【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年12月6日提出
【計算期間】	第4期(自 2020年9月8日至 2021年9月6日)
【ファンド名】	ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

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

＜信託金限度額＞

上限　5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 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（　）

［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。

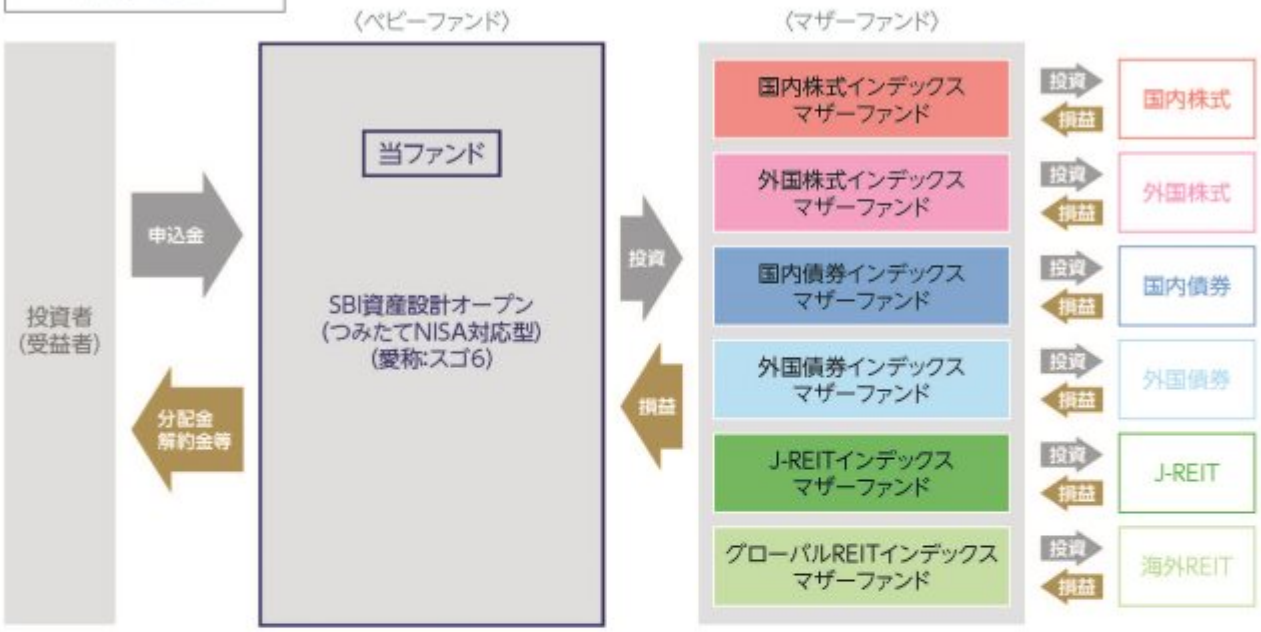
[特殊型]
(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左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

ファンドのしくみ



? 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。

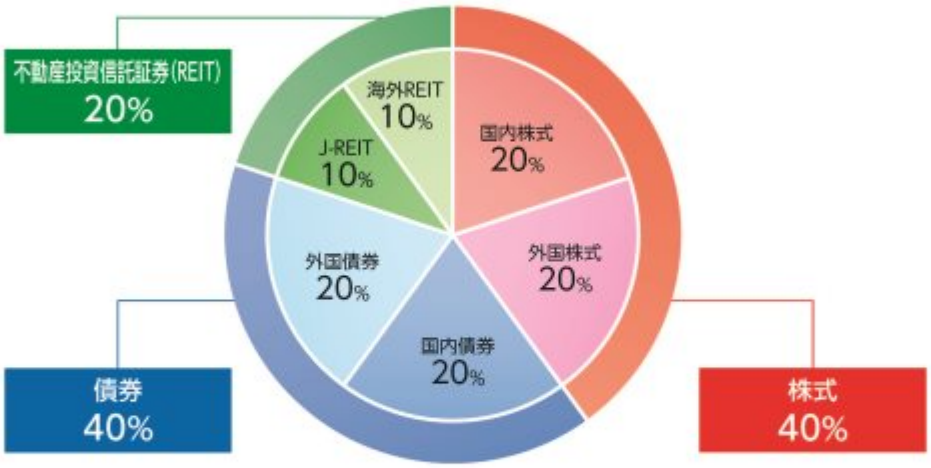
「東証REIT指数」とは、東証が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「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。

2022年4月4日に東京証券取引所(以下「東証」といいます。)は、「市場第一部・市場第二部・マザーズ・JASDAQ(スタンダード・グロース)」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロース市場」の3つの市場区分に見直すこととしております。これに伴い東証の市場区分に関する記載内容を変更する予定です。詳細は日本取引所グループのホームページをご確認ください。

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

基本組入比率



●組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

4. ノーロードファンドです。

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

分配方針

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

●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

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

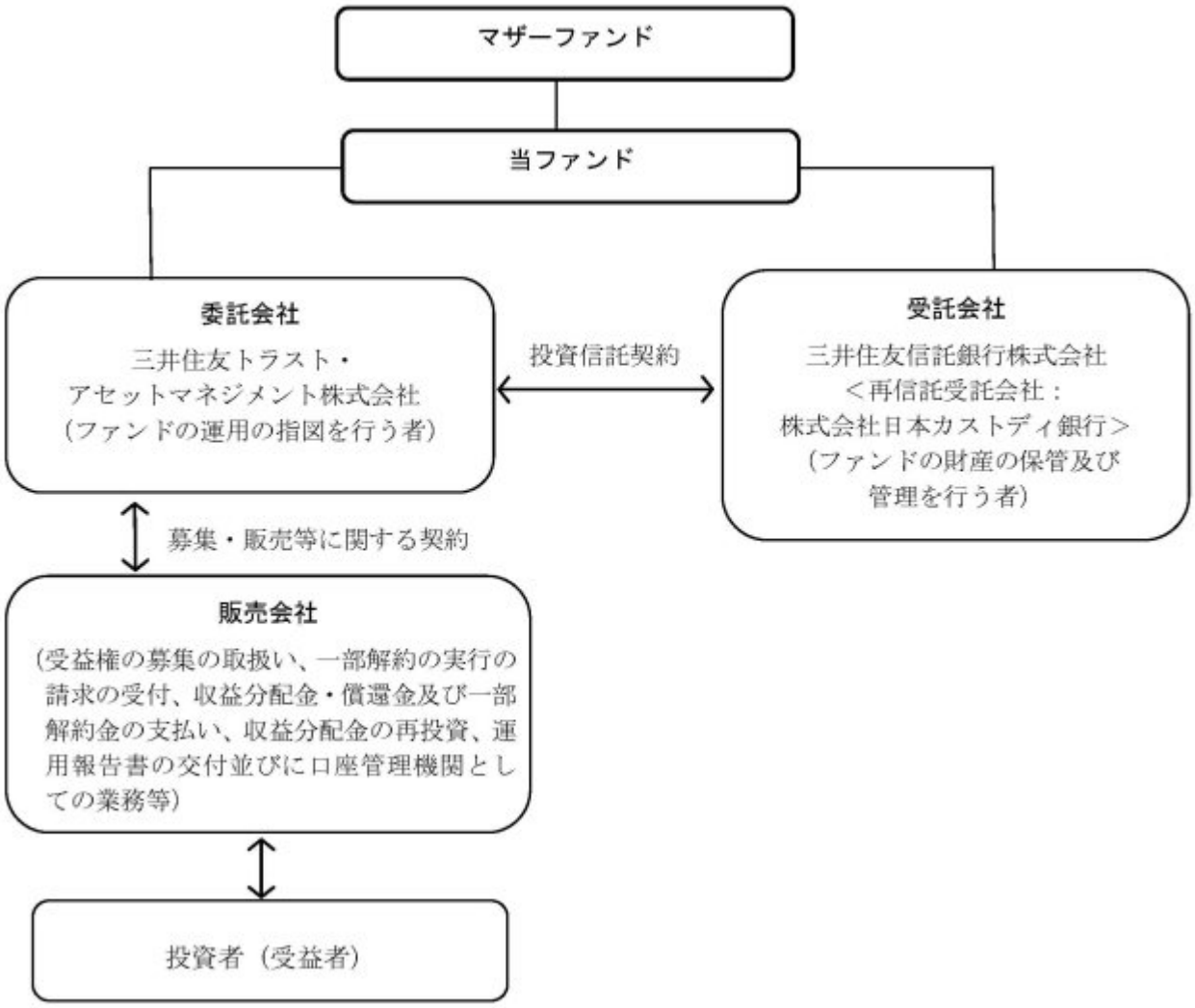
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2017年12月19日　　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

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 9月30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】

①基本方針

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

②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。

③投資態度

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

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

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

ハ．各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

ニ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券

2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限ります。）

3. 金銭債権

4. 約束手形

ロ.次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

②有価証券の指図範囲

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

1.株券又は新株引受権証書

2.国債証券

3.地方債証券

4.特別の法律により法人の発行する債券

5.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10.コマーシャル・ペーパー

11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券

12.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの

13.投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14.投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16.オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18.外国法人が発行する譲渡性預金証書
19.指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22.外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

イ.委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1.預金
2.指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3.コール・ローン
4.手形割引市場において売買される手形
5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

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

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

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場

合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

３．運用制限

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

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

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

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

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新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。
⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行

うことができます。

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

３．運用制限

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

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

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

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

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

④外貨建資産への投資は行いません。

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

⑥一般社団法人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。

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並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

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。

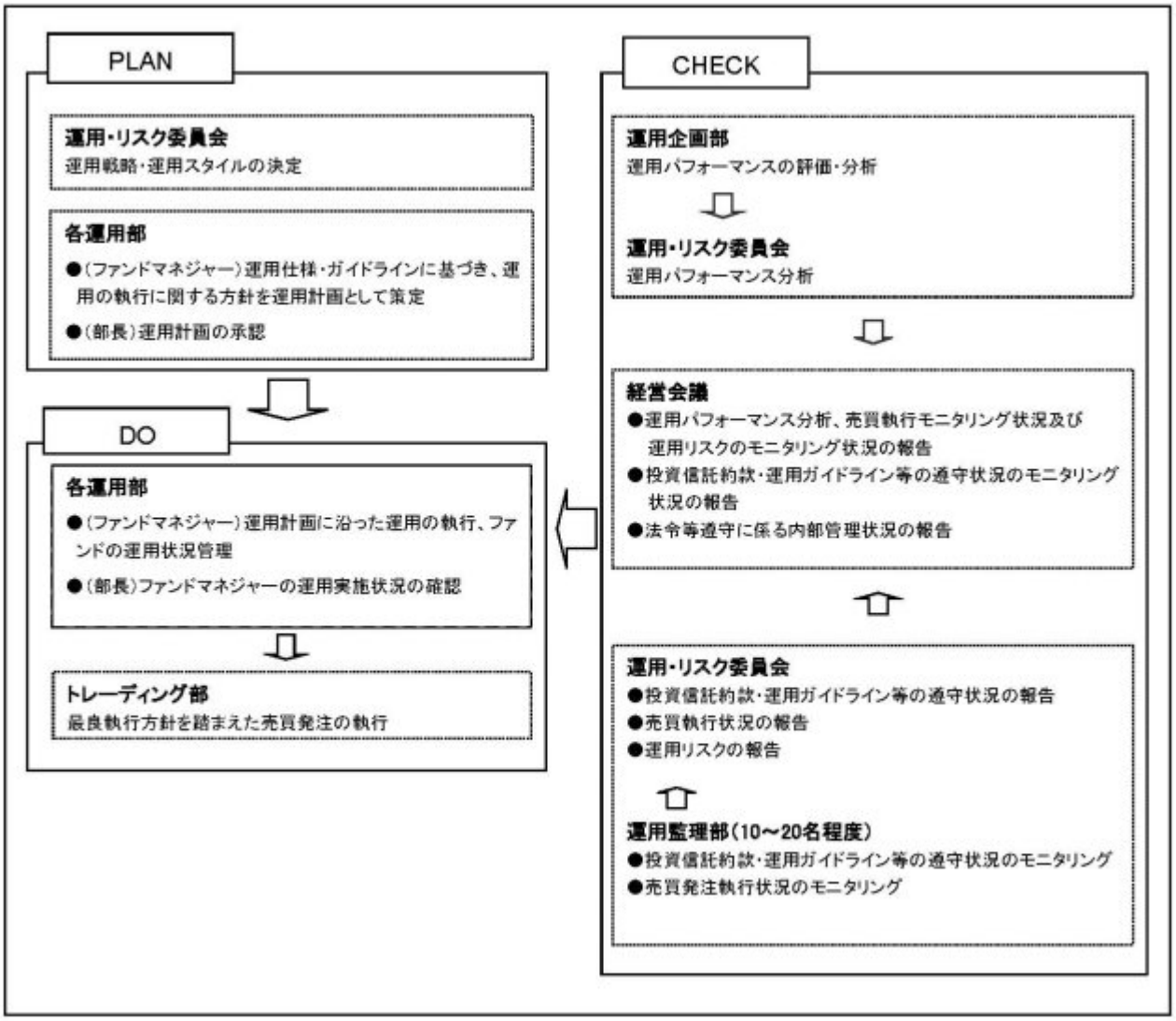
③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（３）【運用体制】

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



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

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

（4）【分配方針】

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

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

ニ．投資する株式等の範囲

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

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

1.投資信託財産に属する株券及び新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

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

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

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券

指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

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

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

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

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

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

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

チ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

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

（ロ）金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

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

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

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

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

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

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

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

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

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

カ．資金の借入れ

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

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

タ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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。

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

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

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

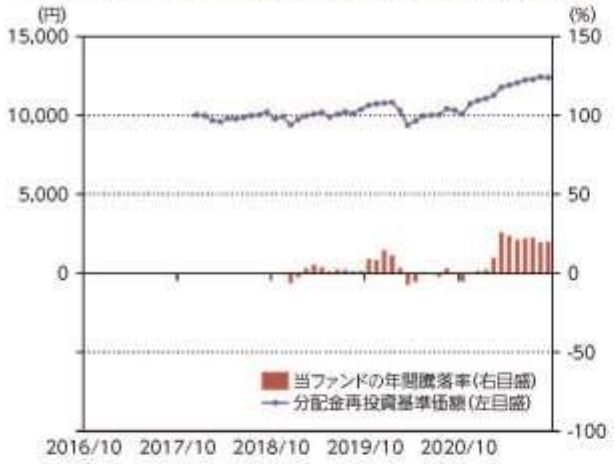
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

*当ファンドについては2018年12月～2021年9月の2年10ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2016年10月～2021年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(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0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（※）として当該基準価額から控除します。

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

（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0.55%（税抜　0.5%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	**年率　0.22%　（税抜　0.2%）**	**委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価**
販売会社	**年率　0.275%　（税抜　0.25%）**	**運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価**
受託会社	**年率　0.055%　（税抜　0.05%）**	**運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価**

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

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

③信託報酬に係る消費税等に相当する額を、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（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

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

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

（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）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」をご利用の場合

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

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

販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

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

5【運用状況】

以下は、2021年9月30日現在の状況について記載してあります。

【ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	214,629,105	96.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	6,896,508	3.11
合計(純資産総額)		221,525,613	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	12,046,249	4.0138	48,351,728	3.9103	47,104,447	21.26
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	23,637,619	1.9723	46,621,992	1.9766	46,722,117	21.09
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	13,223,856	3.0830	40,769,818	3.0660	40,544,342	18.30
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	23,915,112	1.4128	33,789,171	1.4101	33,722,699	15.22
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	10,568,083	2.3832	25,186,578	2.2791	24,085,717	10.87
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	10,208,159	2.2894	23,371,171	2.1992	22,449,783	10.13

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	96.89
合計	96.89

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

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

第3期計算期間末	(2020年 9月 7日)	147,615,298	147,615,298	10,379	10,379
第4期計算期間末	(2021年 9月 6日)	222,181,297	222,181,297	12,585	12,585
	2020年 9月末日	149,408,500	—	10,323	—
	10月末日	150,229,298	—	10,083	—
	11月末日	162,441,774	—	10,729	—
	12月末日	167,864,405	—	10,948	—
	2021年 1月末日	173,924,273	—	11,058	—
	2月末日	180,494,354	—	11,289	—
	3月末日	191,178,976	—	11,783	—
	4月末日	193,879,780	—	11,918	—
	5月末日	199,304,221	—	12,052	—
	6月末日	204,499,227	—	12,231	—
	7月末日	209,865,821	—	12,276	—
	8月末日	217,510,700	—	12,438	—
	9月末日	221,525,613	—	12,385	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	0
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	0
第3期計算期間	2019年 9月 6日～2020年 9月 7日	0
第4期計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	△0.3
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	2.2
第3期計算期間	2019年 9月 6日～2020年 9月 7日	1.9
第4期計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	21.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	44,509,649	2,557,562	41,952,087
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	54,949,184	10,565,823	86,335,448

第3期計算期間	2019年 9月 6日～2020年 9月 7日	68,964,944	13,069,234	142,231,158
第4期計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	56,921,923	22,602,543	176,550,538

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	559,165,884,100	84.08
地方債証券	日本	36,499,280,427	5.49
特殊債券	日本	39,876,899,990	6.00
社債券	日本	27,470,591,160	4.13
	フランス	1,100,384,000	0.17
	オーストラリア	400,428,000	0.06
	小計	28,971,403,160	4.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	497,106,837	0.07
合計(純資産総額)		665,010,574,514	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）	8,160,000,000	100.95	8,237,520,000	100.81	8,226,667,200	0.100	2025/9/20	1.24
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	7,830,000,000	101.05	7,912,234,600	101.03	7,911,275,400	0.100	2028/3/20	1.19
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	7,750,000,000	100.74	7,807,350,000	100.64	7,799,600,000	0.100	2024/9/20	1.17
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	6,890,000,000	100.57	6,929,828,200	100.42	6,919,351,400	0.005	2026/6/20	1.04
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	6,880,000,000	100.60	6,921,280,000	100.48	6,913,643,200	0.100	2023/12/20	1.04
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	100.54	6,796,706,800	100.43	6,789,338,400	0.100	2023/9/20	1.02
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	6,640,000,000	100.98	6,705,404,000	100.92	6,701,287,200	0.100	2026/9/20	1.01
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	6,350,000,000	101.01	6,414,706,500	100.98	6,412,738,000	0.100	2027/3/20	0.96

日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	6,310,000,000	100.91	6,367,421,000	100.78	6,359,407,300	0.100	2025/6/20	0.96
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	6,300,000,000	100.70	6,344,352,000	100.59	6,337,737,000	0.100	2024/6/20	0.95
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	6,170,000,000	102.24	6,308,208,000	102.03	6,295,436,100	0.400	2025/9/20	0.95
日本	国債証券	第４２７回利付国債（２年）	5,990,000,000	100.26	6,006,097,900	100.23	6,004,256,200	0.005	2023/8/1	0.90
日本	国債証券	第３２８回利付国債（１０年）	5,940,000,000	101.22	6,012,937,800	101.04	6,002,310,600	0.600	2023/3/20	0.90
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	5,810,000,000	100.67	5,849,405,100	100.33	5,829,579,700	0.100	2031/6/20	0.88
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	5,690,000,000	100.66	5,727,554,000	100.54	5,720,953,600	0.100	2024/3/20	0.86
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	5,700,000,000	100.35	5,720,406,000	100.26	5,714,934,000	0.100	2022/12/20	0.86
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	5,660,000,000	100.46	5,686,036,000	100.71	5,700,525,600	0.100	2030/9/20	0.86
日本	国債証券	第１４７回利付国債（５年）	5,450,000,000	100.54	5,479,970,900	100.44	5,474,416,000	0.005	2026/3/20	0.82
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	5,340,000,000	101.84	5,438,463,400	101.71	5,431,634,400	0.300	2025/12/20	0.82
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	5,380,000,000	100.80	5,423,201,400	100.67	5,416,476,400	0.100	2024/12/20	0.81
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	5,260,000,000	100.90	5,307,718,000	100.91	5,308,234,200	0.100	2029/9/20	0.80
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	5,220,000,000	100.96	5,270,112,000	100.87	5,265,622,800	0.100	2026/3/20	0.79
日本	国債証券	第３２７回利付国債（１０年）	5,190,000,000	101.34	5,260,064,100	101.11	5,247,609,000	0.800	2022/12/20	0.79
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	5,150,000,000	100.95	5,199,383,100	100.96	5,199,749,000	0.100	2029/6/20	0.78
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	5,090,000,000	101.05	5,143,906,100	101.04	5,143,394,100	0.100	2027/9/20	0.77
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	5,090,000,000	100.95	5,138,452,200	100.97	5,139,474,800	0.100	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	5,010,000,000	101.05	5,062,991,900	101.01	5,060,751,300	0.100	2028/9/20	0.76
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	4,860,000,000	102.23	4,968,378,000	101.96	4,955,401,800	0.600	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	4,920,000,000	100.34	4,936,773,600	100.59	4,949,372,400	0.100	2030/12/20	0.74
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	101.87	4,889,760,000	101.59	4,876,320,000	0.600	2023/12/20	0.73

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.08
地方債証券	5.49
特殊債券	6.00
社債券	4.36
合計	99.93

(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	486,963,215,070	98.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	6,740,158,535	1.37
合計(純資産総額)		493,703,373,605	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	6,781,870,000	1.37

(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	8,862,000	1,826.95	16,190,430,900	2,000.00	17,724,000,000	3.59
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,096,000	10,790.97	11,826,903,120	12,455.00	13,650,680,000	2.76
日本	株式	キーエンス	電気機器	171,700	54,031.40	9,277,191,380	67,000.00	11,503,900,000	2.33
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,362,300	8,223.42	11,202,765,066	6,480.00	8,827,704,000	1.79
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,197,600	5,560.39	6,659,123,064	6,832.00	8,182,003,200	1.66

日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,804,000	619.33	7,310,571,320	657.90	7,765,851,600	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,008,100	2,929.82	5,883,371,542	3,085.00	6,194,988,500	1.25
日本	株式	信越化学工業	化学	316,900	18,834.99	5,968,808,331	18,900.00	5,989,410,000	1.21
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	341,400	14,392.68	4,913,660,952	17,475.00	5,965,965,000	1.21
日本	株式	日立製作所	電気機器	841,200	5,752.88	4,839,322,656	6,640.00	5,585,568,000	1.13
日本	株式	ダイキン工業	機械	222,900	21,648.34	4,825,414,986	24,460.00	5,452,134,000	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	100,100	67,456.49	6,752,394,649	54,310.00	5,436,431,000	1.10
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,455,600	3,718.44	5,412,561,264	3,699.00	5,384,264,400	1.09
日本	株式	日本電産	電気機器	421,200	12,536.45	5,280,352,740	12,420.00	5,231,304,000	1.06
日本	株式	村田製作所	電気機器	514,100	8,293.50	4,263,688,350	9,960.00	5,120,436,000	1.04
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	102,500	48,605.05	4,982,017,625	49,670.00	5,091,175,000	1.03
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,376,800	3,708.10	5,105,312,080	3,691.00	5,081,768,800	1.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,377,500	3,358.19	4,625,906,725	3,455.00	4,759,262,500	0.96
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,194,100	3,947.04	4,713,160,464	3,944.00	4,709,530,400	0.95
日本	株式	第一三共	医薬品	1,374,900	2,524.88	3,471,457,512	2,979.50	4,096,514,550	0.83
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,205,200	3,249.74	3,916,586,648	3,277.00	3,949,440,400	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	153,500	26,283.61	4,034,534,135	24,565.00	3,770,727,500	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,344,800	1,670.42	3,916,800,816	1,584.50	3,715,335,600	0.75
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,049,100	2,988.42	3,135,151,422	3,536.00	3,709,617,600	0.75
日本	株式	ＳＭＣ	機械	51,200	65,569.29	3,357,147,648	70,080.00	3,588,096,000	0.73
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	674,100	4,746.14	3,199,372,974	5,085.00	3,427,798,500	0.69
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	568,300	5,180.54	2,944,100,882	6,021.00	3,421,734,300	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	1,338,200	2,417.39	3,234,951,298	2,464.00	3,297,324,800	0.67
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	177,800	16,297.81	2,897,750,618	18,130.00	3,223,514,000	0.65
日本	株式	富士通	電気機器	157,400	17,851.70	2,809,857,580	20,310.00	3,196,794,000	0.65

(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	0.20
		建設業	2.28
		食料品	3.39
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.22
		化学	6.96
		医薬品	5.08
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.71

		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.80
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.59
		機械	5.30
		電気機器	18.34
		輸送用機器	7.60
		精密機器	2.93
		その他製品	2.17
		電気・ガス業	1.12
		陸運業	3.25
		海運業	0.47
		空運業	0.48
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.32
		卸売業	4.70
		小売業	4.44
		銀行業	4.94
		証券、商品先物取引業	0.73
		保険業	2.00
		その他金融業	1.13
		不動産業	1.98
		サービス業	5.95
		小計	98.63
合計			98.63

(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	334	円	6,892,842,900	6,781,870,000	1.37

(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	134,932,172,129	45.28
	フランス	29,622,702,495	9.94
	イタリア	27,461,878,651	9.22
	ドイツ	21,707,171,356	7.28
	イギリス	17,578,771,598	5.90
	スペイン	17,294,069,722	5.80
	ベルギー	6,896,932,231	2.31
	カナダ	5,678,752,870	1.91
	オランダ	5,426,604,668	1.82
	オーストラリア	5,317,259,436	1.78
	オーストリア	4,316,071,697	1.45
	アイルランド	2,387,323,410	0.80
	メキシコ	2,022,045,883	0.68
	フィンランド	1,776,218,290	0.60
	ポーランド	1,653,700,172	0.55
	デンマーク	1,474,819,643	0.49
	マレーシア	1,391,435,058	0.47
	イスラエル	1,334,084,483	0.45
	シンガポール	1,315,315,589	0.44
	スウェーデン	845,879,468	0.28
	ノルウェー	711,599,017	0.24
	小計	291,144,807,866	97.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	6,856,488,758	2.30
合計(純資産総額)		298,001,296,624	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	2,132,607,620	0.72
	買建	ドイツ	2,524,575,795	0.85

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

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

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	—	4,661,369,340	1.56
	売建	—	78,629,011	△0.03

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

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

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	10,320.24	1,646,079,585	10,405.93	1,659,746,940	0.625	2030/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	10,742.57	1,616,756,972	10,832.63	1,630,311,105	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,362.21	1,461,072,763	10,440.03	1,472,045,288	0.625	2030/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/51	13,600,000	10,455.81	1,421,990,925	10,686.61	1,453,379,129	1.875	2051/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	11,193.74	1,455,187,337	11,153.09	1,449,901,744	0.250	2024/3/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/40	13,000,000	9,745.78	1,266,951,887	10,052.68	1,306,849,626	1.375	2040/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	11,069.58	1,273,002,563	10,997.88	1,264,757,206	0.500	2026/2/28	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	11,400.77	1,271,186,881	11,313.53	1,261,459,505	1.625	2031/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	11,189.81	1,230,879,550	11,108.93	1,221,982,787	0.750	2026/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,847.78	1,210,843,243	11,740.23	1,199,851,831	2.000	2026/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,900.68	1,207,919,111	11,780.89	1,195,760,495	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,531.84	1,174,300,932	10,614.91	1,183,562,743	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,493.00	1,149,300,358	11,422.83	1,142,283,500	2.000	2022/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/50	11,300,000	9,865.98	1,114,855,951	10,070.17	1,137,929,992	1.625	2050/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	11,217.79	1,138,606,100	11,200.52	1,136,853,304	0.250	2023/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	11,132.67	1,113,267,680	11,135.60	1,113,560,284	0.250	2024/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	11,162.70	1,116,270,841	11,131.66	1,113,166,818	0.125	2024/1/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	11,035.92	1,103,592,409	10,974.71	1,097,471,784	0.250	2025/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,810.77	1,081,077,250	10,791.53	1,079,153,625	0.625	2027/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	11,395.94	1,082,615,062	11,343.48	1,077,631,124	1.500	2022/9/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,997.73	1,073,797,425	11,883.63	1,063,584,945	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	11,334.92	1,076,817,574	11,157.89	1,060,000,445	1.250	2028/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,639.96	1,061,757,060	12,566.51	1,055,587,470	3.125	2028/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,729.45	1,019,298,289	10,705.41	1,017,013,982	0.375	2027/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,986.80	1,024,871,992	11,891.93	1,016,760,627	2.250	2027/8/15	0.34
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000	22,409.94	1,012,929,298	22,462.01	1,015,283,036	4.500	2041/4/25	0.34
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	15,904.21	1,014,688,848	15,868.50	1,012,410,454	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,627.00	1,020,850,739	11,529.94	1,012,329,251	1.625	2026/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	11,189.20	1,008,147,101	11,157.46	1,005,287,341	0.375	2024/7/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	11,157.97	1,004,217,869	11,126.42	1,001,377,974	0.250	2024/6/15	0.34

