAUX SA	9,522	16.16	153,875.52
PUBLICIS GROUPE	21,469	30.12	646,646.28
SCOUT24 AG	9,470	75.05	710,723.50
SES	31,369	6.18	194,111.37
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	31.52	157,536.96
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,311	65.66	611,360.26
VIVENDI	77,307	23.85	1,843,771.95
DELIVERY HERO SE	11,471	86.96	997,518.16
INDITEX	101,980	23.04	2,349,619.20
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	88.76	1,009,378.72
PROSUS	45,138	80.20	3,620,067.60
ZALANDO SE	13,985	71.74	1,003,283.90
CARREFOUR	59,235	14.31	847,949.02
COLRUYT SA	5,424	53.00	287,472.00
JERONIMO MARTINS	24,901	13.75	342,513.25
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,264	24.86	2,567,143.04
METRO AG	13,712	8.38	114,906.56
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	69,515	49.21	3,420,833.15
DANONE (GROUPE)	56,282	56.18	3,161,922.76
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	8.78	430,896.06
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	68.75	735,693.75
HEINEKEN NV	24,387	76.76	1,871,946.12
KERRY GROUP PLC-A	14,641	112.80	1,651,504.80
PERNOD-RICARD	19,514	141.30	2,757,328.20
REMY COINTREAU	2,382	142.40	339,196.80
BEIERSDORF AG	9,190	96.92	890,694.80
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	74.25	756,607.50
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,398	85.36	1,314,373.28
LOREAL	22,685	273.90	6,213,421.50
UNILEVER NV	131,684	48.82	6,428,812.88
BIOMERIEUX	4,175	113.20	472,610.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	93.50	320,705.00
DIASORIN SPA	2,070	141.80	293,526.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	70.66	1,412,140.10
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,250	38.13	1,382,212.50
KONINKLIJKE PHILIPS	84,867	39.14	3,322,118.71
ORPEA	4,336	97.86	424,320.96
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	324.40	1,053,002.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,846	36.69	544,699.74

ARGENX SE	3,898	183.20	714,113.60
BAYER	88,266	54.28	4,791,078.48
EUROFINS SCIENTIFIC	1,158	647.60	749,920.80
GALAPAGOS NV	4,368	102.45	447,501.60
GRIFOLS SA	27,685	21.68	600,210.80
IPSEN	2,722	85.95	233,955.90
MERCK KGAA	12,078	115.30	1,392,593.40
ORION OYJ-CLASS B	9,854	37.82	372,678.28
QIAGEN N.V.	21,801	39.54	862,011.54
RECORDATI SPA	7,949	44.38	352,776.62
SANOFI	104,017	83.57	8,692,700.69
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	277.00	670,063.00
UCB (GROUPE)	10,800	96.16	1,038,528.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	29,696	8.24	244,813.82
BANCO BILBAO VIZCAYA	578,411	2.55	1,478,996.92
BANCO SANTANDER SA	1,512,323	1.90	2,881,882.70
BANKINTER SA	58,881	4.51	265,847.71
BNP PARIBAS	104,161	37.22	3,877,393.22
CAIXABANK	328,697	2.04	670,541.88
COMMERZBANK AG	75,494	5.15	388,794.10
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	8.67	931,704.21
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	20.28	558,916.80
FINECOBANK SPA	53,120	12.14	645,142.40
ING GROEP NV-CVA	354,047	6.97	2,467,707.59
INTESA SANPAOLO	1,460,677	1.77	2,597,960.11
KBC GROEP NV	24,002	47.71	1,145,135.42
MEDIOBANCA	53,990	7.16	387,000.32
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	15.05	187,974.50
SOCIETE GENERALE	79,076	13.67	1,081,285.22
UNICREDIT SPA	190,988	8.12	1,551,204.53
AMUNDI SA	6,226	63.60	395,973.60
DEUTSCHE BANK NAMEN	169,989	8.13	1,383,030.50
DEUTSCHE BOERSE	17,279	148.70	2,569,387.30
EURAZEO SA	3,357	46.12	154,824.84
EXOR NV	10,345	49.20	508,974.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,855	78.04	769,084.20
NATIXIS	114,996	2.37	273,460.48
SOFINA	1,238	234.00	289,692.00
WENDEL	2,023	84.25	170,437.75
AEGON	166,267	2.33	387,734.64
AGEAS	16,065	35.80	575,127.00
ALLIANZ SE-REG	37,636	178.68	6,724,800.48

ASSICURAZIONI GENERALI	98,533	12.82	1,263,193.06
AXA SA	176,230	17.18	3,027,631.40
CNP ASSURANCES	21,830	11.03	240,784.90
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	140.00	810,460.00
MAPFRE SA	90,939	1.56	141,955.77
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,766	241.30	3,080,435.80
NN GROUP NV	27,631	32.75	904,915.25
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.69	354,101.22
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	33.61	1,447,750.75
SCOR SE	13,354	22.24	296,992.96
AROUNDTOWN SA	111,346	4.70	523,548.89
DEUTSCHE WOHNEN SE	30,563	43.49	1,329,184.87
LEG IMMOBILIEN AG	5,781	119.00	687,939.00
VONOVIA SE	46,859	57.56	2,697,204.04
ADYEN NV	1,648	1,311.50	2,161,352.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	41,884	50.30	2,106,765.20
ATOS SE	9,750	71.08	693,030.00
CAPGEMINI SA	14,053	117.00	1,644,201.00
DASSAULT SYSTEMES SA	12,515	152.10	1,903,531.50
EDENRED	22,756	42.29	962,351.24
NEMETSCHKE SE	4,179	61.40	256,590.60
NEXI SPA	36,670	14.20	520,897.35
SAP SE	94,680	132.86	12,579,184.80
TEAMVIEWER AG	10,974	40.56	445,105.44
WORLDLINE SA	12,702	73.80	937,407.60
INGENICO GROUP	5,266	137.00	721,442.00
NOKIA OYJ	511,885	3.76	1,926,991.08
ALTICE NV -A	50,000	3.42	171,050.00
CELLNEX TELECOM SA	28,402	51.24	1,455,318.48
DEUTSCHE TELEKOM	298,969	14.97	4,477,060.77
ELISA A	11,943	48.55	579,832.65
ILIAD SA	1,253	169.35	212,195.55
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	8.20	249,075.00
KPN (KON.)	354,332	2.16	767,483.11
ORANGE	188,105	9.21	1,733,951.89
PROXIMUS	13,141	16.44	216,103.74
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.39	335,564.46
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.39	183,451.35
TELEFONICA	456,457	3.29	1,504,482.27
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	125,107	2.29	286,620.13
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	39.63	377,000.19
E.ON SE	203,050	9.79	1,988,265.60

	ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	8.64	530,041.43
	ELIA GROUP SA/NV	3,630	84.30	306,009.00
	ENAGAS	25,299	20.01	506,232.99
	ENDESA	31,750	22.91	727,392.50
	ENEL	731,990	7.41	5,425,509.88
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	4.13	975,736.16
	ENGIE	171,054	11.64	1,991,068.56
	FORTUM OYJ	41,901	16.93	709,593.43
	IBERDROLA SA	534,719	10.46	5,595,834.33
	NATURGY ENERGY GROUP SA	30,185	16.44	496,392.32
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	15.96	632,724.88
	RWE STAMM	56,470	31.29	1,766,946.30
	SNAM SPA	203,694	4.30	877,717.44
	SUEZ	28,043	15.12	424,150.37
	TERNA SPA	130,230	5.96	776,691.72
	UNIPER SE	20,192	25.96	524,184.32
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,667	19.54	1,029,376.51
	VERBUND AG	7,463	44.54	332,402.02
	ASML HOLDING NV	38,578	304.80	11,758,574.40
	INFINEON TECHNOLOGIES	115,347	22.78	2,627,604.66
	STMICROELECTRONICS	56,957	23.64	1,346,463.48
	ユーロ 小計	17,263,935		343,223,578.24 (43,201,551,793)
イギリスポンド	BP PLC	1,822,680	2.57	4,693,401.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	368,074	10.78	3,968,573.86
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	331,816	10.35	3,436,286.49
	ANGLO AMERICAN PLC	112,174	18.32	2,055,700.72
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	10.83	388,499.76
	BHP GROUP PLC	195,828	16.55	3,241,736.71
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,371	58.24	662,247.04
	EVRAZ PLC	43,000	3.27	140,696.00
	GLENCORE PLC	901,837	1.71	1,546,109.35
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	24.26	408,732.48
	MONDI PLC	47,780	14.39	687,554.20
	RIO TINTO PLC REG	100,902	45.75	4,616,771.01
	ASHTREAD GROUP PLC	42,021	25.61	1,076,157.81
	BAE SYSTEMS PLC	280,704	5.03	1,414,186.75
	BUNZL PLC	33,283	23.64	786,810.12
	DCC PLC	9,127	62.56	570,985.12
	FERGUSON PLC	20,559	70.80	1,455,577.20
	MELROSE INDUSTRIES PLC	508,486	1.15	587,555.57
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	205,244	2.17	446,405.70

SMITHS GROUP PLC	37,146	13.79	512,429.07
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,255	101.75	738,196.25
EXPERIAN PLC	82,501	26.70	2,202,776.70
INTERTEK GROUP PLC	15,404	58.32	898,361.28
RELX PLC	176,194	16.94	2,985,607.33
RENTOKIL INITIAL PLC	181,066	5.09	922,712.33
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	5.01	484,081.44
BURBERRY GROUP PLC	40,410	14.66	592,410.60
PERSIMMON PLC	31,506	25.03	788,595.18
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.14	408,790.19
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	44.75	474,305.25
COMPASS GROUP PLC	162,339	12.50	2,029,237.50
GVC HOLDINGS PLC	59,240	8.09	479,251.60
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	44.27	710,135.07
WHITBREAD PLC	17,434	25.26	440,382.84
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.41	526,506.61
INFORMA PLC	128,525	3.95	508,059.32
PEARSON	66,305	5.21	345,449.05
WPP PLC	113,065	6.28	710,726.59
JD SPORTS FASHION PLC	32,000	7.15	228,800.00
KINGFISHER PLC	170,994	2.70	462,709.76
NEXT PLC	13,238	56.98	754,301.24
OCADO GROUP PLC	44,612	22.92	1,022,507.04
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.90	399,472.23
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.82	271,156.38
TESCO	919,600	2.15	1,984,496.80
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,908	20.27	626,505.16
BRITISH AMERICAN TOBACCO	206,613	25.54	5,277,929.08
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	20.13	361,534.80
DIAGEO	210,514	24.96	5,255,482.01
IMPERIAL BRANDS PLC	91,416	13.04	1,192,064.64
RECKITT BENCKISER PLC	63,909	71.04	4,540,095.36
UNILEVER PLC	105,087	44.26	4,651,150.62
SMITH & NEPHEW PLC	83,051	14.92	1,239,120.92
ASTRAZENECA	118,864	79.70	9,473,460.80
GLAXOSMITHKLINE	461,217	14.35	6,619,386.38
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	24.57	404,274.78
BARCLAYS	1,522,945	1.06	1,627,723.61
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,837,218	3.19	5,874,504.55
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,637,108	0.26	1,788,036.89
NATWEST GROUP PLC	479,086	1.07	516,454.70
STANDARD CHARTERED PLC	254,760	3.75	956,114.28

