【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年8月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　民野　誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）
【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（分配型）
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】

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

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）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。

（7）【申込期間】

2021年 8月11日から2022年 2月10日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、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＞
当ファンドは「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）専用ファンドです。
＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞
取引所（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なら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＞

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。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

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

＜信託金限度額＞

上限　5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でもご覧いただけます。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

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

［投資対象地域による区分］

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

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

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

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

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

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

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

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

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

［独立した区分］

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

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

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

［補足分類］

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

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

＜属性区分表定義＞

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

(3)北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とす

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

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

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

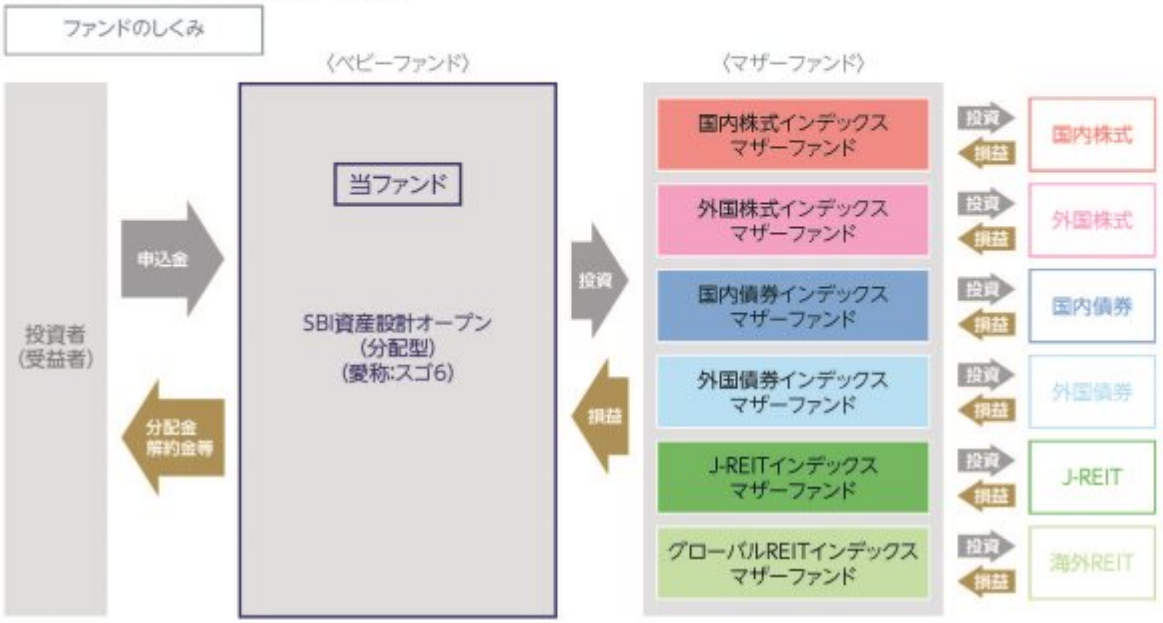
[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

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

＜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。

ポートフォリオ構築	ファンドマネジャー	●基本組入比率に従って、各マザーファンドへ資金を配分
リバランス実施	ファンドマネジャー	●各マザーファンドの組入比率が基本組入比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※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、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株

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

「MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

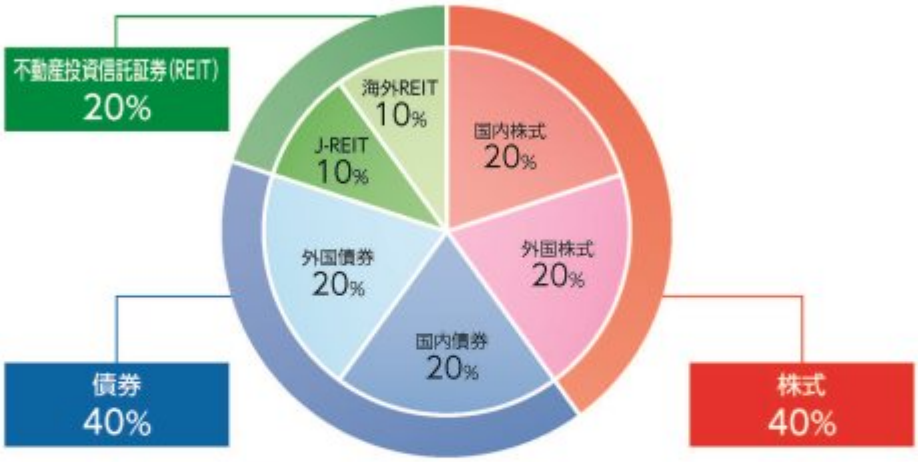
「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE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

「東証REIT指数」とは、東証が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's(R)およびS&P(R)は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones(R)はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

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

基本組入比率



●基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
●基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。

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0.748%(税抜0.68%)です。）

5. 原則として、年6回（1月、3月、5月、7月、9月、11月の10日（休業日の場合は翌営業日））の決算時に収益の分配を目指します。また、年2回（1月、7月）の決算時には、加算分配（以下「ボーナス分配」ということがあります。）を目指します。

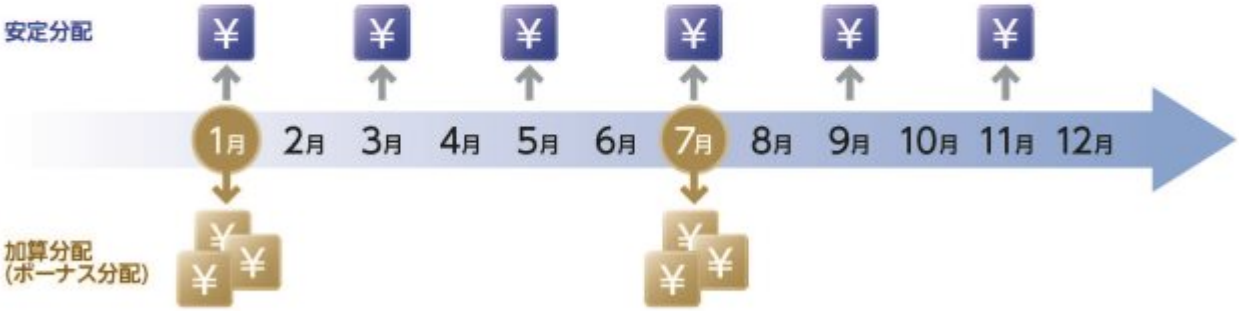
分配方針

●原則として、年6回（1月、3月、5月、7月、9月、11月の10日（休業日の場合は翌営業日））決算を行い、安定した分配を目指します。

●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等の全額とします。

●年2回（1月、7月）の決算時には、売買益を配当等収益に加算して分配することを目指します。

収益分配のイメージ



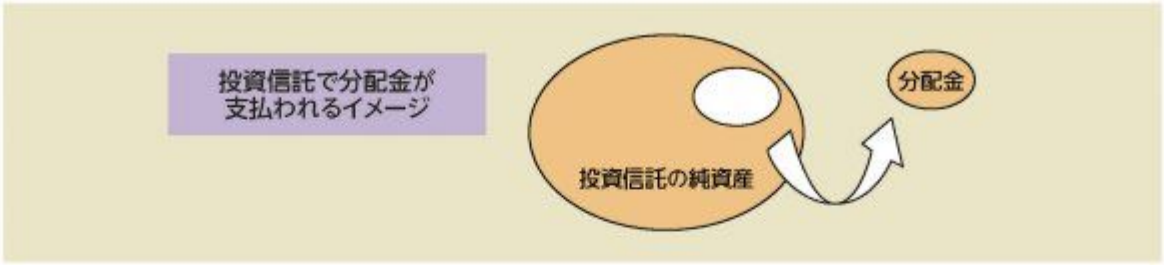
※上記はイメージであり、将来の分配金の支払い及びその金額について示唆あるいは保証するものではありません。

●分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

●売買益が確保できた場合でも、基準価額水準、市況動向等を勘案して、ボーナス分配を行わないことがあります。

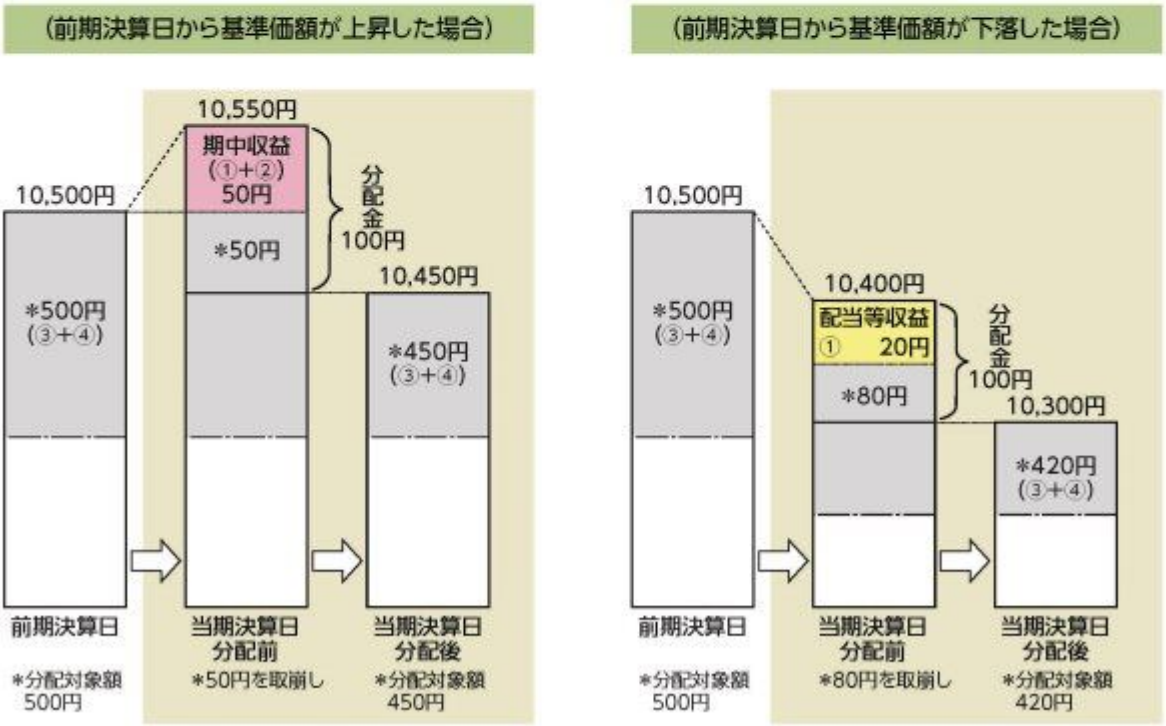
[収益分配金に関する留意事項]

●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。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

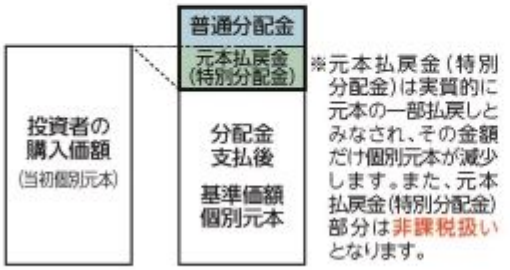


(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

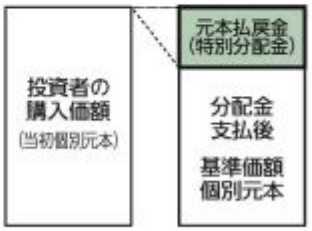
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆あるいは保証するものではありませんのでご留意ください。

●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。

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)



(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

（注）普通分配金に対する課税については、後掲「4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」をご覧ください。

主な投資制限

●株式への直接投資は行いません。

●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。

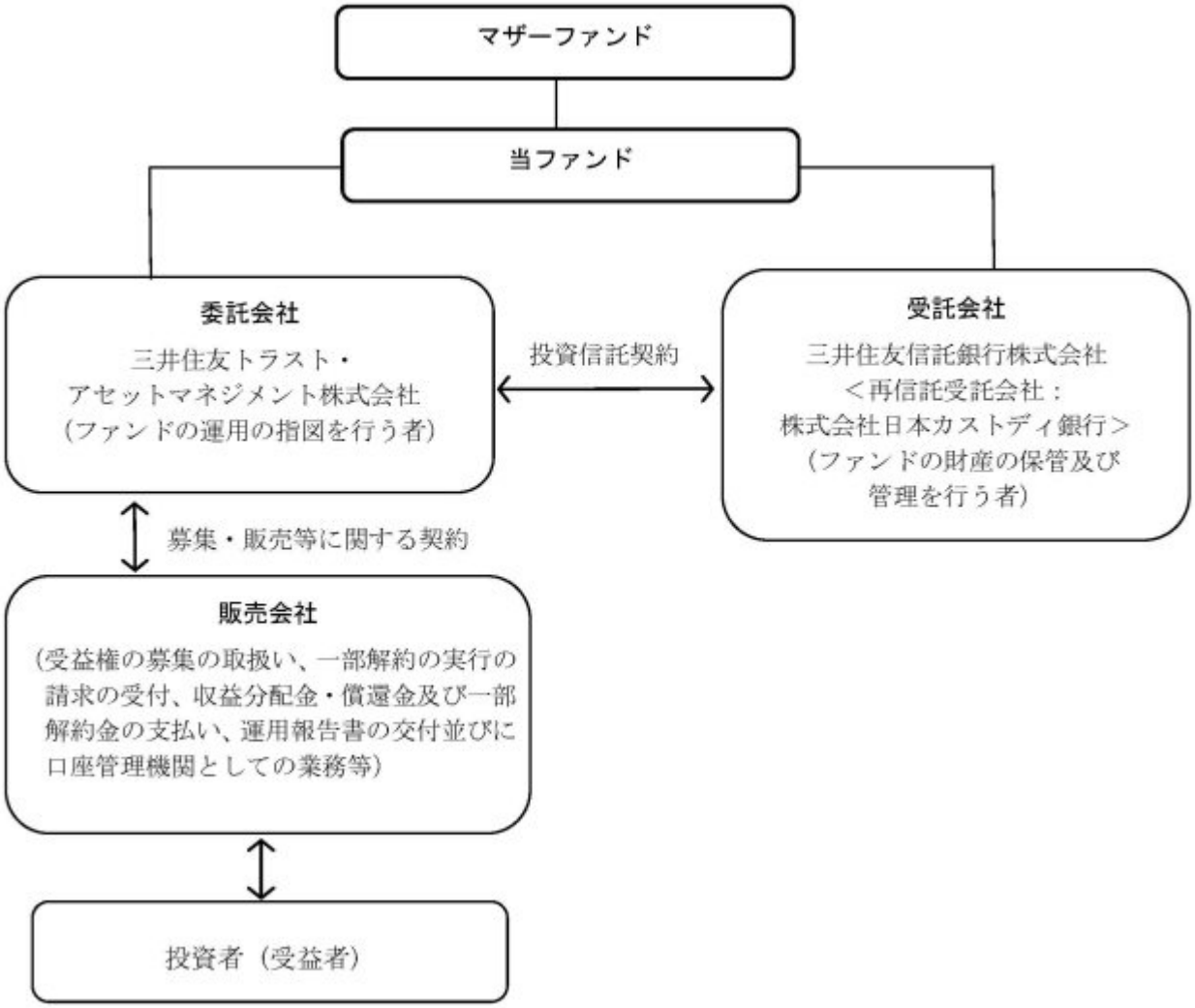
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2008年1月9日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年4月1日	本ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 J-REITインデックス マザーファンド」の名称を「J-REITインデックス マザーファンド」に、「住信 グローバルREITインデックス マザーファンド」の名称を「グローバルREITインデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2021年 5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】

（イ）基本方針

本ファンドは、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」および「グローバルREITインデックス マザーファンド」（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内外の公社債、株式およ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、安定したインカムゲインの確保と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）運用方法

①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。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、主要投資対象の見直しおよび追加が行われる場合があります。

②投資態度

1)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、株式およ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。

2)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。

マザーファンド受益証券	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	20%
国内株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
外国債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
外国株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
J-REITインデックス マザーファンド受益証券	10%
グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券	10%

3)前記2)に定める各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

4)各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。

5)実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。

6)株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として投資信託財産総額の70%以下とします。

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

（2）【投資対象】

（イ）本ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託会社は、信託金を主として次に掲げる第1号から第6号までの三井住友トラスト・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マザーファンドの受益証券ならびに第7号から第11号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1.国内債券インデックス マザーファンド

2.国内株式インデックス マザーファンド

3.外国債券インデックス マザーファンド

4.外国株式インデックス マザーファンド

5.J-REITインデックス マザーファンド

6.グローバルREITインデックス マザーファンド

7.コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

8.外国または外国の者の発行する証券または証書で、第7号の証券の性質を有するもの

9.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および社債券（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および短期社債等を除きます。）

10.外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、第9号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（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。

（ハ）委託会社は、信託金を、前記（ロ）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

（ニ）前記（ロ）の規定にかかわらず、本ファンドの設定、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、信託金を前記（ハ）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

①NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

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

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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（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およ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ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する

外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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

①FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投

資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引およ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ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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

①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。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスクおよ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、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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

①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに東証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およ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。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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および短期社債等を除きます。）をいいます。）およ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）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

④外貨建資産への投資は行いません。

⑤投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引および外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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なら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なら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

①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）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不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②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。

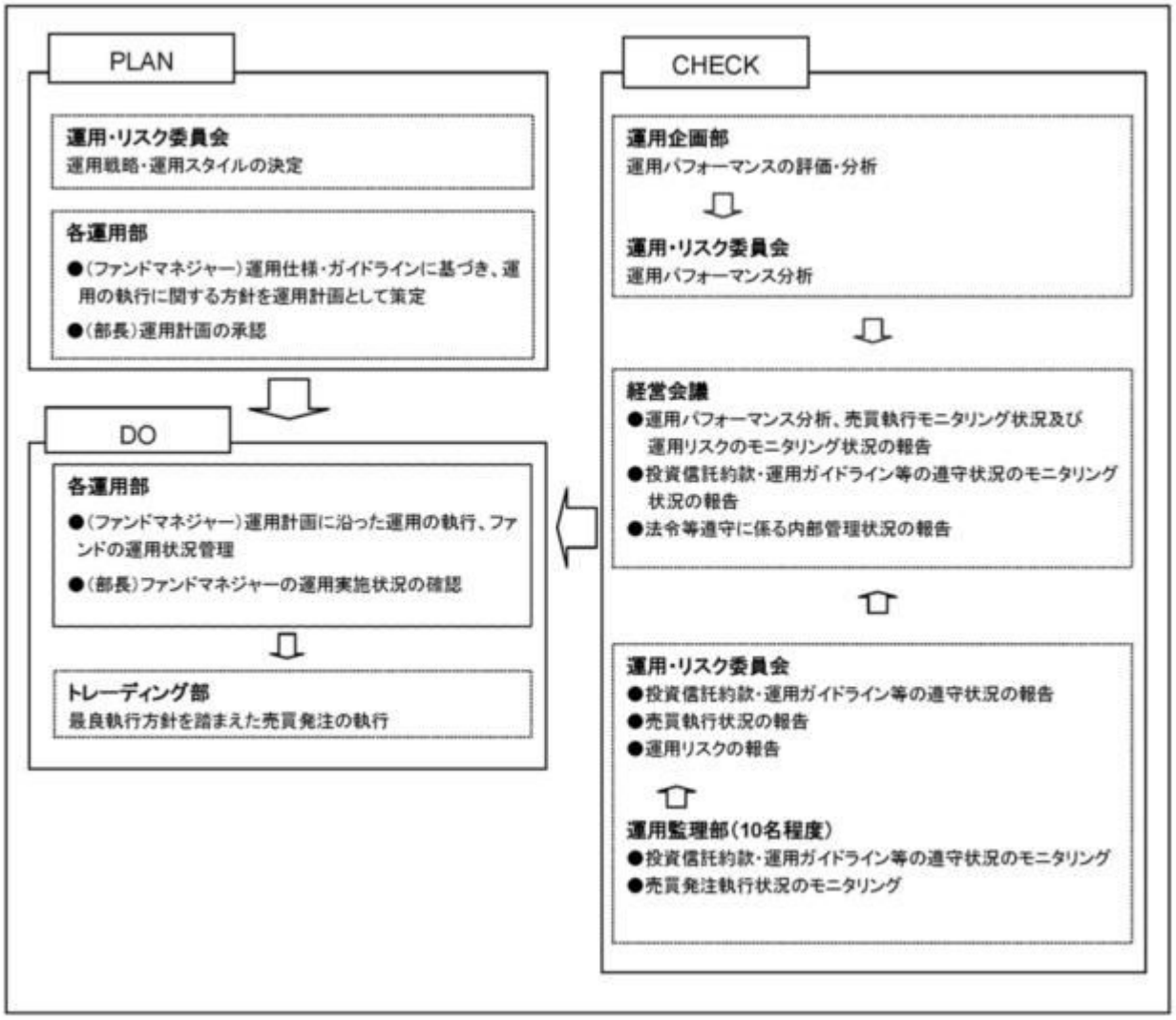
③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー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】

毎決算時（決算日は奇数月の10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

・分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。
・分配については、原則として、配当等収益を中心として、毎決算時に安定した分配を行うことをめざします。また、1月および7月の決算期には、売買益に相当する額を上乗せして分配することをめざします。なお、売買益が確保できた場合でも、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場

合は、上乗せの分配を行わないことがあります。委託会社はこのほか、基準価額水準、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断にもとづき、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＞

①株式への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

②外貨建資産への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

③デリバティブへの直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

④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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑤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、この指図は、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。（投資信託約款第19条）

⑥委託会社は、投資信託財産の効率的な運用なら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入れた資金の返済を含みます。）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。また、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また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、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第26条）

⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

※前記④における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対するマザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの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。

＜その他の投資制限＞

イ.当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、

投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3【投資リスク】

（イ）ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。
●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク
株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥流動性リスク
時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑦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＞

①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。
②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。

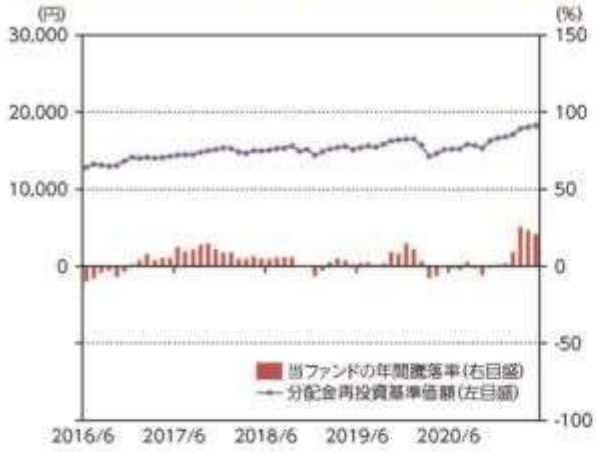
（ロ）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

＊2016年6月～2021年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCI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、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより算出されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.15%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す。

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、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0.748%（税抜　0.68%）（※）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。

内訳（純資産総額に対して）	支払先	純資産総額			主な役務
		100億円以下の部分	100億円超300億円以下の部分	300億円超の部分	
	委託会社	年率　0.418% (税抜　0.38%)	年率　0.352% (税抜　0.32%)	年率　0.286% (税抜　0.26%)	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　0.286% (税抜　0.26%)	年率　0.352% (税抜　0.32%)	年率　0.418% (税抜　0.38%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年率　0.044% (税抜　0.04%)	年率　0.044% (税抜　0.04%)	年率　0.044% (税抜　0.04%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

③信託報酬に係る消費税等に相当する額を、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】

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

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

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

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

⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、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ます。）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）」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。

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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

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

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

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

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

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

※上記は、2021年 5月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2021年5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（分配型）】

（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	117,706,489	98.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,961,954	1.64
合計(純資産総額)		119,668,443	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(％)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス　マザーファンド	7,005,685	3.7204	26,063,951	3.7583	26,329,465	22.00
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	13,712,867	1.8820	25,807,616	1.8550	25,437,368	21.26
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	7,391,523	3.0399	22,469,491	3.0717	22,704,541	18.97
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	13,063,855	1.4086	18,401,747	1.4082	18,396,520	15.37
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	5,829,003	2.1180	12,345,829	2.1617	12,600,555	10.53
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	5,632,901	2.1499	12,110,174	2.1726	12,238,040	10.23

(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	98.36
合計	98.36

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第8特定期間末 (2011年11月10日)	113,662,210	114,093,210	6,593	6,618
第9特定期間末 (2012年 5月10日)	117,721,563	118,141,313	7,011	7,036
第10特定期間末 (2012年11月12日)	117,895,984	118,311,884	7,087	7,112
第11特定期間末 (2013年 5月10日)	147,321,414	147,697,364	9,797	9,822
第12特定期間末 (2013年11月11日)	122,040,492	122,357,417	9,627	9,652
第13特定期間末 (2014年 5月12日)	104,682,013	104,940,638	10,119	10,144
第14特定期間末 (2014年11月10日)	115,231,346	115,486,796	11,277	11,302
第15特定期間末 (2015年 5月11日)	152,350,349	152,677,449	11,644	11,669
第16特定期間末 (2015年11月10日)	203,190,644	203,656,069	10,914	10,939
第17特定期間末 (2016年 5月10日)	184,525,169	184,988,894	9,948	9,973
第18特定期間末 (2016年11月10日)	177,476,666	177,936,466	9,650	9,675
第19特定期間末 (2017年 5月10日)	181,966,182	182,396,932	10,561	10,586
第20特定期間末 (2017年11月10日)	168,947,238	169,332,538	10,962	10,987
第21特定期間末 (2018年 5月10日)	124,494,067	124,793,617	10,390	10,415
第22特定期間末 (2018年11月12日)	121,941,464	122,235,614	10,364	10,389
第23特定期間末 (2019年 5月10日)	116,468,041	116,749,791	10,334	10,359
第24特定期間末 (2019年11月11日)	114,747,322	115,010,172	10,914	10,939
第25特定期間末 (2020年 5月11日)	94,892,059	95,144,959	9,380	9,405
第26特定期間末 (2020年11月10日)	104,375,978	104,632,353	10,178	10,203
第27特定期間末 (2021年 5月10日)	118,923,786	119,183,611	11,443	11,468
2020年 5月末日	97,882,143	—	9,654	—
6月末日	98,513,328	—	9,701	—
7月末日	99,185,771	—	9,698	—
8月末日	103,167,586	—	10,079	—
9月末日	102,059,416	—	9,958	—
10月末日	99,730,275	—	9,726	—
11月末日	105,821,733	—	10,319	—
12月末日	112,116,787	—	10,526	—
2021年 1月末日	111,877,071	—	10,600	—
2月末日	113,958,603	—	10,816	—
3月末日	117,469,209	—	11,262	—
4月末日	118,326,837	—	11,384	—
5月末日	119,668,443	—	11,486	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第8特定期間	2011年 5月11日～2011年11月10日	91
第9特定期間	2011年11月11日～2012年 5月10日	75
第10特定期間	2012年 5月11日～2012年11月12日	75
第11特定期間	2012年11月13日～2013年 5月10日	75
第12特定期間	2013年 5月11日～2013年11月11日	75
第13特定期間	2013年11月12日～2014年 5月12日	75
第14特定期間	2014年 5月13日～2014年11月10日	75
第15特定期間	2014年11月11日～2015年 5月11日	575
第16特定期間	2015年 5月12日～2015年11月10日	575
第17特定期間	2015年11月11日～2016年 5月10日	425
第18特定期間	2016年 5月11日～2016年11月10日	75
第19特定期間	2016年11月11日～2017年 5月10日	75
第20特定期間	2017年 5月11日～2017年11月10日	125
第21特定期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	575
第22特定期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	75
第23特定期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	75
第24特定期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	75
第25特定期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	575
第26特定期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	75
第27特定期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	75

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第8特定期間	2011年 5月11日～2011年11月10日	△9.7
第9特定期間	2011年11月11日～2012年 5月10日	7.5
第10特定期間	2012年 5月11日～2012年11月12日	2.2
第11特定期間	2012年11月13日～2013年 5月10日	39.3
第12特定期間	2013年 5月11日～2013年11月11日	△1.0
第13特定期間	2013年11月12日～2014年 5月12日	5.9
第14特定期間	2014年 5月13日～2014年11月10日	12.2
第15特定期間	2014年11月11日～2015年 5月11日	8.4
第16特定期間	2015年 5月12日～2015年11月10日	△1.3
第17特定期間	2015年11月11日～2016年 5月10日	△5.0
第18特定期間	2016年 5月11日～2016年11月10日	△2.2
第19特定期間	2016年11月11日～2017年 5月10日	10.2
第20特定期間	2017年 5月11日～2017年11月10日	5.0

第21特定期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.0
第22特定期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.5
第23特定期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0.4
第24特定期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	6.3
第25特定期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	△8.8
第26特定期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	9.3
第27特定期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	13.2

(注1)収益率とは、各特定期間末の基準価額(分配落)から前特定期間末の基準価額(分配落)を控除した額に特定期間中の分配金累計額を加算し、前特定期間末の基準価額(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8特定期間	2011年 5月11日～2011年11月10日	5,390,000	15,530,000	172,400,000
第9特定期間	2011年11月11日～2012年 5月10日	2,580,000	7,080,000	167,900,000
第10特定期間	2012年 5月11日～2012年11月12日	3,110,000	4,650,000	166,360,000
第11特定期間	2012年11月13日～2013年 5月10日	18,410,000	34,390,000	150,380,000
第12特定期間	2013年 5月11日～2013年11月11日	4,390,000	28,000,000	126,770,000
第13特定期間	2013年11月12日～2014年 5月12日	2,830,000	26,150,000	103,450,000
第14特定期間	2014年 5月13日～2014年11月10日	8,870,000	10,140,000	102,180,000
第15特定期間	2014年11月11日～2015年 5月11日	34,550,000	5,890,000	130,840,000
第16特定期間	2015年 5月12日～2015年11月10日	83,140,000	27,810,000	186,170,000
第17特定期間	2015年11月11日～2016年 5月10日	18,390,000	19,070,000	185,490,000
第18特定期間	2016年 5月11日～2016年11月10日	8,720,000	10,290,000	183,920,000
第19特定期間	2016年11月11日～2017年 5月10日	30,870,000	42,490,000	172,300,000
第20特定期間	2017年 5月11日～2017年11月10日	61,680,000	79,860,000	154,120,000
第21特定期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	780,000	35,080,000	119,820,000
第22特定期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	190,000	2,350,000	117,660,000
第23特定期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	490,000	5,450,000	112,700,000
第24特定期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	1,020,000	8,580,000	105,140,000
第25特定期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	3,890,000	7,870,000	101,160,000
第26特定期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	1,960,000	570,000	102,550,000
第27特定期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	6,200,000	4,820,000	103,930,000

(注)当該特定期間中において、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	525,432,430,000	83.62
地方債証券	日本	34,036,521,966	5.42
特殊債券	日本	39,338,438,637	6.26
社債券	日本	26,659,799,160	4.24
	フランス	1,101,387,000	0.18
	オーストラリア	399,688,000	0.06
	小計	28,160,874,160	4.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,397,905,758	0.22
合計(純資産総額)		628,366,170,521	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	8,240,000,000	100.99	8,321,576,000	100.95	8,318,362,400	0.100	2025/9/20	1.32
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	7,960,000,000	101.20	8,055,599,200	101.05	8,044,137,200	0.100	2028/3/20	1.28
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	7,790,000,000	100.98	7,866,880,700	100.74	7,848,113,400	0.100	2024/9/20	1.25
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	7,050,000,000	100.91	7,114,155,000	100.60	7,092,441,000	0.100	2023/12/20	1.13
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	100.86	6,818,136,000	100.54	6,796,706,800	0.100	2023/9/20	1.08
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	6,640,000,000	101.42	6,734,288,000	100.98	6,705,404,000	0.100	2026/9/20	1.07
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	6,520,000,000	100.98	6,583,896,000	100.91	6,579,723,200	0.100	2025/6/20	1.05
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	102.83	6,498,856,000	102.24	6,462,136,800	0.400	2025/9/20	1.03
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	6,350,000,000	101.36	6,436,406,300	101.01	6,414,706,500	0.100	2027/3/20	1.02
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	6,300,000,000	100.99	6,362,370,000	100.70	6,344,352,000	0.100	2024/6/20	1.01
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	6,150,000,000	100.74	6,195,510,000	100.46	6,178,474,500	0.100	2030/9/20	0.98
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	6,070,000,000	100.89	6,124,055,000	100.66	6,110,062,000	0.100	2024/3/20	0.97
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	5,700,000,000	100.67	5,738,190,000	100.35	5,720,406,000	0.100	2022/12/20	0.91
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	5,380,000,000	101.31	5,450,478,000	100.96	5,431,863,200	0.100	2026/3/20	0.86
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	5,380,000,000	101.07	5,437,566,000	100.80	5,423,201,400	0.100	2024/12/20	0.86
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	4,900,000,000	102.76	5,035,240,000	102.23	5,009,564,000	0.600	2024/6/20	0.80

日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	4,850,000,000	102.72	4,981,920,000	102.13	4,953,693,000	0.400	2025/6/20	0.79
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	4,880,000,000	101.50	4,953,361,200	101.04	4,930,947,200	0.100	2027/9/20	0.78
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	102.54	4,922,030,800	101.87	4,889,760,000	0.600	2023/12/20	0.78
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	4,820,000,000	101.26	4,881,165,000	100.96	4,866,464,800	0.100	2026/6/20	0.77
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	4,800,000,000	100.98	4,847,190,000	100.85	4,841,232,000	0.100	2025/3/20	0.77
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	4,740,000,000	99.97	4,738,702,200	100.33	4,755,736,800	0.100	2030/12/20	0.76
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	4,690,000,000	101.23	4,747,687,000	100.89	4,732,116,200	0.100	2029/3/20	0.75
日本	国債証券	第４１６回利付国債（２年）	4,670,000,000	100.45	4,691,015,000	100.30	4,684,056,700	0.100	2022/9/1	0.75
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	4,640,000,000	100.88	4,680,832,000	100.78	4,676,563,200	0.100	2029/9/20	0.74
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	4,610,000,000	101.47	4,677,767,000	101.02	4,657,252,500	0.100	2028/6/20	0.74
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	102.39	4,669,250,400	102.00	4,651,382,400	0.400	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第３２５回利付国債（１０年）	4,590,000,000	101.85	4,675,151,800	101.20	4,645,447,200	0.800	2022/9/20	0.74
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	4,580,000,000	100.68	4,611,334,800	100.54	4,604,777,800	0.100	2030/6/20	0.73
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	4,400,000,000	100.69	4,430,706,100	100.48	4,421,252,000	0.100	2023/6/20	0.70

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.62
地方債証券	5.42
特殊債券	6.26
社債券	4.48
合計	99.78

(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	455,964,175,980	98.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	6,871,529,851	1.48
合計(純資産総額)		462,835,705,831	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	6,749,750,000	1.46

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,750,200	7,039.23	12,320,064,827	9,115.00	15,953,073,000	3.45
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,082,300	8,032.80	8,693,902,620	10,785.00	11,672,605,500	2.52
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,345,200	5,893.99	7,928,607,750	8,256.00	11,105,971,200	2.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	169,600	47,732.19	8,095,380,860	53,870.00	9,136,352,000	1.97
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,656,200	460.11	5,363,230,300	620.00	7,226,844,000	1.56
日本	株式	任天堂	その他製品	98,900	48,659.61	4,812,436,326	67,700.00	6,695,530,000	1.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,182,600	4,004.75	4,736,021,080	5,555.00	6,569,343,000	1.42
日本	株式	信越化学工業	化学	312,900	14,178.39	4,436,419,235	18,855.00	5,899,729,500	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,983,000	2,506.48	4,970,361,249	2,931.50	5,813,164,500	1.26
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,437,400	4,050.03	5,821,524,080	3,719.00	5,345,690,600	1.15
日本	株式	日本電産	電気機器	415,900	8,387.20	3,488,239,580	12,530.00	5,211,227,000	1.13
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,359,600	3,169.84	4,309,719,103	3,717.00	5,053,633,200	1.09
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	101,200	25,973.21	2,628,489,288	48,660.00	4,924,392,000	1.06
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	340,000	10,805.04	3,673,715,338	14,350.00	4,879,000,000	1.05
日本	株式	日立製作所	電気機器	830,700	3,785.96	3,145,002,048	5,736.00	4,764,895,200	1.03
日本	株式	ダイキン工業	機械	220,100	17,714.03	3,898,858,804	21,605.00	4,755,260,500	1.03

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,179,200	3,214.93	3,791,045,529	3,951.00	4,659,019,200	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,360,300	2,829.73	3,849,286,623	3,353.00	4,561,085,900	0.99
日本	株式	村田製作所	電気機器	507,600	6,790.96	3,447,092,016	8,279.00	4,202,420,400	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	151,600	21,058.12	3,192,411,565	26,300.00	3,987,080,000	0.86
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,315,400	1,387.83	3,213,392,914	1,673.00	3,873,664,200	0.84
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,190,100	2,506.00	2,982,393,874	3,249.00	3,866,634,900	0.84
日本	株式	第一三共	医薬品	1,357,700	3,307.39	4,490,443,976	2,530.00	3,434,981,000	0.74
日本	株式	ＳＭＣ	機械	50,600	56,792.99	2,873,725,362	65,520.00	3,315,312,000	0.72
日本	株式	三井物産	卸売業	1,357,400	1,734.22	2,354,037,994	2,414.00	3,276,763,600	0.71
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	665,700	3,780.07	2,516,398,760	4,736.00	3,152,755,200	0.68
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,036,000	2,579.42	2,672,280,578	2,984.00	3,091,424,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,727,600	1,483.00	2,562,036,924	1,692.00	2,923,099,200	0.63
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	561,200	4,858.26	2,726,458,754	5,179.00	2,906,454,800	0.63
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	175,600	15,952.06	2,801,182,201	16,310.00	2,864,036,000	0.62

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.17
		建設業	2.29
		食料品	3.34
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.27
		医薬品	5.01
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.66
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.61
		機械	5.54
		電気機器	17.52
		輸送用機器	7.52
		精密機器	2.67
		その他製品	2.52
		電気・ガス業	1.21
		陸運業	3.27

		海運業	0.27
		空運業	0.47
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	8.89
		卸売業	4.65
		小売業	4.46
		銀行業	5.10
		証券、商品先物取引業	0.81
		保険業	1.92
		その他金融業	1.11
		不動産業	1.97
		サービス業	5.53
		小計	98.52
合計			98.52

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物	買建	350	円	6,850,854,700	6,749,750,000	1.46

(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	132,115,094,711	43.42
	フランス	30,970,696,394	10.18
	イタリア	28,417,855,854	9.34
	ドイツ	22,536,372,411	7.41
	イギリス	19,785,369,114	6.50
	スペイン	18,202,803,911	5.98
	ベルギー	7,233,204,858	2.38

	オーストラリア	6,569,251,479	2.16
	カナダ	6,190,083,364	2.03
	オランダ	5,819,811,099	1.91
	オーストリア	4,485,399,337	1.47
	アイルランド	2,501,713,224	0.82
	メキシコ	2,399,051,797	0.79
	ポーランド	1,904,317,299	0.63
	フィンランド	1,846,189,676	0.61
	デンマーク	1,534,167,724	0.50
	マレーシア	1,425,343,880	0.47
	イスラエル	1,356,443,547	0.45
	シンガポール	1,291,459,562	0.42
	スウェーデン	1,091,472,367	0.36
	ノルウェー	750,250,784	0.25
	小計	298,426,352,392	98.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,829,240,629	1.92
合計(純資産総額)		304,255,593,021	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	1,430,303,129	0.47
	買建	ドイツ	1,950,065,614	0.64

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	4,662,029,884	1.53

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	15,950,000	10,838.07	1,728,672,432	10,121.07	1,614,311,072	0.625	2030/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	10,425.36	1,569,017,317	10,535.24	1,585,554,372	1.125	2031/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,926.07	1,540,576,191	10,162.23	1,432,874,789	0.625	2030/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	10,958.12	1,424,556,850	10,977.71	1,427,102,950	0.250	2024/3/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	12,371.15	1,329,898,899	11,842.07	1,273,023,062	2.375	2027/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	10,845.01	1,247,176,989	10,855.95	1,248,434,250	0.500	2026/2/28	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/40	13,000,000	9,771.88	1,270,345,227	9,557.69	1,242,500,350	1.375	2040/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	10,927.90	1,202,069,868	10,973.85	1,207,124,191	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,835.06	1,282,222,494	12,006.71	1,199,470,828	2.625	2029/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,029.43	1,229,408,637	11,619.12	1,187,474,574	2.000	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,917.96	1,209,673,317	11,671.00	1,184,606,877	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,708.77	1,194,028,203	10,328.58	1,151,637,512	0.875	2030/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,455.34	1,145,534,255	11,271.19	1,127,119,436	2.000	2022/10/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,997.73	1,116,269,847	11,001.29	1,116,631,572	0.250	2023/4/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	11,295.41	1,129,541,872	11,165.07	1,116,507,872	1.500	2022/8/15	0.37
フランス	国債証券	FRTR 0% 03/25/25	8,090,000	13,704.47	1,108,692,210	13,638.67	1,103,368,521	0.000	2025/3/25	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	10,922.32	1,092,232,736	10,947.27	1,094,727,372	0.125	2024/1/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000	24,220.56	1,143,210,844	23,080.71	1,089,409,770	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,980.83	1,157,890,482	12,195.36	1,087,826,558	2.875	2028/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,969.19	1,096,919,488	10,822.93	1,082,293,628	0.250	2025/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	11,320.71	1,081,128,282	11,159.93	1,065,773,670	1.750	2022/5/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	11,269.66	1,070,618,140	11,176.01	1,061,721,132	1.500	2022/9/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,597.10	1,059,710,848	10,602.13	1,060,213,000	0.625	2027/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,242.52	1,095,706,215	11,766.18	1,053,073,672	2.250	2027/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	16,805.01	1,072,159,717	16,379.40	1,045,006,057	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,250.09	1,113,007,560	12,396.02	1,041,265,680	3.125	2028/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	11,516.12	1,036,451,606	11,340.43	1,020,639,380	1.375	2025/1/31	0.34
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	16,437.51	1,043,782,222	15,982.46	1,014,886,525	3.500	2026/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	11,377.73	1,023,996,486	11,206.88	1,008,619,373	1.875	2022/7/31	0.33
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	12,311.98	1,052,674,717	11,755.46	1,005,092,475	2.250	2027/8/15	0.33

(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	98.08
合計	98.08

(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	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	40	アメリカドル	4,954,393.15	543,794,192	4,954,062.4	543,757,889	0.18
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	28	アメリカドル	3,695,875.35	405,659,279	3,694,250	405,480,880	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	28	アメリカドル	4,389,640.9	481,806,985	4,382,875	481,064,360	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	20	ユーロ	2,241,032	299,715,620	2,240,900	299,697,966	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	26	ユーロ	3,501,904.6	468,344,720	3,503,240	468,523,317	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	52	ユーロ	8,836,799.2	1,181,833,525	8,836,880	1,181,844,331	0.39

(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	19,207,051.92	2,103,788,621	2,108,040,404	0.69
	カナダドル	買建	2,390,000.00	215,555,524	217,012,000	0.07
	ユーロ	買建	15,010,000.00	1,995,196,603	2,007,812,650	0.66
	イギリスポンド	買建	2,115,544.10	328,089,460	329,164,830	0.11

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

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

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	337,733,171,533	65.25
	イギリス	22,698,120,946	4.39
	カナダ	18,702,513,626	3.61
	フランス	17,353,631,230	3.35
	スイス	16,922,557,071	3.27