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	97.70
合計	97.70

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	58	アメリカドル	7,148,967.14	800,112,402	7,114,062.5	796,205,875	0.27
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	40	アメリカドル	5,312,721.52	594,599,793	5,258,750	588,559,300	0.20
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	42	アメリカドル	6,814,961.35	762,730,474	6,681,937.5	747,842,445	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	25	ユーロ	2,806,472.5	364,448,519	2,805,250	364,289,765	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	35	ユーロ	4,741,963.5	615,791,380	4,725,000	613,588,500	0.21
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	70	ユーロ	12,017,377	1,560,576,577	11,910,500	1,546,697,530	0.52

(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	19,350,000.00	2,133,110,027	2,165,352,075	0.73
	カナダドル	買建	3,120,000.00	271,850,894	273,918,840	0.09
	ユーロ	買建	14,770,000.00	1,917,063,337	1,918,261,135	0.64
	イギリスポンド	買建	2,020,000.00	306,663,920	303,837,290	0.10
	カナダドル	売建	895,497.87	78,623,727	78,629,011	△0.03

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

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

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	344,194,019,791	66.57
	イギリス	21,327,736,235	4.13
	カナダ	17,576,264,659	3.40
	スイス	16,292,266,216	3.15
	フランス	16,062,694,582	3.11
	ドイツ	14,103,169,586	2.73
	オランダ	10,450,957,137	2.02
	アイルランド	9,472,295,686	1.83
	オーストラリア	9,369,443,000	1.81
	スウェーデン	5,356,228,340	1.04
	デンマーク	4,072,671,429	0.79
	スペイン	3,773,442,191	0.73
	香港	3,405,309,610	0.66
	イタリア	2,904,932,127	0.56
	フィンランド	1,957,982,261	0.38
	ジャージー	1,570,114,883	0.30
	シンガポール	1,372,918,552	0.27
	ベルギー	1,296,081,034	0.25
	バミューダ	1,158,246,620	0.22
	ケイマン	998,806,745	0.19
	ノルウェー	987,078,646	0.19
	イスラエル	985,885,555	0.19
	ニュージーランド	501,136,115	0.10
	ルクセンブルク	496,510,489	0.10
	キュラソー	396,196,384	0.08
	オーストリア	342,205,134	0.07
	ポルトガル	250,534,753	0.05
	パナマ	201,419,111	0.04
	リベリア	195,517,401	0.04
	マン島	161,635,455	0.03
	パプアニューギニア	64,542,137	0.01
	小計	491,298,241,864	95.02
投資信託受益証券	オーストラリア	216,518,588	0.04
	香港	81,880,151	0.02
	小計	298,398,739	0.06

投資証券	アメリカ	9,550,254,272	1.85
	オーストラリア	688,623,359	0.13
	イギリス	300,430,262	0.06
	フランス	249,172,113	0.05
	シンガポール	230,863,835	0.04
	香港	159,979,297	0.03
	カナダ	75,892,858	0.01
	小計	11,255,215,996	2.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	14,176,715,369	2.74
合計(純資産総額)		517,028,571,968	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	10,539,740,033	2.04
	買建	カナダ	802,228,647	0.16
	買建	ドイツ	2,014,757,668	0.39
	買建	イギリス	425,716,900	0.08
	買建	オーストラリア	534,077,388	0.10

(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	—	1,237,360,995	0.24
	売建	—	317,341,726	△0.06

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,380,967	13,946.35	19,259,450,778	15,985.53	22,075,494,379	4.27
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	592,083	27,944.18	16,545,277,242	31,785.27	18,819,523,938	3.64
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	37,556	362,280.56	13,605,808,832	369,461.35	13,875,490,476	2.68
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	198,185	36,791.46	7,291,515,818	38,009.15	7,532,843,631	1.46
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	24,877	263,778.65	6,562,021,525	300,736.87	7,481,431,224	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	24,088	269,901.79	6,501,394,443	301,111.80	7,253,181,193	1.40
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	67,711	70,734.55	4,789,507,738	87,444.21	5,920,935,255	1.15
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	206,048	18,219.45	3,754,082,634	22,962.62	4,731,403,244	0.92
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	250,254	18,381.74	4,600,104,163	18,573.12	4,647,998,574	0.90
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	217,670	18,942.45	4,123,205,268	18,357.11	3,995,793,962	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	139,816	25,439.41	3,556,837,387	25,370.02	3,547,135,499	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	77,990	46,102.08	3,595,501,719	44,813.88	3,495,035,063	0.68
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	109,624	32,394.12	3,551,173,537	31,034.29	3,402,103,752	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	87,860	35,692.40	3,135,934,897	37,709.20	3,313,130,804	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	201,599	15,092.41	3,042,615,167	15,894.87	3,204,391,591	0.62
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	237,137	13,321.06	3,158,917,533	13,481.70	3,197,011,031	0.62
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	637,169	4,744.28	3,022,913,750	4,820.39	3,071,405,879	0.59
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	34,516	71,721.67	2,475,545,438	84,110.32	2,903,151,874	0.56
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	150,108	19,994.50	3,001,335,607	19,326.34	2,901,039,085	0.56
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	73,080	40,356.11	2,949,224,781	39,529.02	2,888,781,132	0.56
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	92,194	29,101.43	2,682,978,012	28,987.27	2,672,453,292	0.52
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	39,486	56,472.59	2,229,876,830	64,656.18	2,553,014,081	0.49
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	36,617	56,274.49	2,060,603,191	67,046.79	2,455,052,500	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	80,235	26,579.88	2,132,636,736	30,274.36	2,429,063,275	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	378,603	6,417.49	2,429,682,026	6,259.68	2,369,935,747	0.46

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	57,934	37,834.12	2,191,882,371	40,525.43	2,347,800,493	0.45
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	349,538	6,532.77	2,283,451,500	6,701.76	2,342,523,142	0.45
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	462,196	4,334.66	2,003,463,253	4,871.87	2,251,762,339	0.44
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	347,932	5,920.56	2,059,955,065	6,209.32	2,160,421,683	0.42
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	32,450	52,546.44	1,705,131,978	64,868.83	2,104,993,598	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	3.28
		素材	3.95
		資本財	6.14
		商業・専門サービス	1.23
		運輸	1.85
		自動車・自動車部品	2.07
		耐久消費財・アパレル	1.82
		消費者サービス	1.86
		メディア・娯楽	7.33
		小売	5.57
		食品・生活必需品小売り	1.39
		食品・飲料・タバコ	3.68
		家庭用品・パーソナル用品	1.67
		ヘルスケア機器・サービス	5.06
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.35
		銀行	6.04
		各種金融	4.59
		保険	2.97
		不動産	0.45
		ソフトウェア・サービス	12.09
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.80
		電気通信サービス	1.58

		公益事業	2.73
		半導体・半導体製造装置	4.52
		小計	95.02
投資信託受益証券	—	—	0.06
投資証券	—	—	2.18
合計			97.26

(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	433	アメリカドル	96,260,418.5	10,773,466,039	94,172,087.5	10,539,740,033	2.04
	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	9,313,261	817,797,448	9,135,960	802,228,647	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	51	スイスフラン	6,114,287	732,980,725	5,935,380	711,533,354	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	247	ユーロ	10,240,981.5	1,329,893,857	10,035,610	1,303,224,314	0.25
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	37	オーストラリアドル	6,840,109	550,355,170	6,637,800	534,077,388	0.10
	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	40	イギリスポンド	2,801,435	421,419,867	2,830,000	425,716,900	0.08

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	9,213,000.00	1,029,217,830	1,031,101,956	0.20
	カナダドル	買建	271,000.00	23,863,718	23,796,239	0.00
	ユーロ	買建	790,000.00	103,012,840	102,590,190	0.02
	イギリスポンド	買建	260,000.00	39,296,140	39,111,540	0.01
	スイスフラン	買建	340,000.00	40,755,800	40,761,070	0.01
	カナダドル	売建	3,614,000.00	317,500,742	317,341,726	△0.06

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

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

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	104,962,167,500	96.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,799,457,463	3.49
合計(純資産総額)		108,761,624,963	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	3,789,504,000	3.48

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	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	10,472	586,353.1	6,140,289,674	725,000	7,592,200,000	6.98
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,240	562,171.15	5,194,461,502	668,000	6,172,320,000	5.68
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	29,927	158,251.63	4,735,996,713	183,200	5,482,626,400	5.04
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	14,640	333,929.81	4,888,732,561	372,500	5,453,400,000	5.01
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	46,623	86,789.29	4,046,377,498	107,300	5,002,647,900	4.60
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	29,881	139,358.71	4,164,177,710	160,600	4,798,888,600	4.41
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	13,875	254,666.84	3,533,502,521	326,500	4,530,187,500	4.17
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	18,411	163,113.4	3,003,080,865	194,000	3,571,734,000	3.28
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	9,239	311,140.59	2,874,627,993	362,000	3,344,518,000	3.08
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,802	129,999.71	2,704,254,026	150,800	3,136,941,600	2.88
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	13,118	179,374.08	2,353,029,248	202,700	2,659,018,600	2.44

日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	27,178	76,575.52	2,081,169,530	92,400	2,511,247,200	2.31
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,073	325,211.04	1,975,006,650	405,000	2,459,565,000	2.26
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,925	411,565.15	2,026,958,369	457,000	2,250,725,000	2.07
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,858	645,718.25	1,845,462,783	767,000	2,192,086,000	2.02
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	11,312	164,696.26	1,863,044,182	187,500	2,121,000,000	1.95
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	3,435	507,147.03	1,742,050,056	590,000	2,026,650,000	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	6,038	294,308.54	1,777,034,982	331,000	1,998,578,000	1.84
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,191	590,720.16	1,884,988,056	625,000	1,994,375,000	1.83
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	28,308	58,170.99	1,646,704,611	67,100	1,899,466,800	1.75
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	40,671	38,611.77	1,570,379,525	43,900	1,785,456,900	1.64
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	10,866	134,348.76	1,459,833,653	151,000	1,640,766,000	1.51
日本	投資証券	イオンリート投資法人	10,867	129,737.62	1,409,858,794	149,800	1,627,876,600	1.50
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,239	394,011.75	1,276,204,069	489,000	1,583,871,000	1.46
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,954	641,055.84	1,252,623,123	752,000	1,469,408,000	1.35
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,161	305,112.81	1,269,574,430	343,500	1,429,303,500	1.31
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,123	149,186.83	1,211,844,630	175,500	1,425,586,500	1.31
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	6,311	179,046.65	1,129,963,422	217,200	1,370,749,200	1.26
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	12,077	101,635.56	1,227,452,766	111,800	1,350,208,600	1.24
日本	投資証券	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	8,346	124,165.4	1,036,284,450	153,400	1,280,276,400	1.18

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	96.51
合計	96.51

(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	3,917,289,600	3,789,504,000	3.48

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

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

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	70,492,892,679	75.20
	オーストラリア	6,325,109,335	6.75
	イギリス	5,066,492,407	5.40
	シンガポール	3,320,269,016	3.54
	カナダ	1,841,082,903	1.96
	フランス	1,816,914,722	1.94
	香港	1,257,377,421	1.34
	ベルギー	1,239,784,200	1.32
	スペイン	400,515,938	0.43
	ニュージーランド	391,774,387	0.42
	ガーンジー	249,493,764	0.27
	ドイツ	248,936,815	0.27
	オランダ	160,322,393	0.17
	韓国	156,776,906	0.17
	アイルランド	106,310,045	0.11
	イスラエル	69,070,302	0.07
	イタリア	28,311,408	0.03
	小計	93,171,434,641	99.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	572,589,287	0.61
合計(純資産総額)		93,744,023,928	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	—	186,393,161	0.20

(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	407,789	11,337.91	4,623,478,676	14,151.16	5,770,689,343	6.16
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	49,516	83,496.76	4,134,425,845	89,712.83	4,442,220,668	4.74
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	84,111	25,400.73	2,136,481,320	33,835.65	2,845,950,727	3.04
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	180,666	9,172.96	1,657,242,570	14,980.49	2,706,465,568	2.89
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	155,930	15,559.48	2,426,190,836	16,425.37	2,561,209,379	2.73
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	232,805	7,584.92	1,765,809,592	9,377.77	2,183,193,328	2.33
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	76,989	18,831.85	1,449,845,835	25,182.00	1,938,736,998	2.07
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	187,881	6,803.43	1,278,236,980	9,127.07	1,714,804,166	1.83
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,474	17,872.03	1,366,745,797	21,582.65	1,650,511,790	1.76
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	215,234	6,972.84	1,500,793,828	7,392.31	1,591,077,742	1.70
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	924,643	1,616.86	1,495,023,436	1,710.57	1,581,675,453	1.69
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	73,700	12,302.24	906,675,560	19,251.35	1,418,825,173	1.51
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	316,837	3,184.06	1,008,829,698	4,359.28	1,381,182,465	1.47
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	215,888	5,252.29	1,133,907,926	6,313.40	1,362,988,854	1.45
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,696	14,478.68	922,234,285	21,259.20	1,354,126,258	1.44
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	63,566	15,781.35	1,003,157,866	21,145.04	1,344,105,969	1.43
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	35,765	28,842.90	1,031,566,433	36,254.24	1,296,633,094	1.38
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	661,864	1,392.41	921,589,765	1,814.18	1,200,744,270	1.28
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	208,931	4,397.92	918,862,780	5,441.55	1,136,908,567	1.21
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	296,212	3,287.09	973,675,622	3,806.39	1,127,501,120	1.20
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	339,170	2,783.48	944,073,190	3,231.13	1,095,902,498	1.17
香港	投資証券	LINK REIT	1,149,400	915.14	1,051,865,594	938.29	1,078,476,273	1.15
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	77,965	10,119.80	788,990,706	12,447.74	970,488,236	1.04
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	55,206	11,503.29	635,051,062	16,798.07	927,354,407	0.99
アメリカ	投資証券	UDR INC	154,487	4,388.64	677,988,416	5,991.07	925,543,605	0.99
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,531	6,714.78	634,755,185	8,888.68	840,256,414	0.90
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	101,244	7,568.55	766,270,368	8,276.48	837,944,346	0.89
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	339,870	1,532.78	520,946,478	2,400.68	815,920,471	0.87
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	160,382	3,154.08	505,859,008	4,959.17	795,362,437	0.85
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	326,646	2,167.50	708,007,613	2,314.50	756,023,996	0.81

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	99.39
合計	99.39

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

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	1,400,000.00	156,431,000	156,685,050	0.17
	ユーロ	買建	150,000.00	19,559,400	19,479,150	0.02
	イギリスポンド	買建	68,000.00	10,228,492	10,228,961	0.01

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

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

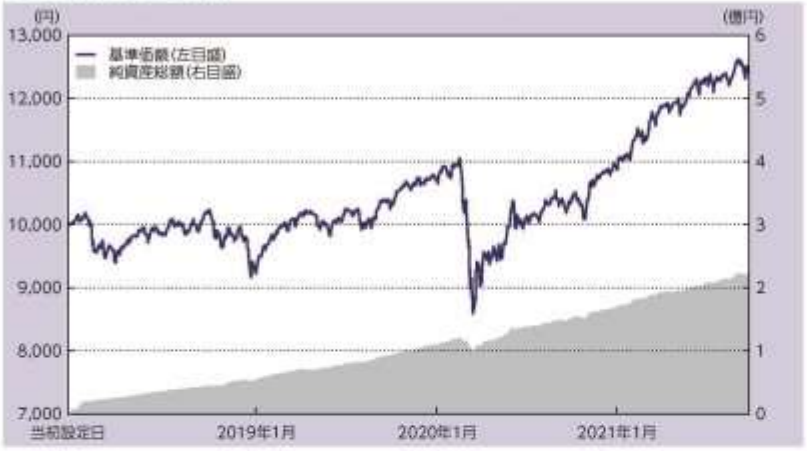
≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2017年12月19日
作成基準日：2021年９月30日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	12,385円
純資産総額	2.22億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2018年９月	0円
2019年９月	0円
2020年９月	0円
2021年９月	0円
－	－
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	21.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.9%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
国内株式インデックスマザーファンド	21.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.8%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
外国債券インデックスマザーファンド	18.3%	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	15.2%	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	10.9%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.7%
		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	10.1%	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)

※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

＜申込手数料＞

ありません。

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

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

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

＜申込受付の中止等＞

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

＜その他＞

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委

託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。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0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

＜一部解約代金の支払い＞

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

＜受付不可日＞

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜一部解約受付の中止等＞

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口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マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

③外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2017年12月19日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年9月6日から翌年9月5日までとします。
ただし、第1計算期間は、2017年12月19日から2018年9月5日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

え、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

替口座簿に記載又は記録されます。

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

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2020年9月8日から2021年9月6日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 （2020年 9月 7日現在）	第4期 （2021年 9月 6日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,793,897	7,310,108
親投資信託受益証券	142,226,210	215,460,366
未収入金	36,080	-
流動資産合計	148,056,187	222,770,474
資産合計	148,056,187	222,770,474
負債の部		
流動負債		
未払解約金	80,650	29,741
未払受託者報酬	35,678	55,397
未払委託者報酬	321,037	498,547
未払利息	14	6
その他未払費用	3,510	5,486
流動負債合計	440,889	589,177
負債合計	440,889	589,177
純資産の部		
元本等		
元本	142,231,158	176,550,538
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,384,140	45,630,759
（分配準備積立金）	4,729,476	37,310,326
元本等合計	147,615,298	222,181,297
純資産合計	147,615,298	222,181,297
負債純資産合計	148,056,187	222,770,474

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2019年 9月 6日 至　2020年 9月 7日	第4期 自　2020年 9月 8日 至　2021年 9月 6日
営業収益		
受取利息	16	24
有価証券売買等損益	3,446,576	36,469,518
営業収益合計	3,446,592	36,469,542
営業費用		
支払利息	1,808	1,884
受託者報酬	64,194	100,058
委託者報酬	577,586	900,403
その他費用	6,311	9,896
営業費用合計	649,899	1,012,241
営業利益又は営業損失（△）	2,796,693	35,457,301
経常利益又は経常損失（△）	2,796,693	35,457,301
当期純利益又は当期純損失（△）	2,796,693	35,457,301
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（△）	56,807	2,255,409
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,621,582	5,384,140
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,298,966	8,094,086
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,298,966	8,094,086
剰余金減少額又は欠損金増加額	276,294	1,049,359
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	276,294	1,049,359
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,384,140	45,630,759

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第3期 (2020年 9月 7日現在)	第4期 (2021年 9月 6日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	142,231,158口	176,550,538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 1.0379円 (1万口当たり純資産額) (10,379円)	1口当たり純資産額 1.2585円 (1万口当たり純資産額) (12,585円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第3期
自 2019年 9月 6日
至 2020年 9月 7日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,023,572円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	716,314円
収益調整金額	C	2,652,249円
分配準備積立金額	D	1,989,590円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,381,725円
当ファンドの期末残存口数	F	142,231,158口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	518円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第4期
自 2020年 9月 8日
至 2021年 9月 6日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,450,076円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	29,751,816円
収益調整金額	C	8,320,433円
分配準備積立金額	D	4,108,434円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	45,630,759円
当ファンドの期末残存口数	F	176,550,538口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,584円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第4期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
３.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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4期 (2021年 9月 6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3期 自 2019年 9月 6日 至 2020年 9月 7日	第4期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	86,335,448円	142,231,158円
期中追加設定元本額	68,964,944円	56,921,923円
期中一部解約元本額	13,069,234円	22,602,543円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第3期 (2020年 9月 7日現在)	第4期 (2021年 9月 6日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,481,584	35,089,396
合計	3,481,584	35,089,396

（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	10,127,160	23,191,196	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	10,488,369	25,006,369	
	国内株式インデックス　マザーファンド	23,458,404	46,259,972	
	外国株式インデックス　マザーファンド	11,954,112	47,990,978	
	国内債券インデックス　マザーファンド	23,697,562	33,482,285	
	外国債券インデックス　マザーファンド	12,819,707	39,529,566	
合計		92,545,314	215,460,366	

(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 9月 6日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	631,981,935
国債証券	554,132,258,750
地方債証券	36,962,228,238
特殊債券	40,427,122,979
社債券	29,205,693,740
未収入金	904,209,600
未収利息	1,511,542,621
前払費用	81,592,688
流動資産合計	663,856,630,551
資産合計	663,856,630,551
負債の部	
流動負債	
未払金	500,006,000

	2021年 9月 6日現在
項目	金額（円）
未払解約金	361,228,497
未払利息	596
流動負債合計	861,235,093
負債合計	861,235,093
純資産の部	
元本等	
元本	469,252,648,029
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	193,742,747,429
元本等合計	662,995,395,458
純資産合計	662,995,395,458
負債純資産合計	663,856,630,551

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 9月 6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 9月 6日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		469,252,648,029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	101,215,000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	1.4129円
	(1万口当たり純資産額)	(14,129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 9月 6日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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 9月 6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。

	2021年 9月 6日現在

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年 9月 6日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	393,927,301,623円
期中追加設定元本額	95,056,359,861円
期中一部解約元本額	19,731,013,455円
期末元本額	469,252,648,029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）	3,788,785,322円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	13,636,761円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	20,818,384,447円
世界経済インデックスファンド	2,822,668,382円
ＤＣマイセレクション２５	24,611,541,898円
ＤＣマイセレクション５０	27,890,849,279円
ＤＣマイセレクション７５	8,140,216,295円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	437,122,234円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	93,048,234,888円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	68,825,344,686円
ＤＣマイセレクションＳ２５	11,720,975,623円
ＤＣマイセレクションＳ５０	13,050,281,600円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,742,412,382円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	883,635,941円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	2,030,086,145円

区分	2021年 9月 6日現在
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	739,333,598円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,051,117,231円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	9,623,138円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,651,160円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	39,159,984円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	9,005,829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）	107,305,445円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	177,133,176円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	38,608,198円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	33,490,682円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,327,135,874円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	799,889,878円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,388,833,698円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	222,735,509円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	85,333,118円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,084,908,137円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,219,986,605円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,524,697,870円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	144,423,466円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	5,805,998,869円
日本債券ファンド・シリーズ１	13,843,333,997円
分散投資コア戦略ファンドＡ	32,031,901,748円
分散投資コア戦略ファンドＳ	40,220,299,123円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	136,110,842円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,265,101,737円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	58,376,260円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	34,141,448円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	57,956,160円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	26,583,030円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	48,811,410円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	79,486,343円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,199,751円
グローバル経済コア	195,498,424円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	23,697,562円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	13,739,915円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	6,945,999円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	3,415,366円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	1,021,774円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	581,315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）	78,505,412,972円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	54,154,154円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,068円

区分	2021年 9月 6日現在
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	81,273円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 9月 6日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	773,811,850
地方債証券	18,188,960
特殊債券	12,438,364
社債券	32,070,580
合計	836,509,754

(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４１７回利付国債（２年）	3,240,000,000	3,247,938,000	
	第４１８回利付国債（２年）	1,040,000,000	1,042,756,000	
	第４１９回利付国債（２年）	570,000,000	571,618,800	
	第４２０回利付国債（２年）	1,250,000,000	1,253,787,500	
	第４２１回利付国債（２年）	590,000,000	591,905,700	
	第４２２回利付国債（２年）	130,000,000	130,442,000	
	第４２３回利付国債（２年）	410,000,000	410,865,100	
	第４２４回利付国債（２年）	570,000,000	571,265,400	
	第４２５回利付国債（２年）	2,870,000,000	2,876,457,500	
	第４２６回利付国債（２年）	620,000,000	621,463,200	

第４２７回利付国債（２年）	5,990,000,000	6,004,795,300	
第１３４回利付国債（５年）	5,700,000,000	5,716,131,000	
第１３５回利付国債（５年）	4,080,000,000	4,094,076,000	
第１３６回利付国債（５年）	4,400,000,000	4,417,292,000	
第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	6,791,028,400	
第１３８回利付国債（５年）	6,880,000,000	6,915,432,000	
第１３９回利付国債（５年）	5,690,000,000	5,722,489,900	
第１４０回利付国債（５年）	6,300,000,000	6,339,564,000	
第１４１回利付国債（５年）	7,750,000,000	7,801,925,000	
第１４２回利付国債（５年）	5,380,000,000	5,419,005,000	
第１４３回利付国債（５年）	4,800,000,000	4,836,576,000	
第１４４回利付国債（５年）	6,310,000,000	6,361,552,700	
第１４５回利付国債（５年）	8,240,000,000	8,311,770,400	
第１４６回利付国債（５年）	2,590,000,000	2,613,413,600	
第１４７回利付国債（５年）	5,450,000,000	5,477,250,000	
第１４８回利付国債（５年）	5,640,000,000	5,668,425,600	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	581,428,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,591,028,700	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	777,634,000	
第４回利付国債（４０年）	1,200,000,000	1,698,696,000	
第５回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,462,208,500	
第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,696,564,800	
第７回利付国債（４０年）	1,440,000,000	1,866,052,800	
第８回利付国債（４０年）	1,230,000,000	1,492,186,800	
第９回利付国債（４０年）	1,720,000,000	1,565,612,800	
第１０回利付国債（４０年）	2,370,000,000	2,519,191,500	
第１１回利付国債（４０年）	1,790,000,000	1,844,756,100	
第１２回利付国債（４０年）	1,710,000,000	1,591,787,700	
第１３回利付国債（４０年）	2,040,000,000	1,890,366,000	
第１４回利付国債（４０年）	940,000,000	929,913,800	
第３２６回利付国債（１０年）	3,120,000,000	3,152,697,600	
第３２７回利付国債（１０年）	5,190,000,000	5,251,086,300	
第３２８回利付国債（１０年）	4,750,000,000	4,802,440,000	
第３２９回利付国債（１０年）	3,810,000,000	3,872,293,500	
第３３０回利付国債（１０年）	1,900,000,000	1,935,663,000	
第３３１回利付国債（１０年）	900,000,000	913,221,000	
第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	4,879,152,000	
第３３３回利付国債（１０年）	3,030,000,000	3,085,388,400	
第３３４回利付国債（１０年）	4,860,000,000	4,958,415,000	
第３３５回利付国債（１０年）	2,370,000,000	2,414,745,600	
第３３６回利付国債（１０年）	1,050,000,000	1,071,462,000	
第３３７回利付国債（１０年）	2,800,000,000	2,838,780,000	

