

## 【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】	2023年6月5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】	上坪 直樹
【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】**

2023年 6月 6日から2023年12月 5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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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。

## &lt;信託金限度額&gt;

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。

## &lt;基本的性格&gt;

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			ファンド・	なし		
	年4回	日本	オブ・ファンズ		その他	ロング・
債券					( )	ショート型/ 絶対収益追求型
一般	年6回	北米				
公債	(隔月)					
社債		欧州				
その他債券	年12回					その他
クレジット属性	(毎月)	アジア				( )
( )	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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## 〔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。

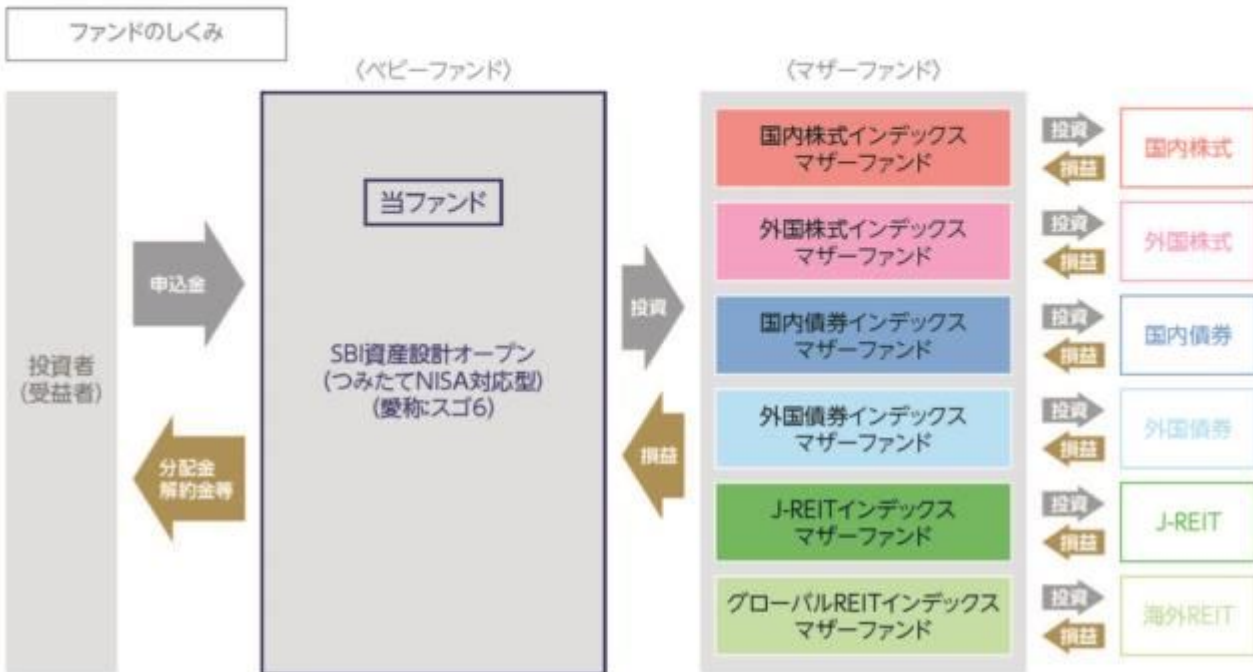
#### [ 特殊型 ]

- (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。

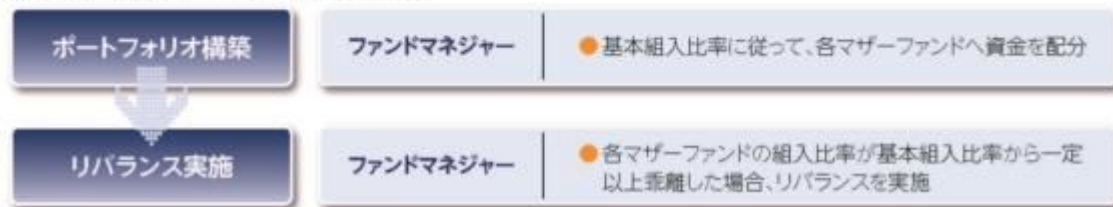


### ? ファミリーファンド方式とは

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

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

「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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

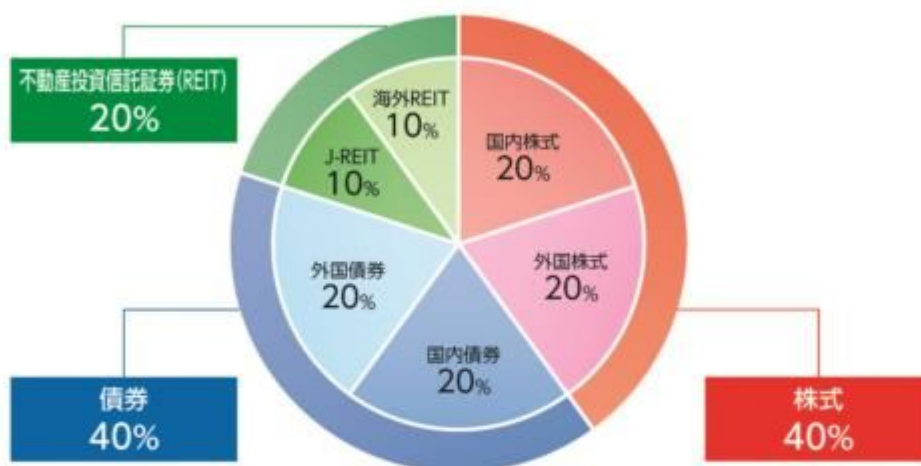
「東証REIT指数」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

「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<sup>(R)</sup>及びS&P<sup>(R)</sup>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<sup>(R)</sup>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、SPDJ1、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、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、又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。

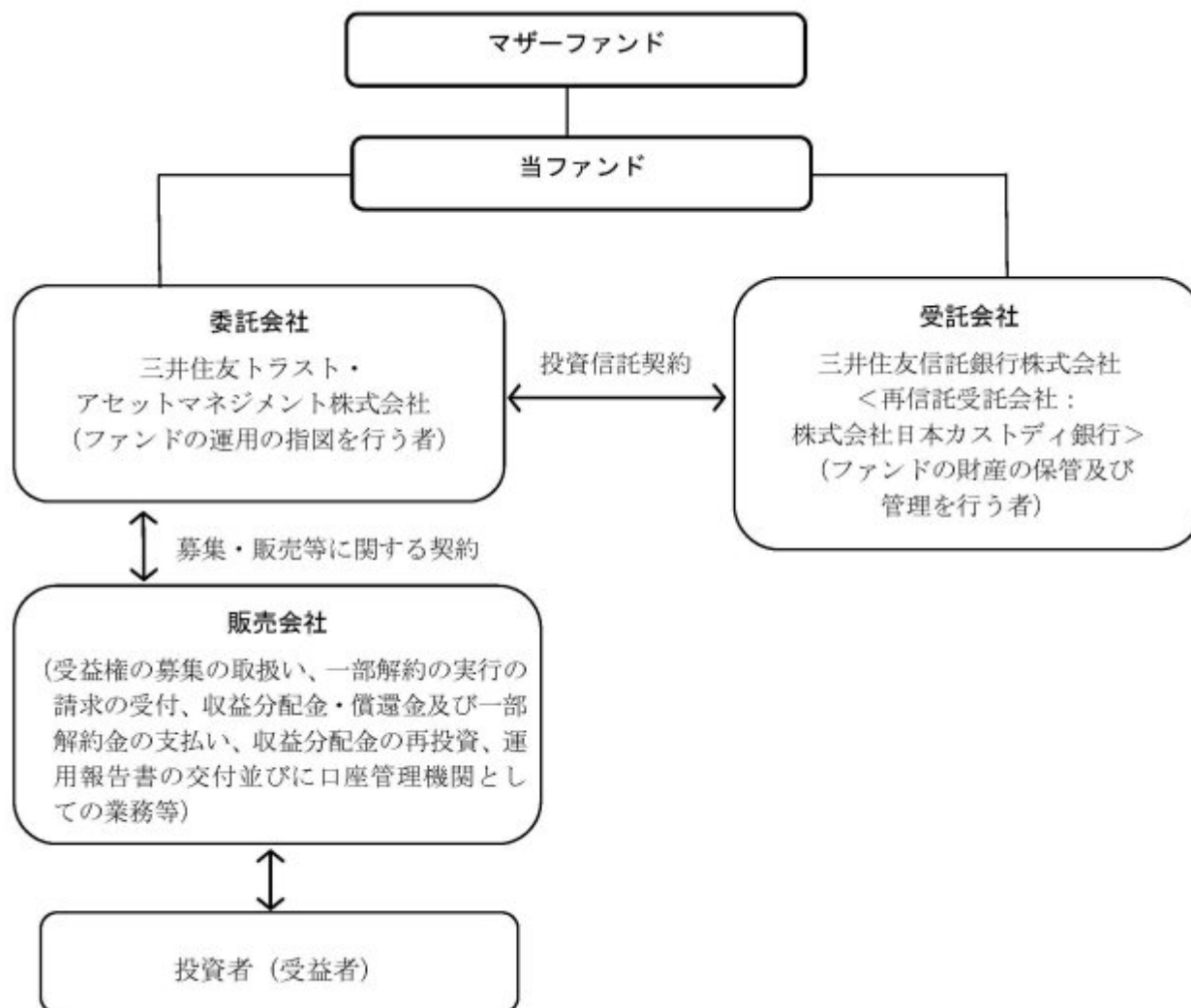
## (2) 【ファンドの沿革】

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（2023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す。）
  17. 預託証書（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書
  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す。）
  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している株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）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、金利先渡し取引及び為替先渡し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。

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ます。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

#### ヘ．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。

(ハ)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。

(ニ)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ます。

(ハ) 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ます。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の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ます。

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

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

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### 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。

（八）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。

（二）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。

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

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。

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

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

#### (2) リスクの管理体制

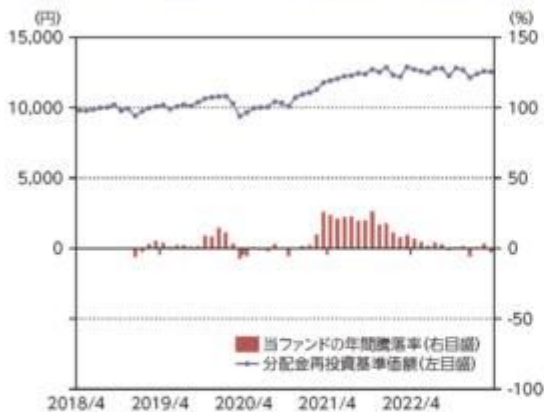
##### 委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法

令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 【参考情報】

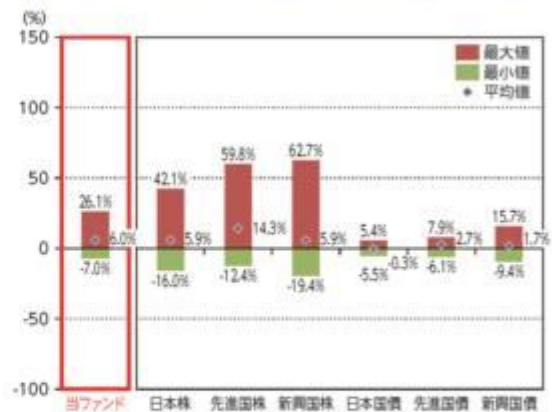
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*当ファンドについては2018年12月～2023年3月の4年4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2018年4月～2023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JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤差、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の購入額基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としてあり、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morganグローバル・エマージング・ マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用されています。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す（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

##### ハ．損益通算について

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

##### ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、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、2023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、2023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	301,363,459	96.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,511,541	3.06
合計(純資産総額)		310,875,000	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載してあります。

(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	15,171,312	4.3187	65,520,844	4.4043	66,819,009	21.49
日本	親投資信託受 益証券	国内株式インデックス マザーファ ンド	31,852,735	1.9108	60,865,299	2.0318	64,718,386	20.82
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	19,566,364	3.1530	61,694,657	3.0785	60,235,051	19.38
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	37,486,940	1.3695	51,338,653	1.3649	51,165,924	16.46
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	13,204,123	2.5606	33,810,917	2.3125	30,534,534	9.82
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	13,897,332	2.2042	30,633,767	2.0069	27,890,555	8.97

(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	96.94
合計	96.94

(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
第4期計算期間末	(2021年 9月 6日)	222,181,297	222,181,297	12,585	12,585

第5期計算期間末	(2022年 9月 5日)	283,583,211	283,583,211	12,712	12,712
	2022年 3月末日	261,874,435		12,882	
	4月末日	261,758,818		12,708	
	5月末日	264,983,835		12,601	
	6月末日	267,611,363		12,467	
	7月末日	279,707,324		12,796	
	8月末日	282,554,212		12,787	
	9月末日	275,968,293		12,259	
	10月末日	294,030,446		12,820	
	11月末日	295,482,203		12,688	
	12月末日	287,215,609		12,130	
	2023年 1月末日	297,281,789		12,396	
	2月末日	305,723,306		12,590	
	3月末日	310,875,000		12,548	

## 【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
第4期計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	0
第5期計算期間	2021年 9月 7日～2022年 9月 5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期計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	21.3
第5期計算期間	2021年 9月 7日～2022年 9月 5日	1.0
第6期中間計算期間	2022年 9月 6日～2023年 3月 5日	0.9

(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期計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	56,921,923	22,602,543	176,550,538
第5期計算期間	2021年 9月 7日～2022年 9月 5日	57,198,326	10,669,877	223,078,987
第6期中間計算期間	2022年 9月 6日～2023年 3月 5日	27,415,496	5,608,849	244,885,634

(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	533,593,815,020	84.63
地方債証券	日本	32,204,051,236	5.11
特殊債券	日本	35,943,447,416	5.70
社債券	日本	26,669,367,000	4.23
	フランス	794,579,000	0.13
	スペイン	396,288,000	0.06
	小計	27,860,234,000	4.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		909,372,763	0.14
合計(純資産総額)		630,510,920,435	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141回利付国債(5年)	8,820,000,000	100.33	8,849,784,000	100.29	8,845,842,600	0.100	2024/9/20	1.40
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	6,660,000,000	100.06	6,663,996,000	100.01	6,661,198,800	0.005	2026/12/20	1.06
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,420,000,000	100.29	6,439,104,500	100.02	6,421,540,800	0.100	2028/3/20	1.02
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,517,000,000	98.76	6,436,665,500	98.05	6,389,983,670	0.100	2031/12/20	1.01
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,170,000,000	100.12	6,177,404,000	100.16	6,179,872,000	0.005	2026/6/20	0.98

日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	100.51	5,930,503,000	100.43	5,925,547,000	0.100	2026/9/20	0.94
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	5,870,000,000	100.29	5,887,455,100	100.26	5,885,320,700	0.100	2024/6/20	0.93
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	100.31	5,768,170,000	0.100	2027/3/20	0.91
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,650,000,000	99.01	5,594,596,600	98.19	5,548,243,500	0.100	2031/6/20	0.88
日本	国債証券	第151回利付国債（5年）	5,370,000,000	99.87	5,363,019,000	99.94	5,366,778,000	0.005	2027/3/20	0.85
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	5,370,000,000	99.71	5,354,427,000	99.04	5,318,448,000	0.200	2032/3/20	0.84
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	5,260,000,000	101.27	5,326,946,800	100.86	5,305,709,400	0.600	2024/6/20	0.84
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	5,120,000,000	100.46	5,143,848,000	100.43	5,142,118,400	0.100	2025/9/20	0.82
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	5,110,000,000	100.45	5,132,995,000	100.39	5,130,388,900	0.100	2025/6/20	0.81
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	5,120,000,000	100.39	5,140,009,200	100.09	5,124,761,600	0.100	2027/12/20	0.81
日本	国債証券	第153回利付国債（5年）	5,100,000,000	99.87	5,093,492,500	99.85	5,092,452,000	0.005	2027/6/20	0.81
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,020,000,000	101.21	5,080,742,000	100.99	5,069,798,400	0.300	2025/12/20	0.80
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,110,000,000	99.01	5,059,411,000	98.10	5,013,165,500	0.100	2031/9/20	0.80
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	5,000,000,000	100.26	5,013,075,200	99.97	4,998,700,000	0.100	2028/6/20	0.79
日本	国債証券	第154回利付国債（5年）	4,950,000,000	99.91	4,945,545,000	100.17	4,958,811,000	0.100	2027/9/20	0.79
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	4,900,000,000	99.82	4,891,180,000	99.59	4,880,106,000	0.200	2032/6/20	0.77
日本	国債証券	第149回利付国債（5年）	4,820,000,000	100.10	4,824,820,000	100.10	4,825,012,800	0.005	2026/9/20	0.77
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	4,730,000,000	100.32	4,745,176,800	101.69	4,810,173,500	0.500	2032/12/20	0.76
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	4,840,000,000	99.46	4,813,864,000	98.90	4,786,760,000	0.100	2030/9/20	0.76
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	100.49	4,783,514,400	100.45	4,781,848,400	0.100	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,790,000,000	100.06	4,793,209,300	99.73	4,777,258,600	0.100	2029/3/20	0.76
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,710,000,000	99.20	4,672,735,000	98.64	4,645,944,000	0.100	2030/12/20	0.74
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	4,660,000,000	99.84	4,652,815,900	99.63	4,642,758,000	0.100	2029/6/20	0.74
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	101.27	4,618,231,200	100.96	4,603,867,200	0.400	2025/3/20	0.73
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	4,480,000,000	100.43	4,499,264,000	100.37	4,496,710,400	0.100	2025/3/20	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	84.63
地方債証券	5.11
特殊債券	5.70

社債券	4.42
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	517,841,790,170	98.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,618,086,751	1.82
合計(純資産総額)		527,459,876,921	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	9,416,450,000	1.79

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,883,200	2,115.16	20,904,586,696	1,880.00	18,580,416,000	3.52
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,273,200	11,929.59	15,188,754,804	11,985.00	15,259,302,000	2.89

日本	株式	キーエンス	電気機器	180,100	51,554.17	9,284,906,653	64,450.00	11,607,445,000	2.20
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,104,000	739.11	8,207,077,440	847.90	9,415,081,600	1.78
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,313,100	3,982.18	9,211,184,600	3,962.00	9,164,502,200	1.74
日本	株式	第一三共	医薬品	1,572,600	3,556.22	5,592,514,868	4,822.00	7,583,077,200	1.44
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,597,500	3,752.59	5,994,777,772	4,350.00	6,949,125,000	1.32
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,295,400	4,001.25	5,183,231,376	5,298.00	6,863,029,200	1.30
日本	株式	日立製作所	電気機器	884,000	6,772.48	5,986,874,590	7,252.00	6,410,768,000	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	1,498,500	3,632.53	5,443,349,748	4,275.00	6,406,087,500	1.21
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	381,000	19,559.96	7,452,346,418	16,040.00	6,111,240,000	1.16
日本	株式	任天堂	その他製品	1,136,400	5,830.39	6,625,662,004	5,131.00	5,830,868,400	1.11
日本	株式	三井物産	卸売業	1,393,400	3,195.66	4,452,837,787	4,116.00	5,735,234,400	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,395,000	4,529.02	6,317,986,470	4,093.00	5,709,735,000	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,190,700	4,483.20	5,338,147,615	4,751.00	5,657,015,700	1.07
日本	株式	HOYA	精密機器	384,400	13,936.77	5,357,298,120	14,560.00	5,596,864,000	1.06
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,043,800	5,369.37	5,604,555,736	5,182.00	5,408,971,600	1.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,463,100	3,189.09	4,665,972,189	3,510.00	5,135,481,000	0.97
日本	株式	ダイキン工業	機械	217,000	20,710.23	4,494,121,367	23,655.00	5,133,135,000	0.97
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,173,400	3,730.14	4,376,951,702	4,301.00	5,046,793,400	0.96
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,369,900	4,674.50	6,403,604,371	3,650.00	5,000,135,000	0.95
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,563,700	1,539.56	3,946,995,292	1,878.00	4,814,628,600	0.91
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,785,000	2,477.07	4,421,573,825	2,547.00	4,546,395,000	0.86
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	979,500	3,935.92	3,855,238,893	4,528.00	4,435,176,000	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,900,100	1,492.18	4,327,496,895	1,529.00	4,434,252,900	0.84
日本	株式	村田製作所	電気機器	545,900	8,204.37	4,478,768,712	8,040.00	4,389,036,000	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	883,500	4,264.19	3,767,418,021	4,760.00	4,205,460,000	0.80
日本	株式	S M C	機械	58,900	66,087.57	3,892,557,873	69,830.00	4,112,987,000	0.78
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	656,300	5,413.70	3,553,017,038	5,975.00	3,921,392,500	0.74
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,166,700	2,371.27	2,766,561,247	2,798.00	3,264,426,600	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。

#### □.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	0.29
		建設業	1.93
		食料品	3.47
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.17

化学	6.19
医薬品	5.45
石油・石炭製品	0.45
ゴム製品	0.76
ガラス・土石製品	0.71
鉄鋼	0.92
非鉄金属	0.73
金属製品	0.57
機械	5.31
電気機器	17.75
輸送用機器	7.32
精密機器	2.54
その他製品	2.21
電気・ガス業	1.19
陸運業	2.90
海運業	0.60
空運業	0.48
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	8.50
卸売業	6.06
小売業	4.46
銀行業	5.81
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	2.10
その他金融業	1.07
不動産業	1.81
サービス業	4.99
小計	98.18
合計	98.18

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	470円		9,286,594,300	9,416,450,000	1.79

(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	146,722,108,864	48.74
	フランス	25,102,099,399	8.34
	イタリア	22,732,332,648	7.55
	ドイツ	19,387,144,335	6.44
	スペイン	15,012,552,647	4.99
	イギリス	14,355,261,664	4.77
	中国	13,746,006,518	4.57
	カナダ	6,060,616,161	2.01
	ベルギー	5,575,628,461	1.85
	オーストラリア	4,707,226,619	1.56
	オランダ	4,580,385,068	1.52
	オーストリア	3,601,202,451	1.20
	メキシコ	2,576,253,249	0.86
	アイルランド	1,902,077,841	0.63
	マレーシア	1,641,006,084	0.55
	フィンランド	1,556,082,145	0.52
	ポーランド	1,381,136,443	0.46
	シンガポール	1,301,079,491	0.43
	イスラエル	965,349,102	0.32
	デンマーク	964,929,420	0.32
ニュージーランド	664,050,022	0.22	
スウェーデン	618,579,229	0.21	
ノルウェー	587,392,237	0.20	
	小計	295,740,500,098	98.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,278,110,182	1.75
合計(純資産総額)		301,018,610,280	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	1,183,820,662	0.39
	買建	ドイツ	1,062,836,506	0.35

(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		2,303,741,076	0.77

(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 2.75% 08/15/32	13,800,000	12,376.78	1,707,996,220	12,496.53	1,724,521,181	2.750	2032/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	13,226.77	1,764,451,449	12,606.32	1,681,684,068	2.625	2029/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	12,857.47	1,671,472,216	12,806.43	1,664,836,950	0.250	2024/3/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,450,000	12,915.81	1,608,018,956	12,742.72	1,586,469,416	2.000	2025/8/15	0.53
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	79,870,000	1,927.43	1,539,441,380	1,923.62	1,536,399,393	1.990	2025/4/9	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	13,380,000	11,707.91	1,566,518,411	11,140.36	1,490,581,002	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,078.98	1,528,933,897	12,641.27	1,477,765,010	2.375	2027/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	11,530,000	12,772.99	1,472,725,871	12,547.90	1,446,773,788	2.250	2027/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	12,293.62	1,454,336,095	12,032.82	1,423,483,364	0.750	2026/8/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	11,765.13	1,404,756,798	11,708.91	1,398,044,078	0.500	2027/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	12,772.97	1,387,145,526	12,609.45	1,369,387,032	0.750	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,022.57	1,409,045,236	11,658.83	1,366,415,828	1.875	2032/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	12,050,000	11,703.90	1,410,320,493	11,188.09	1,348,165,166	1.125	2031/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	10,900,000	12,225.73	1,332,605,632	12,302.49	1,340,971,887	0.250	2025/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	13,245.02	1,344,370,385	12,921.89	1,311,572,469	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	12,000,000	11,352.72	1,362,326,472	10,881.13	1,305,735,619	0.625	2030/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,291.63	1,349,349,859	10,829.75	1,294,155,422	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	12,180.43	1,358,119,024	11,547.99	1,287,601,755	1.625	2031/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	12,687.92	1,281,480,180	12,638.92	1,276,531,676	2.875	2032/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,796.19	1,279,619,032	12,729.68	1,272,968,610	0.250	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/29	9,800,000	12,663.01	1,240,974,996	12,769.06	1,251,368,569	2.875	2029/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	11,030,000	11,743.96	1,295,359,174	11,209.99	1,236,462,999	1.375	2031/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,497.14	1,281,931,300	10,994.31	1,225,866,434	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	12,087.07	1,234,090,150	11,676.83	1,192,204,692	1.125	2028/8/31	0.40

アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	12,043.03	1,144,088,204	12,144.44	1,153,722,674	0.750	2026/4/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,764.63	1,148,817,010	12,689.26	1,142,033,583	0.250	2024/6/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,772.45	1,150,798,419	12,673.35	1,141,869,116	0.375	2024/7/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	11,315.89	1,118,010,703	11,503.92	1,136,587,541	0.375	2027/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	13,060.38	1,168,904,149	12,612.06	1,128,779,817	2.250	2027/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	12,977.78	1,142,044,702	12,756.28	1,122,553,328	1.500	2024/11/30	0.37

(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	98.25
合計	98.25

(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	32	アメリカ ドル	3,475,105.32	464,030,813	3,497,000	466,954,410	0.16
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	23	アメリカ ドル	2,608,580.08	348,323,698	2,635,296.99	351,891,207	0.12
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	21	アメリカ ドル	2,695,308.8	359,904,584	2,733,281.25	364,975,045	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	13	ユーロ	1,371,517.3	199,857,501	1,373,450	200,139,134	0.07
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	17	ユーロ	1,988,965.7	289,832,082	1,998,860	291,273,879	0.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	29	ユーロ	3,897,320.9	567,917,601	3,921,380	571,423,493	0.19

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	8,870,000.00	1,168,915,947	1,182,016,200	0.39

カナダドル	買建	1,020,000.00	98,465,794	100,541,400	0.03
ユーロ	買建	5,350,000.00	760,208,103	778,612,250	0.26
イギリスポンド	買建	590,000.00	95,130,577	97,506,350	0.03
オフショア人民元	買建	7,480,000.00	143,708,016	145,064,876	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。

## 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	356,259,366,449	65.52
	イギリス	23,260,235,999	4.28
	カナダ	18,995,347,370	3.49
	フランス	18,551,475,982	3.41
	スイス	17,582,176,544	3.23
	ドイツ	13,900,782,655	2.56
	オーストラリア	11,122,386,992	2.05
	オランダ	10,668,367,628	1.96
	アイルランド	9,717,826,804	1.79
	スウェーデン	5,046,353,359	0.93
	デンマーク	4,976,403,516	0.92
	スペイン	4,288,249,921	0.79
	香港	3,325,223,658	0.61
	イタリア	2,921,330,809	0.54
	フィンランド	1,963,628,285	0.36
	シンガポール	1,837,451,852	0.34
	ジャージー	1,633,870,316	0.30
	ベルギー	1,378,822,613	0.25
	ケイマン	1,100,695,517	0.20
	イスラエル	1,083,410,200	0.20
	ノルウェー	1,075,994,165	0.20
	バミューダ	797,093,920	0.15
	キュラソー	727,446,873	0.13
	ニュージーランド	450,986,862	0.08
	ルクセンブルク	349,420,399	0.06
	ポルトガル	299,758,405	0.06
オーストリア	296,274,509	0.05	
リベリア	147,917,526	0.03	

	パナマ	114,449,599	0.02
	マン島	102,709,285	0.02
	小計	513,975,458,012	94.53
投資信託受益証券	オーストラリア	117,643,472	0.02
	香港	55,724,760	0.01
	小計	173,368,232	0.03
投資証券	アメリカ	9,464,358,970	1.74
	オーストラリア	620,153,911	0.11
	イギリス	239,428,507	0.04
	シンガポール	234,383,053	0.04
	フランス	210,244,859	0.04
	香港	146,170,332	0.03
	カナダ	53,638,205	0.01
	ベルギー	51,260,997	0.01
	小計	11,019,638,834	2.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		18,559,051,881	3.41
合計(純資産総額)		543,727,516,959	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	13,729,020,480	2.52
	買建	カナダ	687,414,550	0.13
	買建	ドイツ	2,824,764,713	0.52
	買建	イギリス	706,848,486	0.13
	買建	オーストラリア	624,376,935	0.11

(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		941,087,703	0.17

(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	1,262,821	20,025.49	25,288,614,485	21,679.93	27,377,871,893	5.04
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	562,164	36,468.76	20,501,425,332	37,929.19	21,322,428,821	3.92
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	727,070	15,417.78	11,209,807,897	13,620.05	9,902,737,024	1.82
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	196,006	25,038.21	4,907,639,449	36,564.51	7,166,865,288	1.32
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	474,294	14,991.75	7,110,498,692	13,471.84	6,389,613,687	1.18
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	433,996	15,080.87	6,545,040,815	13,529.25	5,871,644,549	1.08
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	213,069	33,684.29	7,177,078,616	26,075.73	5,555,931,505	1.02
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	179,617	26,008.97	4,671,653,775	27,752.87	4,984,888,185	0.92
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	327,418	13,015.16	4,261,400,636	14,620.19	4,786,916,545	0.88
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	74,171	67,755.92	5,025,524,937	62,767.11	4,655,499,449	0.86
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	207,999	24,089.42	5,010,577,181	20,487.50	4,261,381,156	0.78
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	103,354	42,521.09	4,394,725,266	40,737.33	4,210,366,253	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	232,844	17,521.18	4,079,702,011	17,191.98	4,003,051,137	0.74
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	128,824	28,420.52	3,661,245,739	29,691.73	3,825,007,529	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	187,873	19,833.21	3,726,124,831	19,688.99	3,699,031,215	0.68
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	218,301	17,014.39	3,714,259,748	16,185.75	3,533,367,244	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	67,952	47,754.33	3,245,002,497	47,971.98	3,259,792,515	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	146,184	23,741.63	3,470,647,025	21,683.93	3,169,844,603	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	80,884	41,185.49	3,331,247,698	38,104.12	3,082,013,707	0.57
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	140,386	20,002.23	2,808,033,645	21,087.05	2,960,327,668	0.54
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,858	78,844.72	2,511,835,103	90,885.56	2,895,432,298	0.53

アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	63,340	43,142.20	2,732,627,435	45,492.33	2,881,484,543	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	201,265	12,446.73	2,505,092,708	14,143.49	2,846,591,044	0.52
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	33,103	77,783.93	2,574,881,627	84,624.63	2,801,329,375	0.52
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	131,448	14,562.93	1,914,268,288	21,116.97	2,775,784,261	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	326,933	8,617.71	2,817,416,610	8,258.83	2,700,084,232	0.50
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	22,026	87,400.84	1,925,091,093	120,510.43	2,654,362,951	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	108,690	22,933.77	2,492,672,277	24,146.22	2,624,453,728	0.48
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	445,597	7,146.01	3,184,244,264	5,391.94	2,402,632,912	0.44
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,133	76,355.30	2,377,169,844	75,173.38	2,340,372,967	0.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	不動産管理・開発	0.31
		エネルギー	5.12
		素材	4.23
		資本財	6.55
		商業・専門サービス	1.53
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	1.90
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	2.03
		メディア・娯楽	5.19
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.96
		生活必需品流通・小売り	1.80
		食品・飲料・タバコ	4.15
		家庭用品・パーソナル用品	1.78
		ヘルスケア機器・サービス	4.52

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.65
	銀行	5.27
	金融サービス	6.39
	保険	3.08
	エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.04
	ソフトウェア・サービス	8.42
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.48
	電気通信サービス	1.41
	公益事業	3.00
	半導体・半導体製造装置	5.17
	小計	94.53
投資信託受益証券		0.03
投資証券		2.03
合計		96.59

(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	504	アメリカドル	98,874,408.2	13,202,699,727	102,816,000	13,729,020,480	2.52
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	29	カナダドル	6,846,674.5	676,109,107	6,961,160	687,414,550	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	56	スイスフラン	5,922,782	865,673,817	6,120,240	894,534,278	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	313	ユーロ	12,862,248.5	1,874,286,851	13,246,160	1,930,230,435	0.35
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	39	オーストラリアドル	6,855,848	614,901,007	6,961,500	624,376,935	0.11
	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	56	イギリスポンド	4,236,295	701,361,000	4,269,440	706,848,486	0.13

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,490,000.00	727,740,500	732,752,421	0.13
	カナダドル	買建	930,000.00	90,779,160	91,801,602	0.02
	ユーロ	買建	800,000.00	116,528,800	116,533,680	0.02

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

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

## 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	122,465,596,950	97.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,682,685,851	2.92
合計(純資産総額)		126,148,282,801	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	3,674,836,000	2.91

(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	14,247	637,819.76	9,087,018,120	551,000	7,850,097,000	6.22
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,213	599,690.38	7,324,018,610	528,000	6,448,464,000	5.11
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	61,618	107,408.46	6,618,294,488	96,700	5,958,460,600	4.72
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	39,492	167,618.31	6,619,582,298	148,500	5,864,562,000	4.65



日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	20,585	313,454.06	6,452,451,825	280,300	5,769,975,500	4.57
日本	投資証券	G L P投資法人	39,417	151,543.26	5,973,380,679	143,100	5,640,572,700	4.47
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	18,409	301,264.86	5,545,984,807	271,500	4,998,043,500	3.96
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	24,333	188,939.84	4,597,473,126	168,000	4,087,944,000	3.24
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	27,318	153,976.19	4,206,321,558	143,000	3,906,474,000	3.10
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	12,211	336,451.47	4,108,408,900	316,500	3,864,781,500	3.06
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	53,752	45,894.6	2,466,926,539	55,700	2,993,986,400	2.37
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	39,383	74,586.04	2,937,422,013	75,100	2,957,663,300	2.34
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,352	388,483.22	3,244,611,853	349,000	2,914,848,000	2.31
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	18,634	155,340.71	2,894,618,790	144,200	2,687,022,800	2.13
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	36,697	79,535.83	2,918,726,353	71,900	2,638,514,300	2.09
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,217	619,435.02	2,612,157,479	597,000	2,517,549,000	2.00
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	6,447	430,850.17	2,777,691,045	378,000	2,436,966,000	1.93
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,234	319,800.43	2,633,236,740	294,500	2,424,913,000	1.92
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,950	162,621.69	2,431,194,265	153,700	2,297,815,000	1.82
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	4,824	491,472.71	2,370,864,353	465,000	2,243,160,000	1.78
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	7,106	334,719.08	2,378,513,782	306,500	2,177,989,000	1.73
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,531	515,897.64	2,337,532,206	475,000	2,152,225,000	1.71
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	14,361	159,213.66	2,286,467,371	147,600	2,119,683,600	1.68
日本	投資証券	イオンリート投資法人	14,020	159,605.9	2,237,674,718	144,900	2,031,498,000	1.61
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,923	116,023.94	1,963,473,136	108,900	1,842,914,700	1.46
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,840	309,835.7	1,809,440,488	315,500	1,842,520,000	1.46
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	8,956	209,540.29	1,876,642,837	204,800	1,834,188,800	1.45
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	11,426	170,601.37	1,949,291,253	149,600	1,709,329,600	1.36
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	4,196	445,465.84	1,869,174,664	390,500	1,638,538,000	1.30
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	11,739	143,060.49	1,679,387,092	134,900	1,583,591,100	1.26

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.08
合計	97.08

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,068	円	3,719,608,200	3,674,836,000	2.91

(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	63,205,933,124	76.14
	オーストラリア	5,406,743,900	6.51
	イギリス	3,910,163,366	4.71
	シンガポール	3,222,113,425	3.88
	フランス	1,499,320,908	1.81
	カナダ	1,471,120,553	1.77
	香港	1,213,489,429	1.46
	ベルギー	944,011,016	1.14
	スペイン	341,146,502	0.41
	ニュージーランド	334,647,423	0.40
	韓国	198,750,268	0.24
	オランダ	165,482,864	0.20
	ガーンジー	163,539,726	0.20
	イスラエル	112,578,230	0.14
	ドイツ	45,046,132	0.05
	小計		82,276,909,668
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		741,169,902	0.89
合計(純資産総額)		83,018,079,570	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		94,848,208	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。

## 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	460,332	14,624.00	6,731,899,119	16,279.97	7,494,194,649	9.03
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	46,181	80,765.72	3,729,841,922	93,739.39	4,328,979,014	5.21
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	78,938	38,074.13	3,005,496,411	39,343.27	3,105,679,774	3.74
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	313,320	8,449.09	2,647,271,010	8,360.31	2,619,453,363	3.16
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	163,396	15,110.17	2,468,942,664	14,362.48	2,346,772,893	2.83
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	236,189	8,904.39	2,103,120,835	9,473.95	2,237,643,603	2.70
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	501,743	4,214.01	2,114,354,843	4,247.58	2,131,198,198	2.57
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	143,827	13,011.73	1,871,438,450	12,481.04	1,795,111,849	2.16
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	69,637	21,297.79	1,483,114,862	21,800.10	1,518,094,107	1.83
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	851,596	1,546.75	1,317,207,685	1,673.61	1,425,244,180	1.72
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	66,360	20,270.27	1,345,135,378	21,208.56	1,407,400,699	1.70
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	170,643	7,978.53	1,361,481,575	7,815.51	1,333,662,227	1.61
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	78,478	18,943.89	1,486,678,913	16,555.04	1,299,207,167	1.56
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	199,439	5,622.62	1,121,370,953	5,936.74	1,184,018,247	1.43
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	288,180	3,989.21	1,149,612,629	4,099.37	1,181,356,735	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	61,488	17,917.31	1,101,699,665	18,610.07	1,144,296,359	1.38
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	57,579	20,382.02	1,173,576,841	19,826.53	1,141,592,024	1.38
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	105,627	10,491.33	1,108,168,078	10,295.16	1,087,447,182	1.31
香港	投資証券	LINK REIT	1,260,400	838.21	1,056,485,730	857.30	1,080,545,962	1.30
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	145,899	6,588.82	961,302,315	6,915.51	1,008,967,263	1.22
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	32,452	27,807.46	902,407,779	27,264.15	884,776,371	1.07
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	128,692	6,701.40	862,417,046	6,798.01	874,849,799	1.05
アメリカ	投資証券	UDR INC	153,910	5,050.19	777,275,518	5,325.17	819,597,900	0.99
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	273,547	3,188.26	872,139,098	2,896.26	792,264,793	0.95
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	309,505	2,772.81	858,201,455	2,511.69	777,383,492	0.94
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	55,399	14,603.08	808,996,051	13,781.63	763,488,592	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	86,579	8,292.29	717,938,466	8,775.59	759,781,945	0.92
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	600,704	1,309.44	786,589,447	1,259.91	756,833,938	0.91
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	357,950	2,247.91	804,640,759	2,108.43	754,715,633	0.91
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	94,687	7,203.13	682,043,616	7,755.42	734,337,681	0.88

(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	99.11
合計	99.11

(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	220,000.00	29,359,000	29,359,638	0.04
	オーストラリアドル	買建	450,000.00	39,766,950	40,347,945	0.05
	シンガポールドル	買建	250,000.00	24,904,250	25,140,625	0.03

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

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

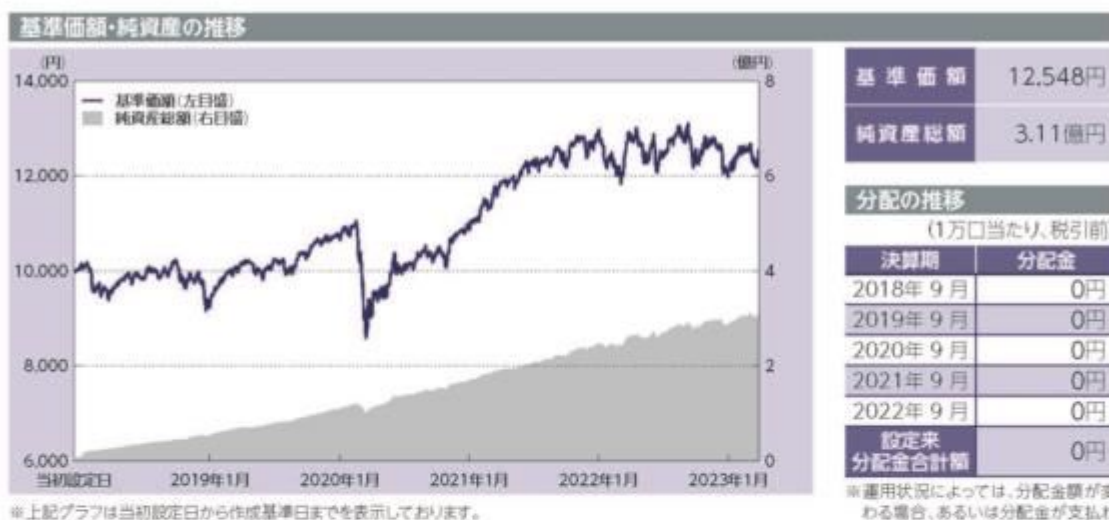
#### 参考情報

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：2023年3月31日



**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	21.5%	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	-	-	1.1%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
国内株式 インデックス マザーファンド	20.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
外国債券 インデックス マザーファンド	19.4%	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.1%
		T 2.625% 02/15/29	アメリカ	国債	-	2.625%	2029/02/15	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	16.5%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.2%
		第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	0.2%
グローバル REITインデックス マザーファンド	9.8%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.9%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
J-REIT インデックス マザーファンド	9.0%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.6%
		ジャパソリアルエステイト投資法人	日本	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。



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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（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30億口を下回るようになった場合
- ・ 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、以下の手続きを行います。

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、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

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ものを除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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5期計算期間(2021年9月7日から2022年9月5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4期 （2021年 9月 6日現在）	第5期 （2022年 9月 5日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,310,108	10,075,689
親投資信託受益証券	215,460,366	274,250,262
流動資産合計	222,770,474	284,325,951
資産合計	222,770,474	284,325,951
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	29,741	16
未払受託者報酬	55,397	73,539
未払委託者報酬	498,547	661,875
未払利息	6	19
その他未払費用	5,486	7,291
流動負債合計	589,177	742,740
負債合計	589,177	742,740
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	176,550,538	223,078,987
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	45,630,759	60,504,224
（分配準備積立金）	37,310,326	39,067,156
元本等合計	222,181,297	283,583,211
純資産合計	222,181,297	283,583,211
負債純資産合計	222,770,474	284,325,951

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2020年 9月 8日	自	2021年 9月 7日
	至	2021年 9月 6日	至	2022年 9月 5日
営業収益				
受取利息		24		40
有価証券売買等損益		36,469,518		4,447,284
営業収益合計		36,469,542		4,447,324
営業費用				
支払利息		1,884		2,926
受託者報酬		100,058		137,824
委託者報酬		900,403		1,240,377
その他費用		9,896		13,653
営業費用合計		1,012,241		1,394,780
営業利益又は営業損失（ ）		35,457,301		3,052,544
経常利益又は経常損失（ ）		35,457,301		3,052,544
当期純利益又は当期純損失（ ）		35,457,301		3,052,544
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		2,255,409		93,184
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,384,140		45,630,759
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,094,086		14,653,301
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,094,086		14,653,301
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,049,359		2,739,196
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,049,359		2,739,196
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		45,630,759		60,504,224