	ドイツ	15,230,237,194	2.94
	オーストラリア	10,525,541,301	2.03
	オランダ	9,807,010,846	1.89
	アイルランド	9,322,692,926	1.80
	スウェーデン	5,830,828,860	1.13
	スペイン	4,246,861,396	0.82
	デンマーク	4,097,445,805	0.79
	香港	3,956,330,338	0.76
	イタリア	3,157,956,874	0.61
	フィンランド	2,071,721,882	0.40
	ジャージー	1,727,609,807	0.33
	シンガポール	1,548,352,937	0.30
	ベルギー	1,465,202,276	0.28
	バミューダ	1,238,003,738	0.24
	ノルウェー	1,066,293,306	0.21
	ケイマン	1,012,447,293	0.20
	イスラエル	963,399,722	0.19
	ニュージーランド	529,289,606	0.10
	ルクセンブルク	529,046,883	0.10
	キュラソー	421,821,486	0.08
	オーストリア	321,899,735	0.06
	ポルトガル	264,760,060	0.05
	パナマ	228,802,535	0.04
	リベリア	197,242,352	0.04
	マン島	127,381,450	0.02
	パプアニューギニア	58,559,406	0.01
	小計	493,356,734,420	95.32
投資信託受益証券	オーストラリア	219,217,878	0.04
	香港	80,837,673	0.02
	小計	300,055,551	0.06
投資証券	アメリカ	9,367,107,819	1.81
	オーストラリア	713,695,039	0.14
	イギリス	309,350,245	0.06
	フランス	285,432,551	0.06
	シンガポール	223,641,258	0.04
	香港	180,453,619	0.03
	カナダ	74,489,713	0.01
	小計	11,154,170,244	2.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	12,792,938,030	2.47
合計(純資産総額)		517,603,898,245	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,571,050,048	1.85
	買建	カナダ	819,767,296	0.16
	買建	ドイツ	1,490,482,234	0.29
	買建	イギリス	590,142,564	0.11
	買建	オーストラリア	409,631,512	0.08

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	1,870,816,968	0.36
	売建	—	376,402,910	△0.07

(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	1,450,831	8,848.85	12,838,187,635	13,677.19	19,843,296,468	3.83
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	619,180	19,996.07	12,381,170,833	27,404.87	16,968,551,617	3.28
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,986	266,094.46	9,841,769,727	353,764.16	13,084,321,340	2.53
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	207,790	24,897.95	5,173,546,776	36,081.40	7,497,355,103	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	25,465	155,865.78	3,969,122,230	264,692.82	6,740,402,804	1.30
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,977	156,011.76	4,052,717,655	258,687.85	6,719,934,435	1.30
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	263,503	10,959.53	2,887,870,614	18,026.98	4,750,163,943	0.92

アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,189	18,808.47	1,244,914,059	68,624.14	4,542,163,679	0.88
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	226,967	16,138.01	3,662,796,351	18,576.88	4,216,338,723	0.81
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	53,433	37,942.93	2,027,404,814	71,319.85	3,810,833,695	0.74
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	118,353	20,461.45	2,421,675,081	31,768.93	3,759,948,693	0.73
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	81,910	33,373.62	2,733,633,673	45,212.33	3,703,342,704	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	146,419	21,360.39	3,127,567,471	24,948.44	3,652,926,808	0.71
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	248,795	12,567.70	3,126,781,394	13,546.63	3,370,336,100	0.65
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	92,922	27,041.57	2,512,756,879	35,003.56	3,252,600,951	0.63
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	212,538	12,815.57	2,723,797,232	14,801.13	3,145,803,843	0.61
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	670,589	2,730.82	1,831,263,754	4,652.72	3,120,067,144	0.60
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	156,656	12,871.55	2,016,406,351	19,608.62	3,071,808,601	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	76,521	33,319.84	2,549,667,722	39,577.26	3,028,491,574	0.59
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	95,999	16,461.80	1,580,316,799	28,539.79	2,739,791,799	0.53
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	36,125	39,528.19	1,427,956,022	73,864.60	2,668,358,747	0.52
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	394,334	4,368.44	1,722,627,574	6,293.63	2,481,795,605	0.48
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,854	41,570.09	2,529,706,312	38,474.79	2,341,345,236	0.45
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	365,193	4,913.95	1,794,542,041	6,406.69	2,339,678,779	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	41,289	42,055.64	1,736,435,386	55,382.70	2,286,696,333	0.44
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	356,926	6,134.48	2,189,557,692	6,200.34	2,213,063,411	0.43
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	350,418	6,728.28	2,357,713,224	6,269.49	2,196,942,567	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	355,696	5,180.67	1,842,744,308	6,068.63	2,158,587,559	0.42
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	38,504	45,654.67	1,757,887,490	55,188.42	2,124,975,139	0.41
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	364,089	4,986.39	1,815,492,224	5,806.30	2,114,011,417	0.41

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	3.22
		素材	4.52
		資本財	6.55
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	2.11
		自動車・自動車部品	1.91
		耐久消費財・アパレル	1.99
		消費者サービス	1.88
		メディア・娯楽	7.08
		小売	5.33
		食品・生活必需品小売り	1.32
		食品・飲料・タバコ	3.93
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		ヘルスケア機器・サービス	5.03
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.20
		銀行	6.36
		各種金融	4.68
		保険	3.17
		不動産	0.49
		ソフトウェア・サービス	11.28
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.34
		電気通信サービス	1.71
		公益事業	2.92
		半導体・半導体製造装置	4.37
		小計	95.32
投資信託受益証券	—	—	0.06
投資証券	—	—	2.15
合計			97.53

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	415	アメリカドル	85,451,060	9,379,108,346	87,199,800	9,571,050,048	1.85
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	38	カナダドル	8,755,853	795,119,010	9,027,280	819,767,296	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	34	スイスフラン	3,781,238	460,970,724	3,884,840	473,600,844	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	187	ユーロ	7,374,696.5	986,291,909	7,603,420	1,016,881,390	0.20
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	27	オーストラリアドル	4,688,789	396,577,773	4,843,125	409,631,512	0.08
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	54	イギリスポンド	3,717,087.5	578,378,815	3,792,690	590,142,564	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。

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	14,880,000.00	1,630,132,800	1,633,216,968	0.32
	スウェーデンクローナ	買建	18,000,000.00	238,694,000	237,600,000	0.05
	ユーロ	売建	2,000,000.00	267,952,000	267,483,400	△0.05
	イギリスポンド	売建	700,000.00	109,269,160	108,919,510	△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－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	104,705,558,260	96.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,832,240,132	3.53
合計(純資産総額)		108,537,798,392	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	3,806,946,000	3.51

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

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

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	10,532	577,174.42	6,078,800,991	694,000	7,309,208,000	6.73
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,358	553,778.9	5,182,262,946	660,000	6,176,280,000	5.69
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	29,241	154,608.66	4,520,911,827	186,900	5,465,142,900	5.04
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	30,261	137,219.39	4,152,395,960	173,400	5,247,257,400	4.83
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	46,610	85,175.81	3,970,044,504	110,800	5,164,388,000	4.76
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	14,794	330,698.85	4,892,358,786	339,500	5,022,563,000	4.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	13,351	245,731.15	3,280,756,583	306,000	4,085,406,000	3.76
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	18,645	160,390.78	2,990,486,093	203,500	3,794,257,500	3.50
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,013	127,088.48	2,543,421,750	157,000	3,142,041,000	2.89
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	8,888	305,051.62	2,711,298,798	352,000	3,128,576,000	2.88
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	13,227	176,882.37	2,339,623,107	196,000	2,592,492,000	2.39
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	5,826	315,337.73	1,837,157,614	430,500	2,508,093,000	2.31
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	27,523	75,320.64	2,073,049,974	90,600	2,493,583,800	2.30
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,895	636,026.47	1,841,296,630	812,000	2,350,740,000	2.17
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,689	404,593.87	1,897,140,656	498,500	2,337,466,500	2.15
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,225	585,719.87	1,888,946,580	634,000	2,044,650,000	1.88
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,147	57,705.11	1,739,635,951	67,200	2,025,878,400	1.87
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	11,319	162,600.01	1,840,469,513	178,500	2,020,441,500	1.86
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,114	291,125.1	1,779,938,861	309,000	1,889,226,000	1.74
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,266	494,591.48	1,615,335,773	562,000	1,835,492,000	1.69
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	39,128	38,213.41	1,495,214,306	44,600	1,745,108,800	1.61
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	10,992	132,581.2	1,457,332,550	157,800	1,734,537,600	1.60
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,105	380,403.13	1,181,151,718	504,000	1,564,920,000	1.44
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,994	632,501.54	1,261,208,070	778,000	1,551,332,000	1.43
日本	投資証券	イオンリート投資法人	9,491	124,612.01	1,182,692,586	154,100	1,462,563,100	1.35
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,378	175,388.37	1,118,627,023	225,200	1,436,325,600	1.32
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,207	301,921.13	1,270,182,193	339,000	1,426,173,000	1.31
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	12,219	100,373.74	1,226,466,729	112,000	1,368,528,000	1.26

日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	8,683	125,695.53	1,091,414,286	157,200	1,364,967,600	1.26
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	7,757	144,991.3	1,124,697,514	174,900	1,356,699,300	1.25

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	96.47
合計	96.47

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	1,836	円	3,499,048,800	3,806,946,000	3.51

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

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

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	66,499,371,997	73.87
	オーストラリア	6,300,675,544	7.00
	イギリス	5,075,952,352	5.64
	シンガポール	3,287,460,525	3.65
	フランス	2,228,849,772	2.48
	カナダ	1,791,017,204	1.99
	香港	1,427,368,238	1.59
	ベルギー	1,209,960,116	1.34
	スペイン	437,743,012	0.49
	ニュージーランド	380,097,131	0.42
	ガーンジー	242,754,882	0.27
	ドイツ	242,687,813	0.27

	オランダ	189,114,151	0.21
	韓国	128,789,801	0.14
	アイルランド	113,578,548	0.13
	イスラエル	62,008,159	0.07
	イタリア	18,347,443	0.02
	小計	89,635,776,688	99.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	384,738,841	0.43
合計(純資産総額)		90,020,515,529	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	—	52,684,464	0.06
	売建	—	76,843,955	△0.09

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	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	415,603	10,949.77	4,550,758,322	12,934.11	5,375,458,409	5.97
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	50,183	81,466.93	4,088,255,371	80,862.38	4,057,917,177	4.51
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	85,167	24,432.11	2,080,809,711	31,005.00	2,640,603,244	2.93
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	157,445	15,161.54	2,387,109,650	16,635.22	2,619,133,095	2.91
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	183,977	8,734.00	1,606,855,433	14,103.06	2,594,639,111	2.88
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	233,927	7,325.46	1,713,625,029	8,206.75	1,919,781,624	2.13
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	78,131	18,109.95	1,414,949,139	22,713.73	1,774,646,782	1.97
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	192,017	6,531.05	1,254,073,922	8,500.91	1,632,319,619	1.81
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	209,144	6,763.16	1,414,475,235	7,507.58	1,570,166,148	1.74
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	946,128	1,688.67	1,597,699,421	1,634.93	1,546,854,376	1.72
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	71,656	17,051.47	1,221,840,683	19,565.81	1,402,008,226	1.56
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	211,066	5,150.90	1,087,181,369	6,086.19	1,284,588,201	1.43
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	319,561	3,037.97	970,818,261	3,980.99	1,272,170,807	1.41
香港	投資証券	LINK REIT	1,172,400	893.15	1,047,136,685	1,058.37	1,240,843,540	1.38
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	73,703	11,748.71	865,915,202	16,443.14	1,211,909,160	1.35

アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	36,652	27,984.37	1,025,683,177	32,411.03	1,187,929,086	1.32
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	62,289	15,017.36	935,416,536	18,376.01	1,144,623,860	1.27
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,825	13,796.83	880,582,802	17,638.43	1,125,772,922	1.25
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	300,597	3,195.11	960,441,563	3,663.78	1,101,323,922	1.22
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	668,523	1,409.81	942,496,894	1,623.68	1,085,471,435	1.21
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	208,515	4,243.32	884,796,203	5,099.44	1,063,311,733	1.18
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	79,963	9,777.70	781,854,537	12,903.38	1,031,793,423	1.15
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	299,377	2,614.48	782,716,137	3,416.82	1,022,919,956	1.14
アメリカ	投資証券	UDR INC	166,554	4,200.79	699,659,763	5,227.86	870,722,460	0.97
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	98,450	7,335.56	722,186,350	8,281.39	815,303,042	0.91
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	161,925	2,954.44	478,399,254	4,778.95	773,831,543	0.86
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	328,011	2,122.60	696,238,682	2,323.61	762,172,657	0.85
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	54,777	10,866.78	595,249,657	13,761.70	753,825,123	0.84
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	398,631	1,505.89	600,296,026	1,884.57	751,251,691	0.83
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	77,808	5,772.92	449,179,867	9,652.01	751,004,045	0.83

(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	99.57
合計	99.57

(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	480,000.00	52,396,800	52,684,464	0.06
	アメリカドル	売建	530,000.00	58,172,800	58,172,111	△0.06
	イギリスポンド	売建	120,000.00	18,672,720	18,671,844	△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。

≪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：2008年1月９日
作成基準日：2021年5月31日

基準価額・純資産の推移

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	11,486円
純資産総額	1.20億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年９月	25円
2020年11月	25円
2021年１月	25円
2021年３月	25円
2021年５月	25円
直近1年間分配金合計額	150円
設定来分配金合計額	4,543円

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

主要な資産の状況

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	22.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	0.8%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.7%
国内株式インデックスマザーファンド	21.3%	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	-	-	0.5%
外国債券インデックスマザーファンド	19.0%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	1.125%	2031/02/15	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	15.4%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.2%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/03/20	0.2%
グローバルREITインデックスマザーファンド	10.5%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
		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	10.2%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.6%

※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。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

当ファンドは「分配金受取りコース」専用ファンドです。

＜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。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。

＜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＞

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。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

＜申込受付の中止等＞

取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

＜その他＞

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

＜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0.15%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。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

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

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

・株式および不動産投資信託証券

原則として、本ファンドの基準価額計算日（外国で取引されているものについては、原則と

して、基準価額計算日の前日）の当該取引所における最終相場で評価します。

・公社債

原則として、計算時において知り得る直近の日（外国で取引されているものについては、原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の次のいずれかから入手した価額で評価します。

a.日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）

b.価格情報会社の提供する価額

c.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

・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、わが国における本ファンドの基準価額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、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

＜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。（2008年 1月 9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1月11日から3月10日まで、3月11日から5月10日まで、5月11日から7月10日まで、7月11日から9月10日まで、9月11日から11月10日まで、11月11日から翌年1月10日まで（第1計算期間は2008年1月9日から2008年5月12日まで）とします。なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意の

うえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合にお

いて、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

委託会社は、毎年5月及び11月の決算時並びに償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

義で混蔵寄託することができるものとします。

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

③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。

④受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

(3)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27特定期間(2020年11月11日から2021年5月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第26特定期間 （2020年11月10日現在）	第27特定期間 （2021年 5月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,972,494	2,010,709
親投資信託受益証券	102,388,410	116,932,259
未収入金	400,000	400,000
流動資産合計	104,760,904	119,342,968
資産合計	104,760,904	119,342,968
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	256,375	259,825
未払解約金	-	11,398
未払受託者報酬	7,510	8,645
未払委託者報酬	120,117	138,259
未払利息	2	1
その他未払費用	922	1,054
流動負債合計	384,926	419,182
負債合計	384,926	419,182
純資産の部		
元本等		
元本	102,550,000	103,930,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,825,978	14,993,786
（分配準備積立金）	1,421,649	10,723,912
元本等合計	104,375,978	118,923,786
純資産合計	104,375,978	118,923,786
負債純資産合計	104,760,904	119,342,968

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第26特定期間 自 2020年 5月12日 至 2020年11月10日	第27特定期間 自 2020年11月11日 至 2021年 5月10日
営業収益		
受取利息	2	3
有価証券売買等損益	9,284,205	14,443,849
営業収益合計	9,284,207	14,443,852
営業費用		
支払利息	380	225
受託者報酬	22,171	24,672
委託者報酬	354,684	394,601
その他費用	2,715	3,005
営業費用合計	379,950	422,503
営業利益又は営業損失（△）	8,904,257	14,021,349
経常利益又は経常損失（△）	8,904,257	14,021,349
当期純利益又は当期純損失（△）	8,904,257	14,021,349
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（△）	4,797	110,163
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△6,267,941	1,825,978
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,980	312,677
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,980	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	312,677
剰余金減少額又は欠損金増加額	52,371	268,905
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	268,905
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	52,371	-
分配金	766,150	787,150
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,825,978	14,993,786

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	第26特定期間 (2020年11月10日現在)		第27特定期間 (2021年 5月10日現在)	
１．特定期間の末日における受益権の総数		102,550,000口		103,930,000口
２．特定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	1.0178円	1口当たり純資産額	1.1443円
	(1万口当たり純資産額)	(10,178円)	(1万口当たり純資産額)	(11,443円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第26特定期間
自 2020年 5月12日
至 2020年11月10日

分配金の計算過程

第74期
自 2020年 5月12日
至 2020年 7月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	296,062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	15,596,388円
分配準備積立金額	D	1,227,685円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,120,135円
当ファンドの期末残存口数	F	101,550,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,685円
1万口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	253,875円

第75期
自 2020年 7月11日
至 2020年 9月10日

第27特定期間
自 2020年11月11日
至 2021年 5月10日

分配金の計算過程

第77期
自 2020年11月11日
至 2021年 1月12日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	298,668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	595,717円
収益調整金額	C	16,313,957円
分配準備積立金額	D	1,396,509円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,604,851円
当ファンドの期末残存口数	F	105,610,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,761円
1万口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	264,025円

第78期
自 2021年 1月13日
至 2021年 3月10日

第26特定期間
自 2020年 5月12日
至 2020年11月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	268,552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	15,735,196円
分配準備積立金額	D	1,266,494円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,270,242円
当ファンドの期末残存口数	F	102,360,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,687円
1万口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	255,900円

第27特定期間
自 2020年11月11日
至 2021年 5月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	296,043円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,844,075円
収益調整金額	C	16,285,149円
分配準備積立金額	D	2,006,503円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,431,770円
当ファンドの期末残存口数	F	105,320,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,129円
1万口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	263,300円

第76期
自 2020年 9月11日
至 2020年11月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	401,390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	15,770,060円
分配準備積立金額	D	1,276,634円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,448,084円
当ファンドの期末残存口数	F	102,550,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,701円
1万口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	256,375円

第79期
自 2021年 3月11日
至 2021年 5月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	505,096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	4,692,145円
収益調整金額	C	16,091,636円
分配準備積立金額	D	5,786,496円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	27,075,373円
当ファンドの期末残存口数	F	103,930,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,605円
1万口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	259,825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27特定期間 自 2020年11月11日 至 2021年 5月10日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。

	第27特定期間 自 2020年11月11日 至 2021年 5月10日
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第27特定期間 (2021年 5月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第26特定期間 自 2020年 5月12日 至 2020年11月10日	第27特定期間 自 2020年11月11日 至 2021年 5月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	101,160,000円	102,550,000円
期中追加設定元本額	1,960,000円	6,200,000円
期中一部解約元本額	570,000円	4,820,000円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第26特定期間 （2020年11月10日現在）	第27特定期間 （2021年 5月10日現在）
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,096,453	5,298,796
合計	2,096,453	5,298,796

（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	5,623,430	12,090,374	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	5,819,259	12,325,772	
	国内株式インデックス　マザーファンド	13,679,351	25,748,642	
	外国株式インデックス　マザーファンド	6,989,142	26,004,500	
	国内債券インデックス　マザーファンド	13,028,329	18,353,007	

	外国債券インデックス　マザーファンド	7,371,699	22,409,964	
合計		52,511,210	116,932,259	

(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

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	336,183,028
国債証券	522,555,617,300
地方債証券	33,331,005,386
特殊債券	40,987,415,370
社債券	26,664,549,340
未収入金	594,689,600
未収利息	1,041,282,546
前払費用	24,391,574
流動資産合計	625,535,134,144
資産合計	625,535,134,144
負債の部	
流動負債	
未払解約金	595,764,091
未払利息	260
流動負債合計	595,764,351
負債合計	595,764,351
純資産の部	
元本等	
元本	443,635,763,178
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	181,303,606,615
元本等合計	624,939,369,793
純資産合計	624,939,369,793
負債純資産合計	625,535,134,144

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 5月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	443,635,763,178口
2.	担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
		有価証券　101,066,000円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　1.4087円
		(1万口当たり純資産額)　(14,087円)

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年 5月10日現在
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	421,545,977,936円
期中追加設定元本額	30,388,071,981円
期中一部解約元本額	8,298,286,739円
期末元本額	443,635,763,178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
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,674,159,226円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	13,028,329円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	20,355,458,999円
世界経済インデックスファンド	2,373,952,241円
ＤＣマイセレクション２５	24,149,129,788円
ＤＣマイセレクション５０	27,453,189,528円
ＤＣマイセレクション７５	7,950,061,633円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	438,357,736円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	92,374,722,510円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	69,071,069,960円
ＤＣマイセレクションＳ２５	10,679,409,626円
ＤＣマイセレクションＳ５０	11,992,135,215円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,535,133,255円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	961,704,830円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	1,807,634,330円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	657,419,045円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,880,551,255円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	15,066,388円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,665,478円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	40,798,833円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,186,019円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,015,770円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	135,459,099円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	191,715,196円

区分	2021年 5月10日現在
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	38,807,907円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	35,911,181円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,544,821,428円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	834,051,112円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,521,685,068円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	507,022,511円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	83,726,323円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,114,570,772円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,276,293,509円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,541,920,744円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	147,812,794円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	6,023,231,385円
日本債券ファンド・シリーズ１	14,121,360,868円
分散投資コア戦略ファンドＡ	26,048,364,855円
分散投資コア戦略ファンドＳ	26,332,440,005円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	117,474,476円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,128,773,424円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	52,562,398円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,390,842円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	53,145,886円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	22,508,809円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	38,947,816円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	57,975,705円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,168,151円
グローバル経済コア	194,681,250円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	20,898,657円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	4,690,534円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	972,466円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	693,281円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	204,759円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	214,790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）	76,919,465,914円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	44,722,029円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△5,319,546,150
地方債証券	△151,266,144
特殊債券	△215,961,487

社債券	69,055,200
合計	△5,617,718,581

(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４１３回利付国債（２年）	1,640,000,000	1,643,985,200	
	第４１４回利付国債（２年）	2,360,000,000	2,366,442,800	
	第４１５回利付国債（２年）	1,060,000,000	1,063,116,400	
	第４１６回利付国債（２年）	4,670,000,000	4,684,663,800	
	第４１７回利付国債（２年）	4,240,000,000	4,254,161,600	
	第４１８回利付国債（２年）	1,040,000,000	1,043,692,000	
	第４１９回利付国債（２年）	660,000,000	662,468,400	
	第４２０回利付国債（２年）	1,250,000,000	1,254,837,500	
	第４２１回利付国債（２年）	590,000,000	592,401,300	
	第４２２回利付国債（２年）	130,000,000	130,575,900	
	第４２３回利付国債（２年）	370,000,000	371,013,800	
	第１３２回利付国債（５年）	4,770,000,000	4,781,925,000	
	第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	4,393,402,800	
	第１３４回利付国債（５年）	5,700,000,000	5,721,147,000	
	第１３５回利付国債（５年）	4,080,000,000	4,097,829,600	
	第１３６回利付国債（５年）	4,400,000,000	4,421,868,000	
	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	6,798,396,800	
	第１３８回利付国債（５年）	7,050,000,000	7,095,261,000	
	第１３９回利付国債（５年）	6,070,000,000	6,112,672,100	
	第１４０回利付国債（５年）	7,300,000,000	7,354,677,000	
	第１４１回利付国債（５年）	7,790,000,000	7,851,774,700	
	第１４２回利付国債（５年）	5,380,000,000	5,424,869,200	

第１４３回利付国債（５年）	3,300,000,000	3,329,403,000	
第１４４回利付国債（５年）	6,620,000,000	6,682,890,000	
第１４５回利付国債（５年）	8,240,000,000	8,321,246,400	
第１４６回利付国債（５年）	2,460,000,000	2,483,935,800	
第１４７回利付国債（５年）	540,000,000	542,764,800	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	579,948,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,589,989,100	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	777,947,500	
第４回利付国債（４０年）	1,200,000,000	1,705,596,000	
第５回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,471,517,500	
第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,707,211,800	
第７回利付国債（４０年）	1,040,000,000	1,357,709,600	
第８回利付国債（４０年）	1,230,000,000	1,502,666,400	
第９回利付国債（４０年）	1,220,000,000	1,119,008,400	
第１０回利付国債（４０年）	2,370,000,000	2,545,996,200	
第１１回利付国債（４０年）	1,790,000,000	1,867,059,500	
第１２回利付国債（４０年）	1,710,000,000	1,612,461,600	
第１３回利付国債（４０年）	2,250,000,000	2,119,005,000	
第３２３回利付国債（１０年）	1,930,000,000	1,951,963,400	
第３２４回利付国債（１０年）	2,740,000,000	2,768,139,800	
第３２５回利付国債（１０年）	2,920,000,000	2,956,821,200	
第３２６回利付国債（１０年）	3,120,000,000	3,161,527,200	
第３２７回利付国債（１０年）	3,190,000,000	3,237,626,700	
第３２８回利付国債（１０年）	3,400,000,000	3,446,206,000	
第３２９回利付国債（１０年）	3,210,000,000	3,273,493,800	
第３３０回利付国債（１０年）	1,900,000,000	1,942,313,000	
第３３１回利付国債（１０年）	900,000,000	915,777,000	
第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	4,893,072,000	
第３３３回利付国債（１０年）	3,030,000,000	3,094,751,100	
第３３４回利付国債（１０年）	5,030,000,000	5,146,243,300	
第３３５回利付国債（１０年）	2,450,000,000	2,502,528,000	
第３３６回利付国債（１０年）	1,050,000,000	1,073,992,500	
第３３７回利付国債（１０年）	2,850,000,000	2,894,460,000	
第３３８回利付国債（１０年）	3,060,000,000	3,122,852,400	
第３３９回利付国債（１０年）	4,850,000,000	4,956,166,500	
第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	6,465,486,400	
第３４１回利付国債（１０年）	2,160,000,000	2,201,536,800	
第３４２回利付国債（１０年）	5,380,000,000	5,432,508,800	
第３４３回利付国債（１０年）	4,820,000,000	4,866,995,000	
第３４４回利付国債（１０年）	6,640,000,000	6,706,134,400	
第３４５回利付国債（１０年）	3,340,000,000	3,373,867,600	
第３４６回利付国債（１０年）	6,350,000,000	6,415,341,500	

第３４７回利付国債（１０年）	3,880,000,000	3,920,468,400	
第３４８回利付国債（１０年）	4,880,000,000	4,931,435,200	
第３４９回利付国債（１０年）	4,130,000,000	4,173,819,300	
第３５０回利付国債（１０年）	8,060,000,000	8,145,919,600	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	4,610,000,000	4,656,007,800	
第３５２回利付国債（１０年）	3,900,000,000	3,937,401,000	
第３５３回利付国債（１０年）	4,300,000,000	4,339,302,000	
第３５４回利付国債（１０年）	4,750,000,000	4,791,087,500	
第３５５回利付国債（１０年）	4,270,000,000	4,304,587,000	
第３５６回利付国債（１０年）	4,830,000,000	4,866,273,300	
第３５７回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,688,342,900	
第３５８回利付国債（１０年）	3,790,000,000	3,813,422,200	
第３５９回利付国債（１０年）	3,230,000,000	3,246,085,400	
第３６０回利付国債（１０年）	6,550,000,000	6,577,444,500	
第３６１回利付国債（１０年）	4,740,000,000	4,753,556,400	
第３６２回利付国債（１０年）	2,030,000,000	2,033,958,500	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	135,526,600	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	193,292,800	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	144,451,200	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	139,664,800	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	60,541,500	
第６回利付国債（３０年）	350,000,000	433,870,500	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	222,816,600	
第８回利付国債（３０年）	350,000,000	416,185,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	274,548,000	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	177,604,800	
第１１回利付国債（３０年）	260,000,000	307,746,400	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	234,680,400	
第１３回利付国債（３０年）	400,000,000	490,372,000	
第１４回利付国債（３０年）	800,000,000	1,023,824,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	441,024,200	
第１６回利付国債（３０年）	200,000,000	260,202,000	
第１７回利付国債（３０年）	770,000,000	994,455,000	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	442,093,350	
第１９回利付国債（３０年）	530,000,000	680,859,200	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	631,920,000	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	645,850,000	
第２２回利付国債（３０年）	400,000,000	529,684,000	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	570,863,700	
第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	505,734,400	
第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	456,428,000	
第２６回利付国債（３０年）	1,140,000,000	1,508,094,600	

第２７回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,381,021,700	
第２８回利付国債（３０年）	2,140,000,000	2,893,108,800	
第２９回利付国債（３０年）	1,670,000,000	2,239,486,700	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,354,046,900	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,448,590,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,560,000,000	2,090,727,600	
第３３回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,347,490,600	
第３４回利付国債（３０年）	1,795,000,000	2,391,568,250	
第３５回利付国債（３０年）	2,240,000,000	2,912,044,800	
第３６回利付国債（３０年）	2,030,000,000	2,647,627,500	
第３７回利付国債（３０年）	2,070,000,000	2,667,919,500	
第３８回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,908,675,000	
第３９回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,943,220,000	
第４０回利付国債（３０年）	1,250,000,000	1,594,462,500	
第４１回利付国債（３０年）	990,000,000	1,243,964,700	
第４２回利付国債（３０年）	1,520,000,000	1,911,795,200	
第４３回利付国債（３０年）	1,390,000,000	1,750,037,800	
第４４回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,537,492,800	
第４５回利付国債（３０年）	1,120,000,000	1,363,712,000	
第４６回利付国債（３０年）	1,750,000,000	2,132,095,000	
第４７回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,676,713,500	
第４８回利付国債（３０年）	1,880,000,000	2,249,871,200	
第４９回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,723,996,800	
第５０回利付国債（３０年）	1,840,000,000	1,946,977,600	
第５１回利付国債（３０年）	1,810,000,000	1,702,648,900	
第５２回利付国債（３０年）	1,940,000,000	1,912,025,200	
第５３回利付国債（３０年）	880,000,000	886,890,400	
第５４回利付国債（３０年）	2,110,000,000	2,226,894,000	
第５５回利付国債（３０年）	1,540,000,000	1,624,176,400	
第５６回利付国債（３０年）	1,680,000,000	1,770,568,800	
第５７回利付国債（３０年）	1,550,000,000	1,632,367,000	
第５８回利付国債（３０年）	2,000,000,000	2,104,680,000	
第５９回利付国債（３０年）	620,000,000	636,678,000	
第６０回利付国債（３０年）	2,700,000,000	2,904,012,000	
第６１回利付国債（３０年）	1,660,000,000	1,699,308,800	
第６２回利付国債（３０年）	20,000,000	19,429,800	
第６３回利付国債（３０年）	1,160,000,000	1,094,970,400	
第６４回利付国債（３０年）	2,600,000,000	2,450,188,000	
第６５回利付国債（３０年）	860,000,000	809,105,200	
第６６回利付国債（３０年）	1,030,000,000	967,427,500	
第６７回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,396,153,800	
第６８回利付国債（３０年）	1,970,000,000	1,948,113,300	
第６９回利付国債（３０年）	840,000,000	852,541,200	

第７０回利付国債（３０年）	180,000,000	182,476,800	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	153,541,500	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	245,400,000	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	308,286,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	205,890,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	358,613,500	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	245,049,600	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	326,294,400	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	208,164,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	335,427,200	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	231,730,400	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	346,731,000	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	137,588,100	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	202,726,200	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	415,002,900	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	431,664,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	214,582,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	677,546,100	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	387,817,200	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	216,180,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	141,211,200	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	291,192,300	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	313,884,400	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	184,218,800	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	293,697,900	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	240,220,200	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	426,250,500	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	658,398,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	319,701,800	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	515,956,600	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	321,061,900	
第８６回利付国債（２０年）	210,000,000	234,542,700	
第８７回利付国債（２０年）	550,000,000	611,594,500	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	471,525,600	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	391,142,500	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	707,534,100	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	507,807,000	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	988,125,600	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	460,052,800	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	688,055,600	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	698,700,100	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,801,692,600	

第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	457,872,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	500,852,000	
第９９回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,474,934,400	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	554,505,600	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	835,820,700	
第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,479,189,600	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	466,732,000	
第１０４回利付国債（２０年）	160,000,000	184,411,200	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,365,437,000	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	442,517,600	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	302,013,400	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	756,591,000	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	598,098,800	
第１１０回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,282,512,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,143,057,700	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	924,537,000	
第１１３回利付国債（２０年）	1,720,000,000	2,020,329,200	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,746,604,000	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	831,173,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,775,618,100	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,277,488,800	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	777,407,400	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	614,662,200	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,792,296,300	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,758,570,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,093,276,400	
第１２３回利付国債（２０年）	1,870,000,000	2,233,453,200	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	722,734,100	
第１２５回利付国債（２０年）	820,000,000	990,502,600	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	867,502,800	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,202,141,400	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,146,462,400	
第１２９回利付国債（２０年）	890,000,000	1,042,991,000	
第１３０回利付国債（２０年）	1,285,000,000	1,509,797,900	
第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,164,680,000	
第１３２回利付国債（２０年）	1,160,000,000	1,354,149,200	
第１３３回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,448,780,100	
第１３４回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,334,179,700	
第１３５回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,205,058,800	
第１３６回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,680,898,000	
第１３７回利付国債（２０年）	1,090,000,000	1,278,101,300	
第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	713,409,200	
第１３９回利付国債（２０年）	730,000,000	847,982,600	

	第１４０回利付国債（２０年）	2,200,000,000	2,586,716,000	
	第１４１回利付国債（２０年）	1,780,000,000	2,097,249,400	
	第１４２回利付国債（２０年）	1,040,000,000	1,237,236,000	
	第１４３回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,694,934,000	
	第１４４回利付国債（２０年）	1,440,000,000	1,666,468,800	
	第１４５回利付国債（２０年）	2,595,000,000	3,071,545,800	
	第１４６回利付国債（２０年）	2,780,000,000	3,296,941,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	2,150,000,000	2,528,013,000	
	第１４８回利付国債（２０年）	2,230,000,000	2,599,912,400	
	第１４９回利付国債（２０年）	2,860,000,000	3,339,221,600	
	第１５０回利付国債（２０年）	3,260,000,000	3,769,081,600	
	第１５１回利付国債（２０年）	1,495,000,000	1,690,845,000	
	第１５２回利付国債（２０年）	3,290,000,000	3,723,556,200	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,570,000,000	2,945,785,400	
	第１５４回利付国債（２０年）	2,720,000,000	3,082,494,400	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,800,000,000	3,096,016,000	
	第１５６回利付国債（２０年）	2,600,000,000	2,648,256,000	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,780,000,000	2,745,750,400	
	第１５８回利付国債（２０年）	1,920,000,000	1,979,289,600	
	第１５９回利付国債（２０年）	2,930,000,000	3,063,344,300	
	第１６０回利付国債（２０年）	2,480,000,000	2,628,155,200	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,810,000,000	1,889,078,900	
	第１６２回利付国債（２０年）	520,000,000	542,214,400	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,610,000,000	2,718,810,900	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,710,000,000	1,752,219,900	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,640,000,000	1,678,343,200	
	第１６６回利付国債（２０年）	900,000,000	949,995,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,770,000,000	2,827,172,800	
	第１６８回利付国債（２０年）	2,430,000,000	2,436,075,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,690,000,000	1,661,455,900	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,360,000,000	2,315,655,600	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,263,271,200	
	第１７２回利付国債（２０年）	2,850,000,000	2,837,545,500	
	第１７３回利付国債（２０年）	3,250,000,000	3,229,915,000	
	第１７４回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,402,721,200	
	第１７５回利付国債（２０年）	1,190,000,000	1,202,887,700	
	第１７６回利付国債（２０年）	720,000,000	727,221,600	
国債証券合計		488,910,000,000	522,555,617,300	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	106,431,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	107,650,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	132,596,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	131,217,000	

第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	127,483,000	
第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	126,568,000	
第１６回東京都公募公債（２０年）	300,000,000	343,539,000	
第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	115,118,000	
第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	116,382,000	
第１９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	100,253,000	
第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	233,464,000	
第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	233,066,000	
第３３回東京都公募公債（５年）	200,000,000	200,000,000	
第７１６回東京都公募公債	100,000,000	101,227,000	
第７１７回東京都公募公債	100,000,000	101,153,000	
第７２０回東京都公募公債	100,000,000	101,816,000	
第７２６回東京都公募公債	200,000,000	203,768,000	
第７２８回東京都公募公債	100,000,000	101,675,000	
第７５１回東京都公募公債	100,000,000	101,659,000	
第７６５回東京都公募公債	100,000,000	100,904,000	
第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,699,000	
第７８１回東京都公募公債	300,000,000	301,695,000	
第８００回東京都公募公債	200,000,000	199,232,000	
平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,408,000	
平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,959,000	
平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,322,000	
平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,010,000	
平成３０年度第１４回北海道公募公債	200,000,000	201,350,000	
第２９回１号宮城県公募公債（１０年）	100,000,000	101,649,000	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	271,190,000	
第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	116,093,000	
第１５回神奈川県公募公債（２０年）	200,000,000	233,784,000	
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	116,363,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,402,000	
第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	203,150,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,852,000	
第２２６回神奈川県公募公債	100,000,000	100,817,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,699,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	199,146,000	
第６回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	233,514,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	233,594,000	
第１０回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	116,722,000	
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,020,000	
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,098,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,877,000	
第３７７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,755,000	

第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,762,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	153,462,810	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,187,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,150,000	
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	156,541,320	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,488,000	
第４３９回大阪府公募公債（１０年）	500,000,000	503,295,000	
第４４０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,727,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	117,287,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	116,436,000	
平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	101,867,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	102,230,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	99,378,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	103,591,000	
第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	103,377,000	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	114,518,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	102,106,000	
第６回兵庫県公募公債（１５年）	400,000,000	435,948,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	107,715,000	
第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	107,685,000	
第９回兵庫県公募公債（２０年）	400,000,000	471,528,000	
平成２４年度第１５回兵庫県公募公債	200,000,000	201,850,000	
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	101,819,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	101,648,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	102,350,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	300,387,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	120,793,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	103,914,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,655,000	
第１８回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	115,296,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	101,246,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,760,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	100,881,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	100,949,000	
平成２９年度第１４回静岡県公募公債（５年）	100,000,000	100,055,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	117,589,000	
平成２４年度第１８回愛知県公募公債（１０年）	150,000,000	152,142,000	
平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,184,000	

平成２５年度第２回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,110,000	
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,948,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,745,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,153,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	201,918,000	
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	309,342,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,782,000	
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	102,815,000	
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	199,306,000	
令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,000,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	116,554,000	
平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年）	200,000,000	233,866,000	
平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	101,243,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	127,881,119	
平成２９年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,661,000	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	114,324,000	
第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	115,587,000	
第６回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	231,936,000	
第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	107,428,000	
第７回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	235,364,000	
第８回埼玉県公募公債（１５年）	200,000,000	200,340,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	233,784,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	198,944,000	
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,441,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,858,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	102,123,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,241,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,120,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,761,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,477,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,859,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	107,523,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	118,194,000	

平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	107,946,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	131,765,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	112,642,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,100,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	102,815,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	103,444,000	
令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	300,405,000	
第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	231,936,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	117,049,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	116,655,000	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	101,903,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	101,568,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	102,167,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,241,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	120,853,200	
令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	298,695,000	
令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	100,000,000	100,342,000	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	100,902,000	
第１１２回共同発行市場公募地方債	220,000,000	222,204,400	
第１１３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,964,000	
第１１６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,221,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,300,000	
第１１９回共同発行市場公募地方債	400,000,000	405,668,000	
第１２１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,097,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,716,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,649,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,654,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,072,000	
第１３１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,817,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,610,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,927,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,827,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,741,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,104,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,366,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,264,136	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,208,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,438,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,346,000	

第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,306,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,102,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,420,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,972,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,711,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,097,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,464,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,285,101	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,964,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,244,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	200,000,000	202,312,000	
平成２９年度第１回熊本県公募公債（５年）	100,000,000	99,999,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,009,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	235,164,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	299,442,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	104,135,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	130,020,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	134,703,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	115,010,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	125,595,000	
第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,185,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,995,000	
第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	300,402,000	
平成２４年度第２回京都市公募公債	122,500,000	123,840,150	
平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,146,000	
平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	101,459,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	201,424,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	135,297,600	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	232,246,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	118,241,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	116,939,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	99,116,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	108,880,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	349,944,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,682,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	101,077,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	100,852,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	203,010,000	
第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	228,404,000	
令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	300,402,000	

	平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	108,259,000	
	平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,276,000	
	平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,499,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	115,786,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,586,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,542,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,136,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	100,295,000	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	116,862,000	
	平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	115,539,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	203,654,000	
	平成３０年度第５回福岡市公募公債（５年）	200,000,000	200,092,000	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,511,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	152,767,500	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,598,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,647,850	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	171,897,200	
	令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	549,279,500	
	令和２年度第３回広島市公募公債（５年）	200,000,000	200,088,000	
	令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	199,130,000	
	平成２４年度第１回徳島県公募公債	100,000,000	101,254,000	
	平成２４年度第２回岡山県公募公債（１０年）	150,000,000	151,894,500	
	平成２４年度第１回岡山市公募公債（１０年）	200,000,000	202,882,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	202,342,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	114,276,000	
地方債証券合計		31,609,430,000	33,331,005,386	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	103,907,400	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	415,170,100	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	313,896,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,391,000	
	第１１９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,949,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	96,116,000	
	第５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,038,000	
	第１４回道路債券	100,000,000	103,067,000	

第１７回道路債券	100,000,000	102,470,000	
第２１回道路債券	100,000,000	129,163,000	
第２７回道路債券	400,000,000	427,456,000	
第２８回道路債券	200,000,000	262,134,000	
第３３回道路債券	200,000,000	266,022,000	
第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,505,000	
第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,765,000	
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,222,000	
第４２回道路債券	100,000,000	108,426,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,860,000	
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	144,187,000	
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	233,460,000	
第９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,871,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,829,000	
第１０２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,440,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	911,799,000	
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,912,000	
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	131,394,000	
第１１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,256,000	
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,698,000	
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	118,798,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,229,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,610,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,064,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	223,716,000	
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,036,000	
第１７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,068,000	
第１８０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,675,000	
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	116,403,000	

第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,468,000	
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,494,000	
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,530,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	615,930,000	
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	302,000,000	305,300,860	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	635,755,800	
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,754,000	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	150,814,960	
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	101,721,000	
第２０４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	270,321,258	
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	203,632,000	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,171,000	
第２０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	422,000,000	430,558,160	
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,849,000	
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	230,450,000	
第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	104,014,500	
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	101,986,000	
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	101,905,000	
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	229,100,000	
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	101,830,000	
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	101,637,000	
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	303,405,000	
第２３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,548,000	
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	224,724,000	
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	202,928,000	
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	100,648,000	
	100,000,000	94,680,000	

第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	106,940,080	
第２９７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	317,153,400	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	206,113,150	
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	100,676,000	
第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,310,000	
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	100,755,000	
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	121,220,400	
第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,350,000	
第３６１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,966,000	
第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	216,443,880	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	376,890,000	
第３回公営企業債券（２０年）	210,000,000	213,996,300	
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	107,989,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	392,817,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	106,247,000	
第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	131,464,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	42,556,000	
第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	129,499,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	233,692,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年）	200,000,000	195,328,000	
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	233,412,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	116,086,000	
第３７回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,862,000	
第３８回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	505,015,000	
第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,229,000	
第４４回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,884,000	
第４４回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,682,000	
第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,473,000	
第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,530,000	
第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,083,000	
第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,210,000	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,879,000	
第５４回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,760,850	

第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,640,000	
第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,824,000	
第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,073,000	
第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,331,000	
第６７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,727,000	
第６９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,719,000	
第７６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,244,000	
Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,803,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,693,000	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,048,000	
第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,000,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,391,000	
第９２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,540,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,634,010	
Ｆ９５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,903,000	
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,771,000	
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,749,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,113,200	
Ｆ１０７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,249,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	157,680,120	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,137,000	
第１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,151,000	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,513,000	
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,946,000	
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,963,000	
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,013,000	
第７回阪神高速道路債券	100,000,000	108,167,000	
第２２回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,944,000	
第４回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	116,886,000	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	119,181,000	
第２５回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	202,978,000	
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,060,480	
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,772,000	
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,732,900	
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,038,300	
第８５回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,964,000	
第８７回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,896,000	
第１１７回都市再生債券	200,000,000	211,198,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	171,756,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	94,242,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	107,845,000	