第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	4,643,265,600	
第３３９回利付国債（１０年）	4,750,000,000	4,842,957,500	
第３４０回利付国債（１０年）	6,170,000,000	6,298,829,600	
第３４１回利付国債（１０年）	4,440,000,000	4,518,366,000	
第３４２回利付国債（１０年）	5,220,000,000	5,268,702,600	
第３４３回利付国債（１０年）	4,820,000,000	4,867,477,000	
第３４４回利付国債（１０年）	6,640,000,000	6,707,196,800	
第３４５回利付国債（１０年）	3,740,000,000	3,779,718,800	
第３４６回利付国債（１０年）	6,350,000,000	6,420,612,000	
第３４７回利付国債（１０年）	3,880,000,000	3,923,999,200	
第３４８回利付国債（１０年）	5,090,000,000	5,148,687,700	
第３４９回利付国債（１０年）	4,130,000,000	4,179,560,000	
第３５０回利付国債（１０年）	7,830,000,000	7,925,134,500	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	4,610,000,000	4,668,178,200	
第３５２回利付国債（１０年）	5,010,000,000	5,073,777,300	
第３５３回利付国債（１０年）	4,430,000,000	4,486,748,300	
第３５４回利付国債（１０年）	5,090,000,000	5,155,508,300	
第３５５回利付国債（１０年）	5,150,000,000	5,214,426,500	
第３５６回利付国債（１０年）	5,260,000,000	5,323,646,000	
第３５７回利付国債（１０年）	2,800,000,000	2,832,564,000	
第３５８回利付国債（１０年）	3,790,000,000	3,832,106,900	
第３５９回利付国債（１０年）	4,030,000,000	4,072,516,500	
第３６０回利付国債（１０年）	5,720,000,000	5,774,282,800	
第３６１回利付国債（１０年）	4,920,000,000	4,961,032,800	
第３６２回利付国債（１０年）	4,850,000,000	4,884,580,500	
第３６３回利付国債（１０年）	4,250,000,000	4,274,820,000	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	135,129,500	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	193,036,800	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	144,321,600	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	139,355,700	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	60,492,000	
第６回利付国債（３０年）	350,000,000	433,268,500	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	222,624,000	
第８回利付国債（３０年）	350,000,000	416,409,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	274,968,000	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	178,240,000	
第１１回利付国債（３０年）	260,000,000	308,089,600	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	234,632,900	
第１３回利付国債（３０年）	400,000,000	490,444,000	
第１４回利付国債（３０年）	800,000,000	1,023,288,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	440,493,800	
第１６回利付国債（３０年）	200,000,000	259,926,000	

第１７回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,485,087,000	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	442,200,300	
第１９回利付国債（３０年）	530,000,000	681,580,000	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	632,448,000	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	646,720,000	
第２２回利付国債（３０年）	420,000,000	556,407,600	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	571,599,000	
第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	506,464,000	
第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	457,313,500	
第２６回利付国債（３０年）	1,140,000,000	1,510,956,000	
第２７回利付国債（３０年）	1,920,000,000	2,588,025,600	
第２８回利付国債（３０年）	2,140,000,000	2,897,495,800	
第２９回利付国債（３０年）	1,670,000,000	2,243,845,400	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,359,604,700	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,452,616,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,560,000,000	2,094,846,000	
第３３回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,353,824,200	
第３４回利付国債（３０年）	1,795,000,000	2,395,517,250	
第３５回利付国債（３０年）	2,300,000,000	2,993,703,000	
第３６回利付国債（３０年）	2,310,000,000	3,016,975,500	
第３７回利付国債（３０年）	2,240,000,000	2,891,929,600	
第３８回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,912,515,000	
第３９回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,946,940,000	
第４０回利付国債（３０年）	1,600,000,000	2,045,328,000	
第４１回利付国債（３０年）	990,000,000	1,246,954,500	
第４２回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,891,305,000	
第４３回利付国債（３０年）	1,390,000,000	1,754,485,800	
第４４回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,541,506,600	
第４５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,758,672,000	
第４６回利付国債（３０年）	1,850,000,000	2,260,922,000	
第４７回利付国債（３０年）	1,480,000,000	1,843,680,400	
第４８回利付国債（３０年）	1,860,000,000	2,235,980,400	
第４９回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,731,902,400	
第５０回利付国債（３０年）	1,790,000,000	1,907,334,500	
第５１回利付国債（３０年）	1,760,000,000	1,669,483,200	
第５２回利付国債（３０年）	1,910,000,000	1,897,317,600	
第５３回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,279,656,000	
第５４回利付国債（３０年）	2,110,000,000	2,240,630,100	
第５５回利付国債（３０年）	1,540,000,000	1,634,309,600	
第５６回利付国債（３０年）	1,680,000,000	1,781,724,000	
第５７回利付国債（３０年）	1,610,000,000	1,706,342,400	
第５８回利付国債（３０年）	2,600,000,000	2,753,660,000	
第５９回利付国債（３０年）	1,050,000,000	1,084,230,000	

第６０回利付国債（３０年）	2,420,000,000	2,616,262,000	
第６１回利付国債（３０年）	1,630,000,000	1,678,052,400	
第６２回利付国債（３０年）	120,000,000	117,164,400	
第６３回利付国債（３０年）	1,160,000,000	1,100,816,800	
第６４回利付国債（３０年）	2,510,000,000	2,375,263,200	
第６５回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,332,139,800	
第６６回利付国債（３０年）	1,030,000,000	971,526,900	
第６７回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,489,035,000	
第６８回利付国債（３０年）	1,640,000,000	1,625,912,400	
第６９回利付国債（３０年）	930,000,000	944,926,500	
第７０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	1,794,142,800	
第７１回利付国債（３０年）	1,280,000,000	1,294,348,800	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	204,670,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	356,821,500	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	244,123,200	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	325,232,000	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	206,844,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	333,190,400	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	230,155,200	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	344,477,100	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	136,649,500	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	201,166,300	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	411,929,700	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	428,152,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	212,958,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	672,506,100	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	385,102,800	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	214,606,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	140,185,500	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	289,240,200	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	311,692,000	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	182,981,200	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	291,643,200	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	238,471,200	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	423,356,700	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	653,748,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	317,521,000	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	512,582,000	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	319,113,100	
第８６回利付国債（２０年）	510,000,000	565,845,000	
第８７回利付国債（２０年）	1,830,000,000	2,022,058,500	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	468,447,000	

第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	388,692,500	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	703,155,600	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	504,531,000	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	982,590,400	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	457,760,900	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	684,450,500	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	694,759,500	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,792,438,800	
第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	455,448,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	498,322,000	
第９９回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,468,097,400	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	551,856,000	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	831,423,450	
第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,473,129,000	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	464,928,000	
第１０４回利付国債（２０年）	160,000,000	183,788,800	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,361,519,400	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	441,142,000	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	301,311,400	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	755,198,400	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	597,334,400	
第１１０回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,280,235,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,140,981,900	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	923,075,500	
第１１３回利付国債（２０年）	2,020,000,000	2,369,419,600	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,744,460,400	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	830,333,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,774,202,600	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,276,754,400	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	777,308,400	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	614,874,200	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,793,787,800	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,758,300,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,093,370,400	
第１２３回利付国債（２０年）	1,870,000,000	2,232,536,900	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	722,599,900	
第１２５回利付国債（２０年）	1,820,000,000	2,196,394,200	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	867,086,700	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,201,855,800	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,145,822,200	
第１２９回利付国債（２０年）	890,000,000	1,042,643,900	
第１３０回利付国債（２０年）	1,285,000,000	1,509,540,900	
第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,164,760,000	

第１３２回利付国債（２０年）	1,160,000,000	1,354,450,800	
第１３３回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,448,767,800	
第１３４回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,335,061,100	
第１３５回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,206,140,300	
第１３６回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,682,797,500	
第１３７回利付国債（２０年）	1,090,000,000	1,279,463,800	
第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	714,506,600	
第１３９回利付国債（２０年）	730,000,000	849,077,600	
第１４０回利付国債（２０年）	2,520,000,000	2,964,931,200	
第１４１回利付国債（２０年）	1,840,000,000	2,169,728,000	
第１４２回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,214,167,200	
第１４３回利付国債（２０年）	1,800,000,000	2,107,800,000	
第１４４回利付国債（２０年）	1,420,000,000	1,646,632,000	
第１４５回利付国債（２０年）	3,195,000,000	3,785,947,200	
第１４６回利付国債（２０年）	2,890,000,000	3,431,730,500	
第１４７回利付国債（２０年）	2,490,000,000	2,932,572,600	
第１４８回利付国債（２０年）	2,230,000,000	2,603,502,700	
第１４９回利付国債（２０年）	2,930,000,000	3,426,136,900	
第１５０回利付国債（２０年）	3,260,000,000	3,776,155,800	
第１５１回利付国債（２０年）	2,175,000,000	2,466,036,750	
第１５２回利付国債（２０年）	3,290,000,000	3,733,261,700	
第１５３回利付国債（２０年）	2,530,000,000	2,909,145,800	
第１５４回利付国債（２０年）	2,600,000,000	2,956,980,000	
第１５５回利付国債（２０年）	2,860,000,000	3,175,543,800	
第１５６回利付国債（２０年）	2,580,000,000	2,643,519,600	
第１５７回利付国債（２０年）	3,080,000,000	3,064,569,200	
第１５８回利付国債（２０年）	2,930,000,000	3,040,548,900	
第１５９回利付国債（２０年）	2,930,000,000	3,080,953,600	
第１６０回利付国債（２０年）	2,460,000,000	2,623,540,800	
第１６１回利付国債（２０年）	2,190,000,000	2,301,142,500	
第１６２回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,070,908,200	
第１６３回利付国債（２０年）	2,610,000,000	2,737,942,200	
第１６４回利付国債（２０年）	1,660,000,000	1,712,290,000	
第１６５回利付国債（２０年）	2,180,000,000	2,246,075,800	
第１６６回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,380,912,000	
第１６７回利付国債（２０年）	2,690,000,000	2,764,755,100	
第１６８回利付国債（２０年）	2,380,000,000	2,403,609,600	
第１６９回利付国債（２０年）	1,690,000,000	1,674,435,100	
第１７０回利付国債（２０年）	2,360,000,000	2,334,040,000	
第１７１回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,273,436,400	
第１７２回利付国債（２０年）	2,760,000,000	2,769,549,600	
第１７３回利付国債（２０年）	3,110,000,000	3,115,442,500	

	第１７４回利付国債（２０年）	2,480,000,000	2,480,000,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	1,560,000,000	1,586,504,400	
	第１７６回利付国債（２０年）	2,810,000,000	2,855,718,700	
	第１７７回利付国債（２０年）	1,340,000,000	1,335,095,600	
国債証券合計		518,340,000,000	554,132,258,750	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	105,695,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	107,026,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	132,833,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	131,571,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	127,691,000	
	第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	127,136,000	
	第１６回東京都公募公債（２０年）	300,000,000	342,459,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	114,734,000	
	第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	116,048,000	
	第１９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	100,488,000	
	第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	233,736,000	
	第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	233,324,000	
	第３３回東京都公募公債（５年）	200,000,000	199,998,000	
	第７１６回東京都公募公債	100,000,000	100,978,000	
	第７１７回東京都公募公債	100,000,000	100,949,000	
	第７２０回東京都公募公債	100,000,000	101,536,000	
	第７２６回東京都公募公債	200,000,000	203,294,000	
	第７２８回東京都公募公債	100,000,000	101,464,000	
	第７５１回東京都公募公債	100,000,000	101,542,000	
	第７６５回東京都公募公債	100,000,000	100,966,000	
	第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,808,000	
	第７８１回東京都公募公債	300,000,000	302,232,000	
	第８００回東京都公募公債	200,000,000	200,164,000	
	平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,160,000	
	平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,916,000	
	平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,324,000	
	平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,119,000	
	平成３０年度第１４回北海道公募公債	200,000,000	201,818,000	
	第２９回１号宮城県公募公債（１０年）	100,000,000	101,430,000	
	第４回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	271,630,000	
	第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	115,825,000	
	第１５回神奈川県公募公債（２０年）	200,000,000	233,674,000	
	第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	116,507,000	
	第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,633,000	
	第７８回神奈川県公募公債（５年）	200,000,000	199,972,000	
	第２０１回神奈川県公募公債	200,250,000	203,081,535	
	第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	202,898,000	

第２１５回神奈川県公募公債	100,000,000	101,832,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,792,000	
第２２６回神奈川県公募公債	100,000,000	100,883,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,808,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	200,080,000	
第６回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	233,742,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	233,602,000	
第１０回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	116,814,000	
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,922,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,621,000	
第３７７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,533,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,620,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	153,307,280	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,042,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,018,000	
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	199,862,000	
第４３９回大阪府公募公債（１０年）	500,000,000	504,470,000	
第４４０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,957,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	116,952,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	116,572,000	
平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	101,608,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	102,054,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	100,168,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	104,225,000	
令和２年度第１２回京都府公募公債	140,500,000	140,755,710	
第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	103,054,000	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	113,951,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	101,983,000	
第６回兵庫県公募公債（１５年）	400,000,000	435,516,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	107,708,000	
第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	107,803,000	
第９回兵庫県公募公債（２０年）	400,000,000	471,144,000	
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	101,578,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	101,563,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	103,192,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	302,001,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	121,426,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	104,496,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,757,000	

第１８回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	115,497,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	101,027,000	
平成２６年度第３回静岡県公募公債	100,000,000	101,819,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,865,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	100,981,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	100,992,000	
平成２９年度第１４回静岡県公募公債（５年）	100,000,000	100,044,000	
令和２年度第１１回静岡県公募公債	310,000,000	312,966,700	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	117,211,000	
平成２４年度第１８回愛知県公募公債（１０年）	150,000,000	151,753,500	
平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,977,000	
平成２５年度第２回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,924,000	
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,733,000	
平成２６年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	203,540,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,624,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,288,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	202,114,000	
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	311,772,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,893,000	
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	103,262,000	
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,334,000	
令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,484,000	
令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年）	200,000,000	200,402,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	115,991,000	
平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年）	200,000,000	233,068,000	
平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	100,981,000	
平成２５年度第４回広島県公募公債	100,000,000	101,468,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	127,690,769	
平成２９年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,777,000	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	113,731,000	
第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	114,965,000	
第６回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	230,860,000	
第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	108,213,000	

第７回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	234,602,000	
第８回埼玉県公募公債（１５年）	200,000,000	201,730,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	233,674,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	200,358,000	
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,169,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,644,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	101,973,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,303,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,223,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,866,000	
令和２年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	100,290,000	
令和２年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	100,182,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	113,901,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,444,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	106,984,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	118,124,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	107,650,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	131,962,000	
平成２５年度第９回福岡県公募公債	100,000,000	101,653,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	112,942,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	101,952,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	103,262,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	104,123,000	
令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	301,809,000	
令和３年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	100,336,000	
令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	99,769,000	
第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	230,860,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	116,691,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	116,757,000	
平成２４年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	100,975,000	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	101,632,000	
平成２５年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	101,587,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	101,454,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	101,998,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,302,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	120,999,600	
令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	300,252,000	

	令和２年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	100,549,000	
	令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	300,000,000	302,280,000	
	平成３０年度第３回茨城県公募公債	350,000,000	350,136,500	
	第１回群馬県公募公債（２０年）	200,000,000	231,716,000	
	平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	100,949,000	
	第１１６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,963,000	
	第１１７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,836,000	
	第１１９回共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,636,000	
	第１２１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,913,000	
	第１２５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,186,000	
	第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,430,000	
	第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,440,000	
	第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,578,000	
	第１３１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,602,000	
	第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,965,000	
	第１３４回共同発行市場公募地方債	112,000,000	114,016,000	
	第１３５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,817,000	
	第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,731,000	
	第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,646,000	
	第１４０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,186,000	
	第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,876,000	
	第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,026,000	
	第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,042,178	
	第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,049,000	
	第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,409,000	
	第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,323,000	
	第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,574,000	
	第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,390,000	
	第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,992,000	
	第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,130,000	
	第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,833,000	
	第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,202,000	
	第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,678,000	
	第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,411,396	
	第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,009,000	
	第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,577,000	
	平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	200,000,000	201,796,000	
	平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,053,000	
	第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	234,932,000	
	第１５回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	98,250,000	
	第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	301,554,000	

第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	104,750,000	
平成２５年度第８回大阪市公募公債	100,000,000	101,818,000	
令和３年度第２回大阪市公募公債	200,000,000	200,862,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	129,949,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	134,920,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	114,589,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	126,203,000	
第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,945,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,050,000	
第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	301,803,000	
平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	100,889,000	
平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	101,183,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	201,668,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	134,520,000	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	231,210,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	118,064,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	117,058,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	99,381,000	
令和３年度第６回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	99,832,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	108,176,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	349,176,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,805,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	101,169,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	100,955,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	203,244,000	
第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	228,886,000	
令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	301,803,000	
令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	100,383,000	
平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	107,970,000	
平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,017,000	
平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,380,000	
第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	115,849,000	
第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,712,000	
第９３回川崎市公募公債	100,000,000	100,188,000	
平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,437,000	
平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,007,000	
平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	100,299,000	
平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	116,541,000	

	平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	115,712,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	203,322,000	
	平成３０年度第５回福岡市公募公債（５年）	200,000,000	200,076,000	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,630,000	
	平成３０年度第１０回福岡市公募公債（５年）	200,000,000	200,046,000	
	平成３０年度第１１回福岡市公募公債（５年）	100,000,000	100,025,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	152,440,500	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,472,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,778,050	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	171,973,700	
	令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	552,079,000	
	令和２年度第３回広島市公募公債（５年）	200,000,000	200,082,000	
	令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	200,168,000	
	平成２５年度第４回福井県公募公債	100,000,000	101,816,000	
	平成２４年度第１回徳島県公募公債	100,000,000	101,033,000	
	平成２４年度第２回岡山県公募公債（１０年）	150,000,000	151,564,500	
	平成２４年度第１回岡山市公募公債（１０年）	200,000,000	202,338,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	202,174,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	113,832,000	
地方債証券合計		35,179,680,000	36,962,228,238	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	103,641,180	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	414,218,900	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	311,823,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,342,000	
	第１１９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,928,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	95,178,000	
	第１４回道路債券	100,000,000	102,440,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	101,964,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	129,147,000	
	第２７回道路債券	400,000,000	424,264,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	261,970,000	
	第３３回道路債券	200,000,000	265,920,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,926,000	
	第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	152,040,000	

第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,720,000	
第４２回道路債券	100,000,000	107,757,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,517,000	
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	143,997,000	
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	233,020,000	
第９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,366,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,979,000	
第１０２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	605,982,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	909,648,000	
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,568,000	
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	131,616,000	
第１１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,473,000	
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,452,000	
第１１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,703,000	
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	118,719,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,586,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,481,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,429,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,950,000	
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	302,919,000	
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	116,601,000	
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	101,182,000	
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	303,657,000	
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	202,066,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	622,146,000	
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	304,727,060	
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	634,681,920	

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	203,234,000	
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	150,413,880	
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	101,481,000	
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	269,709,918	
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	203,154,000	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,685,000	
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	429,469,400	
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	101,624,000	
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	230,958,000	
第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	103,777,860	
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	101,780,000	
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	101,713,000	
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	229,560,000	
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	101,666,000	
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	101,507,000	
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	303,162,000	
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	111,868,000	
第２４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,350,000	
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	202,726,000	
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	100,604,000	
第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,562,000	
第２９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,915,470	
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	317,087,040	
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	206,049,600	
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	100,691,000	
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	201,328,000	
	100,000,000	100,776,000	

第３２１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	121,318,800	
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	201,612,000	
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	312,024,000	
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	216,807,680	
第３８５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,766,000	
第３９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,642,000	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	377,412,000	
第３回公営企業債券（２０年）	210,000,000	213,278,100	
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	107,974,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	393,606,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	105,521,000	
第７回公営企業債券（３０年）	200,000,000	263,804,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	42,259,200	
第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	129,921,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	233,824,000	
第１０回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	229,308,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年）	200,000,000	195,834,000	
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	233,948,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	116,382,000	
第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,964,000	
第４４回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,314,000	
第４４回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,158,000	
第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,194,000	
第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,066,000	
第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,892,000	
第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,038,000	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,636,000	
第５４回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,520,400	
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,180,000	
第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,600,000	
第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,824,000	
第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,803,000	
第６７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,572,000	
第６９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,574,000	
第７６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,888,000	

Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,448,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,573,000	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,045,000	
第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,100,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,342,000	
第９２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,509,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,664,130	
Ｆ９５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,479,000	
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,789,000	
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,770,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,202,300	
Ｆ１０７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,809,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	157,989,000	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,305,000	
第１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,477,000	
第１２０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,733,000	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,145,000	
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,178,000	
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,668,000	
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,906,000	
第７回阪神高速道路債券	100,000,000	107,540,000	
第２２回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,934,000	
第４回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	116,752,000	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	119,307,000	
第２５回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	202,420,000	
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,056,700	
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,791,000	
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,823,200	
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,279,530	
第８７回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,878,000	
第１１７回都市再生債券	200,000,000	212,432,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	169,758,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	92,964,000	
第１７１回都市再生債券	200,000,000	199,168,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	107,173,000	
第３４４回東京交通債券	100,000,000	102,352,000	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,383,600	
第５９回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,981,000	
第６２回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	100,600,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,253,000	11,460,167	

第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,650,000	11,896,281	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,922,000	12,219,930	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	160,887,000	160,814,600	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	114,772,000	114,804,136	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,681,000	11,945,574	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,651,000	13,013,577	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	208,062,000	207,602,182	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,101,000	10,116,555	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	21,088,000	21,302,675	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,530,000	12,877,081	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	227,454,000	226,728,421	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	81,134,000	81,103,169	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,140,000	11,331,496	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,031,000	13,445,255	
第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	264,819,000	264,723,665	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,199,000	11,392,966	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	182,664,000	182,716,972	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,148,000	13,581,884	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,794,000	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,282,000	18,285,565	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,551,000	18,643,198	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,374,000	20,681,163	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,287,000	22,638,724	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,541,000	25,171,920	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,067,000	25,688,393	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,304,000	54,660,307	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,439,000	11,626,485	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,289,000	24,586,663	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,563,000	11,790,097	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,281,000	11,510,568	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,156,000	25,504,629	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,571,000	10,680,621	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,990,000	25,385,498	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,802,000	24,044,252	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,499,000	12,929,215	

第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,754,000	51,099,554	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,191,000	27,516,264	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,215,000	12,566,425	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,687,000	38,705,151	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,672,000	36,519,324	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,786,000	36,676,271	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,238,000	80,230,584	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,770,000	87,620,906	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,846,000	44,771,070	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,182,000	45,487,055	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,363,000	45,727,584	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,730,000	39,621,782	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,374,000	38,975,102	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,984,000	45,362,734	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	177,756,000	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,162,000	119,037,859	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,744,000	160,302,719	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,759,000	45,568,434	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,071,000	46,973,446	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,919,000	47,730,045	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,977,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,734,000	151,464,260	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,761,000	51,518,060	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,116,000	107,129,117	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,380,000	60,268,009	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,922,000	63,763,560	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,591,000	63,727,591	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,758,000	198,157,502	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	128,198,000	133,032,346	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,140,000	64,355,912	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,311,000	69,773,909	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,385,000	73,842,922	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,778,000	79,434,220	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,552,000	79,043,735	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,841,000	79,691,694	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,252,000	80,455,045	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,021,000	81,117,287	
	81,487,000	82,587,074	

第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,189,000	83,393,890	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,086,000	83,070,211	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,314,000	83,297,652	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,822,000	83,860,587	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,444,000	169,192,115	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,959,000	83,942,893	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,846,000	171,268,940	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,251,000	85,262,854	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,518,000	170,285,753	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,173,000	86,208,703	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,556,000	173,259,551	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,596,000	174,296,070	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	130,310,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,420,000	88,788,123	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,162,000	88,709,125	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,210,000	88,052,448	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,928,000	179,924,628	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,497,000	89,914,950	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,313,000	89,858,702	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,436,000	181,300,288	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,186,000	90,981,743	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	275,526,000	273,555,989	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,658,000	183,308,150	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,653,000	94,313,253	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,475,000	94,846,286	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,222,000	194,997,710	

第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,355,000	98,092,950	
第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,278,000	196,730,868	
第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,892,000	197,008,584	
第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,108,000	98,913,466	
第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,654,000	199,080,710	
第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,094,000	200,342,366	
第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,436,000	100,473,117	
第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,354,000	
第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,032,000	
第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,593,000	
第３２０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,293,000	
第６２回日本学生支援債券	100,000,000	99,978,000	
第６４回日本学生支援債券	300,000,000	299,853,000	
第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	107,623,000	
い第８２３号商工債	200,000,000	200,576,000	
い第８２９号商工債	200,000,000	200,476,000	
い第８３２号商工債	200,000,000	200,030,000	
い第８３３号商工債	100,000,000	99,984,000	
い第８４３号商工債	200,000,000	200,434,000	
い第８４７号商工債	100,000,000	100,107,000	
い第８５０号商工債	200,000,000	200,134,000	
第３３７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,110,000	
第３３８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,110,000	
第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	200,232,000	
第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,136,000	
第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,107,000	
第３６０回信金中金債（５年）	200,000,000	199,838,000	
第３７６回信金中金債（５年）	100,000,000	100,045,000	
第２５４号商工債（３年）	300,000,000	300,036,000	
第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	101,943,000	
第２１回国際協力機構債券	100,000,000	117,553,000	
第４８回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,498,000	
第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,121,000	
第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,412,000	
第７３回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	502,820,000	
第８３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,023,000	
第６０回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,856,000	

	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,344,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,173,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	200,422,000	
	第１４１回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,962,000	
特殊債券合計		38,851,913,000	40,427,122,979	
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	100,270,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	299,562,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,198,000	
	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	100,561,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,219,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,204,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,979,000	
	第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,129,000	
	第１２回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	400,216,000	
	第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,896,000	
	第３９回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,592,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,498,000	
	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	199,514,000	
	第７回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	100,001,000	
	第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	300,171,000	
	第２５回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,412,000	
	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	100,361,000	
	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	199,696,000	
	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	100,428,000	
	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	199,756,000	
	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	101,740,000	
	第１９回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,596,000	
	第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,130,000	
	第５回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,907,000	
	第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,007,000	

第１０回Ｊ．フロント　リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	100,334,000	
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	99,844,000	
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	100,946,000	
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	200,490,000	
第１３回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,037,000	
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	101,390,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,863,000	
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	101,030,000	
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	200,398,000	
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	200,662,000	
第４０回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,057,000	
第４２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,436,000	
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,782,000	
第７回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,692,000	
第４回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,298,000	
第６回株式会社電通無担保社債	200,000,000	202,994,000	
第２回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,100,000	
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	100,051,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	99,093,000	
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	199,918,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,444,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,900,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,565,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,377,000	
第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,127,000	
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,105,000	
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	100,010,000	
第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,666,000	
第３３回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,097,000	
第８回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,936,000	
第１７回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	108,159,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,082,000	
第１回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	100,080,000	

	第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,204,000	
	第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,549,000	
	第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,418,000	
	第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,964,000	
	第２０回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,955,000	
	第２１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,203,000	
	第２３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,757,000	
	第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,675,000	
	第１９回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,607,000	
	第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,585,000	
	第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,381,000	
	第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,201,000	
	第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,055,000	
	第２７回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	201,200,000	
	第１６回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,922,000	
	第１２回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,918,000	
	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	100,124,000	
	第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,168,000	
	第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,664,000	
	第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	97,887,000	
	第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,851,000	
	第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,729,000	
	第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,935,000	
	第７３回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	200,536,000	
	第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,560,000	
	第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,109,000	
	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	99,997,000	
	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	117,323,000	
	第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	111,913,000	
	第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,020,000	
	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	101,262,000	
	第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,377,000	
	第１回みずほＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	303,846,000	
	第３回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,338,000	
	第４回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,295,000	
	第９回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,766,000	
	第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,576,000	

第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,370,000	
第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	99,669,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,105,000	
第６４回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,742,000	
第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,253,000	
第６７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,160,000	
第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,246,000	
第４１回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,850,000	
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	199,960,000	
第１６回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,918,000	
第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,206,000	
第３２回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,940,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,020,000	
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,286,000	
第８０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,920,000	
第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,860,000	
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	200,446,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,151,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	202,042,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,548,000	
第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,573,000	
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	100,389,000	
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	200,222,000	
第３回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,278,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	200,878,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,220,000	
第１３５回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,126,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,034,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,034,000	
第１０９回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,890,000	
	100,000,000	101,778,000	