## (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、前計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は2021年 9月 7日から2022年 9月 5日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 (2021年 9月 6日現在)	第5期 (2022年 9月 5日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	176,550,538口	223,078,987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) 1.2585円 (12,585円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2712円 (12,712円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日			第5期 自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 5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	3,450,076円	費用控除後の配当等収益額	A	3,666,526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	29,751,816円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	8,320,433円	収益調整金額	C	21,437,068円
分配準備積立金額	D	4,108,434円	分配準備積立金額	D	35,400,630円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	45,630,759円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	60,504,224円
当ファンドの期末残存口数	F	176,550,538口	当ファンドの期末残存口数	F	223,078,987口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,584円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,712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5期 自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 5日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第5期 (2022年 9月 5日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第4期	第5期
	自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日	自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 5日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	142,231,158円	176,550,538円
期中追加設定元本額	56,921,923円	57,198,326円
期中一部解約元本額	22,602,543円	10,669,877円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期	第5期
	(2021年 9月 6日現在)	(2022年 9月 5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	35,089,396	4,261,555
合計	35,089,396	4,261,555

## （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-REITインデックス マザーファンド	12,629,183	27,990,058	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	12,102,334	31,168,350	
	国内株式インデックス マザーファンド	29,115,018	55,548,542	
	外国株式インデックス マザーファンド	13,939,508	60,213,098	
	国内債券インデックス マザーファンド	32,185,047	44,173,977	
	外国債券インデックス マザーファンド	17,432,990	55,156,237	
合計		117,404,080	274,250,262	

(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

	2022年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	567,685,148
国債証券	526,269,767,600
地方債証券	33,324,911,884
特殊債証券	36,755,157,786
社債証券	29,076,622,700
未収入金	300,651,000
未収利息	1,480,431,573
前払費用	48,689,474
流動資産合計	627,823,917,165
資産合計	627,823,917,165
負債の部	
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	325,341,829
未払利息	1,072
流動負債合計	625,342,901
負債合計	625,342,901
純資産の部	
元本等	

	2022年 9月 5日現在
項目	金額（円）
元本	456,966,880,624
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	170,231,693,640
元本等合計	627,198,574,264
純資産合計	627,198,574,264
負債純資産合計	627,823,917,165

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 9月 5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）

	2022年 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	456,966,880,624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 100,303,000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 1.3725円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,725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

	2022年 9月 5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（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月 5日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 9月 7日
期首元本額	469,252,648,029円
期中追加設定元本額	42,824,768,721円
期中一部解約元本額	55,110,536,126円
期末元本額	456,966,880,624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）	4,134,173,302円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,956,396円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,838,858,775円
世界経済インデックスファンド	4,039,120,716円
D Cマイセレクション2 5	26,084,566,065円
D Cマイセレクション5 0	29,950,546,743円
D Cマイセレクション7 5	8,749,644,614円
D C日本債券インデックス・オープン	439,750,117円
D C日本債券インデックス・オープンS	92,368,518,315円
D C日本債券インデックス・オープンP	66,862,729,024円
D CマイセレクションS 2 5	13,288,157,823円
D CマイセレクションS 5 0	14,813,119,158円
D CマイセレクションS 7 5	3,386,564,882円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	691,281,777円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	2,340,130,473円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	887,174,271円
D C世界経済インデックスファンド	3,517,045,625円
国内バランス6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,791,837円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	31,497,651円
マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,937,325円
国内バランス6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	972,063円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	83,742,059円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	115,711,518円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	33,991,043円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	27,636,279円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,756,315,017円

区分	2022年 9月 5日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	747,818,859円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,122,222,350円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	76,482,006円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	54,472,065円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	968,717,420円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,107,535,359円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,412,090,181円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	136,567,342円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,571,025,390円
日本債券ファンド・シリーズ1	16,481,077,456円
分散投資コア戦略ファンドA	20,452,828,218円
分散投資コア戦略ファンドS	25,702,211,927円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	172,708,851円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,435,329,822円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	72,864,454円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	36,837,336円
SMT インデックスバランス・オープン	61,858,450円
SMT 世界経済インデックス・オープン	40,119,187円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	79,233,224円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	124,874,492円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,511,104円
グローバル経済コア	232,415,212円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	32,185,047円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	20,589,696円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	35,311,557円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	19,080,321円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	4,721,917円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,806,072円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	8,883,215円
10資産分散投資ファンド	89,612円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	82,855,619,752円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	89,925,062円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,719,926円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	309,987,634円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,598,403,350
地方債証券	223,930,426



特殊債券	223,469,286
社債券	252,989,680
合計	6,298,792,742

(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429回利付国債(2年)	950,000,000	951,415,500	
	第430回利付国債(2年)	990,000,000	991,534,500	
	第432回利付国債(2年)	1,550,000,000	1,552,557,500	
	第433回利付国債(2年)	1,910,000,000	1,913,208,800	
	第434回利付国債(2年)	1,915,000,000	1,918,255,500	
	第435回利付国債(2年)	3,120,000,000	3,125,366,400	
	第436回利付国債(2年)	720,000,000	721,303,200	
	第437回利付国債(2年)	2,390,000,000	2,394,349,800	
	第438回利付国債(2年)	370,000,000	370,706,700	
	第439回利付国債(2年)	470,000,000	470,893,000	
	第440回利付国債(2年)	1,500,000,000	1,502,835,000	
	第138回利付国債(5年)	6,890,000,000	6,909,498,700	
	第139回利付国債(5年)	5,590,000,000	5,607,608,500	
	第140回利付国債(5年)	4,660,000,000	4,676,636,200	
	第141回利付国債(5年)	7,650,000,000	7,681,212,000	
	第142回利付国債(5年)	4,370,000,000	4,390,014,600	
	第143回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,824,384,000	
	第144回利付国債(5年)	5,830,000,000	5,862,531,400	
	第145回利付国債(5年)	5,170,000,000	5,200,709,800	
	第146回利付国債(5年)	4,120,000,000	4,145,791,200	
第147回利付国債(5年)	4,170,000,000	4,183,302,300		

第148回利付国債(5年)	6,770,000,000	6,790,513,100	
第149回利付国債(5年)	4,820,000,000	4,832,676,600	
第150回利付国債(5年)	7,700,000,000	7,713,167,000	
第151回利付国債(5年)	4,000,000,000	4,004,520,000	
第152回利付国債(5年)	210,000,000	211,094,100	
第153回利付国債(5年)	3,900,000,000	3,899,064,000	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	513,384,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,396,770,400	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	682,181,500	
第4回利付国債(40年)	950,000,000	1,176,945,500	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,273,310,700	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,463,628,600	
第7回利付国債(40年)	1,240,000,000	1,380,256,400	
第8回利付国債(40年)	1,490,000,000	1,541,688,100	
第9回利付国債(40年)	2,050,000,000	1,562,551,000	
第10回利付国債(40年)	2,100,000,000	1,881,852,000	
第11回利付国債(40年)	1,635,000,000	1,413,948,000	
第12回利付国債(40年)	1,290,000,000	998,511,600	
第13回利付国債(40年)	2,120,000,000	1,632,463,600	
第14回利付国債(40年)	2,130,000,000	1,754,587,500	
第15回利付国債(40年)	1,010,000,000	908,333,400	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,844,544,000	
第333回利付国債(10年)	3,320,000,000	3,355,955,600	
第334回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,313,335,200	
第335回利付国債(10年)	2,310,000,000	2,338,297,500	
第336回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,226,637,500	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,825,676,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,617,912,000	
第339回利付国債(10年)	4,670,000,000	4,735,239,900	
第340回利付国債(10年)	4,830,000,000	4,902,836,400	
第341回利付国債(10年)	5,340,000,000	5,408,619,000	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,791,178,000	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,687,728,800	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,938,173,000	
第345回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,801,886,200	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,781,280,000	
第347回利付国債(10年)	3,850,000,000	3,867,479,000	
第348回利付国債(10年)	4,460,000,000	4,479,044,200	
第349回利付国債(10年)	5,000,000,000	5,018,450,000	
第350回利付国債(10年)	6,890,000,000	6,910,876,700	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,940,000,000	4,951,362,000	
第352回利付国債(10年)	4,510,000,000	4,518,118,000	

第353回利付国債(10年)	5,415,000,000	5,420,035,950	
第354回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,791,532,800	
第355回利付国債(10年)	3,820,000,000	3,816,103,600	
第356回利付国債(10年)	4,280,000,000	4,268,058,800	
第357回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,757,008,700	
第358回利付国債(10年)	3,560,000,000	3,538,818,000	
第359回利付国債(10年)	3,360,000,000	3,336,782,400	
第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	4,851,271,200	
第361回利付国債(10年)	4,180,000,000	4,142,505,400	
第362回利付国債(10年)	3,790,000,000	3,753,464,400	
第363回利付国債(10年)	5,070,000,000	5,017,525,500	
第364回利付国債(10年)	5,210,000,000	5,156,858,000	
第365回利付国債(10年)	6,740,000,000	6,675,498,200	
第366回利付国債(10年)	5,970,000,000	5,989,581,600	
第367回利付国債(10年)	4,090,000,000	4,078,220,800	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	130,484,200	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	186,342,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	139,376,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	134,084,500	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	58,552,500	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	419,790,000	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	215,665,200	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	403,613,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	267,144,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	173,246,400	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	298,030,200	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	226,177,900	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	472,692,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	982,904,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	422,504,400	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	249,096,000	
第17回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,421,032,000	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	422,983,800	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	650,908,900	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	602,299,200	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	615,975,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	680,783,400	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	543,016,900	
第24回利付国債(30年)	780,000,000	985,927,800	
第25回利付国債(30年)	600,000,000	743,022,000	
第26回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,741,934,100	
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,440,012,800	

第28回利付国債(30年)	2,090,000,000	2,661,824,000
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,103,632,200
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,206,021,800
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,354,265,000
第32回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,697,171,200
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,181,452,000
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,211,314,350
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,758,275,000
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,557,491,000
第37回利付国債(30年)	2,255,000,000	2,667,236,550
第38回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,641,310,500
第39回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,749,878,000
第40回利付国債(30年)	1,380,000,000	1,605,367,800
第41回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,315,531,000
第42回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,554,847,200
第43回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,485,367,000
第44回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,450,174,900
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,585,670,400
第46回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,870,068,000
第47回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,825,029,500
第48回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,843,243,200
第49回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,722,512,000
第50回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,624,722,300
第51回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,441,205,100
第52回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,472,505,800
第53回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,187,802,000
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,617,178,400
第55回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,350,590,400
第56回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,383,326,400
第57回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,314,599,400
第58回利付国債(30年)	2,350,000,000	2,183,338,000
第59回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,274,922,000
第60回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,540,610,800
第61回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,310,189,400
第62回利付国債(30年)	480,000,000	407,452,800
第63回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,341,196,600
第64回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,467,692,600
第65回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,152,619,850
第66回利付国債(30年)	1,140,000,000	934,800,000
第67回利付国債(30年)	1,865,000,000	1,603,415,100
第68回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,278,300,800
第69回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,181,035,800
第70回利付国債(30年)	2,270,000,000	1,992,719,500

第7 1 回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,252,894,500	
第7 2 回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,005,594,500	
第7 3 回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,633,725,500	
第7 4 回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,640,854,800	
第7 5 回利付国債(30年)	900,000,000	911,745,000	
第6 5 回利付国債(20年)	220,000,000	225,715,600	
第6 6 回利付国債(20年)	330,000,000	338,147,700	
第6 7 回利付国債(20年)	130,000,000	134,005,300	
第6 8 回利付国債(20年)	190,000,000	196,729,800	
第6 9 回利付国債(20年)	390,000,000	403,213,200	
第7 0 回利付国債(20年)	400,000,000	417,892,000	
第7 1 回利付国債(20年)	200,000,000	208,230,000	
第7 2 回利付国債(20年)	630,000,000	658,236,600	
第7 3 回利付国債(20年)	360,000,000	377,334,000	
第7 4 回利付国債(20年)	200,000,000	210,088,000	
第7 5 回利付国債(20年)	130,000,000	137,265,700	
第7 6 回利付国債(20年)	270,000,000	283,718,700	
第7 7 回利付国債(20年)	290,000,000	305,471,500	
第7 8 回利付国債(20年)	170,000,000	179,474,100	
第7 9 回利付国債(20年)	270,000,000	285,800,400	
第8 0 回利付国債(20年)	220,000,000	233,490,400	
第8 1 回利付国債(20年)	390,000,000	414,893,700	
第8 2 回利付国債(20年)	600,000,000	640,128,000	
第8 3 回利付国債(20年)	290,000,000	310,940,900	
第8 4 回利付国債(20年)	470,000,000	502,387,700	
第8 5 回利付国債(20年)	290,000,000	312,405,400	
第8 6 回利付国債(20年)	510,000,000	553,018,500	
第8 7 回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,977,864,000	
第8 8 回利付国債(20年)	420,000,000	457,875,600	
第8 9 回利付国債(20年)	350,000,000	380,233,000	
第9 0 回利付国債(20年)	630,000,000	687,632,400	
第9 1 回利付国債(20年)	450,000,000	492,988,500	
第9 2 回利付国債(20年)	880,000,000	960,669,600	
第9 3 回利付国債(20年)	410,000,000	447,584,700	
第9 4 回利付国債(20年)	610,000,000	668,688,100	
第9 5 回利付国債(20年)	610,000,000	676,984,100	
第9 6 回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,749,381,600	
第9 7 回利付国債(20年)	900,000,000	999,000,000	
第9 8 回利付国債(20年)	440,000,000	486,186,800	
第9 9 回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,430,971,200	
第1 0 0 回利付国債(20年)	480,000,000	537,100,800	
第1 0 1 回利付国債(20年)	715,000,000	807,950,000	

第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,430,415,000
第103回利付国債(20年)	400,000,000	451,796,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	178,872,000
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,324,432,000
第106回利付国債(20年)	380,000,000	428,795,800
第107回利付国債(20年)	760,000,000	856,041,200
第108回利付国債(20年)	870,000,000	969,058,200
第109回利付国債(20年)	520,000,000	581,136,400
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,243,627,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,106,556,600
第112回利付国債(20年)	790,000,000	895,891,600
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,297,527,800
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,656,572,800
第115回利付国債(20年)	700,000,000	803,152,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,715,004,900
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,235,055,600
第118回利付国債(20年)	660,000,000	752,235,000
第119回利付国債(20年)	530,000,000	595,926,700
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,741,177,100
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,703,070,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,059,821,800
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,160,523,200
第124回利付国債(20年)	610,000,000	699,798,100
第125回利付国債(20年)	1,770,000,000	2,067,041,400
第126回利付国債(20年)	730,000,000	840,251,900
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,165,492,800
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,111,901,300
第129回利付国債(20年)	740,000,000	841,868,400
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,467,521,400
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,133,160,000
第132回利付国債(20年)	660,000,000	750,268,200
第133回利付国債(20年)	730,000,000	836,499,700
第134回利付国債(20年)	430,000,000	493,902,300
第135回利付国債(20年)	630,000,000	717,740,100
第136回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,186,416,000
第137回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,209,703,800
第138回利付国債(20年)	620,000,000	695,689,600
第139回利付国債(20年)	830,000,000	939,277,800
第140回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,764,971,000
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,829,936,000
第142回利付国債(20年)	980,000,000	1,130,645,600
第143回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,178,201,600
第144回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,292,899,000

第145回利付国債（20年）	2,675,000,000	3,066,272,250	
第146回利付国債（20年）	2,700,000,000	3,097,251,000	
第147回利付国債（20年）	2,250,000,000	2,559,555,000	
第148回利付国債（20年）	2,050,000,000	2,310,083,500	
第149回利付国債（20年）	2,700,000,000	3,044,547,000	
第150回利付国債（20年）	2,530,000,000	2,823,808,900	
第151回利付国債（20年）	2,445,000,000	2,670,942,450	
第152回利付国債（20年）	2,840,000,000	3,101,904,800	
第153回利付国債（20年）	2,630,000,000	2,903,783,000	
第154回利付国債（20年）	2,655,000,000	2,896,658,100	
第155回利付国債（20年）	2,800,000,000	2,981,860,000	
第156回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,445,453,600	
第157回利付国債（20年）	2,950,000,000	2,823,091,000	
第158回利付国債（20年）	2,610,000,000	2,594,679,300	
第159回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,493,119,200	
第160回利付国債（20年）	1,890,000,000	1,921,676,400	
第161回利付国債（20年）	2,020,000,000	2,021,353,400	
第162回利付国債（20年）	1,260,000,000	1,257,391,800	
第163回利付国債（20年）	2,630,000,000	2,617,165,600	
第164回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,291,144,800	
第165回利付国債（20年）	2,150,000,000	2,096,314,500	
第166回利付国債（20年）	1,820,000,000	1,823,931,200	
第167回利付国債（20年）	2,210,000,000	2,142,241,400	
第168回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,578,012,600	
第169回利付国債（20年）	1,990,000,000	1,853,704,900	
第170回利付国債（20年）	2,240,000,000	2,078,272,000	
第171回利付国債（20年）	1,720,000,000	1,589,383,200	
第172回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,258,290,500	
第173回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,193,372,500	
第174回利付国債（20年）	2,830,000,000	2,632,862,200	
第175回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,916,015,500	
第176回利付国債（20年）	2,850,000,000	2,681,679,000	
第177回利付国債（20年）	2,340,000,000	2,155,444,200	
第178回利付国債（20年）	2,120,000,000	1,985,380,000	
第179回利付国債（20年）	2,935,000,000	2,742,053,100	
第180回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,375,874,400	
第181回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,101,848,000	
国債証券合計	512,640,000,000	526,269,767,600	
地方債証券			
第2回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（5年））	100,000,000	100,128,000	
第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	103,463,000	
第5回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	86,106,000	

第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	105,042,000	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	123,888,000	
第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	121,391,000	
第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	117,169,000	
第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	114,577,000	
第16回東京都公募公債（20年）	200,000,000	222,342,000	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,702,000	
第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	112,649,000	
第19回東京都公募公債（30年）	100,000,000	86,406,000	
第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	226,080,000	
第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	225,648,000	
第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,934,000	
第726回東京都公募公債	200,000,000	201,882,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	100,838,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	101,149,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	100,564,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,356,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	299,742,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	197,076,000	
第830回東京都公募公債	300,000,000	297,876,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,659,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,183,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,667,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	199,812,000	
第29回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	100,771,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	254,626,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,426,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	225,870,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	114,133,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,719,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	110,259,000	
第78回神奈川県公募公債（5年）	200,000,000	199,964,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	202,018,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,349,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,574,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,496,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,356,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	197,004,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	225,950,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	226,532,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	112,915,000	
第377回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,836,000	



第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,107,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	152,674,590	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,526,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,509,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	156,313,560	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,620,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,788,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	99,934,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	157,094,400	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	178,687,600	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	196,292,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	113,376,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	112,955,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,512,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	95,991,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	99,049,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	138,126,955	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	111,223,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	101,436,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	106,807,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,659,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,635,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	455,944,000	
平成25年度第7回兵庫県公募公債	100,000,000	100,802,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,114,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	97,453,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	296,964,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	108,418,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	91,101,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	112,804,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,063,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,144,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,404,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,499,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,449,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	306,853,500	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	113,650,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,080,000	
	200,000,000	202,226,000	

平成26年度第5回愛知県公募公債（10年）			
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,203,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,117,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	201,040,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	295,302,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,112,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	89,905,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	197,016,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,692,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	171,354,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	112,909,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	226,258,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	100,820,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,068,376	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,352,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	386,061,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	111,042,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	112,431,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	95,331,000	
第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	227,456,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	193,780,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	225,870,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	192,500,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,001,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,482,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,118,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,730,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,382,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	98,449,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	98,310,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	147,129,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,122,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,453,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	105,294,000	
	100,000,000	114,217,000	

平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）			
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	106,009,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	120,401,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,992,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,526,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,465,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	89,905,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	98,082,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	296,466,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	98,440,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	95,719,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	224,862,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	113,277,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	112,804,000	
平成25年度第8回千葉県公募公債	300,000,000	302,448,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	100,920,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,036,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,461,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,117,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,524,400	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	295,182,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,665,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	296,310,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	200,000,000	199,018,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	224,116,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,357,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,771,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,805,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,108,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,964,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,021,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,265,600	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,160,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,123,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,092,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,198,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,086,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,944,000	

第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,352,478	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,532,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,248,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,182,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,234,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,040,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,148,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,935,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,437,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,713,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,718,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,445,725	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,408,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,252,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,334,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,536,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,414,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	99,619,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	226,938,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	85,304,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	289,452,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	99,738,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,077,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	196,980,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	123,875,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	125,745,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	111,577,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	113,374,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,612,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	296,355,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,874,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	131,370,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	225,096,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	114,109,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	113,121,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	85,305,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	85,575,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	106,022,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	338,451,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,414,000	

	平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,610,000	
	平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,195,000	
	平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,598,000	
	第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	220,020,000	
	令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	296,367,000	
	令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	98,489,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	106,248,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,961,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	112,051,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,384,000	
	第93回川崎市公募公債	100,000,000	98,317,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,003,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,506,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,163,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	113,021,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	111,430,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	202,268,000	
	平成30年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	100,025,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	151,468,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,027,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,405,300	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,691,900	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	542,575,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	200,030,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	196,788,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	296,499,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	99,276,000	
	平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,128,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	201,536,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	99,576,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	110,985,000	
	地方債証券合計	32,411,430,000	33,324,911,884	
特殊債券	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,170,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,038,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,411,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	76,383,000	

第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,875,000	
第21回道路債券	100,000,000	123,784,000	
第27回道路債券	400,000,000	414,624,000	
第28回道路債券	200,000,000	250,584,000	
第33回道路債券	200,000,000	253,638,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,971,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,931,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,571,000	
第42回道路債券	100,000,000	105,531,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,884,000	
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	126,555,000	
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	226,134,000	
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	227,944,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,128,000	
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	122,094,000	
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,954,000	
第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,988,000	
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	114,725,000	
第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,950,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,272,000	
第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,856,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,997,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,354,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,682,000	
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	113,157,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	588,960,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,697,000	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,837,000	
	265,800,000	268,091,196	

第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,896,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,346,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	533,000,000	538,799,040	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,138,000	
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	223,146,000	
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	103,166,880	
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	101,202,000	
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	101,180,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	221,520,000	
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	101,193,000	
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	101,111,000	
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	302,415,000	
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	108,002,000	
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	217,334,000	
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	202,210,000	
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	100,521,000	
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	84,954,000	
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	106,817,030	
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	205,539,150	
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	100,364,000	
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	200,648,000	
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	100,292,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	120,457,200	
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	200,056,000	
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	294,657,000	
	214,000,000	214,768,260	

第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,684,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,355,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	362,313,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	105,821,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	375,639,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,345,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	250,958,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	41,369,200	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	123,568,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	225,986,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	221,750,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	600,000,000	600,306,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	167,492,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,501,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	226,526,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	112,646,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	562,385,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	105,877,800	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	706,965,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,021,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,096,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,246,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,087,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,098,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,808,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,820,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,288,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,087,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,220,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,976,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,170,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,805,710	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,148,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,345,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,309,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,445,500	



F 1 0 7 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,425,000	
第 1 1 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,541,320	
第 1 1 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,387,000	
第 1 1 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,400,000	
第 1 1 9 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,062,000	
第 1 2 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,618,000	
F 1 3 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,046,000	
F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,838,000	
F 2 0 2 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,526,000	
F 2 0 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,673,000	
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,734,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,786,000	
F 4 4 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,290,000	
第 2 9 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,745,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	105,335,000	
第 1 9 回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,844,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	113,016,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	114,934,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,109,620	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,347,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,892,900	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	187,658,240	
第 5 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	220,074,800	
第 8 7 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,882,000	
第 8 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,962,000	
第 8 9 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,974,000	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	206,694,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	143,928,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	79,214,000	
第 1 7 1 回都市再生債券	200,000,000	168,520,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,927,000	
第 1 6 回政府保証民間都市開発債券	180,000,000	181,467,000	
第 6 2 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,601,000	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,337,000	10,425,588	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,439,000	10,546,626	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	128,475,000	127,549,980	
第 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,649,000	
	89,544,000	88,844,661	

第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券			
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,807,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,370,000	10,468,411	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,298,000	11,480,349	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	159,501,000	157,931,510	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,114,000	11,287,600	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	182,121,000	179,986,541	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	64,936,000	64,298,328	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,579,000	11,825,632	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	219,006,000	216,042,848	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	151,398,000	149,478,273	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,714,000	11,983,656	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,053,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,529,000	16,277,031	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,629,000	16,418,889	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,492,000	18,513,182	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,237,000	20,273,874	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,141,000	22,405,231	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,658,000	22,913,081	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,990,000	47,475,247	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,160,000	10,261,600	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,438,000	21,491,783	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,369,000	10,453,507	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,735,000	21,795,180	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,369,000	21,437,557	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,209,000	20,166,184	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,268,000	11,485,359	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,668,000	42,468,372	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,484,000	22,456,580	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,903,000	11,074,940	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,496,000	29,768,346	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,228,000	28,419,225	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,400,000	28,623,410	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,100,000	62,631,412	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,814,000	76,487,543	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,027,000	39,363,268	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,802,000	40,494,155	

第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,041,000	40,789,255	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,219,000	35,634,982	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,467,000	34,602,200	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,974,000	40,759,788	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	171,534,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,018,000	105,470,289	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,056,000	142,701,584	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,564,000	40,819,761	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,896,000	42,218,167	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,792,000	43,019,431	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,323,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,111,000	135,931,650	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,499,000	46,626,010	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,332,000	97,021,283	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,199,000	54,294,367	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,971,000	57,953,749	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	319,788,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,425,000	57,678,763	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,951,000	179,468,234	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,952,000	120,826,490	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,224,000	58,506,962	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,899,000	63,272,538	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,172,000	67,516,185	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,856,000	73,305,034	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,534,000	72,805,278	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,859,000	73,435,049	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,394,000	74,275,713	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,763,000	74,510,301	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,601,000	76,262,423	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,053,000	76,782,543	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,040,000	76,550,796	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,942,000	76,451,110	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,707,000	77,232,210	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,366,000	156,034,683	

第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,843,000	77,317,559	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,022,000	158,258,694	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,964,000	78,412,831	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,302,000	156,889,946	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,096,000	79,506,493	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,226,000	159,731,434	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,304,000	160,758,865	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,233,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,890,000	81,508,392	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,590,000	81,386,025	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,782,000	80,894,665	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,784,000	166,176,287	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,555,000	83,142,931	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,834,000	82,557,208	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,890,000	167,012,063	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,340,000	84,260,069	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	260,622,000	252,967,531	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,762,000	169,578,559	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,009,000	87,569,724	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,603,000	87,900,543	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,272,000	182,116,017	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,146,000	91,899,706	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,338,000	183,772,125	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,928,000	184,973,771	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,458,000	92,233,700	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,952,000	186,219,082	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,310,000	187,312,779	

第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,118,000	94,008,924	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,624,000	94,808,435	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,524,000	284,031,729	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,910,000	95,182,094	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,399,000	97,874,533	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,179,000	98,763,439	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,930,000	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,156,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	93,547,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	85,673,000	
第65回日本学生支援債券	200,000,000	199,950,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	105,571,000	
第24回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	600,426,000	
い第823号商工債	200,000,000	200,286,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,162,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,896,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,925,000	
い第843号商工債	200,000,000	200,080,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,901,000	
い第850号商工債	200,000,000	199,716,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,031,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,754,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,823,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,738,000	
第385回信金中金債（5年）	100,000,000	99,529,000	
第254号商工債（3年）	300,000,000	299,883,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,326,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	113,393,000	
第53回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,024,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,521,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	197,912,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	493,525,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,362,000	
第63回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,848,000	
第66回西日本高速道路株式会社社債	800,000,000	799,928,000	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,919,000	
	200,000,000	194,536,000	

	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券			
	特殊債券合計	35,858,231,000	36,755,157,786	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,806,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	298,575,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,640,000	
	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,114,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,919,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,913,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,615,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,452,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,894,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,925,000	
	第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,776,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,239,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	299,634,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,273,000	
	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	100,133,000	
	第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,740,000	
	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	100,160,000	
	第13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	200,000,000	199,788,000	
	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	101,039,000	
	第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,720,000	
	第8回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,865,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,087,000	
	第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,909,000	
	第10回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,257,000	
	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	99,977,000	
	第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,710,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,972,000		
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	100,217,000		

第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	100,240,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,857,000	
第13回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	100,024,000	
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	99,975,000	
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	199,154,000	
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	200,240,000	
第40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	99,581,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	92,756,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,731,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,726,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,166,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	199,426,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	291,792,000	
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	100,230,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,621,000	
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,541,000	
第19回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	93,894,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,809,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,660,000	
第4回E N E O Sホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,435,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,176,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,089,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,222,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,879,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,178,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,588,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,025,000	
第14回株式会社L I X I L無担保社債	100,000,000	100,025,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,912,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	106,231,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,911,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,769,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,168,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,001,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,664,000	

第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,934,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,936,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,401,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,892,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,796,000	
第29回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,038,000	
第35回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,945,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,026,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,817,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,002,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,982,000	
第8回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	95,106,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,744,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	91,897,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,115,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,881,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	113,027,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,540,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,736,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,740,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,115,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	100,106,000	
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	98,540,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	100,026,000	
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	114,695,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	109,397,000	
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	100,911,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,851,000	
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	302,352,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,648,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,724,000	
第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,872,000	
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,330,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,098,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,065,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,029,000	



第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,936,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	200,058,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,109,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,116,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,458,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,228,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,435,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,141,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,911,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,310,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,043,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,562,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,656,000	
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	200,032,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,992,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,288,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,819,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,525,000	
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	99,734,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,687,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,171,000	
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,004,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	199,532,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,814,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	200,046,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	93,793,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,179,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,233,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,323,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,762,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,813,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,828,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,162,000	

第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,151,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,599,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,752,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,241,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,422,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,094,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	94,234,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,449,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,759,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	224,226,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,211,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,372,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	90,922,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,241,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	86,901,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	91,939,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	82,401,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,201,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	86,263,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,354,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,055,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	91,786,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	122,105,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,649,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,944,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	90,494,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	77,845,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	71,818,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	84,236,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	91,988,000	
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	168,648,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,643,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,872,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,763,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	397,312,000	

第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	182,872,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	94,338,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	93,389,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,734,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,256,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,550,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	90,528,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,571,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,258,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,217,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,907,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,792,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,326,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,219,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,557,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,114,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,674,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,026,000	
第442回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,039,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,475,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,415,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,482,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	127,568,700	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,140,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,487,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	195,066,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	96,038,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,589,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,311,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,782,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,276,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,583,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,851,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,610,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,389,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,711,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,235,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,864,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	95,601,000	
第377回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,039,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	96,615,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,478,000	

第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,502,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,539,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,776,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,823,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,548,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	298,911,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,051,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,033,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,171,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	281,127,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	98,148,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	86,462,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	195,694,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	194,836,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	91,928,000	
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	200,118,000	
社債券合計	29,426,000,000	29,076,622,700	
合計		625,426,459,970	

(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

	2022年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,540,504,557
株式	501,538,974,460

	2022年 9月 5日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	9,566,650
未収配当金	375,777,563
前払金	36,967,000
差入委託証拠金	129,155,000
流動資産合計	504,630,945,230
資産合計	504,630,945,230
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,579,300
未払解約金	88,067,110
未払利息	4,799
流動負債合計	134,651,209
負債合計	134,651,209
純資産の部	
元本等	
元本	264,418,414,974
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	240,077,879,047
元本等合計	504,496,294,021
純資産合計	504,496,294,021
負債純資産合計	504,630,945,230

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</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)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>
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>株価指数先物取引</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>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</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）

	2022年 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	264,418,414,974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) 1.9079円 (19,079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

	2022年 9月 5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株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月 5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

	2022年 9月 5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>「(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> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 9月 7日
期首元本額	252,855,267,319円
期中追加設定元本額	34,261,798,890円
期中一部解約元本額	22,698,651,235円
期末元本額	264,418,414,974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）	394,188,846円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,027,412,087円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,584,314円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,733,188,480円
世界経済インデックスファンド	4,143,730,041円
日本株式インデックス・オープン	3,267,601,065円

区分	2022年 9月 5日現在
DCマイセレクション25	6,238,424,785円
DCマイセレクション50	19,068,017,045円
DCマイセレクション75	19,186,046,898円
DC日本株式インデックス・オープン	6,197,983,289円
DCマイセレクションS25	3,215,256,877円
DCマイセレクションS50	9,459,089,130円
DCマイセレクションS75	7,278,120,948円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,487,637,301円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	162,217,671円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	685,264,037円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	510,833,533円
DC世界経済インデックスファンド	3,748,818,591円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,627,923,492円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	4,129,572円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	19,221,125円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	21,109,086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）	171,138,651円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	27,801,674円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	102,252,535円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	24,990,112円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	69,667,171円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	850,965,134円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	427,603,319円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,763,955,850円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	44,984,886円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	17,474,015円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	466,955,730円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	266,039,004円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	341,799,664円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	34,534,247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）	585,351,398円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,898,166,518円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,965,998,216円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドA	1,440,100,504円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	506,101,302円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	438,303,490円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,880,527,274円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	222,342,538円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,996,074円



区分	2022年 9月 5日現在
SMT インデックスバランス・オープン	58,332,838円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	31,582,895,984円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	546,528,890円
SMT 世界経済インデックス・オープン	50,470,672円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	191,866,507円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	34,185,467円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,218,418円
グローバル経済コア	220,557,241円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	29,115,018円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	234,372,434円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	24,537,141円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,309,165,117円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	227,326,387円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	19,071,819円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	16,068,458円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	6,065,054円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,404,667円
10資産分散投資ファンド	32,436円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,620,526,324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）	894,085,382円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	319,299,844円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	53,924,018円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	226,775,993円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	45,731,619,023円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,966,810円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	197,471,821円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,755,008,156
合計	1,755,008,156

(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

（2022年 9月 5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	3,047,767,000	-	3,010,800,000	36,967,000
合計		3,047,767,000	-	3,010,800,000	36,967,000

## (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	9,000	3,540.00	31,860,000	
日本水産	256,300	551.00	141,221,300	
マルハニチロ	36,600	2,499.00	91,463,400	
雪国まいたけ	20,200	995.00	20,099,000	
カネコ種苗	7,800	1,576.00	12,292,800	
サカタのタネ	29,900	5,010.00	149,799,000	
ホクト	21,100	1,909.00	40,279,900	
ホクリヨウ	3,700	615.00	2,275,500	
住石ホールディングス	48,300	262.00	12,654,600	
日鉄鉱業	5,300	5,860.00	31,058,000	
三井松島ホールディングス	11,500	3,560.00	40,940,000	
I N P E X	875,200	1,556.00	1,361,811,200	
石油資源開発	32,500	3,925.00	127,562,500	
K & O エナジーグループ	10,700	1,653.00	17,687,100	
ショーボンドホールディングス	32,200	5,990.00	192,878,000	
ミライト・ワン	88,900	1,549.00	137,706,100	
タマホーム	16,700	2,334.00	38,977,800	
サンヨーホームズ	3,200	707.00	2,262,400	
日本アクア	11,000	693.00	7,623,000	
ファーストコーポレーション	6,700	739.00	4,951,300	
ベステラ	5,700	1,116.00	6,361,200	
R o b o t H o m e	40,300	187.00	7,536,100	
キャンディル	4,100	587.00	2,406,700	
ダイセキ環境ソリューション	5,300	908.00	4,812,400	

第一カッター興業	6,100	1,277.00	7,789,700
安藤・間	125,700	870.00	109,359,000
東急建設	74,100	660.00	48,906,000
コムシスホールディングス	89,000	2,575.00	229,175,000
ピーアールホールディングス	34,700	341.00	11,832,700
高松コンストラクショングループ	17,600	1,910.00	33,616,000
東建コーポレーション	7,700	8,470.00	65,219,000
ソネック	2,800	1,042.00	2,917,600
ヤマウラ	12,000	955.00	11,460,000
オリエンタル白石	92,800	251.00	23,292,800
大成建設	177,400	4,215.00	747,741,000
大林組	592,000	965.00	571,280,000
清水建設	547,400	761.00	416,571,400
飛鳥建設	17,100	1,069.00	18,279,900
長谷工コーポレーション	170,900	1,618.00	276,516,200
松井建設	21,200	586.00	12,423,200
銭高組	2,300	3,220.00	7,406,000
鹿島建設	433,800	1,458.00	632,480,400
不動テトラ	13,500	1,540.00	20,790,000
大末建設	6,700	1,538.00	10,304,600
鉄建建設	12,900	1,782.00	22,987,800
西松建設	38,600	4,035.00	155,751,000
三井住友建設	143,700	452.00	64,952,400
大豊建設	9,300	4,060.00	37,758,000
佐田建設	13,700	435.00	5,959,500
ナカノフドー建設	15,200	299.00	4,544,800
奥村組	31,700	2,934.00	93,007,800
東鉄工業	25,100	2,319.00	58,206,900
イチケン	4,600	1,815.00	8,349,000
富士ピー・エス	8,200	465.00	3,813,000
浅沼組	14,300	2,820.00	40,326,000
戸田建設	244,400	673.00	164,481,200
熊谷組	31,500	2,656.00	83,664,000
北野建設	3,900	2,312.00	9,016,800
植木組	5,200	1,262.00	6,562,400
矢作建設工業	25,300	760.00	19,228,000
ピーエス三菱	21,000	646.00	13,566,000
日本ハウスホールディングス	32,800	414.00	13,579,200
大東建託	65,200	13,970.00	910,844,000
新日本建設	27,100	719.00	19,484,900
東亜道路工業	3,300	5,860.00	19,338,000
日本道路	5,500	6,100.00	33,550,000

東亜建設工業	14,200	2,407.00	34,179,400
日本国土開発	49,600	595.00	29,512,000
若築建設	9,800	2,354.00	23,069,200
東洋建設	71,500	870.00	62,205,000
五洋建設	234,700	727.00	170,626,900
世紀東急工業	29,100	756.00	21,999,600
福田組	6,200	4,745.00	29,419,000
住友林業	127,000	2,283.00	289,941,000
日本基礎技術	15,600	522.00	8,143,200
巴コーポレーション	23,200	429.00	9,952,800
大和ハウス工業	504,600	3,074.00	1,551,140,400
ライト工業	35,000	1,897.00	66,395,000
積水ハウス	605,000	2,467.00	1,492,535,000
日特建設	13,200	910.00	12,012,000
北陸電気工事	11,300	750.00	8,475,000
ユアテック	36,500	742.00	27,083,000
日本リーテック	12,100	824.00	9,970,400
四電工	6,200	1,849.00	11,463,800
中電工	25,700	2,123.00	54,561,100
関電工	103,700	836.00	86,693,200
きんでん	129,500	1,512.00	195,804,000
東京エネシス	18,800	1,015.00	19,082,000
トーエネック	6,400	3,490.00	22,336,000
住友電設	15,700	2,609.00	40,961,300
日本電設工業	27,200	1,770.00	48,144,000
エクシオグループ	88,500	2,119.00	187,531,500
新日本空調	13,800	1,836.00	25,336,800
九電工	40,300	2,825.00	113,847,500
三機工業	41,400	1,637.00	67,771,800
日揮ホールディングス	180,000	1,984.00	357,120,000
中外炉工業	5,900	1,600.00	9,440,000
ヤマト	15,300	767.00	11,735,100
太平電業	11,600	3,445.00	39,962,000
高砂熱学工業	48,800	1,661.00	81,056,800
三晃金属工業	2,500	2,643.00	6,607,500
朝日工業社	7,700	1,907.00	14,683,900
明星工業	32,000	736.00	23,552,000
大気社	26,600	3,200.00	85,120,000
ダイダン	12,000	2,237.00	26,844,000
日比谷総合設備	17,400	1,855.00	32,277,000
フィル・カンパニー	2,900	1,178.00	3,416,200
テスホールディングス	17,800	1,127.00	20,060,600

インフロニア・ホールディングス	222,000	1,022.00	226,884,000
東洋エンジニアリング	26,800	675.00	18,090,000
レイズネクスト	27,400	1,204.00	32,989,600
ニッポン	49,700	1,555.00	77,283,500
日清製粉グループ本社	192,100	1,554.00	298,523,400
日東富士製粉	3,000	4,590.00	13,770,000
昭和産業	16,100	2,533.00	40,781,300
鳥越製粉	14,800	653.00	9,664,400
中部飼料	21,100	1,077.00	22,724,700
フィード・ワン	24,300	708.00	17,204,400
東洋精糖	3,400	894.00	3,039,600
日本甜菜製糖	10,600	1,621.00	17,182,600
D M三井製糖ホールディングス	16,500	1,852.00	30,558,000
塩水港精糖	24,300	204.00	4,957,200
日新製糖	9,700	1,750.00	16,975,000
森永製菓	41,000	3,875.00	158,875,000
中村屋	4,100	3,080.00	12,628,000
江崎グリコ	47,500	3,565.00	169,337,500
名糖産業	7,400	1,643.00	12,158,200
井村屋グループ	9,900	2,226.00	22,037,400
不二家	11,400	2,345.00	26,733,000
山崎製パン	111,200	1,658.00	184,369,600
第一屋製パン	3,500	467.00	1,634,500
モロゾフ	6,000	3,570.00	21,420,000
亀田製菓	10,600	4,470.00	47,382,000
寿スピリッツ	17,700	7,850.00	138,945,000
カルビー	93,000	2,728.00	253,704,000
森永乳業	34,600	4,100.00	141,860,000
六甲バター	12,200	1,406.00	17,153,200
ヤクルト本社	129,500	8,050.00	1,042,475,000
明治ホールディングス	112,400	6,570.00	738,468,000
雪印メグミルク	44,700	1,677.00	74,961,900
プリマハム	25,500	2,116.00	53,958,000
日本ハム	71,500	3,950.00	282,425,000
林兼産業	6,200	469.00	2,907,800
丸大食品	18,400	1,532.00	28,188,800
S Foods	18,300	2,906.00	53,179,800
柿安本店	7,100	2,261.00	16,053,100
伊藤ハム米久ホールディングス	129,200	665.00	85,918,000
サッポロホールディングス	54,700	3,010.00	164,647,000
アサヒグループホールディングス	384,000	4,574.00	1,756,416,000
キリンホールディングス	749,900	2,220.00	1,664,778,000