	3I GROUP PLC	88,121	8.70	767,005.18
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	15.39	509,251.20
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	28,781	84.88	2,442,931.28
	M&G PLC	229,107	1.57	360,614.41
	SCHRODERS PLC	11,794	27.01	318,555.94
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	9.23	413,221.50
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	233,327	2.24	524,752.42
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	25.56	415,477.80
	AVIVA PIC	381,270	2.73	1,043,154.72
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.88	327,499.20
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.04	1,124,013.65
	PRUDENTIAL	232,560	11.35	2,639,556.00
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	4.37	378,171.06
	AVEVA GROUP PLC	6,717	47.18	316,908.06
	SAGE GROUP PLC	95,210	7.03	669,326.30
	HALMA PLC	37,159	21.58	801,891.22
	BT GROUP PLC	817,227	1.01	830,711.24
	VODAFONE GROUP PLC	2,475,816	1.05	2,606,043.92
	NATIONAL GRID PLC	319,792	8.33	2,665,146.52
	SEVERN TRENT PLC	18,923	23.60	446,582.80
	SSE PLC	100,354	12.02	1,206,756.85
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	8.35	560,853.50
	イギリスポンド 小計	26,445,425		125,837,707.89 (17,734,308,172)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.91	329,083.17
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	811.00	659,343.00
	GIVAUDAN-REG	849	3,799.00	3,225,351.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	47,484	42.07	1,997,651.88
	SIKA AG-BR	12,877	213.10	2,744,088.70
	ABB LTD	168,308	23.23	3,909,794.84
	GEBERIT AG-REG	3,423	509.40	1,743,676.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	238.60	503,923.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	241.10	908,464.80
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	47.34	626,024.16
	SGS SA	586	2,351.00	1,377,686.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	171.75	870,257.25
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	47,970	61.82	2,965,505.40
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	199.65	495,730.95
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	37.96	149,486.48
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,024.00	566,720.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	80,100.00	801,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,585.00	788,840.00

	NESTLE SA - REGISTERED	270,609	108.32	29,312,366.88
	ALCON INC	44,953	50.52	2,271,025.56
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,138	207.60	1,066,648.80
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,014	886.20	898,606.80
	LONZA GROUP AG-REG	6,876	539.20	3,707,539.20
	NOVARTIS	201,435	78.78	15,869,049.30
	ROCHE HOLDING GENUSS	63,807	317.25	20,242,770.75
	VIFOR PHARMA AG	4,486	122.50	549,535.00
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,550	95.80	340,090.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	220,884	9.94	2,195,586.96
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	41.58	880,539.66
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,620	868.00	1,406,160.00
	UBS GROUP AG	338,963	11.14	3,776,047.82
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,805	140.40	674,622.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	368.50	1,049,856.50
	SWISS RE LTD	25,792	73.50	1,895,712.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,901	334.70	4,652,664.70
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	81.80	610,064.40
	TEMENOS AG - REG	6,511	136.35	887,774.85
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	62.74	921,399.64
	SWISSCOM	2,441	502.60	1,226,846.60
	スイスフラン 小計	1,593,649		119,097,534.45 (13,867,716,911)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	201.40	3,468,510.80
	BOLIDEN AB	23,903	263.80	6,305,611.40
	SCA SV CELLULOSA B	51,834	115.10	5,966,093.40
	ALFA LAVAL AB	27,268	205.20	5,595,393.60
	ASSA ABLOY AB-B	90,383	200.60	18,130,829.80
	ATLAS COPCO A	59,356	397.60	23,599,945.60
	ATLAS COPCO B	36,538	352.20	12,868,683.60
	EPIROC AB-A	58,039	128.60	7,463,815.40
	EPIROC AB-B	29,972	124.15	3,721,023.80
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	11,162	192.10	2,144,220.20
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,906	227.60	6,123,805.60
	SANDVIK AB	101,932	172.90	17,624,042.80
	SKANSKA B	28,530	175.85	5,017,000.50
	SKF AB-B	35,405	179.65	6,360,508.25
	VOLVO B	134,889	171.15	23,086,252.35
	SECURITAS B	25,130	121.25	3,047,012.50
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	185.45	3,369,626.50
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	91.54	3,543,696.48
	EVOLUTION GAMING GROUP	11,183	573.60	6,414,568.80

	HENNES & MAURITZ B	77,319	137.60	10,639,094.40	
	ICA GRUPPEN AB	7,959	424.50	3,378,595.50	
	SWEDISH MATCH AB	16,014	655.80	10,501,981.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,085	295.00	16,840,075.00	
	NORDEA BANK ABP	284,669	69.29	19,724,715.01	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	155,710	83.74	13,039,155.40	
	SVENSKA HANDELSBK A	150,386	83.32	12,530,161.52	
	SWEDBANK AB-A	86,716	145.36	12,605,037.76	
	EQT AB	20,102	159.05	3,197,223.10	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	229.80	3,858,801.60	
	INVESTOR AB-B SHS	41,257	549.20	22,658,344.40	
	KINNEVIK AB - B	23,604	318.70	7,522,594.80	
	KINNEVIK AB -B - REDEMPTION	23,604	7.00	165,228.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	401.00	2,919,280.00	
	ERICSSON (LM) B	263,755	98.00	25,847,990.00	
	HEXAGON AB-B SHS	26,504	631.80	16,745,227.20	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	124.55	6,228,994.60	
	TELIA CO AB	212,811	34.19	7,276,008.09	
	スウェーデンクローナ 小計	2,348,113		359,529,148.96 (4,379,065,034)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	92,158	138.75	12,786,922.50	
	NORSK HYDRO	106,150	27.59	2,928,678.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	360.70	6,662,129.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	150.60	2,879,020.20	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	334.60	2,332,496.60	
	MOWI ASA	40,968	173.80	7,120,238.40	
	ORKLA	69,804	89.12	6,220,932.48	
	DNB ASA	85,517	137.95	11,797,070.15	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	183.40	3,406,471.60	
	TELENOR ASA	71,821	147.80	10,615,143.80	
	ノルウェークローネ 小計	529,550		66,749,103.23 (794,981,819)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	686.80	7,106,319.60	
	NOVOZYMES A/S	19,125	378.40	7,236,900.00	
	VESTAS WIND SYSEMS	17,951	924.60	16,597,494.60	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,875.00	2,653,625.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	649	9,606.00	6,234,294.00	
	DSV PANALPINA A S	18,784	950.20	17,848,556.80	
	PANDORA A/S	8,431	465.00	3,920,415.00	
	CARLSBERG AS-B	9,141	871.00	7,961,811.00	
	AMBU A/S-B	13,555	169.30	2,294,861.50	
	COLOPLAST-B	11,223	999.60	11,218,510.80	

	DEMANT A/S	11,604	184.65	2,142,678.60
	GN STORE NORD A/S	11,117	438.90	4,879,251.30
	GENMAB A/S	5,888	2,178.00	12,824,064.00
	H LUNDBECK A/S	4,871	200.50	976,635.50
	NOVO NORDISK A/S-B	158,418	408.90	64,777,120.20
	DANSKE BANK A/S	57,713	90.34	5,213,792.42
	TRYG A/S	9,828	186.80	1,835,870.40
	ORSTED A/S	17,372	848.20	14,734,930.40
	デンマーククローネ 小計	386,316		190,457,131.12 (3,222,534,658)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	25.00	515,725.00
	OIL SEARCH LTD	144,170	3.11	448,368.70
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	5.33	882,621.35
	SANTOS	156,437	5.31	830,680.47
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	20.61	264,075.93
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,829	18.97	1,723,026.13
	BHP GROUP LTD	265,490	36.19	9,608,083.10
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	12.92	637,317.76
	EVOLUTION MINING LTD	126,532	5.52	698,456.64
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	154,776	17.52	2,711,675.52
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	43,228	30.14	1,302,891.92
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	30.86	2,286,664.28
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	64,628	13.15	849,858.20
	ORICA LTD	44,211	17.04	753,355.44
	RIO TINTO LTD	32,650	95.58	3,120,687.00
	SOUTH32 LTD	481,840	2.15	1,035,956.00
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	20.82	191,960.40
	BRAMBLES LTD	137,883	10.87	1,498,788.21
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	4.32	827,241.12
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	3.89	330,650.00
	TRANSURBAN GROUP	240,667	14.14	3,403,031.38
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	29.06	1,532,973.12
	CROWN RESORTS LTD	30,328	9.16	277,804.48
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	3.55	646,146.15
	REA GROUP LTD	5,276	112.81	595,185.56
	SEEK LTD	26,358	20.16	531,377.28
WESFARMERS LTD	103,282	46.74	4,827,400.68	
COLES GROUP LTD	128,408	17.11	2,197,060.88	
WOOLWORTHS GROUP LTD	114,869	38.01	4,366,170.69	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.07	418,399.10	
TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	9.02	636,252.76	
COCHLEAR LIMITED	6,220	190.04	1,182,048.80	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	64.70	1,051,245.60	
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	32.51	1,302,870.76	
	CSL LIMITED	41,726	279.05	11,643,640.30	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	258,217	17.81	4,598,844.77	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	159,681	66.73	10,655,513.13	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	295,326	17.35	5,123,906.10	
	WESTPAC BANKING	334,568	17.06	5,707,730.08	
	AMP LTD	343,649	1.63	560,147.87	
	ASX LTD	16,798	85.90	1,442,948.20	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	30,997	126.20	3,911,821.40	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	58.52	638,570.24	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	4.75	994,436.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	2.54	685,444.40	
	QBE INSURANCE GROUP	127,160	9.82	1,248,711.20	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	9.07	1,082,540.78	
	AFTERPAY LTD	18,973	78.20	1,483,688.60	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	12.74	565,350.24	
	WISETECH GLOBAL LTD	18,000	27.53	495,540.00	
	TELSTRA CORP	403,126	2.84	1,144,877.84	
	TPG TELECOM LTD	31,475	7.81	245,819.75	
	AGL ENERGY LTD	64,235	15.02	964,809.70	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.85	346,218.25	
	オーストラリアドル 小計	6,398,946		107,026,609.51 (8,294,562,237)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	136,010	7.08	963,630.85	
	A2 MILK CO LTD	66,854	18.27	1,221,422.58	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	34.25	1,867,310.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.88	504,079.96	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	198,932	4.81	956,862.92	
	MERCURY NZ LTD	85,000	5.19	441,150.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.94	546,640.08	
	ニュージーランドドル 小計	688,177		6,501,096.39 (464,113,271)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,496	50.00	12,824,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	118,500	95.60	11,328,600.00	
	MTR CORP	151,000	40.05	6,047,550.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	187,000	59.80	11,182,600.00	
	SANDS CHINA LTD	242,800	33.50	8,133,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	10.54	1,391,280.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	14.46	2,035,968.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	25.30	3,691,270.00	
	WH GROUP LTD	936,500	6.62	6,199,630.00	