第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債			
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,033,000	
第１２４回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,759,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,822,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,102,000	
第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,608,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,300,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,995,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,163,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,694,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,179,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,735,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	232,008,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,732,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,646,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,821,000	
第１４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,761,000	
第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,618,000	
第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,988,000	
第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,762,000	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,794,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,223,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,221,000	
第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	500,830,000	
第７５回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,651,000	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,778,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,371,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,005,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,770,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,088,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	91,771,000	
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	195,000,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,853,000	
第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,062,000	

第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	101,536,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,783,000	
第１１回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	399,852,000	
第３３回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,207,000	
第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,729,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,113,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,363,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,929,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,996,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,380,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,368,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,221,000	
第５２４回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,707,000	
第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,990,000	
第５３８回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,454,000	
第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,369,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,542,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,048,000	
第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,500,000	
第４１６回中国電力株式会社社債	200,000,000	201,740,000	
第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,677,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,412,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,206,000	
第３３０回北陸電力株式会社社債	200,000,000	201,590,000	
第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	129,148,740	
第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,659,000	
第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,107,000	
第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,724,000	
第５２１回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,446,000	
第５２７回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,907,000	
第５３５回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,694,000	
第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,694,000	
第３０９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,970,000	
第３１４回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,857,000	
第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,708,000	
第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,913,000	
第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,370,000	
第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,522,000	
第４８９回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,224,000	
第４９４回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,717,000	
第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,775,000	
第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,434,000	
第３５０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,082,000	

	第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	107,231,000	
	第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,052,000	
	第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,480,000	
	第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,403,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,716,000	
	第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	206,740,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	400,000,000	405,324,000	
	第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,162,000	
	第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	305,217,000	
	第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,286,000	
	第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,558,000	
	第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,388,000	
	第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,931,000	
	第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,885,000	
	第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,722,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,572,000	
	第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,638,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,462,000	
	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	100,566,000	
	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	202,678,000	
社債券合計		28,826,000,000	29,205,693,740	
合計			660,727,303,707	

(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 9月 6日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,842,732,423
株式	495,780,077,820
派生商品評価勘定	167,030,950
未収入金	20,140,957
未収配当金	289,495,563
差入委託証拠金	140,746,200
流動資産合計	499,240,223,913
資産合計	499,240,223,913
負債の部	
流動負債	
前受金	167,060,100
未払解約金	454,915,944
未払利息	2,683
流動負債合計	621,978,727
負債合計	621,978,727
純資産の部	
元本等	
元本	252,855,267,319
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	245,762,977,867
元本等合計	498,618,245,186
純資産合計	498,618,245,186
負債純資産合計	499,240,223,913

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 9月 6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。

	2021年 9月 6日現在
	(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 9月 6日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	252,855,267,319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　1.9720円 (1万口当たり純資産額)　(19,720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 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	226,469,579,366円
期中追加設定元本額	76,657,396,009円

区分	2021年 9月 6日現在
期中一部解約元本額	50,271,708,056円
期末元本額	252,855,267,319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）	420,254,676円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,902,184,474円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	13,253,680円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	10,639,978,618円
世界経済インデックスファンド	3,060,474,404円
日本株式インデックス・オープン	3,463,799,221円
ＤＣマイセレクション２５	6,138,987,468円
ＤＣマイセレクション５０	18,179,198,989円
ＤＣマイセレクション７５	17,984,647,911円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,899,394,882円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,008,334,163円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,674,917,034円
ＤＣマイセレクションＳ７５	6,195,040,913円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	7,782,203,334円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	223,036,407円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	683,411,057円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	488,194,864円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,324,487,985円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,561,578,853円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	6,195,294円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	26,076,117円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	20,457,639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）	190,824,766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）	39,182,614円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	158,116,137円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	30,211,277円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	89,857,145円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,107,059,798円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	471,101,454円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,007,138,985円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	139,506,739円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	29,139,708円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	546,351,690円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	307,282,814円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	393,375,514円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	41,176,725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）	646,184,499円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	3,535,323,215円

区分	2021年 9月 6日現在
日本株式ファンド・シリーズ２	1,952,227,135円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,492,806,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,088,522,067円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,412,057,804円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,014,239,060円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	423,101,126円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	396,391,924円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,069,568,637円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	210,759,330円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,502,130円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	59,873,263円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	26,408,539,689円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	592,505,570円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	37,535,118円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	130,300,192円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	24,075,895円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,471,922円
グローバル経済コア	236,382,233円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	23,458,404円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	64,018,456円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	19,079,623円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,221,625,817円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	152,374,343円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	4,352,165円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	3,291,917円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	1,523,276円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	1,445,333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）	42,805,682,616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）	1,144,426,924円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	210,519,219円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	32,472,010円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	541,022,593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）	46,633,748,926円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	8,021円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	58,821円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2021年 9月 6日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	28,644,865,054

合計	28,644,865,054

(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 9月 6日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,796,829,900	－	2,963,890,000	167,060,100
合計		2,796,829,900	－	2,963,890,000	167,060,100

(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	7,800	3,060.00	23,868,000	
日本水産	223,400	625.00	139,625,000	
マルハニチロ	37,700	2,485.00	93,684,500	
雪国まいたけ	19,800	1,626.00	32,194,800	
カネコ種苗	7,300	1,487.00	10,855,100	
サカタのタネ	28,700	3,650.00	104,755,000	
ホクト	20,200	1,995.00	40,299,000	
ホクリヨウ	3,700	779.00	2,882,300	
住石ホールディングス	42,100	135.00	5,683,500	
日鉄鉱業	5,500	6,630.00	36,465,000	
三井松島ホールディングス	10,100	1,298.00	13,109,800	
ＩＮＰＥＸ	965,400	763.00	736,600,200	
石油資源開発	31,400	1,896.00	59,534,400	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	11,700	1,360.00	15,912,000	
ヒノキヤグループ	5,200	2,341.00	12,173,200	
ショーボンドホールディングス	34,300	5,020.00	172,186,000	

ミライト・ホールディングス	83,400	2,285.00	190,569,000	
タマホーム	14,600	2,616.00	38,193,600	
サンヨーホームズ	2,800	720.00	2,016,000	
日本アクア	9,600	576.00	5,529,600	
ファーストコーポレーション	7,300	781.00	5,701,300	
ベステラ	4,700	1,511.00	7,101,700	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	40,100	215.00	8,621,500	
キャンディル	4,100	643.00	2,636,300	
スペースバリューホールディングス	29,300	836.00	24,494,800	
ダイセキ環境ソリューション	4,600	1,306.00	6,007,600	
第一カッター興業	5,900	1,273.00	7,510,700	
安藤・間	154,300	844.00	130,229,200	
東急建設	70,500	792.00	55,836,000	
コムシスホールディングス	85,300	3,120.00	266,136,000	
ビーアールホールディングス	32,200	514.00	16,550,800	
高松コンストラクショングループ	15,000	2,118.00	31,770,000	
東建コーポレーション	7,400	10,910.00	80,734,000	
ソネック	2,500	1,136.00	2,840,000	
ヤマウラ	10,400	965.00	10,036,000	
オリエンタル白石	80,900	273.00	22,085,700	
大成建設	172,900	3,605.00	623,304,500	
大林組	555,700	948.00	526,803,600	
清水建設	520,500	815.00	424,207,500	
飛島建設	15,900	1,127.00	17,919,300	
長谷工コーポレーション	182,000	1,573.00	286,286,000	
松井建設	21,900	798.00	17,476,200	
錢高組	2,400	4,090.00	9,816,000	
鹿島建設	407,200	1,493.00	607,949,600	
不動テトラ	13,600	1,773.00	24,112,800	
大末建設	7,000	995.00	6,965,000	
鉄建建設	11,200	1,838.00	20,585,600	
西松建設	39,800	3,605.00	143,479,000	
三井住友建設	134,200	483.00	64,818,600	
大豊建設	12,200	3,860.00	47,092,000	
前田建設工業	139,200	833.00	115,953,600	
佐田建設	12,800	482.00	6,169,600	
ナカノフドー建設	13,300	369.00	4,907,700	
奥村組	30,500	3,100.00	94,550,000	
東鉄工業	23,800	2,504.00	59,595,200	
イチケン	4,000	1,922.00	7,688,000	
富士ピー・エス	7,200	580.00	4,176,000	
淺沼組	6,700	4,640.00	31,088,000	

戸田建設	230,800	830.00	191,564,000	
熊谷組	25,700	2,761.00	70,957,700	
北野建設	3,400	2,184.00	7,425,600	
植木組	4,900	1,512.00	7,408,800	
矢作建設工業	24,500	769.00	18,840,500	
ピーエス三菱	18,300	666.00	12,187,800	
日本ハウスホールディングス	37,900	432.00	16,372,800	
大東建託	60,700	12,540.00	761,178,000	
新日本建設	23,600	888.00	20,956,800	
ＮＩＰＰＯ	46,000	3,515.00	161,690,000	
東亜道路工業	3,400	4,555.00	15,487,000	
前田道路	34,300	1,903.00	65,272,900	
日本道路	5,400	8,200.00	44,280,000	
東亜建設工業	14,900	2,323.00	34,612,700	
日本国土開発	54,100	590.00	31,919,000	
若築建設	10,000	2,066.00	20,660,000	
東洋建設	62,300	572.00	35,635,600	
五洋建設	236,000	734.00	173,224,000	
世紀東急工業	26,700	865.00	23,095,500	
福田組	5,900	4,940.00	29,146,000	
住友林業	142,200	2,175.00	309,285,000	
日本基礎技術	17,000	584.00	9,928,000	
巴コーポレーション	24,700	477.00	11,781,900	
大和ハウス工業	513,100	3,540.00	1,816,374,000	
ライト工業	31,800	1,979.00	62,932,200	
積水ハウス	602,700	2,288.00	1,378,977,600	
日特建設	13,800	740.00	10,212,000	
北陸電気工事	9,600	1,329.00	12,758,400	
ユアテック	31,800	735.00	23,373,000	
日本リーテック	11,600	1,696.00	19,673,600	
四電工	3,000	3,535.00	10,605,000	
中電工	25,600	2,350.00	60,160,000	
関電工	90,300	951.00	85,875,300	
きんでん	112,900	1,914.00	216,090,600	
東京エネシス	18,400	1,095.00	20,148,000	
トーエネック	5,600	3,785.00	21,196,000	
住友電設	15,700	2,288.00	35,921,600	
日本電設工業	30,500	1,846.00	56,303,000	
協和エクシオ	84,300	2,844.00	239,749,200	
新日本空調	14,700	2,487.00	36,558,900	
九電工	39,000	4,130.00	161,070,000	
三機工業	39,400	1,553.00	61,188,200	

日揮ホールディングス	185,400	970.00	179,838,000	
中外炉工業	6,000	1,813.00	10,878,000	
ヤマト	17,800	771.00	13,723,800	
太平電業	12,300	2,757.00	33,911,100	
高砂熱学工業	50,200	2,188.00	109,837,600	
三晃金属工業	2,200	2,274.00	5,002,800	
朝日工業社	4,100	3,385.00	13,878,500	
明星工業	35,900	755.00	27,104,500	
大氣社	27,000	3,585.00	96,795,000	
ダイダン	12,300	2,793.00	34,353,900	
日比谷総合設備	17,900	1,926.00	34,475,400	
フィル・カンパニー	3,200	2,822.00	9,030,400	
テスホールディングス	10,100	2,113.00	21,341,300	
東洋エンジニアリング	23,300	908.00	21,156,400	
レイズネクスト	29,800	1,158.00	34,508,400	
ニップン	52,000	1,648.00	85,696,000	
日清製粉グループ本社	200,900	1,887.00	379,098,300	
日東富士製粉	1,300	6,740.00	8,762,000	
昭和産業	15,400	2,801.00	43,135,400	
鳥越製粉	15,800	792.00	12,513,600	
中部飼料	21,700	1,141.00	24,759,700	
フィード・ワン	23,900	766.00	18,307,400	
東洋精糖	3,000	1,169.00	3,507,000	
日本甜菜製糖	9,300	1,648.00	15,326,400	
DM三井製糖ホールディングス	14,000	1,970.00	27,580,000	
塩水港精糖	21,200	222.00	4,706,400	
日新製糖	8,400	1,704.00	14,313,600	
森永製菓	41,700	3,985.00	166,174,500	
中村屋	4,300	3,815.00	16,404,500	
江崎グリコ	49,000	4,190.00	205,310,000	
名糖産業	7,800	1,746.00	13,618,800	
井村屋グループ	10,100	2,321.00	23,442,100	
不二家	9,900	2,344.00	23,205,600	
山崎製パン	133,300	1,862.00	248,204,600	
第一屋製パン	3,400	833.00	2,832,200	
モロゾフ	2,800	5,500.00	15,400,000	
亀田製菓	10,100	4,710.00	47,571,000	
寿スピリッツ	17,100	7,140.00	122,094,000	
カルビー	81,000	2,800.00	226,800,000	
森永乳業	32,900	7,150.00	235,235,000	
六甲バター	13,000	1,614.00	20,982,000	
ヤクルト本社	122,300	6,350.00	776,605,000	

明治ホールディングス	117,600	6,920.00	813,792,000	
雪印メグミルク	42,800	2,291.00	98,054,800	
プリマハム	25,000	3,045.00	76,125,000	
日本ハム	68,000	4,420.00	300,560,000	
林兼産業	5,900	586.00	3,457,400	
丸大食品	17,500	1,807.00	31,622,500	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	16,000	3,145.00	50,320,000	
柿安本店	6,200	2,571.00	15,940,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	114,500	738.00	84,501,000	
サッポロホールディングス	60,700	2,483.00	150,718,100	
アサヒグループホールディングス	418,400	5,383.00	2,252,247,200	
キリンホールディングス	653,700	2,073.50	1,355,446,950	
宝ホールディングス	131,800	1,517.00	199,940,600	
オエノンホールディングス	50,500	385.00	19,442,500	
養命酒製造	5,400	1,856.00	10,022,400	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	124,800	1,571.00	196,060,800	
サントリー食品インターナショナル	119,000	4,525.00	538,475,000	
ダイドーグループホールディングス	10,000	5,730.00	57,300,000	
伊藤園	54,000	7,000.00	378,000,000	
キーコーヒー	17,500	2,240.00	39,200,000	
ユニカフェ	5,300	1,035.00	5,485,500	
ジャパンフーズ	2,500	1,240.00	3,100,000	
日清オイリオグループ	22,300	3,135.00	69,910,500	
不二製油グループ本社	43,400	2,569.00	111,494,600	
かどや製油	1,900	4,045.00	7,685,500	
Ｊ－オイルミルズ	16,600	1,838.00	30,510,800	
キッコーマン	128,000	9,030.00	1,155,840,000	
味の素	423,000	3,425.00	1,448,775,000	
ブルドックソース	8,100	2,097.00	16,985,700	
キユーピー	99,000	2,711.00	268,389,000	
ハウス食品グループ本社	66,500	3,650.00	242,725,000	
カゴメ	67,500	2,983.00	201,352,500	
焼津水産化学工業	8,600	985.00	8,471,000	
アリアケジャパン	16,200	6,380.00	103,356,000	
ピエトロ	2,300	1,800.00	4,140,000	
エバラ食品工業	3,900	2,604.00	10,155,600	
やまみ	1,900	1,993.00	3,786,700	
ニチレイ	84,700	2,871.00	243,173,700	
東洋水産	91,500	4,665.00	426,847,500	
イートアンドホールディングス	6,100	2,160.00	13,176,000	
大冷	2,000	2,006.00	4,012,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,900	762.00	7,543,800	

日清食品ホールディングス	69,800	8,630.00	602,374,000	
永谷園ホールディングス	8,700	2,130.00	18,531,000	
一正蒲鉾	6,900	931.00	6,423,900	
フジッコ	19,300	1,906.00	36,785,800	
ロック・フィールド	19,200	1,607.00	30,854,400	
日本たばこ産業	953,600	2,180.00	2,078,848,000	
ケンコーマヨネーズ	10,900	1,544.00	16,829,600	
わらべや日洋ホールディングス	11,600	2,447.00	28,385,200	
なとり	9,900	1,972.00	19,522,800	
イフジ産業	2,800	959.00	2,685,200	
ピックルスコーポレーション	8,500	1,937.00	16,464,500	
ファーマフーズ	16,800	2,989.00	50,215,200	
北の達人コーポレーション	62,100	501.00	31,112,100	
ユーグレナ	90,600	887.00	80,362,200	
紀文食品	10,400	1,275.00	13,260,000	
ミヨシ油脂	6,800	1,294.00	8,799,200	
理研ビタミン	16,800	1,836.00	30,844,800	
片倉工業	19,700	1,503.00	29,609,100	
グンゼ	12,800	4,540.00	58,112,000	
東洋紡	68,900	1,385.00	95,426,500	
ユニチカ	52,200	361.00	18,844,200	
富士紡ホールディングス	8,500	4,345.00	36,932,500	
倉敷紡績	15,100	1,984.00	29,958,400	
シキボウ	9,700	939.00	9,108,300	
日本毛織	52,800	1,044.00	55,123,200	
トーア紡コーポレーション	6,400	434.00	2,777,600	
帝国繊維	19,800	2,064.00	40,867,200	
帝人	163,700	1,620.00	265,194,000	
東レ	1,257,200	752.10	945,540,120	
サカイオーベックス	4,700	3,805.00	17,883,500	
住江織物	3,800	1,855.00	7,049,000	
日本フエルト	10,900	454.00	4,948,600	
イチカワ	2,600	1,359.00	3,533,400	
日東製網	1,900	1,512.00	2,872,800	
アツギ	13,700	638.00	8,740,600	
ダイニック	6,600	751.00	4,956,600	
セーレン	42,900	2,077.00	89,103,300	
ソトー	7,200	811.00	5,839,200	
東海染工	2,400	1,139.00	2,733,600	
小松マテーレ	28,700	994.00	28,527,800	
ワコールホールディングス	43,400	2,387.00	103,595,800	
ホギメディカル	23,400	3,450.00	80,730,000	

ＴＳＩホールディングス	53,400	331.00	17,675,400	
マツオカコーポレーション	5,700	1,466.00	8,356,200	
ワールド	22,900	1,429.00	32,724,100	
三陽商会	9,000	870.00	7,830,000	
ナイガイ	7,000	363.00	2,541,000	
オンワードホールディングス	105,000	313.00	32,865,000	
ルックホールディングス	5,700	1,353.00	7,712,100	
ゴールドウイン	28,700	7,070.00	202,909,000	
デサント	29,700	3,605.00	107,068,500	
キング	9,700	526.00	5,102,200	
ヤマトインターナショナル	15,900	329.00	5,231,100	
特種東海製紙	10,700	4,515.00	48,310,500	
王子ホールディングス	781,300	596.00	465,654,800	
日本製紙	76,700	1,221.00	93,650,700	
三菱製紙	24,600	379.00	9,323,400	
北越コーポレーション	124,100	651.00	80,789,100	
中越パルプ工業	6,600	1,219.00	8,045,400	
巴川製紙所	5,700	917.00	5,226,900	
大王製紙	83,700	2,144.00	179,452,800	
阿波製紙	4,500	396.00	1,782,000	
レンゴー	178,900	905.00	161,904,500	
トーモク	10,600	1,930.00	20,458,000	
ザ・パック	13,100	3,020.00	39,562,000	
クラレ	253,800	1,059.00	268,774,200	
旭化成	1,150,300	1,157.00	1,330,897,100	
共和レザー	9,400	693.00	6,514,200	
昭和電工	123,500	2,542.00	313,937,000	
住友化学	1,366,100	582.00	795,070,200	
住友精化	8,500	3,610.00	30,685,000	
日産化学	95,100	6,620.00	629,562,000	
ラサ工業	5,700	1,918.00	10,932,600	
クレハ	14,900	7,810.00	116,369,000	
多木化学	6,800	6,490.00	44,132,000	
テイカ	12,700	1,336.00	16,967,200	
石原産業	31,100	1,171.00	36,418,100	
片倉コープアグリ	4,500	1,209.00	5,440,500	
日本曹達	24,300	3,655.00	88,816,500	
東ソー	268,300	2,104.00	564,503,200	
トクヤマ	51,600	2,248.00	115,996,800	
セントラル硝子	33,100	2,232.00	73,879,200	
東亞合成	98,800	1,308.00	129,230,400	
大阪ソーダ	17,600	2,762.00	48,611,200	

関東電化工業	41,200	1,092.00	44,990,400	
デンカ	63,300	4,040.00	255,732,000	
信越化学工業	320,900	19,475.00	6,249,527,500	
日本カーバイド工業	6,400	1,408.00	9,011,200	
堺化学工業	12,200	2,216.00	27,035,200	
第一稀元素化学工業	17,500	1,711.00	29,942,500	
エア・ウォーター	177,000	1,837.00	325,149,000	
日本酸素ホールディングス	143,000	2,883.00	412,269,000	
日本化学工業	4,900	3,450.00	16,905,000	
東邦アセチレン	2,600	1,488.00	3,868,800	
日本パーカライジング	87,500	1,190.00	104,125,000	
高圧ガス工業	27,500	751.00	20,652,500	
チタン工業	2,200	1,837.00	4,041,400	
四国化成工業	22,600	1,420.00	32,092,000	
戸田工業	3,700	3,175.00	11,747,500	
ステラ　ケミファ	9,400	2,911.00	27,363,400	
保土谷化学工業	5,100	5,110.00	26,061,000	
日本触媒	31,400	5,920.00	185,888,000	
大日精化工業	14,300	2,674.00	38,238,200	
カネカ	44,900	4,615.00	207,213,500	
三菱瓦斯化学	173,900	2,268.00	394,405,200	
三井化学	149,800	3,830.00	573,734,000	
ＪＳＲ	174,200	3,990.00	695,058,000	
東京応化工業	29,800	7,380.00	219,924,000	
大阪有機化学工業	14,800	4,055.00	60,014,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,160,100	986.00	1,143,858,600	
ＫＨネオケム	28,600	3,090.00	88,374,000	
ダイセル	233,300	898.00	209,503,400	
住友ベークライト	27,300	5,210.00	142,233,000	
積水化学工業	363,200	1,958.00	711,145,600	
日本ゼオン	156,500	1,590.00	248,835,000	
アイカ工業	48,300	3,765.00	181,849,500	
宇部興産	87,600	2,291.00	200,691,600	
積水樹脂	26,200	2,225.00	58,295,000	
タキロンシーアイ	37,500	648.00	24,300,000	
旭有機材	9,800	1,516.00	14,856,800	
ニチバン	9,100	1,833.00	16,680,300	
リケンテクノス	42,300	598.00	25,295,400	
大倉工業	8,900	2,231.00	19,855,900	
積水化成品工業	23,300	607.00	14,143,100	
群栄化学工業	4,000	2,882.00	11,528,000	
タイガースポリマー	9,100	440.00	4,004,000	

ミライアル	5,600	1,430.00	8,008,000	
ダイキアクシス	6,600	887.00	5,854,200	
ダイキョーニシカワ	36,600	697.00	25,510,200	
竹本容器	6,200	934.00	5,790,800	
森六ホールディングス	9,300	2,160.00	20,088,000	
恵和	4,400	4,825.00	21,230,000	
日本化薬	107,400	1,258.00	135,109,200	
カーリットホールディングス	17,200	875.00	15,050,000	
日本精化	12,600	2,180.00	27,468,000	
扶桑化学工業	13,700	4,835.00	66,239,500	
トリケミカル研究所	16,100	3,635.00	58,523,500	
ＡＤＥＫＡ	79,900	2,590.00	206,941,000	
日油	65,300	6,570.00	429,021,000	
新日本理化	28,700	285.00	8,179,500	
ハリマ化成グループ	12,900	897.00	11,571,300	
花王	392,000	6,852.00	2,685,984,000	
第一工業製薬	5,900	3,370.00	19,883,000	
石原ケミカル	4,400	2,780.00	12,232,000	
日華化学	5,800	1,071.00	6,211,800	
ニイタカ	3,600	2,301.00	8,283,600	
三洋化成工業	10,400	5,910.00	61,464,000	
有機合成薬品工業	13,300	340.00	4,522,000	
大日本塗料	19,600	880.00	17,248,000	
日本ペイントホールディングス	652,100	1,399.00	912,287,900	
関西ペイント	195,000	2,938.00	572,910,000	
神東塗料	13,600	195.00	2,652,000	
中国塗料	41,800	894.00	37,369,200	
日本特殊塗料	13,000	1,076.00	13,988,000	
藤倉化成	23,400	547.00	12,799,800	
太陽ホールディングス	12,800	6,120.00	78,336,000	
ＤＩＣ	73,300	3,235.00	237,125,500	
サカタインクス	34,400	1,139.00	39,181,600	
東洋インキＳＣホールディングス	36,700	2,082.00	76,409,400	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	12,100	858.00	10,381,800	
富士フイルムホールディングス	311,400	9,549.00	2,973,558,600	
資生堂	330,100	7,764.00	2,562,896,400	
ライオン	213,900	1,903.00	407,051,700	
高砂香料工業	11,100	2,888.00	32,056,800	
マンダム	37,200	1,697.00	63,128,400	
ミルボン	21,900	6,660.00	145,854,000	
ファンケル	64,500	3,820.00	246,390,000	
コーセー	33,300	13,110.00	436,563,000	

コタ	11,200	1,623.00	18,177,600	
シーボン	2,300	1,886.00	4,337,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	75,600	2,494.00	188,546,400	
ノエビアホールディングス	15,000	5,970.00	89,550,000	
アジュバンコスメジャパン	4,000	1,056.00	4,224,000	
新日本製薬	4,800	2,012.00	9,657,600	
エステー	11,400	1,806.00	20,588,400	
アグロ　カネショウ	5,900	1,490.00	8,791,000	
コニシ	29,100	1,726.00	50,226,600	
長谷川香料	30,500	2,922.00	89,121,000	
星光ＰＭＣ	10,100	867.00	8,756,700	
小林製薬	49,700	9,030.00	448,791,000	
荒川化学工業	14,800	1,283.00	18,988,400	
メック	13,300	3,530.00	46,949,000	
日本高純度化学	4,900	2,918.00	14,298,200	
タカラバイオ	46,400	3,235.00	150,104,000	
ＪＣＵ	19,900	4,235.00	84,276,500	
新田ゼラチン	11,100	634.00	7,037,400	
ＯＡＴアグリオ	3,700	1,871.00	6,922,700	
デクセリアルズ	49,600	2,190.00	108,624,000	
アース製薬	14,600	6,580.00	96,068,000	
北興化学工業	16,500	1,126.00	18,579,000	
大成ラミック	5,400	2,806.00	15,152,400	
クミアイ化学工業	65,900	920.00	60,628,000	
日本農薬	31,600	555.00	17,538,000	
アキレス	12,200	1,353.00	16,506,600	
有沢製作所	24,700	949.00	23,440,300	
日東電工	107,100	8,830.00	945,693,000	
レック	21,000	1,117.00	23,457,000	
三光合成	18,600	450.00	8,370,000	
きもと	27,100	250.00	6,775,000	
藤森工業	15,900	4,685.00	74,491,500	
前澤化成工業	11,300	1,275.00	14,407,500	
未来工業	6,300	1,651.00	10,401,300	
ウェーブロックホールディングス	6,100	679.00	4,141,900	
ＪＳＰ	10,400	1,637.00	17,024,800	
エフピコ	32,600	4,275.00	139,365,000	
天馬	13,300	3,020.00	40,166,000	
信越ポリマー	27,300	997.00	27,218,100	
東リ	44,100	237.00	10,451,700	
ニフコ	65,100	3,555.00	231,430,500	
バルカー	14,400	2,208.00	31,795,200	