第３４４回東京交通債券	100,000,000	102,928,000	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,468,800	
第５９回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,986,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,614,000	11,897,613	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,973,000	12,294,355	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,220,000	12,587,088	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	170,388,000	170,278,951	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	121,776,000	121,778,435	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,037,000	12,336,841	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,964,000	13,392,719	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	219,867,000	219,273,359	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,412,000	10,483,218	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	21,718,000	22,056,583	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,853,000	13,269,951	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	239,190,000	238,245,199	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	85,152,000	85,079,620	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,487,000	11,742,930	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,445,000	13,937,624	
第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	277,119,000	276,742,118	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,519,000	11,776,910	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	191,114,000	190,991,687	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,492,000	14,002,267	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,351,000	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,727,000	18,821,819	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,079,000	19,280,168	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,103,000	21,552,024	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,975,000	23,406,451	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,025,000	25,748,313	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,731,000	26,456,976	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,036,000	56,648,812	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,727,000	11,973,736	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,116,000	25,526,062	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,871,000	12,127,651	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,635,000	11,944,025	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,284,000	26,790,673	

第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,835,000	11,007,059	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,463,000	27,062,331	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,570,000	26,038,794	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,799,000	13,311,343	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,836,000	55,777,908	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,334,000	29,937,137	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,608,000	13,048,397	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,124,000	40,285,630	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,086,000	38,068,925	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,943,000	37,947,541	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,650,000	82,850,696	
第６１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,288,000	
第６４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,325,000	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,012,000	89,871,358	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,793,000	45,710,257	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,048,000	46,352,150	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,455,000	46,839,566	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,448,000	40,343,486	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,348,000	39,953,630	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,052,000	46,449,750	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	177,603,000	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,438,000	122,341,036	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,420,000	165,035,619	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,774,000	46,568,094	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,185,000	48,070,271	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,920,000	48,701,083	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,842,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,076,000	154,702,128	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,949,000	52,690,436	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,012,000	109,960,180	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,449,000	61,293,702	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,247,000	65,016,018	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,965,000	65,043,474	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,613,000	201,838,980	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,992,000	135,714,261	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,697,000	65,877,348	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,722,000	71,133,454	
第１０７回一般担保住宅金融支援機構債券	400,000,000	403,732,000	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,782,000	75,085,614	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,920,000	80,437,082	

第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,777,000	80,123,232	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,101,000	80,789,868	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,443,000	81,491,976	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,184,000	82,120,863	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,887,000	83,818,649	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,619,000	84,657,547	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,142,000	83,948,477	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,565,000	84,371,402	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,074,000	84,932,395	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,582,000	170,952,222	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,134,000	84,936,638	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,258,000	173,318,233	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,536,000	86,392,215	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,114,000	172,556,491	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,396,000	87,271,191	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,142,000	175,502,049	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,894,000	176,245,930	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	129,727,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,538,000	89,714,670	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,771,000	90,138,073	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,785,000	89,416,261	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,280,000	181,802,086	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,679,000	90,854,010	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,658,000	90,963,517	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,760,000	183,059,726	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,456,000	91,904,962	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	278,994,000	275,919,486	

第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,094,000	184,996,676	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,910,000	95,264,963	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,465,000	95,517,505	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,232,000	196,356,536	
第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,274,000	98,672,992	
第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,188,000	197,957,033	
第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,600,000	198,011,008	
第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,077,000	99,536,717	
第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,976,000	200,734,947	
第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	201,556,000	
第１６８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,025,000	
第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,573,000	
第２９４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,043,000	
第５９回日本学生支援債券	200,000,000	199,978,000	
第６０回日本学生支援債券	200,000,000	199,974,000	
第６２回日本学生支援債券	100,000,000	99,984,000	
第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	108,256,000	
い第８２３号商工債	200,000,000	200,688,000	
い第８２９号商工債	200,000,000	200,374,000	
い第８３２号商工債	200,000,000	199,928,000	
い第８３３号商工債	100,000,000	99,872,000	
い第８４３号商工債	200,000,000	200,256,000	
第３３７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,131,000	
第３３８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,129,000	
第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	200,270,000	
第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,153,000	
第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,111,000	
第３６０回信金中金債（５年）	200,000,000	199,760,000	
第２３６号商工債（３年）	300,000,000	299,958,000	
第２５４号商工債（３年）	300,000,000	300,093,000	
第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	102,076,000	
第２１回国際協力機構債券	100,000,000	117,306,000	
第４８回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,678,000	
第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,578,000	
第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,428,000	
第７３回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,770,000	

	第７４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,022,000	
	第７３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,024,000	
	第８３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,038,000	
	第８８回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,950,000	
	第２７回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,260,000	
	第２８回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,288,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,572,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,921,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	198,924,000	
	第１４１回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,972,000	
特殊債券合計		39,448,599,000	40,987,415,370	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	100,342,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	299,652,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,109,000	
	第２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,586,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,203,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,196,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,904,000	
	第１２回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,936,000	
	第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,191,000	
	第１２回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	399,692,000	
	第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,906,000	
	第３９回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,896,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,147,000	
	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	199,432,000	
	第７回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,980,000	
	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	100,209,000	
	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	199,894,000	
	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	100,425,000	
	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	199,948,000	

第１０回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,726,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,097,000	
第１０回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,297,000	
第５回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,030,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,159,000	
第２回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,961,000	
第１８回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,847,000	
第２５回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,453,000	
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	200,894,000	
第１３回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,081,000	
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	100,908,000	
第９回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,737,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,343,000	
第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,688,000	
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	199,914,000	
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	200,634,000	
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,628,000	
第５回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	399,716,000	
第７回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,736,000	
第４回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,156,000	
第６回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,380,000	
第２回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,987,000	
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	100,027,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	97,324,000	
第１４回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,906,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,639,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,071,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,308,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,255,000	
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,809,000	
第２８回ジェイ　エフ　イー　ホールディングス株式会社無担保社	100,000,000	99,367,000	
第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,345,000	
第３３回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,061,000	
第８回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,970,000	

第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,357,000	
第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,198,000	
第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,851,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,515,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,618,000	
第２０回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,995,000	
第２１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,241,000	
第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第１９回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,709,000	
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,740,000	
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,030,000	
第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,206,000	
第１回明治安田生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,134,000	
第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,964,000	
第１６回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,436,000	
第１２回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,544,000	
第１回明治安田生命２０１８基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,150,000	
第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,986,000	
第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,944,000	
第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	97,110,000	
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,111,000	
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,623,000	
第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,626,000	
第７３回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	200,560,000	
第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,444,000	
第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,030,000	
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	100,066,000	
第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	118,073,000	
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	112,441,000	
第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,244,000	
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	101,407,000	
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,380,000	
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	304,305,000	
第３回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,323,000	
第４回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,252,000	
第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,894,000	

第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	201,976,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,708,000	
第６４回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,762,000	
第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,142,000	
第６７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,965,000	
第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第３７回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,718,000	
第４１回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,839,000	
第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,792,000	
第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,267,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,169,000	
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,361,000	
第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,936,000	
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	200,576,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,205,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	201,984,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,503,000	
第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,437,000	
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	99,134,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,086,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,644,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,972,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,266,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,202,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,095,000	
第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,909,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,173,000	
第１２４回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,718,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,714,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,586,000	
第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,640,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,620,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,390,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,630,000	

第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,095,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,066,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,489,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	232,882,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,740,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,795,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,595,000	
第１４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,527,000	
第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,154,000	
第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,363,000	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,365,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,499,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,706,000	
第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	501,465,000	
第７５回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,024,000	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,570,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,401,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,936,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,379,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,958,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,785,000	
第５３回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	194,152,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,883,000	
第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,046,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	101,722,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,206,000	
第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,924,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,293,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,335,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,268,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,311,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,440,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,242,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,095,000	
第５２４回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,669,000	

第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,790,000	
第５３８回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,281,000	
第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,610,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,409,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,849,000	
第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,614,000	
第４１６回中国電力株式会社社債	200,000,000	201,398,000	
第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,666,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,656,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,181,000	
第３３０回北陸電力株式会社社債	200,000,000	201,242,000	
第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	129,665,340	
第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,924,000	
第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,975,000	
第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,579,000	
第５２１回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,460,000	
第５２７回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,952,000	
第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,034,000	
第３０９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,924,000	
第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,884,000	
第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,956,000	
第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,324,000	
第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,248,000	
第４８９回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,054,000	
第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,007,000	
第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,557,000	
第３５０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,046,000	
第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	107,892,000	
第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,391,000	
第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,867,000	
第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,270,000	
第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,764,000	
第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	204,420,000	
第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	400,000,000	404,424,000	
第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,863,000	
第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	303,369,000	
第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,893,000	
第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,083,000	
	100,000,000	100,213,000	

	第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債			
	第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,419,000	
	第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,182,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,675,000	
	第６回ＳＣＳＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,957,000	
	第３回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,712,000	
	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	202,762,000	
社債券合計		26,326,000,000	26,664,549,340	
合計			623,538,587,396	

(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

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,261,145,192
株式	460,742,957,170
派生商品評価勘定	35,797,450
未収配当金	4,332,026,086
前払金	13,490,400
差入委託証拠金	346,933,600
流動資産合計	467,732,349,898
資産合計	467,732,349,898
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,326,350
未払金	849,700
未払解約金	184,421,515
未払利息	1,751
流動負債合計	234,599,316
負債合計	234,599,316
純資産の部	
元本等	
元本	248,363,141,878

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	219,134,608,704
元本等合計	467,497,750,582
純資産合計	467,497,750,582
負債純資産合計	467,732,349,898

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 5月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	248,363,141,878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 1.8823円 (1万口当たり純資産額) (18,823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

	2021年 5月10日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、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と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年 5月10日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	224,126,876,199円
期中追加設定元本額	53,343,075,862円
期中一部解約元本額	29,106,810,183円
期末元本額	248,363,141,878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）	426,546,883円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,843,112,972円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	13,679,351円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	10,275,999,594円
世界経済インデックスファンド	2,636,633,867円
日本株式インデックス・オープン	3,608,491,153円
ＤＣマイセレクション２５	6,022,402,023円
ＤＣマイセレクション５０	17,808,256,511円
ＤＣマイセレクション７５	17,445,586,637円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,756,866,721円

区分	2021年 5月10日現在
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,753,740,100円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,172,713,122円
ＤＣマイセレクションＳ７５	5,734,449,846円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	7,400,454,679円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	246,671,315円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	639,834,663円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	456,115,271円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,163,332,283円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,535,953,339円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	6,227,022円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	26,725,162円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	25,297,047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）	198,941,548円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,358,345円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	52,282,962円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	170,954,225円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	30,939,348円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	98,131,095円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,188,478,233円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	491,003,404円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,126,744,431円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	323,286,485円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	29,119,791円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	561,010,702円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	321,308,515円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	405,108,729円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	42,081,893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）	653,443,965円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	3,731,672,493円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,859,744,293円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,664,905,026円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,195,855,155円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,020,477,503円
分散投資コア戦略ファンドＳ	7,117,796,551円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	385,022,461円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	378,308,846円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,005,572,530円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	201,449,996円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,320,477円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	59,342,566円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	24,107,759,942円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	623,662,329円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	32,919,636円

区分	2021年 5月10日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	107,005,839円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	18,594,136円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,621,986円
グローバル経済コア	235,497,660円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	22,224,695円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	52,758,327円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	6,885,464円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,149,454,517円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	118,999,556円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	661,927円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	656,421円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	278,950円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	627,631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）	42,222,011,781円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,219,797,320円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	163,727,479円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	26,760,409円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	595,818,256円
ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用）	46,326,666,488円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	72,229,695,184
合計	72,229,695,184

(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

（2021年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,735,250,400	－	6,721,760,000	△13,490,400
合計		6,735,250,400	－	6,721,760,000	△13,490,400

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数（株）	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	7,600	3,005.00	22,838,000	
日本水産	216,700	540.00	117,018,000	
マルハニチロ	36,500	2,662.00	97,163,000	
雪国まいたけ	19,200	1,974.00	37,900,800	
カネコ種苗	7,100	1,573.00	11,168,300	
サカタのタネ	27,800	3,825.00	106,335,000	
ホクト	19,600	2,030.00	39,788,000	
ホクリヨウ	3,600	723.00	2,602,800	
住石ホールディングス	40,800	130.00	5,304,000	
日鉄鉱業	5,300	6,890.00	36,517,000	
三井松島ホールディングス	9,800	990.00	9,702,000	
ＩＮＰＥＸ	858,000	813.00	697,554,000	
石油資源開発	30,500	2,238.00	68,259,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	11,300	1,447.00	16,351,100	
ヒノキヤグループ	5,800	2,591.00	15,027,800	
ショーボンドホールディングス	33,300	4,660.00	155,178,000	
ミライト・ホールディングス	80,900	1,812.00	146,590,800	
タマホーム	14,100	2,477.00	34,925,700	
サンヨーホームズ	2,700	766.00	2,068,200	
日本アクア	9,300	619.00	5,756,700	
ファーストコーポレーション	7,100	779.00	5,530,900	
ベステラ	4,500	1,647.00	7,411,500	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	43,700	175.00	7,647,500	
キャンディル	4,000	541.00	2,164,000	
スペースバリューホールディングス	28,400	770.00	21,868,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,500	977.00	4,396,500	
第一カッター興業	5,800	1,416.00	8,212,800	
安藤・間	149,600	861.00	128,805,600	
東急建設	68,300	585.00	39,955,500	
コムシスホールディングス	82,700	3,580.00	296,066,000	
ビーアールホールディングス	31,200	577.00	18,002,400	

高松コンストラクショングループ	14,500	2,076.00	30,102,000	
東建コーポレーション	7,200	9,930.00	71,496,000	
ソネック	2,400	936.00	2,246,400	
ヤマウラ	10,100	924.00	9,332,400	
オリエンタル白石	78,400	300.00	23,520,000	
大成建設	167,700	4,230.00	709,371,000	
大林組	538,800	1,041.00	560,890,800	
清水建設	504,700	935.00	471,894,500	
飛島建設	15,500	1,135.00	17,592,500	
長谷工コーポレーション	176,500	1,536.00	271,104,000	
松井建設	21,200	726.00	15,391,200	
錢高組	2,400	4,530.00	10,872,000	
鹿島建設	394,800	1,583.00	624,968,400	
不動テトラ	13,200	1,907.00	25,172,400	
大末建設	6,800	974.00	6,623,200	
鉄建建設	10,900	1,868.00	20,361,200	
西松建設	38,500	2,944.00	113,344,000	
三井住友建設	130,200	486.00	63,277,200	
大豊建設	11,800	3,985.00	47,023,000	
前田建設工業	134,900	981.00	132,336,900	
佐田建設	12,400	436.00	5,406,400	
ナカノフドー建設	12,900	385.00	4,966,500	
奥村組	29,600	2,783.00	82,376,800	
東鉄工業	23,100	2,603.00	60,129,300	
イチケン	3,900	1,934.00	7,542,600	
富士ピー・エス	6,900	591.00	4,077,900	
淺沼組	6,500	4,535.00	29,477,500	
戸田建設	223,700	811.00	181,420,700	
熊谷組	25,000	3,140.00	78,500,000	
北野建設	3,300	2,420.00	7,986,000	
植木組	4,800	1,541.00	7,396,800	
矢作建設工業	23,800	802.00	19,087,600	
ピーエス三菱	17,700	661.00	11,699,700	
日本ハウスホールディングス	36,800	333.00	12,254,400	
大東建託	58,800	11,630.00	683,844,000	
新日本建設	22,900	866.00	19,831,400	
ＮＩＰＰＯ	44,600	2,914.00	129,964,400	
東亜道路工業	3,300	4,495.00	14,833,500	
前田道路	33,300	2,193.00	73,026,900	
日本道路	5,200	8,030.00	41,756,000	
東亜建設工業	14,400	2,487.00	35,812,800	
日本国土開発	52,400	608.00	31,859,200	

若築建設	9,700	1,304.00	12,648,800	
東洋建設	60,400	593.00	35,817,200	
五洋建設	228,800	883.00	202,030,400	
世紀東急工業	25,900	889.00	23,025,100	
福田組	6,200	4,985.00	30,907,000	
住友林業	126,700	2,450.00	310,415,000	
日本基礎技術	16,500	519.00	8,563,500	
巴コーポレーション	23,900	390.00	9,321,000	
大和ハウス工業	497,500	3,421.00	1,701,947,500	
ライト工業	30,800	1,798.00	55,378,400	
積水ハウス	584,400	2,318.00	1,354,639,200	
日特建設	14,100	801.00	11,294,100	
北陸電気工事	9,300	1,140.00	10,602,000	
ユアテック	30,800	793.00	24,424,400	
日本リーテック	11,300	1,806.00	20,407,800	
四電工	2,900	3,295.00	9,555,500	
中電工	24,800	2,369.00	58,751,200	
関電工	87,600	955.00	83,658,000	
きんでん	109,400	1,854.00	202,827,600	
東京エネシス	17,900	970.00	17,363,000	
トーエネック	5,400	3,845.00	20,763,000	
住友電設	15,200	2,339.00	35,552,800	
日本電設工業	29,500	1,801.00	53,129,500	
協和エクシオ	81,700	2,995.00	244,691,500	
新日本空調	14,200	2,253.00	31,992,600	
九電工	37,800	3,810.00	144,018,000	
三機工業	38,200	1,413.00	53,976,600	
日揮ホールディングス	179,700	1,297.00	233,070,900	
中外炉工業	5,800	2,167.00	12,568,600	
ヤマト	17,200	698.00	12,005,600	
太平電業	11,900	2,704.00	32,177,600	
高砂熱学工業	48,700	1,695.00	82,546,500	
三晃金属工業	2,100	2,684.00	5,636,400	
朝日工業社	4,000	2,915.00	11,660,000	
明星工業	34,800	793.00	27,596,400	
大氣社	26,200	3,015.00	78,993,000	
ダイダン	12,000	2,793.00	33,516,000	
日比谷総合設備	17,300	1,925.00	33,302,500	
フィル・カンパニー	3,100	3,035.00	9,408,500	
東洋エンジニアリング	22,600	741.00	16,746,600	
レイズネクスト	28,900	1,202.00	34,737,800	
ニップン	50,500	1,610.00	81,305,000	

日清製粉グループ本社	194,800	1,844.00	359,211,200	
日東富士製粉	1,300	7,180.00	9,334,000	
昭和産業	14,500	3,025.00	43,862,500	
鳥越製粉	15,300	818.00	12,515,400	
中部飼料	21,100	1,410.00	29,751,000	
フィード・ワン	23,200	885.00	20,532,000	
東洋精糖	2,900	1,211.00	3,511,900	
日本甜菜製糖	9,000	1,634.00	14,706,000	
DM三井製糖ホールディングス	13,600	1,859.00	25,282,400	
塩水港精糖	20,500	237.00	4,858,500	
日新製糖	8,200	1,795.00	14,719,000	
森永製菓	40,500	3,750.00	151,875,000	
中村屋	4,100	3,850.00	15,785,000	
江崎グリコ	47,500	4,245.00	201,637,500	
名糖産業	7,600	1,529.00	11,620,400	
井村屋グループ	9,800	2,501.00	24,509,800	
不二家	11,000	2,180.00	23,980,000	
山崎製パン	129,300	1,755.00	226,921,500	
第一屋製パン	3,300	959.00	3,164,700	
モロゾフ	2,700	5,350.00	14,445,000	
亀田製菓	9,800	4,680.00	45,864,000	
寿スピリッツ	16,600	6,490.00	107,734,000	
カルビー	78,600	2,676.00	210,333,600	
森永乳業	31,900	6,280.00	200,332,000	
六甲バター	11,400	1,631.00	18,593,400	
ヤクルト本社	118,600	5,550.00	658,230,000	
明治ホールディングス	114,000	6,930.00	790,020,000	
雪印メグミルク	41,500	2,281.00	94,661,500	
プリマハム	24,300	3,345.00	81,283,500	
日本ハム	65,900	4,830.00	318,297,000	
林兼産業	5,700	634.00	3,613,800	
丸大食品	17,000	1,721.00	29,257,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	15,500	3,315.00	51,382,500	
柿安本店	6,000	2,563.00	15,378,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	111,000	733.00	81,363,000	
サッポロホールディングス	58,800	2,240.00	131,712,000	
アサヒグループホールディングス	376,700	4,741.00	1,785,934,700	
キリンホールディングス	731,300	2,082.00	1,522,566,600	
宝ホールディングス	127,800	1,472.00	188,121,600	
オエノンホールディングス	49,000	393.00	19,257,000	
養命酒製造	5,300	1,859.00	9,852,700	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	132,000	1,831.00	241,692,000	

サントリー食品インターナショナル	115,400	3,775.00	435,635,000	
ダイドーグループホールディングス	9,700	5,250.00	50,925,000	
伊藤園	52,300	6,240.00	326,352,000	
キーコーヒー	16,900	2,089.00	35,304,100	
ユニカフェ	5,200	1,005.00	5,226,000	
ジャパンフーズ	2,400	1,209.00	2,901,600	
日清オイリオグループ	22,200	3,135.00	69,597,000	
不二製油グループ本社	42,000	2,842.00	119,364,000	
かどや製油	1,900	4,160.00	7,904,000	
Ｊ－オイルミルズ	16,100	1,891.00	30,445,100	
キッコーマン	124,100	6,920.00	858,772,000	
味の素	410,100	2,322.50	952,457,250	
ブルドックソース	7,800	2,326.00	18,142,800	
キユーピー	96,000	2,604.00	249,984,000	
ハウス食品グループ本社	64,500	3,495.00	225,427,500	
カゴメ	70,500	3,215.00	226,657,500	
焼津水産化学工業	8,400	986.00	8,282,400	
アリアケジャパン	15,800	6,680.00	105,544,000	
ピエトロ	2,300	1,780.00	4,094,000	
エバラ食品工業	3,800	2,677.00	10,172,600	
やまみ	1,900	2,143.00	4,071,700	
ニチレイ	82,100	2,824.00	231,850,400	
東洋水産	88,700	4,555.00	404,028,500	
イートアンドホールディングス	6,000	1,852.00	11,112,000	
大冷	1,900	1,949.00	3,703,100	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,600	826.00	7,929,600	
日清食品ホールディングス	67,700	7,900.00	534,830,000	
永谷園ホールディングス	8,400	2,283.00	19,177,200	
一正蒲鉾	6,700	1,267.00	8,488,900	
フジッコ	18,700	1,942.00	36,315,400	
ロック・フィールド	18,600	1,579.00	29,369,400	
日本たばこ産業	924,600	2,147.50	1,985,578,500	
ケンコーマヨネーズ	10,500	1,784.00	18,732,000	
わらべや日洋ホールディングス	11,300	2,034.00	22,984,200	
なとり	9,600	1,931.00	18,537,600	
イフジ産業	2,700	946.00	2,554,200	
ピックルスコーポレーション	4,100	3,375.00	13,837,500	
ファーマフーズ	16,300	3,335.00	54,360,500	
北の達人コーポレーション	60,200	492.00	29,618,400	
ユーグレナ	87,800	919.00	80,688,200	
ミヨシ油脂	6,000	1,230.00	7,380,000	
理研ビタミン	16,300	1,410.00	22,983,000	

片倉工業	22,900	1,462.00	33,479,800	
グンゼ	12,500	4,055.00	50,687,500	
東洋紡	66,900	1,453.00	97,205,700	
ユニチカ	50,600	400.00	20,240,000	
富士紡ホールディングス	8,200	4,540.00	37,228,000	
倉敷紡績	15,800	1,890.00	29,862,000	
シキボウ	9,500	959.00	9,110,500	
日本毛織	55,900	1,012.00	56,570,800	
トーア紡コーポレーション	6,700	460.00	3,082,000	
帝国繊維	19,200	2,104.00	40,396,800	
帝人	158,700	1,876.00	297,721,200	
東レ	1,219,100	708.10	863,244,710	
サカイオーベックス	4,600	3,080.00	14,168,000	
住江織物	3,700	1,996.00	7,385,200	
日本フエルト	10,700	439.00	4,697,300	
イチカワ	2,600	1,334.00	3,468,400	
日東製網	1,800	1,548.00	2,786,400	
アツギ	13,300	642.00	8,538,600	
ダイニック	6,400	814.00	5,209,600	
セーレン	41,600	1,966.00	81,785,600	
ソトー	6,900	800.00	5,520,000	
東海染工	2,300	1,125.00	2,587,500	
小松マテーレ	27,800	927.00	25,770,600	
ワコールホールディングス	42,100	2,602.00	109,544,200	
ホギメディカル	22,700	3,350.00	76,045,000	
ＴＳＩホールディングス	51,800	337.00	17,456,600	
マツオカコーポレーション	5,500	1,876.00	10,318,000	
ワールド	22,200	1,459.00	32,389,800	
三陽商会	8,800	837.00	7,365,600	
ナイガイ	6,800	340.00	2,312,000	
オンワードホールディングス	101,800	306.00	31,150,800	
ルックホールディングス	5,900	1,276.00	7,528,400	
ゴールドウイン	27,900	6,750.00	188,325,000	
デサント	28,800	1,942.00	55,929,600	
キング	9,300	532.00	4,947,600	
ヤマトインターナショナル	15,400	333.00	5,128,200	
特種東海製紙	10,300	4,715.00	48,564,500	
王子ホールディングス	757,500	762.00	577,215,000	
日本製紙	74,400	1,446.00	107,582,400	
三菱製紙	23,900	363.00	8,675,700	
北越コーポレーション	120,400	588.00	70,795,200	
中越パルプ工業	6,400	1,263.00	8,083,200	

巴川製紙所	5,500	812.00	4,466,000	
大王製紙	81,100	1,926.00	156,198,600	
阿波製紙	4,300	433.00	1,861,900	
レンゴー	173,500	965.00	167,427,500	
トーモク	10,300	2,047.00	21,084,100	
ザ・パック	12,700	2,832.00	35,966,400	
クラレ	265,000	1,252.00	331,780,000	
旭化成	1,115,300	1,207.50	1,346,724,750	
共和レザー	9,100	770.00	7,007,000	
昭和電工	127,800	3,670.00	469,026,000	
住友化学	1,324,600	603.00	798,733,800	
住友精化	8,200	3,890.00	31,898,000	
日産化学	92,800	5,980.00	554,944,000	
ラサ工業	5,500	2,228.00	12,254,000	
クレハ	14,400	7,900.00	113,760,000	
多木化学	6,600	5,890.00	38,874,000	
テイカ	12,300	1,427.00	17,552,100	
石原産業	30,200	938.00	28,327,600	
片倉コープアグリ	4,300	1,212.00	5,211,600	
日本曹達	23,500	3,365.00	79,077,500	
東ソー	260,100	2,038.00	530,083,800	
トクヤマ	50,000	2,529.00	126,450,000	
セントラル硝子	32,100	2,374.00	76,205,400	
東亞合成	102,700	1,249.00	128,272,300	
大阪ソーダ	17,100	2,588.00	44,254,800	
関東電化工業	39,900	899.00	35,870,100	
デンカ	61,400	4,520.00	277,528,000	
信越化学工業	311,200	18,575.00	5,780,540,000	
日本カーバイド工業	6,100	1,351.00	8,241,100	
堺化学工業	11,800	1,955.00	23,069,000	
第一稀元素化学工業	16,900	1,400.00	23,660,000	
エア・ウォーター	171,600	1,930.00	331,188,000	
日本酸素ホールディングス	138,600	2,134.00	295,772,400	
日本化学工業	4,800	2,999.00	14,395,200	
東邦アセチレン	2,500	1,282.00	3,205,000	
日本パーカライジング	84,900	1,086.00	92,201,400	
高圧ガス工業	26,700	733.00	19,571,100	
チタン工業	2,100	2,079.00	4,365,900	
四国化成工業	22,400	1,250.00	28,000,000	
戸田工業	3,600	2,153.00	7,750,800	
ステラ　ケミファ	9,200	3,160.00	29,072,000	
保土谷化学工業	4,900	4,470.00	21,903,000	

日本触媒	30,500	5,930.00	180,865,000	
大日精化工業	13,900	2,376.00	33,026,400	
カネカ	43,500	4,465.00	194,227,500	
三菱瓦斯化学	168,600	2,615.00	440,889,000	
三井化学	145,200	3,660.00	531,432,000	
ＪＳＲ	168,900	3,365.00	568,348,500	
東京応化工業	28,900	7,310.00	211,259,000	
大阪有機化学工業	15,500	4,085.00	63,317,500	
三菱ケミカルホールディングス	1,124,900	869.30	977,875,570	
ＫＨネオケム	27,700	2,717.00	75,260,900	
ダイセル	226,200	896.00	202,675,200	
住友ベークライト	26,500	4,650.00	123,225,000	
積水化学工業	355,800	2,004.00	713,023,200	
日本ゼオン	151,800	1,751.00	265,801,800	
アイカ工業	46,900	4,225.00	198,152,500	
宇部興産	85,000	2,333.00	198,305,000	
積水樹脂	27,800	2,174.00	60,437,200	
タキロンシーアイ	36,400	675.00	24,570,000	
旭有機材	9,500	1,448.00	13,756,000	
ニチバン	8,800	1,869.00	16,447,200	
リケンテクノス	41,000	553.00	22,673,000	
大倉工業	7,900	1,979.00	15,634,100	
積水化成品工業	22,600	599.00	13,537,400	
群栄化学工業	3,800	2,425.00	9,215,000	
タイガースポリマー	8,900	489.00	4,352,100	
ミライアル	5,400	1,354.00	7,311,600	
ダイキアクシス	6,400	913.00	5,843,200	
ダイキョーニシカワ	35,500	794.00	28,187,000	
竹本容器	6,000	1,003.00	6,018,000	
森六ホールディングス	9,000	2,136.00	19,224,000	
恵和	3,300	2,526.00	8,335,800	
日本化薬	104,200	1,075.00	112,015,000	
カーリットホールディングス	16,700	725.00	12,107,500	
日本精化	12,200	1,446.00	17,641,200	
扶桑化学工業	13,300	4,280.00	56,924,000	
トリケミカル研究所	15,600	3,655.00	57,018,000	
ＡＤＥＫＡ	77,500	2,184.00	169,260,000	
日油	63,400	6,150.00	389,910,000	
新日本理化	27,800	287.00	7,978,600	
ハリマ化成グループ	12,500	939.00	11,737,500	
花王	411,400	6,981.00	2,871,983,400	
第一工業製薬	5,700	3,710.00	21,147,000	

石原ケミカル	4,200	2,128.00	8,937,600	
日華化学	5,700	1,232.00	7,022,400	
ニイタカ	3,500	2,660.00	9,310,000	
三洋化成工業	10,000	5,400.00	54,000,000	
有機合成薬品工業	12,900	292.00	3,766,800	
大日本塗料	19,000	878.00	16,682,000	
日本ペイントホールディングス	694,200	1,753.00	1,216,932,600	
関西ペイント	189,000	2,814.00	531,846,000	
神東塗料	13,200	210.00	2,772,000	
中国塗料	40,500	1,004.00	40,662,000	
日本特殊塗料	12,600	1,062.00	13,381,200	
藤倉化成	22,700	551.00	12,507,700	
太陽ホールディングス	12,400	5,490.00	68,076,000	
ＤＩＣ	71,100	2,945.00	209,389,500	
サカタインクス	36,700	1,086.00	39,856,200	
東洋インキＳＣホールディングス	35,600	2,090.00	74,404,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	11,700	805.00	9,418,500	
富士フイルムホールディングス	302,000	7,286.00	2,200,372,000	
資生堂	341,400	7,920.00	2,703,888,000	
ライオン	223,400	2,040.00	455,736,000	
高砂香料工業	10,700	2,693.00	28,815,100	
マンダム	36,000	2,062.00	74,232,000	
ミルボン	23,000	5,790.00	133,170,000	
ファンケル	62,600	3,540.00	221,604,000	
コーセー	32,300	16,120.00	520,676,000	
コタ	10,900	1,541.00	16,796,900	
シーボン	2,200	1,975.00	4,345,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	73,300	2,871.00	210,444,300	
ノエビアホールディングス	14,600	4,870.00	71,102,000	
アジュバンコスメジャパン	3,800	1,039.00	3,948,200	
新日本製薬	4,700	2,094.00	9,841,800	
エステー	11,000	1,843.00	20,273,000	
アグロ　カネショウ	6,400	1,485.00	9,504,000	
コニシ	28,200	1,614.00	45,514,800	
長谷川香料	29,600	2,183.00	64,616,800	
星光ＰＭＣ	9,800	801.00	7,849,800	
小林製薬	48,100	9,830.00	472,823,000	
荒川化学工業	14,300	1,273.00	18,203,900	
メック	11,800	2,537.00	29,936,600	
日本高純度化学	4,700	2,674.00	12,567,800	
タカラバイオ	45,000	2,836.00	127,620,000	
ＪＣＵ	19,300	4,090.00	78,937,000	

新田ゼラチン	10,800	647.00	6,987,600	
ＯＡＴアグリオ	3,200	1,419.00	4,540,800	
デクセリアルズ	48,000	2,017.00	96,816,000	
アース製薬	12,900	6,240.00	80,496,000	
北興化学工業	16,000	1,003.00	16,048,000	
大成ラミック	5,300	2,815.00	14,919,500	
クミアイ化学工業	71,000	899.00	63,829,000	
日本農薬	30,600	576.00	17,625,600	
アキレス	11,800	1,418.00	16,732,400	
有沢製作所	23,900	970.00	23,183,000	
日東電工	103,800	9,030.00	937,314,000	
レック	20,400	1,177.00	24,010,800	
三光合成	18,000	451.00	8,118,000	
きもと	26,300	277.00	7,285,100	
藤森工業	15,400	4,210.00	64,834,000	
前澤化成工業	10,900	1,138.00	12,404,200	
未来工業	6,100	1,783.00	10,876,300	
ウェーブロックホールディングス	5,900	736.00	4,342,400	
ＪＳＰ	10,100	1,741.00	17,584,100	
エフピコ	31,600	4,430.00	139,988,000	
天馬	12,900	2,316.00	29,876,400	
信越ポリマー	26,400	1,090.00	28,776,000	
東リ	42,800	258.00	11,042,400	
ニフコ	63,100	3,860.00	243,566,000	
バルカー	14,000	2,144.00	30,016,000	
ユニ・チャーム	364,300	4,254.00	1,549,732,200	
ショーエイコーポレーション	3,800	1,006.00	3,822,800	
協和キリン	172,800	3,375.00	583,200,000	
武田薬品工業	1,429,500	3,730.00	5,332,035,000	
アステラス製薬	1,489,700	1,722.00	2,565,263,400	
大日本住友製薬	127,300	1,954.00	248,744,200	
塩野義製薬	216,100	5,797.00	1,252,731,700	
わかもと製薬	20,400	332.00	6,772,800	
日本新薬	48,700	7,410.00	360,867,000	
ビオフェルミン製薬	2,900	3,025.00	8,772,500	
中外製薬	537,400	4,171.00	2,241,495,400	
科研製薬	29,400	4,590.00	134,946,000	
エーザイ	189,800	7,250.00	1,376,050,000	
ロート製薬	81,900	2,860.00	234,234,000	
小野薬品工業	394,600	2,880.50	1,136,645,300	
久光製薬	50,000	6,560.00	328,000,000	
持田製薬	23,800	3,940.00	93,772,000	

参天製薬	299,000	1,430.00	427,570,000	
扶桑薬品工業	5,500	2,477.00	13,623,500	
日本ケミファ	2,000	2,345.00	4,690,000	
ツムラ	57,300	3,730.00	213,729,000	
日医工	48,700	973.00	47,385,100	
キッセイ薬品工業	30,400	2,298.00	69,859,200	
生化学工業	30,300	1,040.00	31,512,000	
栄研化学	30,200	2,210.00	66,742,000	
日水製薬	6,300	990.00	6,237,000	
鳥居薬品	10,800	2,576.00	27,820,800	
ＪＣＲファーマ	48,400	3,060.00	148,104,000	
東和薬品	24,700	2,322.00	57,353,400	
富士製薬工業	11,600	1,224.00	14,198,400	
ゼリア新薬工業	31,200	2,011.00	62,743,200	
第一三共	1,475,000	2,922.50	4,310,687,500	
キョーリン製薬ホールディングス	37,900	1,908.00	72,313,200	
大幸薬品	21,100	1,039.00	21,922,900	
ダイト	11,000	3,470.00	38,170,000	
大塚ホールディングス	357,100	4,384.00	1,565,526,400	
大正製薬ホールディングス	40,900	6,770.00	276,893,000	
ペプチドリーム	88,600	4,870.00	431,482,000	
あすか製薬ホールディングス	19,600	1,382.00	27,087,200	
サワイグループホールディングス	37,600	5,330.00	200,408,000	
日本コークス工業	145,100	110.00	15,961,000	
ニチレキ	20,300	1,414.00	28,704,200	
ユシロ化学工業	9,600	1,150.00	11,040,000	
ビーピー・カストロール	6,100	1,402.00	8,552,200	
富士石油	41,700	245.00	10,216,500	
ＭＯＲＥＳＣＯ	6,200	1,104.00	6,844,800	
出光興産	190,700	2,808.00	535,485,600	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,584,600	507.50	1,311,684,500	
コスモエネルギーホールディングス	54,300	2,603.00	141,342,900	
横浜ゴム	99,500	2,133.00	212,233,500	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	90,400	2,096.00	189,478,400	
ブリヂストン	456,800	4,628.00	2,114,070,400	
住友ゴム工業	154,300	1,408.00	217,254,400	
藤倉コンポジット	15,000	493.00	7,395,000	
オカモト	10,500	4,070.00	42,735,000	
フコク	7,500	790.00	5,925,000	
ニッタ	17,800	2,714.00	48,309,200	
住友理工	33,300	745.00	24,808,500	
三ツ星ベルト	20,900	1,728.00	36,115,200	

バンドー化学	30,200	754.00	22,770,800	
日東紡績	25,600	4,025.00	103,040,000	
ＡＧＣ	157,700	5,230.00	824,771,000	
日本板硝子	87,200	771.00	67,231,200	
石塚硝子	2,900	1,948.00	5,649,200	
日本山村硝子	7,300	973.00	7,102,900	
日本電気硝子	63,800	2,794.00	178,257,200	
オハラ	6,900	1,575.00	10,867,500	
住友大阪セメント	31,000	3,675.00	113,925,000	
太平洋セメント	101,800	2,912.00	296,441,600	
日本ヒューム	15,800	729.00	11,518,200	
日本コンクリート工業	37,300	406.00	15,143,800	
三谷セキサン	8,000	4,095.00	32,760,000	
アジアパイルホールディングス	26,700	523.00	13,964,100	
東海カーボン	168,100	1,916.00	322,079,600	
日本カーボン	9,500	4,995.00	47,452,500	
東洋炭素	10,100	2,274.00	22,967,400	
ノリタケカンパニーリミテド	9,500	3,785.00	35,957,500	
ＴＯＴＯ	122,700	5,830.00	715,341,000	
日本碍子	189,100	2,045.00	386,709,500	
日本特殊陶業	130,800	1,708.00	223,406,400	
ＭＡＲＵＷＡ	6,000	11,340.00	68,040,000	
品川リフラクトリーズ	4,100	3,290.00	13,489,000	
黒崎播磨	2,900	4,750.00	13,775,000	
ヨータイ	12,400	1,106.00	13,714,400	
イソライト工業	7,800	660.00	5,148,000	
東京窯業	22,300	331.00	7,381,300	
ニッカトー	8,000	734.00	5,872,000	
フジミインコーポレーテッド	13,800	4,655.00	64,239,000	
クニミネ工業	5,500	1,214.00	6,677,000	
エーアンドエーマテリアル	3,300	1,018.00	3,359,400	
ニチアス	43,500	2,997.00	130,369,500	
ニチハ	23,900	3,265.00	78,033,500	
日本製鉄	811,100	2,281.00	1,850,119,100	
神戸製鋼所	311,100	912.00	283,723,200	
中山製鋼所	23,800	489.00	11,638,200	
合同製鐵	9,200	1,902.00	17,498,400	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	491,700	1,725.00	848,182,500	
東京製鐵	66,300	1,189.00	78,830,700	
共英製鋼	19,200	1,526.00	29,299,200	
大和工業	36,100	3,720.00	134,292,000	
東京鐵鋼	6,500	1,733.00	11,264,500	

大阪製鐵	9,100	1,407.00	12,803,700	
淀川製鋼所	22,900	2,591.00	59,333,900	
丸一鋼管	55,200	2,899.00	160,024,800	
モリ工業	5,100	2,727.00	13,907,700	
大同特殊鋼	27,800	6,110.00	169,858,000	
日本高周波鋼業	6,500	456.00	2,964,000	
日本冶金工業	13,300	2,494.00	33,170,200	
山陽特殊製鋼	20,400	1,842.00	37,576,800	
愛知製鋼	9,600	3,510.00	33,696,000	
日立金属	160,200	2,130.00	341,226,000	
日本金属	4,300	1,208.00	5,194,400	
大平洋金属	11,500	2,565.00	29,497,500	
新日本電工	109,900	407.00	44,729,300	
栗本鐵工所	7,700	1,750.00	13,475,000	
虹技	2,400	1,218.00	2,923,200	
三菱製鋼	12,700	915.00	11,620,500	
日亜鋼業	25,200	320.00	8,064,000	
日本精線	2,400	4,350.00	10,440,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,300	1,134.00	8,278,200	
シンニッタン	20,900	271.00	5,663,900	
新家工業	4,300	1,709.00	7,348,700	
大紀アルミニウム工業所	25,700	1,067.00	27,421,900	
日本軽金属ホールディングス	46,400	2,318.00	107,555,200	
三井金属鉱業	45,900	4,080.00	187,272,000	
東邦亜鉛	9,500	2,592.00	24,624,000	
三菱マテリアル	112,300	2,734.00	307,028,200	
住友金属鉱山	217,200	5,283.00	1,147,467,600	
ＤＯＷＡホールディングス	43,000	5,060.00	217,580,000	
古河機械金属	28,200	1,339.00	37,759,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,800	1,071.00	19,063,800	
東邦チタニウム	30,500	1,044.00	31,842,000	
ＵＡＣＪ	25,800	2,884.00	74,407,200	
ＣＫサンエツ	3,600	3,605.00	12,978,000	
古河電気工業	52,800	3,000.00	158,400,000	
住友電気工業	593,000	1,677.50	994,757,500	
フジクラ	205,200	590.00	121,068,000	
昭和電線ホールディングス	16,500	1,624.00	26,796,000	
東京特殊電線	2,200	2,614.00	5,750,800	
タツタ電線	30,200	613.00	18,512,600	
カナレ電気	2,900	1,788.00	5,185,200	
平河ヒューテック	9,500	1,341.00	12,739,500	
リョービ	21,000	1,687.00	35,427,000	

アーレスティ	21,200	502.00	10,642,400	
アサヒホールディングス	63,800	2,359.00	150,504,200	
稲葉製作所	9,600	1,495.00	14,352,000	
宮地エンジニアリンググループ	5,500	2,348.00	12,914,000	
トーカロ	43,800	1,552.00	67,977,600	
アルファＣｏ	6,000	1,259.00	7,554,000	
ＳＵＭＣＯ	217,400	2,649.00	575,892,600	
川田テクノロジーズ	3,500	4,375.00	15,312,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,500	6,280.00	34,540,000	
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,830.00	5,377,000	
信和	9,000	806.00	7,254,000	
東洋製罐グループホールディングス	108,200	1,391.00	150,506,200	
ホッカンホールディングス	8,600	1,442.00	12,401,200	
コロナ	9,400	964.00	9,061,600	
横河ブリッジホールディングス	29,200	2,141.00	62,517,200	
駒井ハルテック	3,400	1,987.00	6,755,800	
高田機工	1,600	2,686.00	4,297,600	
三和ホールディングス	160,200	1,426.00	228,445,200	
文化シヤッター	50,100	968.00	48,496,800	
三協立山	21,900	859.00	18,812,100	
アルインコ	11,200	1,038.00	11,625,600	
東洋シヤッター	3,700	653.00	2,416,100	
ＬＩＸＩＬ	234,000	2,935.00	686,790,000	
日本フイルコン	11,800	498.00	5,876,400	
ノーリツ	35,200	1,721.00	60,579,200	
長府製作所	17,300	2,041.00	35,309,300	
リンナイ	33,000	11,250.00	371,250,000	
ダイニチ工業	8,100	835.00	6,763,500	
日東精工	21,300	564.00	12,013,200	
三洋工業	2,100	1,847.00	3,878,700	
岡部	34,400	754.00	25,937,600	
ジーテクト	21,100	1,470.00	31,017,000	
東プレ	31,700	1,505.00	47,708,500	
高周波熱錬	32,700	581.00	18,998,700	
東京製綱	12,100	1,100.00	13,310,000	
サンコール	14,500	470.00	6,815,000	
モリテック　スチール	13,200	451.00	5,953,200	
パイオラックス	25,100	1,517.00	38,076,700	
エイチワン	16,700	836.00	13,961,200	
日本発條	169,200	817.00	138,236,400	
中央発條	8,200	1,111.00	9,110,200	
アドバネクス	2,400	1,484.00	3,561,600	