	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	54,000	37.20	2,008,800.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	17.18	1,875,368.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	360,500	21.70	7,822,850.00	
	HANG SENG BANK	74,200	119.10	8,837,220.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	111,400	380.60	42,398,840.00	
	AIA GROUP LTD	1,094,000	78.00	85,332,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	229,496	41.10	9,432,285.60	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	20.95	3,624,350.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	29.30	3,669,180.40	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	20.25	1,306,125.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	155,375	39.40	6,121,775.00	
	PACIFIC CENTURY PREMIUM DEVE	38,556	1.79	69,015.24	
	SINO LAND CO	315,400	9.05	2,854,370.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	99.50	11,790,750.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	41.60	1,684,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	20.25	1,948,050.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	143,000	32.10	4,590,300.00	
	PCCW LTD	357,000	4.52	1,613,640.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	39.30	2,652,750.00	
	CLP HOLDINGS	157,000	75.30	11,822,100.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,030,579	11.10	11,439,426.90	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	42.65	5,864,375.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	82.30	1,950,510.00	
	香港ドル 小計	7,387,290		293,544,379.94 (4,027,428,892)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	116,500	4.36	507,940.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,500	3.42	374,490.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	0.93	185,907.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	3.62	392,161.84	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.69	427,425.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	18.56	183,744.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.37	780,482.00	
	DBS GROUP	162,400	20.68	3,358,432.00	
	OCBC BANK	315,600	8.56	2,701,536.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	105,200	19.45	2,046,140.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	8.68	679,644.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	2.75	614,625.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.95	340,260.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.55	311,125.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	19.06	489,842.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.27	1,707,591.61	
		3,090,975		15,101,345.45	

シンガポールドル 小計				(1,176,696,837)
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	12.11	820,525.16
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	431.70	926,428.20
	BANK HAPOALIM BM	98,310	19.60	1,926,876.00
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	16.51	2,322,214.05
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	10.29	1,023,855.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	66.60	832,699.80
	AZRIELI GROUP	4,323	172.10	743,988.30
	NICE LTD	5,312	746.00	3,962,752.00
イスラエルシェケル 小計		430,505		12,559,338.51 (396,498,316)
合 計		98,296,132		398,625,261,572 (398,625,261,572)

(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	114,413	1,199,048.24	
		LENDLEASE GROUP	55,692	679,999.32	
		SYDNEY AIRPORT	107,308	629,897.96	
	オーストラリアドル 小計		277,413	2,508,945.52 (194,443,277)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,748,565.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,997,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,746,065.00 (78,836,011)	
	投資信託受益証券合計			872,913	273,279,288 (273,279,288)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	640,238.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,175	1,859,855.25	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	40,774	10,192,684.52	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	917,393.64	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	2,163,224.50	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,144,076.49	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	818,953.72	
		CROWN CASTLE INTL CORP	37,466	6,016,664.94	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,642,711.38	
		DUKE REALTY CORP	35,040	1,337,476.80	
		EQUINIX INC	8,137	6,120,488.66	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,086,929.68	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35,477	2,061,568.47	

	ESSEX PROPERTY TRUST	6,320	1,417,323.20
	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,327	1,335,630.45
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,257	595,509.42
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47,101	1,335,313.35
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	808,445.46
	INVITATION HOMES INC	51,458	1,475,300.86
	IRON MOUNTAIN INC	27,546	830,787.36
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	920,662.40
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,915	1,291,790.25
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,505	618,112.25
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	667,386.60
	PROLOGIS INC	66,488	6,699,330.88
	PUBLIC STORAGE	13,935	2,956,170.90
	REALTY INCOME CORP	30,398	1,956,719.26
	REGENCY CENTERS CORP	17,800	739,234.00
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,143	3,045,841.47
	SIMON PROPERTY GROUP	27,990	1,966,017.60
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,320,679.85
	UDR INC	28,059	990,763.29
	VENTAS INC	33,353	1,486,209.68
	VEREIT INC	105,798	735,296.10
	VICI PROPERTIES INC	44,224	1,011,845.12
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	566,044.20
	WELLTOWER INC	38,031	2,324,454.72
	WP CAREY INC	16,500	1,155,825.00
	アメリカドル 小計	1,191,808	76,252,960.12 (8,110,264,838)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	389,694.95
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,465	170,396.55
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	231,420.60
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	118,025.76
	カナダドル 小計	42,473	909,537.86 (73,972,714)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	300,945.30
	GECINA SA	4,459	495,394.90
	ICADE	2,845	149,647.00
	KLEPIERRE	17,225	237,963.37
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,695	529,585.65
	ユーロ 小計	43,186	1,713,536.22 (215,682,804)
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	280,172.59
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	318,570.55
	SEGRO PLC	106,999	981,822.82

	イギリスポンド 小計		244,963	1,580,565.96 (222,749,160)	
オーストラリアドル	DEXUS		94,090	851,514.50	
	GOODMAN GROUP		147,935	2,685,020.25	
	GPT GROUP		167,884	634,601.52	
	MIRVAC GROUP		392,919	829,059.09	
	SCENTRE GROUP		486,663	1,060,925.34	
	STOCKLAND		207,412	761,202.04	
	VICINITY CENTERS		291,115	403,194.27	
	オーストラリアドル 小計		1,788,018	7,225,517.01 (559,977,568)	
香港ドル	LINK REIT		199,000	12,537,000.00	
	香港ドル 小計		199,000	12,537,000.00 (172,007,640)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		274,000	898,720.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		243,000	400,950.00	
	CAPITALAND MALL TRUST		200,300	386,579.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		220,000	435,600.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST		215,000	440,750.00	
	SUNTEC REIT		173,000	243,930.00	
	シンガポールドル 小計		1,325,300	2,806,529.00 (218,684,739)	
	投資証券合計		4,834,748	9,573,339,463 (9,573,339,463)	
	合計			9,846,618,751 (9,846,618,751)	

(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 592銘柄	97.3%			70.3%
	投資証券 38銘柄			2.7%	2.0%
カナダドル	株式 80銘柄	99.5%			3.4%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.5%			10.6%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.1%

イギリスポンド	株式	83銘柄	98.8%			4.3%
	投資証券	3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式	37銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式	54銘柄	91.7%			2.0%
	投資信託受益証券	3銘柄		2.1%		0.0%
	投資証券	7銘柄			6.2%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	32銘柄	94.1%			1.0%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券	1銘柄			4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	84.3%			0.3%
	投資証券	6銘柄			15.7%	0.1%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 9月 7日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,189,352,171
投資証券	107,115,876,010
未収入金	29,613,993
未収配当金	1,521,507,149
前払金	32,718,160
差入委託証拠金	704,076,500
流動資産合計	110,593,143,983
資産合計	110,593,143,983
負債の部	
流動負債	

	2020年 9月 7日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	32,718,160
未払金	4,335,740
未払解約金	132,144,973
未払利息	2,913
流動負債合計	169,201,786
負債合計	169,201,786
純資産の部	
元本等	
元本	63,382,035,403
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	47,041,906,794
元本等合計	110,423,942,197
純資産合計	110,423,942,197
負債純資産合計	110,593,143,983

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 9月 7日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 9月 7日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		63,382,035,403口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7422円 (17,422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

	2020年 9月 7日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 9月 7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。

	2020年 9月 7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	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 9月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	56,676,784,641円
期中追加設定元本額	18,725,153,083円
期中一部解約元本額	12,019,902,321円
期末元本額	63,382,035,403円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,632,207,412円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,307,128円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	15,635,778,312円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	26,710,436,291円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,260,170,305円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,024,464,783円

区分	2020年 9月 7日現在
分散投資コア戦略ファンドA	3,037,286,626円
分散投資コア戦略ファンドS	6,134,762,810円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,107,909,967円
SMT インデックスバランス・オープン	30,226,219円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	427,055,025円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,642,742円
グローバル経済コア	272,725,248円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	7,936,827円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	489,812,542円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	45,239,764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)	942,697,571円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	4,562,822円
J-REITパッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	311,533円
J-REITパッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	910,487,112円
J-REITパッシブ・ファンド 2018-11(適格機関投資家専用)	385,565,768円
J-REITパッシブ・ファンド 2019-03(適格機関投資家専用)	313,448,596円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 9月 7日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	21,284,366,750	
合計	21,284,366,750	

(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

(2020年 9月 7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	3,304,534,160	-	3,271,816,000	32,718,160
合計		3,304,534,160	-	3,271,816,000	32,718,160

(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	1,952	197,542,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	2,923	265,700,700	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,661	354,445,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,969	2,480,625,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	14,615	1,145,816,000	
	森ヒルズリート投資法人	14,031	1,857,704,400	
	産業ファンド投資法人	16,884	3,010,417,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,346	3,483,222,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,793	1,447,939,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,985	2,411,955,000	
	G L P 投資法人	34,345	5,587,931,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,212	1,646,992,000	
	日本プロロジスリート投資法人	18,074	6,244,567,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1,817	874,885,500	
	O n e リート投資法人	1,862	456,562,400	
	イオンリート投資法人	12,115	1,375,052,500	
	ヒューリックリート投資法人	9,616	1,317,392,000	
	日本リート投資法人	3,880	1,390,980,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	76,738	1,102,725,060	
	積水ハウス・リート投資法人	35,132	2,613,820,800	
	トーセイ・リート投資法人	2,643	281,479,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,392	944,280,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,548	307,288,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,300	228,620,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	38,626	5,036,830,400	
	いちごホテルリート投資法人	2,089	144,976,600	
	ラサールロジポート投資法人	13,311	2,297,478,600	
スターアジア不動産投資法人	12,273	533,875,500		
マリモ地方創生リート投資法人	1,119	114,361,800		