宝ホールディングス	113,400	1,041.00	118,049,400
オエノンホールディングス	49,700	280.00	13,916,000
養命酒製造	5,500	1,806.00	9,933,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	130,200	1,381.00	179,806,200
サントリー食品インターナショナル	117,000	4,960.00	580,320,000
ダイドグループホールディングス	10,500	4,665.00	48,982,500
伊藤園	61,900	5,950.00	368,305,000
キーコーヒー	18,600	2,087.00	38,818,200
ユニカフェ	6,100	924.00	5,636,400
ジャパンフーズ	2,900	1,111.00	3,221,900
日清オイリオグループ	23,400	3,250.00	76,050,000
不二製油グループ本社	44,200	2,339.00	103,383,800
かどや製油	1,800	3,560.00	6,408,000
J - オイルミルズ	19,000	1,574.00	29,906,000
キッコーマン	122,400	8,590.00	1,051,416,000
味の素	406,700	3,812.00	1,550,340,400
ブルドックソース	7,300	1,827.00	13,337,100
キューピー	89,300	2,256.00	201,460,800
ハウス食品グループ本社	63,600	2,933.00	186,538,800
カゴメ	77,400	3,045.00	235,683,000
焼津水産化学工業	8,200	871.00	7,142,200
アリアケジャパン	18,600	4,505.00	83,793,000
ピエトロ	2,700	1,760.00	4,752,000
エバラ食品工業	4,500	3,085.00	13,882,500
やまみ	1,800	1,431.00	2,575,800
ニチレイ	76,100	2,461.00	187,282,100
東洋水産	91,000	5,910.00	537,810,000
イトアンドホールディングス	7,700	2,083.00	16,039,100
大冷	2,300	1,906.00	4,383,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,500	490.00	5,145,000
日清食品ホールディングス	65,800	9,900.00	651,420,000
永谷園ホールディングス	9,100	2,000.00	18,200,000
一正蒲鉾	7,900	777.00	6,138,300
フジッコ	19,000	1,901.00	36,119,000
ロック・フィールド	20,300	1,444.00	29,313,200
日本たばこ産業	1,094,000	2,365.00	2,587,310,000
ケンコーマヨネーズ	10,400	1,475.00	15,340,000
わらべや日洋ホールディングス	12,200	2,204.00	26,888,800
なとり	11,400	2,011.00	22,925,400
イフジ産業	3,600	918.00	3,304,800
ファーマフーズ	25,700	1,456.00	37,419,200
ユーグレナ	107,000	935.00	100,045,000

紀文食品	15,800	980.00	15,484,000
ピクルスホールディングス	9,700	1,133.00	10,990,100
ミヨシ油脂	6,500	993.00	6,454,500
理研ビタミン	14,400	1,724.00	24,825,600
片倉工業	15,800	2,026.00	32,010,800
グンゼ	11,700	3,845.00	44,986,500
東洋紡	79,200	1,053.00	83,397,600
ユニチカ	57,000	241.00	13,737,000
富士紡ホールディングス	8,300	3,495.00	29,008,500
倉敷紡績	14,100	2,096.00	29,553,600
シキボウ	10,400	891.00	9,266,400
日本毛織	49,700	1,017.00	50,544,900
トーア紡コーポレーション	7,300	355.00	2,591,500
帝国繊維	19,400	1,601.00	31,059,400
帝人	175,300	1,460.00	255,938,000
東レ	1,236,300	780.40	964,808,520
住江織物	3,400	1,726.00	5,868,400
日本フェルト	12,600	414.00	5,216,400
イチカワ	2,800	1,389.00	3,889,200
日東製網	2,100	1,339.00	2,811,900
アツギ	14,800	405.00	5,994,000
ダイニック	6,400	618.00	3,955,200
セーレン	37,000	2,064.00	76,368,000
ソトー	7,600	754.00	5,730,400
東海染工	2,500	1,124.00	2,810,000
小松マテーレ	30,200	859.00	25,941,800
ワコールホールディングス	40,800	2,206.00	90,004,800
ホギメディカル	24,800	3,405.00	84,444,000
T S Iホールディングス	61,000	381.00	23,241,000
マツオカコーポレーション	6,000	937.00	5,622,000
ワールド	26,200	1,357.00	35,553,400
三陽商会	8,800	894.00	7,867,200
ナイガイ	7,600	265.00	2,014,000
オンワードホールディングス	110,500	271.00	29,945,500
ルックホールディングス	5,500	2,009.00	11,049,500
ゴールドウイン	33,000	7,780.00	256,740,000
デサント	34,100	3,250.00	110,825,000
キング	9,900	435.00	4,306,500
ヤマトインターナショナル	15,600	267.00	4,165,200
特種東海製紙	10,300	3,160.00	32,548,000
王子ホールディングス	768,300	558.00	428,711,400
日本製紙	80,700	890.00	71,823,000

三菱製紙	25,400	297.00	7,543,800
北越コーポレーション	118,700	745.00	88,431,500
中越パルプ工業	7,600	952.00	7,235,200
巴川製紙所	5,900	814.00	4,802,600
大王製紙	85,300	1,248.00	106,454,400
阿波製紙	4,500	311.00	1,399,500
レンゴー	154,000	817.00	125,818,000
トモク	9,800	1,518.00	14,876,400
ザ・パック	12,600	2,231.00	28,110,600
北の達人コーポレーション	71,200	235.00	16,732,000
クラレ	268,800	1,058.00	284,390,400
旭化成	1,231,700	1,020.50	1,256,949,850
共和レザー	10,800	552.00	5,961,600
昭和電工	163,400	2,101.00	343,303,400
住友化学	1,358,200	544.00	738,860,800
住友精化	7,900	3,160.00	24,964,000
日産化学	89,600	6,930.00	620,928,000
ラサ工業	7,000	2,388.00	16,716,000
クレハ	14,400	9,410.00	135,504,000
多木化学	6,600	5,050.00	33,330,000
テイカ	11,400	1,273.00	14,512,200
石原産業	35,700	1,044.00	37,270,800
片倉コープアグリ	4,500	1,250.00	5,625,000
日本曹達	21,800	4,480.00	97,664,000
東ソー	246,200	1,830.00	450,546,000
トクヤマ	59,100	1,837.00	108,566,700
セントラル硝子	29,800	3,335.00	99,383,000
東亜合成	86,900	1,084.00	94,199,600
大阪ソーダ	15,200	3,770.00	57,304,000
関東電化工業	36,300	964.00	34,993,200
デンカ	67,100	3,335.00	223,778,500
信越化学工業	315,600	16,255.00	5,130,078,000
日本カーバイド工業	7,100	1,240.00	8,804,000
堺化学工業	12,900	1,926.00	24,845,400
第一稀元素化学工業	16,900	1,347.00	22,764,300
エア・ウォーター	159,500	1,736.00	276,892,000
日本酸素ホールディングス	164,000	2,475.00	405,900,000
日本化学工業	5,600	2,066.00	11,569,600
東邦アセチレン	4,000	1,184.00	4,736,000
日本パーカラライジング	83,700	960.00	80,352,000
高圧ガス工業	28,100	661.00	18,574,100
チタン工業	2,300	1,627.00	3,742,100



四国化成工業	23,000	1,220.00	28,060,000
戸田工業	4,200	2,678.00	11,247,600
ステラ ケミファ	10,000	2,733.00	27,330,000
保土谷化学工業	5,300	3,215.00	17,039,500
日本触媒	28,300	5,620.00	159,046,000
大日精化工業	14,100	1,756.00	24,759,600
カネカ	42,900	3,680.00	157,872,000
三菱瓦斯化学	156,400	2,051.00	320,776,400
三井化学	155,000	3,065.00	475,075,000
J S R	185,500	3,125.00	579,687,500
東京応化工業	29,600	6,650.00	196,840,000
大阪有機化学工業	12,700	2,449.00	31,102,300
三菱ケミカルグループ	1,235,900	727.40	898,993,660
K Hネオケム	28,100	2,489.00	69,940,900
ダイセル	267,700	873.00	233,702,100
住友ベークライト	28,200	4,340.00	122,388,000
積水化学工業	380,300	1,876.00	713,442,800
日本ゼオン	149,300	1,372.00	204,839,600
アイカ工業	46,900	3,070.00	143,983,000
U B E	93,800	2,045.00	191,821,000
積水樹脂	27,300	1,707.00	46,601,100
タキロンシーアイ	43,100	531.00	22,886,100
旭有機材	11,200	2,310.00	25,872,000
ニチバン	10,500	1,604.00	16,842,000
リケンテクノス	40,500	516.00	20,898,000
大倉工業	7,800	1,764.00	13,759,200
積水化成成品工業	23,700	404.00	9,574,800
群栄化学工業	4,000	2,440.00	9,760,000
タイガースポリマー	9,500	430.00	4,085,000
ミライアル	6,400	1,904.00	12,185,600
ダイキアクシス	6,900	669.00	4,616,100
ダイキョーニシカワ	42,000	577.00	24,234,000
竹本容器	6,300	757.00	4,769,100
森六ホールディングス	9,600	1,744.00	16,742,400
恵和	5,500	4,250.00	23,375,000
日本化薬	139,900	1,195.00	167,180,500
カーリットホールディングス	16,700	655.00	10,938,500
日本精化	12,800	1,910.00	24,448,000
扶桑化学工業	15,700	3,425.00	53,772,500
トリケミカル研究所	20,500	2,331.00	47,785,500
A D E K A	78,600	2,335.00	183,531,000
日油	57,500	5,280.00	303,600,000

新日本理化	28,200	242.00	6,824,400
ハリマ化成グループ	13,200	909.00	11,998,800
花王	419,700	5,942.00	2,493,857,400
第一工業製薬	6,700	2,173.00	14,559,100
石原ケミカル	9,300	1,270.00	11,811,000
日華化学	7,500	867.00	6,502,500
ニイタカ	3,800	2,322.00	8,823,600
三洋化成工業	11,900	4,590.00	54,621,000
有機合成薬品工業	13,900	337.00	4,684,300
大日本塗料	22,500	725.00	16,312,500
日本ペイントホールディングス	748,100	1,060.00	792,986,000
関西ペイント	172,100	2,111.00	363,303,100
神東塗料	15,700	144.00	2,260,800
中国塗料	43,000	866.00	37,238,000
日本特殊塗料	11,900	946.00	11,257,400
藤倉化成	24,800	461.00	11,432,800
太陽ホールディングス	29,300	2,668.00	78,172,400
D I C	66,100	2,473.00	163,465,300
サカタインクス	37,600	954.00	35,870,400
東洋インキS Cホールディングス	33,100	1,889.00	62,525,900
T & K T O K A	16,100	1,018.00	16,389,800
富士フィルムホールディングス	357,300	6,985.00	2,495,740,500
資生堂	353,400	5,079.00	1,794,918,600
ライオン	203,100	1,605.00	325,975,500
高砂香料工業	11,400	2,760.00	31,464,000
マンダム	39,600	1,505.00	59,598,000
ミルボン	25,100	6,020.00	151,102,000
ファンケル	82,300	2,801.00	230,522,300
コーセー	34,400	13,030.00	448,232,000
コタ	14,200	1,550.00	22,010,000
シーボン	2,600	1,678.00	4,362,800
ポーラ・オルビスホールディングス	86,800	1,512.00	131,241,600
ノエビアホールディングス	15,100	5,660.00	85,466,000
アジュバンホールディングス	4,600	961.00	4,420,600
新日本製薬	9,700	1,585.00	15,374,500
エステー	13,100	1,525.00	19,977,500
アグロ カネショウ	6,800	1,280.00	8,704,000
コニシ	30,800	1,583.00	48,756,400
長谷川香料	35,000	2,963.00	103,705,000
星光P M C	9,600	581.00	5,577,600
小林製薬	51,800	8,080.00	418,544,000
荒川化学工業	14,300	1,018.00	14,557,400

メック	13,900	2,404.00	33,415,600
日本高純度化学	4,800	2,327.00	11,169,600
タカラバイオ	53,200	1,845.00	98,154,000
J C U	20,900	3,080.00	64,372,000
新田ゼラチン	11,600	819.00	9,500,400
O A T アグリオ	7,700	1,870.00	14,399,000
デクセリアルズ	52,900	3,785.00	200,226,500
アース製薬	15,300	5,330.00	81,549,000
北興化学工業	17,000	993.00	16,881,000
大成ラミック	5,300	2,851.00	15,110,300
クミアイ化学工業	67,200	1,080.00	72,576,000
日本農薬	36,200	843.00	30,516,600
アキレス	13,000	1,327.00	17,251,000
有沢製作所	27,600	1,302.00	35,935,200
日東電工	122,900	8,590.00	1,055,711,000
レック	24,100	744.00	17,930,400
三光合成	23,200	459.00	10,648,800
きもと	31,100	252.00	7,837,200
藤森工業	15,800	3,375.00	53,325,000
前澤化成工業	11,900	1,303.00	15,505,700
未来工業	7,300	1,501.00	10,957,300
ウェーブロックホールディングス	7,700	628.00	4,835,600
J S P	11,900	1,424.00	16,945,600
エフピコ	37,400	3,275.00	122,485,000
天馬	16,000	2,152.00	34,432,000
信越ポリマー	36,500	1,316.00	48,034,000
東リ	46,400	203.00	9,419,200
ニフコ	67,900	3,085.00	209,471,500
バルカー	16,500	2,644.00	43,626,000
ユニ・チャーム	352,700	4,665.00	1,645,345,500
ショーエイコーポレーション	5,400	583.00	3,148,200
協和キリン	204,500	3,095.00	632,927,500
武田薬品工業	1,597,800	3,820.00	6,103,596,000
アステラス製薬	1,738,000	1,971.50	3,426,467,000
住友ファーマ	125,600	1,023.00	128,488,800
塩野義製薬	236,000	6,768.00	1,597,248,000
わかもと製薬	19,800	234.00	4,633,200
日本新薬	44,300	7,500.00	332,250,000
中外製薬	529,900	3,560.00	1,886,444,000
科研製薬	29,000	3,810.00	110,490,000
エーザイ	224,600	5,660.00	1,271,236,000
ロート製薬	96,900	4,150.00	402,135,000

小野薬品工業	391,900	3,343.00	1,310,121,700
久光製薬	43,000	3,435.00	147,705,000
持田製薬	22,800	3,375.00	76,950,000
参天製薬	354,100	988.00	349,850,800
扶桑薬品工業	6,600	2,041.00	13,470,600
日本ケミファ	2,200	1,902.00	4,184,400
ツムラ	58,100	3,195.00	185,629,500
日医工	57,200	355.00	20,306,000
キッセイ薬品工業	29,400	2,446.00	71,912,400
生化学工業	35,900	872.00	31,304,800
栄研化学	30,200	1,848.00	55,809,600
鳥居薬品	9,100	2,906.00	26,444,600
JCRファーマ	57,300	2,069.00	118,553,700
東和薬品	29,300	2,155.00	63,141,500
富士製薬工業	10,900	1,015.00	11,063,500
ゼリア新薬工業	30,200	2,055.00	62,061,000
第一三共	1,474,600	4,137.00	6,100,420,200
キョーリン製薬ホールディングス	36,700	1,754.00	64,371,800
大幸薬品	30,600	616.00	18,849,600
ダイト	12,700	2,585.00	32,829,500
大塚ホールディングス	387,300	4,474.00	1,732,780,200
大正製薬ホールディングス	37,600	5,190.00	195,144,000
ペプチドリーム	82,100	1,552.00	127,419,200
あすか製薬ホールディングス	19,300	1,151.00	22,214,300
サワイグループホールディングス	39,000	4,010.00	156,390,000
日本コークス工業	171,700	98.00	16,826,600
ニチレキ	22,000	1,349.00	29,678,000
ユシロ化学工業	9,700	869.00	8,429,300
ビーピー・カストロール	7,300	1,096.00	8,000,800
富士石油	44,400	357.00	15,850,800
MORESCO	6,700	1,140.00	7,638,000
出光興産	206,800	3,535.00	731,038,000
ENEOSホールディングス	3,058,200	515.10	1,575,278,820
コスモエネルギーホールディングス	80,300	4,015.00	322,404,500
横浜ゴム	96,300	2,272.00	218,793,600
TOYO TIRE	97,300	1,663.00	161,809,900
ブリヂストン	540,500	5,205.00	2,813,302,500
住友ゴム工業	166,000	1,186.00	196,876,000
藤倉コンポジット	16,300	965.00	15,729,500
オカモト	9,400	3,865.00	36,331,000
フコク	8,900	997.00	8,873,300
ニッタ	19,100	2,888.00	55,160,800

住友理工	39,400	578.00	22,773,200
三ツ星ベルト	24,700	3,200.00	79,040,000
バンドー化学	32,800	1,018.00	33,390,400
日東紡績	25,300	2,516.00	63,654,800
A G C	172,300	4,715.00	812,394,500
日本板硝子	91,900	548.00	50,361,200
石塚硝子	3,300	1,610.00	5,313,000
日本山村硝子	7,200	631.00	4,543,200
日本電気硝子	69,100	2,628.00	181,594,800
オハラ	8,100	1,310.00	10,611,000
住友大阪セメント	30,400	3,420.00	103,968,000
太平洋セメント	115,600	2,071.00	239,407,600
日本ヒューム	16,900	671.00	11,339,900
日本コンクリート工業	37,000	269.00	9,953,000
三谷セキサン	8,300	3,640.00	30,212,000
アジアパイルホールディングス	29,100	498.00	14,491,800
東海カーボン	142,100	999.00	141,957,900
日本カーボン	9,700	4,000.00	38,800,000
東洋炭素	10,600	3,215.00	34,079,000
ノリタケカンパニーリミテド	10,300	4,090.00	42,127,000
T O T O	122,900	4,720.00	580,088,000
日本碍子	200,300	1,939.00	388,381,700
日本特殊陶業	141,800	2,813.00	398,883,400
M A R U W A	7,000	16,680.00	116,760,000
品川リフラクトリーズ	4,800	3,825.00	18,360,000
黒崎播磨	3,500	4,760.00	16,660,000
ヨータイ	13,000	1,400.00	18,200,000
東京窯業	20,600	273.00	5,623,800
ニッカトー	8,700	458.00	3,984,600
フジインコーポレーテッド	16,300	6,670.00	108,721,000
クニミネ工業	6,500	842.00	5,473,000
エーアンドエーマテリアル	3,600	863.00	3,106,800
ニチアス	42,900	2,367.00	101,544,300
ニチハ	26,000	2,725.00	70,850,000
日本製鉄	839,700	2,216.00	1,860,775,200
神戸製鋼所	350,300	632.00	221,389,600
中山製鋼所	28,000	580.00	16,240,000
合同製鐵	9,800	1,830.00	17,934,000
J F E ホールディングス	465,400	1,484.00	690,653,600
東京製鐵	58,800	1,323.00	77,792,400
共英製鋼	19,900	1,480.00	29,452,000
大和工業	32,800	4,705.00	154,324,000

東京鐵鋼	8,300	1,334.00	11,072,200
大阪製鐵	10,700	1,242.00	13,289,400
淀川製鋼所	22,000	2,463.00	54,186,000
丸一鋼管	58,300	2,926.00	170,585,800
モリ工業	4,900	2,711.00	13,283,900
大同特殊鋼	27,400	3,815.00	104,531,000
日本高周波鋼業	7,600	331.00	2,515,600
日本冶金工業	13,700	2,824.00	38,688,800
山陽特殊製鋼	17,200	2,014.00	34,640,800
愛知製鋼	11,300	2,032.00	22,961,600
日立金属	216,600	2,079.00	450,311,400
日本金属	5,100	1,020.00	5,202,000
大平洋金属	12,400	2,302.00	28,544,800
新日本電工	111,500	358.00	39,917,000
栗本鐵工所	8,300	1,630.00	13,529,000
虹技	2,600	941.00	2,446,600
三菱製鋼	13,000	1,018.00	13,234,000
日亜鋼業	23,100	247.00	5,705,700
日本精線	3,200	4,520.00	14,464,000
エンビプロ・ホールディングス	13,400	867.00	11,617,800
シンニッタン	24,600	219.00	5,387,400
新家工業	4,200	1,715.00	7,203,000
大紀アルミニウム工業所	24,900	1,316.00	32,768,400
日本軽金属ホールディングス	50,900	1,594.00	81,134,600
三井金属鉱業	54,300	3,145.00	170,773,500
東邦亜鉛	10,300	2,433.00	25,059,900
三菱マテリアル	116,200	2,011.00	233,678,200
住友金属鉱山	220,300	4,236.00	933,190,800
D O W A ホールディングス	47,000	5,100.00	239,700,000
古河機械金属	30,700	1,249.00	38,344,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,300	2,987.00	69,597,100
東邦チタニウム	36,000	2,115.00	76,140,000
U A C J	27,500	2,293.00	63,057,500
C K サンエツ	3,800	4,070.00	15,466,000
古河電気工業	58,000	2,414.00	140,012,000
住友電気工業	701,600	1,587.00	1,113,439,200
フジクラ	224,200	969.00	217,249,800
昭和電線ホールディングス	17,600	1,735.00	30,536,000
東京特殊電線	2,600	2,228.00	5,792,800
タツタ電線	35,600	463.00	16,482,800
カナレ電気	3,100	1,500.00	4,650,000
平河ヒューテック	11,200	1,110.00	12,432,000

リョービ	18,600	1,270.00	23,622,000
アーレスティ	21,600	396.00	8,553,600
アサヒホールディングス	80,500	2,053.00	165,266,500
稲葉製作所	10,200	1,337.00	13,637,400
宮地エンジニアリンググループ	5,700	3,145.00	17,926,500
トーカロ	51,900	1,256.00	65,186,400
アルファC o	7,100	943.00	6,695,300
SUMCO	331,500	1,894.00	627,861,000
川田テクノロジーズ	3,700	3,635.00	13,449,500
RS Technologies	5,700	6,580.00	37,506,000
ジェイテックコーポレーション	2,600	1,706.00	4,435,600
信和	12,500	811.00	10,137,500
東洋製罐グループホールディングス	102,400	1,664.00	170,393,600
ホッカンホールディングス	9,400	1,324.00	12,445,600
コロナ	9,700	828.00	8,031,600
横河ブリッジホールディングス	28,800	1,917.00	55,209,600
駒井ハルテック	3,100	1,668.00	5,170,800
高田機工	1,700	2,425.00	4,122,500
三和ホールディングス	189,500	1,368.00	259,236,000
文化シャッター	59,200	1,060.00	62,752,000
三協立山	23,900	612.00	14,626,800
アルインコ	13,300	903.00	12,009,900
東洋シャッター	4,400	546.00	2,402,400
LIXIL	316,400	2,377.00	752,082,800
日本フィルコン	12,600	483.00	6,085,800
ノーリツ	25,600	1,540.00	39,424,000
長府製作所	18,200	1,992.00	36,254,400
リンナイ	34,700	10,590.00	367,473,000
ダイニチ工業	9,600	639.00	6,134,400
日東精工	25,200	512.00	12,902,400
三洋工業	2,400	1,688.00	4,051,200
岡部	28,000	650.00	18,200,000
ジーテクト	22,200	1,355.00	30,081,000
東ブレ	30,700	1,227.00	37,668,900
高周波熱錬	31,000	677.00	20,987,000
東京製綱	12,300	976.00	12,004,800
サンコール	17,200	713.00	12,263,600
モリテック スチール	15,700	284.00	4,458,800
パイオラックス	26,400	1,940.00	51,216,000
エイチワン	17,900	592.00	10,596,800
日本発條	169,400	931.00	157,711,400
中央発條	9,700	700.00	6,790,000

アドバネクス	2,600	1,238.00	3,218,800
立川ブラインド工業	7,900	1,039.00	8,208,100
三益半導体工業	15,700	2,051.00	32,200,700
日本ドライケミカル	4,600	1,602.00	7,369,200
日本製鋼所	51,700	3,060.00	158,202,000
三浦工業	79,200	2,884.00	228,412,800
タクマ	57,800	1,346.00	77,798,800
ツガミ	41,200	1,212.00	49,934,400
オークマ	19,200	5,170.00	99,264,000
芝浦機械	22,800	2,957.00	67,419,600
アマダ	317,600	1,075.00	341,420,000
アイダエンジニアリング	44,100	841.00	37,088,100
滝澤鉄工所	5,900	1,145.00	6,755,500
F U J I	80,300	2,004.00	160,921,200
牧野フライス製作所	20,500	4,320.00	88,560,000
オーエスジー	81,500	1,857.00	151,345,500
ダイジェット工業	2,400	891.00	2,138,400
旭ダイヤモンド工業	49,600	732.00	36,307,200
D M G 森精機	103,500	1,748.00	180,918,000
ソディック	47,600	791.00	37,651,600
ディスコ	29,600	33,000.00	976,800,000
日東工器	9,700	1,621.00	15,723,700
日進工具	15,900	1,108.00	17,617,200
パンチ工業	17,500	439.00	7,682,500
富士ダイス	10,300	623.00	6,416,900
豊和工業	10,600	828.00	8,776,800
ニデックオーケーケー	7,600	1,151.00	8,747,600
東洋機械金属	13,300	575.00	7,647,500
津田駒工業	3,400	503.00	1,710,200
エンシュウ	4,700	779.00	3,661,300
島精機製作所	29,500	2,230.00	65,785,000
オプトラン	25,300	2,228.00	56,368,400
N C ホールディングス	5,700	1,903.00	10,847,100
イワキポンプ	12,900	1,253.00	16,163,700
フリーー	18,000	1,020.00	18,360,000
ヤマシンフィルタ	31,900	326.00	10,399,400
日阪製作所	20,800	826.00	17,180,800
やまびこ	27,900	1,142.00	31,861,800
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,570.00	22,848,000
平田機工	8,900	4,470.00	39,783,000
ペガサスミシン製造	20,500	885.00	18,142,500
マルマエ	8,300	1,974.00	16,384,200



タツモ	9,400	1,300.00	12,220,000
ナブテスコ	107,100	3,290.00	352,359,000
三井海洋開発	21,400	1,462.00	31,286,800
レオン自動機	21,600	1,209.00	26,114,400
S M C	59,500	66,320.00	3,946,040,000
ホソカワミクロン	13,100	2,610.00	34,191,000
ユニオンツール	7,500	3,485.00	26,137,500
オイレス工業	26,100	1,480.00	38,628,000
日精エー・エス・ピー機械	7,800	4,035.00	31,473,000
サトーホールディングス	26,500	1,892.00	50,138,000
技研製作所	17,800	3,185.00	56,693,000
日本エアーテック	8,700	1,053.00	9,161,100
カワタ	6,100	907.00	5,532,700
日精樹脂工業	12,900	944.00	12,177,600
オカダアイヨン	6,400	1,441.00	9,222,400
ワイエイシイホールディングス	8,100	1,388.00	11,242,800
小松製作所	921,400	2,881.50	2,655,014,100
住友重機械工業	108,700	2,904.00	315,664,800
日立建機	81,600	2,876.00	234,681,600
日工	25,700	630.00	16,191,000
巴工業	7,400	2,480.00	18,352,000
井関農機	16,200	1,230.00	19,926,000
T O W A	17,400	1,823.00	31,720,200
丸山製作所	3,300	1,567.00	5,171,100
北川鉄工所	8,100	1,332.00	10,789,200
ローツェ	10,000	8,330.00	83,300,000
タカキタ	6,400	564.00	3,609,600
クボタ	909,200	2,145.00	1,950,234,000
荏原実業	8,600	2,156.00	18,541,600
三菱化工機	6,100	2,236.00	13,639,600
月島機械	32,000	895.00	28,640,000
帝国電機製作所	13,000	1,973.00	25,649,000
新東工業	38,300	703.00	26,924,900
澁谷工業	16,100	2,388.00	38,446,800
アイチ コーポレーション	29,200	814.00	23,768,800
小森コーポレーション	47,000	752.00	35,344,000
鶴見製作所	14,400	2,153.00	31,003,200
住友精密工業	3,100	2,491.00	7,722,100
日本ギア工業	7,600	350.00	2,660,000
酒井重工業	3,400	3,025.00	10,285,000
荏原製作所	69,800	5,260.00	367,148,000
石井鐵工所	2,500	2,842.00	7,105,000

西島製作所	16,700	1,387.00	23,162,900
北越工業	17,300	964.00	16,677,200
ダイキン工業	222,000	24,395.00	5,415,690,000
オルガノ	5,900	8,820.00	52,038,000
トーヨーカネツ	7,200	2,546.00	18,331,200
栗田工業	102,700	5,430.00	557,661,000
椿本チエイン	26,700	3,140.00	83,838,000
大同工業	8,600	737.00	6,338,200
木村化工機	15,900	771.00	12,258,900
アネスト岩田	31,700	923.00	29,259,100
ダイフク	95,900	7,730.00	741,307,000
サムコ	5,600	3,120.00	17,472,000
加藤製作所	10,000	759.00	7,590,000
油研工業	3,300	1,805.00	5,956,500
タダノ	98,300	929.00	91,320,700
フジテック	62,500	2,768.00	173,000,000
C K D	51,500	1,818.00	93,627,000
キトー	16,000	2,707.00	43,312,000
平和	56,800	2,074.00	117,803,200
理想科学工業	17,100	2,410.00	41,211,000
S A N K Y O	41,900	4,090.00	171,371,000
日本金銭機械	20,800	658.00	13,686,400
マースグループホールディングス	13,000	1,586.00	20,618,000
フクシマガリレイ	12,600	3,505.00	44,163,000
オーイズミ	7,400	397.00	2,937,800
ダイコク電機	9,400	1,280.00	12,032,000
竹内製作所	31,000	2,610.00	80,910,000
アマノ	53,300	2,538.00	135,275,400
J U K I	26,600	693.00	18,433,800
ジャノメ	17,400	692.00	12,040,800
マックス	24,100	1,986.00	47,862,600
グローリー	48,300	2,188.00	105,680,400
新晃工業	19,000	1,556.00	29,564,000
大和冷機工業	26,200	1,091.00	28,584,200
セガサミーホールディングス	182,800	2,021.00	369,438,800
日本ピストンリング	7,500	1,263.00	9,472,500
リケン	7,400	2,395.00	17,723,000
T P R	22,300	1,268.00	28,276,400
ツバキ・ナカシマ	42,100	1,136.00	47,825,600
ホシザキ	109,700	4,020.00	440,994,000
大豊工業	16,700	701.00	11,706,700
日本精工	348,100	753.00	262,119,300

NTN	369,700	261.00	96,491,700
ジェイテクト	173,500	993.00	172,285,500
不二越	12,600	3,720.00	46,872,000
日本トムソン	46,600	551.00	25,676,600
THK	98,400	2,745.00	270,108,000
ユーシン精機	15,900	713.00	11,336,700
前澤給装工業	13,200	898.00	11,853,600
イーグル工業	22,100	1,143.00	25,260,300
前澤工業	12,400	633.00	7,849,200
日本ピラー工業	17,400	2,546.00	44,300,400
キッツ	62,900	789.00	49,628,100
マキタ	229,800	3,212.00	738,117,600
三井E & Sホールディングス	76,900	428.00	32,913,200
日立造船	161,400	878.00	141,709,200
三菱重工業	298,100	5,214.00	1,554,293,400
IHI	127,000	3,715.00	471,805,000
スター精密	33,000	1,791.00	59,103,000
日清紡ホールディングス	138,800	1,079.00	149,765,200
イビデン	97,900	4,255.00	416,564,500
コニカミノルタ	413,700	475.00	196,507,500
ブラザー工業	231,900	2,554.00	592,272,600
ミネベアミツミ	323,700	2,341.00	757,781,700
日立製作所	977,700	6,916.00	6,761,773,200
東芝	355,400	5,023.00	1,785,174,200
三菱電機	1,897,300	1,386.00	2,629,657,800
富士電機	113,100	5,810.00	657,111,000
東洋電機製造	6,800	889.00	6,045,200
安川電機	202,000	4,515.00	912,030,000
シンフォニアテクノロジー	20,700	1,450.00	30,015,000
明電舎	28,700	1,981.00	56,854,700
オリジン	4,700	1,429.00	6,716,300
山洋電気	7,500	5,190.00	38,925,000
デンヨー	14,400	1,532.00	22,060,800
PHCホールディングス	31,800	1,557.00	49,512,600
東芝テック	21,800	4,115.00	89,707,000
芝浦メカトロニクス	3,700	11,060.00	40,922,000
マブチモーター	42,500	3,915.00	166,387,500
日本電産	451,700	9,123.00	4,120,859,100
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,400	488.00	4,099,200
トレックス・セミコンダクター	9,000	2,860.00	25,740,000
東光高岳	11,600	1,874.00	21,738,400
ダブル・スコープ	55,700	2,500.00	139,250,000

ダイヘン	18,800	4,035.00	75,858,000
ヤーマン	33,500	1,478.00	49,513,000
JVCケンウッド	168,500	199.00	33,531,500
ミマキエンジニアリング	19,100	661.00	12,625,100
I-PEX	9,900	1,343.00	13,295,700
日新電機	47,600	1,465.00	69,734,000
大崎電気工業	34,200	520.00	17,784,000
オムロン	169,200	7,205.00	1,219,086,000
日東工業	25,500	2,543.00	64,846,500
IDEC	25,200	2,830.00	71,316,000
正興電機製作所	7,700	1,080.00	8,316,000
不二電機工業	4,300	1,143.00	4,914,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	61,300	2,458.00	150,675,400
サクサホールディングス	4,700	1,283.00	6,030,100
メルコホールディングス	5,800	3,235.00	18,763,000
テクノメディカ	4,900	1,621.00	7,942,900
日本電気	241,100	4,940.00	1,191,034,000
富士通	182,900	16,260.00	2,973,954,000
沖電気工業	77,100	743.00	57,285,300
岩崎通信機	8,300	780.00	6,474,000
電気興業	9,800	2,412.00	23,637,600
サンケン電気	17,400	4,695.00	81,693,000
ナカヨ	3,300	1,073.00	3,540,900
アイホン	9,200	2,032.00	18,694,400
ルネサスエレクトロニクス	1,110,300	1,283.00	1,424,514,900
セイコーエプソン	227,000	2,145.00	486,915,000
ワコム	156,500	799.00	125,043,500
アルバック	40,500	5,380.00	217,890,000
アクセル	8,400	965.00	8,106,000
EIZO	13,900	3,810.00	52,959,000
日本信号	43,100	940.00	40,514,000
京三製作所	39,700	421.00	16,713,700
能美防災	23,400	1,606.00	37,580,400
ホーチキ	13,200	1,327.00	17,516,400
星和電機	8,900	446.00	3,969,400
エレコム	46,900	1,617.00	75,837,300
パナソニック ホールディングス	2,168,100	1,100.00	2,384,910,000
シャープ	193,100	992.00	191,555,200
アンリツ	128,600	1,611.00	207,174,600
富士通ゼネラル	55,200	2,924.00	161,404,800
ソニーグループ	1,273,500	10,865.00	13,836,577,500
TDK	294,600	4,860.00	1,431,756,000

帝国通信工業	9,400	1,411.00	13,263,400
タムラ製作所	73,100	721.00	52,705,100
アルプスアルパイン	166,600	1,229.00	204,751,400
池上通信機	6,000	603.00	3,618,000
日本電波工業	20,800	1,551.00	32,260,800
鈴木	10,700	905.00	9,683,500
メイコー	22,200	3,145.00	69,819,000
日本トリム	4,100	2,384.00	9,774,400
ローランド ディー・ジー・	9,800	3,225.00	31,605,000
フォスター電機	18,900	791.00	14,949,900
S M K	4,500	2,415.00	10,867,500
ヨコオ	13,800	2,076.00	28,648,800
ホシデン	45,300	1,535.00	69,535,500
ヒロセ電機	28,200	19,580.00	552,156,000
日本航空電子工業	40,800	2,309.00	94,207,200
T O A	21,800	792.00	17,265,600
マクセル	37,400	1,461.00	54,641,400
古野電気	24,700	1,120.00	27,664,000
ユニデンホールディングス	1,900	4,100.00	7,790,000
スミダコーポレーション	16,200	951.00	15,406,200
アイコム	6,600	2,563.00	16,915,800
リオン	7,300	2,057.00	15,016,100
本多通信工業	16,600	704.00	11,686,400
横河電機	186,500	2,380.00	443,870,000
新電元工業	7,200	3,585.00	25,812,000
アズビル	117,900	3,930.00	463,347,000
東亜ディーケーケー	10,800	847.00	9,147,600
日本光電工業	78,200	3,130.00	244,766,000
チノー	6,400	1,625.00	10,400,000
共和電業	17,700	332.00	5,876,400
日本電子材料	9,500	1,520.00	14,440,000
堀場製作所	37,600	6,260.00	235,376,000
アドバンテスト	151,100	7,620.00	1,151,382,000
小野測器	8,400	414.00	3,477,600
エスベック	15,300	1,798.00	27,509,400
キーエンス	184,200	51,340.00	9,456,828,000
日置電機	8,900	6,470.00	57,583,000
シスメックス	145,600	8,092.00	1,178,195,200
日本マイクロニクス	28,200	1,385.00	39,057,000
メガチップス	18,200	2,611.00	47,520,200
O B A R A G R O U P	8,100	3,195.00	25,879,500
澤藤電機	2,900	1,262.00	3,659,800

原田工業	10,400	787.00	8,184,800
コーセル	23,200	876.00	20,323,200
イリソ電子工業	17,200	3,920.00	67,424,000
オブテックスグループ	31,300	2,034.00	63,664,200
千代田インテグレ	7,100	2,137.00	15,172,700
レーザーテック	83,300	18,650.00	1,553,545,000
スタンレー電気	131,300	2,492.00	327,199,600
岩崎電気	6,600	2,498.00	16,486,800
ウシオ電機	96,500	1,623.00	156,619,500
岡谷電機産業	16,900	242.00	4,089,800
ハリオス テクノ ホールディング	18,900	376.00	7,106,400
エノモト	6,000	1,512.00	9,072,000
日本セラミック	17,400	2,603.00	45,292,200
遠藤照明	10,100	762.00	7,696,200
古河電池	15,000	1,134.00	17,010,000
双信電機	11,100	436.00	4,839,600
山一電機	13,500	2,011.00	27,148,500
図研	13,400	3,515.00	47,101,000
日本電子	39,100	5,550.00	217,005,000
カシオ計算機	125,700	1,315.00	165,295,500
ファナック	178,400	22,395.00	3,995,268,000
日本シイエムケイ	37,100	450.00	16,695,000
エンプラス	5,200	4,130.00	21,476,000
大真空	25,700	957.00	24,594,900
ローム	84,600	10,560.00	893,376,000
浜松ホトニクス	135,500	5,800.00	785,900,000
三井ハイテック	17,500	8,310.00	145,425,000
新光電気工業	59,900	3,685.00	220,731,500
京セラ	286,100	7,623.00	2,180,940,300
太陽誘電	90,500	4,195.00	379,647,500
村田製作所	554,600	7,324.00	4,061,890,400
双葉電子工業	35,700	656.00	23,419,200
北陸電気工業	8,100	1,090.00	8,829,000
ニチコン	54,600	1,450.00	79,170,000
日本ケミコン	19,600	1,815.00	35,574,000
K O A	28,400	2,346.00	66,626,400
市光工業	25,900	370.00	9,583,000
小糸製作所	101,600	4,765.00	484,124,000
ミツバ	31,600	423.00	13,366,800
S C R E E Nホールディングス	32,100	9,070.00	291,147,000
キャノン電子	19,000	1,603.00	30,457,000
キャノン	926,000	3,253.00	3,012,278,000

リコー	483,700	1,072.00	518,526,400
象印マホービン	50,800	1,576.00	80,060,800
MUTOHホールディングス	2,900	1,930.00	5,597,000
東京エレクトロン	129,000	42,570.00	5,491,530,000
トヨタ紡織	71,100	1,984.00	141,062,400
芦森工業	3,800	1,016.00	3,860,800
ユニプレス	33,300	950.00	31,635,000
豊田自動織機	144,000	7,540.00	1,085,760,000
モリタホールディングス	32,600	1,274.00	41,532,400
三櫻工業	28,100	769.00	21,608,900
デンソー	397,800	7,200.00	2,864,160,000
東海理化電機製作所	53,500	1,471.00	78,698,500
川崎重工業	137,800	2,624.00	361,587,200
名村造船所	52,500	646.00	33,915,000
日本車輛製造	6,500	2,118.00	13,767,000
三菱ロジスネクスト	26,900	828.00	22,273,200
近畿車輛	3,100	1,012.00	3,137,200
日産自動車	2,397,500	530.00	1,270,675,000
いすゞ自動車	588,800	1,696.00	998,604,800
トヨタ自動車	9,267,400	2,037.00	18,877,693,800
日野自動車	253,900	630.00	159,957,000
三菱自動車工業	752,500	576.00	433,440,000
エフテック	13,000	524.00	6,812,000
レシップホールディングス	8,100	526.00	4,260,600
G M B	3,700	712.00	2,634,400
ファルテック	3,600	581.00	2,091,600
武蔵精密工業	45,300	1,694.00	76,738,200
日産車体	29,800	757.00	22,558,600
新明和工業	53,000	1,042.00	55,226,000
極東開発工業	32,400	1,353.00	43,837,200
トピー工業	15,200	1,393.00	21,173,600
ティラド	5,500	2,725.00	14,987,500
曙ブレーキ工業	111,600	168.00	18,748,800
タチエス	33,400	1,200.00	40,080,000
N O K	76,500	1,220.00	93,330,000
フタバ産業	45,200	353.00	15,955,600
K Y B	17,900	3,240.00	57,996,000
大同メタル工業	39,000	521.00	20,319,000
プレス工業	91,100	431.00	39,264,100
ミクニ	23,600	324.00	7,646,400
太平洋工業	38,700	1,060.00	41,022,000
河西工業	24,900	235.00	5,851,500

アイシン	148,800	4,085.00	607,848,000
マツダ	598,100	1,181.00	706,356,100
今仙電機製作所	13,300	571.00	7,594,300
本田技研工業	1,486,300	3,620.00	5,380,406,000
スズキ	403,000	4,902.00	1,975,506,000
S U B A R U	534,000	2,472.00	1,320,048,000
安永	8,200	745.00	6,109,000
ヤマハ発動機	265,200	2,822.00	748,394,400
T B K	20,400	315.00	6,426,000
エクセディ	30,700	1,769.00	54,308,300
豊田合成	57,400	2,380.00	136,612,000
愛三工業	31,800	718.00	22,832,400
盟和産業	2,900	992.00	2,876,800
日本プラスト	14,700	448.00	6,585,600
ヨロズ	15,800	884.00	13,967,200
エフ・シー・シー	33,200	1,418.00	47,077,600
シマノ	69,000	24,015.00	1,657,035,000
テイ・エス テック	85,800	1,532.00	131,445,600
ジャムコ	11,900	1,179.00	14,030,100
テルモ	575,300	4,429.00	2,548,003,700
クリエートメディック	6,100	921.00	5,618,100
日機装	42,200	1,019.00	43,001,800
日本エム・ディ・エム	11,700	1,329.00	15,549,300
島津製作所	242,900	3,990.00	969,171,000
J M S	15,700	548.00	8,603,600
長野計器	13,500	1,061.00	14,323,500
ブイ・テクノロジー	8,900	2,881.00	25,640,900
東京計器	13,000	1,271.00	16,523,000
愛知時計電機	7,300	1,394.00	10,176,200
インターアクション	10,200	1,758.00	17,931,600
オーバル	18,200	463.00	8,426,600
東京精密	31,700	4,590.00	145,503,000
マニー	74,200	1,654.00	122,726,800
ニコン	286,600	1,534.00	439,644,400
トプコン	95,600	1,805.00	172,558,000
オリンパス	973,900	3,000.00	2,921,700,000
理研計器	13,400	4,265.00	57,151,000
タムロン	12,600	3,055.00	38,493,000
H O Y A	392,500	14,090.00	5,530,325,000
シード	9,500	564.00	5,358,000
ノーリツ鋼機	16,000	2,502.00	40,032,000
A & D ホロンホールディングス	22,900	903.00	20,678,700