立川ブラインド工業	7,500	1,375.00	10,312,500	
三益半導体工業	13,300	2,729.00	36,295,700	
日本ドライケミカル	4,300	1,735.00	7,460,500	
日本製鋼所	51,600	2,787.00	143,809,200	
三浦工業	73,600	5,910.00	434,976,000	
タクマ	57,700	2,280.00	131,556,000	
ツガミ	35,300	1,761.00	62,163,300	
オークマ	19,800	6,230.00	123,354,000	
芝浦機械	17,700	2,718.00	48,108,600	
アマダ	249,200	1,235.00	307,762,000	
アイダエンジニアリング	44,700	967.00	43,224,900	
滝澤鉄工所	5,000	1,169.00	5,845,000	
ＦＵＪＩ	67,900	2,966.00	201,391,400	
牧野フライス製作所	20,000	4,440.00	88,800,000	
オーエスジー	83,900	1,862.00	156,221,800	
ダイジェット工業	2,100	1,322.00	2,776,200	
旭ダイヤモンド工業	45,000	540.00	24,300,000	
DMG森精機	107,600	1,813.00	195,078,800	
ソディック	35,900	1,078.00	38,700,200	
ディスコ	23,100	35,100.00	810,810,000	
日東工器	8,200	1,962.00	16,088,400	
日進工具	13,400	1,551.00	20,783,400	
パンチ工業	14,400	590.00	8,496,000	
冨士ダイス	8,700	666.00	5,794,200	
豊和工業	9,600	918.00	8,812,800	
ＯＫＫ	6,500	444.00	2,886,000	
東洋機械金属	12,400	531.00	6,584,400	
津田駒工業	3,300	930.00	3,069,000	
エンシュウ	4,300	980.00	4,214,000	
島精機製作所	24,900	2,225.00	55,402,500	
オプトラン	21,300	2,820.00	60,066,000	
ＮＣホールディングス	5,300	699.00	3,704,700	
イワキポンプ	10,900	1,000.00	10,900,000	
フリュー	16,700	997.00	16,649,900	
ヤマシンフィルタ	34,400	831.00	28,586,400	
日阪製作所	21,100	865.00	18,251,500	
やまびこ	33,000	1,209.00	39,897,000	
平田機工	8,000	7,270.00	58,160,000	
ペガサスミシン製造	17,400	508.00	8,839,200	
マルマエ	7,000	1,754.00	12,278,000	
タツモ	7,300	1,774.00	12,950,200	
ナブテスコ	100,200	5,040.00	505,008,000	

三井海洋開発	18,100	2,284.00	41,340,400	
レオン自動機	16,700	1,232.00	20,574,400	
ＳＭＣ	50,300	65,230.00	3,281,069,000	
ホソカワミクロン	6,000	6,380.00	38,280,000	
ユニオンツール	6,400	3,545.00	22,688,000	
オイレス工業	23,900	1,626.00	38,861,400	
日精エー・エス・ビー機械	5,800	5,230.00	30,334,000	
サトーホールディングス	22,400	2,775.00	62,160,000	
技研製作所	15,000	4,555.00	68,325,000	
日本エアーテック	5,600	1,203.00	6,736,800	
カワタ	4,700	935.00	4,394,500	
日精樹脂工業	13,300	1,041.00	13,845,300	
オカダアイヨン	5,500	1,245.00	6,847,500	
ワイエイシイホールディングス	6,800	967.00	6,575,600	
小松製作所	778,500	3,436.00	2,674,926,000	
住友重機械工業	98,400	3,250.00	319,800,000	
日立建機	80,400	3,650.00	293,460,000	
日工	25,900	731.00	18,932,900	
巴工業	6,800	2,108.00	14,334,400	
井関農機	17,300	1,636.00	28,302,800	
ＴＯＷＡ	16,100	2,193.00	35,307,300	
丸山製作所	3,600	1,849.00	6,656,400	
北川鉄工所	7,900	1,643.00	12,979,700	
ローツェ	7,500	9,750.00	73,125,000	
タカキタ	6,100	668.00	4,074,800	
クボタ	902,600	2,718.50	2,453,718,100	
荏原実業	4,300	4,950.00	21,285,000	
三菱化工機	5,600	2,822.00	15,803,200	
月島機械	31,800	1,254.00	39,877,200	
帝国電機製作所	12,100	1,358.00	16,431,800	
新東工業	41,000	778.00	31,898,000	
澁谷工業	15,100	3,590.00	54,209,000	
アイチ　コーポレーション	29,500	907.00	26,756,500	
小森コーポレーション	43,800	773.00	33,857,400	
鶴見製作所	13,300	1,794.00	23,860,200	
住友精密工業	2,600	2,232.00	5,803,200	
日本ギア工業	7,200	327.00	2,354,400	
酒井重工業	3,100	2,110.00	6,541,000	
荏原製作所	71,300	4,890.00	348,657,000	
石井鐵工所	2,500	2,949.00	7,372,500	
酉島製作所	17,600	887.00	15,611,200	
北越工業	17,800	1,109.00	19,740,200	

ダイキン工業	218,900	23,115.00	5,059,873,500	
オルガノ	5,600	7,370.00	41,272,000	
トーヨーカネツ	6,600	2,636.00	17,397,600	
栗田工業	93,000	5,020.00	466,860,000	
椿本チエイン	24,600	3,040.00	74,784,000	
大同工業	8,400	867.00	7,282,800	
木村化工機	14,600	771.00	11,256,600	
アネスト岩田	29,100	1,057.00	30,758,700	
ダイフク	94,600	11,240.00	1,063,304,000	
サムコ	4,300	3,255.00	13,996,500	
加藤製作所	9,600	1,089.00	10,454,400	
油研工業	3,000	1,703.00	5,109,000	
タダノ	83,100	1,170.00	97,227,000	
フジテック	59,200	2,592.00	153,446,400	
ＣＫＤ	39,900	2,463.00	98,273,700	
キトー	14,500	1,824.00	26,448,000	
平和	48,000	1,931.00	92,688,000	
理想科学工業	13,300	1,394.00	18,540,200	
ＳＡＮＫＹＯ	40,900	2,936.00	120,082,400	
日本金銭機械	19,200	602.00	11,558,400	
マースグループホールディングス	11,000	1,618.00	17,798,000	
フクシマガリレイ	11,800	4,165.00	49,147,000	
オーイズミ	7,500	404.00	3,030,000	
ダイコク電機	8,000	943.00	7,544,000	
竹内製作所	28,800	3,075.00	88,560,000	
アマノ	45,000	2,956.00	133,020,000	
ＪＵＫＩ	23,900	863.00	20,625,700	
蛇の目ミシン工業	15,800	801.00	12,655,800	
マックス	23,100	1,665.00	38,461,500	
グローリー	44,200	2,391.00	105,682,200	
新晃工業	16,000	2,376.00	38,016,000	
大和冷機工業	27,700	1,120.00	31,024,000	
セガサミーホールディングス	156,300	1,604.00	250,705,200	
日本ピストンリング	6,400	1,130.00	7,232,000	
リケン	8,000	2,395.00	19,160,000	
ＴＰＲ	23,200	1,675.00	38,860,000	
ツバキ・ナカシマ	33,000	1,710.00	56,430,000	
ホシザキ	54,100	10,240.00	553,984,000	
大豊工業	14,100	1,018.00	14,353,800	
日本精工	353,000	1,071.00	378,063,000	
ＮＴＮ	397,600	344.00	136,774,400	
ジェイテクト	164,900	1,097.00	180,895,300	

不二越	16,000	4,360.00	69,760,000	
日本トムソン	47,200	703.00	33,181,600	
ＴＨＫ	107,100	3,875.00	415,012,500	
ユーシン精機	11,500	875.00	10,062,500	
前澤給装工業	12,100	1,117.00	13,515,700	
イーグル工業	21,300	1,200.00	25,560,000	
前澤工業	10,500	666.00	6,993,000	
日本ピラー工業	17,400	1,889.00	32,868,600	
キッツ	53,200	725.00	38,570,000	
マキタ	224,100	5,120.00	1,147,392,000	
日立造船	136,500	826.00	112,749,000	
三菱重工業	270,000	3,502.00	945,540,000	
ＩＨＩ	115,600	2,320.00	268,192,000	
スター精密	26,500	1,692.00	44,838,000	
日清紡ホールディングス	105,400	873.00	92,014,200	
イビデン	82,900	4,875.00	404,137,500	
コニカミノルタ	350,300	638.00	223,491,400	
ブラザー工業	210,300	2,168.00	455,930,400	
ミネベアミツミ	296,600	2,865.00	849,759,000	
日立製作所	826,100	5,384.00	4,447,722,400	
東芝	340,100	4,515.00	1,535,551,500	
三菱電機	1,718,200	1,696.00	2,914,067,200	
富士電機	103,600	5,150.00	533,540,000	
東洋電機製造	7,000	1,288.00	9,016,000	
安川電機	185,000	5,170.00	956,450,000	
シンフォニアテクノロジー	22,400	1,520.00	34,048,000	
明電舎	29,300	2,419.00	70,876,700	
オリジン	4,900	1,354.00	6,634,600	
山洋電気	8,500	7,900.00	67,150,000	
デンヨー	14,800	2,046.00	30,280,800	
東芝テック	18,500	4,430.00	81,955,000	
芝浦メカトロニクス	3,200	6,070.00	19,424,000	
マブチモーター	47,800	4,445.00	212,471,000	
日本電産	413,600	12,490.00	5,165,864,000	
トレックス・セミコンダクター	9,900	1,846.00	18,275,400	
東光高岳	9,400	1,434.00	13,479,600	
ダイヘン	18,900	4,930.00	93,177,000	
ヤーマン	28,800	1,512.00	43,545,600	
ＪＶＣケンウッド	153,400	236.00	36,202,400	
ミマキエンジニアリング	17,100	679.00	11,610,900	
Ｉ－ＰＥＸ	8,600	1,980.00	17,028,000	
日新電機	40,500	1,242.00	50,301,000	

大崎電気工業	34,700	613.00	21,271,100	
オムロン	143,100	8,530.00	1,220,643,000	
日東工業	25,400	1,988.00	50,495,200	
ＩＤＥＣ	23,200	1,736.00	40,275,200	
正興電機製作所	6,000	1,732.00	10,392,000	
不二電機工業	3,700	1,289.00	4,769,300	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	62,100	3,005.00	186,610,500	
サクサホールディングス	4,200	1,491.00	6,262,200	
メルコホールディングス	6,200	4,320.00	26,784,000	
テクノメディカ	4,500	1,630.00	7,335,000	
日本電気	218,400	6,350.00	1,386,840,000	
富士通	154,600	16,775.00	2,593,415,000	
沖電気工業	70,000	1,197.00	83,790,000	
岩崎通信機	7,500	922.00	6,915,000	
電気興業	8,400	2,586.00	21,722,400	
サンケン電気	20,100	5,060.00	101,706,000	
ナカヨ	3,500	1,524.00	5,334,000	
アイホン	9,900	2,085.00	20,641,500	
ルネサスエレクトロニクス	740,400	1,241.00	918,836,400	
セイコーエプソン	213,300	1,891.00	403,350,300	
ワコム	125,900	688.00	86,619,200	
アルバック	31,700	5,040.00	159,768,000	
アクセル	8,300	1,075.00	8,922,500	
ＥＩＺＯ	14,600	4,160.00	60,736,000	
日本信号	40,400	962.00	38,864,800	
京三製作所	37,600	417.00	15,679,200	
能美防災	23,200	2,108.00	48,905,600	
ホーチキ	13,300	1,311.00	17,436,300	
星和電機	10,400	610.00	6,344,000	
エレコム	39,800	2,327.00	92,614,600	
パナソニック	1,832,500	1,290.50	2,364,841,250	
シャープ	228,700	1,822.00	416,691,400	
アンリツ	103,400	2,236.00	231,202,400	
富士通ゼネラル	52,600	2,916.00	153,381,600	
ソニーグループ	1,076,300	10,780.00	11,602,514,000	
ＴＤＫ	83,000	14,820.00	1,230,060,000	
帝国通信工業	8,600	1,109.00	9,537,400	
タムラ製作所	62,400	527.00	32,884,800	
アルプスアルパイン	141,200	1,284.00	181,300,800	
池上通信機	5,400	888.00	4,795,200	
鈴木	8,600	1,204.00	10,354,400	
日本トリム	4,000	3,845.00	15,380,000	

ローランド　ディー．ジー．	10,800	1,867.00	20,163,600	
フォスター電機	17,600	1,194.00	21,014,400	
ＳＭＫ	4,500	2,838.00	12,771,000	
ヨコオ	13,700	2,638.00	36,140,600	
ホシデン	48,000	1,089.00	52,272,000	
ヒロセ電機	26,500	15,500.00	410,750,000	
日本航空電子工業	39,500	1,930.00	76,235,000	
ＴＯＡ	20,600	918.00	18,910,800	
マクセルホールディングス	34,900	1,340.00	46,766,000	
古野電気	23,200	1,117.00	25,914,400	
ユニデンホールディングス	4,500	2,626.00	11,817,000	
スミダコーポレーション	15,700	1,039.00	16,312,300	
アイコム	7,200	2,656.00	19,123,200	
リオン	7,600	2,715.00	20,634,000	
本多通信工業	15,600	510.00	7,956,000	
横河電機	172,100	2,066.00	355,558,600	
新電元工業	6,700	3,610.00	24,187,000	
アズビル	116,200	4,595.00	533,939,000	
東亜ディーケーケー	9,800	857.00	8,398,600	
日本光電工業	71,300	3,330.00	237,429,000	
チノー	5,700	1,369.00	7,803,300	
共和電業	18,700	385.00	7,199,500	
日本電子材料	6,800	2,000.00	13,600,000	
堀場製作所	34,100	7,550.00	257,455,000	
アドバンテスト	127,800	10,200.00	1,303,560,000	
小野測器	9,200	527.00	4,848,400	
エスペック	15,800	1,928.00	30,462,400	
キーエンス	168,700	53,490.00	9,023,763,000	
日置電機	8,500	5,400.00	45,900,000	
シスメックス	134,200	11,160.00	1,497,672,000	
日本マイクロニクス	30,500	1,698.00	51,789,000	
メガチップス	17,500	3,785.00	66,237,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	10,300	3,820.00	39,346,000	
澤藤電機	2,300	2,312.00	5,317,600	
原田工業	8,200	904.00	7,412,800	
コーセル	22,000	1,075.00	23,650,000	
イリソ電子工業	14,600	5,370.00	78,402,000	
オプテックスグループ	28,900	1,732.00	50,054,800	
千代田インテグレ	7,800	1,830.00	14,274,000	
アイ・オー・データ機器	7,400	1,104.00	8,169,600	
レーザーテック	75,500	18,790.00	1,418,645,000	
スタンレー電気	120,600	3,195.00	385,317,000	

岩崎電気	7,000	1,509.00	10,563,000	
ウシオ電機	88,800	1,483.00	131,690,400	
岡谷電機産業	15,300	398.00	6,089,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	18,900	361.00	6,822,900	
エノモト	5,300	1,830.00	9,699,000	
日本セラミック	17,900	2,768.00	49,547,200	
遠藤照明	10,400	771.00	8,018,400	
古河電池	12,900	1,640.00	21,156,000	
双信電機	10,800	508.00	5,486,400	
山一電機	11,900	1,590.00	18,921,000	
図研	11,500	2,971.00	34,166,500	
日本電子	31,500	6,130.00	193,095,000	
カシオ計算機	138,300	1,984.00	274,387,200	
ファナック	150,800	26,580.00	4,008,264,000	
日本シイエムケイ	39,500	457.00	18,051,500	
エンプラス	8,000	4,175.00	33,400,000	
大真空	6,300	2,585.00	16,285,500	
ローム	71,500	10,600.00	757,900,000	
浜松ホトニクス	123,400	6,380.00	787,292,000	
三井ハイテック	17,100	4,225.00	72,247,500	
新光電気工業	58,000	3,330.00	193,140,000	
京セラ	262,000	6,901.00	1,808,062,000	
太陽誘電	76,600	5,000.00	383,000,000	
村田製作所	504,800	8,699.00	4,391,255,200	
双葉電子工業	30,700	912.00	27,998,400	
北陸電気工業	7,600	936.00	7,113,600	
ニチコン	55,100	1,084.00	59,728,400	
日本ケミコン	17,300	1,768.00	30,586,400	
ＫＯＡ	24,500	1,665.00	40,792,500	
市光工業	27,300	714.00	19,492,200	
小糸製作所	103,100	6,990.00	720,669,000	
ミツバ	31,600	675.00	21,330,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	29,800	10,420.00	310,516,000	
キヤノン電子	16,400	1,787.00	29,306,800	
キヤノン	853,900	2,621.50	2,238,498,850	
リコー	437,300	1,232.00	538,753,600	
象印マホービン	47,100	1,738.00	81,859,800	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,900	1,571.00	4,555,900	
東京エレクトロン	100,600	50,060.00	5,036,036,000	
トヨタ紡織	50,100	2,071.00	103,757,100	
芦森工業	3,300	1,018.00	3,359,400	
ユニプレス	28,200	1,110.00	31,302,000	

豊田自動織機	139,100	9,020.00	1,254,682,000	
モリタホールディングス	27,600	1,605.00	44,298,000	
三櫻工業	23,800	1,209.00	28,774,200	
デンソー	378,300	7,274.00	2,751,754,200	
東海理化電機製作所	45,300	1,776.00	80,452,800	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	66,500	597.00	39,700,500	
川崎重工業	133,700	2,807.00	375,295,900	
名村造船所	51,600	188.00	9,700,800	
日本車輌製造	6,300	2,446.00	15,409,800	
三菱ロジスネクスト	22,700	1,200.00	27,240,000	
近畿車輛	2,900	1,296.00	3,758,400	
日産自動車	2,026,300	582.40	1,180,117,120	
いすゞ自動車	456,200	1,156.00	527,367,200	
トヨタ自動車	1,740,500	8,506.00	14,804,693,000	
日野自動車	214,500	960.00	205,920,000	
三菱自動車工業	636,000	311.00	197,796,000	
エフテック	12,100	744.00	9,002,400	
レシップホールディングス	6,800	552.00	3,753,600	
ＧＭＢ	3,200	962.00	3,078,400	
ファルテック	3,100	889.00	2,755,900	
武蔵精密工業	38,300	1,968.00	75,374,400	
日産車体	25,200	736.00	18,547,200	
新明和工業	48,500	1,032.00	50,052,000	
極東開発工業	29,600	1,707.00	50,527,200	
トピー工業	14,200	1,398.00	19,851,600	
ティラド	5,400	1,968.00	10,627,200	
曙ブレーキ工業	94,300	188.00	17,728,400	
タチエス	26,400	1,185.00	31,284,000	
ＮＯＫ	83,200	1,452.00	120,806,400	
フタバ産業	43,200	548.00	23,673,600	
ＫＹＢ	19,200	3,195.00	61,344,000	
大同メタル工業	35,600	589.00	20,968,400	
プレス工業	85,400	337.00	28,779,800	
ミクニ	22,100	317.00	7,005,700	
太平洋工業	36,000	1,262.00	45,432,000	
河西工業	23,400	472.00	11,044,800	
アイシン	125,800	4,320.00	543,456,000	
マツダ	539,200	900.00	485,280,000	
今仙電機製作所	15,200	740.00	11,248,000	
本田技研工業	1,352,700	3,431.00	4,641,113,700	
スズキ	340,500	4,297.00	1,463,128,500	
ＳＵＢＡＲＵ	492,300	2,128.00	1,047,614,400	

安永	8,400	1,223.00	10,273,200	
ヤマハ発動機	242,800	2,875.00	698,050,000	
ＴＢＫ	20,600	416.00	8,569,600	
エクセディ	23,400	1,610.00	37,674,000	
豊田合成	55,500	2,713.00	150,571,500	
愛三工業	27,000	789.00	21,303,000	
盟和産業	2,700	862.00	2,327,400	
日本プラスト	14,700	588.00	8,643,600	
ヨロズ	14,800	1,268.00	18,766,400	
エフ・シー・シー	28,100	1,794.00	50,411,400	
シマノ	64,300	25,205.00	1,620,681,500	
テイ・エス　テック	79,900	1,536.00	122,726,400	
ジャムコ	10,000	910.00	9,100,000	
テルモ	526,700	4,241.00	2,233,734,700	
クリエートメディック	5,700	1,018.00	5,802,600	
日機装	55,500	1,161.00	64,435,500	
日本エム・ディ・エム	9,900	2,250.00	22,275,000	
島津製作所	221,100	3,985.00	881,083,500	
ＪＭＳ	14,600	991.00	14,468,600	
長野計器	12,500	1,241.00	15,512,500	
ブイ・テクノロジー	8,100	5,520.00	44,712,000	
東京計器	11,000	1,079.00	11,869,000	
愛知時計電機	2,300	4,295.00	9,878,500	
インターアクション	8,600	2,377.00	20,442,200	
オーバル	15,500	286.00	4,433,000	
東京精密	29,000	5,260.00	152,540,000	
マニー	68,500	2,562.00	175,497,000	
ニコン	262,400	1,077.00	282,604,800	
トプコン	86,600	1,591.00	137,780,600	
オリンパス	950,700	2,279.00	2,166,645,300	
理研計器	15,200	2,888.00	43,897,600	
タムロン	13,900	2,413.00	33,540,700	
ＨＯＹＡ	338,100	13,155.00	4,447,705,500	
シード	7,300	720.00	5,256,000	
ノーリツ鋼機	15,500	2,519.00	39,044,500	
エー・アンド・デイ	14,500	1,355.00	19,647,500	
朝日インテック	180,900	2,968.00	536,911,200	
シチズン時計	218,100	392.00	85,495,200	
リズム	5,400	813.00	4,390,200	
大研医器	13,700	578.00	7,918,600	
メニコン	26,400	6,850.00	180,840,000	
シンシア	1,900	888.00	1,687,200	

松風	7,900	2,137.00	16,882,300	
セイコーホールディングス	24,300	2,107.00	51,200,100	
ニプロ	128,100	1,386.00	177,546,600	
中本パックス	4,400	1,604.00	7,057,600	
スノーピーク	10,200	4,165.00	42,483,000	
パラマウントベッドホールディングス	32,900	2,240.00	73,696,000	
トランザクション	9,400	1,362.00	12,802,800	
粧美堂	5,000	415.00	2,075,000	
ニホンフラッシュ	14,700	1,338.00	19,668,600	
前田工繊	18,900	3,415.00	64,543,500	
永大産業	22,500	347.00	7,807,500	
アートネイチャー	16,500	679.00	11,203,500	
バンダイナムコホールディングス	142,100	8,091.00	1,149,731,100	
アイフィスジャパン	4,400	743.00	3,269,200	
共立印刷	28,700	134.00	3,845,800	
ＳＨＯＥＩ	16,100	4,025.00	64,802,500	
フランスベッドホールディングス	22,100	931.00	20,575,100	
パイロットコーポレーション	29,000	3,585.00	103,965,000	
萩原工業	9,500	1,454.00	13,813,000	
トッパン・フォームズ	30,700	1,155.00	35,458,500	
フジシールインターナショナル	35,300	2,479.00	87,508,700	
タカラトミー	77,000	965.00	74,305,000	
廣済堂	12,000	1,026.00	12,312,000	
エステールホールディングス	4,600	627.00	2,884,200	
タカノ	5,900	641.00	3,781,900	
プロネクサス	13,800	1,169.00	16,132,200	
ホクシン	10,600	249.00	2,639,400	
ウッドワン	5,800	1,684.00	9,767,200	
大建工業	11,600	2,125.00	24,650,000	
凸版印刷	261,200	1,953.00	510,123,600	
大日本印刷	207,500	2,297.00	476,627,500	
共同印刷	5,300	2,779.00	14,728,700	
ＮＩＳＳＨＡ	35,300	1,337.00	47,196,100	
光村印刷	1,500	1,769.00	2,653,500	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,400	1,904.00	15,993,600	
アシックス	151,900	1,824.00	277,065,600	
ツツミ	4,300	2,392.00	10,285,600	
ローランド	13,400	5,320.00	71,288,000	
小松ウオール工業	5,200	2,059.00	10,706,800	
ヤマハ	102,200	6,290.00	642,838,000	
河合楽器製作所	4,800	3,490.00	16,752,000	
クリナップ	16,000	557.00	8,912,000	

ピジョン	110,300	3,700.00	408,110,000	
オリバー	3,600	2,562.00	9,223,200	
兼松サステック	1,100	1,779.00	1,956,900	
キングジム	14,300	952.00	13,613,600	
リンテック	36,800	2,507.00	92,257,600	
イトーキ	34,100	391.00	13,333,100	
任天堂	98,300	62,220.00	6,116,226,000	
三菱鉛筆	28,300	1,487.00	42,082,100	
タカラスタンダード	35,500	1,610.00	57,155,000	
コクヨ	82,400	1,702.00	140,244,800	
ナカバヤシ	16,900	607.00	10,258,300	
グローブライド	8,300	4,420.00	36,686,000	
オカムラ	59,000	1,361.00	80,299,000	
美津濃	17,000	2,312.00	39,304,000	
東京電力ホールディングス	1,457,300	345.00	502,768,500	
中部電力	525,600	1,362.50	716,130,000	
関西電力	651,000	1,098.00	714,798,000	
中国電力	247,800	1,243.00	308,015,400	
北陸電力	157,100	679.00	106,670,900	
東北電力	402,400	976.00	392,742,400	
四国電力	142,800	817.00	116,667,600	
九州電力	379,400	1,012.00	383,952,800	
北海道電力	160,800	536.00	86,188,800	
沖縄電力	33,400	1,490.00	49,766,000	
電源開発	136,700	1,692.00	231,296,400	
エフオン	10,400	1,031.00	10,722,400	
イーレックス	25,200	1,961.00	49,417,200	
レノバ	29,200	3,140.00	91,688,000	
東京瓦斯	330,400	2,334.50	771,318,800	
大阪瓦斯	311,200	2,152.00	669,702,400	
東邦瓦斯	84,500	6,330.00	534,885,000	
北海道瓦斯	9,200	1,568.00	14,425,600	
広島ガス	35,400	388.00	13,735,200	
西部ガスホールディングス	19,300	2,553.00	49,272,900	
静岡ガス	48,800	982.00	47,921,600	
メタウォーター	19,300	2,100.00	40,530,000	
ＳＢＳホールディングス	12,700	2,816.00	35,763,200	
東武鉄道	179,100	2,948.00	527,986,800	
相鉄ホールディングス	58,900	2,253.00	132,701,700	
東急	433,300	1,460.00	632,618,000	
京浜急行電鉄	220,600	1,445.00	318,767,000	
小田急電鉄	275,200	2,998.00	825,049,600	

京王電鉄	96,000	7,210.00	692,160,000	
京成電鉄	128,800	3,320.00	427,616,000	
富士急行	23,400	5,260.00	123,084,000	
新京成電鉄	4,400	2,178.00	9,583,200	
東日本旅客鉄道	302,400	7,683.00	2,323,339,200	
西日本旅客鉄道	153,100	6,221.00	952,435,100	
東海旅客鉄道	142,800	16,270.00	2,323,356,000	
西武ホールディングス	207,000	1,167.00	241,569,000	
鴻池運輸	27,300	1,177.00	32,132,100	
西日本鉄道	47,600	2,849.00	135,612,400	
ハマキョウレックス	13,200	3,180.00	41,976,000	
サカイ引越センター	7,900	5,660.00	44,714,000	
近鉄グループホールディングス	162,700	4,070.00	662,189,000	
阪急阪神ホールディングス	217,000	3,525.00	764,925,000	
南海電気鉄道	77,100	2,385.00	183,883,500	
京阪ホールディングス	72,400	3,850.00	278,740,000	
神戸電鉄	3,900	3,620.00	14,118,000	
名古屋鉄道	133,800	2,560.00	342,528,000	
山陽電気鉄道	11,600	1,890.00	21,924,000	
アルプス物流	11,400	953.00	10,864,200	
日本通運	56,300	8,940.00	503,322,000	
ヤマトホールディングス	228,000	3,105.00	707,940,000	
山九	41,700	4,930.00	205,581,000	
丸運	9,300	282.00	2,622,600	
丸全昭和運輸	13,200	3,270.00	43,164,000	
センコーグループホールディングス	89,700	1,040.00	93,288,000	
トナミホールディングス	3,900	5,350.00	20,865,000	
ニッコンホールディングス	54,600	2,335.00	127,491,000	
日本石油輸送	1,800	2,649.00	4,768,200	
福山通運	20,800	4,335.00	90,168,000	
セイノーホールディングス	121,900	1,567.00	191,017,300	
エスライン	4,400	921.00	4,052,400	
神奈川中央交通	4,000	3,695.00	14,780,000	
日立物流	35,800	3,470.00	124,226,000	
丸和運輸機関	34,400	1,929.00	66,357,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	16,400	1,758.00	28,831,200	
九州旅客鉄道	125,900	2,530.00	318,527,000	
ＳＧホールディングス	307,400	2,504.00	769,729,600	
日本郵船	136,500	4,415.00	602,647,500	
商船三井	96,900	4,680.00	453,492,000	
川崎汽船	50,100	3,165.00	158,566,500	
ＮＳユナイテッド海運	8,500	2,385.00	20,272,500	

飯野海運	78,600	561.00	44,094,600	
共栄タンカー	4,700	1,001.00	4,704,700	
乾汽船	11,100	1,146.00	12,720,600	
日本航空	396,400	2,317.00	918,458,800	
ＡＮＡホールディングス	439,200	2,568.00	1,127,865,600	
パスコ	3,200	1,410.00	4,512,000	
トランコム	5,000	9,020.00	45,100,000	
日新	13,000	1,422.00	18,486,000	
三菱倉庫	56,300	3,355.00	188,886,500	
三井倉庫ホールディングス	17,300	2,371.00	41,018,300	
住友倉庫	58,400	1,478.00	86,315,200	
澁澤倉庫	8,900	2,160.00	19,224,000	
東陽倉庫	27,300	332.00	9,063,600	
日本トランスシティ	35,800	538.00	19,260,400	
ケイヒン	3,100	1,400.00	4,340,000	
中央倉庫	9,900	1,102.00	10,909,800	
川西倉庫	3,000	1,169.00	3,507,000	
安田倉庫	13,400	953.00	12,770,200	
ファイズホールディングス	2,900	933.00	2,705,700	
東洋埠頭	5,000	1,505.00	7,525,000	
宇徳	11,600	503.00	5,834,800	
上組	90,600	2,225.00	201,585,000	
サンリツ	4,200	717.00	3,011,400	
キムラユニティー	4,300	1,282.00	5,512,600	
キユーソー流通システム	4,100	1,635.00	6,703,500	
近鉄エクスプレス	30,700	2,727.00	83,718,900	
東海運	9,300	355.00	3,301,500	
エーアイテイー	10,200	1,068.00	10,893,600	
内外トランスライン	5,700	1,858.00	10,590,600	
日本コンセプト	5,200	1,599.00	8,314,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	56,000	1,893.00	106,008,000	
クロスキャット	4,800	1,022.00	4,905,600	
システナ	60,300	2,280.00	137,484,000	
デジタルアーツ	9,800	8,740.00	85,652,000	
日鉄ソリューションズ	25,300	3,325.00	84,122,500	
キューブシステム	9,300	1,099.00	10,220,700	
エイジア	2,800	1,927.00	5,395,600	
コア	7,400	1,504.00	11,129,600	
ラクーンホールディングス	12,000	3,195.00	38,340,000	
ソリトンシステムズ	8,600	1,772.00	15,239,200	
ソフトクリエイトホールディングス	6,800	2,511.00	17,074,800	
ＴＩＳ	168,700	2,681.00	452,284,700	

ＪＮＳホールディングス	8,300	545.00	4,523,500	
電算システム	6,400	3,340.00	21,376,000	
グリー	104,100	586.00	61,002,600	
GMOペパボ	1,500	5,930.00	8,895,000	
コーエーテクモホールディングス	44,900	4,665.00	209,458,500	
三菱総合研究所	7,300	4,140.00	30,222,000	
電算	2,000	2,402.00	4,804,000	
ＡＧＳ	9,000	805.00	7,245,000	
ファインデックス	14,500	1,205.00	17,472,500	
ブレインパッド	4,400	5,160.00	22,704,000	
ＫＬａｂ	30,900	780.00	24,102,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	22,700	1,158.00	26,286,600	
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	2,722.00	7,893,800	
ネクソン	426,700	3,470.00	1,480,649,000	
アイスタイル	52,200	502.00	26,204,400	
エムアップホールディングス	4,500	2,841.00	12,784,500	
エイチーム	11,800	1,632.00	19,257,600	
エニグモ	16,200	1,310.00	21,222,000	
テクノスジャパン	13,600	658.00	8,948,800	
コロプラ	55,800	814.00	45,421,200	
ブロードリーフ	84,300	573.00	48,303,900	
クロス・マーケティンググループ	8,200	526.00	4,313,200	
デジタルハーツホールディングス	7,900	1,589.00	12,553,100	
システム情報	13,000	999.00	12,987,000	
メディアドゥ	6,600	5,270.00	34,782,000	
じげん	42,700	408.00	17,421,600	
ブイキューブ	9,300	2,828.00	26,300,400	
エンカレッジ・テクノロジ	3,600	655.00	2,358,000	
サイバーリンクス	5,800	1,639.00	9,506,200	
フィックスターズ	18,300	1,006.00	18,409,800	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,100	1,520.00	10,792,000	
オプティム	11,900	2,751.00	32,736,900	
セレス	5,600	3,800.00	21,280,000	
ＳＨＩＦＴ	8,500	15,370.00	130,645,000	
ティーガイア	18,100	1,929.00	34,914,900	
セック	2,600	2,735.00	7,111,000	
日本アジアグループ	16,300	940.00	15,322,000	
テクマトリックス	26,300	2,076.00	54,598,800	
プロシップ	5,200	1,412.00	7,342,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	40,800	2,111.00	86,128,800	
GMOペイメントゲートウェイ	32,300	13,350.00	431,205,000	
ザッパラス	7,300	516.00	3,766,800	

システムリサーチ	5,100	2,150.00	10,965,000	
インターネットイニシアティブ	45,000	2,436.00	109,620,000	
さくらインターネット	18,600	665.00	12,369,000	
ヴィンクス	5,100	1,047.00	5,339,700	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,800	5,600.00	21,280,000	
ＳＲＡホールディングス	9,100	2,632.00	23,951,200	
システムインテグレータ	5,300	671.00	3,556,300	
朝日ネット	14,200	752.00	10,678,400	
ｅＢＡＳＥ	20,500	990.00	20,295,000	
アバント	18,300	1,647.00	30,140,100	
アドソル日進	6,100	2,675.00	16,317,500	
ＯＤＫソリューションズ	4,000	844.00	3,376,000	
フリービット	10,400	925.00	9,620,000	
コムチュア	15,600	2,607.00	40,669,200	
サイバーコム	3,300	1,550.00	5,115,000	
アステリア	12,600	824.00	10,382,400	
アイル	9,600	1,764.00	16,934,400	
マークラインズ	7,200	3,210.00	23,112,000	
メディカル・データ・ビジョン	19,400	1,936.00	37,558,400	
ｇｕｍｉ	23,700	1,401.00	33,203,700	
ショーケース	4,000	839.00	3,356,000	
モバイルファクトリー	4,000	1,437.00	5,748,000	
テラスカイ	5,600	2,783.00	15,584,800	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,600	2,179.00	16,560,400	
ＰＣＩホールディングス	6,600	1,459.00	9,629,400	
パイプドＨＤ	3,700	1,673.00	6,190,100	
アイビーシー	3,100	996.00	3,087,600	
ネオジャパン	3,400	1,773.00	6,028,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,700	3,145.00	11,636,500	
ラクス	50,900	2,068.00	105,261,200	
ランドコンピュータ	2,900	1,105.00	3,204,500	
ダブルスタンダード	2,300	3,580.00	8,234,000	
オープンドア	10,200	2,073.00	21,144,600	
マイネット	5,500	864.00	4,752,000	
アカツキ	6,800	4,035.00	27,438,000	
ベネフィットジャパン	1,500	1,924.00	2,886,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,500	3,155.00	14,197,500	
カナミックネットワーク	18,500	651.00	12,043,500	
ノムラシステムコーポレーション	8,600	312.00	2,683,200	
チェンジ	31,100	3,315.00	103,096,500	
シンクロ・フード	11,100	378.00	4,195,800	
オークネット	9,200	1,285.00	11,822,000	

キャピタル・アセット・プランニング	3,700	1,273.00	4,710,100	
セグエグループ	4,600	1,332.00	6,127,200	
エイトレッド	3,300	2,617.00	8,636,100	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	17,700	636.00	11,257,200	
マクロミル	34,900	875.00	30,537,500	
ビーグリー	3,600	1,404.00	5,054,400	
オロ	5,400	3,760.00	20,304,000	
ユーザーローカル	2,600	4,700.00	12,220,000	
テモナ	4,000	906.00	3,624,000	
ニーズウェル	4,000	635.00	2,540,000	
サインポスト	4,400	932.00	4,100,800	
ソルクシーズ	6,900	915.00	6,313,500	
フェイス	5,600	918.00	5,140,800	
プロトコーポレーション	20,400	1,189.00	24,255,600	
ハイマックス	5,100	1,139.00	5,808,900	
野村総合研究所	293,000	3,380.00	990,340,000	
サイバネットシステム	12,400	836.00	10,366,400	
ＣＥホールディングス	9,600	592.00	5,683,200	
日本システム技術	3,200	1,592.00	5,094,400	
インテージホールディングス	21,300	1,370.00	29,181,000	
東邦システムサイエンス	4,900	928.00	4,547,200	
ソースネクスト	81,200	331.00	26,877,200	
インフォコム	15,500	2,767.00	42,888,500	
ＨＥＲＯＺ	4,900	2,783.00	13,636,700	
ラクスル	18,400	4,905.00	90,252,000	
ＩＰＳ	4,100	2,509.00	10,286,900	
ＦＩＧ	19,600	286.00	5,605,600	
システムサポート	5,200	1,520.00	7,904,000	
イーソル	9,500	1,196.00	11,362,000	
アルテリア・ネットワークス	18,900	1,587.00	29,994,300	
ＥｄｕＬａｂ	1,700	6,330.00	10,761,000	
東海ソフト	3,000	1,227.00	3,681,000	
ウイングアーク１ｓｔ	8,900	2,590.00	23,051,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,000	2,080.00	8,320,000	
サーバーワークス	1,700	4,365.00	7,420,500	
東名	1,900	1,132.00	2,150,800	
ヴィッツ	1,700	2,073.00	3,524,100	
トビラシステムズ	2,500	1,338.00	3,345,000	
Ｓａｎｓａｎ	15,000	8,660.00	129,900,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,300	1,181.00	3,897,300	
ギフティ	10,300	3,140.00	32,342,000	
ベース	2,000	6,070.00	12,140,000	

フォーカスシステムズ	11,700	929.00	10,869,300	
クレスコ	11,300	1,697.00	19,176,100	
フジ・メディア・ホールディングス	175,200	1,340.00	234,768,000	
オービック	53,100	19,960.00	1,059,876,000	
ジャストシステム	24,000	6,500.00	156,000,000	
ＴＤＣソフト	15,100	1,053.00	15,900,300	
Ｚホールディングス	2,316,800	475.20	1,100,943,360	
トレンドマイクロ	90,100	5,350.00	482,035,000	
ＩＤホールディングス	6,700	1,365.00	9,145,500	
日本オラクル	34,200	10,850.00	371,070,000	
アルファシステムズ	4,600	3,640.00	16,744,000	
フューチャー	20,500	2,104.00	43,132,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	11,200	1,426.00	15,971,200	
ＳＢテクノロジー	6,200	3,160.00	19,592,000	
トーセ	5,000	801.00	4,005,000	
オービックビジネスコンサルタント	17,300	6,340.00	109,682,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	76,900	3,825.00	294,142,500	
アイティフォー	22,500	793.00	17,842,500	
東計電算	2,600	4,330.00	11,258,000	
エックスネット	3,000	1,020.00	3,060,000	
大塚商会	91,300	5,660.00	516,758,000	
サイボウズ	19,900	2,357.00	46,904,300	
電通国際情報サービス	21,000	4,015.00	84,315,000	
ＡＣＣＥＳＳ	21,500	892.00	19,178,000	
デジタルガレージ	27,900	4,605.00	128,479,500	
ＥＭシステムズ	28,300	825.00	23,347,500	
ウェザーニューズ	5,100	5,420.00	27,642,000	
ＣＩＪ	11,900	869.00	10,341,100	
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,495.00	6,291,000	
日本エンタープライズ	18,900	228.00	4,309,200	
ＷＯＷＯＷ	8,200	2,705.00	22,181,000	
スカラ	15,500	759.00	11,764,500	
インテリジェント　ウェイブ	10,400	680.00	7,072,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	15,100	503.00	7,595,300	
ネットワンシステムズ	68,900	3,405.00	234,604,500	
システムソフト	38,100	163.00	6,210,300	
アルゴグラフィックス	13,200	3,075.00	40,590,000	
マーベラス	27,000	821.00	22,167,000	
エイベックス	29,300	1,501.00	43,979,300	
日本ユニシス	58,600	3,560.00	208,616,000	
兼松エレクトロニクス	9,300	3,760.00	34,968,000	
都築電気	7,800	1,833.00	14,297,400	

ＴＢＳホールディングス	112,000	2,185.00	244,720,000	
日本テレビホールディングス	141,000	1,441.00	203,181,000	
朝日放送グループホールディングス	17,300	706.00	12,213,800	
テレビ朝日ホールディングス	52,300	2,011.00	105,175,300	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	111,800	464.00	51,875,200	
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,282.00	28,296,800	
日本ＢＳ放送	6,100	1,094.00	6,673,400	
ビジョン	21,300	1,070.00	22,791,000	
スマートバリュー	4,800	870.00	4,176,000	
ワイヤレスゲート	7,800	467.00	3,642,600	
コネクシオ	9,800	1,474.00	14,445,200	
クロップス	3,500	896.00	3,136,000	
日本電信電話	1,972,000	2,854.00	5,628,088,000	
ＫＤＤＩ	1,352,100	3,440.00	4,651,224,000	
ソフトバンク	1,532,400	1,449.00	2,220,447,600	
光通信	19,900	22,180.00	441,382,000	
エムティーアイ	16,800	776.00	13,036,800	
ＧＭＯインターネット	59,800	3,160.00	188,968,000	
ファイバーゲート	5,700	1,571.00	8,954,700	
アイドママーケティングコミュニケーション	5,300	413.00	2,188,900	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	43,700	3,920.00	171,304,000	
学研ホールディングス	24,100	1,407.00	33,908,700	
ゼンリン	30,900	1,162.00	35,905,800	
昭文社ホールディングス	7,600	477.00	3,625,200	
インプレスホールディングス	14,000	240.00	3,360,000	
アイネット	8,900	1,477.00	13,145,300	
松竹	11,200	12,430.00	139,216,000	
東宝	99,600	4,410.00	439,236,000	
東映	5,500	25,090.00	137,995,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	449,100	1,751.00	786,374,100	
ピー・シー・エー	2,500	4,440.00	11,100,000	
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,814.00	10,884,000	
ＤＴＳ	35,100	2,610.00	91,611,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72,000	6,130.00	441,360,000	
シーイーシー	18,300	1,394.00	25,510,200	
カプコン	144,600	3,360.00	485,856,000	
アイ・エス・ビー	8,100	1,353.00	10,959,300	
ジャステック	11,000	1,286.00	14,146,000	
ＳＣＳＫ	39,000	6,330.00	246,870,000	
日本システムウエア	5,800	2,215.00	12,847,000	
アイネス	16,800	1,436.00	24,124,800	
ＴＫＣ	28,600	3,590.00	102,674,000	