ユニ・チャーム	341,500	4,900.00	1,673,350,000	
ショーエイコーポレーション	3,900	841.00	3,279,900	
協和キリン	208,000	3,965.00	824,720,000	
武田薬品工業	1,474,200	3,727.00	5,494,343,400	
アステラス製薬	1,536,400	1,906.50	2,929,146,600	
大日本住友製薬	131,300	2,082.00	273,366,600	
塩野義製薬	222,800	7,280.00	1,621,984,000	
わかもと製薬	21,100	350.00	7,385,000	
日本新薬	50,200	9,260.00	464,852,000	
中外製薬	554,200	4,447.00	2,464,527,400	
科研製薬	30,300	5,120.00	155,136,000	
エーザイ	195,800	9,220.00	1,805,276,000	
ロート製薬	84,500	3,520.00	297,440,000	
小野薬品工業	406,900	2,748.50	1,118,364,650	
久光製薬	51,500	4,600.00	236,900,000	
持田製薬	24,600	3,655.00	89,913,000	
参天製薬	308,400	1,685.00	519,654,000	
扶桑薬品工業	5,700	2,556.00	14,569,200	
日本ケミファ	2,100	2,255.00	4,735,500	
ツムラ	59,100	3,850.00	227,535,000	
日医工	50,200	911.00	45,732,200	
キッセイ薬品工業	31,400	2,510.00	78,814,000	
生化学工業	31,300	1,117.00	34,962,100	
栄研化学	31,100	2,294.00	71,343,400	
日水製薬	6,500	1,027.00	6,675,500	
鳥居薬品	9,500	2,956.00	28,082,000	
ＪＣＲファーマ	49,900	2,920.00	145,708,000	
東和薬品	25,500	3,180.00	81,090,000	
富士製薬工業	10,900	1,161.00	12,654,900	
ゼリア新薬工業	32,100	2,194.00	70,427,400	
第一三共	1,392,500	2,790.00	3,885,075,000	
キョーリン製薬ホールディングス	39,100	1,866.00	72,960,600	
大幸薬品	26,700	931.00	24,857,700	
ダイト	11,300	3,735.00	42,205,500	
大塚ホールディングス	368,300	4,892.00	1,801,723,600	
大正製薬ホールディングス	43,700	6,600.00	288,420,000	
ペプチドリーム	93,000	4,005.00	372,465,000	
あすか製薬ホールディングス	20,200	1,071.00	21,634,200	
サワイグループホールディングス	38,800	5,230.00	202,924,000	
日本コークス工業	149,700	133.00	19,910,100	
ニチレキ	20,900	1,330.00	27,797,000	
ユシロ化学工業	9,900	1,203.00	11,909,700	

ビーピー・カストロール	6,300	1,350.00	8,505,000	
富士石油	43,000	247.00	10,621,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	6,400	1,160.00	7,424,000	
出光興産	196,600	2,704.00	531,606,400	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,665,600	439.30	1,170,998,080	
コスモエネルギーホールディングス	56,000	2,226.00	124,656,000	
横浜ゴム	102,600	1,954.00	200,480,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	93,300	2,056.00	191,824,800	
ブリヂストン	510,400	5,235.00	2,671,944,000	
住友ゴム工業	159,200	1,377.00	219,218,400	
藤倉コンポジット	15,500	710.00	11,005,000	
オカモト	10,500	4,350.00	45,675,000	
フコク	7,700	1,016.00	7,823,200	
ニッタ	18,300	2,882.00	52,740,600	
住友理工	34,300	728.00	24,970,400	
三ツ星ベルト	21,500	2,063.00	44,354,500	
バンドー化学	31,200	957.00	29,858,400	
日東紡績	26,400	3,685.00	97,284,000	
ＡＧＣ	162,700	5,670.00	922,509,000	
日本板硝子	89,900	575.00	51,692,500	
石塚硝子	3,000	2,062.00	6,186,000	
日本山村硝子	7,500	925.00	6,937,500	
日本電気硝子	71,200	2,438.00	173,585,600	
オハラ	7,100	1,390.00	9,869,000	
住友大阪セメント	31,900	3,100.00	98,890,000	
太平洋セメント	100,700	2,628.00	264,639,600	
日本ヒューム	16,300	751.00	12,241,300	
日本コンクリート工業	38,500	313.00	12,050,500	
三谷セキサン	8,300	6,300.00	52,290,000	
アジアパイルホールディングス	27,500	493.00	13,557,500	
東海カーボン	148,600	1,599.00	237,611,400	
日本カーボン	9,100	4,365.00	39,721,500	
東洋炭素	11,600	2,968.00	34,428,800	
ノリタケカンパニーリミテド	9,800	4,240.00	41,552,000	
ＴＯＴＯ	126,600	6,430.00	814,038,000	
日本碍子	195,000	1,901.00	370,695,000	
日本特殊陶業	134,800	1,741.00	234,686,800	
ＭＡＲＵＷＡ	6,100	11,230.00	68,503,000	
品川リフラクトリーズ	4,200	4,040.00	16,968,000	
黒崎播磨	3,000	4,990.00	14,970,000	
ヨータイ	12,800	1,300.00	16,640,000	
イソライト工業	7,900	692.00	5,466,800	

東京窯業	22,800	328.00	7,478,400	
ニッカトー	8,200	704.00	5,772,800	
フジミインコーポレーテッド	14,200	6,500.00	92,300,000	
クニミネ工業	5,700	1,102.00	6,281,400	
エーアンドエーマテリアル	3,400	1,002.00	3,406,800	
ニチアス	44,800	2,906.00	130,188,800	
ニチハ	24,700	3,325.00	82,127,500	
日本製鉄	836,500	2,313.50	1,935,242,750	
神戸製鋼所	320,800	719.00	230,655,200	
中山製鋼所	24,500	470.00	11,515,000	
合同製鐵	9,500	1,546.00	14,687,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	507,100	1,897.00	961,968,700	
東京製鐵	68,300	1,252.00	85,511,600	
共英製鋼	19,800	1,513.00	29,957,400	
大和工業	37,200	4,185.00	155,682,000	
東京鐵鋼	6,800	1,621.00	11,022,800	
大阪製鐵	9,400	1,239.00	11,646,600	
淀川製鋼所	23,000	2,537.00	58,351,000	
丸一鋼管	56,900	2,810.00	159,889,000	
モリ工業	5,200	2,401.00	12,485,200	
大同特殊鋼	28,700	5,140.00	147,518,000	
日本高周波鋼業	6,700	400.00	2,680,000	
日本冶金工業	13,700	2,782.00	38,113,400	
山陽特殊製鋼	21,000	1,850.00	38,850,000	
愛知製鋼	9,900	2,839.00	28,106,100	
日立金属	165,200	2,134.00	352,536,800	
日本金属	4,400	1,060.00	4,664,000	
大平洋金属	11,900	1,802.00	21,443,800	
新日本電工	113,400	324.00	36,741,600	
栗本鐵工所	8,000	1,656.00	13,248,000	
虹技	2,500	1,135.00	2,837,500	
三菱製鋼	13,000	1,296.00	16,848,000	
日亜鋼業	25,900	296.00	7,666,400	
日本精線	2,500	5,000.00	12,500,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,500	1,594.00	11,955,000	
シンニッタン	21,500	251.00	5,396,500	
新家工業	4,400	1,513.00	6,657,200	
大紀アルミニウム工業所	26,500	1,620.00	42,930,000	
日本軽金属ホールディングス	47,800	1,981.00	94,691,800	
三井金属鉱業	47,300	3,445.00	162,948,500	
東邦亜鉛	9,800	2,202.00	21,579,600	
三菱マテリアル	115,800	2,274.00	263,329,200	

住友金属鉱山	224,000	4,313.00	966,112,000	
ＤＯＷＡホールディングス	44,400	4,855.00	215,562,000	
古河機械金属	29,000	1,267.00	36,743,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,400	817.00	15,032,800	
東邦チタニウム	31,500	1,166.00	36,729,000	
ＵＡＣＪ	26,600	2,759.00	73,389,400	
ＣＫサンエツ	3,700	3,355.00	12,413,500	
古河電気工業	54,500	2,392.00	130,364,000	
住友電気工業	611,600	1,518.50	928,714,600	
フジクラ	211,800	657.00	139,152,600	
昭和電線ホールディングス	17,000	2,402.00	40,834,000	
東京特殊電線	2,300	2,778.00	6,389,400	
タツタ電線	31,100	547.00	17,011,700	
カナレ電気	2,700	1,730.00	4,671,000	
平河ヒューテック	9,800	1,199.00	11,750,200	
リョービ	21,700	1,353.00	29,360,100	
アーレスティ	21,800	458.00	9,984,400	
アサヒホールディングス	65,800	2,280.00	150,024,000	
稲葉製作所	9,900	1,493.00	14,780,700	
宮地エンジニアリンググループ	5,700	2,682.00	15,287,400	
トーカロ	45,200	1,406.00	63,551,200	
アルファＣｏ	6,200	1,253.00	7,768,600	
ＳＵＭＣＯ	223,500	2,511.00	561,208,500	
川田テクノロジーズ	3,600	3,880.00	13,968,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,700	6,530.00	37,221,000	
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,519.00	4,786,100	
信和	9,300	734.00	6,826,200	
東洋製罐グループホールディングス	111,600	1,614.00	180,122,400	
ホッカンホールディングス	8,900	1,453.00	12,931,700	
コロナ	9,700	930.00	9,021,000	
横河ブリッジホールディングス	30,100	2,284.00	68,748,400	
駒井ハルテック	3,600	1,676.00	6,033,600	
高田機工	1,600	2,849.00	4,558,400	
三和ホールディングス	165,200	1,530.00	252,756,000	
文化シヤッター	51,600	1,173.00	60,526,800	
三協立山	22,600	770.00	17,402,000	
アルインコ	11,600	1,043.00	12,098,800	
東洋シヤッター	3,900	654.00	2,550,600	
ＬＩＸＩＬ	241,300	3,300.00	796,290,000	
日本フイルコン	12,200	518.00	6,319,600	
ノーリツ	33,500	1,910.00	63,985,000	
長府製作所	17,800	2,086.00	37,130,800	

リンナイ	34,100	12,470.00	425,227,000	
ダイニチ工業	8,400	751.00	6,308,400	
日東精工	22,000	658.00	14,476,000	
三洋工業	2,100	1,902.00	3,994,200	
岡部	35,500	681.00	24,175,500	
ジーテクト	21,800	1,523.00	33,201,400	
東プレ	32,700	1,384.00	45,256,800	
高周波熱錬	33,700	648.00	21,837,600	
東京製綱	12,500	1,033.00	12,912,500	
サンコール	15,000	466.00	6,990,000	
モリテック　スチール	13,700	461.00	6,315,700	
パイオラックス	25,900	1,573.00	40,740,700	
エイチワン	17,200	734.00	12,624,800	
日本発條	174,600	822.00	143,521,200	
中央発條	8,400	1,132.00	9,508,800	
アドバネクス	2,500	1,200.00	3,000,000	
立川ブラインド工業	7,700	1,305.00	10,048,500	
三益半導体工業	13,700	2,487.00	34,071,900	
日本ドライケミカル	4,400	2,125.00	9,350,000	
日本製鋼所	53,300	2,919.00	155,582,700	
三浦工業	75,900	4,975.00	377,602,500	
タクマ	59,500	1,710.00	101,745,000	
ツガミ	36,500	1,828.00	66,722,000	
オークマ	20,500	5,660.00	116,030,000	
芝浦機械	18,300	2,742.00	50,178,600	
アマダ	257,100	1,205.00	309,805,500	
アイダエンジニアリング	46,100	1,130.00	52,093,000	
滝澤鉄工所	5,200	1,109.00	5,766,800	
ＦＵＪＩ	70,000	2,991.00	209,370,000	
牧野フライス製作所	20,600	4,355.00	89,713,000	
オーエスジー	81,200	2,090.00	169,708,000	
ダイジェット工業	2,200	1,175.00	2,585,000	
旭ダイヤモンド工業	46,500	538.00	25,017,000	
DMG森精機	104,100	2,109.00	219,546,900	
ソディック	38,900	936.00	36,410,400	
ディスコ	23,800	33,650.00	800,870,000	
日東工器	8,400	1,983.00	16,657,200	
日進工具	13,800	1,458.00	20,120,400	
パンチ工業	14,800	592.00	8,761,600	
冨士ダイス	8,900	681.00	6,060,900	
豊和工業	10,000	840.00	8,400,000	
ＯＫＫ	6,700	388.00	2,599,600	

東洋機械金属	12,700	500.00	6,350,000	
津田駒工業	3,400	856.00	2,910,400	
エンシュウ	4,600	833.00	3,831,800	
島精機製作所	25,700	2,285.00	58,724,500	
オプトラン	22,000	2,377.00	52,294,000	
ＮＣホールディングス	5,400	1,032.00	5,572,800	
イワキポンプ	11,200	967.00	10,830,400	
フリュー	17,200	1,585.00	27,262,000	
ヤマシンフィルタ	35,500	661.00	23,465,500	
日阪製作所	21,700	889.00	19,291,300	
やまびこ	34,000	1,318.00	44,812,000	
野村マイクロ・サイエンス	3,800	5,510.00	20,938,000	
平田機工	8,300	6,840.00	56,772,000	
ペガサスミシン製造	18,000	420.00	7,560,000	
マルマエ	7,200	2,106.00	15,163,200	
タツモ	8,200	1,736.00	14,235,200	
ナブテスコ	100,000	4,760.00	476,000,000	
三井海洋開発	18,700	1,725.00	32,257,500	
レオン自動機	17,200	1,540.00	26,488,000	
ＳＭＣ	51,900	76,790.00	3,985,401,000	
ホソカワミクロン	6,200	6,750.00	41,850,000	
ユニオンツール	6,600	4,045.00	26,697,000	
オイレス工業	24,600	1,699.00	41,795,400	
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,445.00	26,225,500	
サトーホールディングス	23,100	2,790.00	64,449,000	
技研製作所	15,500	4,825.00	74,787,500	
日本エアーテック	8,100	1,264.00	10,238,400	
カワタ	4,900	914.00	4,478,600	
日精樹脂工業	13,700	1,190.00	16,303,000	
オカダアイヨン	5,600	1,324.00	7,414,400	
ワイエイシイホールディングス	7,000	959.00	6,713,000	
小松製作所	802,900	2,859.00	2,295,491,100	
住友重機械工業	101,500	3,075.00	312,112,500	
日立建機	82,900	3,375.00	279,787,500	
日工	26,800	681.00	18,250,800	
巴工業	7,000	2,307.00	16,149,000	
井関農機	16,600	1,743.00	28,933,800	
ＴＯＷＡ	16,600	2,940.00	48,804,000	
丸山製作所	3,800	1,664.00	6,323,200	
北川鉄工所	8,100	1,643.00	13,308,300	
ローツェ	7,800	9,020.00	70,356,000	
タカキタ	6,300	658.00	4,145,400	

クボタ	864,500	2,469.50	2,134,882,750	
荏原実業	8,200	2,659.00	21,803,800	
三菱化工機	5,800	2,490.00	14,442,000	
月島機械	32,900	1,207.00	39,710,300	
帝国電機製作所	12,400	1,349.00	16,727,600	
新東工業	42,400	800.00	33,920,000	
澁谷工業	15,600	3,165.00	49,374,000	
アイチ　コーポレーション	30,500	771.00	23,515,500	
小森コーポレーション	45,200	858.00	38,781,600	
鶴見製作所	13,800	1,779.00	24,550,200	
住友精密工業	2,700	2,429.00	6,558,300	
日本ギア工業	7,400	304.00	2,249,600	
酒井重工業	3,200	2,545.00	8,144,000	
荏原製作所	73,600	6,220.00	457,792,000	
石井鐵工所	2,600	3,005.00	7,813,000	
酉島製作所	17,900	952.00	17,040,800	
北越工業	18,300	1,065.00	19,489,500	
ダイキン工業	225,800	29,085.00	6,567,393,000	
オルガノ	5,800	6,550.00	37,990,000	
トーヨーカネツ	6,800	2,530.00	17,204,000	
栗田工業	95,900	5,390.00	516,901,000	
椿本チエイン	25,400	3,510.00	89,154,000	
大同工業	8,700	1,070.00	9,309,000	
木村化工機	15,100	763.00	11,521,300	
アネスト岩田	29,900	1,055.00	31,544,500	
ダイフク	97,500	10,860.00	1,058,850,000	
サムコ	4,500	3,175.00	14,287,500	
加藤製作所	10,000	918.00	9,180,000	
油研工業	3,100	1,788.00	5,542,800	
タダノ	85,700	1,253.00	107,382,100	
フジテック	61,000	2,992.00	182,512,000	
ＣＫＤ	41,100	2,505.00	102,955,500	
キトー	14,900	1,741.00	25,940,900	
平和	49,500	2,027.00	100,336,500	
理想科学工業	13,000	2,355.00	30,615,000	
ＳＡＮＫＹＯ	42,200	2,824.00	119,172,800	
日本金銭機械	19,700	601.00	11,839,700	
マースグループホールディングス	11,300	1,703.00	19,243,900	
フクシマガリレイ	12,200	4,930.00	60,146,000	
オーイズミ	7,700	384.00	2,956,800	
ダイコク電機	8,200	1,193.00	9,782,600	
竹内製作所	29,700	2,766.00	82,150,200	

アマノ	46,400	2,872.00	133,260,800	
ＪＵＫＩ	24,700	793.00	19,587,100	
蛇の目ミシン工業	16,200	725.00	11,745,000	
マックス	23,800	1,959.00	46,624,200	
グローリー	45,600	2,378.00	108,436,800	
新晃工業	16,500	2,212.00	36,498,000	
大和冷機工業	25,700	1,259.00	32,356,300	
セガサミーホールディングス	161,200	1,558.00	251,149,600	
日本ピストンリング	6,500	1,453.00	9,444,500	
リケン	8,200	2,950.00	24,190,000	
ＴＰＲ	23,900	1,520.00	36,328,000	
ツバキ・ナカシマ	38,900	1,586.00	61,695,400	
ホシザキ	51,800	10,670.00	552,706,000	
大豊工業	14,600	870.00	12,702,000	
日本精工	364,100	771.00	280,721,100	
ＮＴＮ	410,100	254.00	104,165,400	
ジェイテクト	170,100	980.00	166,698,000	
不二越	15,100	4,555.00	68,780,500	
日本トムソン	48,700	595.00	28,976,500	
ＴＨＫ	103,100	2,704.00	278,782,400	
ユーシン精機	11,900	852.00	10,138,800	
前澤給装工業	12,400	1,068.00	13,243,200	
イーグル工業	22,000	1,283.00	28,226,000	
前澤工業	10,700	804.00	8,602,800	
日本ピラー工業	17,900	2,636.00	47,184,400	
キッツ	59,800	841.00	50,291,800	
マキタ	231,100	6,790.00	1,569,169,000	
日立造船	140,800	854.00	120,243,200	
三菱重工業	278,500	2,999.50	835,360,750	
ＩＨＩ	119,200	2,609.00	310,992,800	
スター精密	27,300	1,609.00	43,925,700	
日清紡ホールディングス	108,300	948.00	102,668,400	
イビデン	85,500	6,530.00	558,315,000	
コニカミノルタ	361,700	594.00	214,849,800	
ブラザー工業	216,900	2,433.00	527,717,700	
ミネベアミツミ	305,900	2,971.00	908,828,900	
日立製作所	851,900	6,607.00	5,628,503,300	
東芝	350,700	4,750.00	1,665,825,000	
三菱電機	1,771,900	1,535.50	2,720,752,450	
富士電機	106,800	4,955.00	529,194,000	
東洋電機製造	7,000	1,110.00	7,770,000	
安川電機	190,700	5,880.00	1,121,316,000	

シンフォニアテクノロジー	22,900	1,234.00	28,258,600	
明電舎	30,100	2,522.00	75,912,200	
オリジン	4,800	1,298.00	6,230,400	
山洋電気	8,700	7,350.00	63,945,000	
デンヨー	15,100	2,079.00	31,392,900	
東芝テック	19,000	4,850.00	92,150,000	
芝浦メカトロニクス	3,300	7,330.00	24,189,000	
マブチモーター	41,800	3,935.00	164,483,000	
日本電産	426,500	13,040.00	5,561,560,000	
トレックス・セミコンダクター	10,000	2,776.00	27,760,000	
東光高岳	9,800	1,531.00	15,003,800	
ダイヘン	19,400	4,925.00	95,545,000	
ヤーマン	30,000	1,128.00	33,840,000	
ＪＶＣケンウッド	159,300	216.00	34,408,800	
ミマキエンジニアリング	17,200	926.00	15,927,200	
Ｉ－ＰＥＸ	8,900	2,098.00	18,672,200	
日新電機	41,500	1,281.00	53,161,500	
大崎電気工業	35,200	570.00	20,064,000	
オムロン	147,500	11,270.00	1,662,325,000	
日東工業	26,000	1,764.00	45,864,000	
ＩＤＥＣ	23,800	2,333.00	55,525,400	
正興電機製作所	6,400	1,472.00	9,420,800	
不二電機工業	3,900	1,273.00	4,964,700	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	64,200	2,630.00	168,846,000	
サクサホールディングス	4,100	1,368.00	5,608,800	
メルコホールディングス	6,400	5,090.00	32,576,000	
テクノメディカ	4,700	1,658.00	7,792,600	
日本電気	225,200	6,080.00	1,369,216,000	
富士通	159,400	21,485.00	3,424,709,000	
沖電気工業	72,000	1,008.00	72,576,000	
岩崎通信機	7,800	904.00	7,051,200	
電気興業	8,500	2,320.00	19,720,000	
サンケン電気	20,700	5,690.00	117,783,000	
ナカヨ	3,400	1,417.00	4,817,800	
アイホン	10,000	2,229.00	22,290,000	
ルネサスエレクトロニクス	958,100	1,290.00	1,235,949,000	
セイコーエプソン	219,900	2,227.00	489,717,300	
ワコム	130,000	728.00	94,640,000	
アルバック	32,600	6,350.00	207,010,000	
アクセル	9,000	776.00	6,984,000	
ＥＩＺＯ	15,000	4,380.00	65,700,000	
日本信号	41,400	939.00	38,874,600	

京三製作所	38,000	472.00	17,936,000	
能美防災	24,000	2,106.00	50,544,000	
ホーチキ	13,900	1,188.00	16,513,200	
星和電機	10,400	524.00	5,449,600	
エレコム	41,300	1,908.00	78,800,400	
パナソニック	1,889,700	1,374.50	2,597,392,650	
シャープ	235,700	1,460.00	344,122,000	
アンリツ	106,500	2,000.00	213,000,000	
富士通ゼネラル	54,100	2,949.00	159,540,900	
ソニーグループ	1,110,000	11,950.00	13,264,500,000	
ＴＤＫ	85,700	12,290.00	1,053,253,000	
帝国通信工業	8,700	1,509.00	13,128,300	
タムラ製作所	63,700	785.00	50,004,500	
アルプスアルパイン	145,800	1,276.00	186,040,800	
池上通信機	5,600	795.00	4,452,000	
鈴木	9,400	872.00	8,196,800	
メイコー	13,700	2,946.00	40,360,200	
日本トリム	4,100	3,805.00	15,600,500	
ローランド　ディー．ジー．	10,900	3,125.00	34,062,500	
フォスター電機	17,900	954.00	17,076,600	
ＳＭＫ	4,500	2,442.00	10,989,000	
ヨコオ	14,900	2,725.00	40,602,500	
ホシデン	47,600	953.00	45,362,800	
ヒロセ電機	27,300	19,260.00	525,798,000	
日本航空電子工業	40,600	1,662.00	67,477,200	
ＴＯＡ	20,900	862.00	18,015,800	
マクセルホールディングス	36,200	1,329.00	48,109,800	
古野電気	23,900	1,119.00	26,744,100	
ユニデンホールディングス	4,200	2,797.00	11,747,400	
スミダコーポレーション	17,600	1,329.00	23,390,400	
アイコム	7,400	2,465.00	18,241,000	
リオン	7,900	2,700.00	21,330,000	
本多通信工業	16,400	472.00	7,740,800	
横河電機	177,300	1,888.00	334,742,400	
新電元工業	6,800	4,190.00	28,492,000	
アズビル	119,800	5,130.00	614,574,000	
東亜ディーケーケー	10,200	873.00	8,904,600	
日本光電工業	73,600	3,840.00	282,624,000	
チノー	5,600	1,495.00	8,372,000	
共和電業	17,000	389.00	6,613,000	
日本電子材料	7,300	1,966.00	14,351,800	
堀場製作所	32,800	8,070.00	264,696,000	

アドバンテスト	131,700	10,400.00	1,369,680,000	
小野測器	9,600	565.00	5,424,000	
エスペック	16,300	2,266.00	36,935,800	
キーエンス	173,900	69,260.00	12,044,314,000	
日置電機	8,600	9,410.00	80,926,000	
シスメックス	138,400	14,110.00	1,952,824,000	
日本マイクロニクス	31,700	1,541.00	48,849,700	
メガチップス	18,100	3,420.00	61,902,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,400	3,950.00	33,180,000	
澤藤電機	2,500	2,048.00	5,120,000	
原田工業	8,500	939.00	7,981,500	
コーセル	22,800	1,047.00	23,871,600	
イリソ電子工業	15,100	4,675.00	70,592,500	
オプテックスグループ	29,900	1,568.00	46,883,200	
千代田インテグレ	8,100	1,934.00	15,665,400	
アイ・オー・データ機器	7,900	920.00	7,268,000	
レーザーテック	77,900	27,520.00	2,143,808,000	
スタンレー電気	124,500	2,802.00	348,849,000	
岩崎電気	7,100	2,003.00	14,221,300	
ウシオ電機	91,400	2,123.00	194,042,200	
岡谷電機産業	16,100	365.00	5,876,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	20,100	333.00	6,693,300	
エノモト	5,700	1,744.00	9,940,800	
日本セラミック	16,900	3,075.00	51,967,500	
遠藤照明	10,300	930.00	9,579,000	
古河電池	13,400	1,651.00	22,123,400	
双信電機	10,200	852.00	8,690,400	
山一電機	12,300	1,718.00	21,131,400	
図研	11,900	4,005.00	47,659,500	
日本電子	32,400	8,850.00	286,740,000	
カシオ計算機	142,500	1,783.00	254,077,500	
ファナック	155,500	26,030.00	4,047,665,000	
日本シイエムケイ	41,100	420.00	17,262,000	
エンプラス	8,400	3,335.00	28,014,000	
大真空	6,300	3,740.00	23,562,000	
ローム	73,800	11,240.00	829,512,000	
浜松ホトニクス	127,300	6,820.00	868,186,000	
三井ハイテック	17,600	7,260.00	127,776,000	
新光電気工業	59,800	4,020.00	240,396,000	
京セラ	270,200	7,330.00	1,980,566,000	
太陽誘電	79,000	7,030.00	555,370,000	
村田製作所	520,600	9,763.00	5,082,617,800	

双葉電子工業	31,900	805.00	25,679,500	
北陸電気工業	7,800	1,033.00	8,057,400	
ニチコン	56,900	1,144.00	65,093,600	
日本ケミコン	17,900	2,242.00	40,131,800	
ＫＯＡ	25,300	1,749.00	44,249,700	
市光工業	23,000	711.00	16,353,000	
小糸製作所	106,300	6,900.00	733,470,000	
ミツバ	32,600	669.00	21,809,400	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	30,700	10,110.00	310,377,000	
キヤノン電子	17,000	1,630.00	27,710,000	
キヤノン	880,500	2,649.00	2,332,444,500	
リコー	450,800	1,139.00	513,461,200	
象印マホービン	48,600	1,765.00	85,779,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	3,000	1,591.00	4,773,000	
東京エレクトロン	103,800	50,180.00	5,208,684,000	
トヨタ紡織	51,700	2,108.00	108,983,600	
芦森工業	3,400	1,050.00	3,570,000	
ユニプレス	29,100	948.00	27,586,800	
豊田自動織機	143,400	9,830.00	1,409,622,000	
モリタホールディングス	28,400	1,630.00	46,292,000	
三櫻工業	24,600	1,107.00	27,232,200	
デンソー	390,100	7,935.00	3,095,443,500	
東海理化電機製作所	46,700	1,653.00	77,195,100	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	68,600	477.00	32,722,200	
川崎重工業	138,600	2,440.00	338,184,000	
名村造船所	53,200	228.00	12,129,600	
日本車輌製造	6,500	2,135.00	13,877,500	
三菱ロジスネクスト	23,500	1,049.00	24,651,500	
近畿車輛	3,000	1,130.00	3,390,000	
日産自動車	2,089,800	572.20	1,195,783,560	
いすゞ自動車	470,500	1,467.00	690,223,500	
トヨタ自動車	1,795,100	9,962.00	17,882,786,200	
日野自動車	221,300	1,001.00	221,521,300	
三菱自動車工業	655,900	285.00	186,931,500	
エフテック	12,500	642.00	8,025,000	
レシップホールディングス	7,000	586.00	4,102,000	
ＧＭＢ	3,300	887.00	2,927,100	
ファルテック	3,200	743.00	2,377,600	
武蔵精密工業	39,500	2,018.00	79,711,000	
日産車体	26,000	757.00	19,682,000	
新明和工業	50,100	948.00	47,494,800	
極東開発工業	30,600	1,733.00	53,029,800	