三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,422	1,796,550,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,928	121,464,000	
投資法人みらい	12,900	490,845,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,587	271,635,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,688	1,131,648,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	3,260	489,000,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,830	158,295,000	
タカラレーベン不動産投資法人	3,589	304,347,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,772	540,904,800	
日本ビルファンド投資法人	11,567	7,194,674,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,945	6,844,485,000	
日本リートールファンド投資法人	22,575	3,582,652,500	
オリックス不動産投資法人	23,799	3,688,845,000	
日本プライムリアルティ投資法人	7,437	2,353,810,500	
プレミア投資法人	10,789	1,300,074,500	
東急リアル・エステート投資法人	8,008	1,107,506,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,294	863,405,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	25,545	2,914,684,500	
森トラスト総合リート投資法人	8,537	1,161,032,000	
インヴィンシブル投資法人	49,944	1,538,275,200	
フロンティア不動産投資法人	3,964	1,373,526,000	
平和不動産リート投資法人	7,438	885,865,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,804	2,188,241,600	
福岡リート投資法人	6,178	829,705,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,695	2,268,730,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,910	734,331,000	
大和証券オフィス投資法人	2,545	1,501,550,000	
阪急阪神リート投資法人	5,395	631,754,500	
スターツプロシード投資法人	1,860	370,326,000	
大和ハウスリート投資法人	17,043	4,516,395,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	38,479	1,864,307,550	
大和証券リビング投資法人	15,069	1,583,751,900	
ジャパンエクセレント投資法人	11,084	1,357,790,000	
合計	715,131	107,115,876,010	

(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

	2020年 9月 7日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	634,746,729
コール・ローン	104,739,085
投資証券	88,337,491,306
派生商品評価勘定	189,785
未収入金	2,397,931
未収配当金	106,429,059
流動資産合計	89,185,993,895
資産合計	89,185,993,895
負債の部	
流動負債	
未払金	409,774,158
未払解約金	19,186,948
未払利息	256
流動負債合計	428,961,362
負債合計	428,961,362
純資産の部	
元本等	
元本	53,636,262,825
剰余金	
剰余金又は欠損金()	35,120,769,708
元本等合計	88,757,032,533
純資産合計	88,757,032,533
負債純資産合計	89,185,993,895

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 9月 7日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

2020年 9月 7日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資信託受益証券は、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。 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月 7日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	53,636,262,825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 1.6548円 (1万口当たり純資産額) (16,548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

2020年 9月 7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。

	2020年 9月 7日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 9月 7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 9月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 9月 6日
期首元本額	40,906,320,235円
期中追加設定元本額	23,320,717,219円
期中一部解約元本額	10,590,774,629円
期末元本額	53,636,262,825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	96,683,160円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	142,414,037円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,659,723,698円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,494,831円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,056,722,814円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	23,412,307,137円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,438,322,562円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,051,476,108円
分散投資コア戦略ファンドA	2,064,264,171円
分散投資コア戦略ファンドS	6,033,991,193円
コア投資戦略ファンド（切替型）	971,406,530円
SMT インデックスバランス・オープン	181,344,610円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	461,760,605円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,991,042円
グローバル経済コア	278,714,336円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	8,195,234円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	321,460,040円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	48,445,983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）	1,081,162,558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）	798,561,909円

区分	2020年 9月 7日現在
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	46,649,597円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	158,797,646円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	158,687,384円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	155,685,640円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 9月 7日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	12,344,075,290	
合計	12,344,075,290	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2020年 9月 7日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	80,827,615	-	81,012,900	185,285
	アメリカドル	71,119,495	-	71,254,500	135,005
	カナダドル	9,708,120	-	9,758,400	50,280
	売建	13,952,700	-	13,948,200	4,500
	オーストラリアドル	13,952,700	-	13,948,200	4,500
合計		94,780,315	-	94,961,100	189,785

(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。

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。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	63,440	771,430.40	
		AGREE REALTY CORP	38,856	2,580,426.96	
		ALEXANDER'S INC	1,490	396,444.30	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	92,431	15,383,291.33	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	35,495	928,194.25	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	99,146	3,551,409.72	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	83,590	573,427.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	184,968	5,299,333.20	
		AMERICOLD REALTY TRUST	145,140	5,506,611.60	
		APARTMENT INVEST & MGMT	107,390	4,021,755.50	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	150,263	1,667,919.30	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	287,500	103,500.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,603	19,280.76	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	103,045	16,703,594.50	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	26,850	202,449.00	
		BOSTON PROPERTIES	106,230	9,328,056.30	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,700	56,750.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	121,120	1,356,544.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	212,803	2,774,951.12	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	42,700	478,667.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	65,600.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	70,570	6,576,418.30	
		CARETRUST REIT INC	72,760	1,416,637.20	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	99,840	18,280.70	
		CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	45,196.50	
		CHATHAM LODGING TRUST	37,360	295,517.60	
		CITY OFFICE REIT INC	37,050	298,993.50	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	48,107.00	
		COLONY CAPITAL INC	365,084	1,000,330.16	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	85,383	1,040,818.77	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	16,300	774,576.00	
		CORECIVIC INC	84,463	801,553.87	
		COREPOINT LODGING INC	22,000	127,160.00	
CORESITE REALTY CORP	29,048	3,389,030.16			
CORPORATE OFFICE PPTYS	80,859	1,954,362.03			
COUSINS PROPERTIES INC	106,974	3,192,104.16			
CUBESMART	139,797	4,465,116.18			

CYRUSONE INC	83,190	6,478,005.30	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	150,540	871,626.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC	196,012	28,457,022.16	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	180,800	713,256.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	118,755	3,303,764.10	
DUKE REALTY CORP	266,740	10,181,465.80	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	53,268	1,264,049.64	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	28,168	3,716,485.92	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	110,335	735,934.45	
EPR PROPERTIES	55,082	1,892,066.70	
EQUINIX INC	64,590	48,583,306.20	
EQUITY COMMONWEALTH	87,589	2,737,156.25	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	131,800	8,648,716.00	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	256,291	14,893,070.01	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	69,910	1,277,954.80	
ESSEX PROPERTY TRUST	48,040	10,773,450.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	93,440	10,124,224.00	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	125,400.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	50,754	4,164,873.24	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	91,767	3,815,671.86	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	49,850	1,293,109.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	78,973	348,270.93	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	37,530	371,171.70	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	149,978	5,646,671.70	
GEO GROUP INC/THE	85,306	940,072.12	
GETTY REALTY CORP	25,485	742,632.90	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	25,650	477,090.00	
GLADSTONE LAND CORP	11,500	175,950.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	34,430	461,706.30	
GLOBAL NET LEASE INC	64,892	1,136,258.92	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	96,998	2,872,110.78	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	157,686	4,191,293.88	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	390,090	11,059,051.50	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	25,650	172,111.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	74,694	2,757,702.48	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	511,126	6,102,844.44	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	110,130	2,647,525.20	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	68,388	830,230.32	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	48,270	1,054,216.80	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	15,933	1,875,632.76	

INVESTORS REAL ESTATE TRUST	8,899	624,175.86
INVITATION HOMES INC	399,030	11,440,190.10
IRON MOUNTAIN INC	208,357	6,284,047.12
JBG SMITH PROPERTIES	84,342	2,344,707.60
KILROY REALTY CORPORATION	76,470	4,427,613.00
KIMCO REALTY CORP	311,939	3,949,147.74
KITE REALTY GROUP TRUST	61,020	768,241.80
LEXINGTON CORP PROPERTIES	198,952	2,242,189.04
LIFE STORAGE INC	34,008	3,662,661.60
LTC PROPERTIES INC	27,626	1,030,173.54
MACERICH CO/THE	80,017	661,740.59
MACK-CALI REALTY CORP	70,670	934,964.10
MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,066,564	794,590.18
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	381,992	7,028,652.80
MID-AMERICA APARTMENT COMM	82,760	9,794,646.00
MONMOUTH REIT -CL A	71,052	1,031,675.04
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	124,205	4,651,477.25
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	44,340	1,514,654.40
NATL HEALTH INVESTORS INC	33,445	2,139,142.20
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	63,000	281,610.00
NEXPOINT RESIDENTIAL	17,500	707,700.00
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	36,330	862,110.90
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	164,489	5,230,750.20
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	13,136	252,079.84
PARAMOUNT GROUP INC	142,226	1,072,384.04
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	168,994	1,789,646.46
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	96,915	1,290,907.80
PENN REAL ESTATE INVEST TST	44,970	45,419.70
PHYSICIANS REALTY TRUST	145,531	2,744,714.66
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	90,485	1,403,422.35
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,300	113,129.00
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	46,280	312,852.80
PRIME US REIT	295,000	234,525.00
PROLOGIS INC	538,890	54,298,556.40
PS BUSINESS PARKS INC	15,000	1,880,850.00
PUBLIC STORAGE	109,897	23,313,549.58
QTS REALTY TRUST INC	43,348	2,828,457.00
REALTY INCOME CORP	251,511	16,189,763.07
REGENCY CENTERS CORP	122,791	5,099,510.23
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	87,770	1,059,822.75
RETAIL PROPRTISE OF AME-A	165,590	1,144,226.90
RETAIL VALUE	8,969	113,368.16

REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	88,563	4,189,915.53	
RLJ LODGING TRUST	123,769	1,243,878.45	
RPT REALTY	58,950	379,048.50	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	38,990	1,569,737.40	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	147,856	2,268,111.04	
SAFEHOLD INC	9,940	580,794.20	
SAUL CENTERS INC	8,800	248,600.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	22,900	357,698.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	117,070	1,033,142.75	
SIMON PROPERTY GROUP	223,973	15,731,863.52	
SITE CENTERS CORP	111,320	923,956.00	
SL GREEN REALTY CORP	55,000	2,705,450.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	77,319	2,819,823.93	
STAG INDUSTRIAL INC	107,430	3,471,063.30	
STORE CAPITAL CORP	160,678	4,484,522.98	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	76,470	462,643.50	
SUN COMMUNITIES INC	71,190	10,371,671.10	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	162,412	1,391,870.84	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	75,170	441,247.90	
TAUBMAN CENTERS INC	43,950	1,681,527.00	
TERRENO REALTY CORP	48,907	2,826,335.53	
UDR INC	213,280	7,530,916.80	
UMH PROPERTIES INC	27,000	391,500.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	10,040	687,840.40	
URBAN EDGE PROPERTIES	78,480	908,798.40	
URSTADT BIDDLE - CL A	22,500	220,275.00	
VENTAS INC	270,380	12,048,132.80	
VEREIT INC	779,420	5,416,969.00	
VICI PROPERTIES INC	338,906	7,754,169.28	
VORNADO REALTY TRUST	114,505	4,211,493.90	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	140,250	93,757.12	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	62,270	1,366,826.50	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	89,810	1,681,243.20	
WELLTOWER INC	305,565	18,676,132.80	
WHITESTONE REIT	38,340	253,427.40	
WP CAREY INC	126,790	8,881,639.50	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	82,830	784,400.10	
アメリカドル 小計	18,330,761	622,851,876.90 (66,246,525,627)	
カナダドル			
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	41,942	1,580,374.56	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	389,648.70	

BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	19,560	577,411.20	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	61,420	2,693,267.00	
CHOICE PROPERTIES REIT	108,670	1,340,987.80	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	70,620	499,989.60	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,577	525,877.92	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	40,730	567,776.20	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	55,550	605,495.00	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	361,155.80	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	74,815	1,022,721.05	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,020	1,671,538.20	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	102,539	1,070,507.16	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	43,490	539,276.00	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	38,900	670,247.00	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	15,100	263,797.00	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	194,123.40	
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	23,400	800,046.00	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	69,170	799,605.20	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	108,631	1,622,947.14	
SLATE GROCERY REIT	10,300	108,562.00	
SLATE OFFICE REI	17,000	64,430.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	48,076	1,007,672.96	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	554,130.00	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	151,188.00	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	32,500	553,475.00	
カナダドル 小計	1,193,350	20,236,249.89 (1,645,814,203)	
ユーロ			
AEDIFICA	19,900	1,993,980.00	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	112,190	1,370,961.80	
ALTAREA	2,730	333,060.00	
BEFIMMO S.C.A.	16,810	649,706.50	
COFINIMMO	18,467	2,230,813.60	
COVIVIO(FP)	34,732	2,106,495.80	
EUROCOMMERCIAL	29,690	287,102.30	
GECINA SA	40,350	4,482,885.00	
HAMBORNER REIT AG	59,000	503,152.00	
HIBERNIA REIT PLC	482,550	550,107.00	
ICADE	19,880	1,045,688.00	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	105,593.75	

	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	172,062	1,197,551.52	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	15,300	332,010.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	328,021	460,541.48	
	KLEPIERRE	152,040	2,100,432.60	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	54,000	227,340.00	
	MERCIALYS	23,450	130,382.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	268,418	1,908,451.98	
	MONTEA	8,100	824,580.00	
	NSI NV	12,300	362,850.00	
	RETAIL ESTATES	7,600	433,200.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	98,892	3,824,153.64	
	VASTNED RETAIL	13,750	338,250.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	92,670	2,721,717.90	
	WERELDHAVE NV	28,770	204,267.00	
	ユーロ 小計	2,145,462	30,725,273.87 (3,867,390,222)	
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	118,000	90,978.00	
	ASSURA PLC	1,917,040	1,533,632.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	117,746	1,238,687.92	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	615,000	402,825.00	
	BRITISH LAND CO PLC	676,850	2,387,926.80	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	615,297	813,422.63	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	29,000	20,300.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	466,910	516,402.46	
	DERWENT LONDON PLC	76,241	2,066,131.10	
	ELITE COMMERCIAL REIT	131,700	86,922.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	496,000	341,744.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	182,280	1,064,150.64	
	HAMMERSON PLC	116,320	308,480.64	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	541,342	2,945,441.82	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	667,660	1,534,282.68	
	LXI REIT PLC	415,000	454,840.00	
	NEWRIVER REIT PL	218,000	122,298.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	450,000	313,650.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	946,207	1,438,234.64	
	RDI REIT PLC	154,400	136,644.00	
	REGIONAL REIT LTD	292,000	207,904.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	150,396	1,150,529.40	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	100,450.00	
SEGRO PLC	874,070	8,020,466.32		
SHAFTESBURY PLC	160,293	855,163.15		

	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	273,286	295,148.88
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,225,658	1,892,415.95
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	652,000	431,624.00
	UNITE GROUP PLC	286,492	2,715,944.16
	WORKSPACE GROUP PLC	94,047	511,615.68
	イギリスポンド 小計	13,831,195	34,007,525.87 (4,792,680,620)
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	266,440	746,032.00
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	189,750.00
	ARENA REIT	241,053	614,685.15
	BWP TRUST	393,160	1,568,708.40
	CENTURIA OFFICE REIT	319,000	653,950.00
	CHARTER HALL GROUP	345,694	4,324,631.94
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	294,112	1,470,560.00
	CHARTER HALL RETAIL REIT	369,160	1,232,994.40
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	242,250	654,075.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,462,633	1,287,117.04
	DEXUS	782,940	7,085,607.00
	GDI PROPERTY GROUP	446,500	471,057.50
	GOODMAN GROUP	1,179,874	21,414,713.10
	GPT GROUP	1,392,517	5,263,714.26
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	243,760	814,158.40
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	148,000	466,200.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	202,588	931,904.80
	MIRVAC GROUP	2,817,500	5,944,925.00
	NATIONAL STORAGE REIT	721,340	1,356,119.20
	RURAL FUNDS GROUP	272,766	613,723.50
SCENTRE GROUP	3,730,393	8,132,256.74	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	779,060	1,713,932.00	
STOCKLAND	1,710,344	6,276,962.48	
VICINITY CENTERS	2,770,040	3,836,505.40	
WAYPOINT REIT LTD	480,580	1,283,148.60	
	オーストラリアドル 小計	21,686,704	78,347,431.91 (6,071,925,973)
ニュージ ーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	652,278	880,575.30
	GOODMAN PROPERTY TRUST	770,300	1,752,432.50
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,098,490	1,136,937.15
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	800,000	1,340,000.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	295,460	898,198.40
	ニュージ ーランド ドル 小計	3,616,528	6,008,143.35 (428,921,353)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,523,000	6,244,300.00

	FORTUNE REIT	982,000	6,549,940.00	
	LINK REIT	1,487,300	93,699,900.00	
	PROSPERITY REIT	952,000	2,208,640.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	791,000	2,918,790.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,208,000	4,469,600.00	
	香港ドル 小計	6,943,300	116,091,170.00 (1,592,770,852)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	375,000	442,500.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	701,000	448,640.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	2,156,100	7,072,008.00	
	ASCOTT TRUST	1,332,077	1,198,869.30	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	2,105,128	3,473,461.20	
	CAPITALAND MALL TRUST	2,127,400	4,105,882.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	637,729	727,011.06	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	582,300	646,353.00	
	ESR REIT	1,404,065	561,626.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	780,000	429,000.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	236,764.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	512,529	1,353,076.56	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	202,400.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,704,296	2,334,885.52	
	KEPPEL DC REIT	862,903	2,511,047.73	
	KEPPEL REIT	1,392,200	1,489,654.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	555,000	360,750.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	110,664.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,580,173	3,128,742.54	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,080,360	3,316,705.20	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,138,352	4,383,621.60	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,502,100	1,411,974.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,903,644	704,348.28	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	288,000	1,108,800.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	478,540	179,452.50	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	465,800	351,679.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	689,516	330,967.68	
SPH REIT	692,300	605,762.50		
STARHILL GLOBAL REIT	1,109,400	488,136.00		
SUNTEC REIT	1,711,900	2,413,779.00		
	シンガポールドル 小計	32,819,912	46,128,560.67	

				(3,594,337,447)	
韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD		69,030	349,982,100.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		19,093	126,968,450.00	
韓国ウォン 小計			88,123	476,950,550.00	(42,782,464)
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD		131,500	1,721,335.00	
	イスラエルシェケル 小計		131,500	1,721,335.00	(54,342,545)
合計			100,786,835	88,337,491,306	(88,337,491,306)

(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 157銘柄	100.0%	75.0%
カナダドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	4.4%
イギリスポンド	投資証券 31銘柄	100.0%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.9%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	4.1%
韓国ウォン	投資証券 2銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券 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。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間(2020年9月8日から2021年3月7日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けておりません。

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 （2020年 9月 7日現在）	第4期中間計算期間 （2021年 3月 7日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,793,897	5,077,135
親投資信託受益証券	142,226,210	179,033,562
未収入金	36,080	52,941
流動資産合計	148,056,187	184,163,638
資産合計	148,056,187	184,163,638
負債の部		
流動負債		
未払解約金	80,650	12
未払受託者報酬	35,678	44,661
未払委託者報酬	321,037	401,856
未払利息	14	10
その他未払費用	3,510	4,410
流動負債合計	440,889	450,949
負債合計	440,889	450,949
純資産の部		
元本等		
元本	142,231,158	162,093,841
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,384,140	21,618,848
（分配準備積立金）	4,729,476	4,446,363
元本等合計	147,615,298	183,712,689
純資産合計	147,615,298	183,712,689
負債純資産合計	148,056,187	184,163,638

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2019年 9月 6日 至 2020年 3月 5日	第4期中間計算期間 自 2020年 9月 8日 至 2021年 3月 7日
営業収益		
受取利息	3	10
有価証券売買等損益	1,367,282	15,187,618
営業収益合計	1,367,285	15,187,628
営業費用		
支払利息	608	747
受託者報酬	28,516	44,661
委託者報酬	256,549	401,856
その他費用	2,795	4,410
営業費用合計	288,468	451,674
営業利益又は営業損失（ ）	1,078,817	14,735,954
経常利益又は経常損失（ ）	1,078,817	14,735,954
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,078,817	14,735,954
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	185,011	467,220
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,621,582	5,384,140
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,988,908	2,341,184
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,988,908	2,341,184
剰余金減少額又は欠損金増加額	122,126	375,210
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	122,126	375,210
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,382,170	21,618,848