富士ソフト	18,000	5,520.00	99,360,000	
ＮＳＤ	54,400	1,810.00	98,464,000	
コナミホールディングス	61,300	6,740.00	413,162,000	
福井コンピュータホールディングス	7,800	4,140.00	32,292,000	
ＪＢＣＣホールディングス	11,700	1,387.00	16,227,900	
ミロク情報サービス	16,900	1,868.00	31,569,200	
ソフトバンクグループ	1,337,700	10,170.00	13,604,409,000	
ホウスイ	1,400	986.00	1,380,400	
高千穂交易	6,600	1,121.00	7,398,600	
オルバヘルスケアホールディングス	2,800	1,723.00	4,824,400	
伊藤忠食品	4,100	5,090.00	20,869,000	
エレマテック	13,600	1,215.00	16,524,000	
ＪＡＬＵＸ	4,800	1,633.00	7,838,400	
あらた	13,500	4,600.00	62,100,000	
トーメンデバイス	2,200	4,160.00	9,152,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,600	6,610.00	37,016,000	
フィールズ	14,800	525.00	7,770,000	
双日	934,600	343.00	320,567,800	
アルフレッサ　ホールディングス	175,500	2,048.00	359,424,000	
横浜冷凍	47,500	895.00	42,512,500	
ラサ商事	9,000	903.00	8,127,000	
アルコニックス	18,000	1,649.00	29,682,000	
神戸物産	116,800	2,916.00	340,588,800	
ハイパー	3,500	559.00	1,956,500	
あい　ホールディングス	24,200	2,242.00	54,256,400	
ディーブイエックス	5,200	980.00	5,096,000	
ダイワボウホールディングス	77,100	1,815.00	139,936,500	
マクニカ・富士エレホールディングス	40,400	2,331.00	94,172,400	
ラクト・ジャパン	7,400	2,893.00	21,408,200	
グリムス	5,000	1,845.00	9,225,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	29,500	737.00	21,741,500	
八洲電機	13,100	971.00	12,720,100	
メディアスホールディングス	9,600	982.00	9,427,200	
レスターホールディングス	17,600	2,037.00	35,851,200	
ジューテックホールディングス	3,900	1,000.00	3,900,000	
大光	6,500	704.00	4,576,000	
ＯＣＨＩホールディングス	4,900	1,295.00	6,345,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	82,000	916.00	75,112,000	
黒谷	4,600	1,202.00	5,529,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,000	772.00	2,316,000	
三洋貿易	17,100	1,120.00	19,152,000	
ビューティガレージ	2,700	3,615.00	9,760,500	

ウイン・パートナーズ	12,200	1,014.00	12,370,800	
ミタチ産業	4,700	689.00	3,238,300	
シップヘルスケアホールディングス	59,700	2,935.00	175,219,500	
明治電機工業	5,800	1,408.00	8,166,400	
デリカフーズホールディングス	6,600	629.00	4,151,400	
スターティアホールディングス	3,300	1,115.00	3,679,500	
コメダホールディングス	36,900	2,052.00	75,718,800	
ピーバンドットコム	2,400	807.00	1,936,800	
アセンテック	4,400	1,464.00	6,441,600	
富士興産	5,200	1,296.00	6,739,200	
協栄産業	1,900	1,375.00	2,612,500	
小野建	15,200	1,390.00	21,128,000	
南陽	3,500	1,801.00	6,303,500	
佐鳥電機	10,600	804.00	8,522,400	
エコートレーディング	3,600	606.00	2,181,600	
伯東	10,300	1,544.00	15,903,200	
コンドーテック	13,100	1,031.00	13,506,100	
中山福	9,800	475.00	4,655,000	
ナガイレーベン	22,500	2,574.00	57,915,000	
三菱食品	18,600	3,050.00	56,730,000	
松田産業	12,400	2,372.00	29,412,800	
第一興商	33,600	4,250.00	142,800,000	
メディパルホールディングス	169,600	2,115.00	358,704,000	
ＳＰＫ	7,300	1,323.00	9,657,900	
萩原電気ホールディングス	6,300	2,669.00	16,814,700	
アズワン	12,100	13,910.00	168,311,000	
スズデン	5,900	1,346.00	7,941,400	
尾家産業	5,000	1,227.00	6,135,000	
シモジマ	10,400	1,162.00	12,084,800	
ドウシシャ	16,000	1,884.00	30,144,000	
小津産業	3,700	2,151.00	7,958,700	
高速	9,000	1,457.00	13,113,000	
たけびし	6,000	1,488.00	8,928,000	
リックス	3,800	1,505.00	5,719,000	
丸文	15,000	524.00	7,860,000	
ハピネット	14,100	1,521.00	21,446,100	
橋本総業ホールディングス	3,400	2,622.00	8,914,800	
日本ライフライン	54,700	1,489.00	81,448,300	
タカショー	11,000	762.00	8,382,000	
マルカ	5,500	2,150.00	11,825,000	
ＩＤＯＭ	57,100	619.00	35,344,900	
進和	10,000	2,084.00	20,840,000	

エスケイジャパン	4,200	456.00	1,915,200	
ダイトロン	7,200	2,043.00	14,709,600	
シークス	21,500	1,555.00	33,432,500	
田中商事	5,200	667.00	3,468,400	
オーハシテクニカ	8,700	1,487.00	12,936,900	
白銅	6,100	1,822.00	11,114,200	
ダイコー通産	2,000	1,795.00	3,590,000	
伊藤忠商事	1,183,600	3,564.00	4,218,350,400	
丸紅	1,668,700	992.60	1,656,351,620	
高島	2,700	1,780.00	4,806,000	
長瀬産業	92,900	1,706.00	158,487,400	
蝶理	10,800	1,552.00	16,761,600	
豊田通商	170,000	5,110.00	868,700,000	
三共生興	25,700	527.00	13,543,900	
兼松	67,600	1,514.00	102,346,400	
ツカモトコーポレーション	2,800	1,396.00	3,908,800	
三井物産	1,373,900	2,539.50	3,489,019,050	
日本紙パルプ商事	8,800	3,670.00	32,296,000	
カメイ	22,100	1,165.00	25,746,500	
東都水産	1,900	4,255.00	8,084,500	
ＯＵＧホールディングス	2,700	2,798.00	7,554,600	
スターゼン	12,500	2,288.00	28,600,000	
山善	66,100	1,025.00	67,752,500	
椿本興業	3,100	3,565.00	11,051,500	
住友商事	1,067,900	1,560.00	1,665,924,000	
内田洋行	7,200	4,870.00	35,064,000	
三菱商事	1,030,300	3,011.00	3,102,233,300	
第一実業	7,700	4,210.00	32,417,000	
キヤノンマーケティングジャパン	42,000	2,602.00	109,284,000	
西華産業	8,900	1,720.00	15,308,000	
佐藤商事	14,000	1,091.00	15,274,000	
菱洋エレクトロ	12,900	2,719.00	35,075,100	
東京産業	15,400	636.00	9,794,400	
ユアサ商事	17,300	3,135.00	54,235,500	
神鋼商事	3,800	2,549.00	9,686,200	
トルク	10,300	253.00	2,605,900	
阪和興業	33,900	3,605.00	122,209,500	
正栄食品工業	11,000	4,115.00	45,265,000	
カナデン	13,800	1,170.00	16,146,000	
菱電商事	12,200	1,684.00	20,544,800	
フルサト工業	8,600	1,641.00	14,112,600	
岩谷産業	40,600	7,220.00	293,132,000	

ナイス	6,700	2,015.00	13,500,500	
ニチモウ	2,600	1,981.00	5,150,600	
極東貿易	4,900	1,407.00	6,894,300	
イワキ	22,700	759.00	17,229,300	
三愛石油	41,700	1,272.00	53,042,400	
稲畑産業	40,700	1,665.00	67,765,500	
ＧＳＩクレオス	8,300	1,225.00	10,167,500	
明和産業	15,700	489.00	7,677,300	
クワザワホールディングス	6,100	598.00	3,647,800	
ヤマエ久野	12,400	1,090.00	13,516,000	
ワキタ	33,300	1,100.00	36,630,000	
東邦ホールディングス	54,300	1,917.00	104,093,100	
サンゲツ	45,700	1,630.00	74,491,000	
ミツウロコグループホールディングス	25,000	1,358.00	33,950,000	
シナネンホールディングス	6,300	3,065.00	19,309,500	
伊藤忠エネクス	37,500	1,094.00	41,025,000	
サンリオ	47,500	1,754.00	83,315,000	
サンワテクノス	11,200	1,283.00	14,369,600	
リョーサン	18,700	2,278.00	42,598,600	
新光商事	22,900	762.00	17,449,800	
トーホー	7,700	1,747.00	13,451,900	
三信電気	9,100	2,049.00	18,645,900	
東陽テクニカ	18,100	1,114.00	20,163,400	
モスフードサービス	23,900	3,075.00	73,492,500	
加賀電子	15,300	2,488.00	38,066,400	
ソーダニッカ	16,200	593.00	9,606,600	
立花エレテック	12,500	1,599.00	19,987,500	
フォーバル	6,000	817.00	4,902,000	
ＰＡＬＴＡＣ	27,100	5,480.00	148,508,000	
三谷産業	22,300	417.00	9,299,100	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,800	2,696.00	10,244,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,500	2,211.00	3,316,500	
コーア商事ホールディングス	12,700	816.00	10,363,200	
国際紙パルプ商事	36,200	247.00	8,941,400	
ヤマタネ	7,300	1,489.00	10,869,700	
丸紅建材リース	1,700	1,870.00	3,179,000	
日鉄物産	12,100	4,685.00	56,688,500	
泉州電業	4,800	3,480.00	16,704,000	
トラスコ中山	38,700	3,015.00	116,680,500	
オートバックスセブン	62,800	1,495.00	93,886,000	
モリト	12,400	614.00	7,613,600	
加藤産業	24,400	3,305.00	80,642,000	

北恵	4,300	942.00	4,050,600	
イノテック	9,500	1,342.00	12,749,000	
イエローハット	32,000	1,937.00	61,984,000	
ＪＫホールディングス	15,300	849.00	12,989,700	
日伝	14,100	2,083.00	29,370,300	
北沢産業	11,600	257.00	2,981,200	
杉本商事	8,500	2,268.00	19,278,000	
因幡電機産業	45,200	2,617.00	118,288,400	
東テク	5,600	2,985.00	16,716,000	
ミスミグループ本社	212,300	3,470.00	736,681,000	
アルテック	12,500	325.00	4,062,500	
タキヒヨー	5,700	1,859.00	10,596,300	
蔵王産業	3,300	1,432.00	4,725,600	
スズケン	71,700	4,085.00	292,894,500	
ジェコス	11,700	918.00	10,740,600	
グローセル	18,400	431.00	7,930,400	
ローソン	42,800	5,100.00	218,280,000	
サンエー	12,900	4,310.00	55,599,000	
カワチ薬品	12,000	2,396.00	28,752,000	
エービーシー・マート	26,500	5,990.00	158,735,000	
ハードオフコーポレーション	7,900	795.00	6,280,500	
アスクル	14,800	3,875.00	57,350,000	
ゲオホールディングス	23,000	1,208.00	27,784,000	
アダストリア	23,600	1,888.00	44,556,800	
くら寿司	20,000	3,900.00	78,000,000	
キャンドゥ	8,200	2,168.00	17,777,600	
アイケイ	5,300	826.00	4,377,800	
パルグループホールディングス	15,100	1,592.00	24,039,200	
エディオン	72,000	1,188.00	85,536,000	
サーラコーポレーション	35,000	618.00	21,630,000	
ワッツ	8,600	902.00	7,757,200	
ハローズ	6,900	3,010.00	20,769,000	
フジオフードグループ本社	14,300	1,447.00	20,692,100	
あみやき亭	3,800	2,864.00	10,883,200	
大黒天物産	5,500	8,690.00	47,795,000	
ハニーズホールディングス	13,800	1,076.00	14,848,800	
ファーマライズホールディングス	4,600	782.00	3,597,200	
アルペン	13,100	2,508.00	32,854,800	
ハブ	6,000	655.00	3,930,000	
クオールホールディングス	23,100	1,364.00	31,508,400	
ジンズホールディングス	11,600	7,800.00	90,480,000	
ビックカメラ	100,700	1,145.00	115,301,500	

ＤＣＭホールディングス	104,700	1,091.00	114,227,700	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	240,800	2,550.00	614,040,000	
東京一番フーズ	4,900	584.00	2,861,600	
きちりホールディングス	4,500	576.00	2,592,000	
アークランドサービスホールディングス	14,300	2,287.00	32,704,100	
Ｊ．フロント　リテイリング	202,400	1,050.00	212,520,000	
ドトール・日レスホールディングス	27,000	1,649.00	44,523,000	
マツモトキヨシホールディングス	70,000	4,455.00	311,850,000	
ブロンコビリー	9,000	2,435.00	21,915,000	
ＺＯＺＯ	99,800	3,595.00	358,781,000	
トレジャー・ファクトリー	5,300	1,160.00	6,148,000	
物語コーポレーション	9,100	6,650.00	60,515,000	
ココカラファイン	15,100	7,550.00	114,005,000	
三越伊勢丹ホールディングス	296,600	784.00	232,534,400	
Ｈａｍｅｅ	4,600	1,583.00	7,281,800	
マーケットエンタープライズ	1,300	1,524.00	1,981,200	
ウエルシアホールディングス	89,600	3,475.00	311,360,000	
クリエイトＳＤホールディングス	25,100	3,400.00	85,340,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	19,700	393.00	7,742,100	
ティーライフ	2,800	1,358.00	3,802,400	
チムニー	5,200	1,255.00	6,526,000	
シュッピン	11,800	1,122.00	13,239,600	
オイシックス・ラ・大地	22,400	3,050.00	68,320,000	
ネクステージ	30,000	1,762.00	52,860,000	
ジョイフル本田	49,800	1,365.00	67,977,000	
鳥貴族ホールディングス	6,400	1,632.00	10,444,800	
ホットランド	12,900	1,369.00	17,660,100	
すかいらーくホールディングス	189,900	1,642.00	311,815,800	
ＳＦＰホールディングス	8,300	1,324.00	10,989,200	
綿半ホールディングス	13,000	1,305.00	16,965,000	
ヨシックス	3,500	2,009.00	7,031,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	49,500	1,107.00	54,796,500	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	1,492.00	13,428,000	
ＢＥＥＮＯＳ	8,700	3,490.00	30,363,000	
あさひ	12,900	1,490.00	19,221,000	
日本調剤	10,500	1,770.00	18,585,000	
コスモス薬品	17,100	15,790.00	270,009,000	
トーエル	8,700	842.00	7,325,400	
オンリー	3,700	465.00	1,720,500	
セブン&アイ・ホールディングス	662,000	4,703.00	3,113,386,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	90,900	803.00	72,992,700	

ツルハホールディングス	36,900	13,010.00	480,069,000	
サンマルクホールディングス	13,600	1,700.00	23,120,000	
フェリシモ	4,100	1,340.00	5,494,000	
トリドールホールディングス	42,100	1,754.00	73,843,400	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	15,800	736.00	11,628,800	
ウイルプラスホールディングス	2,900	1,320.00	3,828,000	
ＪＭホールディングス	13,000	2,143.00	27,859,000	
サツドラホールディングス	2,700	2,285.00	6,169,500	
アレンザホールディングス	13,200	1,230.00	16,236,000	
串カツ田中ホールディングス	4,700	1,712.00	8,046,400	
バロックジャパンリミテッド	12,200	768.00	9,369,600	
クスリのアオキホールディングス	16,900	7,990.00	135,031,000	
力の源ホールディングス	7,700	614.00	4,727,800	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	99,100	4,725.00	468,247,500	
メディカルシステムネットワーク	15,200	715.00	10,868,000	
はるやまホールディングス	8,500	669.00	5,686,500	
ノジマ	30,200	3,265.00	98,603,000	
カッパ・クリエイト	23,700	1,495.00	35,431,500	
ライトオン	12,600	705.00	8,883,000	
良品計画	194,900	2,336.00	455,286,400	
三城ホールディングス	22,400	283.00	6,339,200	
アドヴァン	17,600	975.00	17,160,000	
アルビス	5,600	2,336.00	13,081,600	
コナカ	19,900	341.00	6,785,900	
ハウス　オブ　ローゼ	2,300	1,662.00	3,822,600	
Ｇ－７ホールディングス	10,100	2,873.00	29,017,300	
イオン北海道	22,500	1,130.00	25,425,000	
コジマ	29,500	887.00	26,166,500	
ヒマラヤ	6,300	991.00	6,243,300	
コーナン商事	24,200	3,070.00	74,294,000	
エコス	6,400	1,878.00	12,019,200	
ワタミ	22,200	984.00	21,844,800	
マルシェ	4,400	481.00	2,116,400	
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	338,400	2,361.00	798,962,400	
西松屋チェーン	37,300	1,733.00	64,640,900	
ゼンショーホールディングス	91,000	2,823.00	256,893,000	
幸楽苑ホールディングス	10,700	1,636.00	17,505,200	
ハークスレイ	4,000	914.00	3,656,000	
サイゼリヤ	25,300	2,461.00	62,263,300	
ＶＴホールディングス	64,600	429.00	27,713,400	
魚力	5,500	1,902.00	10,461,000	

フジ・コーポレーション	9,200	1,316.00	12,107,200	
ユナイテッドアローズ	19,500	2,015.00	39,292,500	
ハイデイ日高	24,600	1,736.00	42,705,600	
京都きもの友禅	12,200	267.00	3,257,400	
コロワイド	56,200	1,862.00	104,644,400	
ピーシーデポコーポレーション	20,500	465.00	9,532,500	
壱番屋	12,000	4,900.00	58,800,000	
ＰＬＡＮＴ	4,800	734.00	3,523,200	
スギホールディングス	33,800	8,630.00	291,694,000	
薬王堂ホールディングス	7,500	2,406.00	18,045,000	
スクロール	24,600	892.00	21,943,200	
ヨンドシーホールディングス	15,800	1,892.00	29,893,600	
木曽路	22,300	2,280.00	50,844,000	
ＳＲＳホールディングス	22,200	830.00	18,426,000	
リテールパートナーズ	20,800	1,208.00	25,126,400	
ケーヨー	31,500	723.00	22,774,500	
上新電機	20,000	2,827.00	56,540,000	
日本瓦斯	83,800	1,889.00	158,298,200	
ロイヤルホールディングス	29,500	1,957.00	57,731,500	
いなげや	19,000	1,569.00	29,811,000	
チヨダ	18,200	893.00	16,252,600	
ライフコーポレーション	17,200	3,535.00	60,802,000	
リンガーハット	20,900	2,267.00	47,380,300	
ＭｒＭａｘＨＤ	23,800	647.00	15,398,600	
ＡＯＫＩホールディングス	34,500	639.00	22,045,500	
オークワ	26,700	1,171.00	31,265,700	
コメリ	26,300	2,868.00	75,428,400	
青山商事	38,100	863.00	32,880,300	
しまむら	19,700	10,990.00	216,503,000	
はせがわ	10,200	292.00	2,978,400	
高島屋	123,400	1,230.00	151,782,000	
松屋	37,200	945.00	35,154,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	80,400	864.00	69,465,600	
近鉄百貨店	6,600	3,145.00	20,757,000	
丸井グループ	143,300	2,097.00	300,500,100	
アクシアル　リテイリング	14,100	4,245.00	59,854,500	
イオン	651,200	3,088.00	2,010,905,600	
イズミ	34,400	4,375.00	150,500,000	
平和堂	31,300	2,290.00	71,677,000	
フジ	20,500	2,130.00	43,665,000	
ヤオコー	19,200	6,980.00	134,016,000	
ゼビオホールディングス	20,900	916.00	19,144,400	

ケーズホールディングス	144,300	1,466.00	211,543,800	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	9,200	782.00	7,194,400	
日産東京販売ホールディングス	26,500	247.00	6,545,500	
シルバーライフ	3,600	2,559.00	9,212,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	7,500	3,415.00	25,612,500	
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	1,228.00	4,420,800	
ブックオフグループホールディングス	9,900	1,006.00	9,959,400	
ギフト	2,300	2,148.00	4,940,400	
アインホールディングス	24,600	6,350.00	156,210,000	
元気寿司	4,900	2,452.00	12,014,800	
ヤマダホールディングス	567,800	562.00	319,103,600	
アークランドサカモト	26,700	1,547.00	41,304,900	
ニトリホールディングス	67,200	19,710.00	1,324,512,000	
グルメ杵屋	12,500	960.00	12,000,000	
愛眼	13,500	227.00	3,064,500	
ケーユーホールディングス	9,200	989.00	9,098,800	
吉野家ホールディングス	55,800	2,070.00	115,506,000	
松屋フーズホールディングス	8,200	3,525.00	28,905,000	
サガミホールディングス	24,100	1,039.00	25,039,900	
関西スーパーマーケット	13,100	1,037.00	13,584,700	
王将フードサービス	11,200	5,690.00	63,728,000	
プレナス	19,100	2,045.00	39,059,500	
ミニストップ	12,700	1,459.00	18,529,300	
アークス	32,400	2,431.00	78,764,400	
バローホールディングス	34,700	2,349.00	81,510,300	
ベルク	8,400	5,920.00	49,728,000	
大庄	9,400	1,004.00	9,437,600	
ファーストリテイリング	22,600	87,660.00	1,981,116,000	
サンドラッグ	63,800	3,880.00	247,544,000	
サックスバー　ホールディングス	15,000	638.00	9,570,000	
ヤマザワ	4,200	1,702.00	7,148,400	
やまや	3,500	2,326.00	8,141,000	
ベルーナ	36,600	1,201.00	43,956,600	
島根銀行	5,800	724.00	4,199,200	
じもとホールディングス	11,400	713.00	8,128,200	
めぶきフィナンシャルグループ	880,500	249.00	219,244,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,300	1,254.00	26,710,200	
九州フィナンシャルグループ	346,000	442.00	152,932,000	
ゆうちょ銀行	480,100	1,042.00	500,264,200	
富山第一銀行	40,400	291.00	11,756,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,032,400	437.00	451,158,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	112,500	733.00	82,462,500	

三十三フィナンシャルグループ	14,700	1,361.00	20,006,700	
第四北越フィナンシャルグループ	27,600	2,419.00	66,764,400	
ひろぎんホールディングス	249,900	620.00	154,938,000	
新生銀行	138,200	1,623.00	224,298,600	
あおぞら銀行	101,000	2,437.00	246,137,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,591,700	607.90	7,046,594,430	
りそなホールディングス	1,955,500	468.20	915,565,100	
三井住友トラスト・ホールディングス	320,300	3,857.00	1,235,397,100	
三井住友フィナンシャルグループ	1,172,700	3,970.00	4,655,619,000	
千葉銀行	565,500	716.00	404,898,000	
群馬銀行	348,800	378.00	131,846,400	
武蔵野銀行	25,200	1,683.00	42,411,600	
千葉興業銀行	43,100	279.00	12,024,900	
筑波銀行	70,500	177.00	12,478,500	
七十七銀行	53,200	1,436.00	76,395,200	
青森銀行	13,100	2,346.00	30,732,600	
秋田銀行	10,100	1,404.00	14,180,400	
山形銀行	19,000	1,059.00	20,121,000	
岩手銀行	11,100	2,161.00	23,987,100	
東邦銀行	151,500	223.00	33,784,500	
東北銀行	8,100	1,064.00	8,618,400	
みちのく銀行	10,900	1,025.00	11,172,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	152,900	1,972.00	301,518,800	
静岡銀行	412,700	867.00	357,810,900	
十六銀行	21,200	2,093.00	44,371,600	
スルガ銀行	148,600	415.00	61,669,000	
八十二銀行	381,700	400.00	152,680,000	
山梨中央銀行	19,700	857.00	16,882,900	
大垣共立銀行	33,500	2,047.00	68,574,500	
福井銀行	14,500	1,770.00	25,665,000	
北國銀行	15,700	2,483.00	38,983,100	
清水銀行	7,000	1,638.00	11,466,000	
富山銀行	3,300	2,791.00	9,210,300	
滋賀銀行	34,000	2,195.00	74,630,000	
南都銀行	24,700	1,880.00	46,436,000	
百五銀行	152,500	330.00	50,325,000	
京都銀行	60,700	6,000.00	364,200,000	
紀陽銀行	60,000	1,500.00	90,000,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	112,800	981.00	110,656,800	
山陰合同銀行	106,800	523.00	55,856,400	
中国銀行	145,800	910.00	132,678,000	
鳥取銀行	5,400	1,147.00	6,193,800	

伊予銀行	224,500	635.00	142,557,500	
百十四銀行	18,000	1,570.00	28,260,000	
四国銀行	24,000	735.00	17,640,000	
阿波銀行	25,900	2,309.00	59,803,100	
大分銀行	9,700	1,940.00	18,818,000	
宮崎銀行	10,600	2,305.00	24,433,000	
佐賀銀行	9,600	1,394.00	13,382,400	
沖縄銀行	15,500	2,757.00	42,733,500	
琉球銀行	36,800	734.00	27,011,200	
セブン銀行	566,200	234.00	132,490,800	
みずほフィナンシャルグループ	2,302,600	1,622.50	3,735,968,500	
高知銀行	6,100	829.00	5,056,900	
山口フィナンシャルグループ	211,500	674.00	142,551,000	
長野銀行	5,600	1,199.00	6,714,400	
名古屋銀行	13,600	2,811.00	38,229,600	
北洋銀行	255,400	295.00	75,343,000	
愛知銀行	5,700	2,928.00	16,689,600	
中京銀行	6,100	1,726.00	10,528,600	
大光銀行	5,800	1,481.00	8,589,800	
愛媛銀行	23,700	936.00	22,183,200	
トマト銀行	6,500	1,057.00	6,870,500	
京葉銀行	72,300	435.00	31,450,500	
栃木銀行	81,900	183.00	14,987,700	
北日本銀行	5,300	1,842.00	9,762,600	
東和銀行	29,700	633.00	18,800,100	
福島銀行	19,400	236.00	4,578,400	
大東銀行	8,100	638.00	5,167,800	
トモニホールディングス	131,000	309.00	40,479,000	
フィデアホールディングス	164,500	131.00	21,549,500	
池田泉州ホールディングス	194,900	178.00	34,692,200	
ＦＰＧ	57,400	742.00	42,590,800	
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,600	1,685.00	19,546,000	
マーキュリアインベストメント	6,900	808.00	5,575,200	
ＳＢＩホールディングス	208,900	3,030.00	632,967,000	
ジャフコ　グループ	26,100	7,840.00	204,624,000	
大和証券グループ本社	1,269,500	625.10	793,564,450	
野村ホールディングス	2,587,600	580.50	1,502,101,800	
岡三証券グループ	144,900	479.00	69,407,100	
丸三証券	50,700	668.00	33,867,600	
東洋証券	57,300	176.00	10,084,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	181,300	428.00	77,596,400	
光世証券	4,400	712.00	3,132,800	

水戸証券	46,000	312.00	14,352,000	
いちよし証券	34,300	633.00	21,711,900	
松井証券	83,200	872.00	72,550,400	
マネックスグループ	152,200	918.00	139,719,600	
極東証券	23,000	852.00	19,596,000	
岩井コスモホールディングス	17,500	1,781.00	31,167,500	
藍澤證券	30,700	1,044.00	32,050,800	
マネーパートナーズグループ	19,000	257.00	4,883,000	
スパークス・グループ	79,100	295.00	23,334,500	
かんぽ生命保険	210,100	2,205.00	463,270,500	
ＳＯＭＰＯホールディングス	298,700	4,255.00	1,270,968,500	
アニコム　ホールディングス	47,700	1,047.00	49,941,900	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	411,500	3,296.00	1,356,304,000	
第一生命ホールディングス	895,200	2,056.50	1,840,978,800	
東京海上ホールディングス	558,100	5,472.00	3,053,923,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	506,500	1,397.00	707,580,500	
アドバンスクリエイト	8,000	1,047.00	8,376,000	
全国保証	44,100	4,935.00	217,633,500	
イントラスト	5,100	660.00	3,366,000	
日本モーゲージサービス	8,800	1,022.00	8,993,600	
Ｃａｓａ	5,000	928.00	4,640,000	
アルヒ	25,100	1,827.00	45,857,700	
プレミアグループ	7,900	2,411.00	19,046,900	
クレディセゾン	99,100	1,298.00	128,631,800	
芙蓉総合リース	17,800	7,540.00	134,212,000	
みずほリース	26,200	3,360.00	88,032,000	
東京センチュリー	39,400	6,710.00	264,374,000	
日本証券金融	71,900	823.00	59,173,700	
アイフル	285,000	324.00	92,340,000	
リコーリース	13,400	3,495.00	46,833,000	
イオンフィナンシャルサービス	103,900	1,271.00	132,056,900	
アコム	341,000	472.00	160,952,000	
ジャックス	18,800	2,193.00	41,228,400	
オリエントコーポレーション	459,800	148.00	68,050,400	
オリックス	1,028,900	1,821.00	1,873,626,900	
三菱ＨＣキャピタル	586,400	641.00	375,882,400	
九州リースサービス	8,600	679.00	5,839,400	
日本取引所グループ	457,800	2,647.50	1,212,025,500	
イー・ギャランティ	19,600	2,120.00	41,552,000	
アサックス	9,100	695.00	6,324,500	
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,000	2,071.00	14,497,000	
いちご	193,100	349.00	67,391,900	

日本駐車場開発	195,000	159.00	31,005,000	
スター・マイカ・ホールディングス	10,000	1,110.00	11,100,000	
ＳＲＥホールディングス	2,700	5,010.00	13,527,000	
ＡＤワークスグループ	33,600	163.00	5,476,800	
ヒューリック	360,600	1,267.00	456,880,200	
三栄建築設計	7,500	1,985.00	14,887,500	
野村不動産ホールディングス	103,500	2,818.00	291,663,000	
三重交通グループホールディングス	37,400	492.00	18,400,800	
サムティ	24,800	2,055.00	50,964,000	
ディア・ライフ	27,100	482.00	13,062,200	
日本商業開発	11,600	1,743.00	20,218,800	
プレサンスコーポレーション	28,800	1,704.00	49,075,200	
ハウスコム	4,100	1,246.00	5,108,600	
日本管理センター	10,300	1,286.00	13,245,800	
サンセイランディック	6,700	849.00	5,688,300	
フージャースホールディングス	27,600	691.00	19,071,600	
オープンハウス	54,100	4,540.00	245,614,000	
東急不動産ホールディングス	463,100	643.00	297,773,300	
飯田グループホールディングス	141,900	2,780.00	394,482,000	
イーグランド	4,300	942.00	4,050,600	
ムゲンエステート	13,400	502.00	6,726,800	
ハウスドゥ	8,300	1,068.00	8,864,400	
シーアールイー	5,400	1,475.00	7,965,000	
グッドコムアセット	9,100	1,470.00	13,377,000	
ジェイ・エス・ビー	3,600	3,455.00	12,438,000	
テンポイノベーション	6,400	886.00	5,670,400	
フェイスネットワーク	2,500	1,311.00	3,277,500	
パーク２４	91,700	2,230.00	204,491,000	
パラカ	5,300	1,700.00	9,010,000	
三井不動産	772,900	2,515.00	1,943,843,500	
三菱地所	1,114,000	1,872.50	2,085,965,000	
平和不動産	29,400	3,910.00	114,954,000	
東京建物	168,300	1,727.00	290,654,100	
ダイビル	44,700	1,278.00	57,126,600	
京阪神ビルディング	30,200	1,520.00	45,904,000	
住友不動産	381,300	3,913.00	1,492,026,900	
テーオーシー	35,300	741.00	26,157,300	
東京楽天地	3,100	4,245.00	13,159,500	
スターツコーポレーション	20,700	2,756.00	57,049,200	
フジ住宅	21,800	666.00	14,518,800	
空港施設	19,400	635.00	12,319,000	
明和地所	10,200	668.00	6,813,600	

ゴールドクレスト	16,200	1,630.00	26,406,000	
エスリード	7,500	1,678.00	12,585,000	
日神グループホールディングス	28,100	501.00	14,078,100	
日本エスコン	30,700	759.00	23,301,300	
タカラレーベン	71,000	369.00	26,199,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	11,100	907.00	10,067,700	
イオンモール	85,800	1,757.00	150,750,600	
毎日コムネット	7,700	775.00	5,967,500	
ファースト住建	8,400	1,244.00	10,449,600	
カチタス	42,400	3,340.00	141,616,000	
トーセイ	24,700	1,123.00	27,738,100	
穴吹興産	4,400	2,127.00	9,358,800	
サンフロンティア不動産	22,300	1,024.00	22,835,200	
エフ・ジェー・ネクスト	18,000	1,053.00	18,954,000	
インテリックス	3,800	862.00	3,275,600	
ランドビジネス	7,100	402.00	2,854,200	
サンネクスタグループ	6,800	991.00	6,738,800	
グランディハウス	14,700	465.00	6,835,500	
日本空港ビルデング	59,200	4,870.00	288,304,000	
明豊ファシリティワークス	7,900	789.00	6,233,100	
日本工営	10,300	3,095.00	31,878,500	
ＬＩＦＵＬＬ	57,800	409.00	23,640,200	
ミクシィ	41,800	2,706.00	113,110,800	
ジェイエイシーリクルートメント	11,400	1,792.00	20,428,800	
日本M&Aセンター	269,400	2,771.00	746,507,400	
メンバーズ	5,000	2,976.00	14,880,000	
中広	3,100	349.00	1,081,900	
ＵＴグループ	23,800	3,720.00	88,536,000	
アイティメディア	5,600	1,993.00	11,160,800	
タケエイ	18,500	1,284.00	23,754,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	8,800	1,135.00	9,988,000	
夢真ビーネックスグループ	43,700	1,428.00	62,403,600	
コシダカホールディングス	44,400	567.00	25,174,800	
アルトナー	4,300	813.00	3,495,900	
パソナグループ	17,900	1,941.00	34,743,900	
ＣＤＳ	4,200	1,568.00	6,585,600	
リンクアンドモチベーション	30,200	690.00	20,838,000	
ＧＣＡ	21,800	850.00	18,530,000	
エス・エム・エス	55,800	3,060.00	170,748,000	
サニーサイドアップグループ	6,000	756.00	4,536,000	
パーソルホールディングス	164,300	2,118.00	347,987,400	
リニカル	9,600	741.00	7,113,600	

クックパッド	52,500	282.00	14,805,000	
アイ・ケイ・ケイ	8,400	670.00	5,628,000	
学情	6,000	1,375.00	8,250,000	
スタジオアリス	8,400	2,400.00	20,160,000	
シミックホールディングス	9,300	1,577.00	14,666,100	
エプコ	4,300	981.00	4,218,300	
ＮＪＳ	4,200	2,013.00	8,454,600	
綜合警備保障	65,400	4,875.00	318,825,000	
カカクコム	121,400	2,882.00	349,874,800	
アイロムグループ	5,900	2,364.00	13,947,600	
セントケア・ホールディング	12,200	1,194.00	14,566,800	
サイネックス	3,200	666.00	2,131,200	
ルネサンス	10,500	1,161.00	12,190,500	
ディップ	25,800	3,230.00	83,334,000	
デジタルホールディングス	11,600	1,931.00	22,399,600	
新日本科学	20,400	733.00	14,953,200	
キャリアデザインセンター	4,400	1,069.00	4,703,600	
ベネフィット・ワン	59,800	2,742.00	163,971,600	
エムスリー	289,700	7,462.00	2,161,741,400	
ツカダ・グローバルホールディング	13,100	347.00	4,545,700	
アウトソーシング	94,200	1,904.00	179,356,800	
ウェルネット	17,000	521.00	8,857,000	
ワールドホールディングス	5,700	2,781.00	15,851,700	
ディー・エヌ・エー	69,600	2,100.00	146,160,000	
博報堂ＤＹホールディングス	228,600	1,838.00	420,166,800	
ぐるなび	29,000	592.00	17,168,000	
タカミヤ	20,400	524.00	10,689,600	
ジャパンベストレスキューシステム	12,900	730.00	9,417,000	
ファンコミュニケーションズ	45,800	398.00	18,228,400	
ライク	4,500	2,315.00	10,417,500	
ビジネス・ブレークスルー	7,500	449.00	3,367,500	
エスプール	42,400	958.00	40,619,200	
ＷＤＢホールディングス	7,600	2,357.00	17,913,200	
手間いらず	2,100	5,570.00	11,697,000	
ティア	10,100	491.00	4,959,100	
ＣＤＧ	1,700	1,594.00	2,709,800	
アドウェイズ	27,000	861.00	23,247,000	
バリューコマース	11,100	3,350.00	37,185,000	
インフォマート	166,300	900.00	149,670,000	
ＪＰホールディングス	47,800	317.00	15,152,600	
エコナックホールディングス	32,600	92.00	2,999,200	
ＥＰＳホールディングス	24,900	1,400.00	34,860,000	

レッグス	4,200	2,488.00	10,449,600	
プレステージ・インターナショナル	61,900	744.00	46,053,600	
アミューズ	9,100	2,361.00	21,485,100	
ドリームインキュベータ	5,300	1,014.00	5,374,200	
クイック	10,400	1,246.00	12,958,400	
ＴＡＣ	10,000	245.00	2,450,000	
電通グループ	184,700	3,535.00	652,914,500	
イオンファンタジー	6,500	2,026.00	13,169,000	
シーティーエス	18,800	888.00	16,694,400	
ネクシィーズグループ	6,000	996.00	5,976,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	46,000	3,655.00	168,130,000	
アルプス技研	14,700	2,042.00	30,017,400	
ダイオーズ	3,500	990.00	3,465,000	
日本空調サービス	17,500	743.00	13,002,500	
オリエンタルランド	174,600	15,265.00	2,665,269,000	
ダスキン	38,200	2,654.00	101,382,800	
明光ネットワークジャパン	21,200	589.00	12,486,800	
ファルコホールディングス	8,000	1,698.00	13,584,000	
ラウンドワン	56,200	1,239.00	69,631,800	
リゾートトラスト	75,400	1,698.00	128,029,200	
ビー・エム・エル	21,200	3,835.00	81,302,000	
りらいあコミュニケーションズ	25,200	1,334.00	33,616,800	
リソー教育	84,200	292.00	24,586,400	
早稲田アカデミー	7,300	926.00	6,759,800	
ユー・エス・エス	183,900	2,001.00	367,983,900	
東京個別指導学院	15,000	592.00	8,880,000	
サイバーエージェント	404,800	2,190.00	886,512,000	
楽天グループ	766,100	1,334.00	1,021,977,400	
クリーク・アンド・リバー社	8,800	1,581.00	13,912,800	
モーニングスター	24,500	461.00	11,294,500	
テー・オー・ダブリュー	29,600	326.00	9,649,600	
山田コンサルティンググループ	9,800	1,238.00	12,132,400	
セントラルスポーツ	6,200	2,430.00	15,066,000	
フルキャストホールディングス	14,100	1,979.00	27,903,900	
エン・ジャパン	29,300	3,440.00	100,792,000	
リソルホールディングス	1,900	4,000.00	7,600,000	
テクノプロ・ホールディングス	32,800	8,470.00	277,816,000	
アトラグループ	3,800	335.00	1,273,000	
インターワークス	5,400	390.00	2,106,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,700	13,130.00	87,971,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	10,700	2,308.00	24,695,600	
ファーストロジック	3,500	775.00	2,712,500	

三機サービス	3,400	1,076.00	3,658,400	
Ｇｕｎｏｓｙ	10,500	1,022.00	10,731,000	
デザインワン・ジャパン	5,900	255.00	1,504,500	
イー・ガーディアン	7,300	2,786.00	20,337,800	
リブセンス	10,200	231.00	2,356,200	
ジャパンマテリアル	50,700	1,275.00	64,642,500	
ベクトル	20,700	958.00	19,830,600	
ウチヤマホールディングス	8,800	378.00	3,326,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,400	1,263.00	15,661,200	
キャリアリンク	5,500	2,236.00	12,298,000	
ＩＢＪ	13,700	912.00	12,494,400	
アサンテ	6,100	1,823.00	11,120,300	
バリューＨＲ	6,700	1,660.00	11,122,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	13,500	4,690.00	63,315,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,500	1,696.00	11,024,000	
ＥＲＩホールディングス	5,100	588.00	2,998,800	
アビスト	2,600	3,060.00	7,956,000	
シグマクシス	9,100	2,139.00	19,464,900	
ウィルグループ	12,300	1,018.00	12,521,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	25,400	253.00	6,426,200	
メドピア	12,700	5,730.00	72,771,000	
レアジョブ	3,200	2,045.00	6,544,000	
リクルートホールディングス	1,176,100	5,257.00	6,182,757,700	
エラン	22,800	1,372.00	31,281,600	
土木管理総合試験所	8,800	406.00	3,572,800	
ネットマーケティング	8,300	591.00	4,905,300	
日本郵政	1,242,400	949.40	1,179,534,560	
ベルシステム２４ホールディングス	27,700	1,694.00	46,923,800	
鎌倉新書	16,700	1,365.00	22,795,500	
ＳＭＮ	3,800	805.00	3,059,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,200	1,013.00	3,241,600	
エアトリ	10,300	2,246.00	23,133,800	
アトラエ	11,600	1,679.00	19,476,400	
ストライク	6,300	4,280.00	26,964,000	
ソラスト	40,500	1,410.00	57,105,000	
セラク	5,300	2,311.00	12,248,300	
インソース	16,000	2,456.00	39,296,000	
ベイカレント・コンサルティング	10,800	34,000.00	367,200,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,700	2,787.00	10,311,900	
アイモバイル	6,000	1,368.00	8,208,000	
キャリアインデックス	7,200	602.00	4,334,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	6,900	1,039.00	7,169,100	

船場	3,600	854.00	3,074,400	
グレイステクノロジー	16,800	2,553.00	42,890,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,400	2,242.00	106,270,800	
フルテック	2,500	1,474.00	3,685,000	
グリーンズ	6,200	592.00	3,670,400	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	5,300	665.00	3,524,500	
ソウルドアウト	4,100	1,587.00	6,506,700	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	3,100	607.00	1,881,700	
ウェルビー	6,200	1,482.00	9,188,400	
エル・ティー・エス	1,600	4,445.00	7,112,000	
ミダック	3,600	5,430.00	19,548,000	
日総工産	13,200	776.00	10,243,200	
キュービーネットホールディングス	7,700	1,773.00	13,652,100	
ＲＰＡホールディングス	19,200	765.00	14,688,000	
スプリックス	4,900	1,067.00	5,228,300	
マネジメントソリューションズ	8,100	1,976.00	16,005,600	
プロレド・パートナーズ	3,100	2,964.00	9,188,400	
テノ．ホールディングス	2,000	1,130.00	2,260,000	
フロンティア・マネジメント	3,900	1,659.00	6,470,100	
ピアラ	1,300	1,582.00	2,056,600	
コプロ・ホールディングス	2,300	1,326.00	3,049,800	
ギークス	3,000	1,709.00	5,127,000	
カーブスホールディングス	45,400	821.00	37,273,400	
フォーラムエンジニアリング	11,700	1,043.00	12,203,100	
ダイレクトマーケティングミックス	8,600	3,485.00	29,971,000	
ポピンズホールディングス	4,400	4,600.00	20,240,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	6,700	4,620.00	30,954,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,700	730.00	6,351,000	
リログループ	89,900	2,291.00	205,960,900	
東祥	10,400	1,679.00	17,461,600	
エイチ・アイ・エス	25,200	2,289.00	57,682,800	
ラックランド	4,800	2,498.00	11,990,400	
共立メンテナンス	27,300	3,535.00	96,505,500	
イチネンホールディングス	17,300	1,299.00	22,472,700	
建設技術研究所	10,700	2,563.00	27,424,100	
スペース	10,900	903.00	9,842,700	
長大	6,700	1,774.00	11,885,800	
燦ホールディングス	7,400	1,065.00	7,881,000	
スバル興業	1,000	8,170.00	8,170,000	
東京テアトル	6,400	1,256.00	8,038,400	
タナベ経営	3,300	1,396.00	4,606,800	
ナガワ	5,300	8,250.00	43,725,000	