トピー工業	14,600	1,234.00	18,016,400	
ティラド	5,600	3,295.00	18,452,000	
曙ブレーキ工業	97,300	188.00	18,292,400	
タチエス	27,200	1,410.00	38,352,000	
ＮＯＫ	85,800	1,386.00	118,918,800	
フタバ産業	44,500	492.00	21,894,000	
ＫＹＢ	19,900	3,195.00	63,580,500	
大同メタル工業	36,700	604.00	22,166,800	
プレス工業	88,100	361.00	31,804,100	
ミクニ	22,700	322.00	7,309,400	
太平洋工業	37,200	1,268.00	47,169,600	
河西工業	24,100	396.00	9,543,600	
アイシン	129,700	4,335.00	562,249,500	
マツダ	556,100	969.00	538,860,900	
今仙電機製作所	15,600	710.00	11,076,000	
本田技研工業	1,395,100	3,382.00	4,718,228,200	
スズキ	351,200	4,925.00	1,729,660,000	
ＳＵＢＡＲＵ	507,800	2,063.50	1,047,845,300	
安永	8,600	1,158.00	9,958,800	
ヤマハ発動機	231,200	2,928.00	676,953,600	
ＴＢＫ	21,300	415.00	8,839,500	
エクセディ	24,100	1,739.00	41,909,900	
豊田合成	57,300	2,366.00	135,571,800	
愛三工業	27,800	860.00	23,908,000	
盟和産業	2,800	1,045.00	2,926,000	
日本プラスト	15,100	644.00	9,724,400	
ヨロズ	15,200	1,264.00	19,212,800	
エフ・シー・シー	29,000	1,595.00	46,255,000	
シマノ	71,400	33,420.00	2,386,188,000	
テイ・エス　テック	82,400	1,545.00	127,308,000	
ジャムコ	10,400	1,014.00	10,545,600	
テルモ	543,200	5,040.00	2,737,728,000	
クリエートメディック	5,400	981.00	5,297,400	
日機装	53,200	930.00	49,476,000	
日本エム・ディ・エム	10,200	2,301.00	23,470,200	
島津製作所	228,000	5,270.00	1,201,560,000	
ＪＭＳ	15,000	825.00	12,375,000	
長野計器	12,900	1,171.00	15,105,900	
ブイ・テクノロジー	8,300	4,870.00	40,421,000	
東京計器	11,300	1,034.00	11,684,200	
愛知時計電機	2,300	4,695.00	10,798,500	
インターアクション	8,900	2,820.00	25,098,000	

オーバル	16,000	279.00	4,464,000	
東京精密	29,900	5,040.00	150,696,000	
マニー	70,600	2,308.00	162,944,800	
ニコン	270,600	1,249.00	337,979,400	
トプコン	89,300	1,909.00	170,473,700	
オリンパス	929,200	2,427.00	2,255,168,400	
理研計器	15,600	2,990.00	46,644,000	
タムロン	13,800	2,624.00	36,211,200	
ＨＯＹＡ	345,800	17,980.00	6,217,484,000	
シード	6,900	704.00	4,857,600	
ノーリツ鋼機	15,900	2,809.00	44,663,100	
エー・アンド・デイ	15,000	1,158.00	17,370,000	
朝日インテック	193,800	3,315.00	642,447,000	
シチズン時計	224,900	500.00	112,450,000	
リズム	5,600	1,329.00	7,442,400	
大研医器	14,100	601.00	8,474,100	
メニコン	27,200	8,820.00	239,904,000	
シンシア	2,000	642.00	1,284,000	
松風	8,100	2,037.00	16,499,700	
セイコーホールディングス	25,100	2,261.00	56,751,100	
ニプロ	132,100	1,293.00	170,805,300	
中本パックス	4,500	1,838.00	8,271,000	
スノーピーク	11,500	5,240.00	60,260,000	
パラマウントベッドホールディングス	34,000	2,210.00	75,140,000	
トランザクション	9,700	1,164.00	11,290,800	
粧美堂	5,200	419.00	2,178,800	
ニホンフラッシュ	15,200	1,264.00	19,212,800	
前田工繊	19,500	3,340.00	65,130,000	
永大産業	23,200	308.00	7,145,600	
アートネイチャー	17,000	728.00	12,376,000	
バンダイナムコホールディングス	146,600	8,349.00	1,223,963,400	
アイフィスジャパン	4,500	705.00	3,172,500	
共立印刷	29,700	172.00	5,108,400	
ＳＨＯＥＩ	16,600	5,130.00	85,158,000	
フランスベッドホールディングス	22,800	950.00	21,660,000	
パイロットコーポレーション	29,900	4,345.00	129,915,500	
萩原工業	11,500	1,518.00	17,457,000	
トッパン・フォームズ	31,600	1,036.00	32,737,600	
フジシールインターナショナル	36,400	2,612.00	95,076,800	
タカラトミー	79,500	1,121.00	89,119,500	
廣済堂	12,300	1,066.00	13,111,800	
エステールホールディングス	4,700	668.00	3,139,600	

タカノ	6,100	772.00	4,709,200	
プロネクサス	14,200	1,075.00	15,265,000	
ホクシン	10,900	163.00	1,776,700	
ウッドワン	6,000	1,166.00	6,996,000	
大建工業	11,900	2,377.00	28,286,300	
凸版印刷	269,300	1,959.00	527,558,700	
大日本印刷	209,400	2,703.00	566,008,200	
共同印刷	5,500	2,655.00	14,602,500	
ＮＩＳＳＨＡ	36,400	1,814.00	66,029,600	
光村印刷	1,500	1,675.00	2,512,500	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,700	1,794.00	15,607,800	
アシックス	156,700	2,546.00	398,958,200	
ツツミ	4,400	2,403.00	10,573,200	
ローランド	12,300	5,540.00	68,142,000	
小松ウオール工業	5,400	1,960.00	10,584,000	
ヤマハ	105,400	7,160.00	754,664,000	
河合楽器製作所	5,000	4,220.00	21,100,000	
クリナップ	16,500	583.00	9,619,500	
ピジョン	107,100	3,235.00	346,468,500	
兼松サステック	1,100	1,811.00	1,992,100	
キングジム	14,300	886.00	12,669,800	
リンテック	37,900	2,530.00	95,887,000	
イトーキ	32,700	362.00	11,837,400	
任天堂	101,400	55,140.00	5,591,196,000	
三菱鉛筆	29,200	1,475.00	43,070,000	
タカラスタンダード	36,600	1,680.00	61,488,000	
コクヨ	85,000	1,937.00	164,645,000	
ナカバヤシ	17,400	595.00	10,353,000	
グローブライド	8,600	8,090.00	69,574,000	
オカムラ	60,900	1,687.00	102,738,300	
美津濃	17,500	2,600.00	45,500,000	
東京電力ホールディングス	1,502,900	287.00	431,332,300	
中部電力	542,100	1,324.50	718,011,450	
関西電力	671,400	1,073.50	720,747,900	
中国電力	255,600	1,029.00	263,012,400	
北陸電力	162,000	585.00	94,770,000	
東北電力	415,000	837.00	347,355,000	
四国電力	147,300	771.00	113,568,300	
九州電力	391,300	840.00	328,692,000	
北海道電力	165,800	511.00	84,723,800	
沖縄電力	34,500	1,430.00	49,335,000	
電源開発	141,000	1,632.00	230,112,000	

エフオン	10,700	889.00	9,512,300	
イーレックス	26,000	2,465.00	64,090,000	
レノバ	30,100	4,900.00	147,490,000	
東京瓦斯	340,800	2,172.50	740,388,000	
大阪瓦斯	320,900	2,110.00	677,099,000	
東邦瓦斯	87,100	5,220.00	454,662,000	
北海道瓦斯	9,500	1,570.00	14,915,000	
広島ガス	36,500	381.00	13,906,500	
西部ガスホールディングス	19,900	2,499.00	49,730,100	
静岡ガス	46,100	1,337.00	61,635,700	
メタウォーター	19,900	1,862.00	37,053,800	
ＳＢＳホールディングス	13,100	4,005.00	52,465,500	
東武鉄道	184,700	2,856.00	527,503,200	
相鉄ホールディングス	60,700	2,140.00	129,898,000	
東急	446,900	1,480.00	661,412,000	
京浜急行電鉄	227,600	1,310.00	298,156,000	
小田急電鉄	283,800	2,544.00	721,987,200	
京王電鉄	99,000	5,950.00	589,050,000	
京成電鉄	132,800	3,430.00	455,504,000	
富士急行	24,200	4,510.00	109,142,000	
新京成電鉄	4,500	2,152.00	9,684,000	
東日本旅客鉄道	311,900	6,918.00	2,157,724,200	
西日本旅客鉄道	157,900	5,111.00	807,026,900	
東海旅客鉄道	147,300	15,675.00	2,308,927,500	
西武ホールディングス	213,500	1,332.00	284,382,000	
鴻池運輸	28,200	1,380.00	38,916,000	
西日本鉄道	49,100	2,741.00	134,583,100	
ハマキョウレックス	13,600	3,355.00	45,628,000	
サカイ引越センター	8,100	4,800.00	38,880,000	
近鉄グループホールディングス	167,800	3,585.00	601,563,000	
阪急阪神ホールディングス	223,800	3,380.00	756,444,000	
南海電気鉄道	79,500	2,327.00	184,996,500	
京阪ホールディングス	74,700	3,105.00	231,943,500	
神戸電鉄	4,000	3,590.00	14,360,000	
名古屋鉄道	138,000	1,959.00	270,342,000	
山陽電気鉄道	12,000	2,010.00	24,120,000	
アルプス物流	11,700	993.00	11,618,100	
日本通運	58,100	7,950.00	461,895,000	
ヤマトホールディングス	235,100	2,847.00	669,329,700	
山九	43,100	5,240.00	225,844,000	
丸運	9,600	276.00	2,649,600	
丸全昭和運輸	13,600	3,425.00	46,580,000	

センコーグループホールディングス	92,600	1,012.00	93,711,200	
トナミホールディングス	4,000	5,070.00	20,280,000	
ニッコンホールディングス	56,300	2,349.00	132,248,700	
日本石油輸送	1,800	2,649.00	4,768,200	
福山通運	21,500	4,785.00	102,877,500	
セイノーホールディングス	125,700	1,388.00	174,471,600	
エスライン	4,600	925.00	4,255,000	
神奈川中央交通	4,200	3,510.00	14,742,000	
日立物流	34,600	4,660.00	161,236,000	
丸和運輸機関	35,400	1,667.00	59,011,800	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	17,000	1,796.00	30,532,000	
九州旅客鉄道	129,800	2,490.00	323,202,000	
ＳＧホールディングス	317,100	3,050.00	967,155,000	
日本郵船	140,600	9,830.00	1,382,098,000	
商船三井	99,900	8,980.00	897,102,000	
川崎汽船	51,700	5,820.00	300,894,000	
ＮＳユナイテッド海運	8,700	3,845.00	33,451,500	
飯野海運	83,000	551.00	45,733,000	
共栄タンカー	5,500	1,054.00	5,797,000	
乾汽船	11,500	2,472.00	28,428,000	
日本航空	408,800	2,422.00	990,113,600	
ＡＮＡホールディングス	452,900	2,634.50	1,193,165,050	
パスコ	3,200	1,487.00	4,758,400	
トランコム	5,100	8,500.00	43,350,000	
日新	13,400	1,563.00	20,944,200	
三菱倉庫	58,100	3,255.00	189,115,500	
三井倉庫ホールディングス	17,800	2,719.00	48,398,200	
住友倉庫	59,300	1,860.00	110,298,000	
澁澤倉庫	9,200	2,216.00	20,387,200	
東陽倉庫	28,100	344.00	9,666,400	
日本トランスシティ	36,900	635.00	23,431,500	
ケイヒン	3,200	1,421.00	4,547,200	
中央倉庫	10,200	1,017.00	10,373,400	
川西倉庫	3,100	1,160.00	3,596,000	
安田倉庫	13,800	962.00	13,275,600	
ファイズホールディングス	3,000	781.00	2,343,000	
東洋埠頭	5,100	1,505.00	7,675,500	
宇徳	12,000	557.00	6,684,000	
上組	92,300	2,416.00	222,996,800	
サンリツ	4,300	790.00	3,397,000	
キムラユニティー	4,500	1,400.00	6,300,000	
キユーソー流通システム	4,200	1,794.00	7,534,800	

近鉄エクスプレス	31,700	2,750.00	87,175,000	
東海運	9,500	332.00	3,154,000	
エーアイテイー	10,500	1,083.00	11,371,500	
内外トランスライン	6,500	2,156.00	14,014,000	
日本コンセプト	5,300	2,035.00	10,785,500	
ＮＥＣネッツエスアイ	57,600	2,161.00	124,473,600	
クロスキャット	4,900	1,122.00	5,497,800	
システナ	62,100	2,318.00	143,947,800	
デジタルアーツ	10,100	9,280.00	93,728,000	
日鉄ソリューションズ	25,200	3,920.00	98,784,000	
キューブシステム	9,100	1,148.00	10,446,800	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	2,900	1,738.00	5,040,200	
コア	7,500	1,524.00	11,430,000	
ラクーンホールディングス	12,400	1,618.00	20,063,200	
ソリトンシステムズ	8,900	1,538.00	13,688,200	
ソフトクリエイトホールディングス	6,900	3,185.00	21,976,500	
ＴＩＳ	173,900	3,225.00	560,827,500	
ＪＮＳホールディングス	8,600	529.00	4,549,400	
グリー	107,000	664.00	71,048,000	
GMOペパボ	1,900	3,685.00	7,001,500	
コーエーテクモホールディングス	46,300	5,190.00	240,297,000	
三菱総合研究所	7,500	4,360.00	32,700,000	
電算	2,100	2,345.00	4,924,500	
ＡＧＳ	9,200	892.00	8,206,400	
ファインデックス	14,900	1,061.00	15,808,900	
ブレインパッド	4,500	5,670.00	25,515,000	
ＫＬａｂ	31,900	682.00	21,755,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	23,300	1,052.00	24,511,600	
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	3,785.00	10,976,500	
ネクソン	391,700	2,218.00	868,790,600	
アイスタイル	53,600	437.00	23,423,200	
エムアップホールディングス	4,600	3,010.00	13,846,000	
エイチーム	12,100	1,512.00	18,295,200	
エニグモ	16,600	1,533.00	25,447,800	
テクノスジャパン	14,000	642.00	8,988,000	
コロプラ	57,400	845.00	48,503,000	
ブロードリーフ	86,700	532.00	46,124,400	
クロス・マーケティンググループ	7,200	902.00	6,494,400	
デジタルハーツホールディングス	8,100	2,048.00	16,588,800	
システム情報	13,300	1,001.00	13,313,300	
メディアドゥ	6,800	5,130.00	34,884,000	
じげん	43,600	425.00	18,530,000	

ブイキューブ	17,700	1,810.00	32,037,000	
エンカレッジ・テクノロジ	3,600	631.00	2,271,600	
サイバーリンクス	6,000	1,593.00	9,558,000	
フィックスターズ	18,800	810.00	15,228,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,100	2,272.00	16,131,200	
オプティム	12,200	2,114.00	25,790,800	
セレス	6,500	3,300.00	21,450,000	
ＳＨＩＦＴ	8,700	26,120.00	227,244,000	
ティーガイア	18,600	2,000.00	37,200,000	
セック	2,700	2,444.00	6,598,800	
テクマトリックス	27,100	1,991.00	53,956,100	
プロシップ	5,300	1,599.00	8,474,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	47,300	2,227.00	105,337,100	
GMOペイメントゲートウェイ	33,700	14,970.00	504,489,000	
ザッパラス	7,400	585.00	4,329,000	
システムリサーチ	5,200	2,026.00	10,535,200	
インターネットイニシアティブ	46,400	3,960.00	183,744,000	
さくらインターネット	19,100	637.00	12,166,700	
ヴィンクス	5,200	1,035.00	5,382,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	5,160.00	20,124,000	
ＳＲＡホールディングス	9,300	2,855.00	26,551,500	
システムインテグレータ	5,500	650.00	3,575,000	
朝日ネット	14,500	741.00	10,744,500	
ｅＢＡＳＥ	21,100	813.00	17,154,300	
アバント	18,800	1,502.00	28,237,600	
アドソル日進	6,300	2,252.00	14,187,600	
ＯＤＫソリューションズ	4,100	755.00	3,095,500	
フリービット	10,700	838.00	8,966,600	
コムチュア	16,000	3,040.00	48,640,000	
サイバーコム	2,900	1,331.00	3,859,900	
アステリア	12,900	696.00	8,978,400	
アイル	9,800	1,724.00	16,895,200	
マークラインズ	8,800	2,946.00	25,924,800	
メディカル・データ・ビジョン	22,200	1,706.00	37,873,200	
ｇｕｍｉ	24,400	1,025.00	25,010,000	
ショーケース	4,300	676.00	2,906,800	
モバイルファクトリー	4,200	1,066.00	4,477,200	
テラスカイ	5,800	2,170.00	12,586,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	2,020.00	15,756,000	
ＰＣＩホールディングス	8,100	1,121.00	9,080,100	
パイプドＨＤ	3,700	2,402.00	8,887,400	
アイビーシー	3,200	856.00	2,739,200	

ネオジャパン	3,500	1,535.00	5,372,500	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,800	3,160.00	12,008,000	
ラクス	52,400	3,915.00	205,146,000	
ランドコンピュータ	3,000	1,254.00	3,762,000	
ダブルスタンダード	2,300	7,750.00	17,825,000	
オープンドア	10,400	2,312.00	24,044,800	
マイネット	6,200	699.00	4,333,800	
アカツキ	7,000	3,290.00	23,030,000	
ベネフィットジャパン	1,500	2,366.00	3,549,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,600	3,035.00	13,961,000	
カナミックネットワーク	19,000	628.00	11,932,000	
ノムラシステムコーポレーション	9,700	301.00	2,919,700	
チェンジ	32,100	2,414.00	77,489,400	
シンクロ・フード	11,400	409.00	4,662,600	
オークネット	9,400	1,976.00	18,574,400	
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	1,029.00	3,910,200	
セグエグループ	4,800	824.00	3,955,200	
エイトレッド	3,400	2,447.00	8,319,800	
マクロミル	35,900	795.00	28,540,500	
ビーグリー	4,300	1,467.00	6,308,100	
オロ	5,600	3,875.00	21,700,000	
ユーザーローカル	5,400	1,919.00	10,362,600	
テモナ	4,100	812.00	3,329,200	
ニーズウェル	4,200	723.00	3,036,600	
マネーフォワード	26,400	9,090.00	239,976,000	
サインポスト	4,200	703.00	2,952,600	
電算システムホールディングス	7,200	2,768.00	19,929,600	
ソルクシーズ	7,600	1,014.00	7,706,400	
フェイス	5,800	690.00	4,002,000	
プロトコーポレーション	20,900	1,565.00	32,708,500	
ハイマックス	5,200	1,101.00	5,725,200	
野村総合研究所	302,100	4,335.00	1,309,603,500	
サイバネットシステム	12,800	704.00	9,011,200	
ＣＥホールディングス	9,800	595.00	5,831,000	
日本システム技術	3,300	1,826.00	6,025,800	
インテージホールディングス	21,800	1,597.00	34,814,600	
東邦システムサイエンス	4,900	963.00	4,718,700	
ソースネクスト	83,500	235.00	19,622,500	
インフォコム	15,900	2,521.00	40,083,900	
ＨＥＲＯＺ	5,100	2,041.00	10,409,100	
ラクスル	19,000	5,940.00	112,860,000	
ＩＰＳ	4,200	2,185.00	9,177,000	

ＦＩＧ	20,100	282.00	5,668,200	
システムサポート	5,400	1,374.00	7,419,600	
イーソル	10,900	935.00	10,191,500	
アルテリア・ネットワークス	19,400	1,768.00	34,299,200	
ＥｄｕＬａｂ	1,700	3,115.00	5,295,500	
東海ソフト	3,000	1,288.00	3,864,000	
ウイングアーク１ｓｔ	9,800	2,361.00	23,137,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	1,894.00	7,765,400	
サーバーワークス	1,800	3,845.00	6,921,000	
東名	1,900	1,170.00	2,223,000	
ヴィッツ	1,800	1,624.00	2,923,200	
トビラシステムズ	3,700	1,300.00	4,810,000	
Ｓａｎｓａｎ	15,500	11,810.00	183,055,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,300	1,575.00	5,197,500	
ギフティ	15,200	3,665.00	55,708,000	
ベース	3,000	4,970.00	14,910,000	
フォーカスシステムズ	11,900	1,044.00	12,423,600	
クレスコ	11,500	2,017.00	23,195,500	
フジ・メディア・ホールディングス	180,600	1,181.00	213,288,600	
オービック	54,800	22,200.00	1,216,560,000	
ジャストシステム	24,800	6,730.00	166,904,000	
ＴＤＣソフト	15,400	1,398.00	21,529,200	
Ｚホールディングス	2,389,400	740.30	1,768,872,820	
トレンドマイクロ	92,900	6,280.00	583,412,000	
ＩＤホールディングス	10,300	951.00	9,795,300	
日本オラクル	35,300	9,470.00	334,291,000	
アルファシステムズ	4,700	3,940.00	18,518,000	
フューチャー	18,500	2,530.00	46,805,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10,300	1,696.00	17,468,800	
ＳＢテクノロジー	6,300	3,105.00	19,561,500	
トーセ	5,200	787.00	4,092,400	
オービックビジネスコンサルタント	16,600	5,290.00	87,814,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	79,300	3,530.00	279,929,000	
アイティフォー	23,000	883.00	20,309,000	
東計電算	2,100	4,820.00	10,122,000	
エックスネット	3,100	1,052.00	3,261,200	
大塚商会	94,100	5,940.00	558,954,000	
サイボウズ	23,300	2,522.00	58,762,600	
電通国際情報サービス	25,200	4,465.00	112,518,000	
ＡＣＣＥＳＳ	22,000	976.00	21,472,000	
デジタルガレージ	28,800	5,120.00	147,456,000	
ＥＭシステムズ	29,000	821.00	23,809,000	

ウェザーニューズ	5,300	5,850.00	31,005,000	
ＣＩＪ	11,600	873.00	10,126,800	
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,505.00	6,309,000	
日本エンタープライズ	19,500	213.00	4,153,500	
WOWOW	8,400	2,448.00	20,563,200	
スカラ	15,900	744.00	11,829,600	
インテリジェント　ウェイブ	10,700	639.00	6,837,300	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	15,500	533.00	8,261,500	
ネットワンシステムズ	71,000	3,640.00	258,440,000	
システムソフト	37,300	201.00	7,497,300	
アルゴグラフィックス	13,600	3,405.00	46,308,000	
マーベラス	27,800	713.00	19,821,400	
エイベックス	30,100	1,501.00	45,180,100	
日本ユニシス	60,400	3,090.00	186,636,000	
兼松エレクトロニクス	9,500	3,885.00	36,907,500	
都築電気	7,900	1,845.00	14,575,500	
ＴＢＳホールディングス	115,500	1,658.00	191,499,000	
日本テレビホールディングス	145,400	1,226.00	178,260,400	
朝日放送グループホールディングス	17,600	724.00	12,742,400	
テレビ朝日ホールディングス	53,900	1,746.00	94,109,400	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	115,000	422.00	48,530,000	
テレビ東京ホールディングス	12,600	2,141.00	26,976,600	
日本ＢＳ放送	6,200	1,119.00	6,937,800	
ビジョン	29,900	1,268.00	37,913,200	
スマートバリュー	5,100	720.00	3,672,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	16,600	3,120.00	51,792,000	
ワイヤレスゲート	8,000	427.00	3,416,000	
コネクシオ	10,000	1,573.00	15,730,000	
クロップス	3,600	985.00	3,546,000	
日本電信電話	2,033,800	3,221.00	6,550,869,800	
ＫＤＤＩ	1,394,500	3,669.00	5,116,420,500	
ソフトバンク	1,580,300	1,535.50	2,426,550,650	
光通信	20,500	20,600.00	422,300,000	
エムティーアイ	17,200	722.00	12,418,400	
GMOインターネット	61,600	3,005.00	185,108,000	
ファイバーゲート	5,900	1,627.00	9,599,300	
アイドママーケティングコミュニケーション	5,500	384.00	2,112,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	45,000	5,390.00	242,550,000	
学研ホールディングス	24,800	1,252.00	31,049,600	
ゼンリン	31,800	1,070.00	34,026,000	
昭文社ホールディングス	7,700	512.00	3,942,400	
インプレスホールディングス	14,400	277.00	3,988,800	

アイネット	9,100	1,419.00	12,912,900	
松竹	11,500	11,680.00	134,320,000	
東宝	102,600	5,110.00	524,286,000	
東映	5,700	21,180.00	120,726,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	463,100	2,156.00	998,443,600	
ピー・シー・エー	2,600	5,450.00	14,170,000	
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,726.00	10,528,600	
ＤＴＳ	36,200	2,665.00	96,473,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	74,200	6,680.00	495,656,000	
シーイーシー	18,800	1,577.00	29,647,600	
カプコン	149,100	3,340.00	497,994,000	
アイ・エス・ビー	8,300	1,249.00	10,366,700	
ジャステック	10,300	1,264.00	13,019,200	
ＳＣＳＫ	40,200	7,270.00	292,254,000	
日本システムウエア	5,800	2,424.00	14,059,200	
アイネス	17,300	1,615.00	27,939,500	
ＴＫＣ	29,500	3,865.00	114,017,500	
富士ソフト	18,600	5,870.00	109,182,000	
ＮＳＤ	56,000	2,098.00	117,488,000	
コナミホールディングス	63,200	7,410.00	468,312,000	
福井コンピュータホールディングス	8,000	4,535.00	36,280,000	
ＪＢＣＣホールディングス	11,900	1,567.00	18,647,300	
ミロク情報サービス	17,400	1,671.00	29,075,400	
ソフトバンクグループ	1,379,700	6,320.00	8,719,704,000	
ホウスイ	1,400	951.00	1,331,400	
高千穂交易	6,800	1,205.00	8,194,000	
オルバヘルスケアホールディングス	2,900	1,564.00	4,535,600	
伊藤忠食品	4,200	5,380.00	22,596,000	
エレマテック	14,000	1,182.00	16,548,000	
ＪＡＬＵＸ	4,900	1,762.00	8,633,800	
あらた	13,900	4,430.00	61,577,000	
トーメンデバイス	2,300	5,430.00	12,489,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,800	5,810.00	33,698,000	
フィールズ	15,300	494.00	7,558,200	
双日	963,900	340.00	327,726,000	
アルフレッサ　ホールディングス	181,000	1,798.00	325,438,000	
横浜冷凍	49,000	908.00	44,492,000	
ラサ商事	9,300	919.00	8,546,700	
アルコニックス	18,600	1,685.00	31,341,000	
神戸物産	135,500	4,350.00	589,425,000	
ハイパー	4,400	540.00	2,376,000	
あい　ホールディングス	24,900	2,365.00	58,888,500	