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年9月6日から翌年9月5日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第4期中間計算期間は2020年 9月 8日から2021年 3月 7日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第3期 (2020年 9月 7日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月 7日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	142,231,158口	162,093,841口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0379円 (10,379円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1334円 (11,334円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第4期中間計算期間 (2021年 3月 7日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第4期中間計算期間 (2021年 3月 7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	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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3期 自 2019年 9月 6日 至 2020年 9月 7日	第4期中間計算期間 自 2020年 9月 8日 至 2021年 3月 7日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	86,335,448円	142,231,158円
期中追加設定元本額	68,964,944円	29,452,494円
期中一部解約元本額	13,069,234円	9,589,811円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 3月 7日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	529,053,908
国債証券	510,474,592,000
地方債証券	32,846,905,549
特殊債券	41,199,989,386
社債券	26,546,165,260
未収入金	100,781,000
未収利息	1,399,558,669
前払費用	60,280,889
流動資産合計	613,157,326,661
資産合計	613,157,326,661
負債の部	
流動負債	
未払金	300,006,000
未払解約金	79,933,508
未払利息	384
流動負債合計	379,939,892
負債合計	379,939,892
純資産の部	
元本等	
元本	436,149,796,209
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	176,627,590,560
元本等合計	612,777,386,769
純資産合計	612,777,386,769
負債純資産合計	613,157,326,661

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 3月 7日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 3月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	436,149,796,209口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 101,023,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4050円 (1万口当たり純資産額) (14,050円)

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

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 3月 7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 3月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	393,927,301,623円
期中追加設定元本額	50,392,617,861円
期中一部解約元本額	8,170,123,275円
期末元本額	436,149,796,209円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,642,450,524円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,057,034円
S M T 国内債券インデックス・オープン	19,704,989,410円
世界経済インデックスファンド	2,207,192,130円
D C マイセレクション 2 5	24,138,949,508円
D C マイセレクション 5 0	26,114,339,686円
D C マイセレクション 7 5	7,300,504,550円
D C 日本債券インデックス・オープン	437,882,401円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,490,562,847円
D C 日本債券インデックス・オープン P	69,137,509,945円
D C マイセレクション S 2 5	10,409,558,992円
D C マイセレクション S 5 0	11,497,890,593円
D C マイセレクション S 7 5	2,263,892,513円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	953,182,016円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,782,285,003円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	646,815,386円
D C 世界経済インデックスファンド	2,815,582,659円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	15,077,674円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,643,195円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	41,040,880円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	11,452,405円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,015,770円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	137,509,666円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	204,849,338円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	45,401,949円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	42,915,215円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	3,576,545,116円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	864,740,364円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,305,119,605円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	647,184,013円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	82,723,767円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,162,045,927円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,277,099,245円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,546,147,444円

区分	2021年 3月 7日現在
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	151,538,025円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,037,126,780円
日本債券ファンド・シリーズ1	12,933,558,727円
分散投資コア戦略ファンドA	25,237,317,543円
分散投資コア戦略ファンドS	24,980,389,432円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	109,652,167円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,089,049,832円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	51,119,884円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,664,522円
S M T インデックスバランス・オープン	52,812,455円
S M T 世界経済インデックス・オープン	20,567,993円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	34,967,512円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	51,929,785円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	5,718,573円
グローバル経済コア	195,517,392円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A 対応型）	20,347,333円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	4,190,970円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 3 0	856,275円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 4 0	620,780円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 5 0	182,781円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 6 0	160,112円
F O F s 用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	76,585,673,972円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	32,449,354円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 3月 7日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,211,707,481
株式	455,045,756,860
派生商品評価勘定	17,372,500
未収入金	3,114,000
未収配当金	628,937,004
前払金	13,469,300
差入委託証拠金	136,741,600

	2021年 3月 7日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	458,057,098,745
資産合計	458,057,098,745
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	30,883,050
未払金	30,440,720
未払解約金	123,753,418
未払利息	1,607
流動負債合計	185,078,795
負債合計	185,078,795
純資産の部	
元本等	
元本	252,730,234,136
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	205,141,785,814
元本等合計	457,872,019,950
純資産合計	457,872,019,950
負債純資産合計	458,057,098,745

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 3月 7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）

		2021年 3月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		252,730,234,136口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8117円 (18,117円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

		2021年 3月 7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 3月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	226,469,579,366円
期中追加設定元本額	62,660,852,138円
期中一部解約元本額	36,400,197,368円
期末元本額	252,730,234,136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）	462,646,915円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,842,677,465円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,706,832円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,833,758,608円
世界経済インデックスファンド	2,480,045,845円
日本株式インデックス・オープン	3,671,942,470円
DCマイセレクション25	6,019,862,282円
DCマイセレクション50	18,508,718,764円
DCマイセレクション75	17,691,634,351円
DC日本株式インデックス・オープン	5,781,397,468円
DCマイセレクションS25	2,731,765,790円
DCマイセレクションS50	8,073,435,497円
DCマイセレクションS75	5,493,629,035円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,299,479,060円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	244,524,972円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	631,075,624円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	448,948,029円
DC世界経済インデックスファンド	3,102,042,465円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,518,339,891円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	6,224,442円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	26,856,807円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	26,689,743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）	211,157,673円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,374,438円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	54,183,111円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	182,276,841円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	35,776,978円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	116,147,962円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,244,195,423円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	508,920,487円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,320,223,929円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	408,787,747円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	28,503,203円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	584,756,340円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	329,040,099円

区分	2021年 3月 7日現在
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	417,110,682円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	43,187,884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）	724,250,353円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,740,289,815円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,746,649,710円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,785,879,261円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,402,139,372円
分散投資コア戦略ファンドA	2,126,539,021円
分散投資コア戦略ファンドS	7,599,494,108円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	366,618,974円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	372,549,908円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,024,515,747円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	198,929,304円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,432,912円
SMT インデックスバランス・オープン	60,175,106円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	25,867,599,148円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	661,789,986円
SMT 世界経済インデックス・オープン	30,732,187円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	97,657,172円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	17,058,075円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,251,538円
グローバル経済コア	236,387,483円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,771,982円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	47,473,079円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,172,815円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,165,179,546円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	109,263,877円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	576,184円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	585,157円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	249,101円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	485,323円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	43,073,882,155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）	1,319,284,660円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	145,946,272円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,485,049円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	424,839,755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）	46,920,054,849円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 3月 7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	2,717,599,300	-	2,704,130,000	13,469,300
合計		2,717,599,300	-	2,704,130,000	13,469,300

(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ではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2021年 3月 7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	152,497,683
コール・ローン	2,780,916,576
国債証券	283,676,438,806
派生商品評価勘定	45,044,392
未収入金	30,006,841
未収利息	1,626,353,365
前払金	13,924,412
前払費用	52,242,080
差入委託証拠金	419,215,878
流動資産合計	288,796,640,033
資産合計	288,796,640,033
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,931,284
未払解約金	235,024,194
未払利息	2,021
流動負債合計	250,957,499
負債合計	250,957,499
純資産の部	
元本等	
元本	96,260,546,909
剰余金	
剰余金又は欠損金()	192,285,135,625
元本等合計	288,545,682,534
純資産合計	288,545,682,534
負債純資産合計	288,796,640,033

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2021年 3月 7日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2021年 3月 7日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	96,260,546,909口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.9975円 (1万口当たり純資産額) (29,975円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 3月 7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 3月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	97,174,191,513円
期中追加設定元本額	7,818,571,700円
期中一部解約元本額	8,732,216,304円
期末元本額	96,260,546,909円
期末元本額の内訳	

区分	2021年 3月 7日現在
外国債券オープン（毎月決算型）	1,477,572,509円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	605,794,140円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,029,367,127円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,384,955円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,956,761,200円
世界経済インデックスファンド	8,446,962,583円
D C マイセレクション 2 5	1,885,614,634円
D C マイセレクション 5 0	1,507,403,301円
D C マイセレクション 7 5	897,147,261円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,103,173,322円
D C マイセレクション S 2 5	819,604,292円
D C マイセレクション S 5 0	651,782,587円
D C マイセレクション S 7 5	292,821,745円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	37,409,713円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	78,787,241円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	39,797,997円
D C 世界経済インデックスファンド	10,682,525,833円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	671,143,741円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	8,131,204円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,401,682円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,604,824円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	33,328,218円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	73,992,845円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	114,199,990円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	106,219,317円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	114,761,126円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,651,060,766円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	507,421,883円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,870,670,915円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	631,004,781円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	61,591,329円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	529,341,343円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	197,397,814円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	235,711,300円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	823,750,121円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1（適格機関投資家専用）	1,091,656,413円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	767,291,156円
外国債券ファンド・シリーズ 1	590,962,896円
コア投資戦略ファンド（安定型）	985,330,333円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,483,631,061円
分散投資コア戦略ファンド A	1,098,711,660円
分散投資コア戦略ファンド S	2,233,929,187円

区分	2021年 3月 7日現在
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	407,383,415円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,455,672,512円
コア投資戦略ファンド(切替型)	881,453,066円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	219,491,228円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	100,217,098円
S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,146,522,474円
S M T インデックスバランス・オープン	186,831,739円
外国債券S M T Bセクション(S M A専用)	20,283,854,444円
S M T 世界経済インデックス・オープン	157,967,201円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	156,912,959円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	253,519,563円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	2,938,279円
グローバル経済コア	770,156,458円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	11,415,889円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	424,133円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	250,667,096円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	22,210,575円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	559,125円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	661,215円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	307,173円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	679,987円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	530,027,379円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	10,460,802,496円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	340,274,542円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	351,626,429円
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	137,691,289円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	304,653,038円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2021年 3月 7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	2,774,743,045	-	2,760,818,633	13,924,412
合計		2,774,743,045	-	2,760,818,633	13,924,412

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2021年 3月 7日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,578,664,480	-	2,621,702,000	43,037,520
	アメリカドル	1,122,484,704	-	1,145,685,600	23,200,896
	カナダドル	131,307,971	-	134,458,000	3,150,029
	ユーロ	1,124,731,549	-	1,136,168,000	11,436,451
	イギリスポンド	200,140,256	-	205,390,400	5,250,144
合計		2,578,664,480	-	2,621,702,000	43,037,520

(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。

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。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 3月 7日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	10,747,602,648
コール・ローン	326,868,679
株式	451,534,753,508
投資信託受益証券	302,522,221
投資証券	9,701,818,774
派生商品評価勘定	75,565,641
未収入金	1,663,793
未収配当金	785,087,433
前払金	113,495,018
差入委託証拠金	2,031,588,467
流動資産合計	475,620,966,182
資産合計	475,620,966,182
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	190,099,059
未払解約金	447,917,860
未払利息	237