東京都競馬	10,800	5,420.00	58,536,000	
カナモト	29,000	2,775.00	80,475,000	
西尾レントオール	15,200	3,215.00	48,868,000	
トランス・コスモス	15,700	3,115.00	48,905,500	
乃村工藝社	70,700	831.00	58,751,700	
藤田観光	6,500	1,937.00	12,590,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	8,700	1,074.00	9,343,800	
日本管財	17,700	2,245.00	39,736,500	
トーカイ	16,000	2,462.00	39,392,000	
セコム	161,800	9,317.00	1,507,490,600	
セントラル警備保障	8,000	2,990.00	23,920,000	
丹青社	31,300	860.00	26,918,000	
メイテック	20,100	6,130.00	123,213,000	
応用地質	18,700	1,328.00	24,833,600	
船井総研ホールディングス	33,700	2,269.00	76,465,300	
進学会ホールディングス	7,100	423.00	3,003,300	
オオバ	11,900	859.00	10,222,100	
いであ	4,100	1,866.00	7,650,600	
学究社	5,000	1,311.00	6,555,000	
ベネッセホールディングス	60,300	2,443.00	147,312,900	
イオンディライト	20,300	3,385.00	68,715,500	
ナック	8,100	947.00	7,670,700	
ダイセキ	27,600	4,115.00	113,574,000	
ステップ	6,200	1,609.00	9,975,800	
合　計	180,192,000		460,742,957,170	

(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

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,238,364,651
コール・ローン	3,303,117,503
国債証券	294,306,290,777
派生商品評価勘定	35,395,355
未収入金	5,920,298,908
未収利息	1,834,340,720
前払費用	57,734,398
差入委託証拠金	425,595,765
流動資産合計	307,121,138,077
資産合計	307,121,138,077
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,569,830
前受金	1,893,876
未払金	6,953,280,296
未払解約金	226,718,670
未払利息	2,558
流動負債合計	7,188,465,230
負債合計	7,188,465,230
純資産の部	
元本等	
元本	98,661,509,279
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	201,271,163,568
元本等合計	299,932,672,847
純資産合計	299,932,672,847
負債純資産合計	307,121,138,077

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引

	2021年 5月10日現在
	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 5月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	98,661,509,279口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0400円 (1万口当たり純資産額) (30,400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

	2021年 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年 5月10日現在
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	93,613,991,047円
期中追加設定元本額	9,177,791,976円
期中一部解約元本額	4,130,273,744円
期末元本額	98,661,509,279円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,450,200,894円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	617,077,783円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,046,735,908円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,371,699円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	7,146,966,169円
世界経済インデックスファンド	9,053,593,050円
ＤＣマイセレクション２５	1,886,404,453円
ＤＣマイセレクション５０	1,594,903,408円
ＤＣマイセレクション７５	1,080,423,744円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,113,883,812円
ＤＣマイセレクションＳ２５	830,492,966円
ＤＣマイセレクションＳ５０	662,002,471円
ＤＣマイセレクションＳ７５	346,205,923円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	37,743,908円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	79,893,966円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	40,438,684円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	11,042,223,425円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	672,086,611円

区分	2021年 5月10日現在
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	3,925,757円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,388,520円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,529,048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）	30,705,008円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	71,223,680円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	106,862,002円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	90,036,269円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	95,223,196円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,630,219,594円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	489,585,124円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,941,568,268円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	490,141,077円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	61,809,375円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	507,355,830円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	192,553,052円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	234,152,090円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	813,587,024円
グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用）	1,256,213,928円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	765,529,114円
外国債券ファンド・シリーズ１	628,687,544円
コア投資戦略ファンド（安定型）	905,750,994円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,367,564,911円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,148,177,436円
分散投資コア戦略ファンドＳ	2,349,587,917円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	429,248,945円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,558,704,644円
コア投資戦略ファンド（切替型）	877,927,110円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	222,908,847円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	100,505,435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）	1,178,174,256円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	188,413,055円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	20,873,361,375円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	170,507,341円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	174,688,010円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	278,813,727円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,165,817円
グローバル経済コア	766,929,857円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,716,556円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	474,156円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	242,417,632円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	25,844,604円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	738,326円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	753,032円

区分	2021年 5月10日現在
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	351,020円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	908,884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）	509,175,396円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	10,494,235,065円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	337,396,905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）	342,715,652円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	187,969,580円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	369,968,658円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△11,025,077,223
合計	△11,025,077,223

(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

（2021年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	3,470,939,672	－	3,472,833,548	1,893,876
合計		3,470,939,672	－	3,472,833,548	1,893,876

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2021年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,190,931,026	－	3,217,770,097	26,839,071
	アメリカドル	1,469,111,279	－	1,470,517,672	1,406,393
	カナダドル	154,095,796	－	158,815,197	4,719,401
	ユーロ	1,328,259,320	－	1,345,734,063	17,474,743
	イギリスポンド	239,464,631	－	242,703,165	3,238,534
	売建	140,421,965	－	140,329,387	92,578
	アメリカドル	95,397,909	－	95,073,623	324,286
	ユーロ	43,749,129	－	43,977,790	△228,661
	シンガポールドル	1,054,232	－	1,057,410	△3,178
	イスラエルシェケル	220,695	－	220,564	131
合計		3,331,352,991	－	3,358,099,484	26,931,649

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,968,750.00	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,694,913.30	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,496,777.32	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,048,035.97	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,986,250.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,241,875.00	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,400,625.02	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,994,921.94	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,172,203.12	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,015,625.04	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	986,562.50	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,854,687.50	

		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,374,609.37	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,534,890.61	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,871,250.00	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,949,062.48	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,094,765.62	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,630,937.52	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,958,984.39	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,940,312.52	
		T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,460,898.45	
		T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,822,659.93	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,216,333.61	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,851,455.46	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,389,121.08	
		T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,863,425.79	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,488,162.50	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,200,292.95	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,042,500.00	
		T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	14,692,691.48	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,415,820.32	
		T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,649,218.80	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,258,945.35	
		T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,999,570.34	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,480,128.96	
		T 1.125% 02/15/31	11,050,000.00	10,603,683.64	
		T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	6,776,696.87	
		T 1.125% 08/15/40	9,300,000.00	7,790,203.12	
		T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,161,667.99	
		T 1.25% 05/15/50	10,650,000.00	8,319,480.51	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,658,951.16	
		T 1.375% 01/31/25	9,000,000.00	9,298,476.54	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,129,492.20	
		T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	7,984,968.75	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,568,457.02	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,112,500.00	
		T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,090,917.95	
		T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	11,383,125.00	
		T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,343,617.17	
		T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,184,218.78	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,481,120.31	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,992,562.50	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,102,890.64	
		T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,179,687.50	

		T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,683,500.00	
		T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,679,794.91	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,817,421.87	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,441,085.97	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,601,855.46	
		T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,364,346.87	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,030,195.31	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,548,974.60	
		T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,866,543.00	
		T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,100,390.65	
		T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,587,597.65	
		T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,585,441.38	
		T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,264,956.29	
		T 1.625% 11/15/50	8,050,000.00	6,927,402.38	
		T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,120,225.00	
		T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,686,906.26	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,761,606.41	
		T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,590,341.79	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,864,867.17	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,808,483.61	
		T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,719,922.86	
		T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,133,710.92	
		T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,506,781.25	
		T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,483,962.48	
		T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,268,590.80	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,077,812.50	
		T 1.875% 02/15/41	3,000,000.00	2,867,343.75	
		T 1.875% 02/15/51	6,300,000.00	5,764,007.84	
		T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,528,483.40	
		T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,197,753.94	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,469,570.71	
		T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,093,203.12	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,297,187.50	
		T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,725,720.69	
		T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,644,107.44	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,367,152.33	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,794,281.25	
		T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,869,131.06	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,551,687.51	
		T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,839,062.50	
		T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,140,273.46	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,074,500.00	
		T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,468,750.00	

		T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,810,650.00	
		T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,494,874.19	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,218,906.24	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,598,875.00	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,405,507.83	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,159,521.46	
		T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	7,283,165.62	
		T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,481,953.12	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,700,148.46	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,800,630.83	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,712,640.63	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,187,890.62	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,739,414.08	
		T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,949,281.29	
		T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,193,750.00	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,100,875.01	
		T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,804,648.44	
		T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	11,604,121.14	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,614,504.68	
		T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,328,906.25	
		T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	7,683,398.47	
		T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,682,944.14	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,377,148.45	
		T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,368,995.31	
		T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,193,125.00	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,230,826.18	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,423,683.57	
		T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,293,425.80	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,788,875.00	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,108,252.74	
		T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	10,932,806.25	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,462,945.31	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,841,894.56	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,158,207.01	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,720,390.62	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,335,842.95	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,207,421.89	
		T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,220,351.56	
		T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,784,710.92	
		T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,086,579.69	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,991,562.50	
		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,057,265.63	

		T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,431,117.19	
		T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	5,439,585.93	
		T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	7,943,261.70	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,528,546.87	
		T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,510,628.15	
		T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,101,118.75	
		T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,353,808.60	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,370,625.00	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,066,540.62	
		T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,655,132.81	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,290,183.62	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,178,125.00	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,981,472.64	
		T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	9,917,925.00	
		T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	4,820,367.20	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,054,296.87	
		T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,664,550.77	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,292,606.25	
		T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,243,554.72	
		T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,164,843.75	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,943,145.35	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	4,717,578.15	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,544,907.06	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,480,154.68	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,787,890.62	
		T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,070,371.09	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,299,093.75	
		T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,278,710.90	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,824,417.23	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,058,789.06	
		T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,744,726.56	
		T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,082,695.33	
		T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	6,988,134.37	
		T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	4,832,803.12	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,494,625.00	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,040,527.35	
		T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,653,622.67	
		T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	6,539,703.12	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	942,407.81	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,023,812.51	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,515,625.00	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,545,156.26	
		T 3.75% 11/15/43	4,500,000.00	5,766,328.12	

		T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,867,554.68	
		T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,217,375.00	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,125,843.75	
		T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,088,281.25	
		T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,855,153.12	
		T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,005,312.50	
		T 3% 05/15/47	5,710,000.00	6,565,161.74	
		T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,284,957.05	
		T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,632,304.69	
		T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,518,945.30	
		T 3% 11/15/44	4,050,000.00	4,632,820.31	
		T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,206,281.25	
		T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,174,519.54	
		T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,347,734.38	
		T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,600,476.57	
		T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,684,601.56	
		T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,717,734.37	
		T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,139,171.10	
		T 4.5% 05/15/38	550,000.00	752,167.97	
		T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,348,523.44	
		T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,348,548.44	
		T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,078,007.81	
		T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,571,539.06	
		T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,614,550.78	
		T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,671,109.37	
		T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,636,156.25	
		T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,556,250.00	
		T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,121,812.50	
		T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,909,695.31	
		T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,478,941.41	
		T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,877,390.62	
	アメリカドル 小計		1,150,000,000.00	1,193,378,271.89 (129,803,754,633)	
	カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,060,642.60	
		CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,213,469.60	
		CAN 0.25% 04/01/24	700,000.00	695,366.00	
		CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,598,024.00	
		CAN 0.25% 08/01/22	910,000.00	910,564.20	
		CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,770,654.90	
		CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	3,947,745.90	
		CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,206,314.00	
		CAN 1.25% 03/01/25	2,400,000.00	2,458,344.00	

		CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,534,351.20	
		CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,096,803.50	
		CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,401,507.20	
		CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	619,074.00	
		CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,717,124.60	
		CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,726,747.60	
		CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,526,100.00	
		CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,417,852.00	
		CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,915,542.00	
		CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,354,210.20	
		CAN 2.5% 06/01/24	1,300,000.00	1,380,171.00	
		CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,770,117.60	
		CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,166,718.80	
		CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	665,660.80	
		CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,384,119.80	
		CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,475,029.90	
		CAN 2% 12/01/51	4,080,000.00	4,026,552.00	
		CAN 3.5% 12/01/45	1,480,000.00	1,912,796.40	
		CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,418,098.50	
		CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,569,133.80	
		CAN 5.75% 06/01/33	1,410,000.00	2,033,135.40	
		CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,188,237.40	
	カナダドル 小計		65,030,000.00	68,160,208.90 (6,116,015,544)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,783,260.00	
		MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	33,994,512.40	
		MBONO 5.75% 03/05/26	45,980,000.00	45,771,710.60	
		MBONO 6.5% 06/09/22	33,080,000.00	33,733,330.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	33,850,000.00	35,003,608.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	41,667,940.80	
		MBONO 7.75% 05/29/31	24,180,000.00	26,044,519.80	
		MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	24,525,757.20	
		MBONO 7.75% 11/23/34	14,100,000.00	15,008,040.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	42,507,581.40	
		MBONO 8.5% 11/18/38	26,220,000.00	28,851,963.60	
		MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	37,145,216.70	
		MBONO 8% 11/07/47	23,430,000.00	24,239,037.90	
		MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	37,347,164.80	
	メキシコペソ 小計		409,160,000.00	436,623,643.20 (2,385,056,650)	
	ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,383,713.70	
		BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	1,000,413.40	
		BGB 0.4% 06/22/40	710,000.00	676,026.50	

		BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,680,960.60	
		BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	520,332.80	
		BGB 0.8% 06/22/25	2,420,000.00	2,554,092.20	
		BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,807,167.70	
		BGB 0.8% 06/22/28	2,090,000.00	2,244,012.10	
		BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,554,747.20	
		BGB 0% 10/22/27	430,000.00	437,912.00	
		BGB 0% 10/22/31	630,000.00	621,337.50	
		BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,682,805.00	
		BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	823,780.80	
		BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,611,067.20	
		BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,195,170.00	
		BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,279,509.00	
		BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,448,697.20	
		BGB 1% 06/22/31	1,980,000.00	2,163,051.00	
		BGB 2.15% 06/22/66	870,000.00	1,196,859.00	
		BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	1,964,737.00	
		BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,060,028.20	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,356,610.80	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,974,648.00	
		BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,385,741.40	
		BGB 4.25% 03/28/41	2,400,000.00	4,001,832.00	
		BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,244,186.00	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,420,189.20	
		BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,533,006.00	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,899,784.00	
		BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,385,507.00	
		BKO 0% 06/10/22	900,000.00	906,552.00	
		BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	5,004,796.50	
		BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,043,073.20	
		BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,647,542.40	
		BTPS 0.3% 08/15/23	1,850,000.00	1,871,737.50	
		BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	587,319.60	
		BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,766,763.00	
		BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,130,168.70	
		BTPS 0.6% 08/01/31	1,850,000.00	1,785,102.00	
		BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,216,199.30	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,314,912.50	
		BTPS 0.9% 04/01/31	2,500,000.00	2,496,550.00	
		BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,229,194.60	
		BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,045,180.00	
		BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	951,282.60	
		BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,639,159.40	

		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,252,032.40	
		BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,454,494.00	
		BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,004,210.00	
		BTPS 0% 04/15/24	500,000.00	501,620.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,051,478.00	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,031,762.00	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,450,000.00	1,469,937.50	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,427,742.00	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,037,978.90	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,524,560.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,550,358.40	
		BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,025,722.80	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,206,312.20	
		BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,721,762.40	
		BTPS 1.7% 09/01/51	1,120,000.00	1,055,107.20	
		BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,384,960.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,852,082.50	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,118,540.00	
		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,895,642.00	
		BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,195,704.80	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,013,287.60	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,504,864.00	
		BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	691,645.80	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,527,471.20	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,061,480.80	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,029,188.80	
		BTPS 2.45% 09/01/50	1,470,000.00	1,638,241.50	
		BTPS 2.45% 10/01/23	910,000.00	968,176.30	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,264,411.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,213,641.50	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	2,943,778.20	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,522,197.60	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,193,439.50	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,499,503.50	
		BTPS 2% 02/01/28	2,690,000.00	2,955,072.60	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,266,458.70	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,766,977.00	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,505,769.50	
		BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,795,801.40	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,821,211.20	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,874,086.80	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,421,201.00	

		BTPS 3.85% 09/01/49	2,160,000.00	3,076,423.20	
		BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,973,334.40	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,108,627.50	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,510,705.60	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,919,598.80	
		BTPS 4.75% 08/01/23	4,950,000.00	5,503,608.00	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,705,714.20	
		BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	4,790,269.00	
		BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,830,130.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,116,782.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,883,928.40	
		BTPS 5.5% 09/01/22	1,400,000.00	1,507,170.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,746,217.00	
		BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,654,804.00	
		BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,354,485.00	
		BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,330,260.00	
		BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	4,985,236.30	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,983,660.00	
		BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,852,909.40	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,929,844.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	982,496.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,072,713.30	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,087,495.30	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,291,528.80	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,136,620.00	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,162,090.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,551,348.90	
		DBR 0.5% 08/15/27	5,690,000.00	6,059,508.60	
		DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,670,566.90	
		DBR 0% 02/15/31	800,000.00	817,864.00	
		DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,812,386.00	
		DBR 0% 05/15/36	620,000.00	612,541.40	
		DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,487,460.00	
		DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,603,250.00	
		DBR 0% 08/15/30	5,380,000.00	5,515,414.60	
		DBR 0% 08/15/30	670,000.00	689,878.90	
		DBR 0% 08/15/50	2,720,000.00	2,460,566.40	
		DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,229,292.80	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,458,961.60	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,076,416.80	
		DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,156,081.20	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,444,529.20	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,881,592.00	

		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,763,668.50	
		DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,148,979.80	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,112,340.00	
		DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,916,003.20	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,385,154.20	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,800,000.00	5,887,986.00	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,038,006.40	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,580,000.00	4,248,718.20	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,761,425.80	
		DBR 4.25% 07/04/39	2,720,000.00	4,773,736.00	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,521,040.00	
		DBR 4.75% 07/04/34	3,390,000.00	5,579,262.00	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,345,388.90	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,457,436.80	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,342,326.40	
		DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,834,946.70	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,980,537.50	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,413,346.20	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,838,605.20	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,819,860.80	
		FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,325,972.40	
		FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,605,730.00	
		FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,087,865.00	
		FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	753,479.10	
		FRTR 0.5% 06/25/44	910,000.00	861,870.10	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,340,732.40	
		FRTR 0.75% 05/25/52	3,580,000.00	3,370,570.00	
		FRTR 0.75% 11/25/28	4,500,000.00	4,807,170.00	
		FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,074,128.50	
		FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,557,960.00	
		FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,313,939.50	
		FRTR 0% 02/25/27	950,000.00	966,492.00	
		FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,354,696.70	
		FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,053,292.00	
		FRTR 0% 03/25/25	8,090,000.00	8,251,476.40	
		FRTR 0% 05/25/22	2,800,000.00	2,818,816.00	
		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,275,411.80	
		FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,003,820.40	
		FRTR 0% 11/25/31	670,000.00	659,420.70	
		FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,706,337.00	
		FRTR 1.25% 05/25/36	4,830,000.00	5,386,657.50	
		FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,719,783.20	

		FRTR 1.5% 05/25/50	4,090,000.00	4,702,559.30	
		FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,644,534.60	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,029,350.00	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,605,506.60	
		FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,502,617.60	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,020,930.50	
		FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,634,182.40	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,458,545.00	
		FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	5,984,811.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,825,516.60	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,153,731.60	
		FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,543,094.00	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,177,157.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,604,252.00	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,628,574.60	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000.00	8,155,924.00	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	5,896,500.80	
		FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	4,506,336.00	
		FRTR 4% 04/25/60	2,180,000.00	4,273,955.40	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,327,498.20	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,501,773.40	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,095,205.60	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,458,524.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,180,620.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	957,369.90	
		IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,039,836.50	
		IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	756,580.00	
		IRISH 0.55% 04/22/41	490,000.00	477,098.30	
		IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,152,229.50	
		IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	534,669.30	
		IRISH 0% 10/18/31	580,000.00	568,295.60	
		IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,312,752.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	750,500.50	
		IRISH 1.35% 03/18/31	860,000.00	964,576.00	
		IRISH 1.5% 05/15/50	730,000.00	837,076.40	
		IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	969,699.20	
		IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,520,337.20	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,470,972.80	
		IRISH 2% 02/18/45	1,090,000.00	1,384,757.80	
		IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,080,376.30	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,095,001.60	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,854,582.00	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,391,358.20	

		NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,778,365.80	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,290,000.00	1,347,959.70	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,441,243.20	
		NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,262,637.40	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,745,598.60	
		NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,884,521.00	
		NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,885,760.80	
		NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	671,321.00	
		NETHER 0% 01/15/52	980,000.00	857,911.60	
		NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,947,936.00	
		NETHER 0% 07/15/31	830,000.00	835,527.80	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,045,070.40	
		NETHER 2.25% 07/15/22	1,220,000.00	1,262,468.20	
		NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,614,061.80	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,100,000.00	3,346,875.00	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,160,821.60	
		NETHER 3.75% 01/15/23	2,330,000.00	2,506,730.50	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,510,343.00	
		NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,489,002.80	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,418,038.30	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	227,954.00	
		OBL 0% 04/05/24	4,250,000.00	4,337,167.50	
		OBL 0% 04/10/26	4,070,000.00	4,191,367.40	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,847,612.50	
		OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,250,680.40	
		OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,200,684.80	
		OBL 0% 10/10/25	4,340,000.00	4,464,384.40	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,536,651.50	
		OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,572,189.50	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,866,553.50	
		RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	938,006.60	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,736,834.40	
		RAGB 0.75% 03/20/51	790,000.00	806,037.00	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,216,011.20	
		RAGB 0.85% 06/30/20	350,000.00	312,634.00	
		RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,138,429.80	
		RAGB 0% 02/20/31	590,000.00	589,185.80	
		RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	949,827.60	
		RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,521,255.00	
		RAGB 0% 07/15/24	1,350,000.00	1,376,190.00	
		RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	322,915.20	
		RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	382,279.80	

		RAGB 1.2% 10/20/25	1,430,000.00	1,541,640.10	
		RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,129,140.90	
		RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	424,545.00	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,068,091.20	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,408,709.40	
		RAGB 2.1% 09/20/17	780,000.00	1,263,210.00	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,260,000.00	1,618,923.60	
		RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,309,507.60	
		RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,508,208.00	
		RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	967,607.80	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,907,814.00	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,655,643.50	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,669,747.20	
		RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	523,956.60	
		RFGB 0.125% 04/15/52	490,000.00	420,758.10	
		RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	383,772.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	650,392.40	
		RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	917,432.40	
		RFGB 0.5% 09/15/28	1,030,000.00	1,088,843.90	
		RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	800,264.80	
		RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	536,610.00	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	732,676.50	
		RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	548,461.80	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,643.60	
		RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	631,499.40	
		RFGB 1.125% 04/15/34	710,000.00	793,141.00	
		RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	592,738.30	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	677,469.00	
		RFGB 1.625% 09/15/22	930,000.00	959,146.20	
		RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	848,915.60	
		RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	513,294.60	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	787,334.20	
		RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	988,945.00	
		SPGB 0.1% 04/30/31	1,850,000.00	1,781,235.50	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,339,715.90	
		SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,659,574.20	
		SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,412,466.00	
		SPGB 0.45% 10/31/22	3,060,000.00	3,105,900.00	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,937,903.00	
		SPGB 0.6% 10/31/29	3,400,000.00	3,488,570.00	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,101,000.00	
		SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	938,380.80	
		SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,380,691.00	

	SPGB 0% 01/31/26	1,410,000.00	1,424,692.20	
	SPGB 0% 01/31/28	780,000.00	776,552.40	
	SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,404,157.00	
	SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,275,787.80	
	SPGB 1.2% 10/31/40	1,810,000.00	1,820,950.50	
	SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,285,399.00	
	SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,724,723.50	
	SPGB 1.4% 04/30/28	2,120,000.00	2,313,810.40	
	SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,605,283.00	
	SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,950,849.30	
	SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,322,537.60	
	SPGB 1.45% 10/31/71	560,000.00	486,136.00	
	SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,899,577.00	
	SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,286,375.00	
	SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,121,965.00	
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,113,199.00	
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,360,625.80	
	SPGB 1% 10/31/50	2,160,000.00	1,921,212.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,117,835.50	
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,918,337.60	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,400,116.00	
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	3,995,892.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,250,000.00	3,008,587.50	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,940,000.00	2,952,098.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,841,451.20	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,754,317.60	
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	3,019,686.40	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,439,580.80	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,331,764.80	
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,747,760.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,550,000.00	4,241,262.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,889,698.10	
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,100,000.00	3,762,276.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,316,069.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,040,427.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,589,076.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,519,213.50	
ユーロ 小計		783,730,000.00	912,720,686.50 (120,771,201,237)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	3,000,000.00	2,973,900.00	
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,517,802.30	
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,970,148.50	

		UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,199,522.40	
		UKT 0.25% 07/31/31	2,110,000.00	1,978,357.10	
		UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,325,402.20	
		UKT 0.5% 07/22/22	3,150,000.00	3,168,522.00	
		UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,037,039.40	
		UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,729,699.00	
		UKT 0.625% 07/31/35	2,450,000.00	2,284,478.00	
		UKT 0.625% 10/22/50	2,550,000.00	2,122,722.00	
		UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,956,909.20	
		UKT 0.875% 01/31/46	760,000.00	688,088.80	
		UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,725,619.00	
		UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,137,197.70	
		UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,785,944.00	
		UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,120,720.00	
		UKT 1.5% 07/22/47	2,550,000.00	2,656,156.50	
		UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,370,786.00	
		UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,026,860.60	
		UKT 1.625% 10/22/71	900,000.00	1,076,706.00	
		UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,436,461.00	
		UKT 1.75% 07/22/57	2,530,000.00	2,895,964.50	
		UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,191,822.40	
		UKT 1.75% 09/07/37	3,100,000.00	3,362,291.00	
		UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,642,640.00	
		UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,629,400.00	
		UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	2,776,588.80	
		UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,761,280.20	
		UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,917,967.80	
		UKT 3.25% 01/22/44	2,810,000.00	3,893,648.40	
		UKT 3.5% 01/22/45	2,550,000.00	3,697,984.50	
		UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,554,982.80	
		UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,614,544.00	
		UKT 4.25% 03/07/36	2,390,000.00	3,418,656.00	
		UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,839,242.00	
		UKT 4.25% 09/07/39	1,820,000.00	2,736,788.60	
		UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,704,951.30	
		UKT 4.25% 12/07/40	2,070,000.00	3,158,675.10	
		UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,573,434.20	
		UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,573,674.20	
		UKT 4.25% 12/07/55	2,210,000.00	4,058,112.50	
		UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,533,507.20	
		UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,768,921.00	
		UKT 4.75% 12/07/30	1,780,000.00	2,432,120.80	
		UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,596,473.00	

	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,858,748.20	
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,131,722.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,749,287.50	
イギリスポンド 小計		105,270,000.00	126,362,469.70 (19,289,230,999)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,270,000.00	5,144,099.70	
	SGB 0.75% 05/12/28	8,380,000.00	8,731,122.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,724,450.90	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,061,625.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,509,784.70	
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,478,850.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	10,050,000.00	11,125,450.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,860,000.00	8,609,687.80	
	SGB 3.5% 06/01/22	14,000,000.00	14,569,520.00	
スウェーデンクローナ 小計		76,250,000.00	82,954,590.60 (1,086,705,136)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,956,620.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	4,340,000.00	4,352,976.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,886,542.20	
	NGB 1.75% 02/17/27	5,360,000.00	5,563,251.20	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,770,000.00	4,937,808.60	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,640,000.00	7,919,242.00	
	NGB 2% 04/26/28	6,100,000.00	6,435,012.00	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,612,325.40	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,849,366.40	
ノルウェークローネ 小計		55,570,000.00	57,513,144.40 (762,624,294)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	8,020,000.00	8,118,485.60	
	DGB 0.25% 11/15/52	3,340,000.00	3,097,883.40	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	10,955,588.00	
	DGB 0.5% 11/15/29	14,260,000.00	15,006,225.80	
	DGB 0% 11/15/31	3,110,000.00	3,092,304.10	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,808,066.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	8,330,000.00	9,168,247.90	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,260,000.00	28,669,957.20	
デンマーククローネ 小計		71,160,000.00	85,916,758.00 (1,528,459,124)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,500,000.00	1,438,170.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,580,790.40	
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,228,105.80	
	POLGB 1.25% 10/25/30	2,160,000.00	2,079,367.20	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,170,948.30	

	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,102,018.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,050,000.00	6,438,168.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,544,254.60	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	4,086,898.20	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,625,341.90	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,149,375.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,260,000.00	6,922,871.40	
	POLGB 4% 10/25/23	3,430,000.00	3,755,987.20	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	797,430.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,410,000.00	3,678,298.80	
ポーランドズロチ 小計		60,380,000.00	64,598,025.40 (1,876,947,306)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,925,898.00	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,305,789.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	3,640,000.00	3,585,691.20	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,609,795.20	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,151,592.40	
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,090,000.00	1,708,721.30	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,610,000.00	1,607,713.80	
	ACGB 1% 11/21/31	3,750,000.00	3,503,775.00	
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,096,742.40	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,753,689.60	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,264,880.40	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,118,479.30	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,487,943.60	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,718,231.90	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,344,070.20	
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,692,836.80	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,843,280.60	
	ACGB 2.75% 11/21/29	3,150,000.00	3,492,783.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,863,008.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,706,103.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,119,640.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,974,358.80	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,820,666.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,820,000.00	3,313,020.60	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,476,907.10	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,839,100.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,763,125.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,574,550.50	
オーストラリアドル 小計		73,260,000.00	77,662,394.30 (6,635,474,968)	
	SIGB 0.5% 11/01/25	390,000.00	385,772.40	

シンガポールドル	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	818,584.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	420,000.00	422,893.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	784,126.20	
	SIGB 2.25% 08/01/36	730,000.00	769,580.60	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	522,952.50	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	462,688.60	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,145,424.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,439,454.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,029,978.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,121,841.50	
	SIGB 2.875% 07/01/29	590,000.00	657,130.20	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	850,485.60	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	426,117.10	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,350,000.00	1,398,573.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	980,495.60	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	998,993.60	
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,315,038.00	
シンガポールドル 小計		14,300,000.00	15,530,128.70 (1,274,712,963)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,528,650.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	724,521.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,391,069.30	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,566,307.90	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,430,000.00	3,608,291.40	
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,125,174.30	
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	521,400.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,538,580.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	964,400.70	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,370,962.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,082,293.10	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,582,965.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,197,946.90	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,093,420.50	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,538,265.60	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	635,184.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,519,515.60	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,003,189.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	727,791.20	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,351,398.40	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,156,440.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,116,741.90	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,146,466.60	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,610,241.20	

		MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,069,729.30	
		MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,578,775.20	
		MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,467,028.40	
		MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,503,416.30	
		MGS 4.921% 07/06/48	1,400,000.00	1,517,054.00	
		MGS 4.935% 09/30/43	1,560,000.00	1,703,083.20	
	マレーシアリンギット 小計		51,060,000.00	53,940,302.00 (1,430,761,116)	
	イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	699,360.90	
		ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,430,558.46	
		ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,808,960.57	
		ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,072,644.47	
		ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,809,821.28	
		ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,145,305.22	
		ILGOV 1% 03/31/30	2,220,000.00	2,193,258.09	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	2,880,000.00	3,156,523.48	
		ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,491,632.83	
		ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,977,730.44	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,079,063.07	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	5,620,000.00	7,332,544.94	
	イスラエルシェケル 小計		35,400,000.00	40,197,403.75 (1,345,346,807)	
合計				294,306,290,777 (294,306,290,777)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　213銘柄	100.0%	44.1%
カナダドル	国債証券　31銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　338銘柄	100.0%	41.0%
イギリスポンド	国債証券　49銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券　9銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券　9銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券　15銘柄	100.0%	0.6%

オーストラリアドル	国債証券　28銘柄	100.0%	2.3%
シンガポールドル	国債証券　18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　30銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　12銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,882,204,414
コール・ローン	1,318,330,516
株式	492,170,999,091
投資信託受益証券	310,449,285
投資証券	10,950,105,288
派生商品評価勘定	322,384,565
未収入金	27,731,317
未収配当金	553,123,772
差入委託証拠金	3,078,760,313
流動資産合計	513,614,088,561
資産合計	513,614,088,561
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	519,068
前受金	322,316,967
未払解約金	1,083,786,846
未払利息	1,021
流動負債合計	1,406,623,902
負債合計	1,406,623,902
純資産の部	
元本等	
元本	137,665,256,872
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	374,542,207,787
元本等合計	512,207,464,659
純資産合計	512,207,464,659
負債純資産合計	513,614,088,561

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金

	2021年 5月10日現在
	株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 5月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	137,665,256,872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 3.7207円 (1万口当たり純資産額) (37,207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

	2021年 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。

	2021年 5月10日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	152,201,958,636円
期中追加設定元本額	5,111,723,733円
期中一部解約元本額	19,648,425,497円
期末元本額	137,665,256,872円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,025,595,498円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,989,142円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	27,144,706,368円
世界経済インデックスファンド	8,197,835,659円
外国株式インデックス・オープン	822,084,955円
ＤＣマイセレクション２５	836,889,650円
ＤＣマイセレクション５０	4,114,945,534円
ＤＣマイセレクション７５	4,542,390,980円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	10,733,322,573円
ＤＣマイセレクションＳ２５	383,598,122円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,890,840,585円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,416,017,250円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	67,346,708円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	174,648,329円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	124,506,498円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,882,386,055円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,852,474,641円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	6,361,961円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	6,247,966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）	31,737,507円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	26,582,046円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	92,579,914円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	15,436,678円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	48,976,172円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	417,591,535円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	225,520,861円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,613,226,997円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	797,662,679円

区分	2021年 5月10日現在
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	43,460,989円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	225,305,939円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	76,547,469円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,357,336,899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）	1,510,793,254円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,078,640,974円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,326,916,742円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,740,937,338円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,991,958,160円
分散投資コア戦略ファンドＳ	9,758,316,514円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,238,262,063円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,116,664,979円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,119,546,807円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	643,651,254円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,849,509円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	171,693,954円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	746,195,230円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	26,821,979,295円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	155,785,906円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	507,726,433円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	90,169,093円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,146,186円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	94,941,701円
グローバル経済コア	707,955,113円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,674,601円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,875,695円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	704,356,644円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	68,895,460円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	2,059,102円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	2,079,468円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	893,725円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	2,024,530円
ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	627,091,183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）	876,377,720円
外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,437,113,120円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	816,695,870円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	123,681,833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）	5,394,645円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	286,317,818円
ＳＭＴＡＭバランスファンド２００２（適格機関投資家専用）	441,289,364円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	316,266,245円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	305,396,245円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	303,279,781円

区分	2021年 5月10日現在
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	275,209,159円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	128,875,186,471
投資信託受益証券	△21,805,554
投資証券	1,822,970,486
合計	130,676,351,403

(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

（2021年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	8,285,823,213	－	8,608,140,180	322,316,967
合計		8,285,823,213	－	8,608,140,180	322,316,967

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2021年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	199,498,200	－	199,046,730	△451,470
	アメリカドル	199,498,200	－	199,046,730	△451,470
合計		199,498,200	－	199,046,730	△451,470

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	24.63	1,428,047.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	17.39	623,935.81	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	82.65	1,573,160.10	
	CHEVRON CORP	167,685	110.02	18,448,703.70	
	CONOCOPHILLIPS	117,327	57.10	6,699,371.70	
	DEVON ENERGY CORPORATION	57,000	26.22	1,494,540.00	
	EOG RESOURCES INC	51,325	83.10	4,265,107.50	
	EXXON MOBIL	368,497	62.43	23,005,267.71	
	HALLIBURTON CO	77,539	22.95	1,779,520.05	
	HESS CORP	24,844	82.53	2,050,375.32	
	KINDER MORGAN INC	179,427	17.84	3,200,977.68	
	MARATHON PETROLEUM CORP	57,189	60.00	3,431,340.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	27.39	2,166,713.34	
	ONEOK INC	37,709	53.38	2,012,906.42	
	PHILLIPS 66	38,113	86.04	3,279,242.52	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	17,954	167.83	3,013,219.82	
	SCHLUMBERGER	122,666	31.89	3,911,818.74	
	VALERO ENERGY CORP	34,683	80.49	2,791,634.67	
	WILLIAMS COS	104,984	25.30	2,656,095.20	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,118	290.55	5,554,734.90	
	ALBEMARLE CORP	10,180	162.72	1,656,489.60	
	AMCOR PLC	132,975	12.45	1,655,538.75	
	AVERY DENNISON CORP	7,457	221.46	1,651,427.22	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	33.71	593,498.26	
	BALL CORP	27,925	90.70	2,532,797.50	
	CELANESE CORP-SERIES A	9,842	168.63	1,659,656.46	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	55.10	1,050,812.10	
	CORTEVA INC	64,900	48.86	3,171,014.00	

CROWN HOLDINGS INC	11,212	113.54	1,273,010.48	
DOW INC	66,007	69.04	4,557,123.28	
DUPONT DE NEMOURS INC	46,139	82.85	3,822,616.15	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,641	124.97	1,579,745.77	
ECOLAB INC	22,189	228.43	5,068,633.27	
FMC CORP	12,118	120.41	1,459,128.38	
FREEPORT-MCMORAN INC	125,342	43.97	5,511,287.74	
INT'L PAPER CO	33,803	61.64	2,083,616.92	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,145	146.45	2,803,785.25	
LINDE PLC	45,667	298.93	13,651,236.31	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	114.06	2,586,082.38	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	378.28	2,012,827.88	
MOSAIC CO/THE	31,911	37.00	1,180,707.00	
NEWMONT CORPORATION	71,834	67.33	4,836,583.22	
NUCOR CORP	25,565	98.76	2,524,799.40	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	153.16	1,361,592.40	
PPG INDUSTRIES INC	20,538	179.49	3,686,365.62	
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	97.47	1,211,552.10	
SEALED AIR CORP	14,689	57.06	838,154.34	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,206	287.23	6,090,999.38	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	63.36	1,157,777.28	
VULCAN MATERIALS CO	11,347	191.71	2,175,333.37	
WESTROCK CO	24,734	59.74	1,477,609.16	
3 M COMPANY	50,115	203.07	10,176,853.05	
ALLEGION PLC	7,601	141.25	1,073,641.25	
AMETEK INC	19,666	137.33	2,700,731.78	
BOEING CO	46,647	235.47	10,983,969.09	
CARRIER GLOBAL CORP	70,603	44.84	3,165,838.52	
CATERPILLAR	47,231	240.99	11,382,198.69	
CUMMINS INC	12,914	266.39	3,440,160.46	
DEERE&CO	25,864	394.22	10,196,106.08	
DOVER CORP	12,202	152.91	1,865,807.82	
EATON CORP	34,431	147.52	5,079,261.12	
EMERSON ELECTRIC CO	53,460	95.05	5,081,373.00	
FASTENAL CO	51,828	53.25	2,759,841.00	
FORTIVE CORP	25,722	72.82	1,873,076.04	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	111.56	1,429,083.60	
GENERAC HOLDINGS INC	5,800	327.38	1,898,804.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	21,212	194.82	4,132,521.84	
GENERAL ELECTRIC CO	761,269	13.30	10,124,877.70	
GRAINGER (WW) INC	3,846	465.64	1,790,851.44	
HEICO CORP	3,640	141.63	515,533.20	

HEICO CORP-CLASS A	6,449	131.00	844,819.00	
HONEYWELL INTL INC	60,714	228.79	13,890,756.06	
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	33.57	1,226,983.50	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	216.99	764,238.78	
IDEX CORP	6,916	226.00	1,563,016.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	27,403	238.28	6,529,586.84	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	50.53	1,594,827.86	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	66.75	1,341,675.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	63,375	65.70	4,163,737.50	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,086	219.25	3,965,355.50	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	348.00	1,065,576.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,652	390.34	8,451,641.68	
MASCO CORP	23,467	66.86	1,569,003.62	
NORDSON CORP	4,880	208.83	1,019,090.40	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,146	370.63	5,242,931.98	
OTIS WORLDWIDE CORP	37,519	78.19	2,933,610.61	
OWENS CORNING	10,458	106.92	1,118,169.36	
PACCAR INC	30,155	94.50	2,849,647.50	
PARKER HANNIFIN CORP	11,234	319.26	3,586,566.84	
PENTAIR PLC	14,533	67.94	987,372.02	
PLUG POWER INC	41,884	23.05	965,426.20	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	131,986	85.71	11,312,520.06	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,938	270.68	2,690,017.84	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,326	444.46	4,145,033.96	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	58.84	813,639.52	
SMITH (A.O.) CORP	12,146	71.13	863,944.98	
SNAP-ON INC	4,900	251.56	1,232,644.00	
STANLEY BLACK&DECKER	13,718	219.69	3,013,707.42	
SUNRUN INC	11,100	45.64	506,604.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,087	435.99	1,345,901.13	
TEXTRON	21,534	68.08	1,466,034.72	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,642	183.68	3,791,522.56	
TRANSDIGM GROUP INC	4,425	607.99	2,690,355.75	
UNITED RENTALS INC	6,643	347.33	2,307,313.19	
WABTEC CORP	15,024	81.87	1,230,014.88	
XYLEM INC	16,718	119.34	1,995,126.12	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	84.11	955,826.04	
CINTAS CORP	7,572	360.67	2,730,993.24	
COPART INC	18,067	124.56	2,250,425.52	
COSTAR GROUP INC	3,403	850.67	2,894,830.01	
EQUIFAX INC	10,409	239.56	2,493,580.04	
IHS MARKIT LTD	32,602	107.87	3,516,777.74	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	139.95	1,683,038.70	
LEIDOS HOLDINGS	12,829	104.03	1,334,600.87	
REPUBLIC SERVICES INC	20,007	110.88	2,218,376.16	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	90.32	864,001.12	
ROLLINS INC	21,849	37.12	811,034.88	
TRANSUNION	17,091	106.21	1,815,235.11	
VERISK ANALYTICS INC	13,390	178.77	2,393,730.30	
WASTE CONNECTIONS INC	22,454	123.34	2,769,476.36	
WASTE MANAGEMENT INC	37,767	141.38	5,339,498.46	
AMERCO	1,000	620.41	620,410.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	99.51	1,123,666.92	
CSX CORP	65,822	103.13	6,788,222.86	
DELTA AIR LINES INC	14,609	46.11	673,620.99	
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	118.67	1,693,658.24	
FEDEX CORP	21,597	314.69	6,796,359.93	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	178.27	1,257,160.04	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,965	305.22	2,431,077.30	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	49.37	528,259.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,987	289.81	6,372,052.47	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	269.57	2,157,368.71	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	61.66	834,444.78	
UBER TECHNOLOGIES INC	84,980	47.03	3,996,609.40	
UNION PACIFIC CORP	58,466	229.48	13,416,777.68	
UNITED PARCEL SERVICE B	62,170	217.50	13,521,975.00	
XPO LOGISTICS INC	8,001	147.00	1,176,147.00	
APTIV PLC	23,540	148.77	3,502,045.80	
AUTOLIV INC	6,776	103.84	703,619.84	
BORGWARNER INC	23,790	53.80	1,279,902.00	
FORD MOTOR COMPANY	348,612	11.82	4,120,593.84	
GENERAL MOTORS CO	114,044	58.99	6,727,455.56	
LEAR CORP	5,287	195.12	1,031,599.44	
TESLA INC	66,189	672.37	44,503,497.93	
DR HORTON INC	29,632	103.87	3,077,875.84	
GARMIN LTD	12,854	143.56	1,845,320.24	
HASBRO INC	12,468	99.15	1,236,202.20	
LENNAR CORP-CL A	24,928	108.05	2,693,470.40	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,777	330.24	3,558,996.48	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	229.74	1,162,943.88	
NEWELL BRANDS INC	37,563	29.07	1,091,956.41	
NIKE B	109,235	137.81	15,053,675.35	
NVR INC	297	5,211.38	1,547,779.86	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	83.81	1,821,694.16	