ディーブイエックス	5,400	1,046.00	5,648,400	
ダイワボウホールディングス	79,500	2,088.00	165,996,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	41,600	2,728.00	113,484,800	
ラクト・ジャパン	6,000	2,776.00	16,656,000	
グリムス	5,200	2,923.00	15,199,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,400	820.00	24,928,000	
八洲電機	13,500	1,005.00	13,567,500	
メディアスホールディングス	9,900	924.00	9,147,600	
レスターホールディングス	18,200	1,958.00	35,635,600	
ジューテックホールディングス	4,000	1,119.00	4,476,000	
大光	6,700	695.00	4,656,500	
ＯＣＨＩホールディングス	5,100	1,285.00	6,553,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	84,600	917.00	77,578,200	
黒谷	4,800	829.00	3,979,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,100	725.00	2,247,500	
三洋貿易	17,600	1,213.00	21,348,800	
ビューティガレージ	2,800	4,805.00	13,454,000	
ウイン・パートナーズ	12,600	994.00	12,524,400	
ミタチ産業	4,800	800.00	3,840,000	
シップヘルスケアホールディングス	61,500	2,890.00	177,735,000	
明治電機工業	6,000	1,353.00	8,118,000	
デリカフーズホールディングス	6,800	661.00	4,494,800	
スターティアホールディングス	3,400	1,795.00	6,103,000	
コメダホールディングス	38,100	2,060.00	78,486,000	
ピーバンドットコム	2,400	695.00	1,668,000	
アセンテック	4,500	1,283.00	5,773,500	
富士興産	5,300	988.00	5,236,400	
協栄産業	2,000	1,440.00	2,880,000	
小野建	15,700	1,614.00	25,339,800	
南陽	3,600	2,007.00	7,225,200	
佐鳥電機	10,900	875.00	9,537,500	
エコートレーディング	3,700	650.00	2,405,000	
伯東	10,600	1,862.00	19,737,200	
コンドーテック	13,500	1,014.00	13,689,000	
中山福	10,100	423.00	4,272,300	
ナガイレーベン	23,200	2,620.00	60,784,000	
三菱食品	19,200	2,928.00	56,217,600	
松田産業	12,700	3,035.00	38,544,500	
第一興商	33,100	3,780.00	125,118,000	
メディパルホールディングス	174,900	2,174.00	380,232,600	
ＳＰＫ	7,500	1,385.00	10,387,500	
萩原電気ホールディングス	6,500	2,337.00	15,190,500	

アズワン	12,500	17,480.00	218,500,000	
スズデン	6,100	1,535.00	9,363,500	
尾家産業	5,100	1,134.00	5,783,400	
シモジマ	10,700	1,133.00	12,123,100	
ドウシシャ	16,500	1,779.00	29,353,500	
小津産業	3,900	1,928.00	7,519,200	
高速	9,300	1,640.00	15,252,000	
たけびし	6,100	1,600.00	9,760,000	
リックス	3,900	1,552.00	6,052,800	
丸文	15,500	808.00	12,524,000	
ハピネット	14,600	1,491.00	21,768,600	
橋本総業ホールディングス	3,500	2,249.00	7,871,500	
日本ライフライン	56,400	1,379.00	77,775,600	
タカショー	11,300	1,077.00	12,170,100	
マルカ	6,200	2,643.00	16,386,600	
ＩＤＯＭ	58,800	991.00	58,270,800	
進和	10,300	2,348.00	24,184,400	
エスケイジャパン	4,300	475.00	2,042,500	
ダイトロン	7,400	2,345.00	17,353,000	
シークス	25,000	1,306.00	32,650,000	
田中商事	5,400	660.00	3,564,000	
オーハシテクニカ	9,000	1,483.00	13,347,000	
白銅	6,300	2,778.00	17,501,400	
ダイコー通産	2,100	1,311.00	2,753,100	
伊藤忠商事	1,220,700	3,394.00	4,143,055,800	
丸紅	1,720,900	900.70	1,550,014,630	
高島	2,800	1,840.00	5,152,000	
長瀬産業	95,800	1,897.00	181,732,600	
蝶理	11,200	1,906.00	21,347,200	
豊田通商	175,300	5,030.00	881,759,000	
三共生興	26,500	536.00	14,204,000	
兼松	69,700	1,436.00	100,089,200	
ツカモトコーポレーション	2,900	1,423.00	4,126,700	
三井物産	1,392,200	2,506.00	3,488,853,200	
日本紙パルプ商事	9,100	3,850.00	35,035,000	
カメイ	22,800	1,214.00	27,679,200	
東都水産	2,000	6,310.00	12,620,000	
ＯＵＧホールディングス	2,800	2,993.00	8,380,400	
スターゼン	12,900	2,287.00	29,502,300	
山善	68,200	1,123.00	76,588,600	
椿本興業	3,200	3,825.00	12,240,000	
住友商事	1,101,400	1,592.50	1,753,979,500	

内田洋行	7,500	5,410.00	40,575,000	
三菱商事	1,062,600	3,437.00	3,652,156,200	
第一実業	7,900	4,885.00	38,591,500	
キヤノンマーケティングジャパン	43,300	2,552.00	110,501,600	
西華産業	9,200	1,705.00	15,686,000	
佐藤商事	14,400	1,238.00	17,827,200	
菱洋エレクトロ	13,300	2,345.00	31,188,500	
東京産業	15,800	709.00	11,202,200	
ユアサ商事	17,800	3,065.00	54,557,000	
神鋼商事	3,900	3,345.00	13,045,500	
トルク	9,400	234.00	2,199,600	
阪和興業	34,900	3,465.00	120,928,500	
正栄食品工業	11,300	4,250.00	48,025,000	
カナデン	14,200	1,048.00	14,881,600	
菱電商事	12,600	1,836.00	23,133,600	
フルサト工業	8,800	2,046.00	18,004,800	
岩谷産業	41,900	6,390.00	267,741,000	
ナイス	6,900	1,930.00	13,317,000	
ニチモウ	2,700	2,100.00	5,670,000	
極東貿易	5,000	2,541.00	12,705,000	
アステナホールディングス	24,700	623.00	15,388,100	
三愛石油	43,000	1,430.00	61,490,000	
稲畑産業	41,900	1,750.00	73,325,000	
ＧＳＩクレオス	8,600	1,044.00	8,978,400	
明和産業	16,200	1,286.00	20,833,200	
クワザワホールディングス	6,300	624.00	3,931,200	
ヤマエ久野	12,700	1,153.00	14,643,100	
ワキタ	34,400	1,041.00	35,810,400	
東邦ホールディングス	56,000	1,955.00	109,480,000	
サンゲツ	46,900	1,634.00	76,634,600	
ミツウロコグループホールディングス	25,800	1,380.00	35,604,000	
シナネンホールディングス	6,500	3,535.00	22,977,500	
伊藤忠エネクス	38,600	1,003.00	38,715,800	
サンリオ	49,000	2,352.00	115,248,000	
サンワテクノス	11,500	1,470.00	16,905,000	
リョーサン	19,300	2,375.00	45,837,500	
新光商事	23,600	834.00	19,682,400	
トーホー	7,900	1,618.00	12,782,200	
三信電気	9,400	1,703.00	16,008,200	
東陽テクニカ	17,300	1,200.00	20,760,000	
モスフードサービス	24,700	3,320.00	82,004,000	
加賀電子	15,800	3,035.00	47,953,000	

ソーダニッカ	16,700	577.00	9,635,900	
立花エレテック	12,900	1,559.00	20,111,100	
フォーバル	6,100	1,053.00	6,423,300	
ＰＡＬＴＡＣ	28,000	4,790.00	134,120,000	
三谷産業	23,100	387.00	8,939,700	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4,000	3,945.00	15,780,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	1,854.00	2,966,400	
コーア商事ホールディングス	13,100	685.00	8,973,500	
国際紙パルプ商事	37,300	373.00	13,912,900	
ヤマタネ	7,500	1,598.00	11,985,000	
丸紅建材リース	1,700	1,879.00	3,194,300	
日鉄物産	12,500	5,130.00	64,125,000	
泉州電業	4,900	4,675.00	22,907,500	
トラスコ中山	36,300	2,969.00	107,774,700	
オートバックスセブン	63,200	1,555.00	98,276,000	
モリト	12,800	685.00	8,768,000	
加藤産業	25,200	3,435.00	86,562,000	
北恵	4,400	1,029.00	4,527,600	
イノテック	9,800	1,474.00	14,445,200	
イエローハット	33,000	1,952.00	64,416,000	
ＪＫホールディングス	15,800	842.00	13,303,600	
日伝	14,500	2,467.00	35,771,500	
北沢産業	12,000	241.00	2,892,000	
杉本商事	8,800	2,739.00	24,103,200	
因幡電機産業	46,600	2,800.00	130,480,000	
東テク	5,800	2,667.00	15,468,600	
ミスミグループ本社	219,000	4,645.00	1,017,255,000	
アルテック	11,800	329.00	3,882,200	
タキヒヨー	5,800	1,844.00	10,695,200	
蔵王産業	3,400	1,670.00	5,678,000	
スズケン	73,900	3,370.00	249,043,000	
ジェコス	12,100	902.00	10,914,200	
グローセル	19,000	424.00	8,056,000	
ローソン	44,200	5,520.00	243,984,000	
サンエー	13,300	4,125.00	54,862,500	
カワチ薬品	12,300	2,308.00	28,388,400	
エービーシー・マート	27,300	5,940.00	162,162,000	
ハードオフコーポレーション	8,200	779.00	6,387,800	
アスクル	28,400	1,709.00	48,535,600	
ゲオホールディングス	23,700	1,201.00	28,463,700	
アダストリア	24,400	1,884.00	45,969,600	
くら寿司	18,300	4,120.00	75,396,000	

キャンドゥ	8,500	1,951.00	16,583,500	
アイケイ	5,700	615.00	3,505,500	
パルグループホールディングス	15,500	1,716.00	26,598,000	
エディオン	74,300	1,080.00	80,244,000	
サーラコーポレーション	36,100	624.00	22,526,400	
ワッツ	8,900	880.00	7,832,000	
ハローズ	7,100	3,060.00	21,726,000	
フジオフードグループ本社	14,700	1,357.00	19,947,900	
あみやき亭	3,900	2,900.00	11,310,000	
大黒天物産	5,600	7,120.00	39,872,000	
ハニーズホールディングス	14,200	1,113.00	15,804,600	
ファーマライズホールディングス	4,700	780.00	3,666,000	
アルペン	13,500	3,640.00	49,140,000	
ハブ	6,100	745.00	4,544,500	
クオールホールディングス	23,800	1,580.00	37,604,000	
ジンズホールディングス	11,900	7,380.00	87,822,000	
ビックカメラ	103,900	1,080.00	112,212,000	
ＤＣＭホールディングス	108,000	1,083.00	116,964,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	220,800	2,499.00	551,779,200	
東京一番フーズ	5,100	598.00	3,049,800	
きちりホールディングス	4,600	617.00	2,838,200	
アークランドサービスホールディングス	12,900	2,270.00	29,283,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	208,800	990.00	206,712,000	
ドトール・日レスホールディングス	27,800	1,659.00	46,120,200	
マツモトキヨシホールディングス	72,200	5,220.00	376,884,000	
ブロンコビリー	10,100	2,459.00	24,835,900	
ＺＯＺＯ	103,000	4,245.00	437,235,000	
トレジャー・ファクトリー	5,500	941.00	5,175,500	
物語コーポレーション	9,400	6,880.00	64,672,000	
ココカラファイン	15,600	8,830.00	137,748,000	
三越伊勢丹ホールディングス	305,900	770.00	235,543,000	
Ｈａｍｅｅ	4,700	1,642.00	7,717,400	
マーケットエンタープライズ	1,600	880.00	1,408,000	
ウエルシアホールディングス	92,400	3,925.00	362,670,000	
クリエイトＳＤホールディングス	25,800	3,930.00	101,394,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	20,400	388.00	7,915,200	
ミサワ	4,100	700.00	2,870,000	
ティーライフ	2,600	1,644.00	4,274,400	
チムニー	5,300	1,487.00	7,881,100	
シュッピン	12,200	1,200.00	14,640,000	
オイシックス・ラ・大地	23,100	3,875.00	89,512,500	
ネクステージ	35,400	2,220.00	78,588,000	

ジョイフル本田	51,400	1,485.00	76,329,000	
鳥貴族ホールディングス	6,600	1,851.00	12,216,600	
ホットランド	13,300	1,315.00	17,489,500	
すかいらーくホールディングス	225,500	1,574.00	354,937,000	
ＳＦＰホールディングス	8,500	1,377.00	11,704,500	
綿半ホールディングス	13,400	1,273.00	17,058,200	
ヨシックスホールディングス	3,600	2,189.00	7,880,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	51,100	1,114.00	56,925,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,300	1,406.00	13,075,800	
ＢＥＥＮＯＳ	8,900	2,961.00	26,352,900	
あさひ	13,300	1,400.00	18,620,000	
日本調剤	10,800	1,745.00	18,846,000	
コスモス薬品	17,600	19,740.00	347,424,000	
トーエル	8,900	872.00	7,760,800	
オンリー	3,700	763.00	2,823,100	
セブン&アイ・ホールディングス	682,800	4,952.00	3,381,225,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	93,800	863.00	80,949,400	
ツルハホールディングス	38,100	13,840.00	527,304,000	
サンマルクホールディングス	14,000	1,560.00	21,840,000	
フェリシモ	4,100	1,495.00	6,129,500	
トリドールホールディングス	43,400	2,343.00	101,686,200	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	16,500	625.00	10,312,500	
ウイルプラスホールディングス	3,100	981.00	3,041,100	
ＪＭホールディングス	11,900	2,295.00	27,310,500	
サツドラホールディングス	2,800	2,158.00	6,042,400	
アレンザホールディングス	13,600	1,410.00	19,176,000	
串カツ田中ホールディングス	4,800	2,102.00	10,089,600	
バロックジャパンリミテッド	12,600	874.00	11,012,400	
クスリのアオキホールディングス	17,400	7,920.00	137,808,000	
力の源ホールディングス	8,000	609.00	4,872,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	102,200	4,965.00	507,423,000	
メディカルシステムネットワーク	15,700	782.00	12,277,400	
はるやまホールディングス	8,800	580.00	5,104,000	
ノジマ	31,200	2,821.00	88,015,200	
カッパ・クリエイト	24,500	1,392.00	34,104,000	
ライトオン	13,000	721.00	9,373,000	
良品計画	201,000	2,485.00	499,485,000	
三城ホールディングス	23,100	269.00	6,213,900	
アドヴァングループ	18,200	936.00	17,035,200	
アルビス	5,800	2,408.00	13,966,400	

コナカ	20,600	361.00	7,436,600	
ハウス　オブ　ローゼ	2,400	1,649.00	3,957,600	
Ｇ－７ホールディングス	8,600	4,190.00	36,034,000	
イオン北海道	23,100	1,207.00	27,881,700	
コジマ	30,600	671.00	20,532,600	
ヒマラヤ	6,400	1,340.00	8,576,000	
コーナン商事	24,900	3,750.00	93,375,000	
エコス	6,600	2,008.00	13,252,800	
ワタミ	22,900	959.00	21,961,100	
マルシェ	4,600	484.00	2,226,400	
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	349,000	2,127.00	742,323,000	
西松屋チェーン	38,600	1,389.00	53,615,400	
ゼンショーホールディングス	93,900	2,775.00	260,572,500	
幸楽苑ホールディングス	11,100	1,502.00	16,672,200	
ハークスレイ	4,000	1,013.00	4,052,000	
サイゼリヤ	26,000	2,587.00	67,262,000	
ＶＴホールディングス	66,400	572.00	37,980,800	
魚力	5,600	2,185.00	12,236,000	
フジ・コーポレーション	9,600	1,252.00	12,019,200	
ユナイテッドアローズ	20,200	1,804.00	36,440,800	
ハイデイ日高	25,400	1,679.00	42,646,600	
京都きもの友禅	12,700	254.00	3,225,800	
コロワイド	59,800	1,783.00	106,623,400	
ピーシーデポコーポレーション	21,100	477.00	10,064,700	
壱番屋	12,400	4,820.00	59,768,000	
ＰＬＡＮＴ	5,000	742.00	3,710,000	
スギホールディングス	34,900	8,260.00	288,274,000	
薬王堂ホールディングス	7,800	2,501.00	19,507,800	
スクロール	25,400	895.00	22,733,000	
ヨンドシーホールディングス	16,300	1,799.00	29,323,700	
木曽路	23,000	2,299.00	52,877,000	
ＳＲＳホールディングス	23,600	828.00	19,540,800	
リテールパートナーズ	21,500	1,271.00	27,326,500	
ケーヨー	32,400	829.00	26,859,600	
上新電機	20,200	2,547.00	51,449,400	
日本瓦斯	85,100	1,584.00	134,798,400	
ロイヤルホールディングス	30,000	1,999.00	59,970,000	
いなげや	19,600	1,466.00	28,733,600	
チヨダ	17,500	811.00	14,192,500	
ライフコーポレーション	16,400	4,610.00	75,604,000	
リンガーハット	21,500	2,237.00	48,095,500	
ＭｒＭａｘＨＤ	24,600	658.00	16,186,800	

ＡＯＫＩホールディングス	34,400	657.00	22,600,800	
オークワ	27,500	1,190.00	32,725,000	
コメリ	27,100	2,588.00	70,134,800	
青山商事	39,400	692.00	27,264,800	
しまむら	20,300	9,710.00	197,113,000	
はせがわ	10,700	274.00	2,931,800	
高島屋	127,300	1,150.00	146,395,000	
松屋	38,300	972.00	37,227,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	82,800	888.00	73,526,400	
近鉄百貨店	6,800	2,515.00	17,102,000	
丸井グループ	147,700	2,077.00	306,772,900	
アクシアル　リテイリング	14,600	4,195.00	61,247,000	
イオン	671,600	3,013.00	2,023,530,800	
イズミ	35,500	3,630.00	128,865,000	
平和堂	32,300	2,264.00	73,127,200	
フジ	21,100	2,140.00	45,154,000	
ヤオコー	19,800	7,260.00	143,748,000	
ゼビオホールディングス	21,400	1,113.00	23,818,200	
ケーズホールディングス	148,900	1,219.00	181,509,100	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	9,500	771.00	7,324,500	
日産東京販売ホールディングス	27,300	247.00	6,743,100	
シルバーライフ	3,800	1,880.00	7,144,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	7,700	5,170.00	39,809,000	
ナルミヤ・インターナショナル	3,800	1,013.00	3,849,400	
ブックオフグループホールディングス	10,200	979.00	9,985,800	
ギフト	2,900	2,288.00	6,635,200	
アインホールディングス	25,400	7,220.00	183,388,000	
元気寿司	5,000	2,629.00	13,145,000	
ヤマダホールディングス	585,800	482.00	282,355,600	
アークランドサカモト	27,600	1,601.00	44,187,600	
ニトリホールディングス	69,300	21,100.00	1,462,230,000	
グルメ杵屋	12,800	998.00	12,774,400	
愛眼	13,900	224.00	3,113,600	
ケーユーホールディングス	9,500	1,032.00	9,804,000	
吉野家ホールディングス	57,500	2,070.00	119,025,000	
松屋フーズホールディングス	8,500	3,640.00	30,940,000	
サガミホールディングス	26,200	1,040.00	27,248,000	
関西スーパーマーケット	13,500	1,734.00	23,409,000	
王将フードサービス	11,600	5,940.00	68,904,000	
プレナス	19,700	2,043.00	40,247,100	
ミニストップ	13,000	1,454.00	18,902,000	
アークス	33,500	2,350.00	78,725,000	

バローホールディングス	35,800	2,515.00	90,037,000	
ベルク	8,700	6,070.00	52,809,000	
大庄	9,700	991.00	9,612,700	
ファーストリテイリング	23,300	76,620.00	1,785,246,000	
サンドラッグ	65,800	3,705.00	243,789,000	
サックスバー　ホールディングス	15,500	557.00	8,633,500	
ヤマザワ	4,300	1,743.00	7,494,900	
やまや	3,600	2,526.00	9,093,600	
ベルーナ	37,900	865.00	32,783,500	
島根銀行	6,000	595.00	3,570,000	
じもとホールディングス	11,800	703.00	8,295,400	
めぶきフィナンシャルグループ	908,100	249.00	226,116,900	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,900	1,613.00	35,324,700	
九州フィナンシャルグループ	356,900	427.00	152,396,300	
ゆうちょ銀行	495,100	972.00	481,237,200	
富山第一銀行	41,700	302.00	12,593,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,064,700	439.00	467,403,300	
西日本フィナンシャルホールディングス	114,100	716.00	81,695,600	
三十三フィナンシャルグループ	15,100	1,490.00	22,499,000	
第四北越フィナンシャルグループ	28,400	2,761.00	78,412,400	
ひろぎんホールディングス	257,800	637.00	164,218,600	
新生銀行	142,500	1,414.00	201,495,000	
あおぞら銀行	104,100	2,657.00	276,593,700	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,955,100	614.50	7,346,408,950	
りそなホールディングス	2,016,800	436.30	879,929,840	
三井住友トラスト・ホールディングス	330,300	3,733.00	1,233,009,900	
三井住友フィナンシャルグループ	1,209,400	3,896.00	4,711,822,400	
千葉銀行	583,200	689.00	401,824,800	
群馬銀行	359,700	354.00	127,333,800	
武蔵野銀行	26,000	1,804.00	46,904,000	
千葉興業銀行	44,500	290.00	12,905,000	
筑波銀行	72,700	177.00	12,867,900	
七十七銀行	54,800	1,269.00	69,541,200	
青森銀行	13,500	2,144.00	28,944,000	
秋田銀行	10,500	1,467.00	15,403,500	
山形銀行	19,600	876.00	17,169,600	
岩手銀行	11,400	1,727.00	19,687,800	
東邦銀行	156,300	215.00	33,604,500	
東北銀行	8,400	1,035.00	8,694,000	
みちのく銀行	11,200	898.00	10,057,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	157,700	2,091.00	329,750,700	
静岡銀行	425,600	892.00	379,635,200	

十六銀行	21,900	2,255.00	49,384,500	
スルガ銀行	153,300	380.00	58,254,000	
八十二銀行	393,600	384.00	151,142,400	
山梨中央銀行	20,300	851.00	17,275,300	
大垣共立銀行	34,500	1,953.00	67,378,500	
福井銀行	14,900	1,607.00	23,944,300	
北國銀行	16,200	2,159.00	34,975,800	
清水銀行	7,200	1,622.00	11,678,400	
富山銀行	3,400	2,074.00	7,051,600	
滋賀銀行	35,000	1,892.00	66,220,000	
南都銀行	25,400	2,011.00	51,079,400	
百五銀行	157,300	328.00	51,594,400	
京都銀行	62,600	5,010.00	313,626,000	
紀陽銀行	61,900	1,579.00	97,740,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	116,300	865.00	100,599,500	
山陰合同銀行	110,100	573.00	63,087,300	
中国銀行	150,400	893.00	134,307,200	
鳥取銀行	5,600	1,149.00	6,434,400	
伊予銀行	231,600	590.00	136,644,000	
百十四銀行	18,600	1,591.00	29,592,600	
四国銀行	24,800	735.00	18,228,000	
阿波銀行	26,800	2,198.00	58,906,400	
大分銀行	10,100	1,793.00	18,109,300	
宮崎銀行	10,900	2,087.00	22,748,300	
佐賀銀行	9,900	1,469.00	14,543,100	
沖縄銀行	16,000	2,757.00	44,112,000	
琉球銀行	37,900	791.00	29,978,900	
セブン銀行	583,900	257.00	150,062,300	
みずほフィナンシャルグループ	2,374,800	1,587.00	3,768,807,600	
高知銀行	6,300	830.00	5,229,000	
山口フィナンシャルグループ	218,100	661.00	144,164,100	
長野銀行	5,700	1,158.00	6,600,600	
名古屋銀行	14,100	2,679.00	37,773,900	
北洋銀行	263,400	259.00	68,220,600	
愛知銀行	5,900	3,625.00	21,387,500	
中京銀行	6,300	1,397.00	8,801,100	
大光銀行	6,000	1,405.00	8,430,000	
愛媛銀行	24,400	793.00	19,349,200	
トマト銀行	6,700	1,102.00	7,383,400	
京葉銀行	74,500	442.00	32,929,000	
栃木銀行	84,400	181.00	15,276,400	
北日本銀行	5,400	1,578.00	8,521,200	

東和銀行	30,700	523.00	16,056,100	
福島銀行	20,000	245.00	4,900,000	
大東銀行	8,400	654.00	5,493,600	
トモニホールディングス	135,100	329.00	44,447,900	
フィデアホールディングス	169,700	127.00	21,551,900	
池田泉州ホールディングス	201,000	168.00	33,768,000	
ＦＰＧ	59,200	707.00	41,854,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,700	1,415.00	19,385,500	
マーキュリアホールディングス	6,200	749.00	4,643,800	
ＳＢＩホールディングス	215,500	2,842.00	612,451,000	
ジャフコ　グループ	22,300	7,030.00	156,769,000	
大和証券グループ本社	1,309,300	659.50	863,483,350	
野村ホールディングス	2,668,800	580.90	1,550,305,920	
岡三証券グループ	149,600	420.00	62,832,000	
丸三証券	52,300	649.00	33,942,700	
東洋証券	59,400	159.00	9,444,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	187,000	419.00	78,353,000	
光世証券	4,700	593.00	2,787,100	
水戸証券	47,500	314.00	14,915,000	
いちよし証券	35,400	659.00	23,328,600	
松井証券	85,900	828.00	71,125,200	
マネックスグループ	157,200	617.00	96,992,400	
極東証券	23,800	834.00	19,849,200	
岩井コスモホールディングス	18,100	1,429.00	25,864,900	
藍澤證券	31,600	1,107.00	34,981,200	
マネーパートナーズグループ	19,900	213.00	4,238,700	
スパークス・グループ	81,700	280.00	22,876,000	
かんぽ生命保険	216,700	2,058.00	445,968,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	308,100	5,011.00	1,543,889,100	
アニコム　ホールディングス	49,200	895.00	44,034,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	424,400	3,769.00	1,599,563,600	
第一生命ホールディングス	860,100	2,342.50	2,014,784,250	
東京海上ホールディングス	575,600	5,584.00	3,214,150,400	
Ｔ＆Ｄホールディングス	522,400	1,428.00	745,987,200	
アドバンスクリエイト	8,400	1,033.00	8,677,200	
全国保証	45,500	5,550.00	252,525,000	
あんしん保証	7,300	312.00	2,277,600	
イントラスト	5,500	706.00	3,883,000	
日本モーゲージサービス	9,300	1,093.00	10,164,900	
Ｃａｓａ	5,300	945.00	5,008,500	
アルヒ	26,100	1,364.00	35,600,400	
プレミアグループ	8,200	3,530.00	28,946,000	