朝日インテック	222,900	2,373.00	528,941,700
シチズン時計	198,100	600.00	118,860,000
リズム	6,400	1,368.00	8,755,200
大研医器	16,100	474.00	7,631,400
メニコン	62,700	3,305.00	207,223,500
シンシア	1,800	432.00	777,600
松風	6,800	2,260.00	15,368,000
セイコーホールディングス	28,800	2,807.00	80,841,600
ニプロ	140,700	1,131.00	159,131,700
中本パックス	5,700	1,557.00	8,874,900
スノーピーク	28,900	2,151.00	62,163,900
パラマウントベッドホールディングス	39,000	2,587.00	100,893,000
トランザクション	13,000	1,058.00	13,754,000
粧美堂	5,100	420.00	2,142,000
ニホンフラッシュ	15,800	955.00	15,089,000
前田工織	18,300	3,260.00	59,658,000
永大産業	22,100	250.00	5,525,000
アートネイチャー	17,400	716.00	12,458,400
バンダイナムコホールディングス	168,100	9,999.00	1,680,831,900
アイフィスジャパン	5,200	600.00	3,120,000
共立印刷	27,800	140.00	3,892,000
S H O E I	17,800	5,370.00	95,586,000
フランスベッドホールディングス	26,100	934.00	24,377,400
パイロットコーポレーション	26,400	5,040.00	133,056,000
萩原工業	11,300	1,063.00	12,011,900
フジシールインターナショナル	41,800	1,514.00	63,285,200
タカラトミー	83,900	1,336.00	112,090,400
広済堂ホールディングス	12,600	1,229.00	15,485,400
エステールホールディングス	4,300	625.00	2,687,500
タカノ	6,900	753.00	5,195,700
プロネクサス	15,700	986.00	15,480,200
ホクシン	14,300	151.00	2,159,300
ウッドワン	6,200	1,105.00	6,851,000
大建工業	10,300	1,945.00	20,033,500
凸版印刷	264,900	2,245.00	594,700,500
大日本印刷	220,200	2,946.00	648,709,200
共同印刷	5,300	2,512.00	13,313,600
N I S S H A	32,100	1,776.00	57,009,600
光村印刷	1,600	1,233.00	1,972,800
T A K A R A & C O M P A N Y	11,600	2,077.00	24,093,200
アシックス	155,800	2,430.00	378,594,000
ツツミ	5,100	1,991.00	10,154,100

ローランド	12,400	4,005.00	49,662,000	
小松ウオール工業	6,200	1,901.00	11,786,200	
ヤマハ	118,200	5,310.00	627,642,000	
河合楽器製作所	5,100	2,673.00	13,632,300	
クリナップ	18,900	607.00	11,472,300	
ピジョン	107,500	2,058.00	221,235,000	
兼松サステック	1,300	1,649.00	2,143,700	
キングジム	14,900	897.00	13,365,300	
リンテック	38,700	2,295.00	88,816,500	
イトーキ	34,600	424.00	14,670,400	
任天堂	114,800	56,430.00	6,478,164,000	
三菱鉛筆	24,300	1,379.00	33,509,700	
タカラスタANDARD	32,700	1,319.00	43,131,300	
コクヨ	81,300	1,760.00	143,088,000	
ナカバヤシ	16,400	509.00	8,347,600	
グローブライド	15,100	2,514.00	37,961,400	
オカムラ	57,200	1,287.00	73,616,400	
美津濃	16,800	2,633.00	44,234,400	
東京電力ホールディングス	1,521,400	528.00	803,299,200	
中部電力	574,100	1,408.00	808,332,800	
関西電力	711,000	1,324.00	941,364,000	
中国電力	293,200	823.00	241,303,600	
北陸電力	172,600	503.00	86,817,800	
東北電力	444,300	699.00	310,565,700	
四国電力	169,000	807.00	136,383,000	
九州電力	389,100	826.00	321,396,600	
北海道電力	176,600	503.00	88,829,800	
沖縄電力	43,100	1,108.00	47,754,800	
電源開発	150,200	2,099.00	315,269,800	
エフオン	12,300	652.00	8,019,600	
イーレックス	26,200	2,729.00	71,499,800	
レノバ	39,900	2,889.00	115,271,100	
東京瓦斯	361,800	2,561.00	926,569,800	
大阪瓦斯	341,900	2,280.00	779,532,000	
東邦瓦斯	79,700	3,010.00	239,897,000	
北海道瓦斯	10,100	1,631.00	16,473,100	
広島ガス	35,500	327.00	11,608,500	
西部ガスホールディングス	19,400	1,746.00	33,872,400	
静岡ガス	38,500	1,001.00	38,538,500	
メタウォーター	21,100	2,007.00	42,347,700	
SBSホールディングス	15,000	2,920.00	43,800,000	
東武鉄道	185,400	3,220.00	596,988,000	

相鉄ホールディングス	60,400	2,325.00	140,430,000
東急	473,300	1,620.00	766,746,000
京浜急行電鉄	226,300	1,372.00	310,483,600
小田急電鉄	255,800	1,830.00	468,114,000
京王電鉄	89,200	5,210.00	464,732,000
京成電鉄	123,554	3,720.00	459,620,880
富士急行	20,800	3,965.00	82,472,000
東日本旅客鉄道	310,100	7,046.00	2,184,964,600
西日本旅客鉄道	215,600	5,292.00	1,140,955,200
東海旅客鉄道	143,000	16,115.00	2,304,445,000
西武ホールディングス	245,000	1,370.00	335,650,000
鴻池運輸	28,800	1,317.00	37,929,600
西日本鉄道	48,800	2,792.00	136,249,600
ハマキョウレックス	13,200	3,135.00	41,382,000
サカイ引越センター	9,300	4,665.00	43,384,500
近鉄グループホールディングス	180,500	4,535.00	818,567,500
阪急阪神ホールディングス	224,700	4,110.00	923,517,000
南海電気鉄道	80,500	2,699.00	217,269,500
京阪ホールディングス	75,000	3,455.00	259,125,000
神戸電鉄	4,600	3,340.00	15,364,000
名古屋鉄道	186,200	2,091.00	389,344,200
山陽電気鉄道	13,700	2,187.00	29,961,900
アルプス物流	13,400	1,097.00	14,699,800
ヤマトホールディングス	263,700	2,159.00	569,328,300
山九	46,800	4,275.00	200,070,000
丸運	9,100	232.00	2,111,200
丸全昭和運輸	13,000	3,080.00	40,040,000
センコーグループホールディングス	89,200	971.00	86,613,200
トナミホールディングス	3,700	3,715.00	13,745,500
ニッコンホールディングス	58,100	2,360.00	137,116,000
日本石油輸送	2,100	2,422.00	5,086,200
福山通運	24,600	3,055.00	75,153,000
セイノーホールディングス	104,900	1,116.00	117,068,400
エスライン	5,300	815.00	4,319,500
神奈川中央交通	4,800	3,685.00	17,688,000
日立物流	37,200	8,810.00	327,732,000
丸和運輸機関	32,500	1,519.00	49,367,500
C & F ロジホールディングス	16,200	1,209.00	19,585,800
九州旅客鉄道	129,100	2,886.00	372,582,600
S Gホールディングス	323,300	2,276.00	735,830,800
NIPPON EXPRESSホールディングス	62,900	7,540.00	474,266,000
日本郵船	161,200	10,340.00	1,666,808,000

商船三井	297,500	3,535.00	1,051,662,500
川崎汽船	59,500	8,430.00	501,585,000
N S ユナイテッド海運	9,600	4,665.00	44,784,000
飯野海運	78,300	774.00	60,604,200
共栄タンカー	5,900	911.00	5,374,900
乾汽船	12,600	2,010.00	25,326,000
日本航空	413,900	2,490.00	1,030,611,000
A N A ホールディングス	458,500	2,612.50	1,197,831,250
パスコ	3,600	1,306.00	4,701,600
トランコム	5,400	7,660.00	41,364,000
日新	14,100	1,830.00	25,803,000
三菱倉庫	46,600	3,600.00	167,760,000
三井倉庫ホールディングス	18,800	3,335.00	62,698,000
住友倉庫	56,500	2,132.00	120,458,000
澁澤倉庫	9,600	2,078.00	19,948,800
東陽倉庫	27,300	277.00	7,562,100
日本トランスシティ	33,900	505.00	17,119,500
ケイヒン	3,300	1,433.00	4,728,900
中央倉庫	9,900	932.00	9,226,800
川西倉庫	3,500	1,054.00	3,689,000
安田倉庫	12,900	927.00	11,958,300
ファイズホールディングス	4,100	1,047.00	4,292,700
東洋埠頭	5,400	1,242.00	6,706,800
上組	91,400	2,692.00	246,048,800
サンリツ	4,900	688.00	3,371,200
キムラユニティー	10,000	803.00	8,030,000
キューソー流通システム	11,200	1,313.00	14,705,600
東海運	11,000	281.00	3,091,000
エーアイティー	12,100	1,507.00	18,234,700
内外トランスライン	6,100	2,172.00	13,249,200
日本コンセプト	5,300	1,806.00	9,571,800
N E C ネットエスアイ	66,100	1,695.00	112,039,500
クロスキャット	10,900	1,377.00	15,009,300
システナ	285,100	422.00	120,312,200
デジタルアーツ	10,700	6,200.00	66,340,000
日鉄ソリューションズ	34,700	3,715.00	128,910,500
キューブシステム	10,300	1,020.00	10,506,000
WOW WORLD	3,100	836.00	2,591,600
コア	8,600	1,430.00	12,298,000
手間いらず	2,900	4,720.00	13,688,000
ラクーンホールディングス	17,100	1,296.00	22,161,600
ソリトンシステムズ	8,900	1,153.00	10,261,700

ソフトクリエイイトホールディングス	8,800	3,580.00	31,504,000
T I S	174,400	4,090.00	713,296,000
J N Sホールディングス	9,800	398.00	3,900,400
グリー	91,000	863.00	78,533,000
G M Oペパボ	2,500	1,901.00	4,752,500
コーエーテクモホールディングス	63,700	4,620.00	294,294,000
三菱総合研究所	8,400	4,270.00	35,868,000
電算	2,300	1,995.00	4,588,500
A G S	8,200	691.00	5,666,200
ファインデックス	13,800	628.00	8,666,400
ブレインパッド	17,100	1,030.00	17,613,000
K L a b	31,800	408.00	12,974,400
ポールトゥウィンホールディングス	29,100	994.00	28,925,400
ネクソン	455,500	2,834.00	1,290,887,000
アイスタイル	51,900	501.00	26,001,900
エムアップホールディングス	23,200	1,445.00	33,524,000
エイチーム	12,800	744.00	9,523,200
エニグモ	22,000	549.00	12,078,000
テクノスジャパン	16,000	447.00	7,152,000
コロプラ	66,000	686.00	45,276,000
ブロードリーフ	99,300	498.00	49,451,400
クロス・マーケティンググループ	7,800	850.00	6,630,000
デジタルハーツホールディングス	9,200	1,788.00	16,449,600
システム情報	15,200	983.00	14,941,600
メディアドゥ	6,900	2,118.00	14,614,200
じげん	57,100	331.00	18,900,100
ブイキューブ	20,500	1,228.00	25,174,000
エンカレッジ・テクノロジー	4,800	525.00	2,520,000
サイバーリンクス	6,200	1,066.00	6,609,200
フィックスターズ	19,300	1,206.00	23,275,800
C A R T A H O L D I N G S	8,300	1,767.00	14,666,100
オブティム	14,200	861.00	12,226,200
セレス	6,900	1,041.00	7,182,900
S H I F T	12,400	19,750.00	244,900,000
ティーガイア	17,800	1,657.00	29,494,600
セック	3,000	2,284.00	6,852,000
テクマトリックス	33,900	1,673.00	56,714,700
プロシップ	6,800	1,434.00	9,751,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	51,900	2,297.00	119,214,300
G M Oペイメントゲートウェイ	38,700	10,640.00	411,768,000
ザッパラス	7,700	313.00	2,410,100
システムリサーチ	5,900	1,914.00	11,292,600

インターネットイニシアティブ	53,200	4,835.00	257,222,000
さくらインターネット	21,800	561.00	12,229,800
ヴィンクス	5,700	1,542.00	8,789,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,200	4,890.00	25,428,000
SRAホールディングス	9,700	2,967.00	28,779,900
システムインテグレータ	6,800	450.00	3,060,000
朝日ネット	18,600	611.00	11,364,600
eBASE	24,200	530.00	12,826,000
アバント	21,500	1,447.00	31,110,500
アドソル日進	7,300	1,525.00	11,132,500
ODKソリューションズ	4,500	612.00	2,754,000
フリービット	10,600	890.00	9,434,000
コムチュア	22,500	2,293.00	51,592,500
サイバーコム	3,200	1,289.00	4,124,800
アステリア	14,600	794.00	11,592,400
アイル	9,600	1,661.00	15,945,600
マークラインズ	9,300	2,217.00	20,618,100
メディカル・データ・ビジョン	25,500	1,072.00	27,336,000
gumi	27,900	804.00	22,431,600
ショーケース	4,900	411.00	2,013,900
モバイルファクトリー	4,200	949.00	3,985,800
テラスカイ	7,400	1,906.00	14,104,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,000	1,526.00	13,734,000
PCIホールディングス	8,100	954.00	7,727,400
アイビーシー	3,500	473.00	1,655,500
ネオジャパン	5,900	1,085.00	6,401,500
PR TIMES	4,300	2,477.00	10,651,100
ラクス	91,600	1,602.00	146,743,200
ランドコンピュータ	4,800	869.00	4,171,200
ダブルスタンダード	6,100	2,389.00	14,572,900
オープンドア	12,000	1,933.00	23,196,000
マイネット	6,500	514.00	3,341,000
アカツキ	9,000	2,319.00	20,871,000
ベネフィットジャパン	1,700	1,528.00	2,597,600
Ubicomホールディングス	5,300	2,560.00	13,568,000
カナミックネットワーク	24,700	545.00	13,461,500
ノムラシステムコーポレーション	19,400	132.00	2,560,800
チェンジ	41,600	1,805.00	75,088,000
シンクロ・フード	10,700	456.00	4,879,200
オークネット	8,900	2,154.00	19,170,600
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	712.00	2,776,800
セグエグループ	5,600	715.00	4,004,000

エイトレッド	3,000	1,827.00	5,481,000
マクロミル	38,500	1,168.00	44,968,000
ビーグリー	3,300	1,356.00	4,474,800
オロ	5,200	1,636.00	8,507,200
ユーザーローカル	6,200	1,550.00	9,610,000
テモナ	4,300	318.00	1,367,400
ニーズウェル	6,100	635.00	3,873,500
マネーフォワード	40,800	3,405.00	138,924,000
サインポスト	6,400	860.00	5,504,000
電算システムホールディングス	8,300	2,284.00	18,957,200
ソルクシーズ	15,900	372.00	5,914,800
フェイス	5,700	570.00	3,249,000
プロトコーポレーション	21,400	1,065.00	22,791,000
ハイマックス	5,500	1,348.00	7,414,000
野村総合研究所	346,900	3,740.00	1,297,406,000
サイバネットシステム	14,400	985.00	14,184,000
C Eホールディングス	10,100	496.00	5,009,600
日本システム技術	3,600	2,700.00	9,720,000
インテージホールディングス	23,100	1,637.00	37,814,700
東邦システムサイエンス	5,500	1,002.00	5,511,000
ソースネクスト	87,000	237.00	20,619,000
インフォコム	21,900	1,965.00	43,033,500
シンプレクス・ホールディングス	31,800	2,016.00	64,108,800
HEROZ	6,000	854.00	5,124,000
ラクスル	24,000	2,109.00	50,616,000
メルカリ	76,200	2,327.00	177,317,400
I P S	5,600	3,010.00	16,856,000
F I G	22,400	397.00	8,892,800
システムサポート	7,400	1,394.00	10,315,600
イーソル	11,200	584.00	6,540,800
アルテリア・ネットワークス	19,100	1,270.00	24,257,000
東海ソフト	3,400	943.00	3,206,200
ウイングアーク1st	15,300	1,781.00	27,249,300
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,675.00	7,872,500
サーバーワークス	3,500	2,489.00	8,711,500
東名	1,600	1,012.00	1,619,200
ヴィッツ	2,100	1,055.00	2,215,500
トビラシステムズ	4,900	1,012.00	4,958,800
S a n s a n	63,300	1,355.00	85,771,500
L i n k - U	3,900	806.00	3,143,400
ギフトィ	18,300	2,110.00	38,613,000
ベース	2,900	6,500.00	18,850,000

J M D C	25,300	6,420.00	162,426,000
フォーカスシステムズ	12,600	1,011.00	12,738,600
クレスコ	14,600	1,749.00	25,535,400
フジ・メディア・ホールディングス	177,600	1,090.00	193,584,000
オービック	62,900	20,450.00	1,286,305,000
ジャストシステム	28,400	3,440.00	97,696,000
T D C ソフト	16,000	1,166.00	18,656,000
Zホールディングス	2,877,500	412.80	1,187,832,000
トレンドマイクロ	97,800	8,250.00	806,850,000
I Dホールディングス	12,800	872.00	11,161,600
日本オラクル	32,400	8,270.00	267,948,000
アルファシステムズ	5,400	4,260.00	23,004,000
フューチャー	42,300	1,658.00	70,133,400
C A C H o l d i n g s	10,500	1,415.00	14,857,500
S B テクノロジー	8,700	2,452.00	21,332,400
トーセ	5,200	776.00	4,035,200
オービックビジネスコンサルタント	19,100	4,885.00	93,303,500
伊藤忠テクノソリューションズ	91,000	3,455.00	314,405,000
アイティフォー	24,400	780.00	19,032,000
東計電算	2,400	6,160.00	14,784,000
エクスネット	3,400	1,000.00	3,400,000
大塚商会	96,000	4,500.00	432,000,000
サイボウズ	23,500	1,360.00	31,960,000
電通国際情報サービス	20,600	4,400.00	90,640,000
A C C E S S	22,800	709.00	16,165,200
デジタルガレージ	33,100	3,805.00	125,945,500
E M システムズ	28,500	920.00	26,220,000
ウェザーニューズ	6,000	7,940.00	47,640,000
C I J	15,800	761.00	12,023,800
ビジネスエンジニアリング	4,600	2,344.00	10,782,400
日本エンタープライズ	20,900	161.00	3,364,900
WOWOW	8,400	1,350.00	11,340,000
スカラ	17,100	712.00	12,175,200
インテリジェント ウェイブ	10,200	866.00	8,833,200
I M A G I C A G R O U P	14,400	925.00	13,320,000
ネットワンシステムズ	73,700	3,005.00	221,468,500
システムソフト	61,100	105.00	6,415,500
アルゴグラフィックス	15,600	3,910.00	60,996,000
マーベラス	31,800	675.00	21,465,000
エイベックス	34,600	1,592.00	55,083,200
B I P R O G Y	62,400	3,065.00	191,256,000
兼松エレクトロニクス	10,900	4,110.00	44,799,000



都築電気	9,100	1,326.00	12,066,600
TBSホールディングス	97,600	1,616.00	157,721,600
日本テレビホールディングス	166,700	1,174.00	195,705,800
朝日放送グループホールディングス	16,200	647.00	10,481,400
テレビ朝日ホールディングス	48,100	1,438.00	69,167,800
スカパーJ SATホールディングス	169,400	543.00	91,984,200
テレビ東京ホールディングス	12,400	1,947.00	24,142,800
日本BS放送	7,000	922.00	6,454,000
ビジョン	22,400	1,308.00	29,299,200
スマートバリュー	5,000	494.00	2,470,000
USEN-NEXT HOLDINGS	15,300	2,011.00	30,768,300
ワイヤレスゲート	9,000	291.00	2,619,000
コネクシオ	14,300	1,297.00	18,547,100
クロップス	3,900	911.00	3,552,900
日本電信電話	2,236,000	3,748.00	8,380,528,000
KDDI	1,454,300	4,259.00	6,193,863,700
ソフトバンク	3,021,500	1,512.50	4,570,018,750
光通信	23,000	17,320.00	398,360,000
エムティーアイ	15,900	501.00	7,965,900
GMOインターネットグループ	63,000	2,575.00	162,225,000
ファイバーゲート	9,300	972.00	9,039,600
アйдママーケティングコミュニケーション	5,100	293.00	1,494,300
KADOKAWA	107,500	3,100.00	333,250,000
学研ホールディングス	28,400	955.00	27,122,000
ゼンリン	32,800	916.00	30,044,800
昭文社ホールディングス	8,800	314.00	2,763,200
インプレスホールディングス	17,600	210.00	3,696,000
アイネット	9,400	1,313.00	12,342,200
松竹	11,500	11,950.00	137,425,000
東宝	117,700	5,270.00	620,279,000
東映	5,600	18,300.00	102,480,000
エヌ・ティ・ティ・データ	531,200	1,960.00	1,041,152,000
ピー・シー・エー	11,900	1,017.00	12,102,300
ビジネスブレイン太田昭和	6,800	1,503.00	10,220,400
DTS	37,200	3,490.00	129,828,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	92,800	6,220.00	577,216,000
シーイーシー	21,500	1,282.00	27,563,000
カブコン	185,100	3,685.00	682,093,500
アイ・エス・ビー	8,800	1,239.00	10,903,200
ジャステック	10,600	1,207.00	12,794,200
SCSK	138,200	2,268.00	313,437,600
NSW	7,600	2,301.00	17,487,600

アイネス	17,300	1,529.00	26,451,700
T K C	30,400	3,470.00	105,488,000
富士ソフト	19,200	8,190.00	157,248,000
N S D	62,600	2,471.00	154,684,600
コナミグループ	72,500	7,180.00	520,550,000
福井コンピュータホールディングス	9,200	3,585.00	32,982,000
J B C Cホールディングス	13,600	1,840.00	25,024,000
ミロク情報サービス	17,700	1,546.00	27,364,200
ソフトバンクグループ	1,196,200	5,497.00	6,575,511,400
高千穂交易	7,100	2,241.00	15,911,100
オルバヘルスケアホールディングス	3,300	1,488.00	4,910,400
伊藤忠食品	4,000	4,940.00	19,760,000
エレマテック	16,100	1,320.00	21,252,000
あらた	14,800	4,105.00	60,754,000
トーメンデバイス	3,000	5,620.00	16,860,000
東京エレクトロン デバイス	5,900	5,770.00	34,043,000
フィールズ	17,600	1,409.00	24,798,400
双日	205,400	2,306.00	473,652,400
アルフレッサ ホールディングス	207,700	1,675.00	347,897,500
横浜冷凍	48,700	921.00	44,852,700
ラサ商事	9,100	972.00	8,845,200
アルコニックス	25,500	1,360.00	34,680,000
神戸物産	138,200	3,495.00	483,009,000
ハイパー	3,800	440.00	1,672,000
あい ホールディングス	28,600	2,148.00	61,432,800
ディーブイエックス	6,900	905.00	6,244,500
ダイワボウホールディングス	85,100	1,920.00	163,392,000
マクニカホールディングス	47,800	2,880.00	137,664,000
ラクト・ジャパン	6,900	2,257.00	15,573,300
グリムス	8,900	1,741.00	15,494,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,900	660.00	21,054,000
八洲電機	14,500	1,001.00	14,514,500
メディアスホールディングス	11,500	741.00	8,521,500
レスターホールディングス	19,000	1,993.00	37,867,000
ジュテックホールディングス	4,000	1,091.00	4,364,000
大光	8,600	705.00	6,063,000
O C H Iホールディングス	4,500	1,228.00	5,526,000
T O K A Iホールディングス	97,000	875.00	84,875,000
黒谷	5,500	568.00	3,124,000
C o m i n i x	3,500	717.00	2,509,500
三洋貿易	18,400	1,005.00	18,492,000
ビューティガレージ	3,200	2,728.00	8,729,600

ウイン・パートナーズ	14,500	971.00	14,079,500
ミタチ産業	5,100	770.00	3,927,000
シップヘルスケアホールディングス	57,800	2,623.00	151,609,400
明治電機工業	6,100	1,050.00	6,405,000
デリカフーズホールディングス	7,800	520.00	4,056,000
スターティアホールディングス	4,600	963.00	4,429,800
コメダホールディングス	43,700	2,214.00	96,751,800
ピーバンドットコム	2,900	514.00	1,490,600
アセンテック	6,900	629.00	4,340,100
富士興産	5,000	1,205.00	6,025,000
協栄産業	2,000	1,415.00	2,830,000
フルサト・マルカホールディングス	17,800	3,250.00	57,850,000
ヤマエグループホールディングス	11,200	1,663.00	18,625,600
小野建	17,900	1,477.00	26,438,300
南陽	3,800	1,870.00	7,106,000
佐島電機	12,500	1,209.00	15,112,500
エコートレーディング	4,300	552.00	2,373,600
伯東	11,700	3,465.00	40,540,500
コンドーテック	15,000	1,004.00	15,060,000
中山福	10,700	305.00	3,263,500
ナガイレーベン	24,200	1,929.00	46,681,800
三菱食品	19,200	3,295.00	63,264,000
松田産業	14,600	2,270.00	33,142,000
第一興商	38,000	3,940.00	149,720,000
メディバルホールディングス	185,200	1,896.00	351,139,200
S P K	8,000	1,385.00	11,080,000
萩原電気ホールディングス	6,900	2,266.00	15,635,400
アズワン	28,700	6,370.00	182,819,000
スズデン	6,300	2,112.00	13,305,600
尾家産業	4,700	859.00	4,037,300
シモジマ	12,300	1,058.00	13,013,400
ドウシシャ	18,900	1,501.00	28,368,900
小津産業	4,400	1,785.00	7,854,000
高速	10,600	1,502.00	15,921,200
たけびし	6,800	1,514.00	10,295,200
リックス	4,100	1,957.00	8,023,700
丸文	16,000	804.00	12,864,000
ハピネット	15,200	1,586.00	24,107,200
橋本総業ホールディングス	3,600	2,000.00	7,200,000
日本ライフライン	59,200	969.00	57,364,800
タカショー	15,600	696.00	10,857,600
I D O M	60,800	850.00	51,680,000

進和	11,800	2,156.00	25,440,800
エスケイジャパン	4,900	548.00	2,685,200
ダイترون	7,100	2,085.00	14,803,500
シークス	25,500	1,061.00	27,055,500
田中商事	6,200	569.00	3,527,800
オーハシテクニカ	9,900	1,385.00	13,711,500
白銅	6,500	2,555.00	16,607,500
ダイコー通産	2,400	1,116.00	2,678,400
伊藤忠商事	1,200,400	3,716.00	4,460,686,400
丸紅	1,734,500	1,396.00	2,421,362,000
高島	2,900	2,539.00	7,363,100
長瀬産業	91,600	2,012.00	184,299,200
蝶理	11,200	2,006.00	22,467,200
豊田通商	178,800	4,790.00	856,452,000
三共生興	25,700	455.00	11,693,500
兼松	69,300	1,478.00	102,425,400
ツカモトコーポレーション	3,300	1,038.00	3,425,400
三井物産	1,451,300	3,177.00	4,610,780,100
日本紙パルプ商事	9,500	4,310.00	40,945,000
カメイ	21,400	1,085.00	23,219,000
東都水産	1,000	4,940.00	4,940,000
OUGホールディングス	2,900	2,950.00	8,555,000
スターゼン	13,600	2,040.00	27,744,000
山善	72,200	912.00	65,846,400
椿本興業	3,300	3,650.00	12,045,000
住友商事	1,184,700	1,921.00	2,275,808,700
内田洋行	7,900	4,385.00	34,641,500
三菱商事	1,312,800	4,372.00	5,739,561,600
第一実業	7,700	3,820.00	29,414,000
キャノンマーケティングジャパン	41,400	3,135.00	129,789,000
西華産業	8,600	1,615.00	13,889,000
佐藤商事	13,800	1,142.00	15,759,600
菱洋エレクトロ	11,900	2,390.00	28,441,000
東京産業	16,300	789.00	12,860,700
ユアサ商事	16,100	3,525.00	56,752,500
神鋼商事	4,500	4,125.00	18,562,500
トルク	10,800	199.00	2,149,200
阪和興業	34,700	3,515.00	121,970,500
正栄食品工業	11,900	4,000.00	47,600,000
カナデン	16,300	1,065.00	17,359,500
菱電商事	15,900	1,616.00	25,694,400
岩谷産業	44,400	5,470.00	242,868,000

ナイス	6,200	1,549.00	9,603,800
ニチモウ	2,400	2,597.00	6,232,800
極東貿易	11,500	1,329.00	15,283,500
アステナホールディングス	31,000	445.00	13,795,000
三愛オブリ	44,900	1,076.00	48,312,400
稲畑産業	40,100	2,393.00	95,959,300
G S I クレオス	9,600	1,550.00	14,880,000
明和産業	18,500	794.00	14,689,000
クワザワホールディングス	7,200	430.00	3,096,000
ワキタ	36,200	1,104.00	39,964,800
東邦ホールディングス	54,400	1,851.00	100,694,400
サンゲツ	48,600	1,641.00	79,752,600
ミツウロコグループホールディングス	23,000	976.00	22,448,000
シナネンホールディングス	6,600	3,770.00	24,882,000
伊藤忠エネクス	44,300	1,062.00	47,046,600
サンリオ	56,200	3,575.00	200,915,000
サンワテクノス	10,200	1,393.00	14,208,600
リョーサン	20,500	2,254.00	46,207,000
新光商事	26,400	978.00	25,819,200
トーホー	7,700	1,340.00	10,318,000
三信電気	8,200	1,716.00	14,071,200
東陽テクニカ	19,800	1,305.00	25,839,000
モスフードサービス	26,300	3,095.00	81,398,500
加賀電子	16,300	4,115.00	67,074,500
ソーダニッカ	16,000	603.00	9,648,000
立花エレテック	13,100	1,612.00	21,117,200
フォーバル	7,000	992.00	6,944,000
P A L T A C	28,100	4,010.00	112,681,000
三谷産業	31,300	304.00	9,515,200
西本Wismettacホールディングス	4,500	3,890.00	17,505,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,800	1,605.00	2,889,000
コア商事ホールディングス	12,600	696.00	8,769,600
国際紙パルプ商事	37,000	722.00	26,714,000
ヤマタネ	8,600	1,597.00	13,734,200
丸紅建材リース	1,800	1,853.00	3,335,400
日鉄物産	12,200	5,330.00	65,026,000
泉州電業	4,500	5,100.00	22,950,000
トラスコ中山	37,500	1,936.00	72,600,000
オートバックスセブン	62,200	1,410.00	87,702,000
モリト	13,200	704.00	9,292,800
加藤産業	21,700	3,470.00	75,299,000
北恵	4,500	751.00	3,379,500

イノテック	12,100	1,329.00	16,080,900
イエローハット	31,500	1,808.00	56,952,000
J Kホールディングス	14,100	1,016.00	14,325,600
日伝	13,600	1,807.00	24,575,200
北沢産業	10,700	218.00	2,332,600
杉本商事	9,400	1,953.00	18,358,200
因幡電機産業	49,900	2,720.00	135,728,000
東テク	6,000	3,440.00	20,640,000
ミスミグループ本社	251,400	3,360.00	844,704,000
アルテック	11,100	324.00	3,596,400
タキヒヨー	5,500	750.00	4,125,000
蔵王産業	3,900	1,803.00	7,031,700
スズケン	71,800	3,290.00	236,222,000
ジェコス	13,900	814.00	11,314,600
グローセル	21,800	422.00	9,199,600
ローソン	44,400	4,600.00	204,240,000
サンエー	13,700	4,115.00	56,375,500
カワチ薬品	15,700	2,079.00	32,640,300
エービーシー・マート	31,300	5,740.00	179,662,000
ハードオフコーポレーション	9,100	1,248.00	11,356,800
アスクル	43,300	1,819.00	78,762,700
ゲオホールディングス	24,300	1,654.00	40,192,200
アダストリア	21,700	2,052.00	44,528,400
くら寿司	21,000	3,075.00	64,575,000
キャンドウ	6,500	2,156.00	14,014,000
アイケイ	7,100	439.00	3,116,900
パルグループホールディングス	17,700	2,350.00	41,595,000
エディオン	92,200	1,166.00	107,505,200
サーラコーポレーション	38,000	807.00	30,666,000
ワッツ	10,100	687.00	6,938,700
ハローズ	9,200	3,025.00	27,830,000
フジオフードグループ本社	14,900	1,287.00	19,176,300
あみやき亭	4,900	2,896.00	14,190,400
大黒天物産	6,500	5,600.00	36,400,000
ハニーズホールディングス	16,100	1,231.00	19,819,100
ファーマライズホールディングス	4,800	675.00	3,240,000
アルペン	14,900	2,060.00	30,694,000
ハブ	7,100	556.00	3,947,600
クオールホールディングス	24,800	1,248.00	30,950,400
ジーンズホールディングス	10,700	4,215.00	45,100,500
ビックカメラ	119,100	1,106.00	131,724,600
D C Mホールディングス	119,300	1,022.00	121,924,600

MonotaRO	253,300	2,400.00	607,920,000
東京一番フーズ	5,100	592.00	3,019,200
きちりホールディングス	5,300	353.00	1,870,900
アークランドサービスホールディングス	14,800	2,025.00	29,970,000
J.フロント リテイリング	222,300	1,127.00	250,532,100
ドトール・日レスホールディングス	31,900	1,604.00	51,167,600
マツキヨココカラ&カンパニー	117,400	5,410.00	635,134,000
ブロンコビリー	9,700	2,344.00	22,736,800
ZOZO	137,800	3,010.00	414,778,000
トレジャー・ファクトリー	6,100	1,733.00	10,571,300
物語コーポレーション	10,000	6,930.00	69,300,000
三越伊勢丹ホールディングス	300,800	1,110.00	333,888,000
Hamee	7,500	1,088.00	8,160,000
マーケットエンタープライズ	2,400	837.00	2,008,800
ウエルシアホールディングス	106,000	2,907.00	308,142,000
クリエイトSDホールディングス	29,600	3,055.00	90,428,000
丸善CHIホールディングス	24,400	358.00	8,735,200
ミサワ	4,600	603.00	2,773,800
ティーライフ	3,000	1,274.00	3,822,000
チムニー	6,100	1,235.00	7,533,500
シュッピン	16,700	1,184.00	19,772,800
オイシックス・ラ・大地	29,000	2,014.00	58,406,000
ネクステージ	40,800	3,100.00	126,480,000
ジョイフル本田	57,700	1,703.00	98,263,100
鳥貴族ホールディングス	6,800	2,133.00	14,504,400
ホットランド	13,900	1,297.00	18,028,300
すかいらーくホールディングス	244,300	1,511.00	369,137,300
SFPホールディングス	9,800	1,619.00	15,866,200
綿半ホールディングス	14,000	1,390.00	19,460,000
ヨシックスホールディングス	4,100	2,151.00	8,819,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	58,500	1,059.00	61,951,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,300	2,082.00	17,280,600
BEE NOS	10,300	2,317.00	23,865,100
あさひ	16,800	1,309.00	21,991,200
日本調剤	12,400	1,324.00	16,417,600
コスモス薬品	20,200	14,610.00	295,122,000
トーエル	9,200	809.00	7,442,800
セブン&アイ・ホールディングス	671,400	5,554.00	3,728,955,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	134,300	877.00	117,781,100
ツルハホールディングス	43,700	7,660.00	334,742,000
サンマルクホールディングス	16,000	1,588.00	25,408,000

フェリシモ	4,800	1,025.00	4,920,000
トリドールホールディングス	50,000	2,916.00	145,800,000
TOKYO BASE	19,400	338.00	6,557,200
ウイルプラスホールディングス	4,100	1,120.00	4,592,000
JMホールディングス	15,400	1,555.00	23,947,000
サツドラホールディングス	9,500	641.00	6,089,500
アレンザホールディングス	13,700	976.00	13,371,200
串カツ田中ホールディングス	4,900	1,788.00	8,761,200
パロックジャパンリミテッド	14,300	773.00	11,053,900
クスリのアオキホールディングス	18,000	6,090.00	109,620,000
力の源ホールディングス	10,600	677.00	7,176,200
FOOD & LIFE COMPANIES	102,700	2,123.00	218,032,100
メディカルシステムネットワーク	18,200	421.00	7,662,200
はるやまホールディングス	10,200	426.00	4,345,200
ノジマ	32,500	2,741.00	89,082,500
カッパ・クリエイト	28,100	1,393.00	39,143,300
ライトオン	15,000	683.00	10,245,000
良品計画	230,700	1,249.00	288,144,300
パリミキホールディングス	26,200	243.00	6,366,600
アドヴァングループ	17,400	815.00	14,181,000
アルビス	6,000	2,250.00	13,500,000
コナカ	21,600	348.00	7,516,800
ハウス オブ ローゼ	2,700	1,623.00	4,382,100
G-7ホールディングス	22,500	1,448.00	32,580,000
イオン北海道	26,600	1,149.00	30,563,400
コジマ	35,000	602.00	21,070,000
ヒマラヤ	6,600	936.00	6,177,600
コーナン商事	28,600	3,340.00	95,524,000
エコス	6,800	1,842.00	12,525,600
ワタミ	24,200	896.00	21,683,200
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	400,500	2,554.00	1,022,877,000
西松屋チェーン	39,700	1,585.00	62,924,500
ゼンショーホールディングス	97,800	3,540.00	346,212,000
幸楽苑ホールディングス	11,600	1,071.00	12,423,600
ハークスレイ	9,100	485.00	4,413,500
サイゼリヤ	29,800	2,466.00	73,486,800
VTホールディングス	76,100	479.00	36,451,900
魚力	5,700	2,248.00	12,813,600
フジ・コーポレーション	10,900	1,270.00	13,843,000
ユナイテッドアローズ	21,200	1,837.00	38,944,400
ハイデイ日高	29,100	1,966.00	57,210,600



YU-WA Creation Holdings	13,500	205.00	2,767,500
コロワイド	82,300	1,851.00	152,337,300
ピーシーデポコーポレーション	24,500	278.00	6,811,000
壱番屋	14,200	4,470.00	63,474,000
PLANT	5,100	672.00	3,427,200
スギホールディングス	40,000	5,890.00	235,600,000
薬王堂ホールディングス	10,100	2,400.00	24,240,000
スクロール	31,300	759.00	23,756,700
ヨンドシーホールディングス	17,100	1,730.00	29,583,000
木曽路	27,200	2,118.00	57,609,600
SRSホールディングス	29,700	854.00	25,363,800
千趣会	33,800	388.00	13,114,400
リテールパートナーズ	26,800	1,057.00	28,327,600
ケーヨー	37,200	890.00	33,108,000
上新電機	19,600	1,891.00	37,063,600
日本瓦斯	95,800	2,125.00	203,575,000
ロイヤルホールディングス	34,000	2,097.00	71,298,000
いなげや	20,000	1,206.00	24,120,000
チヨダ	17,500	772.00	13,510,000
ライフコーポレーション	15,700	2,642.00	41,479,400
リンガーハット	23,000	2,099.00	48,277,000
MrMaxHD	25,600	610.00	15,616,000
AOKIホールディングス	39,200	708.00	27,753,600
オークワ	28,800	901.00	25,948,800
コメリ	31,000	2,589.00	80,259,000
青山商事	38,500	956.00	36,806,000
しまむら	23,300	12,400.00	288,920,000
はせがわ	11,700	362.00	4,235,400
高島屋	134,800	1,549.00	208,805,200
松屋	33,900	882.00	29,899,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	87,100	1,015.00	88,406,500
近鉄百貨店	5,900	2,299.00	13,564,100
丸井グループ	145,000	2,406.00	348,870,000
アクシアル リテイリング	13,400	3,370.00	45,158,000
イオン	660,500	2,677.00	1,768,158,500
イズミ	31,700	2,953.00	93,610,100
平和堂	30,000	1,959.00	58,770,000
フジ	44,000	1,919.00	84,436,000
ヤオコー	22,800	6,540.00	149,112,000
ゼビオホールディングス	27,600	962.00	26,551,200
ケーズホールディングス	170,700	1,231.00	210,131,700
Olympicグループ	9,400	590.00	5,546,000

日産東京販売ホールディングス	30,800	284.00	8,747,200
シルバーライフ	4,400	1,427.00	6,278,800
Genky DrugStores	8,900	3,625.00	32,262,500
ナルミヤ・インターナショナル	4,900	858.00	4,204,200
ブックオフグループホールディングス	12,000	998.00	11,976,000
ギフトホールディングス	3,900	2,916.00	11,372,400
アインホールディングス	24,600	6,870.00	169,002,000
元気寿司	5,700	2,776.00	15,823,200
ヤマダホールディングス	709,000	477.00	338,193,000
アークランズ	31,600	1,481.00	46,799,600
ニトリホールディングス	79,500	12,880.00	1,023,960,000
グルメ杵屋	16,200	1,033.00	16,734,600
愛眼	14,600	179.00	2,613,400
ケーユーホールディングス	10,700	1,165.00	12,465,500
吉野家ホールディングス	70,000	2,346.00	164,220,000
松屋フーズホールディングス	9,700	3,735.00	36,229,500
サガミホールディングス	29,000	1,209.00	35,061,000
関西フードマーケット	16,400	1,177.00	19,302,800
王将フードサービス	13,300	6,370.00	84,721,000
プレナス	22,600	1,908.00	43,120,800
ミニストップ	15,000	1,388.00	20,820,000
アークス	35,700	2,022.00	72,185,400
パローホールディングス	41,100	1,728.00	71,020,800
ベルク	9,000	5,380.00	48,420,000
大庄	11,000	1,075.00	11,825,000
ファーストリテイリング	26,800	80,300.00	2,152,040,000
サンドラッグ	75,400	3,400.00	256,360,000
サクスパー ホールディングス	19,400	616.00	11,950,400
ヤマザワ	4,400	1,311.00	5,768,400
やまや	4,200	2,550.00	10,710,000
ベルーナ	43,400	725.00	31,465,000
島根銀行	6,400	470.00	3,008,000
じもとホールディングス	13,300	506.00	6,729,800
めぶきフィナンシャルグループ	824,800	266.00	219,396,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23,200	2,169.00	50,320,800
九州フィナンシャルグループ	350,900	371.00	130,183,900
ゆうちょ銀行	473,300	1,009.00	477,559,700
富山第一銀行	44,600	411.00	18,330,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	992,500	440.00	436,700,000
西日本フィナンシャルホールディングス	105,200	725.00	76,270,000
三十三フィナンシャルグループ	16,100	1,455.00	23,425,500
第四北越フィナンシャルグループ	28,300	2,599.00	73,551,700