PULTE GROUP INC	24,818	61.73	1,532,015.14	
VF CORP	28,638	89.88	2,573,983.44	
WHIRLPOOL CORP	5,220	252.95	1,320,399.00	
AIRBNB INC-CLASS A	4,665	151.21	705,394.65	
ARAMARK	20,955	38.09	798,175.95	
BOOKING HOLDINGS INC	3,556	2,327.08	8,275,096.48	
CARNIVAL CORPORATION	70,520	26.76	1,887,115.20	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,284	1,426.05	3,257,098.20	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,063	142.38	1,717,529.94	
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	432.47	1,609,220.87	
DRAFTKINGS INC - CL A	15,674	48.42	758,935.08	
EXPEDIA GROUP INC	11,638	173.46	2,018,727.48	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,788	123.44	2,936,390.72	
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	57.70	1,694,649.00	
MARRIOTT INTL A	24,361	146.69	3,573,515.09	
MCDONALD'S CORP	64,866	234.84	15,233,131.44	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	18.21	321,625.02	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,847	39.92	1,630,612.24	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,923	84.29	1,426,439.67	
STARBUCKS CORP	102,054	114.34	11,668,854.36	
VAIL RESORTS INC	3,574	312.80	1,117,947.20	
WYNN RESORTS LTD	9,302	126.29	1,174,749.58	
YUM BRANDS INC	25,844	121.23	3,133,068.12	
ACTIVISION BLIZZARD INC	66,954	94.80	6,347,239.20	
ALPHABET INC-CL A	26,249	2,351.93	61,735,810.57	
ALPHABET INC-CL C	25,920	2,398.69	62,174,044.80	
ALTICE USA INC- A	22,505	37.14	835,835.70	
CABLE ONE INC	445	1,756.23	781,522.35	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	12,405	693.44	8,602,123.20	
COMCAST CORP-CL A	397,973	58.11	23,126,211.03	
DISCOVERY INC - A	12,804	37.56	480,918.24	
DISCOVERY INC-C	28,190	32.62	919,557.80	
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	46.53	1,121,512.59	
ELECTRONIC ARTS INC	24,944	142.42	3,552,524.48	
FACEBOOK INC-A	209,903	319.08	66,975,849.24	
FOX CORP - CLASS A	27,658	38.32	1,059,854.56	
FOX CORP- CLASS B	15,092	37.17	560,969.64	
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	241.40	1,622,449.40	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	33.47	1,132,423.98	
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	161.65	416,895.35	
LIBERTY BROADBAND-C	13,516	166.37	2,248,656.92	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	44.25	827,165.25	

LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	42.85	739,762.40	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	42.61	272,022.24	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	79.96	1,112,083.68	
MATCH GROUP INC	21,851	146.19	3,194,397.69	
NETFLIX INC	38,504	503.84	19,399,855.36	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	27.44	918,663.76	
OMNICOM GROUP	18,031	84.96	1,531,913.76	
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	59.86	2,739,612.62	
ROKU INC	9,741	317.00	3,087,897.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.04	601,269.92	
SNAP INC - A	81,742	54.70	4,471,287.40	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,738	170.07	1,656,141.66	
THE WALT DISNEY CO	157,918	184.84	29,189,563.12	
TWITTER INC	70,140	53.79	3,772,830.60	
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	39.39	1,913,802.54	
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	119.40	656,341.80	
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	118.54	1,591,703.71	
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	204.47	1,264,851.42	
AMAZON.COM	37,255	3,291.61	122,628,930.55	
AUTOZONE INC	1,986	1,507.20	2,993,299.20	
BEST BUY COMPANY INC	19,870	122.34	2,430,895.80	
BURLINGTON STORES INC	5,808	331.01	1,922,506.08	
CARMAX INC	13,891	129.99	1,805,691.09	
CARVANA CO	5,700	247.81	1,412,517.00	
CHEWY INC - CLASS A	6,878	71.00	488,338.00	
DOLLAR GENERAL CORP	21,836	220.20	4,808,287.20	
DOLLAR TREE INC	20,151	116.25	2,342,553.75	
EBAY	59,339	59.78	3,547,285.42	
ETSY INC	11,000	165.51	1,820,610.00	
GENUINE PARTS CO	12,119	133.46	1,617,401.74	
HOME DEPOT	93,905	339.25	31,857,271.25	
LKQ CORP	26,705	49.78	1,329,374.90	
LOWES COMPANIES	63,738	208.40	13,282,999.20	
MERCADOLIBRE INC	3,877	1,481.26	5,742,845.02	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,541	562.32	3,678,135.12	
POOL CORP	3,700	444.01	1,642,837.00	
ROSS STORES INC	31,643	132.96	4,207,253.28	
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,484	214.71	9,336,449.64	
TJX COMPANIES INC	106,288	73.78	7,841,928.64	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,932	195.46	1,941,308.72	
ULTA BEAUTY INC	4,520	322.74	1,458,784.80	
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	305.49	1,832,940.00	

COSTCO WHOLESALE CORP	38,401	384.32	14,758,272.32	
KROGER CO	66,103	37.73	2,494,066.19	
SYSCO CORP	41,867	86.26	3,611,447.42	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,310	54.53	3,452,294.30	
WALMART INC	123,412	140.20	17,302,362.40	
ALTRIA GROUP INC	161,290	49.95	8,056,435.50	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,339	67.02	3,239,679.78	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	76.68	2,010,549.60	
BUNGE LIMITED	13,606	91.32	1,242,499.92	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	49.55	786,308.95	
COCA-COLA CO	355,696	54.51	19,388,988.96	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	19,221	56.81	1,091,945.01	
CONAGRA BRANDS INC	41,157	37.95	1,561,908.15	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,911	240.92	3,592,358.12	
GENERAL MILLS INC	53,282	63.05	3,359,430.10	
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,532	168.49	2,111,516.68	
HORMEL FOODS CORP	27,157	47.14	1,280,180.98	
JM SMUCKER CO	10,802	136.60	1,475,553.20	
KELLOGG CO	24,092	66.95	1,612,959.40	
KEURIG DR PEPPER INC	52,280	36.60	1,913,448.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	57,338	43.48	2,493,056.24	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	78.97	1,020,608.28	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	89.33	1,883,791.04	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	59.51	1,083,260.53	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	126,700	61.85	7,836,395.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,258	91.25	3,126,042.50	
PEPSICO INC	120,371	145.56	17,521,202.76	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	135,448	97.41	13,193,989.68	
TYSON FOODS INC	25,074	78.82	1,976,332.68	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	87.43	1,840,838.65	
CLOROX COMPANY	10,830	183.01	1,981,998.30	
COLGATE-PALMOLIVE CO	70,441	82.18	5,788,841.38	
ESTEE LAUDER CO-CL A	20,159	303.35	6,115,232.65	
KIMBERLY-CLARK CORP	30,423	135.50	4,122,316.50	
PROCTER & GAMBLE CO	216,277	135.15	29,229,836.55	
ABBOTT LABORATORIES	154,411	118.95	18,367,188.45	
ABIOMED INC	3,781	296.81	1,122,238.61	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,653	598.34	3,980,756.02	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	120.86	1,558,610.56	
ANTHEM INC	22,016	396.57	8,730,885.12	
BAXTER INTERNATIONAL	44,024	86.62	3,813,358.88	
BECTON DICKINSON & CO	25,112	239.39	6,011,561.68	

BOSTON SCIENTIFIC CORP	123,665	43.13	5,333,671.45	
CARDINAL HEALTH	24,692	58.16	1,436,086.72	
CENTENE CORP	51,303	70.45	3,614,296.35	
CERNER CORP	27,382	76.68	2,099,651.76	
CIGNA CORP	31,982	261.18	8,353,058.76	
CVS HEALTH CORP	113,622	85.11	9,670,368.42	
DANAHER CORP	55,620	258.48	14,376,657.60	
DAVITA INC	7,259	126.80	920,441.20	
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	68.47	1,382,272.36	
DEXCOM INC	8,405	358.74	3,015,209.70	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	55,706	92.17	5,134,422.02	
HCA HEALTHCARE INC	24,127	210.52	5,079,216.04	
HENRY SCHEIN INC	14,096	80.61	1,136,278.56	
HOLOGIC INC	21,687	65.63	1,423,317.81	
HUMANA INC	11,427	465.08	5,314,469.16	
IDEXX LABORATORIES INC	7,438	544.26	4,048,205.88	
INSULET CORP	5,923	234.19	1,387,107.37	
INTUITIVE SURGICAL INC	10,199	857.09	8,741,460.91	
LABORATORY CRP OF AMER	8,285	278.14	2,304,389.90	
MASIMO CORP	4,835	224.16	1,083,813.60	
MCKESSON CORP	13,893	197.61	2,745,395.73	
MEDTRONIC PLC	117,112	126.70	14,838,090.40	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	267.84	1,323,129.60	
NOVOCURE LTD	7,933	192.45	1,526,705.85	
QUEST DIAGNOSTICS	11,335	138.95	1,574,998.25	
RESMED INC	12,370	195.16	2,414,129.20	
STERIS PLC	7,163	211.50	1,514,974.50	
STRYKER CORP	29,983	254.78	7,639,068.74	
TELADOC HEALTH INC	10,065	151.04	1,520,217.60	
TELEFLEX INC	3,934	412.55	1,622,971.70	
THE COOPER COS INC	4,556	404.34	1,842,173.04	
UNITEDHEALTH GROUP INC	82,765	417.65	34,566,802.25	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	155.19	1,124,817.12	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,775	259.96	3,061,029.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,317	333.68	2,107,856.56	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,277	172.49	3,152,599.73	
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	146.36	827,665.80	
ABBVIE INC	153,747	115.75	17,796,215.25	
AGILENT TECHNOLOGIES	27,421	133.90	3,671,671.90	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,936	170.43	3,227,262.48	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	131.30	1,400,314.50	
AMGEN	50,649	254.21	12,875,482.29	

AVANTOR INC	47,985	31.22	1,498,091.70	
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	608.01	1,301,749.41	
BIOGEN INC	13,488	274.04	3,696,251.52	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	77.77	1,335,388.67	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	196,574	64.44	12,667,228.56	
CATALENT INC	15,232	107.56	1,638,353.92	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	32.88	1,185,685.68	
EXACT SCIENCES CORP	14,756	104.50	1,542,002.00	
GILEAD SCIENCES INC	111,105	66.54	7,392,926.70	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	20,300	87.93	1,784,979.00	
ILLUMINA INC	12,945	383.94	4,970,103.30	
INCYTE CORP	17,504	82.74	1,448,280.96	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	36.54	468,333.18	
IQVIA HOLDINGS INC	16,726	234.39	3,920,407.14	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	174.59	867,886.89	
JOHNSON & JOHNSON	229,713	168.50	38,706,640.50	
LILLY (ELI) & CO	74,927	195.42	14,642,234.34	
MERCK & CO	220,359	78.41	17,278,349.19	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,051	1,278.56	2,622,326.56	
MODERNA INC	25,034	163.15	4,084,297.10	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	91.04	771,472.96	
PERKINELMER INC	10,645	140.97	1,500,625.65	
PFIZER	484,175	39.58	19,163,646.50	
PPD INC	11,027	46.10	508,344.70	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,176	496.75	4,558,178.00	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	40.97	636,427.98	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	74.57	532,951.79	
SEAGEN INC	11,471	139.49	1,600,089.79	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	10.40	836,170.40	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,513	468.45	16,167,614.85	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,458	215.01	4,828,694.58	
VIATRIS INC	114,289	14.08	1,609,189.12	
WATERS CORP	5,228	314.65	1,644,990.20	
ZOETIS INC	42,095	171.55	7,221,397.25	
BANK OF AMERICA CORP	678,967	42.18	28,638,828.06	
CITIGROUP	181,157	75.08	13,601,267.56	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	49.44	1,781,867.04	
FIFTH THIRD BANCORP	61,361	42.35	2,598,638.35	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	187.87	2,981,872.64	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,482	15.80	1,350,615.60	
JPMORGAN CHASE & CO	266,016	161.24	42,892,419.84	
KEY CORP	83,212	23.07	1,919,700.84	

M & T BANK CORP	11,721	163.15	1,912,281.15	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,707	198.91	7,301,389.37	
REGIONS FINL CORP	81,824	22.89	1,872,951.36	
SVB FINANCIAL GROUP	4,393	587.98	2,582,996.14	
TRUIST FINANCIAL CORP	119,435	61.57	7,353,612.95	
US BANCORP	117,465	61.37	7,208,827.05	
WELLS FARGO & CO	341,799	46.54	15,907,325.46	
ALLY FINANCIAL INC	31,445	54.10	1,701,174.50	
AMERICAN EXPRESS	59,420	158.98	9,446,591.60	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,185	265.65	2,705,645.25	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	58.22	882,207.66	
BANK NEW YORK CO	68,501	51.82	3,549,721.82	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	119,592	290.93	34,792,900.56	
BLACKROCK INC	13,255	873.83	11,582,616.65	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,302	157.71	6,356,028.42	
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	44.98	566,523.10	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	108.10	959,387.50	
CME GROUP INC	31,096	202.92	6,310,000.32	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,704	119.46	3,309,519.84	
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	35.01	1,148,853.15	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	337.05	1,224,502.65	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	34.10	888,987.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,388	370.89	10,528,825.32	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,552	114.81	5,574,255.12	
INVESCO LTD	35,765	28.38	1,015,010.70	
KKR & CO INC	43,643	58.72	2,562,716.96	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	437.17	1,402,004.19	
MOODY'S CORP	14,787	334.50	4,946,251.50	
MORGAN STANLEY	122,211	87.70	10,717,904.70	
MSCI INC	7,235	482.31	3,489,512.85	
NASDAQ INC	9,657	164.56	1,589,155.92	
NORTHERN TRUST CORP	17,625	119.28	2,102,310.00	
PRICE T ROWE GROUP INC	20,087	189.23	3,801,063.01	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,324	136.64	1,410,671.36	
S&P GLOBAL INC	21,321	390.71	8,330,327.91	
SCHWAB (CHARLES) CORP	132,850	71.75	9,531,987.50	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	63.27	775,753.47	
STATE STREET CORP	31,754	87.23	2,769,901.42	
SYNCHRONY FINANCIAL	46,378	45.90	2,128,750.20	
THE BLACKSTONE GROUP INC	58,748	90.04	5,289,669.92	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	82.53	747,804.33	
VOYA FINANCIAL INC	12,505	70.00	875,350.00	

AFLAC	58,037	56.11	3,256,456.07	
ALLEGHANY CORP	1,276	729.80	931,224.80	
ALLSTATE CORP	26,425	132.26	3,494,970.50	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	128.70	813,255.30	
AMERICAN INT'L GROUP	75,227	51.19	3,850,870.13	
AON PLC	20,358	258.52	5,262,950.16	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	40.79	1,388,124.49	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	151.16	2,472,826.44	
ASSURANT INC	5,819	160.71	935,171.49	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	63.05	643,551.35	
BROWN & BROWN INC	22,945	53.69	1,231,917.05	
CHUBB LTD	39,962	176.39	7,048,897.18	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	120.35	1,539,396.85	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	210.33	455,574.78	
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	273.10	1,072,190.60	
FNF GROUP	24,961	46.19	1,152,948.59	
GLOBE LIFE INC	8,106	105.99	859,154.94	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,371	66.65	2,024,227.15	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	69.30	1,134,025.20	
LOEWS CORP	23,338	58.44	1,363,872.72	
MARKEL CORP	1,156	1,220.37	1,410,747.72	
MARSH & MCLENNAN COS	44,622	137.97	6,156,497.34	
METLIFE INC	68,534	67.16	4,602,743.44	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	66.66	1,537,979.52	
PROGRESSIVE CORP	50,582	105.18	5,320,214.76	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,851	105.95	3,692,463.45	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	126.26	839,881.52	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	164.88	801,976.32	
TRAVELERS COS INC/THE	22,437	160.81	3,608,093.97	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,021	270.07	2,976,441.47	
WR BERKLEY CORP	11,715	81.45	954,186.75	
CBRE GROUP INC-A	30,111	86.90	2,616,645.90	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.86	479,682.00	
WEYERHAEUSER CO	63,665	40.00	2,546,600.00	
ACCENTURE PLC-CL A	55,165	291.53	16,082,252.45	
ADOBE INC	41,807	488.73	20,432,335.11	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	13,673	110.81	1,515,105.13	
ANSYS INC	7,474	332.38	2,484,208.12	
AUTODESK INC	18,964	285.76	5,419,152.64	
AUTOMATIC DATA PROCESS	37,957	194.89	7,397,439.73	
AVALARA INC	7,698	125.63	967,099.74	
BLACK KNIGHT INC	14,413	75.15	1,083,136.95	

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	164.20	1,599,636.40	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,740	129.05	3,192,697.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	12,296	87.40	1,074,670.40	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	119.87	1,256,956.82	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	121.03	1,264,037.32	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,762	71.62	1,272,114.44	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,007	74.81	3,442,013.70	
COUPA SOFTWARE INC	6,059	237.84	1,441,072.56	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,694	189.18	2,968,990.92	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	120.23	372,713.00	
DATADOG INC - CLASS A	15,807	77.29	1,221,723.03	
DOCUSIGN INC	15,540	195.28	3,034,651.20	
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	24.70	712,471.50	
DYNATRACE INC	17,890	46.78	836,894.20	
EPAM SYSTEMS INC	4,753	460.20	2,187,330.60	
FAIR ISAAC CORP	2,615	496.17	1,297,484.55	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	53,834	151.59	8,160,696.06	
FISERV INC	49,334	117.65	5,804,145.10	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,154	285.66	2,043,611.64	
FORTINET INC	12,295	211.77	2,603,712.15	
GARTNER INC	7,500	234.00	1,755,000.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	26,387	201.41	5,314,605.67	
GODADDY INC - CLASS A	15,914	81.06	1,289,988.84	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	98.70	782,000.10	
HUBSPOT INC	4,000	509.66	2,038,640.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,449	145.46	11,265,731.54	
INTUIT INC	22,819	401.04	9,151,331.76	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	156.13	1,149,116.80	
MASTERCARD INC-CLASS A	77,591	375.40	29,127,661.40	
MICROSOFT CORP	627,464	252.46	158,409,561.44	
MONGODB INC	4,623	260.32	1,203,459.36	
NORTONLIFELOCK INC	50,376	21.09	1,062,681.72	
OKTA INC	10,230	237.27	2,427,272.10	
ORACLE CORP	170,258	80.40	13,688,743.20	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,311	342.34	2,845,187.74	
PAYCHEX INC	27,703	101.01	2,798,280.03	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	327.58	1,387,301.30	
PAYPAL HOLDINGS INC	97,048	253.36	24,588,081.28	
PTC INC	9,984	131.16	1,309,501.44	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	257.04	1,643,256.72	
SALESFORCE.COM INC	79,266	216.50	17,161,089.00	
SERVICENOW INC	16,939	483.51	8,190,175.89	

SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	41,035	41.23	1,691,873.05	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,960	206.04	403,838.40	
SPLUNK INC	14,752	117.82	1,738,080.64	
SQUARE INC - A	33,292	233.35	7,768,688.20	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	73.35	1,418,222.25	
SYNOPSYS INC	13,492	241.84	3,262,905.28	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3,578	661.43	2,366,596.54	
TWILIO INC - A	12,576	307.15	3,862,718.40	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	399.87	1,484,717.31	
VERISIGN INC	8,760	222.89	1,952,516.40	
VISA INC-CLASS A SHARES	147,639	232.12	34,269,964.68	
VMWARE INC-CLASS A	7,867	163.41	1,285,546.47	
WESTERN UNION CO	38,757	25.11	973,188.27	
WIX.COM LTD	5,010	288.79	1,446,837.90	
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	236.71	3,670,188.55	
ZENDESK INC	10,500	135.67	1,424,535.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,843	295.24	4,972,727.32	
ZSCALER INC	6,234	169.32	1,055,540.88	
AMPHENOL CORPORATION	51,451	68.11	3,504,327.61	
APPLE INC	1,485,374	130.21	193,410,548.54	
ARISTA NETWORKS INC	5,179	328.52	1,701,405.08	
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	117.50	716,750.00	
CDW CORP/DE	11,982	174.87	2,095,292.34	
CISCO SYSTEMS	368,180	53.43	19,671,857.40	
COGNEX CORP	16,230	77.58	1,259,123.40	
CORNING	64,989	46.00	2,989,494.00	
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	101.06	2,175,821.80	
F5 NETWORKS INC	5,350	184.28	985,898.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	16.48	1,798,775.52	
HP INC	118,260	35.57	4,206,508.20	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	197.30	632,741.10	
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	27.20	851,468.80	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,004	143.41	2,295,133.64	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,918	199.07	2,969,726.26	
NETAPP INC	20,586	79.52	1,636,998.72	
SEAGATE TECHNOLOGY	21,474	91.56	1,966,159.44	
TE CONNECTIVITY LTD	29,387	138.00	4,055,406.00	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	79.33	1,679,892.08	
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	71.65	1,847,853.50	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,612	488.58	2,253,330.96	
AT&T INC	620,884	32.16	19,967,629.44	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	27.72	430,103.52	

LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	27.80	936,304.00	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	86,131	13.99	1,204,972.69	
T-MOBILE US INC	48,374	139.12	6,729,790.88	
VERIZON COMMUNICATIONS	360,661	58.72	21,178,013.92	
AES CORP	61,761	25.79	1,592,816.19	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	56.74	1,178,943.72	
AMEREN CORPORATION	20,898	84.98	1,775,912.04	
AMERICAN ELECTRIC POWER	44,128	87.19	3,847,520.32	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,464	152.77	2,362,435.28	
ATMOS ENERGY CORP	11,419	103.00	1,176,157.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	24.49	1,179,487.38	
CMS ENERGY CORP	26,742	63.99	1,711,220.58	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	78.09	2,244,697.05	
DOMINION ENERGY INC	71,961	78.45	5,645,340.45	
DTE ENERGY COMPANY	16,240	141.69	2,301,045.60	
DUKE ENERGY CORP	63,724	100.86	6,427,202.64	
EDISON INTL	32,117	58.58	1,881,413.86	
ENTERGY CORP	16,926	108.31	1,833,255.06	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	46.64	971,697.76	
EVERGY INC	21,330	63.82	1,361,280.60	
EVERSOURCE ENERGY	29,303	84.07	2,463,503.21	
EXELON CORP	86,723	44.68	3,874,783.64	
FIRSTENERGY CORP	50,559	37.52	1,896,973.68	
NEXTERA ENERGY INC	170,459	74.53	12,704,309.27	
NISOURCE INC	35,781	25.98	929,590.38	
NRG ENERGY INC	23,078	34.76	802,191.28	
OGE ENERGY CORP	19,225	33.93	652,304.25	
PG&E CORP	135,327	10.94	1,480,477.38	
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	86.12	927,684.64	
PPL CORPORATION	69,904	29.25	2,044,692.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,258	63.15	2,731,742.70	
SEMPRA ENERGY	25,041	137.82	3,451,150.62	
SOUTHERN CO	91,389	66.26	6,055,435.14	
UGI CORP	18,019	45.62	822,026.78	
VISTRA CORP	37,797	16.05	606,641.85	
WEC ENERGY GROUP INC	26,821	97.64	2,618,802.44	
XCEL ENERGY INC	46,423	71.32	3,310,888.36	
ADVANCED MICRO DEVICES	104,401	78.81	8,227,842.81	
ANALOG DEVICES	31,938	157.26	5,022,569.88	
APPLIED MATERIALS	79,412	132.95	10,557,825.40	
BROADCOM INC	35,233	452.58	15,945,751.14	
ENPHASE ENERGY INC	11,000	122.96	1,352,560.00	

	INTEL CORP	357,270	57.67	20,603,760.90	
	KLA CORP	13,649	319.70	4,363,585.30	
	LAM RESEARCH CORP	12,499	630.54	7,881,119.46	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,440	45.96	3,237,422.40	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,641	96.58	2,186,667.78	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,404	149.75	3,354,999.00	
	MICRON TECHNOLOGY	96,673	85.98	8,311,944.54	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,953	342.79	1,355,048.87	
	NVIDIA CORP	53,994	592.49	31,990,905.06	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	24,180	197.92	4,785,705.60	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	38.63	1,390,525.48	
	QORVO INC	9,678	184.18	1,782,494.04	
	QUALCOMM	98,431	137.85	13,568,713.35	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,359	175.12	2,514,548.08	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	220.40	1,013,840.00	
	TERADYNE INC	14,398	128.17	1,845,391.66	
	TEXAS INSTRUMENTS	79,929	187.76	15,007,469.04	
	XILINX INC	20,982	124.43	2,610,790.26	
アメリカドル 小計		27,462,914		3,239,572,201.28 (352,368,268,333)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	24.44	656,947.20	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	102,786	41.70	4,286,176.20	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	9.57	925,093.62	
	ENBRIDGE	173,165	48.09	8,327,504.85	
	IMPERIAL OIL	24,763	38.09	943,222.67	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	17.94	636,062.70	
	KEYERA CORP	18,607	28.89	537,556.23	
	PARKLAND CORP	14,075	39.82	560,466.50	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	38.06	1,738,047.96	
	SUNCOR ENERGY	132,181	28.66	3,788,307.46	
	TC ENERGY CORP	82,366	61.94	5,101,750.04	
	AGNICO EAGLE MINES	20,293	83.93	1,703,191.49	
	B2GOLD CORP	90,243	6.28	566,726.04	
	BARRICK GOLD CORP	160,886	29.02	4,668,911.72	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	71.41	938,255.99	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,000	33.70	1,853,500.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	16,953	179.58	3,044,419.74	
	KINROSS GOLD CORP	125,340	9.39	1,176,942.60	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	49.60	1,162,028.80	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	14.84	923,686.12	
	NUTRIEN LTD	48,966	74.54	3,649,925.64	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	42.50	782,467.50	

SSR MINING INC	21,000	21.07	442,470.00	
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	31.09	1,420,097.93	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	104.96	818,688.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	53.16	2,101,308.48	
YAMANA GOLD INC	81,672	6.16	503,099.52	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	18.69	368,641.56	
CAE INC	25,999	38.07	989,781.93	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	105.30	811,336.50	
WSP GLOBAL INC	10,656	127.83	1,362,156.48	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	17,694	39.65	701,567.10	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	81.42	834,147.90	
THOMSON REUTERS CORP	16,323	118.04	1,926,766.92	
AIR CANADA	13,805	24.92	344,020.60	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,870	136.42	8,303,885.40	
CP RAILWAY LIMITED	12,047	483.02	5,818,941.94	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	119.52	2,782,664.64	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,923	44.47	930,445.81	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	84.38	1,946,899.74	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	34.12	518,624.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	35.92	1,272,358.24	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	199.44	1,078,770.96	
DOLLARAMA INC	26,700	54.10	1,444,470.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	74,153	41.86	3,104,044.58	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	39.91	608,747.23	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	70.61	911,786.93	
METRO INC	18,840	57.52	1,083,676.80	
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	111.73	769,037.59	
SAPUTO INC	24,489	39.70	972,213.30	
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	34.08	947,424.00	
CANOPY GROWTH CORP	20,989	30.68	643,942.52	
BANK MONTREAL	57,280	117.84	6,749,875.20	
BANK NOVA SCOTIA	107,218	79.43	8,516,325.74	
CANADIAN IMPERIAL BANK	38,790	130.70	5,069,853.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	90.88	2,480,024.32	
ROYAL BANK OF CANADA	122,804	120.26	14,768,409.04	
TORONTO-DOMINION BANK	156,322	86.10	13,459,324.20	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	114,488	56.33	6,449,109.04	
IGM FINANCIAL INC	7,685	44.79	344,211.15	
ONEX CORP	6,603	84.91	560,660.73	
TMX GROUP LTD	4,685	134.91	632,053.35	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	575.50	1,227,541.50	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	36.26	862,552.88	

	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	70.83	715,312.17	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	164.94	2,151,312.42	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	25.85	4,214,997.60	
	POWER CORP OF CANADA	51,551	36.69	1,891,406.19	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	50,702	66.20	3,356,472.40	
	FIRSTSERVICE CORP	3,690	198.36	731,948.40	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	10.28	405,032.00	
	CGI INC - CL A	18,428	110.56	2,037,399.68	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	1,802.86	2,994,550.46	
	OPEN TEXT CORP	24,643	58.17	1,433,483.31	
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,494	1,345.36	12,772,847.84	
	BCE INC	15,355	59.11	907,634.05	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	33,271	61.64	2,050,824.44	
	TELUS CORP	32,908	26.29	865,151.32	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.29	999,569.22	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	23.99	585,236.05	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	42.47	222,585.27	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	48.44	547,129.80	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.94	360,720.56	
	EMERA INC	23,704	56.12	1,330,268.48	
	FORTIS INC	42,633	54.97	2,343,536.01	
	HYDRO ONE LTD	32,299	29.81	962,833.19	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	39.24	700,590.96	
カナダドル 小計		3,485,535		199,433,989.64 (17,895,211,890)	
ユーロ	ENI	218,529	10.32	2,255,219.28	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	10.14	499,073.13	
	NESTE OIL OYJ	37,233	51.72	1,925,690.76	
	OMV AG	14,984	44.16	661,693.44	
	REPSOL SA	127,332	10.80	1,375,440.26	
	TENARIS SA	40,648	9.54	387,863.21	
	TOTAL SE	217,070	39.05	8,476,583.50	
	VOPAK	6,360	37.89	240,980.40	
	AIR LIQUIDE	40,492	143.28	5,801,693.76	
	AKZO NOBEL	15,301	103.45	1,582,888.45	
	ARCELORMITTAL	66,229	26.99	1,787,520.71	
	ARKEMA	5,949	108.20	643,681.80	
	BASF SE	78,752	70.38	5,542,565.76	
	COVESTRO AG	17,254	58.02	1,001,077.08	
	CRH PLC	64,773	41.94	2,716,579.62	
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	30.04	593,410.16	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	43.92	253,067.04	

HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	74.60	972,858.60	
KONINKLIJKE DSM NV	14,947	152.25	2,275,680.75	
LANXESS	7,293	64.44	469,960.92	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	23,039	44.02	1,014,176.78	
SOLVAY SA	6,906	112.45	776,579.70	
STORA ENSO OYJ R	54,792	16.03	878,315.76	
SYMRISE AG	11,456	107.20	1,228,083.20	
UMICORE	17,605	51.48	906,305.40	
UPM KYMMENE OYJ	45,603	33.07	1,508,091.21	
VOESTALPINE AG	7,152	38.10	272,491.20	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	23,765	28.37	674,213.05	
AIRBUS SE	50,151	98.37	4,933,353.87	
ALSTOM	24,388	46.66	1,137,944.08	
BOUYGUES ORD	21,446	35.07	752,111.22	
BRENNTAG SE	12,514	76.20	953,566.80	
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	13.72	1,276,781.85	
DASSAULT AVIATION SA	213	966.50	205,864.50	
EIFFAGE	7,964	94.34	751,323.76	
FERROVIAL SA	47,178	24.97	1,178,034.66	
GEA GROUP AG	13,382	36.43	487,506.26	
HOCHTIEF AG	2,222	75.60	167,983.20	
KINGSPAN GROUP PLC	14,482	76.46	1,107,293.72	
KION GROUP AG	5,887	84.10	495,096.70	
KNORR-BREMSE AG	6,822	104.25	711,193.50	
KONE OYJ-B	29,051	68.10	1,978,373.10	
LEGRAND SA	21,768	85.76	1,866,823.68	
MTU AERO ENGINES AG	4,753	212.40	1,009,537.20	
PRYSMIAN SPA	21,155	26.45	559,549.75	
RATIONAL AG	483	774.40	374,035.20	
SAFRAN SA	28,410	125.20	3,556,932.00	
SAINT-GOBAIN	43,973	56.38	2,479,197.74	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	47,768	134.96	6,446,769.28	
SIEMENS	66,090	144.28	9,535,465.20	
SIEMENS ENERGY AG	36,181	26.23	949,027.63	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	27.70	621,449.50	
THALES SA	9,665	86.04	831,576.60	
VINCI S.A.	44,183	95.69	4,227,871.27	
WARTSILA OYJ	41,917	10.71	448,931.07	
BUREAU VERITAS SA	25,073	25.13	630,084.49	
RANDSTAD NV	11,218	61.80	693,272.40	
TELEPERFORMANCE	4,734	322.70	1,527,661.80	
WOLTERS KLUWER	22,949	79.00	1,812,971.00	

ADP	2,382	115.55	275,240.10	
AENA SME SA	6,542	150.30	983,262.60	
ATLANTIA SPA	46,597	16.29	759,065.13	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	11.23	261,530.73	
DEUTSCHE POST AG-REG	88,114	51.00	4,493,814.00	
GETLINK	44,101	13.69	603,963.19	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,684	83.64	2,399,129.76	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	69.25	345,626.75	
CONTINENTAL AG	9,928	114.62	1,137,947.36	
DAIMLER AG	73,367	73.41	5,385,871.47	
FAURECIA	10,948	44.80	490,470.40	
FERRARI NV	10,170	165.50	1,683,135.00	
MICHELIN	13,839	123.70	1,711,884.30	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	87.50	1,227,450.00	
RENAULT SA	17,362	34.15	592,912.30	
STELLANTIS NV	183,437	14.94	2,740,915.65	
VALEO SA	21,538	27.74	597,464.12	
VOLKSWAGEN AG-PFD	16,304	210.75	3,436,068.00	
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	261.40	649,840.40	
ADIDAS AG	16,242	280.60	4,557,505.20	
ESSILORLUXOTTICA	25,177	140.70	3,542,403.90	
HERMES INTERNATIONAL	2,731	1,073.00	2,930,363.00	
KERING	6,743	695.10	4,687,059.30	
LVMH	24,043	631.40	15,180,750.20	
MONCLER SPA	18,219	51.26	933,905.94	
PUMA SE	9,220	89.82	828,140.40	
SEB SA	2,282	154.40	352,340.80	
ACCOR	17,931	33.47	600,150.57	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	168.65	2,448,460.70	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	43.02	348,806.16	
SODEXO	8,135	86.24	701,562.40	
BOLLORE	83,646	4.26	356,331.96	
PUBLICIS GROUPE	17,077	55.84	953,579.68	
SCOUT24 AG	9,470	70.38	666,498.60	
SES	31,369	6.71	210,611.46	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	62.82	444,200.22	
VIVENDI	71,967	29.82	2,146,055.94	
DELIVERY HERO SE	12,154	125.25	1,522,288.50	
HELLOFRESH SE	13,805	65.48	903,951.40	
INDITEX	95,060	30.78	2,925,946.80	
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	81.86	930,911.92	
PROSUS	43,038	89.74	3,862,230.12	

ZALANDO SE	13,985	86.68	1,212,219.80	
CARREFOUR	59,235	16.52	978,562.20	
COLRUYT SA	5,424	49.75	269,844.00	
JERONIMO MARTINS	24,901	15.49	385,716.49	
KESKO OYJ-B SHS	25,583	26.00	665,158.00	
KONINKLIJKE AHOLD NV	95,504	23.05	2,201,844.72	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,788	61.28	3,908,928.64	
DANONE (GROUPE)	54,643	59.16	3,232,679.88	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	10.28	504,511.56	
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	84.75	906,909.75	
HEINEKEN NV	22,407	99.44	2,228,152.08	
JDE PEET'S BV	7,000	32.50	227,500.00	
KERRY GROUP PLC-A	14,641	109.50	1,603,189.50	
PERNOD-RICARD	18,224	174.15	3,173,709.60	
REMY COINTREAU	2,382	166.00	395,412.00	
BEIERSDORF AG	9,190	96.06	882,791.40	
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	83.00	845,770.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	95.92	1,384,988.88	
LOREAL	21,631	349.90	7,568,686.90	
AMPLIFON SPA	11,650	35.83	417,419.50	
BIOMERIEUX	4,175	96.94	404,724.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	145.05	497,521.50	
DIASORIN SPA	2,070	140.80	291,456.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	64.64	1,291,830.40	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	41.66	1,403,652.18	
KONINKLIJKE PHILIPS	81,047	48.07	3,895,929.29	
ORPEA	4,336	106.50	461,784.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	448.10	1,454,532.60	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,546	48.79	1,197,599.34	
ARGENX SE	4,178	219.10	915,399.80	
BAYER	83,832	54.13	4,537,826.16	
EUROFINS SCIENTIFIC	12,420	82.63	1,026,264.60	
GALAPAGOS NV	4,368	63.14	275,795.52	
GRIFOLS SA	27,685	23.32	645,614.20	
IPSEN	3,532	80.46	284,184.72	
MERCK KGAA	10,555	142.75	1,506,726.25	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	36.52	359,868.08	
QIAGEN N.V.	21,801	39.77	867,025.77	
RECORDATI SPA	9,859	45.02	443,852.18	
SANOFI	97,536	85.44	8,333,475.84	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	374.50	905,915.50	
UCB (GROUPE)	11,875	76.66	910,337.50	

ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.94	436,895.42	
BANCO BILBAO VIZCAYA	576,942	4.82	2,781,725.85	
BANCO SANTANDER SA	1,470,387	3.21	4,728,764.59	
BNP PARIBAS	99,381	54.78	5,444,091.18	
CAIXABANK	328,697	2.69	884,852.32	
COMMERZBANK AG	94,388	5.61	529,894.23	
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	12.87	1,383,048.81	
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	31.20	859,872.00	
FINECOBANK SPA	53,120	14.14	751,382.40	
ING GROEP NV-CVA	343,429	10.81	3,713,841.20	
INTESA SANPAOLO	1,441,455	2.36	3,404,716.71	
KBC GROEP NV	21,052	66.32	1,396,168.64	
MEDIOBANCA	53,990	9.52	514,308.74	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	18.70	233,563.00	
SOCIETE GENERALE	67,846	24.91	1,690,043.86	
UNICREDIT SPA	169,030	9.35	1,580,430.50	
AMUNDI SA	6,226	77.60	483,137.60	
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,094	11.48	1,850,003.49	
DEUTSCHE BOERSE	16,510	141.10	2,329,561.00	
EURAZEO SA	3,357	70.15	235,493.55	
EXOR NV	10,345	69.04	714,218.80	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,615	91.14	967,451.10	
NATIXIS	89,751	4.06	364,837.81	
SOFINA	1,238	317.60	393,188.80	
WENDEL	2,023	114.70	232,038.10	
AEGON	166,267	3.95	657,752.25	
AGEAS	16,065	51.44	826,383.60	
ALLIANZ SE-REG	35,536	214.35	7,617,141.60	
ASSICURAZIONI GENERALI	87,567	17.37	1,521,038.79	
AXA SA	171,687	22.73	3,902,445.51	
CNP ASSURANCES	16,287	15.00	244,305.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	152.75	884,269.75	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,376	248.70	3,077,911.20	
NN GROUP NV	27,631	42.65	1,178,462.15	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	11.00	506,385.00	
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	40.49	1,744,106.75	
SCOR SE	13,354	28.16	376,048.64	
AROUNDTOWN SA	94,068	6.62	622,730.16	
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,092	43.18	1,213,012.56	
LEG IMMOBILIEN SE	6,992	115.50	807,576.00	
VONOVIA SE	45,080	51.82	2,336,045.60	
ADYEN NV	1,604	1,913.00	3,068,452.00	

AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,094	59.02	2,307,327.88	
ATOS SE	9,750	56.24	548,340.00	
BECHTLE AG	2,553	163.20	416,649.60	
CAPGEMINI SA	13,914	155.10	2,158,061.40	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,425	188.55	2,154,183.75	
EDENRED	22,756	46.98	1,069,076.88	
NEMETSCHEK SE	5,455	57.96	316,171.80	
NEXI SPA	41,348	15.62	645,855.76	
SAP SE	90,249	117.36	10,591,622.64	
TEAMVIEWER AG	14,174	34.52	489,286.48	
WORLDLINE SA	20,332	78.38	1,593,622.16	
NOKIA OYJ	450,608	4.26	1,922,519.03	
CELLNEX TELECOM SA	41,435	47.67	1,975,206.45	
DEUTSCHE TELEKOM	285,034	16.53	4,712,752.15	
ELISA A	13,387	47.80	639,898.60	
ILIAD SA	1,253	147.90	185,318.70	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.52	289,413.00	
KPN (KON.)	282,927	2.80	793,327.30	
ORANGE	171,535	10.48	1,798,029.87	
PROXIMUS	13,141	17.42	228,981.92	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.41	356,622.50	
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.46	216,408.66	
TELEFONICA	434,645	3.91	1,700,331.24	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.45	242,740.18	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	35.43	337,045.59	
E.ON SE	185,377	10.57	1,959,434.89	
ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	11.80	723,564.20	
ELIA GROUP SA/NV	2,925	89.75	262,518.75	
ENAGAS	25,299	18.79	475,368.21	
ENDESA	25,972	22.35	580,474.20	
ENEL	692,930	8.26	5,729,145.24	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	260,788	4.62	1,204,840.56	
ENGIE	158,224	12.61	1,995,521.08	
FORTUM OYJ	41,901	23.00	963,723.00	
IBERDROLA SA	542,124	11.52	6,245,268.48	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	21.48	500,698.80	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	15.75	624,402.16	
RWE STAMM	55,390	32.16	1,781,342.40	
SNAM SPA	189,497	4.78	907,501.13	
SUEZ	32,549	19.85	646,097.65	
TERNA SPA	130,230	6.18	805,342.32	
UNIPER SE	20,192	30.92	624,336.64	

	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	26.31	1,142,564.37	
	VERBUND AG	6,430	69.40	446,242.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	4,217	262.30	1,106,119.10	
	ASML HOLDING NV	36,915	543.90	20,078,068.50	
	INFINEON TECHNOLOGIES	116,532	32.50	3,787,290.00	
	STMICROELECTRONICS	55,076	30.94	1,704,051.44	
ユーロ 小計		16,413,585		407,614,630.14 (53,935,567,860)	
イギリスポンド	BP PLC	1,795,634	3.13	5,630,210.40	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	363,509	14.30	5,198,905.71	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	327,858	13.68	4,486,408.87	
	ANGLO AMERICAN PLC	108,946	33.81	3,684,008.99	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	18.74	671,941.44	
	BHP GROUP PLC	186,498	23.37	4,359,390.75	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,112	67.32	882,699.84	
	EVRAZ PLC	43,000	6.89	296,356.00	
	FRESNILLO PLC	17,490	9.11	159,333.90	
	GLENCORE PLC	875,677	3.22	2,826,247.51	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	32.73	551,435.04	
	MONDI PLC	36,710	19.64	720,984.40	
	RIO TINTO PLC REG	96,096	65.35	6,279,873.60	
	ASHTEAD GROUP PLC	37,034	48.10	1,781,335.40	
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.08	1,321,328.32	
	BUNZL PLC	24,880	23.48	584,182.40	
	DCC PLC	9,127	61.78	563,866.06	
	FERGUSON PLC	20,559	94.32	1,939,124.88	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	456,624	1.67	765,530.13	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	786,119	1.06	839,103.42	
	SMITHS GROUP PLC	37,146	16.19	601,579.47	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	120.55	664,712.70	
	EXPERIAN PLC	82,684	28.09	2,322,593.56	
	INTERTEK GROUP PLC	15,404	61.90	953,507.60	
	RELX PLC	172,179	19.13	3,293,784.27	
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	4.90	688,632.96	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	7.80	753,037.01	
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	21.91	652,392.16	
	PERSIMMON PLC	25,686	31.99	821,695.14	
	TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.80	643,350.70	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,829	47.50	561,877.50	
	COMPASS GROUP PLC	155,632	16.25	2,529,020.00	
	ENTAIN PLC	49,630	16.59	823,609.85	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	51.16	820,657.56	

WHITBREAD PLC	17,434	32.92	573,927.28	
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.75	559,595.75	
INFORMA PLC	141,175	5.75	812,038.60	
PEARSON	66,305	8.46	561,072.91	
WPP PLC	113,065	9.89	1,119,117.37	
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	9.21	381,137.11	
KINGFISHER PLC	198,587	3.63	721,863.74	
NEXT PLC	11,468	82.64	947,715.52	
OCADO GROUP PLC	44,612	19.75	881,087.00	
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.79	375,290.34	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.51	372,617.52	
TESCO PLC	666,000	2.27	1,515,150.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	23.50	787,015.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	196,527	28.38	5,578,418.89	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	25.46	457,261.60	
DIAGEO	200,801	32.84	6,594,304.84	
IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	16.03	1,298,205.58	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,534	63.55	3,846,935.70	
UNILEVER PLC	227,095	42.73	9,703,769.35	
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	15.83	1,085,858.85	
ASTRAZENECA	113,182	77.35	8,754,627.70	
GLAXOSMITHKLINE	430,042	13.55	5,829,649.35	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	23.50	386,669.00	
BARCLAYS	1,516,252	1.81	2,752,603.88	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,754,485	4.51	7,916,236.32	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,190,268	0.46	2,881,879.26	
NATWEST GROUP PLC	369,149	2.00	738,298.00	
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.16	1,097,496.03	
3I GROUP PLC	88,121	12.48	1,099,750.08	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	17.48	578,386.31	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	71.70	1,978,346.40	
M&G PLC	229,107	2.17	498,307.72	
SCHRODERS PLC	11,794	36.11	425,881.34	
ST JAMES'S PLACE PLC	50,535	13.85	699,909.75	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	210,980	2.78	588,212.24	
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	29.78	484,073.90	
AVIVA PIC	332,730	4.09	1,362,862.08	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.92	332,730.09	
LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	2.84	1,566,906.94	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	7.35	374,959.35	
PRUDENTIAL	232,591	15.79	3,672,611.89	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	97,285	6.84	665,429.40	