	2021年 3月 7日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	638,017,156
負債合計	638,017,156
純資産の部	
元本等	
元本	143,481,008,800
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	331,501,940,226
元本等合計	474,982,949,026
純資産合計	474,982,949,026
負債純資産合計	475,620,966,182

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 3月 7日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2021年 3月 7日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 3月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	143,481,008,800口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.3104円 (1万口当たり純資産額) (33,104円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 3月 7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

	2021年 3月 7日現在
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 3月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	145,539,517,095円
期中追加設定元本額	11,872,927,530円
期中一部解約元本額	13,931,435,825円
期末元本額	143,481,008,800円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,117,555,205円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,578,185円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,825,673,582円
世界経済インデックスファンド	8,043,567,912円
外国株式インデックス・オープン	819,432,330円

区分	2021年 3月 7日現在
D Cマイセレクション2 5	836,566,434円
D Cマイセレクション5 0	4,460,815,522円
D Cマイセレクション7 5	4,951,869,324円
D C外国株式インデックス・オープン	10,454,451,316円
D CマイセレクションS 2 5	379,086,534円
D CマイセレクションS 5 0	1,908,954,450円
D CマイセレクションS 7 5	1,532,754,819円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5	66,792,722円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5	172,373,255円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5	122,631,276円
D C世界経済インデックスファンド	10,110,982,475円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,810,148,864円
マイセレクション5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	6,393,585円
マイセレクション7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	7,289,144円
外国株式インデックス・オープンV A 1(適格機関投資家専用)	31,785,607円
バランス3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	29,995,362円
バランス5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	100,649,248円
バランス2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	19,512,012円
バランス5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	63,328,257円
バランスA(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	467,810,755円
バランスB(3 7. 5)V A 1(適格機関投資家専用)	246,678,280円
バランスC(5 0)V A 1(適格機関投資家専用)	1,822,508,186円
世界バランスV A 1(適格機関投資家専用)	1,112,371,247円
世界バランスV A 2(適格機関投資家専用)	46,561,171円
バランスD(3 5)V A 1(適格機関投資家専用)	239,776,761円
バランスE(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	78,301,465円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,376,480,314円
F O F s用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,617,219,373円
外国株式ファンド・シリーズ1	963,053,695円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,507,910,861円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,040,519,229円
分散投資コア戦略ファンドA	2,223,777,748円
分散投資コア戦略ファンドS	10,496,741,053円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,232,170,107円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,156,528,933円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,140,269,742円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	664,587,611円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	33,106,591円
S M T インデックスバランス・オープン	182,850,159円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	849,586,504円
外国株式S M T Bセレクション(SMA専用)	29,444,136,137円
S M T 世界経済インデックス・オープン	152,899,215円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	491,595,333円

区分	2021年 3月 7日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	84,280,579円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,035,166円
i - S M T グローバル株式インデックス(ノーロード)	89,593,293円
グローバル経済コア	763,121,465円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	12,081,256円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	1,686,341円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	718,403,150円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	68,083,059円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	1,852,252円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	1,863,906円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	800,823円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	1,572,496円
F O F s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)	728,265,005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)	1,461,159,641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)	1,665,619,461円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	732,066,771円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	108,295,725円
S M T A M海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	321,937,393円
S M T A Mバランスファンド2002(適格機関投資家専用)	311,188,833円
S M T A M海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	321,854,368円
S M T A M海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	310,546,084円
S M T A M海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	306,073,843円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2021年 3月 7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	13,241,522,385	-	13,128,027,367	113,495,018
	合計	13,241,522,385	-	13,128,027,367	113,495,018

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	201,406,400	-	202,444,800	1,038,400
	アメリカドル	119,817,600	-	120,836,800	1,019,200
	ノルウェークローネ	15,048,000	-	15,048,000	-
	オーストラリアドル	66,540,800	-	66,560,000	19,200
合計		201,406,400	-	202,444,800	1,038,400

(注)時価の算定方法

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

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。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 3月 7日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,031,057,030
投資証券	102,773,164,250
未収入金	145,204,939
未収配当金	1,307,543,671
前払金	37,270,800
差入委託証拠金	442,476,000
流動資産合計	106,736,716,690
資産合計	106,736,716,690
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	37,270,800
未払金	190,798,585
未払解約金	256,189,645
未払利息	1,476
流動負債合計	484,260,506
負債合計	484,260,506
純資産の部	
元本等	
元本	53,776,817,254
剰余金	
剰余金又は欠損金()	52,475,638,930
元本等合計	106,252,456,184
純資産合計	106,252,456,184

	2021年 3月 7日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	106,736,716,690

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 3月 7日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 3月 7日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	53,776,817,254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 1.9758円 (1万口当たり純資産額) (19,758円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 3月 7日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 3月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	63,382,035,403円
期中追加設定元本額	3,615,364,181円
期中一部解約元本額	13,220,582,330円
期末元本額	53,776,817,254円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,615,718,564円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,634,427円

区分	2021年 3月 7日現在
SMT J-REITインデックス・オープン	17,133,969,713円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	25,531,044,849円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,528,459,510円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,223,776,810円
分散投資コア戦略ファンドA	527,813,690円
分散投資コア戦略ファンドS	1,039,209,557円
コア投資戦略ファンド（切替型）	871,401,330円
SMT インデックスバランス・オープン	27,418,050円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	311,762,228円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,624,104円
グローバル経済コア	261,761,205円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,398,861円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	436,873,573円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	42,599,327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）	615,891,067円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	8,756,584円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	894,206,321円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	378,668,340円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	307,829,144円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2021年 3月 7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	3,499,048,800	-	3,461,778,000	37,270,800
合計		3,499,048,800	-	3,461,778,000	37,270,800

(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ではありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 3月 7日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	466,768,138
コール・ローン	168,523,254
投資証券	83,422,026,915
派生商品評価勘定	363,450
未収入金	2,850,387
未収配当金	114,430,819
流動資産合計	84,174,962,963
資産合計	84,174,962,963
負債の部	
流動負債	
未払金	246,995,002
未払株式払込金	22,326,301
未払解約金	106,553,100
未払利息	122
流動負債合計	375,874,525
負債合計	375,874,525
純資産の部	
元本等	
元本	44,871,227,265
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	38,927,861,173
元本等合計	83,799,088,438
純資産合計	83,799,088,438
負債純資産合計	84,174,962,963

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 3月 7日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

2021年 3月 7日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 3月 7日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	44,871,227,265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 1.8675円 (1万口当たり純資産額) (18,675円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 3月 7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。

	2021年 3月 7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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 3月 7日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	53,636,262,825円
期中追加設定元本額	2,187,619,563円
期中一部解約元本額	10,952,655,123円
期末元本額	44,871,227,265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	83,446,846円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	135,900,621円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,646,794,393円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,830,821円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,619,816,323円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	21,923,194,984円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,165,216,302円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,470,131,182円
分散投資コア戦略ファンドA	523,397,906円
分散投資コア戦略ファンドS	1,071,882,269円
コア投資戦略ファンド（切替型）	945,863,466円
SMT インデックスバランス・オープン	163,907,291円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	354,422,407円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,028,485円
グローバル経済コア	264,620,342円

区分	2021年 3月 7日現在
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A 対応型）	9,755,329円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	464,211,616円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	46,833,519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）	755,868,460円
F O F s 用 グローバルR E I Tインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	553,928,746円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	84,570,801円
S M T A M 海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	151,282,615円
S M T A M 海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	145,867,426円
S M T A M 海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	140,741,405円
S M T A M 海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	138,713,710円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 3月 7日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	53,442,600	-	53,802,000	359,400
	アメリカドル	10,698,000	-	10,789,000	91,000
	カナダドル	16,906,000	-	17,020,000	114,000
	香港ドル	13,793,000	-	13,900,000	107,000
	シンガポールドル	12,045,600	-	12,093,000	47,400
	売建	22,468,050	-	22,464,000	4,050
	オーストラリアドル	22,468,050	-	22,464,000	4,050
合計		75,910,650	-	76,266,000	363,450

(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。

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。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

【純資産額計算書】

（2021年 3月31日現在）

資産総額	191,247,518円
負債総額	68,542円
純資産総額（ - ）	191,178,976円
発行済口数	162,244,595口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1783円
（1万口当たり純資産額）	（11,783円）

（参考）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 3月31日現在）

資産総額	625,754,932,864円
負債総額	5,633,828,347円
純資産総額（ - ）	620,121,104,517円
発行済口数	441,384,593,193口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4049円
（1万口当たり純資産額）	（14,049円）

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 3月31日現在）

資産総額	471,189,899,302円
負債総額	322,160,155円
純資産総額（ - ）	470,867,739,147円
発行済口数	250,048,587,254口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8831円
（1万口当たり純資産額）	（18,831円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 3月31日現在)

資産総額	293,737,070,023円
負債総額	91,892,180円
純資産総額（ - ）	293,645,177,843円
発行済口数	96,792,324,709口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0338円
（1万口当たり純資産額）	（30,338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

(2021年 3月31日現在)

資産総額	501,603,734,095円
負債総額	440,140,126円
純資産総額（ - ）	501,163,593,969円
発行済口数	141,658,377,699口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5378円
（1万口当たり純資産額）	（35,378円）

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 3月31日現在)

資産総額	112,248,189,149円
負債総額	505,757,683円
純資産総額（ - ）	111,742,431,466円
発行済口数	53,208,662,305口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1001円
（1万口当たり純資産額）	（21,001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

(2021年 3月31日現在)

資産総額	89,892,918,119円
負債総額	259,576円
純資産総額（ - ）	89,892,658,543円
発行済口数	44,495,447,940口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0203円
（1万口当たり純資産額）	（20,203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。

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。

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。

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。

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。

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。

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（2021年 3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年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

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

委託会社の機構は2021年 6月 7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。

2021年3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	520	14,190,499
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	78	292,510
単位型公社債投資信託	44	284,118
合計	642	14,767,128