ひろぎんホールディングス	256,300	608.00	155,830,400
おきなわフィナンシャルグループ	17,000	2,079.00	35,343,000
十六フィナンシャルグループ	23,300	2,440.00	56,852,000
北國フィナンシャルホールディングス	16,600	4,880.00	81,008,000
プロクレアホールディングス	20,300	2,112.00	42,873,600
新生銀行	130,800	1,933.00	252,836,400
あおぞら銀行	112,000	2,676.00	299,712,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,736,000	718.20	8,428,795,200
りそなホールディングス	2,121,500	512.80	1,087,905,200
三井住友トラスト・ホールディングス	331,600	4,288.00	1,421,900,800
三井住友フィナンシャルグループ	1,301,100	4,198.00	5,462,017,800
千葉銀行	566,200	734.00	415,590,800
群馬銀行	322,600	379.00	122,265,400
武蔵野銀行	25,600	1,687.00	43,187,200
千葉興業銀行	43,200	261.00	11,275,200
筑波銀行	78,200	191.00	14,936,200
七十七銀行	53,200	1,758.00	93,525,600
秋田銀行	12,000	1,636.00	19,632,000
山形銀行	18,500	926.00	17,131,000
岩手銀行	12,300	1,808.00	22,238,400
東邦銀行	143,400	202.00	28,966,800
東北銀行	9,000	972.00	8,748,000
ふくおかフィナンシャルグループ	144,800	2,445.00	354,036,000
静岡銀行	413,200	812.00	335,518,400
スルガ銀行	175,800	372.00	65,397,600
八十二銀行	372,000	471.00	175,212,000
山梨中央銀行	20,200	1,143.00	23,088,600
大垣共立銀行	34,300	1,718.00	58,927,400
福井銀行	16,000	1,377.00	22,032,000
清水銀行	7,200	1,456.00	10,483,200
富山銀行	3,100	1,755.00	5,440,500
滋賀銀行	32,700	2,433.00	79,559,100
南都銀行	27,100	1,948.00	52,790,800
百五銀行	168,400	316.00	53,214,400
京都銀行	62,200	5,390.00	335,258,000
紀陽銀行	59,500	1,468.00	87,346,000
ほくほくフィナンシャルグループ	113,800	817.00	92,974,600
山陰合同銀行	111,500	679.00	75,708,500
中国銀行	141,100	917.00	129,388,700
鳥取銀行	6,400	1,119.00	7,161,600
伊予銀行	224,800	630.00	141,624,000
百十四銀行	18,500	1,657.00	30,654,500

四国銀行	26,400	835.00	22,044,000
阿波銀行	26,600	1,860.00	49,476,000
大分銀行	10,800	1,862.00	20,109,600
宮崎銀行	10,900	2,180.00	23,762,000
佐賀銀行	10,500	1,514.00	15,897,000
琉球銀行	43,500	771.00	33,538,500
セブン銀行	595,500	262.00	156,021,000
みずほフィナンシャルグループ	2,404,000	1,591.00	3,824,764,000
高知銀行	6,300	665.00	4,189,500
山口フィナンシャルグループ	200,200	758.00	151,751,600
長野銀行	6,100	1,224.00	7,466,400
名古屋銀行	12,300	3,025.00	37,207,500
北洋銀行	251,900	224.00	56,425,600
愛知銀行	6,200	5,650.00	35,030,000
中京銀行	6,200	1,835.00	11,377,000
大光銀行	6,000	1,305.00	7,830,000
愛媛銀行	26,100	849.00	22,158,900
トマト銀行	6,100	1,021.00	6,228,100
京葉銀行	83,600	482.00	40,295,200
栃木銀行	89,900	280.00	25,172,000
北日本銀行	5,800	1,676.00	9,720,800
東和銀行	32,900	529.00	17,404,100
福島銀行	21,200	213.00	4,515,600
大東銀行	8,800	622.00	5,473,600
トモニホールディングス	144,700	311.00	45,001,700
フィデアホールディングス	18,300	1,307.00	23,918,100
池田泉州ホールディングス	212,800	214.00	45,539,200
F P G	67,700	1,290.00	87,333,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,800	1,337.00	18,450,600
マーキュリアホールディングス	11,200	643.00	7,201,600
S B Iホールディングス	247,800	2,686.00	665,590,800
ジャフコ グループ	69,500	2,147.00	149,216,500
大和証券グループ本社	1,288,100	610.60	786,513,860
野村ホールディングス	3,061,800	497.30	1,522,633,140
岡三証券グループ	145,300	329.00	47,803,700
丸三証券	60,100	471.00	28,307,100
東洋証券	61,600	247.00	15,215,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	198,000	375.00	74,250,000
光世証券	4,800	447.00	2,145,600
水戸証券	50,000	261.00	13,050,000
いちよし証券	33,600	629.00	21,134,400
松井証券	98,500	792.00	78,012,000

マネックスグループ	169,300	484.00	81,941,200
極東証券	23,100	684.00	15,800,400
岩井コスモホールディングス	19,100	1,250.00	23,875,000
アイザワ証券グループ	27,400	654.00	17,919,600
マネーパートナーズグループ	22,400	244.00	5,465,600
スパークス・グループ	93,400	300.00	28,020,000
かんぽ生命保険	201,800	2,123.00	428,421,400
S O M P Oホールディングス	285,300	5,901.00	1,683,555,300
アニコム ホールディングス	61,600	642.00	39,547,200
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	412,200	4,115.00	1,696,203,000
第一生命ホールディングス	976,400	2,345.50	2,290,146,200
東京海上ホールディングス	557,900	7,649.00	4,267,377,100
T & Dホールディングス	446,100	1,494.00	666,473,400
アドバンスクリエイト	9,600	1,065.00	10,224,000
全国保証	48,000	4,630.00	222,240,000
あんしん保証	10,500	265.00	2,782,500
イントラスト	9,500	622.00	5,909,000
日本モーゲージサービス	11,800	933.00	11,009,400
C a s a	7,800	840.00	6,552,000
アルヒ	30,200	1,034.00	31,226,800
プレミアグループ	30,900	1,737.00	53,673,300
ネットプロテクションズホールディングス	62,200	513.00	31,908,600
クレディセゾン	117,400	1,720.00	201,928,000
芙蓉総合リース	17,300	8,050.00	139,265,000
みずほリース	24,900	3,275.00	81,547,500
東京センチュリー	31,200	4,720.00	147,264,000
日本証券金融	79,600	823.00	65,510,800
アイフル	338,200	387.00	130,883,400
リコーリース	17,900	3,550.00	63,545,000
イオンフィナンシャルサービス	109,500	1,437.00	157,351,500
アコム	397,500	323.00	128,392,500
ジャックス	20,100	3,765.00	75,676,500
オリエントコーポレーション	547,900	118.00	64,652,200
オリックス	1,191,500	2,255.50	2,687,428,250
三菱H C キャピタル	649,100	666.00	432,300,600
九州リースサービス	9,700	605.00	5,868,500
日本取引所グループ	467,400	2,057.50	961,675,500
イー・ギャランティ	30,100	2,221.00	66,852,100
アサックス	11,500	591.00	6,796,500
N E C キャピタルソリューション	8,500	2,126.00	18,071,000
いちご	230,100	298.00	68,569,800
日本駐車場開発	210,900	159.00	33,533,100

スター・マイカ・ホールディングス	9,800	1,533.00	15,023,400
S R Eホールディングス	5,800	2,944.00	17,075,200
A Dワークスグループ	44,700	157.00	7,017,900
ヒューリック	389,700	1,053.00	410,354,100
三栄建築設計	9,300	1,615.00	15,019,500
野村不動産ホールディングス	104,400	3,370.00	351,828,000
三重交通グループホールディングス	44,900	482.00	21,641,800
サムティ	27,400	2,191.00	60,033,400
ディア・ライフ	28,100	638.00	17,927,800
地主	13,700	1,982.00	27,153,400
プレサンスコーポレーション	23,200	1,473.00	34,173,600
ハウスコム	5,600	948.00	5,308,800
J P M C	10,500	995.00	10,447,500
サンセイランディック	7,900	816.00	6,446,400
フージャースホールディングス	25,600	800.00	20,480,000
オープンハウスグループ	64,200	5,260.00	337,692,000
東急不動産ホールディングス	548,000	737.00	403,876,000
飯田グループホールディングス	164,800	2,126.00	350,364,800
イーランド	4,200	1,622.00	6,812,400
ムゲンエステート	16,700	475.00	7,932,500
A n d D oホールディングス	9,900	856.00	8,474,400
シーアールイー	8,800	1,711.00	15,056,800
ケイアイスター不動産	9,400	4,810.00	45,214,000
グッドコムアセット	9,200	1,365.00	12,558,000
ジェイ・エス・ビー	4,700	3,470.00	16,309,000
ロードスターキャピタル	8,200	1,825.00	14,965,000
テンポイノベーション	7,900	906.00	7,157,400
フェイスネットワーク	4,000	1,387.00	5,548,000
パーク24	130,600	1,954.00	255,192,400
パラカ	6,900	1,920.00	13,248,000
三井不動産	783,100	2,806.50	2,197,770,150
三菱地所	1,142,800	1,872.00	2,139,321,600
平和不動産	32,400	3,935.00	127,494,000
東京建物	159,400	2,063.00	328,842,200
京阪神ビルディング	27,900	1,244.00	34,707,600
住友不動産	361,200	3,336.00	1,204,963,200
テ-オーシー	32,900	709.00	23,326,100
東京楽天地	3,400	4,025.00	13,685,000
スターツコーポレーション	28,000	2,639.00	73,892,000
フジ住宅	26,400	652.00	17,212,800
空港施設	23,800	556.00	13,232,800
明和地所	12,800	617.00	7,897,600

ゴールドクレスト	17,000	1,707.00	29,019,000
エスリード	9,000	1,719.00	15,471,000
日神グループホールディングス	37,400	428.00	16,007,200
日本エスコン	37,300	782.00	29,168,600
タカラレーベン	84,000	377.00	31,668,000
A V A N T I A	12,000	799.00	9,588,000
イオンモール	101,800	1,639.00	166,850,200
毎日コムネット	10,200	625.00	6,375,000
ファースト住建	9,300	1,092.00	10,155,600
カチタス	50,300	3,290.00	165,487,000
トーセイ	29,200	1,382.00	40,354,400
穴吹興産	5,400	2,053.00	11,086,200
サンフロンティア不動産	29,400	1,162.00	34,162,800
F Jネクストホールディングス	21,700	1,015.00	22,025,500
インテリックス	4,500	553.00	2,488,500
ランドビジネス	6,800	234.00	1,591,200
サンネクスタグループ	8,200	953.00	7,814,600
グランディハウス	17,400	543.00	9,448,200
日本空港ビルデング	65,000	5,470.00	355,550,000
明豊ファシリティワークス	9,400	665.00	6,251,000
日本工営	12,500	3,565.00	44,562,500
L I F U L L	61,400	173.00	10,622,200
ミクシィ	44,600	2,327.00	103,784,200
ジェイエシーリクルートメント	15,900	1,952.00	31,036,800
日本M & Aセンターホールディングス	318,800	1,659.00	528,889,200
メンバーズ	5,200	2,675.00	13,910,000
中広	4,000	407.00	1,628,000
UTグループ	28,200	2,729.00	76,957,800
アイティメディア	9,400	1,774.00	16,675,600
E・Jホールディングス	11,400	1,310.00	14,934,000
夢真ビーネックスグループ	63,600	1,644.00	104,558,400
コシダカホールディングス	52,400	820.00	42,968,000
アルトナー	5,100	962.00	4,906,200
パソナグループ	21,200	2,038.00	43,205,600
C D S	5,000	1,757.00	8,785,000
リンクアンドモチベーション	50,000	643.00	32,150,000
エス・エム・エス	66,100	2,996.00	198,035,600
サニーサイドアップグループ	7,300	612.00	4,467,600
パーソルホールディングス	194,300	2,785.00	541,125,500
リニカル	11,400	731.00	8,333,400
クックパッド	49,200	212.00	10,430,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	10,100	598.00	6,039,800

学情	8,200	1,154.00	9,462,800
スタジオアリス	8,800	2,154.00	18,955,200
シミックホールディングス	9,800	1,626.00	15,934,800
エプロ	4,700	645.00	3,031,500
N J S	4,000	1,950.00	7,800,000
総合警備保障	70,900	3,595.00	254,885,500
カカクコム	142,700	2,529.00	360,888,300
アイロムグループ	7,100	2,470.00	17,537,000
セントケア・ホールディング	13,000	845.00	10,985,000
サイネックス	3,900	598.00	2,332,200
ルネサンス	13,900	940.00	13,066,000
ディップ	34,300	3,405.00	116,791,500
デジタルホールディングス	13,800	1,279.00	17,650,200
新日本科学	23,800	2,280.00	54,264,000
キャリアデザインセンター	4,200	1,594.00	6,694,800
ベネフィット・ワン	70,500	2,018.00	142,269,000
エムスリー	342,900	4,350.00	1,491,615,000
ツカダ・グローバルホールディング	12,400	341.00	4,228,400
アウトソーシング	103,700	1,186.00	122,988,200
ウェルネット	17,900	550.00	9,845,000
ワールドホールディングス	7,900	2,635.00	20,816,500
ディー・エヌ・エー	74,200	1,887.00	140,015,400
博報堂D Yホールディングス	246,200	1,257.00	309,473,400
ぐるなび	29,200	440.00	12,848,000
タカミヤ	24,400	412.00	10,052,800
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	713.00	7,771,700
ファンコミュニケーションズ	34,900	410.00	14,309,000
ライク	6,600	2,200.00	14,520,000
ビジネス・ブレークスルー	8,100	406.00	3,288,600
エスプール	50,200	1,029.00	51,655,800
W D Bホールディングス	9,000	2,539.00	22,851,000
ティア	12,200	436.00	5,319,200
C D G	2,400	1,273.00	3,055,200
アドウェイズ	24,400	759.00	18,519,600
バリューコマース	13,200	2,470.00	32,604,000
インフォマート	181,000	409.00	74,029,000
J Pホールディングス	51,400	261.00	13,415,400
エコナックホールディングス	37,500	88.00	3,300,000
C Lホールディングス	5,200	866.00	4,503,200
プレステージ・インターナショナル	73,400	653.00	47,930,200
アミューズ	10,800	1,930.00	20,844,000
ドリームインキュベータ	6,100	1,949.00	11,888,900



クイック	12,300	1,775.00	21,832,500
T A C	12,200	209.00	2,549,800
電通グループ	182,100	4,380.00	797,598,000
イオンファンタジー	7,600	3,390.00	25,764,000
シーティーエス	22,400	750.00	16,800,000
ネクシィーズグループ	6,600	572.00	3,775,200
H . U . グループホールディングス	50,900	2,760.00	140,484,000
アルプス技研	15,300	1,822.00	27,876,600
ダイオーズ	4,100	1,499.00	6,145,900
日本空調サービス	20,800	753.00	15,662,400
オリエンタルランド	206,600	20,200.00	4,173,320,000
ダスキン	42,000	2,829.00	118,818,000
明光ネットワークジャパン	23,400	590.00	13,806,000
ファルコホールディングス	8,700	1,794.00	15,607,800
ラウンドワン	54,400	1,975.00	107,440,000
リゾートトラスト	82,400	2,167.00	178,560,800
ビー・エム・エル	24,800	3,475.00	86,180,000
りらいあコミュニケーションズ	29,000	1,000.00	29,000,000
リソー教育	89,900	307.00	27,599,300
早稲田アカデミー	11,100	1,104.00	12,254,400
ユー・エス・エス	217,600	2,411.00	524,633,600
東京個別指導学院	17,800	548.00	9,754,400
サイバーエージェント	415,400	1,340.00	556,636,000
楽天グループ	802,300	673.00	539,947,900
クリーク・アンド・リバー社	10,300	2,283.00	23,514,900
モーニングスター	34,700	487.00	16,898,900
テー・オー・ダブリュー	38,300	307.00	11,758,100
山田コンサルティンググループ	10,300	1,242.00	12,792,600
セントラルスポーツ	7,400	2,469.00	18,270,600
フルキャストホールディングス	16,700	2,441.00	40,764,700
エン・ジャパン	34,700	2,337.00	81,093,900
リソルホールディングス	2,200	4,325.00	9,515,000
テクノプロ・ホールディングス	116,400	3,050.00	355,020,000
アトラグループ	4,300	188.00	808,400
インターワークス	6,500	393.00	2,554,500
アイ・アールジャパンホールディングス	9,200	2,383.00	21,923,600
K e e P e r 技研	12,600	3,840.00	48,384,000
ファーストロジック	3,500	782.00	2,737,000
三機サービス	3,800	957.00	3,636,600
G u n o s y	11,200	765.00	8,568,000
デザインワン・ジャパン	7,800	179.00	1,396,200
イー・ガーディアン	6,700	2,921.00	19,570,700

リブセンス	10,200	278.00	2,835,600	
ジャパンマテリアル	59,900	1,881.00	112,671,900	
ベクトル	27,600	1,141.00	31,491,600	
ウチヤマホールディングス	10,800	300.00	3,240,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	14,800	1,173.00	17,360,400	
キャリアリンク	7,300	2,239.00	16,344,700	
I B J	11,000	899.00	9,889,000	
アサンテ	8,800	1,612.00	14,185,600	
バリューHR	15,400	1,490.00	22,946,000	
M & A キャピタルパートナーズ	16,100	3,405.00	54,820,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,800	1,125.00	8,775,000	
E R I ホールディングス	5,800	1,014.00	5,881,200	
アビスト	3,100	2,998.00	9,293,800	
シグマクシス・ホールディングス	23,700	1,195.00	28,321,500	
ウィルグループ	14,700	1,310.00	19,257,000	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	22,500	161.00	3,622,500	
メドピア	13,900	1,542.00	21,433,800	
レアジョブ	4,200	709.00	2,977,800	
リクルートホールディングス	1,391,600	4,688.00	6,523,820,800	
エラン	23,300	1,064.00	24,791,200	
土木管理総合試験所	9,200	317.00	2,916,400	
ネットマーケティング	9,900	897.00	8,880,300	
日本郵政	2,122,700	965.90	2,050,315,930	
ベルシステム24ホールディングス	28,200	1,417.00	39,959,400	
鎌倉新書	22,700	646.00	14,664,200	
S M N	5,100	542.00	2,764,200	
グローバルキッズCOMPANY	3,500	670.00	2,345,000	
エアトリ	11,300	2,636.00	29,786,800	
アトラエ	13,800	1,550.00	21,390,000	
ストライク	8,600	3,980.00	34,228,000	
ソラスト	48,200	856.00	41,259,200	
セラク	6,500	1,058.00	6,877,000	
インソース	21,700	2,741.00	59,479,700	
ベイカレント・コンサルティング	13,700	40,250.00	551,425,000	
Orchestra Holdings	3,800	2,635.00	10,013,000	
アイモバイル	9,900	1,429.00	14,147,100	
キャリアインデックス	7,400	426.00	3,152,400	
MS - Japan	8,400	795.00	6,678,000	
船場	3,800	734.00	2,789,200	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	61,800	1,831.00	113,155,800	
フルテック	3,000	1,209.00	3,627,000	
GameWith	6,700	394.00	2,639,800	

MS&Consulting	3,400	622.00	2,114,800
ウェルビー	13,200	756.00	9,979,200
エル・ティー・エス	2,300	3,095.00	7,118,500
ミダックホールディングス	8,900	3,140.00	27,946,000
日総工産	15,800	546.00	8,626,800
キュービーネットホールディングス	9,300	1,365.00	12,694,500
RPAホールディングス	28,500	308.00	8,778,000
スプリックス	7,000	995.00	6,965,000
マネジメントソリューションズ	9,700	2,719.00	26,374,300
プロレド・パートナーズ	4,900	534.00	2,616,600
テノ・ホールディングス	3,000	591.00	1,773,000
フロンティア・マネジメント	6,000	1,286.00	7,716,000
ピアラ	3,600	738.00	2,656,800
コプロ・ホールディングス	4,200	899.00	3,775,800
ギークス	3,700	886.00	3,278,200
カーブスホールディングス	53,800	774.00	41,641,200
フォーラムエンジニアリング	12,200	935.00	11,407,000
Fast Fitness Japan	3,800	1,455.00	5,529,000
ダイレクトマーケティングミックス	19,900	1,835.00	36,516,500
ポピンズ	2,800	1,756.00	4,916,800
LITALICO	15,900	2,811.00	44,694,900
アドバンテッジリスクマネジメント	10,500	469.00	4,924,500
リログループ	106,400	2,224.00	236,633,600
東祥	14,800	1,067.00	15,791,600
ビーウィズ	5,400	1,383.00	7,468,200
TREホールディングス	36,700	1,672.00	61,362,400
人・夢・技術グループ	7,900	2,702.00	21,345,800
エイチ・アイ・エス	45,500	1,989.00	90,499,500
ラックランド	5,500	2,912.00	16,016,000
共立メンテナンス	34,700	5,450.00	189,115,000
イチネンホールディングス	20,200	1,250.00	25,250,000
建設技術研究所	9,100	2,790.00	25,389,000
スペース	13,000	852.00	11,076,000
燦ホールディングス	8,700	1,792.00	15,590,400
スバル興業	1,200	8,850.00	10,620,000
東京テアトル	7,100	1,211.00	8,598,100
タナベ経営	8,000	626.00	5,008,000
ナガワ	5,500	7,770.00	42,735,000
東京都競馬	14,600	4,105.00	59,933,000
カナモト	32,000	2,045.00	65,440,000
西尾レントオール	16,300	2,832.00	46,161,600
トランス・コスモス	24,700	3,720.00	91,884,000

乃村工藝社	83,600	946.00	79,085,600	
藤田観光	7,700	2,615.00	20,135,500	
KNT-CTホールディングス	12,100	1,620.00	19,602,000	
日本管財	20,900	2,615.00	54,653,500	
トーカイ	15,600	1,801.00	28,095,600	
セコム	191,500	8,777.00	1,680,795,500	
セントラル警備保障	9,500	2,393.00	22,733,500	
丹青社	37,100	790.00	29,309,000	
メイテック	69,300	2,396.00	166,042,800	
応用地質	17,000	1,859.00	31,603,000	
船井総研ホールディングス	36,600	2,340.00	85,644,000	
進学会ホールディングス	7,500	317.00	2,377,500	
オオバ	12,700	709.00	9,004,300	
いであ	4,500	1,710.00	7,695,000	
学究社	6,500	1,629.00	10,588,500	
ベネッセホールディングス	64,900	2,115.00	137,263,500	
イオンディライト	22,500	2,820.00	63,450,000	
ナック	9,600	936.00	8,985,600	
ダイセキ	35,500	4,165.00	147,857,500	
ステップ	7,300	1,801.00	13,147,300	
合 計	205,922,354		501,538,974,460	

## (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

	2022年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,766,757,523

	2022年 9月 5日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	4,345,211,870
国債証券	316,027,530,942
派生商品評価勘定	63,176,074
未収入金	4,248,379,242
未収利息	1,640,544,567
前払金	40,583,468
前払費用	76,276,112
差入委託証拠金	600,820,015
流動資産合計	328,809,279,813
資産合計	328,809,279,813
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,692,319
未払金	7,209,692,793
未払解約金	297,294,587
未払利息	8,209
流動負債合計	7,551,687,908
負債合計	7,551,687,908
純資産の部	
元本等	
元本	101,538,827,807
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	219,718,764,098
元本等合計	321,257,591,905
純資産合計	321,257,591,905
負債純資産合計	328,809,279,813

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 9月 5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>

2022年 9月 5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) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2022年 9月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	101,538,827,807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 3.1639円 (1万口当たり純資産額) (31,639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

2022年 9月 5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。

	2022年 9月 5日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月 5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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

### ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

### ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 9月 7日
期首元本額	96,959,233,542円
期中追加設定元本額	18,574,018,751円
期中一部解約元本額	13,994,424,486円
期末元本額	101,538,827,807円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,289,514,926円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	558,469,017円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,197,211,256円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,432,049円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,319,660,862円
世界経済インデックスファンド	14,766,049,237円
D C マイセレクション 2 5	1,951,479,270円
D C マイセレクション 5 0	1,688,876,583円
D C マイセレクション 7 5	1,159,771,370円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,307,309,481円
D C マイセレクション S 2 5	969,596,020円
D C マイセレクション S 5 0	770,192,552円
D C マイセレクション S 7 5	436,807,689円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	25,366,590円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	92,468,260円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	48,040,607円
D C 世界経済インデックスファンド	13,220,436,505円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	597,251,967円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,727,388円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,321,326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）	21,640,654円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	41,727,707円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	64,141,912円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	74,070,750円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	68,824,167円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,198,005,296円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	421,845,972円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,692,028,194円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	69,439,666円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	37,766,271円



区分	2022年 9月 5日現在
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	421,404,926円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	161,779,927円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	206,267,859円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	735,049,745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）	2,744,354,613円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	688,811,698円
外国債券ファンド・シリーズ1	700,749,090円
コア投資戦略ファンド（安定型）	511,218,449円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,348,562,464円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	578,377,417円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,195,847,782円
コア投資戦略ファンド（切替型）	617,085,545円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	252,439,042円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,460,833円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,311,549,590円
SMT インデックスバランス・オープン	198,264,600円
外国債券SMT Bセクション（SMA専用）	15,647,914,046円
SMT 世界経済インデックス・オープン	271,866,988円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	340,775,826円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	542,532,678円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,464,738円
グローバル経済コア	852,315,138円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	17,432,990円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,770,749円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	199,453,093円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,400,351円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	18,648,266円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	20,809,215円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	8,801,934円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,253,566円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	24,948,678円
10資産分散投資ファンド	7,886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）	260,134,065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）	11,064,792,921円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	331,566,812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）	289,447,457円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	362,281,983円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	997,961,657円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	89,742,019円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	73,459,264円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 9月 5日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		12,356,500,031
合計		12,356,500,031

(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

（2022年 9月 5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	3,054,323,062	-		3,013,739,594	40,583,468
	合計	3,054,323,062	-		3,013,739,594	40,583,468

## (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

（2022年 9月 5日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	4,885,948,050	-		4,943,032,967	57,084,917
	アメリカドル	3,421,075,962	-		3,468,619,561	47,543,599
	カナダドル	124,280,423	-		125,835,200	1,554,777
	メキシコペソ	30,779,334	-		31,388,265	608,931
	ユーロ	878,801,189	-		887,542,854	8,741,665
	イギリスポンド	247,354,532	-		245,875,375	1,479,157
	スウェーデンク ローナ	2,845,024	-		2,826,200	18,824

ノルウェークローネ	7,289,917	-	7,288,847	1,070
デンマーククローネ	21,562,687	-	21,464,774	97,913
ポーランドズロチ	26,752,497	-	26,625,397	127,100
オーストラリアドル	62,431,996	-	62,577,826	145,830
シンガポールドル	62,691,016	-	62,906,138	215,122
イスラエルシェケル	83,473	-	82,530	943
売建	641,357,096	-	639,374,790	1,982,306
アメリカドル	95,566,345	-	95,827,910	261,565
カナダドル	41,315,742	-	41,608,464	292,722
ユーロ	405,944,082	-	404,031,205	1,912,877
シンガポールドル	8,421,271	-	8,421,777	506
マレーシアリンギット	22,412,908	-	22,548,203	135,295
イスラエルシェケル	67,696,748	-	66,937,231	759,517
合計	5,527,305,146	-	5,582,407,757	59,067,223

## (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
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,566,796.90	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,493,910.33	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,793,012.50	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,715,156.24	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,118,286.14	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,391,132.78	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,483,984.40	

T 0.25% 05/31/25	10,900,000.00	9,996,917.99	
T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,514,492.21	
T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,478,335.92	
T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,743,578.11	
T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,600,390.64	
T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,808,300.80	
T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,258,562.50	
T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,599,531.25	
T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,214,375.04	
T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,668,320.33	
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,383,437.52	
T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,524,304.68	
T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,773,183.58	
T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,717,382.80	
T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,211,992.20	
T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,904,375.04	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,718,867.18	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,617,031.24	
T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,067,050.77	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,705,292.98	
T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,487,144.50	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,067,558.58	
T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,087,281.27	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,058,386.73	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,498,925.80	
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,640,429.72	
T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	9,885,000.00	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,190,625.04	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,790,597.71	
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,795,837.50	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,175,683.60	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,682,812.50	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,416,250.00	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,013,007.84	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,725,898.43	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,626,562.52	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,664,560.21	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,253,367.24	
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,254,353.69	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,277,500.00	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,428,593.78	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,304,152.39	

T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,448,578.10
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,772,511.79
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,038,808.61
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,120,000.00
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,153,582.03
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	4,877,312.50
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	8,986,395.31
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,602,812.50
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,138,437.52
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,265,011.76
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,130,000.00
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,449,433.57
T 1.25% 08/15/31	19,380,000.00	16,457,859.37
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,835,898.51
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,414,570.33
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,524,507.06
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,812,812.52
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,233,132.86
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,450,634.77
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,913,437.52
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,135,962.50
T 1.375% 11/15/31	21,030,000.00	17,972,435.26
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,179,843.78
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,360,042.98
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,544,609.36
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,733,532.06
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,974,707.05
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,180,917.99
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,443,875.00
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,723,925.80
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,621,593.75
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,129,898.43
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,828,550.83
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,068,144.56
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,449,951.17
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,610,234.36
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,649,953.12
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,455,856.25
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,455,781.28
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,331,000.00
T 1.75% 08/15/41	12,330,000.00	9,059,660.21
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,721,328.14
T 1.875% 02/15/32	8,020,000.00	7,153,464.10

T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,994,742.22	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,744,265.65	
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,756,093.76	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,904,752.72	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,826,679.68	
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,673,476.60	
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,125,000.00	
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,580,937.52	
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,005,869.14	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,256,769.52	
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,087,733.20	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,438,843.76	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,688,625.02	
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,875,585.95	
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,639,119.52	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,936,718.76	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,535,013.64	
T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,811,250.00	
T 2.25% 03/31/24	5,900,000.00	5,794,906.25	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,209,082.05	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,870,390.66	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,214,431.25	
T 2.25% 08/15/27	11,530,000.00	10,961,607.08	
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,242,012.50	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,344,570.34	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,151,851.59	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,906,955.10	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,240,328.13	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,253,455.05	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,433,906.25	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,261,414.07	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,509,570.34	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,674,275.01	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,620,929.71	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,509,914.05	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,187,695.31	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,554,431.25	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	6,613,597.68	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,903,710.95	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	3,331,570.33	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,425,811.73	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,893,359.40	

T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,398,058.60
T 2.5% 02/15/46	6,450,000.00	5,253,726.56
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,785,203.12
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,180,957.03
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,569,818.75
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,793,893.75
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,109,248.06
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,465,751.94
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,674,272.67
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,972,109.39
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,352,732.40
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,499,609.37
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,399,882.84
T 2.75% 08/15/42	5,800,000.00	5,041,921.90
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,475,089.86
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,489,687.50
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,764,964.86
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,302,690.61
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,401,212.50
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,621,093.75
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,942,656.24
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,078,500.00
T 2.875% 05/15/32	6,000,000.00	5,832,656.28
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,660,105.48
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	4,999,510.18
T 2.875% 05/15/52	4,800,000.00	4,361,250.00
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,763,446.08
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,375,967.21
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,817,865.61
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,010,882.82
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,723,281.25
T 2.875% 10/31/23	7,900,000.00	7,854,328.12
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,189,062.50
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	3,994,168.36
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,371,093.75
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,180,423.47
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,728,906.25
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,091,893.54
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,233,003.70
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,365,400.37
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,612,785.19
T 2% 08/15/51	17,350,000.00	12,845,777.43
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,663,888.30

T 2% 11/15/41	8,200,000.00	6,297,984.41	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	977,156.25	
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,839,687.50	
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,508,877.37	
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	3,786,806.25	
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,296,968.79	
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,631,191.41	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,873,139.06	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,182,820.33	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	783,595.31	
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,382,000.00	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,989,375.00	
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,044,843.76	
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,039,843.75	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,522,386.72	
T 3% 02/15/47	800,000.00	716,937.50	
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,023,078.12	
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,589,453.15	
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,473,946.87	
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,233,984.37	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,881,476.56	
T 3% 08/15/48	7,250,000.00	6,591,269.56	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,146,187.50	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,935,546.90	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,505,125.00	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,003,078.12	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,588,855.48	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,134,062.50	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,136,460.94	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,178,515.62	
T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,341,331.26	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,250,349.22	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	631,683.59	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,949,687.50	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,604,034.37	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	880,898.43	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,326,187.50	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,436,957.02	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,255,449.22	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,839,984.37	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,638,330.07	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,262,707.03	



	アメリカドル 小計	1,290,980,000.00	1,174,755,819.74 (164,876,979,300)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,049,697.20
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,279,544.00
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,274,482.40
	CAN 0.5% 12/01/30	4,940,000.00	4,010,786.00
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,249,404.00
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	661,549.00
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,362,945.60
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,738,381.60
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,164,604.00
	CAN 1.5% 04/01/25	2,710,000.00	2,576,722.20
	CAN 1.5% 05/01/24	1,590,000.00	1,536,941.70
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,276,006.40
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,487,922.90
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,153,560.00
	CAN 1.5% 12/01/31	4,320,000.00	3,771,057.60
	CAN 1.75% 12/01/53	2,520,000.00	1,871,503.20
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	734,313.60
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,401,372.90
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,255,587.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,240,307.20
	CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	722,425.60
	CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	483,576.90
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,306,631.90
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	827,341.20
	CAN 2.75% 09/01/27	760,000.00	744,853.20
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,563,441.00
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	708,304.80
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,233,849.70
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,173,525.90
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,403,290.60
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,769,413.00
CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,123,132.50	
CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,182,604.50	
CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,184,424.00	
CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,187,827.20	
CAN 5% 06/01/37	880,000.00	1,072,816.80	
	カナダドル 小計	68,070,000.00	62,784,147.30 (6,701,579,882)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,303,255.00
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,835,651.20
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,870,125.00

	MBONO 5.75% 03/05/26	52,610,000.00	47,162,234.50
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,687,332.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,631,819.50
	MBONO 7.75% 05/29/31	47,430,000.00	43,969,032.90
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	25,327,860.80
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	8,054,473.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,340,000.00	36,461,763.20
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	25,548,259.80
	MBONO 8% 07/31/53	3,700,000.00	3,359,415.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,446,930.40
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	25,835,196.00
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,408,948.20
	メキシコペソ 小計	392,870,000.00	369,902,297.00 (2,602,854,503)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,198,023.90
	BGB 0.2% 10/22/23	630,000.00	625,186.80
	BGB 0.35% 06/22/32	1,550,000.00	1,302,341.00
	BGB 0.4% 06/22/40	1,010,000.00	691,961.10
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,400,191.00
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	295,232.00
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,644,356.00
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,630,968.30
	BGB 0.8% 06/22/28	1,460,000.00	1,392,212.20
	BGB 0.9% 06/22/29	2,430,000.00	2,296,787.40
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	718,068.00
	BGB 0% 10/22/31	1,830,000.00	1,522,999.20
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,374,330.00
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	760,263.00
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	695,136.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	1,000,308.00
	BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,049,022.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	963,763.50
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,244,249.60
	BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,912,162.50
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	760,557.60
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	691,198.20
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,197,095.20
	BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,416,216.00
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,096,939.70
	BGB 4.25% 03/28/41	2,030,000.00	2,494,098.60
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,263,177.00
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,262,606.40

BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,357,322.60
BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	2,930,375.60
BKO 0.2% 06/14/24	500,000.00	493,335.00
BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,827,337.50
BKO 0% 09/15/23	2,470,000.00	2,456,785.50
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,863,568.80
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,438,953.60
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	554,126.20
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,734,722.10
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,780,502.00
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	1,959,842.40
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,438,508.80
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	662,589.80
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,073,487.50
BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	3,080,009.40
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	695,670.60
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	1,982,344.50
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,843,005.80
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,160,397.40
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,688,781.00
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	975,380.00
BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,590,130.20
BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,510,438.40
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,909,400.00
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,321,509.80
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,440,165.00
BTPS 0% 11/29/23	1,750,000.00	1,712,497.50
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,757,465.00
BTPS 1.1% 04/01/27	1,000,000.00	923,470.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,835,808.00
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,677,110.60
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,279,760.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,241,695.00
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,363,832.00
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	800,662.50
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,354,473.60
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,726,167.30
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,769,901.00
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,203,450.00
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,055,392.80
BTPS 1.75% 05/30/24	1,910,000.00	1,898,138.90
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	994,570.00
BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,630,544.80

BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,442,037.50	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,655,072.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,630,180.80	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,132,448.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	466,886.10	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	696,445.80	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,211,075.60	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,363,533.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,318,421.60	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,356,088.20	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,934,647.70	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,250,000.00	1,247,925.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,971,240.00	
BTPS 2.5% 12/01/32	250,000.00	222,732.50	
BTPS 2.65% 12/01/27	960,000.00	939,331.20	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	1,792,597.30	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	865,184.50	
BTPS 2.8% 06/15/29	1,820,000.00	1,761,851.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	2,720,000.00	2,667,993.60	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,580,000.00	1,401,365.20	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,147,158.20	
BTPS 2% 12/01/25	1,490,000.00	1,465,266.00	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,271,666.80	
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	880,857.60	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,970,000.00	1,771,857.40	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,724,723.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	1,954,512.80	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,008,114.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,218,520.50	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	1,821,126.00	
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,133,457.20	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,853,812.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,216,281.60	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,859,520.10	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,343,243.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,611,912.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,403,410.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,021,020.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,665,434.00	
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,900,022.80	
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,298,244.40	
BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,540,204.80	

BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,228,092.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,486,457.80
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,655,836.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	866,048.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,735,839.30
DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,880,200.40
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,471,884.40
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,039,775.20
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,939,190.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,529,120.00
DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,828,270.40
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,238,091.70
DBR 0% 02/15/31	3,280,000.00	2,918,904.80
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,189,982.80
DBR 0% 05/15/35	2,780,000.00	2,265,950.20
DBR 0% 05/15/36	2,730,000.00	2,181,379.20
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,159,557.00
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,195,640.00
DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,437,769.70
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	601,666.70
DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,851,499.50
DBR 0% 08/15/50	5,330,000.00	3,350,757.80
DBR 0% 08/15/52	1,790,000.00	1,085,921.40
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,772,928.00
DBR 0% 11/15/28	1,720,000.00	1,588,368.40
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,271,547.20
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,313,060.30
DBR 1.7% 08/15/32	1,550,000.00	1,575,714.50
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,673,347.50
DBR 1% 05/15/38	800,000.00	723,168.00
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,001,240.00
DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,633,120.40
DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,864,840.00
DBR 2.5% 08/15/46	3,610,000.00	4,216,335.60
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,828,532.00
DBR 4.0% 01/04/37	3,190,000.00	4,137,334.30
DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	2,953,390.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,036,259.50
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,031,626.30
DBR 4.75% 07/04/40	2,480,000.00	3,640,739.20
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,757,064.40
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,881,772.40
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,464,821.00

DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,676,900.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,335,843.60	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,442,068.80	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,465,454.80	
FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,463,476.60	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,950,000.00	5,493,992.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,304,812.10	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	434,679.30	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,321,907.40	
FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	2,045,961.50	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	5,981,223.90	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,980,000.00	2,489,251.20	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,660,000.00	1,622,999.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,530,122.00	
FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,785,398.00	
FRTR 0% 02/25/25	2,500,000.00	2,418,400.00	
FRTR 0% 02/25/26	4,460,000.00	4,250,959.80	
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,256,760.00	
FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,194,609.00	
FRTR 0% 03/25/25	5,490,000.00	5,307,896.70	
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,692,716.00	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,637,584.20	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,186,125.20	
FRTR 0% 11/25/31	5,790,000.00	4,837,255.50	
FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	3,922,772.30	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,454,276.40	
FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	5,997,054.90	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,838,756.60	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,402,301.80	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	3,026,213.20	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,206,800.00	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,531,099.50	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,218,224.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,180,770.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000.00	7,569,227.80	
FRTR 2.75% 10/25/27	6,580,000.00	6,954,928.40	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,188,158.00	
FRTR 2% 11/25/32	1,220,000.00	1,204,506.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	3,808,850.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	6,010,256.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,870,350.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	5,858,824.00	

FRTR 4.75% 04/25/35	3,540,000.00	4,478,631.00
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,145,516.00
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,698,925.60
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,067,792.20
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,388,569.00
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,789,516.60
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,170,028.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	872,358.60
IRISH 0.2% 10/18/30	960,000.00	838,051.20
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	394,156.10
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	483,010.20
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	355,390.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	736,689.80
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	708,220.00
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,148,640.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	614,825.50
IRISH 1.35% 03/18/31	790,000.00	757,831.20
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	626,912.00
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	753,998.20
IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,616,531.60
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,263,203.70
IRISH 2% 02/18/45	1,280,000.00	1,162,649.60
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,004,182.80
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,277,473.20
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,246,844.60
NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,431,745.80
NETHER 0.5% 01/15/40	1,780,000.00	1,386,620.00
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,245,458.40
NETHER 0.5% 07/15/32	900,000.00	791,784.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,509,066.00
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,625,557.00
NETHER 0% 01/15/24	1,630,000.00	1,609,494.60
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,138,318.30
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,729,268.80
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,254,419.40
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	703,756.80
NETHER 0% 01/15/52	1,610,000.00	892,133.20
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,186,272.00
NETHER 0% 07/15/31	1,770,000.00	1,522,713.30
NETHER 2.5% 01/15/33	1,970,000.00	2,085,048.00
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,657,667.90
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,025,700.60
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,857,432.50

NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,708,977.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,083,439.00	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,288,541.50	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,950,270.00	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,650,325.00	
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,040,050.00	
OBL 0% 10/09/26	3,900,000.00	3,713,034.00	
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,386,670.00	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,500,924.90	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,358,956.20	
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	448,692.00	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,810,000.00	1,664,874.20	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,039,707.40	
RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	224,611.20	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,148,882.90	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	515,642.40	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,020,844.80	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	146,995.20	
RAGB 0.9% 02/20/32	880,000.00	787,230.40	
RAGB 0% 02/20/30	1,690,000.00	1,465,432.80	
RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,384,766.80	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	898,445.10	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,410,840.00	
RAGB 0% 10/20/28	450,000.00	402,921.00	
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	431,379.50	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,066,586.70	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	864,932.20	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	185,595.30	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	998,682.30	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,342,728.10	
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	410,324.60	
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	673,895.70	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,094,925.60	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	940,273.80	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	554,038.80	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,218,998.60	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,533,728.70	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,441,429.00	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	330,444.40	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	247,645.60	
RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	458,298.00	
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	344,885.00	



RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	600,550.60
RFGB 0.5% 04/15/43	440,000.00	304,216.00
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	824,507.70
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	605,163.00
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	694,807.20
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	726,176.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	681,402.60
RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	564,824.40
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	410,676.00
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	282,570.00
RFGB 0% 09/15/30	520,000.00	447,538.00
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	498,853.60
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	346,479.00
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	406,312.90
RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	464,422.00
RFGB 2.625% 07/04/42	680,000.00	701,216.00
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	583,104.50
RFGB 2% 04/15/24	660,000.00	670,989.00
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	894,549.10
SPGB 0.1% 04/30/31	2,700,000.00	2,208,735.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,243,077.90
SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	2,975,442.00
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,148,031.70
SPGB 0.6% 10/31/29	2,050,000.00	1,831,183.00
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,845,294.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,311,290.00
SPGB 0.8% 07/30/29	740,000.00	671,853.40
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,082,867.40
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,201,134.80
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,567,027.20
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,434,950.40
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,730,959.10
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,065,436.80
SPGB 0% 05/31/25	990,000.00	947,043.90
SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	2,070,014.60
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,798,283.50
SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,174,392.50
SPGB 1.4% 04/30/28	3,070,000.00	2,967,799.70
SPGB 1.4% 07/30/28	3,030,000.00	2,916,072.00
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,573,388.50
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	2,963,726.40
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	353,027.40
SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,966,200.00

	SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,058,357.00
	SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,455,667.50
	SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	661,392.00
	SPGB 1.95% 04/30/26	3,600,000.00	3,626,712.00
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,664,348.60
	SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	618,149.50
	SPGB 1% 10/31/50	2,330,000.00	1,394,901.10
	SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,861,900.70
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,150,000.00	2,079,114.50
	SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,953,190.80
	SPGB 2.7% 10/31/48	2,160,000.00	1,987,480.80
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,140,890.00
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,121,042.00
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,780,017.80
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,625,008.40
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,918,304.40
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,792,838.70
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,093,441.60
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	2,773,612.80
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,840,000.00	1,935,293.60
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,558,815.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	4,098,132.50
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,314,530.60
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,662,687.60
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,386,551.20
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,294,818.00
	ユーロ 小計	776,660,000.00	756,248,366.30 (105,216,835,203)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,386,984.80
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,161,796.00
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	1,960,233.60
	UKT 0.25% 01/31/25	1,800,000.00	1,681,578.00
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,595,464.40
	UKT 0.375% 10/22/26	2,970,000.00	2,681,553.60
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,772,395.50
	UKT 0.5% 01/31/29	1,930,000.00	1,664,740.80
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	560,629.20
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,599,870.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,810,000.00	2,034,917.70
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	556,624.70
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	705,872.70
	UKT 0.875% 07/31/33	1,260,000.00	1,007,244.00

UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,488,758.00	
UKT 1.125% 01/31/39	1,370,000.00	985,838.30	
UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	270,197.20	
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	882,493.00	
UKT 1.25% 07/31/51	1,710,000.00	1,070,990.10	
UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	1,976,884.00	
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,521,552.00	
UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,645,893.90	
UKT 1.5% 07/31/53	420,000.00	278,426.40	
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	1,001,648.40	
UKT 1.625% 10/22/54	1,740,000.00	1,189,429.20	
UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	959,321.20	
UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	945,451.00	
UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,557,276.50	
UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,786,558.20	
UKT 1% 01/31/32	1,720,000.00	1,445,178.40	
UKT 1% 04/22/24	800,000.00	773,736.00	
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,478,400.00	
UKT 2.5% 07/22/65	2,000,000.00	1,741,880.00	
UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,680,029.00	
UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,735,660.20	
UKT 3.25% 01/22/44	2,230,000.00	2,187,563.10	
UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,334,265.70	
UKT 3.5% 07/22/68	2,130,000.00	2,364,342.60	
UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	1,752,304.00	
UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	1,819,760.40	
UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,340,282.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,813,136.40	
UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,461,050.20	
UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	1,967,350.00	
UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,203,564.80	
UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,764,238.70	
UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,318,453.50	
UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,787,570.60	
UKT 4.5% 12/07/42	2,050,000.00	2,396,327.00	
UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,669,407.80	
UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	1,949,937.00	
UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	1,833,955.20	
UKT 5% 03/07/25	2,300,000.00	2,410,216.00	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,476,637.50	
イギリスポンド 小計	96,360,000.00	88,635,868.50 (14,284,556,567)	
SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,559,606.30	

スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,989,737.90
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	6,943,784.40
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,413,250.00
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,196,270.80
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,710,398.70
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,347,337.00
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,604,896.60
スウェーデンクローナ 小計		62,720,000.00	61,765,281.70 (800,478,050)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,672,725.00
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,641,164.00
	NGB 1.5% 02/19/26	6,470,000.00	6,094,093.00
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,962,621.70
	NGB 1.75% 03/13/25	6,570,000.00	6,333,348.60
	NGB 1.75% 09/06/29	6,010,000.00	5,449,146.80
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	3,053,164.80
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,694,754.20
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,737,884.00
ノルウェークローネ 小計		50,240,000.00	46,638,902.10 (651,079,073)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,210,000.00	3,792,384.90
	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,358,471.00
	DGB 0.5% 11/15/29	8,280,000.00	7,601,371.20
	DGB 0% 11/15/24	3,840,000.00	3,733,324.80
	DGB 0% 11/15/31	8,390,000.00	7,081,915.10
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,601,189.00
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,568,295.80
	DGB 4.5% 11/15/39	13,320,000.00	18,112,669.20
デンマーククローネ 小計		61,950,000.00	61,849,621.00 (1,157,206,408)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,290,000.00	1,774,040.10
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,071,781.60
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,907,020.80
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,907,241.00
	POLGB 1.75% 04/25/32	1,810,000.00	1,256,339.10
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,597,482.70
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,337,390.50
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,574,486.50
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,260,000.00	3,559,783.80
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,811,082.50
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	5,048,338.60
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,474,188.40

	POLGB 3.75% 05/25/27	1,390,000.00	1,228,899.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,346,183.20	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	588,744.00	
	ポーランドズロチ 小計	54,640,000.00	46,483,001.80 (1,369,166,114)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,221,490.30	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,907,388.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,810,000.00	2,513,067.30	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,210,823.80	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,687,383.60	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,244,941.50	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,400,000.00	2,015,736.00	
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,874,931.80	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,925,594.80	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,391,570.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,620,000.00	3,367,034.40	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,374,562.80	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,374,497.50	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,075,044.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,872,524.60	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,596,090.00	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,341,897.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,562,304.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,168,188.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,030,904.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,602,990.00	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,435,240.80	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,726,343.20	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,198,884.20	
ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,482,510.80		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,460,267.20		
	オーストラリアドル 小計	56,700,000.00	51,662,209.60 (4,921,858,708)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	696,517.50	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	495,963.40	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	578,903.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	634,481.10	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	247,894.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,051,088.40	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	807,666.10	
	SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	928,757.60	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	391,171.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	598,928.50	

	SIGB 2.625% 08/01/32	350,000.00	336,980.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	719,454.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	600,774.30	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	645,079.50	
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,070,000.00	1,059,160.90	
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	672,615.20	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	853,646.70	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	756,775.80	
	SIGB 3% 08/01/72	280,000.00	282,018.80	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,595,088.00	
	シンガポールドル 小計	14,590,000.00	13,952,964.20 (1,395,296,420)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,800,000.00	1,622,736.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,927,276.80	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,494,945.30	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,596,470.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,830,000.00	1,690,316.10	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,708,758.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,628,650.80	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,389,371.80	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,491,405.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,137,910.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,985,957.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,141,178.80	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	606,060.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,170,575.20	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,299,494.40	
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,164,078.80	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,300,544.00	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,533,674.60	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,760,000.00	2,762,842.80	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,574,450.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,955,295.20	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,847,207.40	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,085,910.00	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,528,766.00	
MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,405,263.20		
MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,450,702.10		
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,773,928.80		
MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,095,250.50		
	マレーシアリンギット 小計	53,040,000.00	53,369,018.60 (1,668,854,548)	
	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,010,000.00	960,160.23	

イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,041,556.03	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,280,445.61	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	950,000.00	818,781.72	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,970,000.00	1,581,582.38	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,204,208.26	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,200,989.97	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,458,848.89	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,933,381.01	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,642,674.37	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	3,030,000.00	3,080,471.01	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,285,708.42	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,793,370.18	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	2,660,000.00	3,003,855.54	
	イスラエルシェケル 小計		29,490,000.00	29,286,033.62
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,389,226.40	
	CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,564,350.00	
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,747,724.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,752,832.00	
	CGB 2.48% 04/15/27	27,000,000.00	27,103,140.00	
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,681,693.60	
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,521,588.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,458,086.00	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,000,000.00	10,088,800.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,345,650.80	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,814,614.50	
	CGB 2.85% 06/04/27	21,430,000.00	21,869,315.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	18,510,000.00	18,794,683.80	
	CGB 2.91% 10/14/28	10,720,000.00	10,932,577.60	
	CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,229,263.40	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,249,602.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	48,010,362.40	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,154,962.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	19,110,000.00	19,924,468.20	
	CGB 3.39% 03/16/50	10,420,000.00	10,884,002.60	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	8,044,361.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,649,577.90	
	CGB 3.81% 09/14/50	13,260,000.00	14,894,162.40	
CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,515,716.20		
CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,790,163.90		
オフショア人民元 小計		441,700,000.00	452,410,923.70	(9,168,605,020)

合計		316,027,530,942 (316,027,530,942)	
----	--	--------------------------------------	--

## 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 219銘柄	100.0%	52.2%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 352銘柄	100.0%	33.3%
イギリスポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	4.5%
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 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 25銘柄	100.0%	2.9%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	



	2022年 9月 5日現在
項目	金額（円）
預金	10,155,681,149
コール・ローン	833,651,094
株式	525,748,856,241
投資信託受益証券	284,990,785
投資証券	13,160,910,434
派生商品評価勘定	112,434,934
未収入金	36,729,334
未収配当金	1,037,238,547
前払金	121,732,247
差入委託証拠金	3,120,783,905
流動資産合計	554,613,008,670
資産合計	554,613,008,670
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	233,256,134
未払金	286,192,169
未払解約金	91,395,370
未払利息	1,575
流動負債合計	610,845,248
負債合計	610,845,248
純資産の部	
元本等	
元本	128,253,256,319
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	425,748,907,103
元本等合計	554,002,163,422
純資産合計	554,002,163,422
負債純資産合計	554,613,008,670

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</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)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</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>(3) 投資証券</p>

2022年 9月 5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。</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>(1)先物取引</p> <p>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。</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)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)

2022年 9月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	128,253,256,319口

	2022年 9月 5日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.3196円 (43,196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

	2022年 9月 5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株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月 5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

	2022年 9月 5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	2022年 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 9月 7日
期首元本額	134,161,147,802円
期中追加設定元本額	17,175,686,854円
期中一部解約元本額	23,083,578,337円
期末元本額	128,253,256,319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）	1,875,792,839円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,546,621円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	32,619,632,680円
世界経済インデックスファンド	11,223,857,450円
外国株式インデックス・オープン	889,501,785円
D C マイセレクション 2 5	799,407,624円
D C マイセレクション 5 0	3,651,509,047円
D C マイセレクション 7 5	4,383,273,488円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,030,613,131円

区分	2022年 9月 5日現在
DCマイセレクションS25	408,795,926円
DCマイセレクションS50	1,869,192,529円
DCマイセレクションS75	1,602,793,875円
DCターゲット・イヤールファンド2025	35,748,108円
DCターゲット・イヤールファンド2035	150,367,077円
DCターゲット・イヤールファンド2045	112,102,642円
DC世界経済インデックスファンド	9,962,851,338円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,392,215,135円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,617,563円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	4,723,159円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	26,262,691円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	12,311,497円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	46,892,139円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	11,110,767円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	30,973,115円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	259,777,924円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	168,953,740円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,239,003,351円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	99,186,777円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	23,117,701円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	158,045,420円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	52,385,554円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	989,546,670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）	1,075,022,826円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,135,686,982円
コア投資戦略ファンド（安定型）	560,233,098円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,362,981,916円
分散投資コア戦略ファンドA	1,498,580,570円
分散投資コア戦略ファンドS	8,213,245,075円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,352,534,787円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,126,117,535円
コア投資戦略ファンド（切替型）	598,401,219円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	582,819,750円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,256,083円
SMT インデックスバランス・オープン	157,841,681円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	362,459,872円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	17,148,575,159円
SMT 世界経済インデックス・オープン	205,508,360円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	790,996,030円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	144,720,027円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,081,213円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	236,726,348円
グローバル経済コア	637,776,454円

区分	2022年 9月 5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）	13,939,508円
D C ターゲット・イヤー ファンド2 0 5 5	5,384,926円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	472,763,498円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	82,914,549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	50,448,530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	42,785,255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	16,046,605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	22,116,550円
1 0 資産分散投資ファンド	18,092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）	263,266,608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）	31,760,007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）	892,333,361円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,307,613,331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）	215,249,988円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	84,904,553円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	66,809,554円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	66,787,960円
S M T A M 海外バランスファンド2 0 2 0 - 0 1（適格機関投資家専用）	236,402,277円
S M T A M 海外バランスファンド2 0 2 0 - 0 8（適格機関投資家専用）	226,303,448円
S M T A M 海外バランスファンド2 0 2 0 - 1 1（適格機関投資家専用）	225,149,556円
S M T A M 海外バランスファンド2 0 2 1 - 0 4（適格機関投資家専用）	228,989,512円
S M T A M 海外バランスファンド2 0 2 1 - 0 7（適格機関投資家専用）	225,426,645円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2 0 2 1 - 1 1（適格機関投資家専用）	112,167,658円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	31,197,866,470
投資信託受益証券	22,671,558
投資証券	1,108,240,903
合計	32,328,778,931

(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

（2022年 9月 5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	14,715,786,135	-	14,594,053,888	121,732,247
	合計	14,715,786,135	-	14,594,053,888	121,732,247

## (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

(2022年 9月 5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	726,653,700	-	727,555,439	901,739
	アメリカドル	349,877,680	-	350,822,810	945,130
	カナダドル	34,086,400	-	34,150,400	64,000
	ユーロ	171,809,560	-	171,127,249	682,311
	スイスフラン	170,880,060	-	171,454,980	574,920
	売建	119,484,090	-	119,474,782	9,308
	アメリカドル	7,016,500	-	7,016,365	135
	イギリスポンド	46,730,600	-	46,730,397	203
	オーストラリアドル	65,736,990	-	65,728,020	8,970
	合計	846,137,790	-	847,030,221	911,047

## (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

				評価額
--	--	--	--	-----

通貨	銘柄	株式数 (株)	単価	金額	備考
アメリカドル	APA CORP	27,671	38.80	1,073,634.80	
	BAKER HUGHES CO	75,948	25.28	1,919,965.44	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	162.36	2,961,933.48	
	CHEVRON CORP	153,061	157.85	24,160,678.85	
	CONOCOPHILLIPS	105,873	110.26	11,673,556.98	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	30.11	1,927,040.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	70.34	3,535,007.04	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	133.87	1,776,053.29	
	EOG RESOURCES INC	47,936	121.52	5,825,182.72	
	EQT CORPORATION	27,026	47.28	1,277,789.28	
	EXXON MOBIL	343,717	95.59	32,855,908.03	
	HALLIBURTON CO	71,583	30.01	2,148,205.83	
	HESS CORP	22,781	120.91	2,754,450.71	
	KINDER MORGAN INC	168,208	18.22	3,064,749.76	
	MARATHON OIL CORP	57,281	25.71	1,472,694.51	
	MARATHON PETROLEUM CORP	45,012	99.13	4,462,039.56	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	77,357	68.77	5,319,840.89	
	ONEOK INC	35,533	60.55	2,151,523.15	
	PHILLIPS 66	38,237	88.46	3,382,445.02	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,998	241.76	4,592,956.48	
	SCHLUMBERGER	112,526	38.07	4,283,864.82	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	69.62	1,204,286.76	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,888.01	1,006,309.33	
	VALERO ENERGY CORP	32,597	113.82	3,710,190.54	
	WILLIAMS COS	98,553	33.72	3,323,207.16	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,324	246.53	4,517,415.72	
	ALBEMARLE CORP	9,440	259.88	2,453,267.20	
	ALCOA CORP	15,500	49.25	763,375.00	
	AMCOR PLC	126,534	12.02	1,520,938.68	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	185.48	1,231,216.24	
	BALL CORP	25,605	55.81	1,429,015.05	
	CELANESE CORP-SERIES A	8,582	106.88	917,244.16	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	106.86	1,766,075.22	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	16.81	722,830.00	
CORTEVA INC	58,500	61.24	3,582,540.00		
CROWN HOLDINGS INC	9,940	91.37	908,217.80		
DOW INC	60,585	49.31	2,987,446.35		
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	54.76	2,244,064.80		
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	89.52	991,434.00		
ECOLAB INC	21,208	161.64	3,428,061.12		
FMC CORP	10,507	106.44	1,118,365.08		



FREEMPORT-MCMORAN INC	119,600	28.30	3,384,680.00
INT'L PAPER CO	30,800	40.93	1,260,644.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,024	107.83	2,267,017.92
LINDE PLC	41,106	277.71	11,415,547.26
LYONDELLBASELL INDU-CL A	21,835	80.78	1,763,831.30
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,192	340.60	1,768,395.20
MOSAIC CO/THE	27,732	54.84	1,520,822.88
NEWMONT CORPORATION	65,704	41.67	2,737,885.68
NUCOR CORP	22,299	130.78	2,916,263.22
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	136.11	1,046,277.57
PPG INDUSTRIES INC	19,278	123.76	2,385,845.28
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	92.53	967,493.68
SEALED AIR CORP	11,690	52.86	617,933.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	231.81	4,571,061.39
STEEL DYNAMICS INC	15,552	77.94	1,212,122.88
VULCAN MATERIALS CO	10,247	164.95	1,690,242.65
WESTLAKE CORP	4,100	95.76	392,616.00
WESTROCK CO	21,356	39.64	846,551.84
3 M COMPANY	46,618	121.65	5,671,079.70
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	43.49	478,607.45
ALLEGION PLC	7,601	94.89	721,258.89
AMETEK INC	19,255	117.83	2,268,816.65
BOEING CO	46,285	151.82	7,026,988.70
CARLISLE COS INC	4,378	295.96	1,295,712.88
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	39.58	2,697,693.64
CATERPILLAR	43,701	180.83	7,902,451.83
CUMMINS INC	11,214	212.87	2,387,124.18
DEERE&CO	23,765	362.22	8,608,158.30
DOVER CORP	12,041	127.97	1,540,886.77
EATON CORP	32,650	137.30	4,482,845.00
EMERSON ELECTRIC CO	48,687	81.75	3,980,162.25
FASTENAL CO	47,949	50.47	2,419,986.03
FORTIVE CORP	28,348	62.57	1,773,734.36
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	60.56	624,373.60
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	223.39	1,164,085.29
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	224.88	4,265,973.60
GENERAL ELECTRIC CO	89,763	72.43	6,501,534.09
GRAINGER (WW) INC	3,667	555.31	2,036,321.77
HEICO CORP	3,640	152.22	554,080.80
HEICO CORP-CLASS A	6,449	122.35	789,035.15
HONEYWELL INTL INC	55,841	186.89	10,436,124.49
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	35.02	1,106,421.88

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	226.80	798,789.60
IDEX CORP	5,916	200.02	1,183,318.32
ILLINOIS TOOL WORKS	25,708	195.40	5,023,343.20
INGERSOLL-RAND INC	31,562	47.74	1,506,769.88
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	54.63	693,801.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	54.89	3,111,659.21
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	227.20	3,563,404.80
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	245.90	621,143.40
LOCKHEED MARTIN CORP	19,579	418.57	8,195,182.03
MASCO CORP	19,462	49.86	970,375.32
NORDSON CORP	4,121	223.74	922,032.54
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,122	476.95	5,781,587.90
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	71.72	2,428,295.76
OWENS CORNING	8,642	80.92	699,310.64
PACCAR INC	28,106	86.47	2,430,325.82
PARKER HANNIFIN CORP	10,579	264.87	2,802,059.73
PENTAIR PLC	14,533	43.91	638,144.03
PLUG POWER INC	41,884	25.87	1,083,539.08
QUANTA SERVICES INC	11,465	140.60	1,611,979.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	121,485	87.59	10,640,871.15
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	238.01	2,165,414.98
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	39.82	550,630.96
SMITH (A.O.) CORP	9,016	56.27	507,330.32
SNAP-ON INC	4,000	213.41	853,640.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	85.77	1,080,530.46
TEXTRON	16,934	61.85	1,047,367.90
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	155.43	2,896,904.34
TRANSDIGM GROUP INC	4,347	601.20	2,613,416.40
UNITED RENTALS INC	6,022	289.71	1,744,633.62
WABTEC CORP	15,024	86.39	1,297,923.36
XYLEM INC	15,077	91.21	1,375,173.17
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	95.13	1,081,057.32
CINTAS CORP	7,423	405.79	3,012,179.17
CLARIVATE PLC	27,357	11.50	314,605.50
COPART INC	16,617	116.40	1,934,218.80
COSTAR GROUP INC	32,116	70.89	2,276,703.24
EQUIFAX INC	9,509	187.50	1,782,937.50
JACOBS SOLUTIONS INC	10,661	118.80	1,266,526.80
LEIDOS HOLDINGS	11,220	93.71	1,051,426.20
REPUBLIC SERVICES INC	18,296	142.79	2,612,485.84
ROBERT HALF INTL INC	9,566	76.06	727,589.96
ROLLINS INC	17,468	33.74	589,370.32

TRANSUNION	15,741	73.80	1,161,685.80
VERISK ANALYTICS INC	13,315	184.77	2,460,212.55
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	140.55	2,990,201.25
WASTE MANAGEMENT INC	33,891	168.45	5,708,938.95
AMERCO	734	521.43	382,729.62
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	115.36	1,185,554.72
CSX CORP	179,261	31.24	5,600,113.64
DELTA AIR LINES INC	14,609	30.94	452,002.46
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	101.68	1,451,176.96
FEDEX CORP	20,314	208.72	4,239,938.08
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	2.96	245,712.56
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	168.74	1,189,954.48
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,697	50.30	688,959.10
LYFT INC-A	21,288	14.60	310,804.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	239.26	4,566,755.62
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	272.23	2,178,656.69
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	36.74	497,202.42
UBER TECHNOLOGIES INC	120,334	29.05	3,495,702.70
UNION PACIFIC CORP	51,838	223.94	11,608,601.72
UNITED PARCEL SERVICE B	59,627	196.05	11,689,873.35
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	34.33	246,317.75
APTIV PLC	22,415	91.31	2,046,713.65
BORGWARNER INC	19,781	37.02	732,292.62
FORD MOTOR COMPANY	321,972	15.16	4,881,095.52
GENERAL MOTORS CO	114,534	38.47	4,406,122.98
LEAR CORP	5,287	136.56	721,992.72
LUCID GROUP INC	31,234	15.16	473,507.44
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	26,935	32.07	863,805.45
TESLA INC	216,377	270.21	58,467,229.17
DR HORTON INC	27,764	71.38	1,981,794.32
GARMIN LTD	12,854	88.51	1,137,707.54
HASBRO INC	10,572	78.71	832,122.12
LENNAR CORP-CL A	20,844	77.87	1,623,122.28
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	314.17	2,923,351.85
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	108.85	453,142.55
NEWELL BRANDS INC	31,461	17.52	551,196.72
NIKE B	103,874	105.74	10,983,636.76
NVR INC	247	4,093.13	1,011,003.11
PULTE GROUP INC	21,609	40.45	874,084.05
VF CORP	25,718	40.75	1,048,008.50
WHIRLPOOL CORP	5,220	153.69	802,261.80
AIRBNB INC-CLASS A	31,141	113.64	3,538,863.24

ARAMARK	20,955	35.44	742,645.20
BOOKING HOLDINGS INC	3,339	1,837.91	6,136,781.49
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	42.60	748,056.00
CARNIVAL CORPORATION	84,361	9.37	790,462.57
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,303	1,616.52	3,722,845.56
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	125.17	1,340,821.04
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	365.80	1,041,798.40
EXPEDIA GROUP INC	11,638	102.10	1,188,239.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	127.49	2,789,226.22
LAS VEGAS SANDS CORP	29,096	36.21	1,053,566.16
MARRIOTT INTL A	22,091	154.23	3,407,094.93
MCDONALD'S CORP	60,458	254.51	15,387,165.58
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	32.86	948,799.64
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	41.00	687,447.00
STARBUCKS CORP	93,796	82.94	7,779,440.24
VAIL RESORTS INC	3,014	222.00	669,108.00
WYNN RESORTS LTD	9,302	59.18	550,492.36
YUM BRANDS INC	22,637	112.74	2,552,095.38
ACTIVISION BLIZZARD INC	64,558	77.53	5,005,181.74
ALPHABET INC-CL A	492,726	107.85	53,140,499.10
ALPHABET INC-CL C	460,933	108.68	50,094,198.44
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	8.88	340,015.20
CABLE ONE INC	445	1,127.55	501,759.75
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	407.14	3,993,636.26
COMCAST CORP-CL A	367,926	35.76	13,157,033.76
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	17.01	342,445.32
ELECTRONIC ARTS INC	23,158	125.33	2,902,392.14
FOX CORP - CLASS A	27,658	33.74	933,180.92
FOX CORP- CLASS B	10,345	31.24	323,177.80
IAC INC	6,721	63.67	427,926.07
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	27.23	921,299.82
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	99.73	1,123,757.64
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	63.80	981,180.20
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	41.19	559,524.96
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	41.33	263,850.72
LIVE NATION ENTERTAINMENT	14,491	89.64	1,298,973.24
MATCH GROUP INC	22,730	55.18	1,254,241.40
META PLATFORMS INC-CLASS A	187,450	160.32	30,051,984.00
NETFLIX INC	36,196	226.11	8,184,277.56
NEWS CORP-CLASS A	33,479	16.96	567,803.84
OMNICOM GROUP	16,538	66.26	1,095,807.88
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	23.12	1,123,308.32

PINTEREST INC- CLASS A	45,767	22.07	1,010,077.69
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	37.94	1,064,558.46
ROKU INC	9,122	65.99	601,960.78
SEA LTD-ADR	28,338	59.93	1,698,296.34
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.07	367,040.76
SNAP INC - A	83,375	11.22	935,467.50
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	118.63	1,526,412.21
THE WALT DISNEY CO	149,471	111.20	16,621,175.20
TWITTER INC	54,209	38.63	2,094,093.67
WARNER BROS DISCOVERY INC	192,233	13.06	2,510,562.98
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	41.35	907,012.25
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	171.73	914,290.52
AMAZON.COM	749,309	127.51	95,544,390.59
AUTOZONE INC	1,639	2,120.88	3,476,122.32
BATH & BODY WORKS INC	19,806	38.47	761,936.82
BEST BUY COMPANY INC	18,175	71.14	1,292,969.50
BURLINGTON STORES INC	5,108	143.46	732,793.68
CARMAX INC	13,591	87.56	1,190,027.96
CHEWY INC - CLASS A	6,878	32.75	225,254.50
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	242.60	4,533,223.60
DOLLAR TREE INC	17,931	136.58	2,449,015.98
DOORDASH INC - A	15,171	58.23	883,407.33
EBAY	46,820	44.11	2,065,230.20
ETSY INC	10,294	105.72	1,088,281.68
GENUINE PARTS CO	11,319	157.25	1,779,912.75
HOME DEPOT	84,000	291.90	24,519,600.00
LKQ CORP	22,779	53.45	1,217,537.55
LOWES COMPANIES	52,525	195.51	10,269,162.75
MERCADOLIBRE INC	3,725	855.91	3,188,264.75
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	702.70	3,799,498.90
POOL CORP	3,304	339.90	1,123,029.60
ROSS STORES INC	28,076	87.39	2,453,561.64
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,926	164.60	6,242,619.60
TJX COMPANIES INC	97,454	63.52	6,190,278.08
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	187.60	1,673,767.20
ULTA BEAUTY INC	4,315	423.08	1,825,590.20
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	49.68	298,080.00
COSTCO WHOLESALE CORP	36,343	519.11	18,866,014.73
KROGER CO	56,126	48.43	2,718,182.18
SYSCO CORP	42,228	80.78	3,411,177.84
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	35.27	2,107,982.09
WALMART INC	124,048	133.00	16,498,384.00

ALTRIA GROUP INC	148,393	45.00	6,677,685.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	46,575	87.61	4,080,435.75
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	71.64	1,719,789.84
BUNGE LIMITED	11,604	99.01	1,148,912.04
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	49.13	779,643.97
COCA-COLA CO	337,769	61.15	20,654,574.35
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	47.59	732,600.46
CONAGRA BRANDS INC	40,304	34.22	1,379,202.88
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	244.85	3,168,359.00
GENERAL MILLS INC	49,534	76.72	3,800,248.48
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	224.05	2,692,856.95
HORMEL FOODS CORP	23,338	46.39	1,082,649.82
JM SMUCKER CO	9,145	140.00	1,280,300.00
KELLOGG CO	21,630	72.70	1,572,501.00
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	37.83	2,351,323.65
KRAFT HEINZ CO/THE	58,511	37.31	2,183,045.41
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	83.05	1,726,609.50
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	51.70	758,387.30
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	113,286	60.73	6,879,858.78
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	88.39	2,852,080.13
PEPSICO INC	113,421	170.66	19,356,427.86
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	126,117	94.53	11,921,840.01
TYSON FOODS INC	23,306	74.62	1,739,093.72
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	84.18	1,628,546.28
CLOROX COMPANY	9,570	142.85	1,367,074.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,702	78.17	5,135,925.34
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,016	248.32	4,722,053.12
KIMBERLY-CLARK CORP	26,841	126.48	3,394,849.68
PROCTER & GAMBLE CO	196,677	137.16	26,976,217.32
ABBOTT LABORATORIES	143,383	102.50	14,696,757.50
ABIOMED INC	3,781	261.24	987,748.44
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	244.51	1,453,122.93
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	147.71	1,904,868.16
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	56.21	2,249,130.73
BECTON DICKINSON & CO	23,274	252.84	5,884,598.16
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,818	40.49	4,729,960.82
CARDINAL HEALTH	21,902	70.99	1,554,822.98
CENTENE CORP	48,335	90.05	4,352,566.75
CIGNA CORP	26,188	287.70	7,534,287.60
CVS HEALTH CORP	106,862	99.44	10,626,357.28
DAVITA INC	4,627	87.80	406,250.60
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	31.80	565,213.20

DEXCOM INC	32,658	82.00	2,677,956.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51,357	88.69	4,554,852.33
ELEVANCE HEALTH INC	19,661	481.99	9,476,405.39
HCA HEALTHCARE INC	19,440	200.03	3,888,583.20
HENRY SCHEIN INC	11,747	71.26	837,091.22
HOLOGIC INC	19,018	67.52	1,284,095.36
HUMANA INC	10,365	484.40	5,020,806.00
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	343.83	2,321,196.33
INSULET CORP	5,311	254.35	1,350,852.85
INTUITIVE SURGICAL INC	29,197	203.67	5,946,552.99
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	225.74	1,714,495.30
MASIMO CORP	4,147	144.27	598,287.69
MCKESSON CORP	12,089	363.82	4,398,219.98
MEDTRONIC PLC	109,343	87.20	9,534,709.60
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	338.22	1,537,209.90
NOVOCURE LTD	7,933	78.65	623,930.45
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	125.13	1,251,925.65
RESMED INC	12,169	215.98	2,628,260.62
STERIS PLC	8,018	199.17	1,596,945.06
STRYKER CORP	28,067	203.76	5,718,931.92
TELADOC HEALTH INC	11,375	30.18	343,297.50
TELEFLEX INC	3,934	222.77	876,377.18
THE COOPER COS INC	4,134	295.53	1,221,721.02
UNITEDHEALTH GROUP INC	76,869	516.35	39,691,308.15
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	96.96	591,649.92
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	169.97	1,913,012.35
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	105.57	1,718,785.17
ABBVIE INC	144,953	136.28	19,754,194.84
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	128.01	3,044,717.85
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	205.45	1,981,154.35
AMGEN	43,905	242.37	10,641,254.85
AVANTOR INC	48,633	24.50	1,191,508.50
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	478.32	886,326.96
BIO-TECHNE CORP	3,245	330.03	1,070,947.35
BIOGEN INC	11,860	196.03	2,324,915.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	89.64	1,325,148.12
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	173,351	68.61	11,893,612.11
CATALENT INC	13,739	87.58	1,203,261.62
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	200.24	841,808.96
DANAHER CORP	56,691	269.42	15,273,689.22
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	15.37	554,257.57
EXACT SCIENCES CORP	14,756	36.09	532,544.04

GILEAD SCIENCES INC	103,360	63.82	6,596,435.20
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	60.00	1,075,560.00
ILLUMINA INC	12,506	196.07	2,452,051.42
INCYTE CORP	15,212	70.21	1,068,034.52
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	207.26	3,135,014.76
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	154.88	769,908.48
JOHNSON & JOHNSON	215,641	162.74	35,093,416.34
LILLY (ELI) & CO	66,242	301.33	19,960,701.86
MERCK & CO	207,468	86.23	17,889,965.64
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,195.02	2,160,596.16
MODERNA INC	27,309	138.57	3,784,208.13
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	103.01	872,906.74
PERKINELMER INC	10,545	134.59	1,419,251.55
PFIZER	460,155	45.70	21,029,083.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,915	580.62	5,176,227.30
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	42.07	1,099,204.96
SEAGEN INC	10,981	152.34	1,672,845.54
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	8.84	814,526.44
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,118	543.55	17,457,738.90
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,811	281.04	5,848,723.44
VIATRIS INC	90,748	9.45	857,568.60
WATERS CORP	4,749	298.32	1,416,721.68
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	291.35	1,680,215.45
ZOETIS INC	38,534	156.98	6,049,067.32
BANK OF AMERICA CORP	591,261	33.43	19,765,855.23
CITIGROUP	158,792	48.84	7,755,401.28
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	36.18	1,429,905.96
FIFTH THIRD BANCORP	57,420	33.67	1,933,331.40
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	799.31	759,344.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,984	149.24	2,236,212.16
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.32	1,519,971.84
JPMORGAN CHASE & CO	240,076	113.71	27,299,041.96
KEY CORP	71,472	17.55	1,254,333.60
M & T BANK CORP	14,929	180.75	2,698,416.75
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,513	157.25	5,427,169.25
REGIONS FINL CORP	79,314	21.28	1,687,801.92
SIGNATURE BANK	4,686	171.28	802,618.08
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	395.10	1,795,729.50
TRUIST FINANCIAL CORP	109,883	46.49	5,108,460.67
US BANCORP	116,467	45.55	5,305,071.85
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	45.81	653,846.13
WELLS FARGO & CO	310,526	43.38	13,470,617.88



ALLY FINANCIAL INC	27,761	32.69	907,507.09
AMERICAN EXPRESS	52,626	149.79	7,882,848.54
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	268.42	2,335,790.84
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	55.00	1,751,970.00
BANK NEW YORK CO	61,254	41.12	2,518,764.48
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,127	277.67	29,190,614.09
BLACKROCK INC	12,394	658.06	8,155,995.64
BLACKSTONE INC	57,841	93.82	5,426,642.62
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	104.22	3,465,940.32
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	32.26	505,481.94
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	119.81	1,063,313.75
CME GROUP INC	29,373	194.69	5,718,629.37
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	65.26	624,929.76
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	99.53	2,329,300.59
EQUITABLE HOLDINGS INC	34,355	29.36	1,008,662.80
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	430.44	1,355,025.12
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	25.89	674,952.30
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	48.92	211,138.72
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,241	331.48	9,361,326.68
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	101.28	4,527,519.84
INVESCO LTD	26,420	16.25	429,325.00
KKR & CO INC	44,282	49.25	2,180,888.50
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	219.25	1,400,130.50
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	249.91	801,461.37
MOODY'S CORP	13,365	284.40	3,801,006.00
MORGAN STANLEY	107,356	86.40	9,275,558.40
MSCI INC	6,518	451.95	2,945,810.10
NASDAQ INC	28,971	59.68	1,728,989.28
NORTHERN TRUST CORP	15,902	93.38	1,484,928.76
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	118.34	2,119,114.38
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	103.50	1,602,801.00
S&P GLOBAL INC	28,338	347.63	9,851,138.94
SCHWAB (CHARLES) CORP	118,155	70.34	8,311,022.70
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	53.85	514,267.50
STATE STREET CORP	30,359	67.68	2,054,697.12
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	31.97	1,328,865.02
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	66.78	605,093.58
AFLAC	50,591	59.40	3,005,105.40
ALLEGHANY CORP	1,080	840.02	907,221.60
ALLSTATE CORP	22,174	121.48	2,693,697.52
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	127.22	803,903.18
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	52.41	3,453,714.18

AON PLC	17,038	278.34	4,742,356.92
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	45.50	1,352,533.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,431	180.47	3,145,772.57
ASSURANT INC	4,726	158.90	750,961.40
BROWN & BROWN INC	19,873	62.89	1,249,812.97
CHUBB LTD	34,810	190.88	6,644,532.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	96.82	1,238,424.62
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	215.59	466,967.94
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	274.01	900,944.88
FNF GROUP	20,461	39.64	811,074.04
GLOBE LIFE INC	8,106	96.79	784,579.74
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	64.99	1,801,587.79
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	46.19	622,825.96
LOEWS CORP	16,741	55.43	927,953.63
MARKEL CORP	1,156	1,181.38	1,365,675.28
MARSH & MCLENNAN COS	41,045	160.27	6,578,282.15
METLIFE INC	57,127	65.06	3,716,682.62
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	74.44	1,542,322.36
PROGRESSIVE CORP	48,534	122.41	5,941,046.94
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,146	94.89	2,955,443.94
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	162.70	3,216,904.40
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,385	204.75	1,921,578.75
WR BERKLEY CORP	17,572	64.77	1,138,138.44
CBRE GROUP INC-A	27,714	77.14	2,137,857.96
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.78	471,786.00
WEYERHAEUSER CO	64,295	33.87	2,177,671.65
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	34.05	457,189.35
ACCENTURE PLC-CL A	51,987	284.07	14,767,947.09
ADOBE INC	38,782	368.14	14,277,205.48
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	22.45	287,719.20
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	88.26	1,206,778.98
ANSYS INC	6,794	244.63	1,662,016.22
APPLOVIN CORP-CLASS A	10,000	24.09	240,900.00
AUTODESK INC	17,467	198.69	3,470,518.23
AUTOMATIC DATA PROCESS	34,246	238.48	8,166,986.08
AVALARA INC	6,847	91.98	629,787.06
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	36.10	505,255.60
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	149.64	1,113,770.52
BLACK KNIGHT INC	11,543	66.36	765,993.48
BLOCK INC	41,288	66.33	2,738,633.04
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	166.48	1,621,848.16
CADENCE DESIGN SYSTEMS	22,740	168.17	3,824,185.80

CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	58.09	619,704.12
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	117.61	955,463.64
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	102.83	1,073,956.52
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	58.71	1,190,814.93
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,220	62.33	2,693,902.60
COUPA SOFTWARE INC	6,059	56.98	345,241.82
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,831	172.45	2,902,505.95
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	137.51	426,281.00
DATADOG INC - CLASS A	20,137	96.94	1,952,080.78
DOCUSIGN INC	14,969	54.45	815,062.05
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	21.17	488,349.56
DYNATRACE INC	14,790	36.75	543,532.50
EPAM SYSTEMS INC	4,779	412.14	1,969,617.06
FAIR ISAAC CORP	2,125	439.78	934,532.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	49,912	89.97	4,490,582.64
FISERV INC	49,921	101.44	5,063,986.24
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	209.12	1,255,138.24
FORTINET INC	56,318	48.60	2,737,054.80
GARTNER INC	6,340	288.92	1,831,752.80
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	124.05	2,799,436.35
GODADDY INC - CLASS A	13,798	75.07	1,035,815.86
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	68.51	432,846.18
HUBSPOT INC	3,646	315.36	1,149,802.56
INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,262	127.79	9,362,150.98
INTUIT INC	21,909	420.06	9,203,094.54
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	191.19	1,202,776.29
MASTERCARD INC-CLASS A	70,879	322.56	22,862,730.24
MICROSOFT CORP	581,193	256.06	148,820,279.58
MONGODB INC	5,325	244.87	1,303,932.75
NORTONLIFELOCK INC	43,549	22.84	994,659.16
OKTA INC	11,505	64.63	743,568.15
ORACLE CORP	130,499	74.68	9,745,665.32
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	7.40	926,805.60
PALO ALTO NETWORKS INC	8,079	539.20	4,356,196.80
PAYCHEX INC	26,693	120.90	3,227,183.70
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	344.46	1,458,788.10
PAYPAL HOLDINGS INC	90,208	91.13	8,220,655.04
PTC INC	9,804	115.05	1,127,950.20
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	42.78	273,492.54
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,672	400.92	3,476,778.24
SALESFORCE INC	81,603	153.69	12,541,565.07
SERVICENOW INC	16,309	434.51	7,086,423.59

SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	171.49	3,031,943.20
SPLUNK INC	13,355	87.33	1,166,292.15
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	55.52	1,073,479.20
SYNOPSIS INC	12,539	330.56	4,144,891.84
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	61.27	2,246,832.17
TWILIO INC - A	12,842	67.01	860,542.42
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	363.67	1,214,294.13
UNITY SOFTWARE INC	16,329	40.79	666,059.91
VERISIGN INC	7,790	181.45	1,413,495.50
VISA INC-CLASS A SHARES	134,653	197.76	26,628,977.28
VMWARE INC-CLASS A	16,717	115.66	1,933,488.22
WESTERN UNION CO	29,297	14.56	426,564.32
WIX.COM LTD	5,010	61.18	306,511.80
WORKDAY INC-CLASS A	16,567	158.54	2,626,532.18
ZENDESK INC	8,890	76.77	682,485.30
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19,002	80.79	1,535,171.58
ZSCALER INC	7,204	145.12	1,045,444.48
AMPHENOL CORPORATION	47,707	72.58	3,462,574.06
APPLE INC	1,323,830	155.81	206,265,952.30
ARISTA NETWORKS INC	20,350	117.30	2,387,055.00
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	102.70	626,470.00
CDW CORP/DE	10,882	168.50	1,833,617.00
CISCO SYSTEMS	337,789	44.59	15,062,011.51
COGNEX CORP	14,352	41.88	601,061.76
CORNING	64,989	33.15	2,154,385.35
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	37.79	849,556.99
F5 INC	4,851	156.11	757,289.61
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,530	13.24	1,450,177.20
HP INC	83,910	27.64	2,319,272.40
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	28.01	709,241.21
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	163.27	2,447,254.03
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,836	243.77	3,372,801.72
NETAPP INC	18,303	71.28	1,304,637.84
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	65.47	1,085,689.01
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	123.89	3,229,564.52
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	367.71	1,433,701.29
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	62.12	1,315,453.12
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	41.65	1,074,153.50
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	297.60	1,238,611.20
AT&T INC	581,626	17.19	9,998,150.94
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	19.96	309,699.36
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	20.96	576,127.52

LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	9.85	726,624.65
T-MOBILE US INC	50,968	141.98	7,236,436.64
VERIZON COMMUNICATIONS	344,746	41.30	14,238,009.80
AES CORP	54,375	26.15	1,421,906.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	61.49	1,277,639.22
AMEREN CORPORATION	20,898	92.93	1,942,051.14
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,467	101.09	4,292,989.03
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,165	148.12	2,246,239.80
ATMOS ENERGY CORP	10,802	114.55	1,237,369.10
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	31.78	1,530,588.36
CMS ENERGY CORP	23,697	67.14	1,591,016.58
CONSOLIDATED EDISON INC	29,197	98.48	2,875,320.56
CONSTELLATION ENERGY	25,732	81.07	2,086,093.24
DOMINION ENERGY INC	66,909	81.83	5,475,163.47
DTE ENERGY COMPANY	15,851	131.14	2,078,700.14
DUKE ENERGY CORP	62,802	107.00	6,719,814.00
EDISON INTL	30,339	67.96	2,061,838.44
ENERGY CORP	16,181	116.22	1,880,555.82
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	49.16	1,002,814.84
EVERGY INC	18,475	68.37	1,263,135.75
EVERSOURCE ENERGY	28,450	89.55	2,547,697.50
EXELON CORP	81,218	44.08	3,580,089.44
FIRSTENERGY CORP	45,165	39.91	1,802,535.15
NEXTERA ENERGY INC	159,643	85.11	13,587,215.73
NISOURCE INC	32,351	29.55	955,972.05
NRG ENERGY INC	19,068	41.47	790,749.96
PG&E CORP	118,132	12.55	1,482,556.60
PPL CORPORATION	58,459	28.94	1,691,803.46
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	64.01	2,526,346.68
SEMPRA ENERGY	25,885	166.80	4,317,618.00
SOUTHERN CO	86,558	77.87	6,740,271.46
UGI CORP	18,019	39.04	703,461.76
VISTRA CORP	31,797	24.96	793,653.12
WEC ENERGY GROUP INC	26,033	103.01	2,681,659.33
XCEL ENERGY INC	43,741	74.41	3,254,767.81
ADVANCED MICRO DEVICES	132,978	80.24	10,670,154.72
ANALOG DEVICES	42,691	148.63	6,345,163.33
APPLIED MATERIALS	72,040	91.24	6,572,929.60
BROADCOM INC	32,989	500.22	16,501,757.58
ENPHASE ENERGY INC	11,020	279.07	3,075,351.40
ENTEGRIS INC	12,483	92.08	1,149,434.64
INTEL CORP	336,001	31.22	10,489,951.22

	KLA CORP	12,119	335.25	4,062,894.75	
	LAM RESEARCH CORP	11,398	430.21	4,903,533.58	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,444	45.76	3,223,517.44	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	64.50	2,856,640.50	
	MICRON TECHNOLOGY	91,511	56.33	5,154,814.63	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	424.42	1,498,627.02	
	NVIDIA CORP	205,210	136.47	28,005,008.70	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	21,751	162.39	3,532,144.89	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	67.51	2,326,934.68	
	QORVO INC	8,556	90.14	771,237.84	
	QUALCOMM	91,671	128.48	11,777,890.08	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	98.40	1,315,804.80	
	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	4,864	267.12	1,299,271.68	
	TERADYNE INC	12,318	83.04	1,022,886.72	
	TEXAS INSTRUMENTS	75,121	163.00	12,244,723.00	
	アメリカドル 小計	27,874,242		2,781,370,924.91 (390,365,409,311)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	18.20	998,452.00	
	CAMECO CORP	31,793	37.89	1,204,636.77	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,374	72.27	6,964,948.98	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	24.86	2,766,743.98	
	ENBRIDGE	165,402	54.31	8,982,982.62	
	IMPERIAL OIL	20,285	64.27	1,303,716.95	
	KEYERA CORP	18,607	31.71	590,027.97	
	PARKLAND CORP	14,075	32.03	450,822.25	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	46.51	2,123,925.66	
	SUNCOR ENERGY	116,208	41.80	4,857,494.40	
	TC ENERGY CORP	81,350	63.11	5,133,998.50	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	77.79	1,945,450.11	
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	54.64	1,986,382.56	
	BARRICK GOLD CORP	139,009	19.58	2,721,796.22	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	64.58	848,516.62	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	21.37	918,910.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	159.73	2,453,931.99	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	8.10	419,960.70	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	4.32	468,508.32	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	6.60	410,803.80	
	NUTRIEN LTD	44,786	120.82	5,411,044.52	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	19.67	362,144.37	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,179	43.05	1,729,705.95	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	111.59	680,699.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	40.97	1,402,730.86	

CAE INC	25,999	23.31	606,036.69
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	101.33	768,588.05
WSP GLOBAL INC	9,951	154.14	1,533,847.14
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	37.71	509,273.55
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	92.32	945,818.40
THOMSON REUTERS CORP	13,293	143.50	1,907,545.50
AIR CANADA	13,805	17.61	243,106.05
CANADIAN NATL RAILWAY CO	48,612	153.76	7,474,581.12
CP RAILWAY LIMITED	75,991	97.32	7,395,444.12
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	135.77	792,489.49
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	74.15	1,726,360.30
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	89.49	274,734.30
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	39.38	672,571.02
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	77.83	1,795,771.59
QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.15	427,880.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	34.01	1,204,702.22
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	157.65	711,474.45
DOLLARAMA INC	22,000	80.29	1,766,380.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	59.46	4,011,587.82
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	38.01	579,766.53
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	117.33	1,515,082.29
METRO INC	18,840	70.77	1,333,306.80
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	152.23	795,553.98
SAPUTO INC	20,898	33.01	689,842.98
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	8.49	176,592.00
BANK MONTREAL	55,487	121.78	6,757,206.86
BANK NOVA SCOTIA	99,336	71.41	7,093,583.76
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,829	61.67	4,429,694.43
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	87.32	2,382,875.48
ROYAL BANK OF CANADA	115,288	123.04	14,185,035.52
TORONTO-DOMINION BANK	148,462	85.53	12,697,954.86
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	116,005	62.52	7,252,632.60
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.35	271,664.75
ONEX CORP	6,603	63.93	422,129.79
TMX GROUP LTD	4,685	131.60	616,546.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	637.77	1,360,363.41
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	31.02	737,903.76
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	69.11	697,941.89
INTACT FINANCIAL CORP	15,012	191.36	2,872,696.32
MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	22.57	3,493,339.46
POWER CORP OF CANADA	43,577	33.86	1,475,517.22
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	57.75	2,639,290.50

	FIRSTSERVICE CORP	2,690	158.58	426,580.20
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	7.53	296,682.00
	CGI INC - CL A	18,300	102.51	1,875,933.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	1,966.25	3,153,865.00
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	23.37	193,877.52
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	38.72	166,534.72
	OPEN TEXT CORP	20,463	39.11	800,307.93
	SHOPIFY INC - CLASS A	92,560	39.54	3,659,822.40
	BCE INC	6,203	63.57	394,324.71
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,196	55.95	1,689,466.20
	TELUS CORP	32,908	29.71	977,696.68
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.00	932,724.00
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	28.64	698,672.80
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	50.65	572,091.75
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	40.24	415,437.76
	EMERA INC	23,223	61.31	1,423,802.13
	FORTIS INC	40,183	58.25	2,340,659.75
	HYDRO ONE LTD	28,888	35.40	1,022,635.20
	NORTHLAND POWER INC	17,854	44.58	795,931.32
	カナダドル 小計	3,336,560		188,220,093.17 (20,090,612,744)
ユーロ	ENI	212,616	12.08	2,569,676.97
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	11.12	441,041.44
	NESTE OIL OYJ	36,735	48.97	1,798,912.95
	OMV AG	12,549	42.37	531,701.13
	REPSOL SA	111,112	13.38	1,486,678.56
	TENARIS SA	40,648	14.15	575,372.44
	TOTALENERGIES SE	203,322	51.56	10,483,282.32
	AIR LIQUIDE	43,239	124.92	5,401,415.88
	AKZO NOBEL	15,301	63.26	967,941.26
	ARCELORMITTAL	48,641	23.22	1,129,687.22
	ARKEMA	4,369	86.14	376,345.66
	BASF SE	73,837	42.99	3,174,621.81
	COVESTRO AG	14,454	31.01	448,218.54
	CRH PLC	65,449	36.87	2,413,104.63
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	19.16	307,349.10
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	46.74	609,536.34
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	127.60	1,749,013.20
	OCI NV	12,000	36.88	442,560.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	33.94	661,965.76
	SOLVAY SA	5,356	82.40	441,334.40
	STORA ENSO OYJ R	42,169	14.56	614,191.48



SYMRISE AG	11,830	104.60	1,237,418.00
UMICORE	17,605	31.36	552,092.80
UPM KYMMENE OYJ	42,324	33.11	1,401,347.64
VOESTALPINE AG	7,152	20.46	146,329.92
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,552	22.62	510,126.24
AIRBUS SE	49,560	98.96	4,904,457.60
ALSTOM	24,388	20.86	508,733.68
BOUYGUES ORD	16,606	29.59	491,371.54
BRENTAG SE	12,514	66.86	836,686.04
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.51	1,014,040.39
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	25.87	863,747.56
DASSAULT AVIATION SA	2,130	136.10	289,893.00
EIFFAGE	5,924	88.04	521,548.96
FERROVIAL SA	43,631	25.11	1,095,574.41
GEA GROUP AG	13,382	32.95	440,936.90
IMCD NV	4,641	135.15	627,231.15
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	58.66	727,266.68
KION GROUP AG	5,887	39.88	234,773.56
KNORR-BREMSE AG	5,022	48.62	244,169.64
KONE OYJ-B	26,311	39.90	1,049,808.90
LEGRAND SA	21,768	73.60	1,602,124.80
MTU AERO ENGINES AG	3,962	174.05	689,586.10
PRYSMIAN SPA	21,155	31.69	670,401.95
RATIONAL AG	483	526.50	254,299.50
RHEINMETALL AG	3,660	151.90	555,954.00
SAFRAN SA	28,774	102.36	2,945,306.64
SAINT-GOBAIN	40,093	40.98	1,643,011.14
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,670	120.90	5,400,603.00
SIEMENS	63,788	104.88	6,690,085.44
SIEMENS ENERGY AG	36,841	14.15	521,300.15
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	17.93	402,259.55
THALES SA	8,524	120.20	1,024,584.80
VINCI S.A.	44,993	93.77	4,218,993.61
WARTSILA OYJ	41,917	8.17	342,629.55
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.69	619,052.37
RANDSTAD NV	10,558	46.80	494,114.40
TELEPERFORMANCE	4,734	290.60	1,375,700.40
WOLTERS KLUWER	20,839	98.30	2,048,473.70
ADP	2,382	134.20	319,664.40
AENA SME SA	5,508	122.35	673,903.80
ATLANTIA SPA	43,726	22.83	998,264.58
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	5.94	269,428.10

DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	36.60	2,880,932.40
GETLINK	35,220	18.36	646,639.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	75.11	1,960,896.77
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	70.80	353,362.80
CONTINENTAL AG	8,168	58.28	476,031.04
FERRARI NV	10,170	196.65	1,999,930.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	64,434	57.58	3,710,109.72
MICHELIN	55,356	24.48	1,355,114.88
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	72.80	855,036.00
RENAULT SA	17,362	29.37	509,921.94
STELLANTIS NV	175,794	13.47	2,368,648.35
VALEO SA	16,596	19.29	320,136.84
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,874	148.96	2,364,591.04
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	190.70	474,080.20
ADIDAS AG	13,972	148.28	2,071,768.16
ESSILORLUXOTTICA	22,910	150.05	3,437,645.50
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,271.00	3,227,069.00
KERING	6,271	496.10	3,111,043.10
LVMH	22,668	644.60	14,611,792.80
MONCLER SPA	19,057	44.75	852,800.75
PUMA SE	9,220	61.32	565,370.40
SEB SA	2,282	72.90	166,357.80
ACCOR	14,436	24.10	347,907.60
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	119.50	1,559,236.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.36	262,374.88
SODEXO	6,027	77.96	469,864.92
BOLLORE SE	83,646	4.80	401,835.38
PUBLICIS GROUPE	17,077	49.48	844,969.96
SCOUT24 SE	7,492	58.36	437,233.12
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	44.92	317,629.32
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	19.19	1,175,498.14
VIVENDI SE	61,243	8.92	546,287.56
D' IETEREN GROUP	2,217	151.20	335,210.40
DELIVERY HERO SE	13,414	41.44	555,876.16
INDITEX	87,326	21.70	1,894,974.20
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	16.52	257,280.58
PROSUS	66,706	60.09	4,008,363.54
ZALANDO SE	17,664	23.06	407,331.84
CARREFOUR	52,544	16.55	869,865.92
HELLOFRESH SE	13,805	24.29	335,323.45
JERONIMO MARTINS	24,901	22.08	549,814.08
KESKO OYJ-B SHS	20,083	21.17	425,157.11

KONINKLIJKE AHOLD NV	86,170	27.50	2,369,675.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,659	48.82	3,547,575.67
DANONE (GROUPE)	51,543	52.26	2,693,637.18
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	9.85	483,604.75
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	70.30	650,345.30
HEINEKEN NV	20,157	89.36	1,801,229.52
JDE PEET'S BV	7,000	31.08	217,560.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	100.40	1,310,220.00
PERNOD-RICARD	16,694	189.45	3,162,678.30
REMY COINTREAU	1,382	183.10	253,044.20
BEIERSDORF AG	7,430	101.20	751,916.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	61.05	536,019.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	62.92	908,501.88
LOREAL	19,843	344.80	6,841,866.40
AMPLIFON SPA	11,650	26.36	307,094.00
BIOMERIEUX	3,044	88.76	270,185.44
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	124.30	426,349.00
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	133.75	276,862.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	34.28	582,245.80
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	24.89	838,519.21
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	16.59	1,190,845.98
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	418.50	763,344.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	49.03	1,057,430.01
ARGENX SE	4,713	381.70	1,798,952.10
BAYER	78,757	52.63	4,144,980.91
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	67.52	690,054.40
GRIFOLS SA	27,685	11.82	327,236.70
IPSEN	3,532	97.00	342,604.00
MERCK KGAA	10,555	173.35	1,829,709.25
ORION OYJ-CLASS B	9,854	44.54	438,897.16
QIAGEN N.V.	17,038	45.67	778,125.46
RECORDATI SPA	9,859	41.39	408,064.01
SANOFI	93,369	81.44	7,603,971.36
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,539	369.50	938,160.50
UCB (GROUPE)	9,389	70.16	658,732.24
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	9.80	391,465.32
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.56	2,439,256.39
BANCO SANTANDER SA	1,393,640	2.42	3,384,454.74
BNP PARIBAS	92,730	47.48	4,402,820.40
CAIXABANK	330,447	3.03	1,001,584.85
COMMERZBANK AG	81,889	6.99	572,404.11
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	9.30	924,912.90

ERSTE GROUP BANK AG	31,905	22.68	723,605.40
FINECOBANK SPA	53,120	11.14	592,022.40
ING GROEP NV-CVA	324,888	8.82	2,868,436.15
INTESA SANPAOLO	1,322,943	1.73	2,299,539.52
KBC GROEP NV	18,608	48.87	909,372.96
MEDIOBANCA	53,990	8.11	437,966.88
SOCIETE GENERALE	63,329	23.09	1,462,266.61
UNICREDIT SPA	168,352	9.99	1,682,846.59
AMUNDI SA	4,626	51.75	239,395.50
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	8.57	1,376,935.24
DEUTSCHE BOERSE	14,999	170.25	2,553,579.75
EURAZEO SA	3,357	58.95	197,895.15
EURONEXT NV	6,480	74.32	481,593.60
EXOR NV	7,825	62.18	486,558.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	75.88	646,118.20
SOFINA	1,238	199.90	247,476.20
WENDEL	2,023	77.90	157,591.70
AEGON	148,741	4.49	668,144.57
AGEAS	11,086	40.92	453,639.12
ALLIANZ SE-REG	34,133	172.36	5,883,163.88
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	15.02	1,286,695.92
AXA SA	154,335	23.88	3,686,291.47
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	152.85	662,299.05
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,889	247.90	2,947,283.10
NN GROUP NV	22,611	41.39	935,869.29
POSTE ITALIANE SPA	46,035	8.10	372,883.50
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	44.74	1,729,424.70
AROUNDTOWN SA	64,068	2.89	185,733.13
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	75.10	396,152.50
VONOVIA SE	59,080	26.78	1,582,162.40
ADYEN NV	1,746	1,520.60	2,654,967.60
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	51.64	1,837,557.76
BECHTLE AG	7,659	38.02	291,195.18
CAPGEMINI SA	13,877	176.35	2,447,208.95
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	38.38	2,025,197.46
EDENRED	22,564	50.88	1,148,056.32
NEMETSCHKE SE	5,455	57.54	313,880.70
NEXI SPA	48,458	8.33	404,042.80
SAP SE	85,927	85.32	7,331,291.64
WORLDLINE SA	20,332	43.66	887,695.12
NOKIA OYJ	427,600	5.06	2,163,656.00
CELLNEX TELECOM SA	46,824	38.37	1,796,636.88

	DEUTSCHE TELEKOM	271,698	18.98	5,157,914.83
	ELISA A	10,227	53.06	542,644.62
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.35	284,249.25
	KPN (KON.)	282,927	3.17	898,293.22
	ORANGE	153,815	10.18	1,566,144.33
	PROXIMUS	13,141	12.48	164,065.38
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.20	178,353.87
	TELEFONICA	431,420	4.17	1,799,021.40
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.59	256,165.42
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	22.59	214,898.67
	ACCIONA SA	2,181	194.60	424,422.60
	E.ON SE	195,549	8.84	1,729,044.25
	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	23.81	511,105.46
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.95	472,473.55
	ELIA GROUP SA/NV	3,125	145.20	453,750.00
	ENAGAS	21,663	18.45	399,682.35
	ENDESA	25,972	17.24	447,887.14
	ENEL	650,125	4.75	3,091,019.31
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.75	1,074,132.77
	ENGIE	158,924	12.17	1,934,422.92
	FORTUM OYJ	32,550	10.10	328,755.00
	IBERDROLA SA	477,647	10.56	5,043,952.32
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	27.77	277,977.70
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	18.49	567,389.61
	RWE STAMM	55,432	38.97	2,160,185.04
	SNAM SPA	147,559	4.83	713,005.08
	TERNA SPA	102,810	7.20	740,437.62
	UNIPER SE	7,335	5.64	41,369.40
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	22.20	1,132,799.40
	VERBUND AG	6,430	88.65	570,019.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,995	273.70	1,093,431.50
	ASML HOLDING NV	33,358	484.15	16,150,275.70
	INFINEON TECHNOLOGIES	110,035	24.80	2,728,868.00
	STMICROELECTRONICS	55,076	35.59	1,960,430.22
	ユーロ 小計	14,956,835		333,282,613.79 (46,369,610,056)
イギリスポンド	BP PLC	1,596,790	4.53	7,244,636.23
	SHELL PLC-NEW	608,239	23.24	14,135,474.36
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	27.51	2,810,822.34
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	11.01	394,953.84
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	67.50	737,370.00
	GLENCORE PLC	817,868	4.53	3,706,986.71

JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	19.98	336,707.28
MONDI PLC	36,710	14.67	538,535.70
RIO TINTO PLC REG	94,110	47.00	4,423,640.55
ASHTED GROUP PLC	37,687	43.32	1,632,600.84
BAE SYSTEMS PLC	260,104	7.64	1,988,234.97
BUNZL PLC	24,880	28.33	704,850.40
DCC PLC	6,622	49.38	326,994.36
FERGUSON PLC	17,761	99.46	1,766,509.06
MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.33	426,742.40
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.75	477,376.88
SMITHS GROUP PLC	26,476	14.80	391,977.18
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	105.45	581,451.30
EXPERIAN PLC	74,115	26.21	1,942,554.15
INTERTEK GROUP PLC	13,890	39.55	549,349.50
RELX PLC	154,242	22.51	3,471,987.42
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.21	731,900.80
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.10	300,201.40
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	34.92	268,464.96
BURBERRY GROUP PLC	29,776	17.15	510,658.40
PERSIMMON PLC	25,686	14.42	370,392.12
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.04	276,780.99
COMPASS GROUP PLC	142,427	18.43	2,624,929.61
ENTAIN PLC	49,630	12.01	596,304.45
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	47.00	696,117.00
WHITBREAD PLC	17,434	25.52	444,915.68
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.47	469,118.98
INFORMA PLC	110,598	5.49	607,183.02
PEARSON	55,305	8.90	492,546.33
WPP PLC	95,821	7.43	712,141.67
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.19	248,086.58
KINGFISHER PLC	153,717	2.34	360,466.36
NEXT PLC	11,468	59.30	680,052.40
OCADO GROUP PLC	54,753	7.04	385,461.12
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.03	301,416.72
TESCO PLC	601,050	2.47	1,488,800.85
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	15.02	386,743.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO	178,799	34.60	6,187,339.39
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	19.72	354,261.00
DIAGEO	189,615	37.80	7,167,447.00
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	19.00	1,445,520.00
HALEON PLC	405,046	2.47	1,001,071.18
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,052	64.00	3,843,328.00

	UNILEVER PLC	209,465	39.06	8,181,702.90
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.74	737,053.27
	ASTRAZENECA	126,291	106.18	13,409,578.38
	GSK PLC	334,172	13.52	4,518,005.44
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	13.08	215,218.32
	BARCLAYS	1,339,545	1.68	2,259,008.68
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,655,458	5.34	8,855,044.84
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,667,831	0.43	2,477,692.32
	NATWEST GROUP PLC	412,008	2.51	1,036,612.12
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	6.02	1,280,199.59
	3I GROUP PLC	74,757	11.70	875,030.68
	ABRDN PLC	153,430	1.52	233,367.03
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.15	269,792.32
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	80.06	2,105,337.82
	M&G PLC	229,107	1.99	456,037.48
	SCHRODERS PLC	11,794	26.94	317,730.36
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	10.87	444,952.58
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.75	337,291.25
	AVIVA PLC	225,378	4.26	961,462.54
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.54	1,173,553.17
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.10	311,310.10
	PRUDENTIAL	230,270	9.36	2,156,708.82
	AVEVA GROUP PLC	10,917	28.45	310,588.65
	SAGE GROUP PLC	76,660	7.08	543,366.08
	HALMA PLC	31,069	20.56	638,778.64
	BT GROUP PLC	557,358	1.46	816,250.79
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.13	2,509,882.84
	NATIONAL GRID PLC	302,035	10.74	3,243,855.90
	SEVERN TRENT PLC	22,468	27.91	627,081.88
	SSE PLC	90,604	16.83	1,525,318.34
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.65	624,169.90
	イギリスボンド 小計	23,075,105		144,993,388.01 (23,367,134,411)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.46	321,167.08
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	689.00	395,486.00
	GIVAUDAN-REG	748	3,114.00	2,329,272.00
	HOLCIM LTD	44,847	45.05	2,020,357.35
	SIG GROUP AG	26,203	23.22	608,433.66
	SIKA AG-BR	11,714	222.80	2,609,879.20
	ABB LTD	137,175	27.41	3,759,966.75
	GEBERIT AG-REG	2,964	454.30	1,346,545.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	167.00	342,016.00

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	172.70	533,988.40	
	VAT GROUP AG	1,956	237.20	463,963.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	30.86	322,487.00	
	SGS SA	506	2,171.00	1,098,526.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	224.00	1,025,248.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,318	107.55	4,658,850.90	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	228.80	568,110.40	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	42.92	169,018.96	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,978.00	553,840.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	105,500.00	844,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,340.00	847,880.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	230,976	113.42	26,197,297.92	
	ALCON INC	42,458	66.02	2,803,077.16	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,686	257.50	1,206,645.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	109.60	935,984.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	67.85	125,522.50	
	LONZA GROUP AG-REG	6,283	526.20	3,306,114.60	
	NOVARTIS	177,027	79.45	14,064,795.15	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	379.00	839,485.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,316	318.70	18,266,609.20	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	5.16	1,100,849.88	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	48.38	914,236.86	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	940.20	1,723,386.60	
	UBS GROUP AG	281,888	15.59	4,396,043.36	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	140.60	446,264.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	515.20	1,246,268.80	
	SWISS RE LTD	24,445	79.00	1,931,155.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,554	434.10	5,449,691.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	84.65	480,727.35	
	TEMENOS AG - REG	5,150	79.52	409,528.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	48.97	719,173.42	
	SWISSCOM	2,187	508.20	1,111,433.40	
	スイスフラン 小計	1,431,967		112,493,325.10 (16,073,046,290)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	332.40	7,396,564.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	451.80	4,518,000.00	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	155.50	6,824,428.50	
	ALFA LAVAL AB	27,268	286.40	7,809,555.20	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	217.70	17,014,996.60	
	ATLAS COPCO A	227,097	110.84	25,171,431.48	
	ATLAS COPCO B	127,608	99.19	12,657,437.52	
	EPIROC AB-A	53,479	163.85	8,762,534.15	



	EPIROC AB-B	28,804	147.20	4,239,948.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	71.80	2,779,521.60	
	INDUTRADE AB	22,644	193.55	4,382,746.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	208.50	2,919,417.00	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	168.60	3,029,742.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	104.55	12,843,758.40	
	SANDVIK AB	87,644	167.15	14,649,694.60	
	SKANSKA B	25,507	158.80	4,050,511.60	
	SKF AB-B	37,718	160.35	6,048,081.30	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	176.70	2,387,923.80	
	VOLVO B	121,238	169.54	20,554,690.52	
	SECURITAS B	29,533	92.36	2,727,667.88	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	60.36	3,008,282.04	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	131.84	2,804,104.96	
	EVOLUTION AB	14,096	840.50	11,847,688.00	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	65.60	3,486,443.20	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	112.86	6,233,144.94	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	107.95	13,738,796.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	233.60	11,557,126.40	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	204.00	3,630,384.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	235.40	3,374,459.00	
	NORDEA BANK ABP	279,221	99.17	27,690,346.57	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	106.25	13,944,781.25	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	87.16	9,651,749.76	
	SWEDBANK AB-A	72,526	140.00	10,153,640.00	
	EQT AB	23,207	239.10	5,548,793.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	237.20	2,803,229.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	234.90	2,623,363.20	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	180.75	7,035,693.75	
	INVESTOR AB-B SHS	156,321	171.20	26,762,155.20	
	KINNEVIK AB - B	18,792	154.85	2,909,941.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	432.50	3,148,600.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	57.91	3,283,497.00	
	SAGAX AB-B	12,402	226.00	2,802,852.00	
	ERICSSON (LM) B	255,508	79.31	20,264,339.48	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	110.75	17,037,558.50	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	114.20	5,340,220.40	
	TELIA CO AB	230,643	37.75	8,706,773.25	
	スウェーデンクローナ 小計	3,169,430		400,156,615.85 (5,186,029,741)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	27,755	360.80	10,014,004.00	
	EQUINOR ASA	81,436	379.80	30,929,392.80	

	NORSK HYDRO	96,800	65.56	6,346,208.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	420.40	5,254,159.20	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	336.80	2,911,636.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	79.45	1,518,845.65	
	MOWI ASA	31,968	202.80	6,483,110.40	
	ORKLA	69,804	83.38	5,820,257.52	
	SALMAR ASA	5,423	652.50	3,538,507.50	
	DNB BANK ASA	71,795	187.80	13,483,101.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	203.80	3,785,381.20	
	TELENOR ASA	51,193	108.40	5,549,321.20	
	ノルウェークローネ 小計	495,008		95,633,924.47 (1,335,049,585)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	439.40	3,727,430.20	
	NOVOZYMES A/S	17,111	424.10	7,256,775.10	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,492.00	1,126,460.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	81,654	180.00	14,697,720.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	16,770.00	3,672,630.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	17,155.00	7,445,270.00	
	DSV A/S	15,307	1,064.50	16,294,301.50	
	PANDORA A/S	8,163	439.90	3,590,903.70	
	CARLSBERG AS-B	8,481	953.40	8,085,785.40	
	COLOPLAST-B	9,208	861.20	7,929,929.60	
	DEMANT A/S	8,512	227.10	1,933,075.20	
	GN STORE NORD A/S	9,226	211.90	1,954,989.40	
	GENMAB A/S	5,250	2,663.00	13,980,750.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	135,410	774.50	104,875,045.00	
	DANSKE BANK A/S	56,132	100.10	5,618,813.20	
TRYG A/S	29,772	167.40	4,983,832.80		
ORSTED A/S	15,439	726.10	11,210,257.90		
	デンマーククローネ 小計	409,556		218,383,969.00 (4,085,964,059)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	31.98	659,715.42	
	SANTOS	265,406	7.73	2,051,588.38	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	25.68	329,037.84	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	158,086	33.65	5,319,593.90	
	BHP GROUP LTD	414,748	36.74	15,237,841.52	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	16.10	559,797.00	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	2.16	263,852.64	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	17.20	2,383,782.40	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	33.24	1,228,151.52	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	58.71	845,952.39	
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	17.03	1,259,181.17	

NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	7.38	750,014.64
ORICA LTD	38,288	15.18	581,211.84
RIO TINTO LTD	28,818	90.19	2,599,095.42
SOUTH32 LTD	407,531	4.00	1,630,124.00
REECE LTD	16,814	15.49	260,448.86
BRAMBLES LTD	108,007	12.30	1,328,486.10
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.71	443,682.61
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.28	448,800.00
TRANSURBAN GROUP	249,674	13.80	3,445,501.20
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	34.58	1,597,941.80
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	60.87	215,540.67
IDP EDUCATION LTD	17,793	28.02	498,559.86
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.48	815,418.24
REA GROUP LTD	3,586	123.77	443,839.22
SEEK LTD	28,001	20.59	576,540.59
WESFARMERS LTD	91,917	46.71	4,293,443.07
COLES GROUP LTD	108,486	17.56	1,905,014.16
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.51	825,356.51
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	36.70	3,666,366.70
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	13.16	841,713.60
COCHLEAR LIMITED	4,783	212.80	1,017,822.40
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	71.65	1,164,169.20
SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	33.61	1,252,006.11
CSL LIMITED	39,814	295.99	11,784,545.86
AUST AND NZ BANKING GROUP	247,511	22.75	5,630,875.25
COMMONWEALTH BANK OF AUST	139,969	96.95	13,569,994.55
NATIONAL AUSTRALIA BANK	267,570	30.54	8,171,587.80
WESTPAC BANKING	283,793	21.40	6,073,170.20
ASX LTD	14,549	78.00	1,134,822.00
MACQUARIE GROUP LIMITED	29,434	177.20	5,215,704.80
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	236,496	4.68	1,106,801.28
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.65	847,467.95
QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.02	1,341,323.82
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	10.88	1,032,120.32
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.24	1,075,674.24
WISETECH GLOBAL LTD	13,801	57.06	787,485.06
XERO LTD	11,340	83.37	945,415.80
TELSTRA CORP	308,467	3.94	1,215,359.98
ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	6.07	919,404.69
オーストラリアドル 小計	5,488,661		121,591,344.58 (11,584,007,398)
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.66	902,891.86

ニュージーランドドル	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	19.79	791,204.20
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.38	931,374.84
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.01	388,324.13
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.98	550,509.12
ニュージーランドドル 小計		506,126		3,564,304.15 (304,748,004)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	50.05	10,710,499.80
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	91.95	9,838,650.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	14.06	2,418,320.00
	MTR CORP	125,000	39.70	4,962,500.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	18.28	2,193,600.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	43.05	7,490,700.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	17.24	3,413,520.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	14.72	2,534,784.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	22.30	3,253,570.00
	WH GROUP LTD	658,301	5.22	3,436,331.22
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	26.65	7,501,975.00
	HANG SENG BANK	59,400	121.60	7,223,040.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	314.40	30,119,520.00
	AIA GROUP LTD	982,200	74.10	72,781,020.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	52.60	8,652,489.60
	ESR GROUP LTD	157,000	21.45	3,367,650.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	13.22	2,287,060.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	26.20	3,280,973.60
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	25.10	3,423,012.50
	SINO LAND CO	315,400	11.40	3,595,560.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	122,500	92.80	11,368,000.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	54.80	2,219,400.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	18.22	1,752,764.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	36.10	4,295,900.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	45.45	3,067,875.00	
CLP HOLDINGS	137,500	65.95	9,068,125.00	
HONG KONG & CHINA GAS	904,657	7.51	6,793,974.07	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	45.25	5,068,000.00	
香港ドル 小計		6,176,653		236,118,813.79 (4,221,804,390)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,800	7.40	834,720.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.73	549,802.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.27	570,909.64
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.77	473,550.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.02	717,972.00
	DBS GROUP	150,000	32.43	4,864,500.00

	OCBC BANK	282,100	11.98	3,379,558.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	27.05	2,539,995.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.50	627,000.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.68	822,480.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.30	355,240.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.05	334,875.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.66	453,862.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.60	1,770,451.80	
	シンガポールドル 小計	2,774,575		18,294,915.44 (1,829,491,544)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	32.12	1,908,795.24	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	688.60	1,477,735.60	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	35.00	3,440,850.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	134,557	35.40	4,763,317.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	20.60	2,049,700.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	138.50	1,731,665.50	
	AZRIELI GROUP	4,323	276.90	1,197,038.70	
	NICE LTD	4,991	702.50	3,506,177.50	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	176,957	5.64	998,037.48	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	153.90	1,539,000.00	
	イスラエルシェケル 小計	602,714		22,612,317.82 (935,948,708)	
	合 計	90,297,432		525,748,856,241 (525,748,856,241)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	38,290	190,301.30	
		アメリカドル 小計	38,290	190,301.30 (26,708,787)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	109,658	1,168,954.28	
		LENDLEASE GROUP	64,786	659,521.48	
	オーストラリアドル 小計	174,444	1,828,475.76 (174,198,885)		
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,426,635.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,276,000.00	
	香港ドル 小計	535,500	4,702,635.00 (84,083,113)		
	投資信託受益証券合計		748,234	284,990,785 (284,990,785)	

投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,110	1,821,222.90	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	874,839.22	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,131	9,314,311.35	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	149,611	954,518.18	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,294,843.32	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	906,799.86	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	981,720.81	
		CROWN CASTLE INC	35,305	5,922,766.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,771,418.68	
		DUKE REALTY CORP	30,517	1,761,136.07	
		EQUINIX INC	7,423	4,685,100.68	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	985,595.50	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,592	2,183,889.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,384,425.90	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	2,169,252.80	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	21,791	1,048,800.83	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	728,688.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,170,552.90	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	979,901.98	
		INVITATION HOMES INC	51,127	1,864,601.69	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,215,984.38	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	1,016,853.31	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	716,515.52	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,510,002.90	
		PROLOGIS INC	60,352	7,356,305.28	
		PUBLIC STORAGE	12,922	4,302,896.78	
		REALTY INCOME CORP	49,865	3,375,361.85	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	756,665.28	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,731,196.43	
		SIMON PROPERTY GROUP	27,091	2,723,458.23	
		SUN COMMUNITIES INC	10,227	1,546,731.48	
		UDR INC	24,265	1,099,689.80	
		VENTAS INC	31,565	1,494,602.75	
VICI PROPERTIES INC	80,143	2,618,271.81			
VORNADO REALTY TRUST	11,390	297,620.70			
WELLTOWER INC	37,724	2,860,610.92			
WP CAREY INC	16,024	1,341,208.80			
	アメリカドル 小計	1,129,069	81,768,363.29 (11,476,189,787)		
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	217,764.72		
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	309,180.40		
		20,377	526,945.12		

	カナダドル 小計		(56,246,122)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	273,654.30
	GECINA SA	3,139	282,039.15
	KLEPIERRE	17,225	347,083.75
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	533,832.30
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	386,128.60
	ユーロ 小計	48,695	1,822,738.10 (253,597,551)
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	332,268.17
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	294,305.46
	SEGRO PLC	93,383	874,998.71
	イギリスポンド 小計	219,086	1,501,572.34 (241,993,398)
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	799,765.00
	GOODMAN GROUP	133,807	2,570,432.47
	GPT GROUP	167,884	710,149.32
	MIRVAC GROUP	266,683	554,700.64
	SCENTRE GROUP	382,183	1,104,508.87
	STOCKLAND	207,412	734,238.48
	VICINITY CENTERS	365,149	693,783.10
	オーストラリアドル 小計	1,617,208	7,167,577.88 (682,855,144)
香港ドル	LINK REIT	170,500	10,553,950.00
	香港ドル 小計	170,500	10,553,950.00 (188,704,626)
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	801,269.16
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	460,429	939,275.16
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	470,093.74
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	402,600.00
	シンガポールドル 小計	1,247,756	2,613,238.06 (261,323,806)
	投資証券合計	4,452,691	13,160,910,434 (13,160,910,434)
	合計		13,445,901,219 (13,445,901,219)

(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 602銘柄	97.1%			72.4%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 37銘柄			2.9%	2.1%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%			3.7%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 223銘柄	99.5%			8.6%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79銘柄	99.0%			4.3%
	投資証券 3銘柄			1.0%	0.0%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 46銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 50銘柄	93.1%			2.1%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 28銘柄	93.9%			0.8%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.2%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	87.5%			0.3%
	投資証券 4銘柄			12.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.0%			0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## J-REITインデックス マザーファンド



## 貸借対照表

	2022年 9月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,700,749,816
投資証券	117,303,686,100
派生商品評価勘定	12,614,800
未収入金	9,972,500
未収配当金	1,411,946,447
差入委託証拠金	259,534,000
流動資産合計	121,698,503,663
資産合計	121,698,503,663
負債の部	
流動負債	
前受金	12,614,800
未払金	204,223,855
未払解約金	27,311,391
未払利息	5,102
流動負債合計	244,155,148
負債合計	244,155,148
純資産の部	
元本等	
元本	54,801,519,931
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	66,652,828,584
元本等合計	121,454,348,515
純資産合計	121,454,348,515
負債純資産合計	121,698,503,663

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 9月 5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>

	2022年 9月 5日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(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。</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）

	2022年 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	54,801,519,931口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2163円 (1万口当たり純資産額) (22,163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

	2022年 9月 5日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 9月 5日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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	2022年 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 9月 7日
期首元本額	49,131,603,828円
期中追加設定元本額	11,083,958,642円
期中一部解約元本額	5,414,042,539円
期末元本額	54,801,519,931円

区分	2022年 9月 5日現在
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,714,424,723円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,339,890円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,567,141,489円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	26,551,333,583円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,231,460,197円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,893,665,668円
分散投資コア戦略ファンドA	795,726,284円
分散投資コア戦略ファンドS	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド（切替型）	841,651,913円
S M T インデックスバランス・オープン	26,531,868円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	229,316,589円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	7,989,784円
グローバル経済コア	244,622,368円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,629,183円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	504,977,132円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	86,943,434円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	52,835,663円
10資産分散投資ファンド	7,002円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	448,686,572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）	19,400,705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）	413,317,327円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	68,784,297円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	848,150,768円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	256,089,432円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	292,012,284円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	1,495,175,487
合計	1,495,175,487

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「J - R E I T 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

（2022年 9月 5日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	4,131,657,200	-	4,144,272,000	12,614,800
合計		4,131,657,200	-	4,144,272,000	12,614,800

## (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。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,127	256,303,500	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,353	325,241,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	4,892	763,641,200	
	東海道リート投資法人	1,269	156,340,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,614	2,439,450,000	
	森ヒルズリート投資法人	12,306	1,914,813,600	
	産業ファンド投資法人	15,639	2,893,215,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	10,464	3,808,896,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,506	1,673,838,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,525	2,400,612,500	
	G L P 投資法人	32,229	5,395,134,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,868	1,628,346,000	
	日本プロロジスリート投資法人	17,149	5,967,852,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1,830	1,184,010,000	
	O n e リート投資法人	1,825	491,472,500	
	イオンリート投資法人	11,585	1,829,271,500	
	ヒューリックリート投資法人	9,791	1,622,368,700	
	日本リート投資法人	3,399	1,288,221,000	
	積水ハウス・リート投資法人	31,804	2,706,520,400	
	トーセイ・リート投資法人	2,322	321,597,000	

ケネディクス商業リート投資法人	4,398	1,253,430,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,580	478,074,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,720	345,168,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	33,843	5,594,247,900	
いちごホテルリート投資法人	1,734	166,984,200	
ラサールロジポート投資法人	12,812	2,154,978,400	
スターアジア不動産投資法人	13,067	750,045,800	
マリモ地方創生リート投資法人	1,307	174,876,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,134	2,228,226,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,689	111,642,900	
投資法人みらい	12,714	644,599,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,455	314,485,500	
三菱地所物流リート投資法人	3,229	1,517,630,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	4,053	855,993,600	
ザイマックス・リート投資法人	1,698	214,117,800	
タカラレーベン不動産投資法人	4,583	483,506,500	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,081	641,125,100	
日本ビルファンド投資法人	12,209	8,375,374,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,465	6,760,390,000	
日本都市ファンド投資法人	52,803	5,702,724,000	
オリックス不動産投資法人	20,852	3,932,687,200	
日本プライムリアルティ投資法人	7,157	2,927,213,000	
N T T 都市開発リート投資法人	10,060	1,516,042,000	
東急リアル・エステート投資法人	7,017	1,380,945,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,170	798,738,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	23,559	3,559,764,900	
森トラスト総合リート投資法人	7,480	1,081,608,000	
インヴィンシブル投資法人	46,062	1,969,150,500	
フロンティア不動産投資法人	3,883	2,054,107,000	
平和不動産リート投資法人	7,152	1,107,129,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,056	2,324,952,000	
福岡リート投資法人	5,412	921,122,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,076	2,199,340,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,575	743,452,500	
大和証券オフィス投資法人	2,187	1,537,461,000	
阪急阪神リート投資法人	4,727	731,739,600	
スターツプロシード投資法人	1,630	418,747,000	
大和ハウスリート投資法人	15,775	4,977,012,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	33,749	2,284,807,300	
大和証券リビング投資法人	14,159	1,747,220,600	
ジャパンエクセレント投資法人	9,600	1,255,680,000	
合計	616,409	117,303,686,100	

(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

項目	2022年 9月 5日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	386,098,646
コール・ローン	134,344,637
投資証券	105,244,138,741
派生商品評価勘定	616,344
未収入金	16,365,175
未収配当金	166,946,736
流動資産合計	105,948,510,279
資産合計	105,948,510,279
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	837
未払解約金	279,074
未払利息	253
流動負債合計	280,164
負債合計	280,164
純資産の部	
元本等	
元本	41,138,994,709
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	64,809,235,406
元本等合計	105,948,230,115
純資産合計	105,948,230,115
負債純資産合計	105,948,510,279

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

2022年 9月 5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。</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> <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>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>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)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)

2022年 9月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,138,994,709口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5754円 (25,754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



	2022年 9月 5日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月 5日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 9月 7日
期首元本額	41,266,058,193円
期中追加設定元本額	8,506,814,042円
期中一部解約元本額	8,633,877,526円
期末元本額	41,138,994,709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	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	94,091,235円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,677,202,592円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,327,381円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,407,297,093円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,726,075,074円
コア投資戦略ファンド（安定型）	691,010,554円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,599,810,944円
分散投資コア戦略ファンドA	663,634,730円
分散投資コア戦略ファンドS	1,393,496,043円
コア投資戦略ファンド（切替型）	705,693,921円
SMT インデックスバランス・オープン	133,495,319円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	196,056,511円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,790,745円
グローバル経済コア	236,717,890円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,102,334円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	419,178,235円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	70,908,200円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	30,374,588円
10資産分散投資ファンド	3,975円

区分	2022年 9月 5日現在
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）	898,946,229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）	309,511,299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）	147,064,403円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	60,705,130円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	43,819,175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）	97,526,469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）	93,394,478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）	92,917,911円
S M T A M海外バランスファンド2021 - 04（適格機関投資家専用）	94,468,258円
S M T A M海外バランスファンド2021 - 07（適格機関投資家専用）	92,998,751円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021 - 11（適格機関投資家専用）	80,197,774円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 9月 5日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		19,177,285,729
合計		19,177,285,729