	AVEVA GROUP PLC	10,917	33.48	365,501.16	
	SAGE GROUP PLC	95,210	6.35	605,345.18	
	HALMA PLC	31,069	25.97	806,861.93	
	BT GROUP PLC	817,227	1.69	1,386,016.99	
	VODAFONE GROUP PLC	2,359,596	1.41	3,346,379.04	
	NATIONAL GRID PLC	306,760	9.31	2,858,082.92	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	25.07	563,272.76	
	SSE PLC	92,294	14.87	1,372,411.78	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	9.90	664,804.80	
イギリスポンド 小計		25,797,041		154,499,604.08 (23,584,364,562)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.55	340,130.90	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	852.50	693,082.50	
	GIVAUDAN-REG	795	3,884.00	3,087,780.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	45,387	55.48	2,518,070.76	
	SIKA AG-BR	12,505	282.30	3,530,161.50	
	ABB LTD	164,413	30.61	5,032,681.93	
	GEBERIT AG-REG	2,964	632.00	1,873,248.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	255.40	539,404.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	261.60	985,708.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	61.14	890,993.22	
	SGS SA	506	2,751.00	1,392,006.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	278.40	1,410,652.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	45,940	95.66	4,394,620.40	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	293.10	727,767.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	57.45	226,238.10	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,050.00	574,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	91,000.00	910,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	8,470.00	694,540.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	250,200	109.12	27,301,824.00	
	ALCON INC	42,603	64.24	2,736,816.72	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,138	273.00	1,402,674.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,377.00	1,175,958.00	
	LONZA GROUP AG-REG	6,536	577.40	3,773,886.40	
	NOVARTIS	191,990	79.49	15,261,285.10	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	321.80	900,718.20	
	ROCHE HOLDING GENUSS	60,854	303.20	18,450,932.80	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	125.80	564,338.80	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	88.90	253,720.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.25	1,974,276.12	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	57.80	1,224,030.60	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,498	1,340.50	2,008,069.00	

	UBS GROUP AG	327,092	14.13	4,621,809.96	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	151.10	659,098.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	459.80	1,309,970.20	
	SWISS RE LTD	24,674	87.74	2,164,896.76	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,740	385.70	4,913,818.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	90.00	671,220.00	
	TEMENOS AG - REG	6,511	130.50	849,685.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	103.80	1,524,406.80	
	SWISSCOM	2,441	494.80	1,207,806.80	
スイスフラン 小計		1,530,179		124,772,329.57 (15,061,267,902)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	275.10	4,737,772.20	
	BOLIDEN AB	23,903	353.30	8,444,929.90	
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	150.20	8,556,443.40	
	ALFA LAVAL AB	27,268	301.10	8,210,394.80	
	ASSA ABLOY AB-B	86,548	255.70	22,130,323.60	
	ATLAS COPCO A	58,390	522.60	30,514,614.00	
	ATLAS COPCO B	31,902	450.50	14,371,851.00	
	EPIROC AB-A	58,039	193.50	11,230,546.50	
	EPIROC AB-B	37,972	173.30	6,580,547.60	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	261.40	3,660,122.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,906	325.00	8,744,450.00	
	SANDVIK AB	96,684	228.60	22,101,962.40	
	SKANSKA B	32,007	236.10	7,556,852.70	
	SKF AB-B	35,405	227.50	8,054,637.50	
	VOLVO B	123,279	217.40	26,800,854.60	
	SECURITAS B	29,533	141.85	4,189,256.05	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	237.50	5,051,387.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	121.35	4,697,701.20	
	EVOLUTION GAMING GROUP	13,192	1,608.60	21,220,651.20	
	HENNES & MAURITZ B	65,999	211.75	13,975,288.25	
	ICA GRUPPEN AB	9,493	400.70	3,803,845.10	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	74.10	9,430,707.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	287.70	14,233,669.80	
	NORDEA BANK ABP	280,957	85.94	24,145,444.58	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	109.35	15,141,694.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	131,166	98.42	12,909,357.72	
	SWEDBANK AB-A	72,526	150.20	10,893,405.20	
	EQT AB	20,102	276.20	5,552,172.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	328.80	3,325,812.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	309.00	5,188,728.00	
	INVESTOR AB-B SHS	39,416	726.80	28,647,548.80	

	KINNEVIK AB - B	18,792	421.05	7,912,371.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	487.20	3,546,816.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	499.00	4,715,550.00	
	ERICSSON (LM) B	253,862	116.38	29,544,459.56	
	HEXAGON AB-B SHS	24,244	816.60	19,797,650.40	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	111.95	5,598,843.40	
	TELIA CO AB	230,643	36.29	8,370,034.47	
スウェーデンクローナ 小計		2,385,263		453,588,697.73 (5,942,011,940)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	76,370	178.20	13,609,134.00	
	NORSK HYDRO	126,800	55.00	6,974,000.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	427.50	7,014,420.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	144.75	2,767,185.75	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	367.20	3,405,412.80	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	414.50	2,935,489.00	
	MOWI ASA	40,968	218.70	8,959,701.60	
	ORKLA	69,804	84.74	5,915,190.96	
	DNB ASA	85,517	183.25	15,670,990.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	190.10	3,530,917.40	
	TELENOR ASA	65,744	146.60	9,638,070.40	
ノルウェークローネ 小計		535,658		80,420,512.16 (1,066,375,991)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	559.20	5,786,042.40	
	NOVOZYMES A/S	19,125	448.30	8,573,737.50	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	2,989.00	2,256,695.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	87,375	245.00	21,406,875.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	15,200.00	4,544,800.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	577	15,985.00	9,223,345.00	
	DSV PANALPINA A S	18,142	1,405.50	25,498,581.00	
	PANDORA A/S	9,401	780.20	7,334,660.20	
	CARLSBERG AS-B	9,672	1,122.00	10,851,984.00	
	AMBU A/S-B	13,555	329.50	4,466,372.50	
	COLOPLAST-B	9,208	985.20	9,071,721.60	
	DEMANT A/S	11,604	324.00	3,759,696.00	
	GN STORE NORD A/S	11,967	520.00	6,222,840.00	
	GENMAB A/S	5,192	2,295.00	11,915,640.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	192.00	935,232.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	147,877	463.60	68,555,777.20	
	DANSKE BANK A/S	64,813	120.40	7,803,485.20	
	TRYG A/S	29,772	146.25	4,354,155.00	
	ORSTED A/S	15,439	892.40	13,777,763.60	
		469,991		226,339,403.20	

デンマーククローネ 小計				(4,026,577,982)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	26.52	547,081.08	
	OIL SEARCH LTD	186,117	3.94	733,300.98	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.14	685,563.30	
	SANTOS	156,437	7.05	1,102,880.85	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	29.86	382,596.18	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	23.26	1,730,637.04	
	BHP GROUP LTD	252,353	50.09	12,640,361.77	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	22.66	1,117,772.48	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	4.80	586,339.20	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	154,776	22.97	3,555,204.72	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	43.33	1,600,956.84	
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	27.33	2,025,098.34	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	10.88	1,105,712.64	
	ORICA LTD	38,288	13.95	534,117.60	
	RIO TINTO LTD	32,028	127.11	4,071,079.08	
	SOUTH32 LTD	341,133	3.00	1,023,399.00	
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	18.93	174,534.60	
	BRAMBLES LTD	137,883	10.57	1,457,423.31	
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.73	714,261.43	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.77	405,450.00	
	TRANSURBAN GROUP	233,493	14.00	3,268,902.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	37.63	1,985,057.76	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.12	367,575.36	
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	5.09	926,446.17	
	REA GROUP LTD	5,276	156.05	823,319.80	
	SEEK LTD	31,593	30.00	947,790.00	
	WESFARMERS LTD	100,575	54.26	5,457,199.50	
	COLES GROUP LTD	115,478	16.13	1,862,660.14	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	109,901	39.42	4,332,297.42	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	13.30	613,529.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	10.16	716,666.08	
	COCHLEAR LIMITED	6,220	218.00	1,355,960.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	62.96	1,022,974.08	
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	34.84	1,396,247.84	
	CSL LIMITED	38,878	274.51	10,672,399.78	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	252,912	27.75	7,018,308.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	152,346	93.92	14,308,336.32	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	278,638	26.78	7,461,925.64	
	WESTPAC BANKING	318,928	26.09	8,320,831.52	
	AMP LTD	343,649	1.07	369,422.67	
	ASX LTD	18,195	71.90	1,308,220.50	

	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,813	158.45	4,723,869.85	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	46.90	511,772.80	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	5.13	1,176,857.91	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.06	825,771.60	
	QBE INSURANCE GROUP	138,071	10.63	1,467,694.73	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	10.98	1,310,506.92	
	AFTERPAY LTD	19,934	95.38	1,901,304.92	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	14.06	623,926.56	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	28.23	389,602.23	
	XERO LTD	11,340	133.75	1,516,725.00	
	TELSTRA CORP	403,126	3.47	1,398,847.22	
	TPG TELECOM LTD	31,475	5.43	170,909.25	
	AGL ENERGY LTD	64,235	8.81	565,910.35	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.89	353,704.05	
オーストラリアドル 小計		6,259,339		127,667,243.41 (10,907,889,276)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.60	895,819.60	
	A2 MILK CO LTD	66,854	7.59	507,421.86	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	33.80	1,842,776.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.16	514,248.72	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.58	792,880.44	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.88	444,537.44	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.33	589,199.52	
ニュージーランドドル 小計		623,837		5,586,883.58 (442,760,523)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	64.35	14,768,067.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	117,500	149.30	17,542,750.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	26.55	4,566,600.00	
	MTR CORP	151,000	44.20	6,674,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	66.70	11,605,800.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	34.55	6,840,900.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	9.13	1,205,160.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	13.68	1,926,144.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	26.10	3,807,990.00	
	WH GROUP LTD	936,500	6.87	6,433,755.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	16.00	1,746,560.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	29.15	8,205,725.00	
	HANG SENG BANK	59,400	162.30	9,640,620.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	107,000	454.40	48,620,800.00	
	AIA GROUP LTD	1,045,200	101.50	106,087,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	242,996	49.95	12,137,650.20	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	24.80	3,893,600.00	

	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	20.20	3,494,600.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	35.60	4,458,116.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	41.80	5,700,475.00	
	SINO LAND CO	315,400	11.64	3,671,256.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	118.60	14,054,100.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	63.80	2,583,900.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	22.80	2,193,360.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	46.10	7,237,700.00	
	PCCW LTD	357,000	4.60	1,642,200.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	49.35	3,331,125.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	79.70	10,958,750.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	861,579	13.30	11,459,000.70	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	49.75	6,840,625.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	112.00	2,654,400.00	
香港ドル 小計		7,146,434		345,983,730.30 (4,847,232,061)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.36	735,928.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.77	555,698.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	4.95	536,243.40	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.85	522,750.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.97	887,642.00	
	DBS GROUP	155,200	29.86	4,634,272.00	
	OCBC BANK	291,200	12.56	3,657,472.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	26.58	2,495,862.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	10.35	810,405.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.64	813,540.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.70	329,560.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.61	361,475.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	19.50	501,150.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.45	1,842,995.35	
シンガポールドル 小計		2,896,975		18,684,992.75 (1,533,664,204)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	22.49	1,523,832.44	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	442.20	948,961.20	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	26.69	2,623,893.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	24.32	3,420,729.60	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	15.44	1,536,280.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	93.72	1,171,781.16	
	AZRIELI GROUP	4,323	239.40	1,034,926.20	
	NICE LTD	5,891	758.10	4,465,967.10	
イスラエルシェケル 小計		431,084		16,726,371.60 (559,806,567)	

合　計		95,437,835		492,170,999,091 (492,170,999,091)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	114,413	1,129,256.31	
		LENDLEASE GROUP	64,786	780,671.30	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	737,341.92	
	オーストラリアドル 小計		303,750	2,647,269.53 (226,182,708)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,739,745.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,275,000.00	
	香港ドル 小計		595,500	6,014,745.00 (84,266,577)	
投資信託受益証券合計			899,250	310,449,285 (310,449,285)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	847,483.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,030	2,143,024.20	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	38,586	9,549,649.14	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,150,501.86	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,025	2,351,248.25	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,409,216.64	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	1,078,199.72	
		CROWN CASTLE INTL CORP	36,859	6,756,991.88	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,793,257.38	
		DUKE REALTY CORP	31,540	1,448,632.20	
		EQUINIX INC	7,704	5,496,418.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,157,657.96	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	32,077	2,375,301.85	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,591,728.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,600,204.32	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,517,282.80	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,190,324.22	
		INVITATION HOMES INC	51,458	1,802,573.74	
		IRON MOUNTAIN INC	27,546	1,137,649.80	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,074,773.28	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,507,959.09	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	766,025.50	
		PROLOGIS INC	63,163	7,328,171.26	
		PUBLIC STORAGE	13,912	3,857,380.24	

	REALTY INCOME CORP	29,792	2,028,835.20	
	REGENCY CENTERS CORP	15,605	1,019,942.80	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,586	2,788,663.26	
	SIMON PROPERTY GROUP	28,176	3,520,309.44	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,501,435.95	
	UDR INC	28,059	1,298,851.11	
	VENTAS INC	34,674	1,899,094.98	
	VEREIT INC	21,159	994,684.59	
	VICI PROPERTIES INC	49,459	1,553,012.60	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	708,093.90	
	WELLTOWER INC	35,679	2,665,221.30	
	WP CAREY INC	16,500	1,239,810.00	
アメリカドル 小計		1,065,081	84,149,611.26 (9,152,953,216)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	507,980.92	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	329,937.00	
カナダドル 小計		24,377	837,917.92 (75,186,374)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	378,005.16	
	GECINA SA	4,459	569,414.30	
	KLEPIERRE	17,225	383,773.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	744,082.35	
ユーロ 小計		37,101	2,075,274.81 (274,600,362)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	425,500.21	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	492,442.27	
	SEGRO PLC	106,999	1,082,294.88	
イギリスポンド 小計		252,762	2,000,237.36 (305,336,233)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	965,363.40	
	GOODMAN GROUP	139,848	2,690,675.52	
	GPT GROUP	167,884	777,302.92	
	MIRVAC GROUP	392,919	1,092,314.82	
	SCENTRE GROUP	486,663	1,333,456.62	
	STOCKLAND	207,412	949,946.96	
	VICINITY CENTERS	365,149	562,329.46	
オーストラリアドル 小計		1,853,965	8,371,389.70 (715,251,535)	
香港ドル	LINK REIT	170,500	12,634,050.00	
香港ドル 小計		170,500	12,634,050.00 (177,003,040)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	866,620.90	
		426,560	908,572.80	

		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST			
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	464,200.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	540,708.30	
		SUNTEC REIT	173,000	262,960.00	
	シンガポールドル 小計		1,376,783	3,043,062.00 (249,774,528)	
投資証券合計			4,780,569	10,950,105,288 (10,950,105,288)	
合計				11,260,554,573 (11,260,554,573)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　592銘柄	97.5%	—	—	70.0%
	投資証券　36銘柄	—	—	2.5%	1.8%
カナダドル	株式　87銘柄	99.6%	—	—	3.6%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.4%	0.0%
ユーロ	株式　233銘柄	99.5%	—	—	10.7%
	投資証券　4銘柄	—	—	0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式　85銘柄	98.7%	—	—	4.7%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式　40銘柄	100.0%	—	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式　38銘柄	100.0%	—	—	1.2%
ノルウェークローネ	株式　11銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　19銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　55銘柄	92.1%	—	—	2.2%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	1.9%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.0%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　31銘柄	94.9%	—	—	1.0%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.5%	0.0%

シンガポールドル	株式　14銘柄	86.0%	—	—	0.3%
	投資証券　5銘柄	—	—	14.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,677,707,192
投資証券	104,512,859,650
派生商品評価勘定	268,423,200
未収入金	91,214,580
未収配当金	1,057,593,188
差入委託証拠金	197,370,000
流動資産合計	108,805,167,810
資産合計	108,805,167,810
負債の部	
流動負債	
前受金	268,423,200
未払解約金	148,007,521
未払利息	2,073
流動負債合計	416,432,794
負債合計	416,432,794
純資産の部	
元本等	
元本	50,413,397,286
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	57,975,337,730
元本等合計	108,388,735,016
純資産合計	108,388,735,016
負債純資産合計	108,805,167,810

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 5月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	50,413,397,286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 2.1500円 (1万口当たり純資産額) (21,500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

	2021年 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年 5月10日現在
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	55,613,724,754円
期中追加設定元本額	2,438,940,748円
期中一部解約元本額	7,639,268,216円
期末元本額	50,413,397,286円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,628,247,461円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,623,430円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	16,574,164,778円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	23,326,868,398円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,420,648,265円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,078,546,626円
分散投資コア戦略ファンドＡ	433,901,311円
分散投資コア戦略ファンドＳ	874,825,963円
コア投資戦略ファンド（切替型）	871,401,330円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	27,022,933円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	285,741,987円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,954,578円
グローバル経済コア	260,777,909円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	9,614,344円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	422,862,295円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	42,599,327円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	555,915,556円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,835,805円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	893,720,485円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用）	378,462,607円

区分	2021年 5月10日現在
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	307,661,898円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	17,200,109,206
合計	17,200,109,206

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2021年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	3,499,048,800	－	3,767,472,000	268,423,200
合計		3,499,048,800	－	3,767,472,000	268,423,200

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,539	201,609,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	2,304	278,323,200	

ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	2,476	357,039,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	3,246	2,087,178,000	
森ヒルズリート投資法人	11,062	1,738,946,400	
産業ファンド投資法人	13,312	2,630,451,200	
アドバンス・レジデンス投資法人	8,945	3,157,585,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,418	1,420,303,400	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,719	2,350,062,000	
ＧＬＰ投資法人	29,427	5,276,261,100	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,234	1,481,900,000	
日本プロロジスリート投資法人	14,888	5,181,024,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,433	919,986,000	
Ｏｎｅリート投資法人	1,468	447,740,000	
イオンリート投資法人	9,552	1,435,665,600	
ヒューリックリート投資法人	7,807	1,348,268,900	
日本リート投資法人	3,059	1,307,722,500	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	59,845	1,239,988,400	
積水ハウス・リート投資法人	27,699	2,481,830,400	
トーセイ・リート投資法人	2,083	279,746,900	
ケネディクス商業リート投資法人	3,746	1,033,146,800	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	2,009	280,657,300	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,813	212,846,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	30,454	5,225,906,400	
いちごホテルリート投資法人	1,647	143,947,800	
ラサールロジポート投資法人	11,391	1,990,007,700	
スターアジア不動産投資法人	9,676	543,791,200	
マリモ地方創生リート投資法人	882	115,101,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,287	1,824,285,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,520	126,160,000	
投資法人みらい	10,171	500,413,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,040	270,504,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,368	1,072,704,000	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	3,013	533,903,600	
ザイマックス・リート投資法人	1,443	166,233,600	
タカラレーベン不動産投資法人	2,830	331,959,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,653	502,652,800	
日本ビルファンド投資法人	10,599	7,429,899,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,417	6,394,143,000	
日本都市ファンド投資法人	46,907	5,197,295,600	
オリックス不動産投資法人	18,764	3,597,058,800	
日本プライムリアルティ投資法人	5,863	2,526,953,000	
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	8,506	1,351,603,400	

	東急リアル・エステート投資法人	6,314	1,164,933,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	6,539	815,413,300	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,140	3,315,044,000	
	森トラスト総合リート投資法人	6,731	1,050,036,000	
	インヴィンシブル投資法人	39,377	1,675,491,350	
	フロンティア不動産投資法人	3,125	1,501,562,500	
	平和不動産リート投資法人	5,778	937,191,600	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,153	1,928,965,500	
	福岡リート投資法人	4,870	860,042,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	2,913	2,307,096,000	
	いちごオフィスリート投資法人	7,813	743,797,600	
	大和証券オフィス投資法人	2,006	1,560,668,000	
	阪急阪神リート投資法人	4,254	656,817,600	
	スターツプロシード投資法人	1,467	328,461,300	
	大和ハウスリート投資法人	13,437	4,010,944,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,339	1,959,899,400	
	大和証券リビング投資法人	12,297	1,377,264,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	8,738	1,326,428,400	
合計		589,806	104,512,859,650	

(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

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	89,964,960
コール・ローン	128,083,425
投資証券	87,805,303,033
派生商品評価勘定	448
未収入金	302,309,944
未収配当金	107,979,419
流動資産合計	88,433,641,229
資産合計	88,433,641,229
負債の部	

	2021年 5月10日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	69,549
未払解約金	130,922,363
未払利息	99
流動負債合計	130,992,011
負債合計	130,992,011
純資産の部	
元本等	
元本	41,688,637,767
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	46,614,011,451
元本等合計	88,302,649,218
純資産合計	88,302,649,218
負債純資産合計	88,433,641,229

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益

	2021年 5月10日現在
	約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 5月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	41,688,637,767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　2.1181円 (1万口当たり純資産額)　(21,181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

	2021年 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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	2021年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	47,638,239,657円
期中追加設定元本額	1,605,477,130円
期中一部解約元本額	7,555,079,020円

区分	2021年 5月10日現在
期末元本額	41,688,637,767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	78,132,785円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	119,338,464円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,659,821,901円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,819,259円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	11,591,466,800円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	19,437,644,405円
コア投資戦略ファンド（安定型）	968,807,753円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,133,420,495円
分散投資コア戦略ファンドＡ	474,238,531円
分散投資コア戦略ファンドＳ	973,563,519円
コア投資戦略ファンド（切替型）	894,066,097円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	156,644,689円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	306,655,965円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,371,396円
グローバル経済コア	263,627,370円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	9,978,964円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	449,706,229円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	45,385,362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）	879,154,604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）	473,403,385円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	91,753,320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）	4,065,754円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	126,865,565円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	143,360,667円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	138,431,255円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	137,460,330円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	120,452,903円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	13,451,541,622
合計	13,451,541,622

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	144,868,274	－	144,937,375	△69,101
	アメリカドル	65,256,000	－	65,260,860	△4,860
	カナダドル	11,662,690	－	11,664,653	△1,963
	ユーロ	10,530,640	－	10,585,680	△55,040
	イギリスポンド	15,262,200	－	15,264,680	△2,480
	オーストラリアドル	23,923,480	－	23,923,032	448
	香港ドル	10,026,864	－	10,030,730	△3,866
	シンガポールドル	8,206,400	－	8,207,740	△1,340
合計		144,868,274	－	144,937,375	△69,101

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,940	1,030,802.40	
		AGREE REALTY CORP	35,452	2,494,402.72	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	767,382.20	
		ALEXANDER'S INC	1,190	327,250.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	71,006	12,649,008.84	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,157	956,741.11	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	77,492	3,547,583.76	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	583,982.00	

		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	151,277	5,659,272.57	
		AMERICOLD REALTY TRUST	142,080	5,451,609.60	
		APARTMENT INCOME REIT CO	83,811	3,716,179.74	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	76,106	530,458.82	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	1,824,331.71	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,000	514,140.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	78,196	15,289,663.88	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	138,699.00	
		BOSTON PROPERTIES	79,048	8,549,831.68	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,286,338.80	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	167,078	3,794,341.38	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	21,202	429,552.52	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	24,100	435,969.00	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	91,350.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	54,928	6,739,116.32	
		CARETRUST REIT INC	52,477	1,211,956.31	
		CENTERSPACE	7,499	534,378.74	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	338,048.80	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	6,500	69,550.00	
		CITY OFFICE REIT INC	25,050	283,816.50	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	63,656.00	
		COLONY CAPITAL INC	277,172	1,940,204.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	66,431	1,211,037.13	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,605	570,617.85	
		COREPOINT LODGING INC	22,000	228,140.00	
		CORESITE REALTY CORP	23,959	2,848,245.92	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	1,769,715.18	
		COUSINS PROPERTIES INC	83,643	3,020,348.73	
		CTO REALTY GROWTH INC	2,800	147,420.00	
		CUBESMART	112,430	4,742,297.40	
		CYRUSONE INC	67,819	4,752,077.33	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,154,966.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	157,875	23,867,542.50	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	523,896.00	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	92,859	3,012,345.96	
		DUKE REALTY CORP	208,515	9,577,093.95	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	1,009,608.24	
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	22,329	3,486,673.35	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	957,192.40	
		EPR PROPERTIES	41,912	2,074,644.00	
		EQUINIX INC	49,993	35,667,505.85	

		EQUITY COMMONWEALTH	67,845	1,877,271.15	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	95,606	6,681,903.34	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	192,339	14,242,702.95	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	63,742	1,652,192.64	
		ESSEX PROPERTY TRUST	36,272	10,478,255.36	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	73,703	10,852,029.72	
		FARMLAND PARTNERS INC	19,000	273,220.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,320	4,575,668.40	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	72,698	3,574,560.66	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,250	1,221,300.00	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	307,256.90	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	123,191	5,803,528.01	
		GEO GROUP INC/THE	64,306	369,116.44	
		GETTY REALTY CORP	21,985	695,165.70	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	429,195.00	
		GLADSTONE LAND CORP	11,500	256,335.00	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	27,530	388,448.30	
		GLOBAL NET LEASE INC	51,412	984,539.80	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	78,310	2,483,993.20	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	123,154	3,484,026.66	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	300,597	10,076,011.44	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	251,789.50	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	58,422	2,597,442.12	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	397,952	6,995,996.16	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	2,344,479.10	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	59,731	982,574.95	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,941	952,698.51	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,388	2,473,165.24	
		INVITATION HOMES INC	316,646	11,092,109.38	
		IRON MOUNTAIN INC	162,379	6,706,252.70	
		JBG SMITH PROPERTIES	62,238	2,001,574.08	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	350,000	257,250.00	
		KILROY REALTY CORPORATION	59,619	4,041,572.01	
		KIMCO REALTY CORP	243,461	5,224,673.06	
		KITE REALTY GROUP TRUST	46,370	1,000,664.60	
		LEXINGTON CORP PROPERTIES	152,908	1,931,228.04	
		LIFE STORAGE INC	42,485	4,077,285.45	
		LTC PROPERTIES INC	23,126	946,547.18	
		MACERICH CO/THE	64,797	890,310.78	
		MACK-CALI REALTY CORP	50,236	848,486.04	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	548,740.18	

		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	327,113	7,026,387.24	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,825	10,022,439.75	
		MONMOUTH REIT -CL A	54,952	1,071,014.48	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	98,678	4,789,830.12	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	36,720	1,682,143.20	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,779,633.00	
		NETSTREIT CORP	7,992	170,229.60	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	45,000	305,550.00	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	621,184.46	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	765,046.70	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	130,489	4,762,848.50	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	215,232.97	
		PARAMOUNT GROUP INC	89,726	951,992.86	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	133,080	2,974,338.00	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,690,066.80	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,212,366.92	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,256,594.00	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	299,238.00	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	293,722.49	
		PRIME US REIT	295,000	252,225.00	
		PROLOGIS INC	414,203	48,055,832.06	
		PS BUSINESS PARKS INC	11,172	1,754,004.00	
		PUBLIC STORAGE	85,357	23,666,935.39	
		QTS REALTY TRUST INC	36,137	2,297,590.46	
		REALTY INCOME CORP	209,371	14,258,165.10	
		REGENCY CENTERS CORP	88,920	5,811,811.20	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	69,615	1,254,810.37	
		RETAIL PROPERTISE OF AME-A	115,918	1,403,766.98	
		RETAIL VALUE	9,529	174,761.86	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	73,995	4,071,944.85	
		RLJ LODGING TRUST	92,291	1,495,114.20	
		RPT REALTY	43,950	570,471.00	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	2,424,677.04	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,636	2,103,416.28	
		SAFEHOLD INC	8,340	588,637.20	
		SAUL CENTERS INC	6,800	298,452.00	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	332,131.00	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	1,137,090.67	
		SIMON PROPERTY GROUP	184,427	23,042,309.38	
		SITE CENTERS CORP	91,820	1,357,099.60	
		SL GREEN REALTY CORP	39,045	2,847,161.40	

		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63,982	3,023,789.32	
		STAG INDUSTRIAL INC	89,179	3,239,873.07	
		STORE CAPITAL CORP	135,047	4,732,046.88	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	635,969.40	
		SUN COMMUNITIES INC	62,289	10,316,927.07	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	124,349	1,584,206.26	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	52,270	919,429.30	
		TERRENO REALTY CORP	38,649	2,479,719.84	
		UDR INC	167,222	7,740,706.38	
		UMH PROPERTIES INC	21,320	471,811.60	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	460,915.30	
		URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,154,506.50	
		URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	283,090.50	
		VENTAS INC	209,174	11,456,459.98	
		VEREIT INC	128,943	6,061,610.43	
		VICI PROPERTIES INC	299,377	9,400,437.80	
		VORNADO REALTY TRUST	88,341	4,064,569.41	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	10,028	22,563.00	
		WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,080,464.70	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	66,885	2,205,198.45	
		WELLTOWER INC	234,215	17,495,860.50	
		WHITESTONE REIT	19,090	180,209.60	
		WP CAREY INC	98,987	7,437,883.18	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,215,218.40	
	アメリカドル 小計		13,841,765	598,534,694.34 (65,102,618,703)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	1,484,623.08	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,830	338,205.10	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	147,480.00	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	530,765.00	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,320	2,647,651.20	
		CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,227,922.50	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	55,620	566,767.80	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	448,088.22	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	463,091.00	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	52,150	736,358.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	302,381.60	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,032,214.75	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,120	1,306,042.40	
			81,539	1,257,331.38	

		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT			
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,490	534,500.40	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	575,209.50	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	243,978.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	209,204.70	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,470	645,135.70	
		PLAZA RETAIL REIT	25,000	99,750.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	89,431	1,904,880.30	
		SLATE GROCERY REIT	10,300	128,544.00	
		SLATE OFFICE REI	17,000	75,820.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	42,076	1,236,192.88	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	751,530.00	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	188,082.00	
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	23,500	488,565.00	
	カナダドル 小計		970,290	19,570,314.51 (1,756,044,320)	
ユーロ		AEDIFICA	18,325	1,902,135.00	
		ALSTRIA OFFICE REIT -AG	98,200	1,418,008.00	
		ALTAREA	2,230	378,208.00	
		BEFIMMO S.C.A.	14,010	497,355.00	
		CARE PROPERTY INVEST	15,000	381,000.00	
		CARMILA	25,000	354,500.00	
		COFINIMMO	15,733	2,050,009.90	
		COVIVIO(FP)	26,742	2,037,205.56	
		CROMWELL EUROPEAN REIT	160,000	380,800.00	
		EUROCOMMERCIAL	19,690	435,149.00	
		GECINA SA	30,292	3,868,288.40	
		HAMBORNER REIT AG	45,000	411,300.00	
		HIBERNIA REIT PLC	365,550	420,382.50	
		ICADE	17,080	1,196,454.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	141,580.10	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	141,062	1,245,577.46	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	268,620.00	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	406,640.00	
		KLEPIERRE	111,130	2,475,976.40	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	184,960.00	
		MERCIALYS	26,000	273,000.00	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	183,486	1,654,676.74	
		MONTEA	6,100	564,860.00	
		NSI NV	10,050	331,650.00	

	RETAIL ESTATES	6,400	407,680.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	77,808	5,537,595.36	
	VASTNED RETAIL	10,650	260,925.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	75,470	2,233,912.00	
	WERELDHAVE NV	22,670	329,621.80	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	490,680.00	
ユーロ 小計		1,874,008	32,538,750.22 (4,305,527,429)	
イギリスポンド	AEW UK REIT PLC	118,000	110,920.00	
	ASSURA PLC	1,467,040	1,079,741.44	
	BIG YELLOW GROUP PLC	90,146	1,109,697.26	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	343,650.00	
	BRITISH LAND CO PLC	524,845	2,812,119.51	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	870,519.74	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	380,067	441,637.85	
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	238,024.41	
	DERWENT LONDON PLC	61,915	2,153,403.70	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	376,000	330,880.00	
	GCP STUDENT LIVING PLC	264,000	429,264.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	136,980	982,146.60	
	HAMMERSON PLC	2,291,000	892,573.60	
	HOME REIT PLC	132,934	153,538.77	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	219,355	245,677.60	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	419,305	3,112,081.71	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	1,149,594.60	
	LXI REIT PLC	279,000	375,534.00	
	NEWRIVER REIT PL	186,000	186,744.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	293,040.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	1,099,891.99	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	193,140.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	1,009,521.90	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	160,650.00	
	SEGRO PLC	670,923	6,786,386.14	
	SHAFTESBURY PLC	176,693	1,131,718.66	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	187,483.56	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	376,000	427,700.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	213,856.87	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	942,658	1,810,846.01	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	462,000	360,360.00	
	UNITE GROUP PLC	221,192	2,595,688.12	
	WORKSPACE GROUP PLC	70,347	628,550.44	

イギリスポンド 小計		14,236,560	33,925,852.48 (5,178,781,381)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	721,419.60	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	230,250.00	
	ARENA REIT	201,053	689,611.79	
	AVENTUS GROUP	230,000	673,900.00	
	BWP TRUST	259,660	1,090,572.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	266,000	712,880.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	266,606	935,787.06	
	CENTURIA OFFICE REIT	220,945	494,916.80	
	CHARTER HALL GROUP	258,140	3,663,006.60	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	270,943	1,322,201.84	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	1,092,830.40	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	617,281.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,102,633	986,856.53	
	DEXUS	604,807	6,205,319.82	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	350,460.00	
	GOODMAN GROUP	939,928	18,084,214.72	
	GPT GROUP	1,087,317	5,034,277.71	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	637,023.20	
	HOME CONSORTIUM	91,000	440,440.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	180,642	230,318.55	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	114,885	364,185.45	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	859,198.24	
	IRONGATE GROUP	340,000	499,800.00	
	MIRVAC GROUP	2,205,770	6,132,040.60	
	NATIONAL STORAGE REIT	546,340	1,119,997.00	
	RURAL FUNDS GROUP	212,766	525,532.02	
	SCENTRE GROUP	2,915,179	7,987,590.46	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	1,450,948.80	
	STOCKLAND	1,339,941	6,136,929.78	
	VICINITY CENTERS	2,158,040	3,323,381.60	
	WAYPOINT REIT LTD	455,796	1,166,837.76	
オーストラリアドル 小計		18,294,725	73,780,009.33 (6,303,763,997)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	768,485.34	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	1,392,696.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	1,077,404.95	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	650,000	1,092,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	655,529.31	
ニュージーランドドル 小計		2,834,417	4,986,115.60 (395,149,661)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,138,000	5,121,000.00	

	FORTUNE REIT	846,000	6,683,400.00	
	LINK REIT	1,162,400	86,133,840.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,007,840.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,474,010.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	3,239,280.00	
香港ドル 小計		5,277,400	105,659,370.00 (1,480,287,773)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	393,250.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	604,977	471,882.06	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,774,418	5,411,974.90	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,051,389.62	
	CAPITALAND CHINA TRUST	586,721	797,940.56	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,537,444	5,404,755.72	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	521,500.00	
	EC WORLD REIT	180,000	131,400.00	
	ESR REIT	1,404,065	547,585.35	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	329,400.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	142,596.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	734,262	1,762,228.80	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	250,700.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,470,696	2,161,923.12	
	IREIT GLOBAL	334,420	215,700.90	
	KEPPEL DC REIT	738,603	1,935,139.86	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,272,194.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000	432,900.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,480,400	163,706.40	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,210,473	2,554,098.03	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	922,060	2,554,106.20	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,618,200	3,204,036.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,207,100	1,279,526.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	515,825.82	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	228,000	978,120.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	200,986.80	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	273,615.00	
	SPH REIT	576,800	498,932.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	859,400	476,967.00	
	SUNTEC REIT	1,180,700	1,794,664.00	
シンガポールドル 小計		27,525,300	37,729,044.64 (3,096,799,984)	

	韓国ウォン	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	56,152,470.00	
		JR REIT XXVII	64,338	326,193,660.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	121,000,000.00	
		LOTTE REIT CO LTD	72,480	400,814,400.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	207,233,750.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	155,798,880.00	
	韓国ウォン 小計		230,114	1,267,193,160.00 (123,804,771)	
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	1,868,175.00	
	イスラエルシェケル 小計		103,500	1,868,175.00 (62,525,014)	
合計			85,188,079	87,805,303,033 (87,805,303,033)	

(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　156銘柄	100.0%	74.1%
カナダドル	投資証券　27銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券　30銘柄	100.0%	4.9%
イギリスポンド	投資証券　34銘柄	100.0%	5.9%
オーストラリアドル	投資証券　31銘柄	100.0%	7.2%
ニュージーランドドル	投資証券　5銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券　6銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	投資証券　30銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券　6銘柄	100.0%	0.1%
イスラエルシェケル	投資証券　1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

２【ファンドの現況】

【ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）】

【純資産額計算書】

（2021年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	119,777,161円
Ⅱ　負債総額	108,718円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	119,668,443円
Ⅳ　発行済口数	104,190,000口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1486円
（1万口当たり純資産額）	（11,486円）

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	645,222,736,404円
Ⅱ　負債総額	16,856,565,883円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	628,366,170,521円
Ⅳ　発行済口数	446,205,859,601口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4082円
（1万口当たり純資産額）	（14,082円）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	466,052,926,671円
Ⅱ　負債総額	3,217,220,840円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	462,835,705,831円
Ⅳ　発行済口数	249,503,103,457口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8550円
（1万口当たり純資産額）	（18,550円）

外国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	307,979,423,385円
Ⅱ　負債総額	3,723,830,364円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	304,255,593,021円
Ⅳ　発行済口数	99,051,563,319口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0717円
（1万口当たり純資産額）	（30,717円）

外国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	521,251,305,898円
Ⅱ　負債総額	3,647,407,653円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	517,603,898,245円
Ⅳ　発行済口数	137,722,653,603口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.7583円
（1万口当たり純資産額）	（37,583円）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	109,265,098,844円
Ⅱ　負債総額	727,300,452円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	108,537,798,392円
Ⅳ　発行済口数	49,958,272,073口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1726円
（1万口当たり純資産額）	（21,726円）

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	90,082,609,268円
Ⅱ　負債総額	62,093,739円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	90,020,515,529円
Ⅳ　発行済口数	41,643,629,919口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1617円
（1万口当たり純資産額）	（21,617円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

②受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

③受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

④受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

⑤償還金

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

則として取得申込者とします。）に支払います。

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2021年 5月31日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：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

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。
また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2021年 8月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年5月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	527	14,570,164
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	76	275,974
単位型公社債投資信託	47	298,023
合計	650	15,144,161

3【委託会社等の経理状況】

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		前事業年度 （2020年3月31日）		当事業年度 （2021年3月31日）
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		24,869		21,589
金銭の信託		5,823		10,857
前払費用		348		397
未収委託者報酬		7,284		8,471
未収運用受託報酬		5,842		6,151
未収収益		190		177
その他		4,624		3,428
流動資産合計		48,983		51,072
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	256	※1	301
器具備品	※1	576	※1	692
その他	※1	0	※1	0
有形固定資産合計		832		993
無形固定資産				
ソフトウェア		3,030		4,104
その他		40		41
無形固定資産合計		3,070		4,145
投資その他の資産				
投資有価証券		8,469		9,950
関係会社株式		5,636		5,636
繰延税金資産		700		311
その他		35		39
投資その他の資産合計		14,842		15,937
固定資産合計		18,745		21,077
資産合計		67,729		72,149

（単位：百万円）

	前事業年度 （2020年3月31日）	当事業年度 （2021年3月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
固定負債		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	305	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	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△587	791
繰延ヘッジ損益	284	△65
評価・換算差額等合計	△302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

（2）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	－
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

（単位：百万円）

	前事業年度	当事業年度

	（自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	（自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	－	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	－
デリバティブ利益	666	－
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	－
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	－	158
デリバティブ費用	－	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	△193	△65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2019年4月1日　至　2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
剰余金の配当	230		△2,536	△2,305	△2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	－	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
剰余金の配当				△2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△980	151	△829	△829
当期変動額合計	△980	151	△829	6,022
当期末残高	△587	284	△302	56,464

当事業年度（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

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法
（1）子会社株式
移動平均法による原価法によっております。
（2）その他有価証券
時価のあるもの
決算日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）
時価のないもの
移動平均法による原価法によっております。
２．デリバティブの評価基準及び評価方法
時価法によっております。
３．金銭の信託の評価基準及び評価方法
時価法によっております。
４．固定資産の減価償却の方法
（1）有形固定資産
定額法によっております。
（2）無形固定資産
定額法によっております。
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。
５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、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
従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。
（2）退職給付引当金
従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。
７．ヘッジ会計の会計処理
（1）ヘッジ会計の方法
繰延ヘッジ処理によっております。
（2）ヘッジ手段とヘッジ対象
ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。
（3）ヘッジ方針
自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。
（4）ヘッジ有効性評価の方法
ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有

効性を判定しております。

８．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

９．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2020年3月31日）		当事業年度 （2021年3月31日）	
建　　物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	〃	391	〃
そ の 他	4	〃	4	〃
計	367	〃	503	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2019年4月1日　至 2020年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

４．基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

当事業年度（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

2021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
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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）　（単位：百万円）

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

（*1）負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。

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

当事業年度（2021年3月31日）　（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	21,589	21,589	－
（2）金銭の信託	10,857	10,857	－
（3）未収委託者報酬	8,471	8,471	－
（4）未収運用受託報酬	6,151	6,151	－
（5）投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	－
（6）未払金	(7,572)	(7,572)	－
（7）デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)	(357)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	－
デリバティブ取引計	(431)	(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。

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

(1) 現金及び預金
現金及び預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 投資有価証券 その他有価証券
投資有価証券の時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

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

(7) デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

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

（単位:百万円）

区分	前事業年度 2020年3月31日	当事業年度 2021年3月31日
非上場株式	0	0

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

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2020年3月31日） **（単位:百万円）**

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	―	―	―
未収委託者報酬	7,284	―	―	―
未収運用受託報酬	5,842	―	―	―
投資有価証券 投資信託	―	9	5,605	―

当事業年度（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

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位:百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位:百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

２．その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）　（単位:百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 　その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 　その他	7,578	8,509	△931
小計	7,578	8,509	△931
合計	8,469	9,316	△846

当事業年度（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

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

3．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）　（単位:百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度（2021年3月31日）　（単位:百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2020年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	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 米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	－	△44
	英ポンド		2,660	－	△67
	カナダドル		6	－	△0
	スイスフラン		35	－	△0
	香港ドル		71	－	△1
	ユーロ		72	－	△0
合計			5,666	－	△114

（注）　1．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（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）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（2）株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,711	－	△315	△315
合計		13,711	－	△315	△315

（注）　1．上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2．時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

ヘッジ会計の方法	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	投資有価証券 子会社株式			
	売建				
	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

（注）　1．時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、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す。

2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度（自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度（自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	－	18
退職給付の支払額	△11	△69
退職給付債務の期末残高	600	626

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

（単位：百万円）

	前事業年度（自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度（自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用　前事業年度74百万円　　当事業年度77百万円

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度44百万円、当事業年度92百万円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （2020年3月31日）		当事業年度 （2021年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	〃	170	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	〃	191	〃
税務上の収益認識差額	―	〃	71	〃
有価証券評価差額	259	〃	―	〃
繰延ヘッジ損益	―	〃	28	〃
その他	151	〃	123	〃
繰延税金資産 合計	862	〃	693	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	―	〃	△349	〃
繰延ヘッジ損益	△125	〃	―	〃
その他	△35	〃	△32	〃
繰延税金負債 合計	△161	〃	△382	〃
繰延税金資産の純額	700	〃	311	〃

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

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2019年4月1日　至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

当事業年度（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(*1)	6,372百万円

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

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

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

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

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

当事業年度（自 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㈱	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
① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

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

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記
（1）親会社情報
前事業年度（2020年3月31日）
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（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）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85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　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2021年 8月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
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、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2021年3月末日現在）
④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(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みます。）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

2021年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤　澤　　孝　　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹　内　知　明　　印

監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年４月１日から2021年３月31日までの第35期事業年度の財務諸表、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2021年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

　監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年7月8日

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

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSBI資産設計オープン（分配型）の2020年11月11日から2021年5月10日までの特定期間の財務諸表、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（分配型）の2021年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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