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第35期事業年度の中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,830	24,869
金銭の信託	-	5,823
有価証券	2,268	-
前払費用	197	348
未収委託者報酬	6,351	7,284
未収運用受託報酬	5,525	5,842
未収収益	212	190
その他	2,261	4,624
流動資産合計	40,648	48,983
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 282	1 256
器具備品	1 564	1 576
その他	1 14	1 0
有形固定資産合計	861	832
無形固定資産		
ソフトウェア	1,487	3,030
その他	7	40
無形固定資産合計	1,494	3,070
投資その他の資産		
投資有価証券	11,334	8,469
関係会社株式	4,663	5,636
繰延税金資産	141	700
その他	32	35
投資その他の資産合計	16,171	14,842
固定資産合計	18,527	18,745
資産合計	59,176	67,729

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	38	38
未払金	5,327	7,988
未払収益分配金	0	0
未払手数料	2,718	3,355
その他未払金	2,608	4,632
未払費用	178	204
未払法人税等	1,992	897
賞与引当金	132	324
その他	395	1,070
流動負債合計	8,063	10,524
固定負債		
退職給付引当金	537	600
資産除去債務	131	132
その他	0	7
固定負債合計	669	740
負債合計	8,733	11,264
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	75	305
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	28,501	35,122
利益剰余金合計	30,676	37,528
株主資本合計	49,916	56,767
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	393	587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,551	34,967
運用受託報酬	5,464	11,091
その他営業収益	283	500
営業収益合計	36,299	46,559
営業費用		
支払手数料	13,423	15,998
広告宣伝費	276	331
公告費	1	0
調査費	5,508	5,018
調査費	567	788
委託調査費	4,935	4,217
図書費	5	11
営業雑経費	2,315	3,434
通信費	45	52
印刷費	449	470
協会費	38	53
諸会費	5	16
情報機器関連費	1,657	2,726
その他営業雑経費	118	114
営業費用合計	21,525	24,783
一般管理費		
給料	3,931	5,756
役員報酬	161	244
給料・手当	3,425	4,962
賞与	343	549
退職給付費用	98	118
福利費	297	535
交際費	9	14
旅費交通費	141	190
租税公課	270	344
不動産賃借料	219	269
寄付金	8	7
減価償却費	152	334
業務委託費	657	864
諸経費	433	750
一般管理費合計	6,219	9,185
営業利益	8,554	12,589

（単位：百万円）

	前事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
営業外収益		
受取利息	11	15
収益分配金	8	119
投資有価証券売却益	46	483
投資有価証券償還益	0	316
為替差益	-	273
デリバティブ利益	250	666
貸倒引当金戻入	17	-
その他	5	30
営業外収益合計	340	1,906
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	1,076
投資有価証券売却損	34	4
投資有価証券償還損	1	19
固定資産除却損	7	19
為替差損	198	-
その他	3	0
営業外費用合計	245	1,118
経常利益	8,649	13,377
特別損失		
統合関連費用	286	-
システム統合費用	49	149
特別損失合計	355	149
税引前当期純利益	8,313	13,227
法人税、住民税及び事業税	2,674	4,263
法人税等調整額	125	193
法人税等合計	2,549	4,070
当期純利益	5,764	9,157

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	300	350	350
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700	1,700	1,700
会社分割による増加		18,589	18,589
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	1,700	16,889	16,889
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74	2,100	22,767	24,942	25,592
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589
剰余金の配当	0		30	30	30
当期純利益			5,764	5,764	5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	0	-	5,734	5,734	24,323
当期末残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916

	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	0	-	0	25,592
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589
剰余金の配当				30
当期純利益				5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393	133	526	526
当期変動額合計	393	133	526	24,850
当期末残高	393	133	526	50,442

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
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	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	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	393	133	526	50,442
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく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。）

時価のないもの

移動平均法による原価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、原則として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、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

7. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(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		当事業年度	
	(2019年3月31日)		(2020年3月31日)	
建 物	53	百万円	77	百万円
器具備品	351	"	285	"
そ の 他	3	"	4	"
計	408	"	367	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

4. 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
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

4. 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

2020年6月26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
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益 剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

（リ・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、自ら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7.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。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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。

2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830	23,830	-
(2) 金銭の信託	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	6,351	6,351	-
(4) 未収運用受託報酬	5,525	5,525	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602	13,602	-
(6) 未払金	(5,327)	(5,327)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(0)	(0)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82	82	-
デリバティブ取引計	81	81	-

(*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) 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（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

(*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) 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。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6) 未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：百万円）

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(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(2019年3月31日)

(単位: 百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830	-	-	-
未収委託者報酬	6,351	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度(2020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	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度(2019年3月31日)

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位: 百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度(2020年3月31日)

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位: 百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. 其他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

(単位: 百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,405	3,432	973

小計	4,405	3,432	973
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196	9,602	406
小計	9,196	9,602	406
合計	13,602	13,035	566

当事業年度（2020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	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

（注）非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2019年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	887	-	3	3
	英ポンド	66	-	1	1
	カナダドル	3	-	0	0
	スイスフラン	7	-	0	0
	香港ドル	183	-	0	0
	ユーロ	183	-	2	2
	買建				
	米ドル	10	-	0	0
	スイスフラン	1	-	0	0
	香港ドル	0	-	0	0
	ユーロ	2	-	0	0
合計	1,346	-	7	7	

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,739	-	8	8
合計		6,739	-	8	8

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建					
	米ドル	有価証券 投資有価証券 子会社株式	3,432	-	13	
	英ポンド		2,575	-	50	
	カナダドル		40	-	0	
	スイスフラン		34	-	0	
	香港ドル		566	-	2	
	人民元		1,725	-	9	
	ユーロ		262	-	6	
	買建					
	ユーロ		6	-	0	
	合計		8,643	-	82	

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
合計			5,666	-	114

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

(2) 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 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

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19百万円、当事業年度44百万円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	125 百万円	168 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40 "	99 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	164 "	183 "
有価証券評価差額	-	259 "
その他	82 "	151 "
繰延税金資産 合計	413 "	862 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	173 "	-
繰延ヘッジ損益	58 "	125 "
その他	38 "	35 "
繰延税金負債 合計	271 "	161 "
繰延税金資産の純額	141 "	700 "

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(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。

(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 2018年4月1日 至 2019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	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

[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)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540	未収運用受託報酬	4,903
							投信販売代行手数料等	9,564	未払手数料	1,774
							投資助言費用	3,357	その他未払金	182
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603 13,907 4,663 13 18,589 無対価	-	-

(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

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。

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。

投資助言費用

各助言案件について、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。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

(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

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。

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（2019年3月31日）

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

当事業年度（2020年3月31日）

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

（1株当たり情報）

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		22,768
金銭の信託		8,094
未収委託者報酬		7,732
未収運用受託報酬		5,430
その他		3,718
流動資産合計		47,745

固定資産

有形固定資産	1	801
無形固定資産		3,344
投資その他の資産		
投資有価証券		9,175
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		261
その他		33
投資その他の資産合計		15,106

固定資産合計		19,252
--------	--	--------

資産合計		66,997
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,364
未払法人税等		473

賞与引当金		289
その他	2	612
流動負債合計		8,740
固定負債		
退職給付引当金		614
資産除去債務		132
その他		6
固定負債合計		752
負債合計		9,493

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		35,114
利益剰余金合計		37,714
株主資本合計		56,953
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		251
繰延ヘッジ損益		299
評価・換算差額等合計		551
純資産合計		57,504
負債・純資産合計		66,997

中間損益計算書

(単位：百万円)

第35期中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		17,868
運用受託報酬		5,169
その他営業収益		206
営業収益合計		23,244
営業費用		13,137
一般管理費	1	4,842
営業利益		5,264
営業外収益	2	1,933

営業外費用	3	1,484
経常利益		5,714
特別損失		110
税引前中間純利益		5,603
法人税、住民税及び事業税		1,692
法人税等調整額		62
法人税等合計		1,754
中間純利益		3,848

中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当中間期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
中間純利益			3,848	3,848	3,848
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 （純額）					
当中間期変動額合計	194	-	8	185	185
当中間期末残高	500	2,100	35,114	37,714	56,953

	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	587	284	302	56,464
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,662
中間純利益				3,848

株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	838	15	854	854
当中間期変動額合計	838	15	854	1,040
当中間期末残高	251	299	551	57,504

重要な会計方針

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>子会社株式 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの 中間会計期間末日の市場価格等に基づく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。)</p> <p>時価のないもの 移動平均法による原価法によっております。</p>
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	<p>(1) 有形固定資産 定額法によっております。</p> <p>(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）に基づく定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p>
7. ヘッジ会計の会計処理	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象</p>

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間末 (2020年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 431百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 64百万円
	無形固定資産 255百万円
2	営業外収益の主要項目
	金銭の信託運用益 1,775百万円
3	営業外費用の主要項目
	デリバティブ費用 1,335百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 配当に関する事項

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
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

2020年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（注2）を参照ください。）。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金及び預金	22,768	22,768	-
(2)金銭の信託	8,094	8,094	-
(3)未収委託者報酬	7,732	7,732	-
(4)未収運用受託報酬	5,430	5,430	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	9,175	9,175	-
(6)未払金	(7,364)	(7,364)	-
(7)デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(80)	(80)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(9)	(9)	-
デリバティブ取引計	(89)	(89)	-

(*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)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。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1)現金及び預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6)未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式5,636百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

1. 子会社株式

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	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	8,605	8,201	403
小計	8,605	8,201	403
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	570	610	40
小計	570	610	40
合計	9,175	8,812	362

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建			
	米ドル	1,861	-	2
	英ポンド	105	-	0
	カナダドル	19	-	0
	スイスフラン	50	-	0
	香港ドル	178	-	0
	ユーロ	306	-	3
合計	2,521	-	1	1

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,865	-	82	82
合計		10,865	-	82	82

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,535	-	4
	英ポンド		2,791	-	5
	カナダドル		8	-	0
	スイスフラン		55	-	0
	香港ドル		98	-	0
	ユーロ		84	-	0
合計			6,574	-	9

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

(関連情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1)営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2)有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,593百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	2,993百万円

(*1)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載して
おります。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第35期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
1株当たり純資産額	19,168,213円23銭
1株当たり中間純利益	1,282,957円88銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）
中間純利益	3,848百万円
普通株式に係る中間純利益	3,848百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

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

2021年6月7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

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

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） （2020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。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

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

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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。

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。

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。

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。

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。

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。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(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のアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）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

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印**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2019年4月1日から2020年3月31日までの第34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2020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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年11月6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 松崎雅則 印

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SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2019年9月6日から2020年9月7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、SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2020年9月7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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年5月7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 松崎雅則 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2020年9月8日から2021年3月7日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2021年3月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年9月8日から2021年3月7日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。