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバルR E I T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

（2022年 9月 5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	172,976,351	-	173,591,858	615,507
	アメリカドル	172,976,351	-	173,591,858	615,507
合計		172,976,351	-	173,591,858	615,507

## (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	55,900	887,133.00	
		AGREE REALTY CORP	41,911	3,105,605.10	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	42,122	786,838.96	
		ALEXANDER'S INC	1,190	271,879.30	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	83,484	12,555,158.76	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	103,683.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,881	846,448.21	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	166,443	5,830,498.29	
		AMERICOLD REALTY TRUST	153,531	4,450,863.69	
		APARTMENT INCOME REIT CO	88,094	3,620,663.40	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	93,351	817,754.76	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	122,364	1,888,076.52	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,600	492,150.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	166,430.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	78,962	15,990,594.62	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	397,386.00	
		BOSTON PROPERTIES	80,339	6,470,503.06	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	146,083.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	747,087.60	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	167,853	3,627,303.33	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	93,466	1,746,879.54	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	116,350.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	60,498	7,664,491.62	
		CARETRUST REIT INC	52,477	1,113,037.17	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13,620	388,170.00	
		CENTERSPACE	9,150	692,014.50	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	305,080.80	
		CITY OFFICE REIT INC	25,050	284,568.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	61,247.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	451,046.28	
CORPORATE OFFICE PPTYS	66,455	1,687,957.00			
COUSINS PROPERTIES INC	83,355	2,234,747.55			

CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	5,000	35,250.00	
CTO REALTY GROWTH INC	8,400	175,224.00	
CUBESMART	127,586	5,863,852.56	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	981,321.60	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	143,040.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	160,653	19,002,036.84	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	168,192.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	98,721	1,973,432.79	
DUKE REALTY CORP	218,006	12,581,126.26	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	53,307	944,600.04	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	23,830	3,900,971.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	582,427.24	
EPR PROPERTIES	42,770	1,805,321.70	
EQUINIX INC	51,297	32,376,614.52	
EQUITY COMMONWEALTH	64,252	1,694,325.24	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	97,444	6,816,207.80	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	193,764	14,299,783.20	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	80,435	1,781,635.25	
ESSEX PROPERTY TRUST	36,974	9,834,344.52	
EXTRA SPACE STORAGE INC	76,012	15,171,995.20	
FARMLAND PARTNERS INC	17,200	244,584.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	40,843	4,115,749.11	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	73,984	3,691,801.60	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,515	1,174,750.85	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	137,919.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	132,532	6,378,765.16	
GETTY REALTY CORP	21,985	657,351.50	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	376,200.50	
GLADSTONE LAND CORP	15,500	356,190.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	359,318.70	
GLOBAL NET LEASE INC	57,012	758,259.60	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	216,667	5,193,507.99	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	306,402	7,923,555.72	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	18,550	176,039.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	59,171	1,780,455.39	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	402,606	6,948,979.56	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	79,230	1,037,913.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	123,610	2,363,423.20	
INDUS REALTY TRUST INC	3,840	230,131.20	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	231,167.02	

INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	15,495	1,398,578.70
INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,823	1,030,619.24
INVITATION HOMES INC	342,959	12,507,714.73
IRON MOUNTAIN INC	165,060	8,604,577.80
JBG SMITH PROPERTIES	59,353	1,287,366.57
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	307,850.00
KILROY REALTY CORPORATION	58,603	2,852,794.04
KIMCO REALTY CORP	346,470	7,355,558.10
KITE REALTY GROUP TRUST	123,053	2,357,695.48
LIFE STORAGE INC	47,650	6,085,381.50
LTC PROPERTIES INC	23,309	1,020,234.93
LXP INDUSTRIAL TRUST	164,791	1,666,037.01
MACERICH CO/THE	124,305	1,169,710.05
MANULIFE US REAL ESTATE INV	957,964	478,982.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	341,592	4,891,597.44
MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,294	10,722,580.68
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	98,246	4,381,771.60
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	47,549	2,414,538.22
NATL HEALTH INVESTORS INC	26,680	1,711,255.20
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	71,590	521,175.20
NETSTREIT CORP	25,337	496,098.46
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	653,891.42
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	488,694.80
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	131,562	4,246,821.36
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	205,602.09
ORION OFFICE REIT INC	30,374	300,702.60
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	624,492.96
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	135,515	1,889,079.10
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	72,812	1,242,900.84
PENN REAL ESTATE INVEST TST	2,333	9,495.31
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	64,567	2,120,380.28
PHYSICIANS REALTY TRUST	127,742	2,106,465.58
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	807,616.36
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	24,051	483,665.61
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	101,990.00
PRIME US REIT	295,000	184,375.00
PROLOGIS INC	418,033	50,954,042.37
PUBLIC STORAGE	86,103	28,671,437.97
REALTY INCOME CORP	339,335	22,969,586.15
REGENCY CENTERS CORP	88,278	5,339,053.44
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	73,582	1,222,932.84

REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	92,974	5,689,079.06	
RLJ LODGING TRUST	90,877	1,076,892.45	
RPT REALTY	43,950	418,843.50	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,899	2,484,588.59	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	130,149	1,920,999.24	
SAFEHOLD INC	8,335	304,310.85	
SAUL CENTERS INC	6,800	304,776.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	100,336	679,274.72	
SIMON PROPERTY GROUP	185,318	18,630,018.54	
SITE CENTERS CORP	99,504	1,274,646.24	
SL GREEN REALTY CORP	36,568	1,622,156.48	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	74,906	3,008,224.96	
STAG INDUSTRIAL INC	100,694	3,045,993.50	
STORE CAPITAL CORP	144,424	3,857,565.04	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	65,970	504,010.80	
SUN COMMUNITIES INC	68,804	10,405,916.96	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	124,166	1,340,992.80	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	61,159	933,286.34	
TERRENO REALTY CORP	42,326	2,545,062.38	
UDR INC	170,023	7,705,442.36	
UMH PROPERTIES INC	30,629	542,439.59	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	346,139.72	
URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	944,433.00	
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	248,626.00	
VENTAS INC	226,148	10,708,107.80	
VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	569,763.64	
VICI PROPERTIES INC	543,651	17,761,078.17	
VORNADO REALTY TRUST	89,021	2,326,118.73	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	51,070	1,011,696.70	
WELLTOWER INC	256,172	19,425,522.76	
WHITESTONE REIT	23,074	228,663.34	
WP CAREY INC	109,442	9,160,295.40	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,382	992,562.12	
アメリカドル 小計	14,643,202	584,118,365.25 (81,981,012,562)	
カナダドル			
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	34,242	1,059,789.90	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	329,080.50	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	158,640.00	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,460	652,540.80	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	71,800.00	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	48,274	2,151,089.44	

CHOICE PROPERTIES REIT	93,170	1,263,385.20	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	411,677.73	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	448,394.10	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	69,960	822,030.00	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	247,930.80	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	81,260.00	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	866,025.30	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,745	1,300,708.50	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	81,239	1,026,860.96	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	38,193.00	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	41,990	510,178.50	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	499,987.50	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	165,723.00	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	212,427.20	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	156,786.85	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	67,970	851,664.10	
PLAZA RETAIL REIT	25,000	103,250.00	
PRIMARIS REIT	28,309	377,925.15	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	85,984	1,716,240.64	
SLATE GROCERY REIT	17,300	242,200.00	
SLATE OFFICE REI	17,000	75,310.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	40,930	1,137,444.70	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	53,000	981,030.00	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	155,832.00	
カナダドル 小計	1,051,790	18,115,405.87 (1,933,638,422)	
ユーロ			
AEDIFICA	21,987	2,067,877.35	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	60,876.00	
ALTAREA	2,480	323,888.00	
CARE PROPERTY INVEST	15,000	324,000.00	
CARMILA	25,000	398,500.00	
COFINIMMO	16,697	1,681,387.90	
COVIVIO(FP)	27,211	1,500,686.65	
CROMWELL REIT EUR	160,000	323,200.00	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	21,060	433,836.00	
GECINA SA	30,472	2,737,909.20	
HAMBORNER REIT AG	37,000	300,810.00	
ICADE	18,300	807,396.00	



	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	113,365.45
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	146,462	865,590.42
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	295,240.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	261,660.00
	KLEPIERRE	109,214	2,200,662.10
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	159,460.00
	MERCIALYS	28,000	219,520.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	190,230	1,740,604.50
	MONTEA NV	6,042	538,946.40
	NSI NV	10,050	295,972.50
	RETAIL ESTATES	6,400	399,360.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	64,866	3,312,057.96
	VASTNED RETAIL	10,650	230,572.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	78,672	2,352,292.80
	WERELDHAVE NV	22,670	304,911.50
	XIOR STUDENT HOUSING NV	12,170	480,715.00
	ユーロ 小計	1,357,723	24,731,298.23 (3,440,865,522)
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	260,756	195,306.24
	AEW UK REIT PLC	68,000	74,256.00
	ASSURA PLC	1,682,040	1,076,505.60
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	435,000	441,960.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	97,668	1,244,290.32
	BRITISH LAND CO PLC	543,883	2,275,606.47
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	488,878	582,253.69
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	232,037.10
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	237,087.31
	DERWENT LONDON PLC	63,472	1,532,214.08
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	294,066.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	140,280	725,949.00
	HAMMERSON PLC	2,044,000	434,554.40
	HOME REIT PLC	419,934	481,244.36
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	229,355	263,299.54
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	432,139	2,747,539.76
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	555,880	1,149,559.84
	LXI REIT PLC	1,061,327	1,568,641.30
	NEWRIVER REIT PL	126,000	102,060.00
PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	236,376.00	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	735,888	994,920.57	
PRS REIT PLC/THE	329,000	334,922.00	

	REGIONAL REIT LTD	222,000	152,514.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	118,937	1,277,383.38	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	181,650.00	
	SEGR0 PLC	684,456	6,413,352.72	
	SHAFTESBURY PLC	168,193	685,891.05	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	705,099	846,118.80	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	165,474.80	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,045,491	1,714,605.24	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	341,040.00	
	UNITE GROUP PLC	231,128	2,477,692.16	
	WORKSPACE GROUP PLC	81,347	421,377.46	
	イギリスポンド 小計	15,673,740	31,911,019.19 (5,142,779,852)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	239,716	644,836.04	
	ARENA REIT	196,553	809,798.36	
	BWP TRUST	262,160	1,038,153.60	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	625,306.50	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	309,606	941,202.24	
	CENTURIA OFFICE REIT	240,945	396,354.52	
	CHARTER HALL GROUP	266,135	3,414,512.05	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	334,782	1,483,084.26	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	295,660	1,218,119.20	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	675,979.50	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	822,633	653,993.23	
	DEXUS	609,041	5,176,848.50	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	309,620.00	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	292,050.00	
	GOODMAN GROUP	960,988	18,460,579.48	
	GPT GROUP	1,065,478	4,506,971.94	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	583,660.00	
	HEALTHCO REIT	137,130	243,405.75	
	HOME CONSORTIUM LTD	111,500	526,280.00	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	782,342	1,001,397.76	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	386,662.80	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	193,766	817,692.52	
	MIRVAC GROUP	2,197,238	4,570,255.04	
	NATIONAL STORAGE REIT	605,040	1,464,196.80	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	158,231.20	
	RURAL FUNDS GROUP	231,095	593,914.15	
SCENTRE GROUP	2,911,575	8,414,451.75		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	635,659	1,709,922.71		
STOCKLAND	1,376,971	4,874,477.34		
VICINITY CENTERS	2,157,067	4,098,427.30		

	WAYPOINT REIT LTD	390,099	1,002,554.43	
オーストラリアドル 小計		18,791,614	71,092,938.97 (6,773,024,295)	
ニュージー ランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	559,152.52	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	605,300	1,310,474.50	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	858,490.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	762,894	1,014,649.02	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	249,502	673,655.40	
ニュージーランドドル 小計		2,893,464	4,416,421.44 (377,604,033)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,108,000	3,745,040.00	
	FORTUNE REIT	836,000	5,308,600.00	
	LINK REIT	1,190,400	73,685,760.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	1,699,520.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,058,870.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	3,183,897.20	
	香港ドル 小計		5,763,060	89,681,687.20 (1,603,508,567)
シンガポ ールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	374,000.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,928,918	5,439,548.76	
	ASCOTT TRUST	1,117,577	1,206,983.16	
	CAPITALAND CHINA TRUST	647,721	706,015.89	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,924,444	5,965,865.76	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	473,600	596,736.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	178,400	119,528.00	
	EC WORLD REIT	180,000	99,000.00	
	ESR-LOGOS REIT	2,769,764	1,135,603.24	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	329,400.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	150,668.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	619,262	1,405,724.74	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,658,196	2,238,564.60	
	IREIT GLOBAL	405,985	227,351.60	
	KEPPEL DC REIT	759,903	1,451,414.73	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,124,998.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	1,025,950	841,279.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,095,163	2,781,714.02	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,798,285	2,985,153.10	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,245,273	2,278,849.59	
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	477,616.50		
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	220,500	1,058,400.00		

	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	229,245.00	
	SPH REIT	577,800	540,243.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	849,400	496,899.00	
	SUNTEC REIT	1,240,200	1,959,516.00	
	シンガポールドル 小計	25,690,285	36,220,317.69 (3,622,031,769)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	127,927,200.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	450,623,600.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	54,408,255.00	
	JR REIT XXVII	76,683	349,674,480.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	134,031,910.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	367,473,600.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	192,201,250.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	65,775,600.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,380	208,665,800.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	66,247,665.00	
	SK REITS CO LTD	39,229	224,782,170.00	
	韓国ウォン 小計	433,138	2,241,811,530.00 (230,682,406)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	103,500	2,173,500.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	1,184,500.00	
	イスラエルシェケル 小計	218,500	3,358,000.00 (138,991,313)	
	合計	86,516,516	105,244,138,741 (105,244,138,741)	

(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 147銘柄	100.0%	77.9%
カナダドル	投資証券 30銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 28銘柄	100.0%	3.3%
イギリスポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	4.9%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.4%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	投資証券 26銘柄	100.0%	3.4%

韓国ウォン	投資証券	11銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	2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6期中間計算期間(2022年9月6日から2023年3月5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5期 （2022年 9月 5日現在）	第6期中間計算期間 （2023年 3月 5日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	10,075,689	10,228,699
親投資信託受益証券	274,250,262	299,134,537
未収入金	-	48,411
流動資産合計	284,325,951	309,411,647
資産合計	284,325,951	309,411,647
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	16	83,721
未払受託者報酬	73,539	79,672
未払委託者報酬	661,875	716,991
未払利息	19	9
その他未払費用	7,291	7,903
流動負債合計	742,740	888,296
負債合計	742,740	888,296
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	223,078,987	244,885,634
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	60,504,224	63,637,717
（分配準備積立金）	39,067,156	38,149,973
元本等合計	283,583,211	308,523,351
純資産合計	283,583,211	308,523,351
負債純資産合計	284,325,951	309,411,647

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2021年 9月 7日 至 2022年 3月 6日	第6期中間計算期間 自 2022年 9月 6日 至 2023年 3月 5日
営業収益		
受取利息	24	16
有価証券売買等損益	8,634,778	1,526,415
営業収益合計	8,634,754	1,526,399
営業費用		
支払利息	1,758	2,593
受託者報酬	64,285	79,672
委託者報酬	578,502	716,991
その他費用	6,362	7,903
営業費用合計	650,907	807,159
営業利益又は営業損失（ ）	9,285,661	2,333,558
経常利益又は経常損失（ ）	9,285,661	2,333,558
中間純利益又は中間純損失（ ）	9,285,661	2,333,558
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（ ）	6,215	113,718
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	45,630,759	60,504,224
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,276,721	6,862,701
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,276,721	6,862,701
剰余金減少額又は欠損金増加額	958,837	1,509,368
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	958,837	1,509,368
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	42,669,197	63,637,717



## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第5期 (2022年 9月 5日現在)	第6期中間計算期間 (2023年 3月 5日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	223,078,987口	244,885,634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) 1.2712円 (12,712円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2599円 (12,599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6期中間計算期間 (2023年 3月 5日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第5期 自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 5日	第6期中間計算期間 自 2022年 9月 6日 至 2023年 3月 5日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	176,550,538円	223,078,987円
期中追加設定元本額	57,198,326円	27,415,496円
期中一部解約元本額	10,669,877円	5,608,849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

	2023年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	381,489,112
国債証券	524,184,962,550
地方債証券	32,094,487,890
特殊債証券	35,524,635,035
社債証券	28,102,647,000
未収入金	199,717,000
未収利息	1,454,973,625
前払費用	70,922,949
流動資産合計	622,013,835,161
資産合計	622,013,835,161

項目	2023年 3月 5日現在
	金額（円）
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	311,791,359
未払利息	129
流動負債合計	511,791,488
負債合計	511,791,488
純資産の部	
元本等	
元本	462,632,016,727
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	158,870,026,946
元本等合計	621,502,043,673
純資産合計	621,502,043,673
負債純資産合計	622,013,835,161

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 3月 5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)

	2023年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	462,632,016,727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 99,476,000円</p>
3.	1口当たり純資産額 1.3434円

2023年 3月 5日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (13,434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

2023年 3月 5日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	456,966,880,624円
期中追加設定元本額	20,855,997,386円
期中一部解約元本額	15,190,861,283円
期末元本額	462,632,016,727円
期末元本額の内訳	

区分	2023年 3月 5日現在
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）	4,241,430,807円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,925,539円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,632,728,069円
世界経済インデックスファンド	5,214,856,847円
D C マイセレクション 2 5	26,580,097,904円
D C マイセレクション 5 0	30,881,933,326円
D C マイセレクション 7 5	9,283,351,801円
D C 日本債券インデックス・オープン	437,098,007円
D C 日本債券インデックス・オープン S	91,238,600,282円
D C 日本債券インデックス・オープン P	65,601,976,191円
D C マイセレクション S 2 5	14,120,491,437円
D C マイセレクション S 5 0	15,819,003,207円
D C マイセレクション S 7 5	3,650,666,581円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	582,962,927円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,459,094,419円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	952,470,502円
D C 世界経済インデックスファンド	4,271,833,772円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,743,356円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	26,997,148円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	7,397,367円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	979,351円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	73,070,144円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	105,906,726円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	27,428,905円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	22,044,184円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,460,828,995円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	714,915,530円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,993,702,340円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	66,776,047円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	51,919,780円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	924,228,514円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,032,658,674円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,341,133,173円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	127,840,589円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	5,308,426,198円
日本債券ファンド・シリーズ 1	16,942,683,737円
分散投資コア戦略ファンド A	20,107,132,935円
分散投資コア戦略ファンド S	25,039,704,682円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	246,623,724円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,700,985,772円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	98,963,957円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,438,198円

区分	2023年 3月 5日現在
S M T インデックスバランス・オープン	75,644,131円
S M T 世界経済インデックス・オープン	40,735,919円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	85,958,765円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	137,623,094円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	13,573,059円
グローバル経済コア	229,071,658円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	37,063,854円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	24,165,710円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	41,831,451円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	24,400,471円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	8,241,256円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,032,717円
M y S M T 国内債券インデックス（ノーロード）	176,444,026円
10資産分散投資ファンド	287,024,291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）	85,526,442,737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）	39,252,687円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,580,601円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	407,651,416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

	2023年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,403,517,240
株式	521,741,237,646
派生商品評価勘定	80,687,650
未収入金	821,400
未収配当金	1,036,420,589
差入委託証拠金	178,036,400
流動資産合計	525,440,720,925
資産合計	525,440,720,925
負債の部	
流動負債	
前受金	80,725,600
未払解約金	114,653,743
未払利息	813
流動負債合計	195,380,156

	2023年 3月 5日現在
項目	金額（円）
負債合計	195,380,156
純資産の部	
元本等	
元本	259,505,763,204
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	265,739,577,565
元本等合計	525,245,340,769
純資産合計	525,245,340,769
負債純資産合計	525,440,720,925

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 3月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</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)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>
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>株価指数先物取引</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>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</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)

	2023年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	259,505,763,204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 2.0240円 (1万口当たり純資産額) (20,240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

	2023年 3月 5日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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	2023年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	264,418,414,974円
期中追加設定元本額	9,211,226,461円
期中一部解約元本額	14,123,878,231円
期末元本額	259,505,763,204円



区分	2023年 3月 5日現在
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）	373,831,614円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,090,746,981円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,292,137円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,874,115,844円
世界経済インデックスファンド	4,376,749,683円
日本株式インデックス・オープン	3,201,243,090円
D C マイセレクション 2 5	6,180,673,059円
D C マイセレクション 5 0	18,994,598,572円
D C マイセレクション 7 5	19,425,112,056円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,101,212,332円
D C マイセレクション S 2 5	3,312,412,293円
D C マイセレクション S 5 0	9,670,445,635円
D C マイセレクション S 7 5	7,601,611,310円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,722,871,195円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	129,303,019円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	655,968,935円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	500,538,036円
D C 世界経済インデックスファンド	3,585,052,923円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,292,366,186円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,110,166円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	16,503,636円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,793,533円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	161,457,107円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	24,164,545円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	90,556,921円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	19,167,113円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	52,802,764円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	736,890,090円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	399,195,212円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	2,593,958,583円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	37,322,731円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	15,827,808円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	422,931,185円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	238,900,241円
バランス F（25）V A 1（適格機関投資家専用）	314,861,020円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	32,360,611円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	537,365,400円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	3,122,495,375円
日本株式ファンド・シリーズ 2	1,993,979,880円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,723,583,109円

区分	2023年 3月 5日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,756,334,500円
分散投資コア戦略ファンドA	1,561,018,872円
分散投資コア戦略ファンドS	6,232,800,431円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	517,453,302円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	385,810,808円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,713,694,598円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	207,661,468円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,618,220円
SMT インデックスバランス・オープン	52,086,536円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,528,758,431円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	452,804,007円
SMT 世界経済インデックス・オープン	45,586,394円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	180,360,919円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	31,218,553円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,780,869円
グローバル経済コア	209,721,121円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	31,510,002円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	441,797,259円
DCターゲット・イヤーフンド2055	26,102,137円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	254,441,032円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	22,323,768円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	20,414,992円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	9,051,592円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	12,778,753円
10資産分散投資ファンド	94,560,256円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,182,786,021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）	743,631,635円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	295,706,737円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,341,818円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	566,472,752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）	44,747,908,677円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,315,099円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	213,961,849円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 3月 5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	3,311,194,400	-	3,391,920,000	80,725,600
合計		3,311,194,400	-	3,391,920,000	80,725,600

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年 3月 5日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,253,147,042
コール・ローン	2,635,219,999
国債証券	291,013,760,727
派生商品評価勘定	1,527,807
未収入金	3,858,498,957
未収利息	1,774,713,872
前払金	6,425,706
前払費用	121,770,441
差入委託証拠金	367,051,618
流動資産合計	303,032,116,169
資産合計	303,032,116,169
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,985,212
未払金	6,707,230,842
未払解約金	239,532,906
未払利息	891
流動負債合計	6,953,749,851
負債合計	6,953,749,851
純資産の部	
元本等	
元本	97,879,108,106
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	198,199,258,212
元本等合計	296,078,366,318
純資産合計	296,078,366,318
負債純資産合計	303,032,116,169

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 3月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	2023年 3月 5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)

	2023年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,879,108,106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 3.0249円 (1万口当たり純資産額) (30,249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

	2023年 3月 5日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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	2023年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	101,538,827,807円
期中追加設定元本額	9,253,856,330円
期中一部解約元本額	12,913,576,031円
期末元本額	97,879,108,106円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,237,683,133円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	538,041,190円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円

区分	2023年 3月 5日現在
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,249,757,117円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,411,383円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,785,874,633円
世界経済インデックスファンド	15,924,103,184円
D Cマイセレクション25	1,934,364,344円
D Cマイセレクション50	1,703,582,354円
D Cマイセレクション75	1,191,896,084円
D C外国債券インデックス・オープン	2,281,732,776円
D CマイセレクションS25	1,001,649,834円
D CマイセレクションS50	800,535,943円
D CマイセレクションS75	470,983,890円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	21,402,154円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	96,385,839円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	50,911,675円
D C世界経済インデックスファンド	13,044,271,595円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	468,015,291円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,485,612円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,003,475円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	20,661,837円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	35,821,238円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	56,967,068円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	60,586,905円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	55,634,656円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,054,200,568円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	400,456,175円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,617,266,744円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	61,445,940円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	36,486,582円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	395,397,992円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	148,160,371円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	192,367,584円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	695,500,818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）	3,236,259,409円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	646,259,182円
外国債券ファンド・シリーズ1	734,750,307円
コア投資戦略ファンド（安定型）	191,540,029円
コア投資戦略ファンド（成長型）	956,949,109円
分散投資コア戦略ファンドA	276,386,697円
分散投資コア戦略ファンドS	604,847,674円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	602,480,528円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,155,283,025円
コア投資戦略ファンド（切替型）	444,535,999円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	241,786,962円

区分	2023年 3月 5日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	103,743,452円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,338,316,016円
SMT インデックスバランス・オープン	184,781,046円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	10,857,083,179円
SMT 世界経済インデックス・オープン	319,645,639円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	404,676,877円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	647,938,426円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,445,125円
グローバル経済コア	762,916,400円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	19,343,396円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,029,944円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	102,830,030円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	22,653,358円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	22,066,349円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	26,471,351円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	13,210,272円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	20,916,652円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	154,959,733円
10資産分散投資ファンド	25,992,460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）	151,200,096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）	11,788,404,701円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	328,592,976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）	284,795,497円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	185,345,144円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	829,979,900円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	114,410,382円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	54,404,276円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（2023年 3月 5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	752,551,933	-	746,126,227	6,425,706
合計		752,551,933	-	746,126,227	6,425,706

(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

（2023年 3月 5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	505,947,859	-	507,235,758	1,287,899
	アメリカドル	240,695,781	-	241,554,732	858,951
	カナダドル	34,006,291	-	34,146,642	140,351
	ユーロ	144,808,408	-	144,836,800	28,392
	イギリスポンド	40,925,665	-	40,840,000	85,665
	オフショア人民元	45,511,714	-	45,857,584	345,870
	売建	77,983,589	-	78,303,187	319,598
	アメリカドル	77,770,928	-	78,092,630	321,702
	イスラエルシェケル	212,661	-	210,557	2,104
合計		583,931,448	-	585,538,945	968,301

### (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

	2023年 3月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,853,394,363
コール・ローン	418,905,319
株式	518,280,739,651
投資信託受益証券	182,308,867
投資証券	11,701,176,899
派生商品評価勘定	144,750,790
未収入金	2,554,341
未収配当金	788,875,634
差入委託証拠金	3,650,556,567
流動資産合計	544,023,262,431
資産合計	544,023,262,431



	2023年 3月 5日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	140,295,674
前受金	3,842,270
未払金	214,860,988
未払解約金	218,312,058
未払利息	141
流動負債合計	577,311,131
負債合計	577,311,131
純資産の部	
元本等	
元本	122,486,201,955
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	420,959,749,345
元本等合計	543,445,951,300
純資産合計	543,445,951,300
負債純資産合計	544,023,262,431

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 3月 5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>

2023年 3月 5日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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> <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)

2023年 3月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	122,486,201,955口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 4.4368円 (1万口当たり純資産額) (44,368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

2023年 3月 5日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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	2023年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	128,253,256,319円
期中追加設定元本額	8,040,817,726円
期中一部解約元本額	13,807,872,090円
期末元本額	122,486,201,955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）	1,857,170,131円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,385,235円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,888,328,691円

区分	2023年 3月 5日現在
世界経済インデックスファンド	11,151,502,704円
外国株式インデックス・オープン	906,439,640円
DCマイセレクション25	793,163,923円
DCマイセレクション50	3,682,711,521円
DCマイセレクション75	4,430,320,382円
DC外国株式インデックス・オープン	12,345,507,025円
DCマイセレクションS25	417,035,291円
DCマイセレクションS50	1,920,201,723円
DCマイセレクションS75	1,724,452,516円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	29,032,704円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	147,314,778円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	112,410,530円
DC世界経済インデックスファンド	9,137,434,391円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,169,415,210円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,091,662円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,459,609円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	25,681,531円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	10,667,224円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	40,186,840円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	8,701,162円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	23,972,787円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	216,332,390円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	155,793,322円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,151,451,071円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	84,589,039円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	21,527,075円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	144,071,755円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	46,252,533円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	923,401,665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）	1,002,520,145円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,173,224,842円
コア投資戦略ファンド（安定型）	491,761,850円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,181,204,042円
分散投資コア戦略ファンドA	1,580,128,367円
分散投資コア戦略ファンドS	8,402,108,841円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,318,662,316円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	983,409,933円
コア投資戦略ファンド（切替型）	533,720,506円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	529,377,194円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,550,645円
SMT インデックスバランス・オープン	132,782,528円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	309,754,828円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	10,845,602,392円

区分	2023年 3月 5日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン	223,844,110円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	885,572,073円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	153,290,411円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	4,783,456円
M y S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	580,303,049円
グローバル経済コア	533,482,030円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	15,012,060円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	5,862,279円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	456,682,822円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	93,594,384円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	58,113,541円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	54,576,284円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	24,125,978円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	33,953,067円
10資産分散投資ファンド	54,306,143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）	226,481,608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）	25,535,945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）	847,904,825円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,452,188,499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）	104,302,835円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	84,694,698円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	80,162,701円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	73,463,566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）	223,103,117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）	213,286,445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）	212,187,298円
S M T A M海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	217,861,630円
S M T A M海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	215,611,827円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	108,805,296円
S M T A M海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	136,295,489円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 3月 5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	13,187,978,775	-	13,191,821,045	3,842,270
	合計	13,187,978,775	-	13,191,821,045	3,842,270

## (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

(2023年 3月 5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	260,008,680	-	260,621,526	612,846
	アメリカドル	146,966,400	-	147,574,332	607,932
	ユーロ	113,042,280	-	113,047,194	4,914
	合計	260,008,680	-	260,621,526	612,846

## (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。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 3月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,321,827,516
投資証券	123,216,393,350
派生商品評価勘定	30,709,800
未収入金	55,351,850
未収配当金	1,723,549,251
差入委託証拠金	237,820,000
流動資産合計	127,585,651,767
資産合計	127,585,651,767
負債の部	
流動負債	
前受金	30,709,800
未払金	208,974,889
未払解約金	370,863,838
未払利息	785
流動負債合計	610,549,312

	2023年 3月 5日現在
項目	金額（円）
負債合計	610,549,312
純資産の部	
元本等	
元本	62,025,987,661
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	64,949,114,794
元本等合計	126,975,102,455
純資産合計	126,975,102,455
負債純資産合計	127,585,651,767

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 3月 5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)

	2023年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	62,025,987,661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 2.0471円 (1万口当たり純資産額) (20,471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

	2023年 3月 5日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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	2023年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	54,801,519,931円
期中追加設定元本額	10,363,572,092円
期中一部解約元本額	3,139,104,362円
期末元本額	62,025,987,661円



区分	2023年 3月 5日現在
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,753,109,390円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,323,821円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,715,418,390円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	32,497,541,348円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,403,182,278円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,164,268,574円
分散投資コア戦略ファンドA	809,296,804円
分散投資コア戦略ファンドS	1,788,340,764円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,021,696,978円
S M T インデックスバランス・オープン	25,085,515円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	247,976,186円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	9,424,971円
グローバル経済コア	269,203,265円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,728,888円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	637,380,154円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	130,962,504円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	320,485,449円
10資産分散投資ファンド	23,027,565円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	521,223,749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）	8,900,235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）	461,771,074円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	88,580,131円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	571,595,213円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	251,110,718円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	286,353,697円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2023年 3月 5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	3,719,608,200	-	3,750,318,000	30,709,800
	合計	3,719,608,200	-	3,750,318,000	30,709,800

（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

	2023年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	338,255,096
コール・ローン	51,528,034
投資証券	86,824,826,901
派生商品評価勘定	201,600
未収入金	8,741,471
未収配当金	159,125,942
流動資産合計	87,382,679,044
資産合計	87,382,679,044
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,760
未払解約金	397,100
未払利息	17
流動負債合計	420,877
負債合計	420,877
純資産の部	
元本等	
元本	35,271,394,613
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	52,110,863,554
元本等合計	87,382,258,167
純資産合計	87,382,258,167
負債純資産合計	87,382,679,044

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 3月 5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>

2023年 3月 5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)

2023年 3月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	35,271,394,613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 2.4774円 (1万口当たり純資産額) (24,774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

2023年 3月 5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。

	2023年 3月 5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>(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> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（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	2023年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	41,138,994,709円
期中追加設定元本額	3,020,269,601円
期中一部解約元本額	8,887,869,697円
期末元本額	35,271,394,613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	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	97,897,742円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,710,227,442円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,314,514円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,460,957,719円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	13,668,290,314円
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,133,064円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,090,366,067円
分散投資コア戦略ファンドA	717,849,611円
分散投資コア戦略ファンドS	1,510,713,823円

区分	2023年 3月 5日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	468,025,599円
SMT インデックスバランス・オープン	116,843,334円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	176,477,358円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,040,181円
グローバル経済コア	228,105,166円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,056,011円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	345,064,516円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	68,408,671円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	115,599,341円
10資産分散投資ファンド	12,727,500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）	1,065,736,862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）	188,275,526円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	79,572,046円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	60,546,917円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	35,049,332円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	98,791,022円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	94,599,877円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	94,112,395円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	96,174,734円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	95,221,524円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	77,708,325円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	60,330,612円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（2023年 3月 5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	52,014,000	-	52,215,600	201,600
	香港ドル	52,014,000	-	52,215,600	201,600
	売建	10,112,850	-	10,136,610	23,760
	オーストラリアドル	10,112,850	-	10,136,610	23,760
合計		62,126,850	-	62,352,210	177,840

（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】

（2023年 3月31日現在）

資産総額	310,995,615円
負債総額	120,615円
純資産総額（ - ）	310,875,000円
発行済口数	247,745,585口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2548円
（1万口当たり純資産額）	（12,548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

（2023年 3月31日現在）

資産総額	635,965,476,217円
負債総額	5,454,555,782円
純資産総額（ - ）	630,510,920,435円
発行済口数	461,944,153,214口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3649円
（1万口当たり純資産額）	（13,649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

（2023年 3月31日現在）

資産総額	528,009,608,503円
負債総額	549,731,582円
純資産総額（ - ）	527,459,876,921円
発行済口数	259,604,331,418口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0318円
（1万口当たり純資産額）	（20,318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

(2023年 3月31日現在)

資産総額	301,090,997,995円
負債総額	72,387,715円
純資産総額（ - ）	301,018,610,280円
発行済口数	97,780,069,141口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0785円
（1万口当たり純資産額）	（30,785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

(2023年 3月31日現在)

資産総額	544,400,542,383円
負債総額	673,025,424円
純資産総額（ - ）	543,727,516,959円
発行済口数	123,453,098,532口
1口当たり純資産額（ / ）	4.4043円
（1万口当たり純資産額）	（44,043円）

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 3月31日現在)

資産総額	126,905,358,280円
負債総額	757,075,479円
純資産総額（ - ）	126,148,282,801円
発行済口数	62,858,276,081口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0069円
（1万口当たり純資産額）	（20,069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



(2023年 3月31日現在)

資産総額	83,558,862,116円
負債総額	540,782,546円
純資産総額（ - ）	83,018,079,570円
発行済口数	35,899,771,910口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3125円
（1万口当たり純資産額）	（23,125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（2023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年間ににお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。

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2023年 6月 5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。

2023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	531	14,256,696
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	207,566
単位型公社債投資信託	53	182,130
合計	652	14,646,392

## 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36期事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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37期事業年度の中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292
その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

（単位：百万円）

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日 )	当事業年度 ( 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

（単位：百万円）

	前事業年度	当事業年度
	（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

## （ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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



	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					

当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	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	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 注記事項

（重要な会計方針）

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### （1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4．固定資産の減価償却の方法

#### （1）有形固定資産

定額法によっております。

#### （2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

### 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6．引当金の計上基準

#### （1）賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

#### （2）退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債

務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

## 7. 収益及び費用の計上基準

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

### (1) 投資信託委託業務

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

### (2) 投資一任業務

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

### (3) 投資助言業務

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

### (4) 成功報酬

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

## 8. ヘッジ会計の会計処理

### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

### (3) ヘッジ方針

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

### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

## 9. 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

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日）を適用する予定であります。

## (会計方針の変更)

### 1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

### 2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-21項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来に

わたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

（未適用の会計基準等）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であり、

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る事業年度末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当事業年度より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、「重要な会計方針 6 . 引当金の計上基準（2）退職給付引当金」をご参照ください。

（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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	"	535	"
そ の 他	4	"	-	"
計	503	"	681	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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
----	-------	-----------------	-----------------	-----	-------

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
----------------------	------	-------	-----------	------------	------------

## 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
2021年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24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

2022年6月23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
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022年6月24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8．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 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、それら的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あります。

#### 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. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）参照）。

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

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

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

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

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

### (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950

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	(357)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(431)

（\*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（2022年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	-	196	-	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（\*2）投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

（\*3）金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

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

（2）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

#### デリバティブ取引

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 （2021年3月31日）	当事業年度 （2022年3月31日）
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

（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（2021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	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-

未収運用受託報酬	6,151	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0

当事業年度(2022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	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

## 2. その他有価証券

前事業年度(2021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	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えない もの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

当事業年度(2022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	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えない もの			
その他	1,585	1,711	126
小計	1,585	1,711	126
合計	6,474	5,115	1,358



非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等		133

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021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	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
香港ドル	2	-	0	0	
合計		3,567	-	41	41

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

##### （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	13,711	-	315	315
合計		13,711	-	315	315

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

#### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

当事業年度（2022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	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
合計	6,915	-	80	80	

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (2) 株式関連

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	17,197	-	1,333	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
--------------	----	---------	---------------	-------------------------	-------------

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
合計			8,057	-	71

## (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。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

## 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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	600		626	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
転籍者受入	18		-	
退職給付の支払額	69		81	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-		120	
その他	-		18	
退職給付債務の期末残高	626		820	

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
非積立型制度の退職給付債務	626		820	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626		820	
退職給付引当金	626		820	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626		820	

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	

簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	-	0.4%

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度92百万円、当事業年度100百万円であります。

(税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	107 百万円	112 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170 "	177 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	191 "	251 "
税務上の収益認識差額	71 "	74 "
税務上の費用認識差額	-	439
繰延ヘッジ損益	28 "	224 "
その他	123 "	76 "
繰延税金資産 合計	693 "	1,357 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	349 "	415 "
その他	32 "	34 "
繰延税金負債 合計	382 "	450 "
繰延税金資産の純額	311 "	907 "

#### 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。

(収益認識関係)

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

#### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

#### 3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 〔セグメント情報等〕

## 〔セグメント情報〕

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

## 〔関連情報〕

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,372百万円

(\*)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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(\*)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〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔関連当事者情報〕

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

(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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(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（2021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（2022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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

現金及び預金		21,051
金銭の信託		13,989
未収委託者報酬		9,325
未収運用受託報酬		5,831
短期差入証拠金		4,507
その他		3,041
流動資産合計		57,747

##### 固定資産

有形固定資産	1	895
無形固定資産		6,915
投資その他の資産		
投資有価証券		4,202
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,228
その他		31
投資その他の資産合計		11,098

固定資産合計		18,909
--------	--	--------

資産合計		76,657
------	--	--------

#### 負債の部

##### 流動負債

未払金		7,649
未払法人税等		1,537
賞与引当金		321
その他	2	2,111
流動負債合計		11,619

##### 固定負債

退職給付引当金		871
---------	--	-----

資産除去債務	153
その他	20
固定負債合計	1,045
負債合計	12,665

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022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	42,655
利益剰余金合計	45,255
株主資本合計	64,494
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	278
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	502
純資産合計	63,992
負債・純資産合計	76,657

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		20,422
運用受託報酬		5,485
その他営業収益		178
営業収益合計		26,086
営業費用		15,618
一般管理費	1	6,047
営業利益		4,421
営業外収益	2	2,365
営業外費用	3	1,945
経常利益		4,840
税引前中間純利益		4,840
法人税、住民税及び事業税		1,402
法人税等調整額		90



法人税等合計	1,492
中間純利益	3,347

## 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
中間純利益			3,347	3,347	3,347
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	-	-	706	706	706
当中間期末残高	500	2,100	42,655	45,255	64,494

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額 等 合計	
当期首残高	941	509	431	64,219
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,641
中間純利益				3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	663	270	933	933
当中間期変動額合計	663	270	933	227
当中間期末残高	278	780	502	63,992

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

## (2) デリバティブ

時価法によっております。

## (3) 金銭の信託

時価法によっております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づいて償却しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

## 4. 収益及び費用の計上基準

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

## (1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱いの適用

当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日。以下、「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

## （表示方法の変更）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
従来「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。	

## （中間貸借対照表関係）

第37期中間会計期間末 （2022年9月30日）	
1	有形固定資産の減価償却累計額 777百万円
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37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 95百万円
	無形固定資産 608百万円
2	営業外収益の主要項目
	デリバティブ利益 2,027百万円
	投資有価証券売却益 317百万円
3	営業外費用の主要項目
	為替差損 1,011百万円
	金銭の信託運用損 904百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

#### (リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

#### (金融商品関係)

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

#### (1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額（百万円）(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	952	12,129	-	13,081
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,978	-	3,978
資産計	952	16,107	-	17,060
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	804	(0)	-	804
ヘッジ会計が適用されているもの	-	22	-	22
デリバティブ取引計	804	21	-	826

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。

(\*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は上記に含めておりません。

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

（2）時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

（注2）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	2,657	1,966	690
小計	2,657	1,966	690

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,321	1,615	293
小計	1,321	1,615	293
合計	3,978	3,581	397

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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	6,412	-	5	5
	英ポンド	250	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	164	-	1	1
	香港ドル	219	-	0	0
	ユーロ	721	-	0	0
	買建				
	米ドル	259	-	0	0
	香港ドル	2	-	0	0
合計	8,141	-	0	0	

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,818	-	804	804
合計		13,818	-	804	804

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)

原則的 処理方法	為替予約取引	投資有価証券 関係会社株式			
	売建				
	米ドル		3,036	-	2
	英ポンド		3,333	-	19
	スイスフラン		70	-	0
	香港ドル		87	-	0
	ユーロ		82	-	0
	買建				
	米ドル		93	-	0
	英ポンド		77	-	2
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		3	-	0
	ユーロ		60	-	1
	合計		6,898	-	22

## （資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （収益認識関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

## 3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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	4,950百万円



## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1株当たり純資産額	21,330,712円74銭
1株当たり中間純利益	1,115,947円92銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（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37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
中間純利益	3,347百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	3,347百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## 4【利害関係人との取引制限】

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

## (1)自己又はその役員との取引

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

## (2)運用財産相互間の取引

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

## (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2023年 6月 5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(2022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) (2022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（2022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。

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**

2022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 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

**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2021年4月1日から2022年3月31日までの第36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2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年11月15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

## 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2021年9月7日から2022年9月5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2022年9月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

2022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 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

**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2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022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（2022年4月1日から2022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

2023年5月17日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 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2022年9月6日から2023年3月5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2023年3月5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（2022年9月6日から2023年3月5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。