クレディセゾン	102,300	1,282.00	131,148,600	
芙蓉総合リース	18,400	7,720.00	142,048,000	
みずほリース	27,100	3,620.00	98,102,000	
東京センチュリー	40,700	6,420.00	261,294,000	
日本証券金融	74,400	864.00	64,281,600	
アイフル	294,300	347.00	102,122,100	
リコーリース	13,900	3,720.00	51,708,000	
イオンフィナンシャルサービス	107,200	1,311.00	140,539,200	
アコム	345,600	428.00	147,916,800	
ジャックス	19,400	2,798.00	54,281,200	
オリエントコーポレーション	475,300	148.00	70,344,400	
オリックス	1,061,200	2,157.00	2,289,008,400	
三菱ＨＣキャピタル	605,100	598.00	361,849,800	
九州リースサービス	9,300	602.00	5,598,600	
日本取引所グループ	472,200	2,853.00	1,347,186,600	
イー・ギャランティ	20,700	2,546.00	52,702,200	
アサックス	9,600	695.00	6,672,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,300	2,139.00	15,614,700	
いちご	200,000	347.00	69,400,000	
日本駐車場開発	202,800	176.00	35,692,800	
スター・マイカ・ホールディングス	10,900	1,409.00	15,358,100	
ＳＲＥホールディングス	2,800	8,280.00	23,184,000	
ＡＤワークスグループ	34,600	160.00	5,536,000	
ヒューリック	372,200	1,343.00	499,864,600	
三栄建築設計	8,000	1,934.00	15,472,000	
野村不動産ホールディングス	101,000	3,005.00	303,505,000	
三重交通グループホールディングス	39,200	514.00	20,148,800	
サムティ	25,700	2,310.00	59,367,000	
ディア・ライフ	26,300	496.00	13,044,800	
日本商業開発	12,200	1,710.00	20,862,000	
プレサンスコーポレーション	29,900	1,835.00	54,866,500	
ハウスコム	4,600	1,272.00	5,851,200	
日本管理センター	9,900	1,299.00	12,860,100	
サンセイランディック	7,500	828.00	6,210,000	
フージャースホールディングス	28,500	673.00	19,180,500	
オープンハウス	55,900	5,410.00	302,419,000	
東急不動産ホールディングス	478,100	671.00	320,805,100	
飯田グループホールディングス	146,500	2,817.00	412,690,500	
イーグランド	4,300	1,519.00	6,531,700	
ムゲンエステート	14,700	485.00	7,129,500	
ハウスドゥ	8,600	1,040.00	8,944,000	
シーアールイー	5,700	1,928.00	10,989,600	

グッドコムアセット	8,900	1,453.00	12,931,700	
ジェイ・エス・ビー	4,100	3,385.00	13,878,500	
テンポイノベーション	7,000	927.00	6,489,000	
フェイスネットワーク	2,800	1,383.00	3,872,400	
パーク２４	94,700	2,107.00	199,532,900	
パラカ	5,600	1,880.00	10,528,000	
三井不動産	797,300	2,686.50	2,141,946,450	
三菱地所	1,149,200	1,792.00	2,059,366,400	
平和不動産	30,400	4,230.00	128,592,000	
東京建物	173,700	1,706.00	296,332,200	
ダイビル	45,600	1,421.00	64,797,600	
京阪神ビルディング	31,400	1,472.00	46,220,800	
住友不動産	393,400	3,868.00	1,521,671,200	
テーオーシー	37,100	671.00	24,894,100	
東京楽天地	3,300	4,160.00	13,728,000	
スターツコーポレーション	21,400	2,975.00	63,665,000	
フジ住宅	23,000	707.00	16,261,000	
空港施設	20,700	606.00	12,544,200	
明和地所	11,300	605.00	6,836,500	
ゴールドクレスト	16,900	1,771.00	29,929,900	
エスリード	8,000	1,640.00	13,120,000	
日神グループホールディングス	29,600	520.00	15,392,000	
日本エスコン	32,500	809.00	26,292,500	
タカラレーベン	73,200	321.00	23,497,200	
ＡＶＡＮＴＩＡ	11,200	880.00	9,856,000	
イオンモール	88,800	1,702.00	151,137,600	
毎日コムネット	8,500	746.00	6,341,000	
ファースト住建	8,000	1,325.00	10,600,000	
カチタス	43,800	4,005.00	175,419,000	
トーセイ	25,700	1,183.00	30,403,100	
穴吹興産	4,800	2,050.00	9,840,000	
サンフロンティア不動産	23,100	1,195.00	27,604,500	
エフ・ジェー・ネクスト	19,000	1,046.00	19,874,000	
インテリックス	3,900	754.00	2,940,600	
ランドビジネス	7,400	271.00	2,005,400	
サンネクスタグループ	7,400	1,020.00	7,548,000	
グランディハウス	15,900	487.00	7,743,300	
日本空港ビルデング	61,100	5,040.00	307,944,000	
明豊ファシリティワークス	8,100	881.00	7,136,100	
日本工営	10,000	3,215.00	32,150,000	
ＬＩＦＵＬＬ	52,600	358.00	18,830,800	
ミクシィ	43,200	2,694.00	116,380,800	

ジェイエイシーリクルートメント	14,100	1,933.00	27,255,300	
日本M&Aセンター	277,800	3,385.00	940,353,000	
メンバーズ	5,200	3,215.00	16,718,000	
中広	3,100	390.00	1,209,000	
ＵＴグループ	24,500	3,175.00	77,787,500	
アイティメディア	5,800	2,285.00	13,253,000	
タケエイ	19,100	1,671.00	31,916,100	
Ｅ・Ｊホールディングス	9,100	1,289.00	11,729,900	
夢真ビーネックスグループ	45,300	1,292.00	58,527,600	
コシダカホールディングス	45,800	592.00	27,113,600	
アルトナー	4,500	868.00	3,906,000	
パソナグループ	18,500	3,095.00	57,257,500	
ＣＤＳ	4,400	1,599.00	7,035,600	
リンクアンドモチベーション	37,300	1,008.00	37,598,400	
ＧＣＡ	24,900	1,377.00	34,287,300	
エス・エム・エス	57,600	4,025.00	231,840,000	
サニーサイドアップグループ	6,300	741.00	4,668,300	
パーソルホールディングス	169,400	2,686.00	455,008,400	
リニカル	9,900	862.00	8,533,800	
クックパッド	54,600	223.00	12,175,800	
アイ・ケイ・ケイ	8,700	675.00	5,872,500	
学情	7,100	1,214.00	8,619,400	
スタジオアリス	8,600	2,257.00	19,410,200	
シミックホールディングス	9,600	1,508.00	14,476,800	
エプコ	4,000	848.00	3,392,000	
ＮＪＳ	3,900	1,933.00	7,538,700	
綜合警備保障	67,400	5,010.00	337,674,000	
カカクコム	125,200	3,760.00	470,752,000	
アイロムグループ	6,100	2,200.00	13,420,000	
セントケア・ホールディング	12,700	986.00	12,522,200	
サイネックス	3,300	673.00	2,220,900	
ルネサンス	10,800	1,171.00	12,646,800	
ディップ	26,600	3,840.00	102,144,000	
デジタルホールディングス	12,000	1,700.00	20,400,000	
新日本科学	21,000	864.00	18,144,000	
キャリアデザインセンター	4,500	1,217.00	5,476,500	
ベネフィット・ワン	61,700	4,945.00	305,106,500	
エムスリー	298,800	8,072.00	2,411,913,600	
ツカダ・グローバルホールディング	10,800	342.00	3,693,600	
アウトソーシング	97,200	2,025.00	196,830,000	
ウェルネット	17,700	514.00	9,097,800	
ワールドホールディングス	6,900	2,735.00	18,871,500	

ディー・エヌ・エー	71,800	2,041.00	146,543,800	
博報堂ＤＹホールディングス	235,800	1,886.00	444,718,800	
ぐるなび	30,100	502.00	15,110,200	
タカミヤ	21,200	485.00	10,282,000	
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	1,103.00	12,574,200	
ファンコミュニケーションズ	43,100	421.00	18,145,100	
ライク	4,700	1,811.00	8,511,700	
ビジネス・ブレークスルー	7,800	449.00	3,502,200	
エスプール	48,100	1,012.00	48,677,200	
ＷＤＢホールディングス	7,800	3,540.00	27,612,000	
手間いらず	2,200	5,760.00	12,672,000	
ティア	10,500	505.00	5,302,500	
ＣＤＧ	1,700	1,573.00	2,674,100	
アドウェイズ	28,000	682.00	19,096,000	
バリューコマース	13,300	4,715.00	62,709,500	
インフォマート	185,900	1,025.00	190,547,500	
ＪＰホールディングス	49,400	279.00	13,782,600	
エコナックホールディングス	34,100	88.00	3,000,800	
レッグス	3,700	2,269.00	8,395,300	
プレステージ・インターナショナル	63,900	785.00	50,161,500	
アミューズ	9,400	2,378.00	22,353,200	
ドリームインキュベータ	5,500	939.00	5,164,500	
クイック	10,700	1,401.00	14,990,700	
ＴＡＣ	10,500	252.00	2,646,000	
電通グループ	174,600	4,230.00	738,558,000	
イオンファンタジー	6,700	1,922.00	12,877,400	
シーティーエス	19,500	797.00	15,541,500	
ネクシィーズグループ	6,300	890.00	5,607,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	47,500	3,225.00	153,187,500	
アルプス技研	15,100	2,001.00	30,215,100	
ダイオーズ	3,600	1,075.00	3,870,000	
日本空調サービス	18,200	728.00	13,249,600	
オリエンタルランド	180,100	16,755.00	3,017,575,500	
ダスキン	39,400	2,675.00	105,395,000	
明光ネットワークジャパン	20,400	596.00	12,158,400	
ファルコホールディングス	8,200	1,757.00	14,407,400	
ラウンドワン	58,000	1,407.00	81,606,000	
リゾートトラスト	77,800	1,921.00	149,453,800	
ビー・エム・エル	21,900	4,410.00	96,579,000	
りらいあコミュニケーションズ	26,000	1,246.00	32,396,000	
リソー教育	86,700	419.00	36,327,300	
早稲田アカデミー	7,500	964.00	7,230,000	

ユー・エス・エス	189,700	1,897.00	359,860,900	
東京個別指導学院	15,500	641.00	9,935,500	
サイバーエージェント	417,500	2,155.00	899,712,500	
楽天グループ	868,700	1,113.00	966,863,100	
クリーク・アンド・リバー社	9,000	1,763.00	15,867,000	
モーニングスター	25,300	497.00	12,574,100	
テー・オー・ダブリュー	30,600	322.00	9,853,200	
山田コンサルティンググループ	10,100	1,150.00	11,615,000	
セントラルスポーツ	6,400	2,494.00	15,961,600	
フルキャストホールディングス	14,600	2,245.00	32,777,000	
エン・ジャパン	30,200	3,820.00	115,364,000	
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	101,500	3,080.00	312,620,000	
アトラグループ	3,800	315.00	1,197,000	
インターワークス	5,600	403.00	2,256,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	13,100.00	90,390,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	11,000	3,895.00	42,845,000	
ファーストロジック	3,700	782.00	2,893,400	
三機サービス	3,600	1,101.00	3,963,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	11,100	689.00	7,647,900	
デザインワン・ジャパン	5,600	224.00	1,254,400	
イー・ガーディアン	7,000	3,255.00	22,785,000	
リブセンス	10,800	204.00	2,203,200	
ジャパンマテリアル	52,300	1,319.00	68,983,700	
ベクトル	21,400	1,105.00	23,647,000	
ウチヤマホールディングス	9,300	350.00	3,255,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,800	1,634.00	20,915,200	
キャリアリンク	5,700	1,953.00	11,132,100	
ＩＢＪ	14,200	981.00	13,930,200	
アサンテ	6,300	1,795.00	11,308,500	
バリューＨＲ	6,900	1,771.00	12,219,900	
M&Aキャピタルパートナーズ	14,000	5,370.00	75,180,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,558.00	10,594,400	
ＥＲＩホールディングス	5,000	1,122.00	5,610,000	
アビスト	2,700	2,984.00	8,056,800	
シグマクシス	9,400	2,597.00	24,411,800	
ウィルグループ	12,700	1,307.00	16,598,900	
エスクロー・エージェント・ジャパン	26,600	215.00	5,719,000	
メドピア	13,100	4,045.00	52,989,500	
レアジョブ	3,400	1,400.00	4,760,000	
リクルートホールディングス	1,213,000	6,624.00	8,034,912,000	
エラン	23,600	1,360.00	32,096,000	

土木管理総合試験所	8,700	367.00	3,192,900	
ネットマーケティング	9,000	441.00	3,969,000	
日本郵政	1,281,500	972.50	1,246,258,750	
ベルシステム２４ホールディングス	28,600	1,667.00	47,676,200	
鎌倉新書	17,400	1,007.00	17,521,800	
ＳＭＮ	4,100	681.00	2,792,100	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,500	752.00	2,632,000	
エアトリ	10,800	3,110.00	33,588,000	
アトラエ	11,900	2,782.00	33,105,800	
ストライク	6,500	4,140.00	26,910,000	
ソラスト	41,800	1,522.00	63,619,600	
セラク	5,500	2,132.00	11,726,000	
インソース	16,600	2,094.00	34,760,400	
ベイカレント・コンサルティング	11,100	52,600.00	583,860,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,300	3,485.00	11,500,500	
アイモバイル	5,000	1,458.00	7,290,000	
キャリアインデックス	7,200	1,074.00	7,732,800	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	7,200	1,081.00	7,783,200	
船場	3,800	780.00	2,964,000	
グレイステクノロジー	17,500	1,189.00	20,807,500	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,900	2,782.00	136,039,800	
フルテック	2,600	1,341.00	3,486,600	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	5,600	547.00	3,063,200	
ソウルドアウト	4,300	1,670.00	7,181,000	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	3,200	605.00	1,936,000	
ウェルビー	6,500	1,580.00	10,270,000	
エル・ティー・エス	2,200	3,625.00	7,975,000	
ミダックホールディングス	7,400	4,730.00	35,002,000	
日総工産	13,600	769.00	10,458,400	
キュービーネットホールディングス	7,900	1,851.00	14,622,900	
ＲＰＡホールディングス	20,900	609.00	12,728,100	
スプリックス	5,100	930.00	4,743,000	
マネジメントソリューションズ	8,400	2,860.00	24,024,000	
プロレド・パートナーズ	3,800	2,479.00	9,420,200	
テノ．ホールディングス	2,400	999.00	2,397,600	
フロンティア・マネジメント	4,700	1,078.00	5,066,600	
ピアラ	3,100	838.00	2,597,800	
コプロ・ホールディングス	2,500	1,129.00	2,822,500	
ギークス	3,100	1,645.00	5,099,500	
カーブスホールディングス	46,800	889.00	41,605,200	
フォーラムエンジニアリング	12,100	906.00	10,962,600	
ダイレクトマーケティングミックス	9,100	4,370.00	39,767,000	

ポピンズホールディングス	4,000	3,195.00	12,780,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	6,900	6,180.00	42,642,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,800	1,158.00	10,190,400	
リログループ	92,700	2,388.00	221,367,600	
東祥	10,700	1,787.00	19,120,900	
エイチ・アイ・エス	37,700	2,522.00	95,079,400	
ラックランド	4,900	2,834.00	13,886,600	
共立メンテナンス	28,100	3,620.00	101,722,000	
イチネンホールディングス	17,900	1,276.00	22,840,400	
建設技術研究所	10,300	2,515.00	25,904,500	
スペース	12,400	919.00	11,395,600	
長大	6,900	1,945.00	13,420,500	
燦ホールディングス	7,600	1,443.00	10,966,800	
スバル興業	1,100	8,400.00	9,240,000	
東京テアトル	6,600	1,270.00	8,382,000	
タナベ経営	3,500	1,500.00	5,250,000	
ナガワ	5,400	11,310.00	61,074,000	
東京都競馬	12,700	4,150.00	52,705,000	
カナモト	30,000	2,638.00	79,140,000	
西尾レントオール	15,700	3,035.00	47,649,500	
トランス・コスモス	16,200	3,570.00	57,834,000	
乃村工藝社	72,900	940.00	68,526,000	
藤田観光	7,400	2,245.00	16,613,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	9,000	1,369.00	12,321,000	
日本管財	18,200	2,725.00	49,595,000	
トーカイ	16,500	2,467.00	40,705,500	
セコム	166,900	8,562.00	1,428,997,800	
セントラル警備保障	8,300	2,693.00	22,351,900	
丹青社	32,300	879.00	28,391,700	
メイテック	20,500	6,660.00	136,530,000	
応用地質	19,300	1,368.00	26,402,400	
船井総研ホールディングス	34,800	2,780.00	96,744,000	
進学会ホールディングス	7,400	423.00	3,130,200	
オオバ	12,300	838.00	10,307,400	
いであ	4,700	1,892.00	8,892,400	
学究社	5,200	1,394.00	7,248,800	
ベネッセホールディングス	62,200	2,416.00	150,275,200	
イオンディライト	21,000	3,650.00	76,650,000	
ナック	8,400	955.00	8,022,000	
ダイセキ	34,160	4,790.00	163,626,400	
ステップ	6,400	1,807.00	11,564,800	
合　計	185,639,660		495,780,077,820	

(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 9月 6日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	403,436,256
コール・ローン	3,800,551,820
国債証券	293,225,691,251
派生商品評価勘定	24,020,765
未収入金	4,327,365
未収利息	1,441,340,215
前払費用	41,977,736
差入委託証拠金	485,054,053
流動資産合計	299,426,399,461
資産合計	299,426,399,461
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,083,587
前受金	3,585,815
前受収益	15,916
未払金	214,551,618
未払解約金	234,432,107
未払利息	3,587
流動負債合計	454,672,630
負債合計	454,672,630
純資産の部	
元本等	
元本	96,959,233,542
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	202,012,493,289
元本等合計	298,971,726,831
純資産合計	298,971,726,831
負債純資産合計	299,426,399,461

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 9月 6日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 9月 6日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	96,959,233,542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 3.0835円 (1万口当たり純資産額) (30,835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 9月 6日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	97,174,191,513円
期中追加設定元本額	17,836,088,110円
期中一部解約元本額	18,051,046,081円
期末元本額	96,959,233,542円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,407,408,768円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	602,990,351円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,090,054,609円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,701,033円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	7,463,135,324円
世界経済インデックスファンド	10,721,177,214円
ＤＣマイセレクション２５	1,921,840,909円
ＤＣマイセレクション５０	1,620,000,445円

区分	2021年 9月 6日現在
ＤＣマイセレクション７５	1,106,112,432円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,219,572,135円
ＤＣマイセレクションＳ２５	908,119,245円
ＤＣマイセレクションＳ５０	705,562,190円
ＤＣマイセレクションＳ７５	374,191,381円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	33,856,949円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	86,293,505円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	43,515,121円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	11,642,062,675円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	637,859,398円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	224,230円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,235,701円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,233,869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）	32,014,192円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	55,303,998円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	98,901,872円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	88,726,795円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	87,966,593円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,514,648,158円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	469,928,981円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,868,805,381円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	213,323,229円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	62,395,825円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	493,995,321円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	184,080,867円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	226,965,520円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	777,056,639円
グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用）	2,055,787,615円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	721,314,555円
外国債券ファンド・シリーズ１	628,107,250円
コア投資戦略ファンド（安定型）	911,972,296円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,380,401,320円
分散投資コア戦略ファンドＡ	258,771,880円
分散投資コア戦略ファンドＳ	554,621,365円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	481,061,031円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,754,424,124円
コア投資戦略ファンド（切替型）	963,518,334円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	234,290,167円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,609,021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）	1,299,604,562円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	195,226,009円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	18,158,222,262円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	196,901,423円

区分	2021年 9月 6日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	223,663,146円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	367,719,460円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,680,914円
グローバル経済コア	770,005,660円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	12,819,707円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,314,150円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	277,929,615円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,950,566円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	4,460,252円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	4,176,020円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	2,158,272円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	2,252,717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）	502,848,396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）	10,593,671,885円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	337,194,301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）	343,735,507円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	226,924,808円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	185,883,196円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	43,657円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	20,374円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 9月 6日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,647,135,545
合計	3,647,135,545

(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 9月 6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	3,659,062,379	－	3,662,648,194	3,585,815
合計		3,659,062,379	－	3,662,648,194	3,585,815

(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 9月 6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	3,466,618,491	－	3,484,970,590	18,352,099
	アメリカドル	1,601,076,205	－	1,602,288,390	1,212,185
	カナダドル	156,586,122	－	157,615,200	1,029,078
	ユーロ	1,459,343,433	－	1,474,062,400	14,718,967
	イギリスポンド	249,612,731	－	251,004,600	1,391,869
	売建	32,823,346	－	32,824,082	△736
	シンガポールドル	8,648,176	－	8,640,152	8,024
	マレーシアリンギット	24,175,170	－	24,183,930	△8,760
合計		3,499,441,837	－	3,517,794,672	18,351,363

(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	9,963,281.30	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,691,601.56	

		T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,996,972.65	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,495,605.45	
		T 0.125% 05/31/23	6,800,000.00	6,794,687.50	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,045,517.22	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,982,500.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,240,224.61	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,400,249.98	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,979,687.50	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,165,859.37	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,972,265.60	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,010,625.04	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,970,117.21	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	987,148.44	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,862,890.60	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,383,691.42	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,540,375.00	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,886,562.48	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	7,007,109.41	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,948,125.04	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	9,006,128.49	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,200,898.48	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,726,875.04	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,963,437.50	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,947,500.00	
		T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,395,781.25	
		T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,812,492.18	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,211,257.01	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,877,984.37	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,421,523.45	
		T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,934,980.45	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,539,859.37	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,288,183.57	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,382,882.88	
		T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	15,095,179.68	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,445,800.77	
		T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,772,265.60	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,362,207.01	
		T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	11,013,750.00	
		T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	3,002,109.39	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	8,042,500.00	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,765,847.71	
		T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,830,128.98	

		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	8,056,250.00	
		T 1.125% 05/15/40	6,260,000.00	5,562,107.84	
		T 1.125% 08/15/40	9,300,000.00	8,234,132.85	
		T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,220,410.18	
		T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	8,106,250.00	
		T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	7,304,519.57	
		T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	9,612,070.36	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,641,799.79	
		T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	4,117,812.52	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,108,789.05	
		T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,623,828.12	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,557,812.50	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,095,312.52	
		T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,070,703.15	
		T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	12,000,625.00	
		T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,315,402.33	
		T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,208,593.78	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,616,585.93	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,957,828.16	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,085,000.00	
		T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,761,914.09	
		T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,637,304.73	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,780,234.37	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,425,898.47	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,584,628.91	
		T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,362,484.77	
		T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	11,478,402.39	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,025,312.50	
		T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,983,085.93	
		T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,075,878.90	
		T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,574,316.40	
		T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,602,265.62	
		T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,225,976.59	
		T 1.625% 11/15/50	11,300,000.00	10,471,921.86	
		T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,143,546.87	
		T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,669,398.42	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,721,202.13	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,789,312.88	
		T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,492,812.51	
		T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,241,130.84	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,133,125.00	
		T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	7,938,882.85	
		T 1.875% 02/15/51	13,600,000.00	13,370,500.00	

		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,466,529.68	
		T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,070,468.76	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,261,796.86	
		T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,710,550.40	
		T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,602,055.69	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,330,695.33	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,741,093.75	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,537,156.25	
		T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,831,187.50	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,041,125.02	
		T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	5,259,375.00	
		T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,791,806.25	
		T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,459,961.69	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,188,437.52	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,616,005.83	
		T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	8,016,503.92	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,352,460.92	
		T 2.25% 05/15/41	4,600,000.00	4,906,906.25	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,206,279.27	
		T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	4,454,166.42	
		T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,866,523.46	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,656,343.75	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,730,453.12	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,690,812.50	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,241,978.49	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,706,015.62	
		T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,889,234.39	
		T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,157,226.55	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,055,424.98	
		T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,795,710.94	
		T 2.375% 05/15/27	5,840,000.00	6,322,712.50	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,732,151.56	
		T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	3,022,421.87	
		T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,290,039.05	
		T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	6,684,265.62	
		T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,653,801.56	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,337,695.30	
		T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,564,353.92	
		T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,451,875.00	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,198,790.03	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,356,101.60	
		T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,624,042.99	

		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,752,617.18	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,083,520.31	
		T 2.625% 02/15/29	7,490,000.00	8,291,664.06	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,451,734.38	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,785,253.94	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,116,958.96	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,690,312.50	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,302,423.46	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,179,648.43	
		T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,265,894.56	
		T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,753,773.42	
		T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,053,463.27	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,949,023.46	
		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,048,515.63	
		T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,500,179.69	
		T 2.75% 08/15/47	7,050,000.00	8,234,730.49	
		T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,575,439.45	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,478,953.12	
		T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,446,875.00	
		T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,254,456.25	
		T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,565,640.62	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,335,625.00	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,123,259.37	
		T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,885,652.36	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,701,406.25	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,144,401.58	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,938,176.58	
		T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	4,393,462.50	
		T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,097,515.62	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,009,208.97	
		T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,641,210.95	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,254,290.62	
		T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,193,164.10	
		T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,134,863.30	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,890,270.35	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,061,718.75	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,503,535.93	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,457,657.04	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,751,367.21	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,263,567.18	
		T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,217,773.40	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,837,990.62	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,046,601.56	

		T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,283,707.03	
		T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	2,444,375.00	
		T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,422,228.93	
		T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	5,088,318.75	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,577,312.50	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,135,273.43	
		T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,839,396.10	
		T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	6,941,343.75	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	983,975.78	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,170,250.00	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,632,812.50	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,656,093.76	
		T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	4,026,093.75	
		T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,948,210.93	
		T 3% 02/15/47	800,000.00	974,937.50	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,442,558.61	
		T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,606,171.91	
		T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,942,228.12	
		T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,232,812.50	
		T 3% 05/15/47	5,710,000.00	6,967,984.37	
		T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,679,656.25	
		T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,599,328.14	
		T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,482,812.50	
		T 3% 11/15/44	2,800,000.00	3,376,625.00	
		T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,257,117.19	
		T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,309,828.12	
		T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,402,968.75	
		T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,708,984.37	
		T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,796,726.56	
		T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,788,904.69	
		T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,521,316.41	
		T 4.5% 05/15/38	550,000.00	783,234.37	
		T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,445,210.94	
		T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	2,020,190.62	
		T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,123,593.75	
		T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,630,664.06	
		T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,676,492.19	
		T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,669,824.22	
		T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,558,593.75	
		T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,095,847.65	
		T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,902,388.67	
		T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,489,031.25	

	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,843,649.41	
アメリカドル 小計		1,166,240,000.00	1,219,365,449.85 (133,922,907,357)	
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,058,500.60	
	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,226,648.00	
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,385,456.00	
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,596,698.00	
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,356,355.20	
	CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,769,539.80	
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,459,936.80	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,275,332.40	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,960,000.00	2,002,747.60	
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,676,593.40	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,091,560.50	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,405,301.60	
	CAN 1.5% 06/01/31	2,710,000.00	2,775,283.90	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	616,740.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,698,011.00	
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,741,677.50	
	CAN 1% 09/01/22	1,270,000.00	1,279,258.30	
	CAN 1% 09/01/26	860,000.00	866,708.00	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,400,694.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,906,560.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,374,244.20	
	CAN 2.5% 06/01/24	300,000.00	316,233.00	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,302,567.60	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	711,956.00	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,398,791.80	
	CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,445,980.50	
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	4,988,313.90	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,769,859.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,479,523.50	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,578,084.30	
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,415,126.40	
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,227,671.20	
カナダドル 小計		62,900,000.00	66,597,954.00 (5,831,982,831)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,685,191.50	
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	33,901,430.40	
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,440,000.00	37,203,385.20	
	MBONO 6.75% 03/09/23	22,180,000.00	22,560,165.20	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	40,248,893.10	
	MBONO 7.75% 05/29/31	31,580,000.00	33,277,740.80	

		MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	24,851,838.40	
		MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	11,127,138.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	33,970,000.00	37,146,534.70	
		MBONO 8.5% 11/18/38	26,220,000.00	28,844,884.20	
		MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	36,143,863.20	
		MBONO 8% 11/07/47	24,630,000.00	25,860,761.10	
		MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	36,401,141.70	
	メキシコペソ 小計		359,170,000.00	378,252,967.50 (2,085,535,561)	
	ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,406,688.60	
		BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	999,080.60	
		BGB 0.4% 06/22/40	1,050,000.00	1,035,793.50	
		BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,680,814.80	
		BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	563,808.00	
		BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,829,436.80	
		BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,820,163.80	
		BGB 0.8% 06/22/28	2,160,000.00	2,340,727.20	
		BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,583,586.40	
		BGB 0% 10/22/27	430,000.00	442,538.80	
		BGB 0% 10/22/31	1,020,000.00	1,024,753.20	
		BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,718,160.00	
		BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	848,613.60	
		BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,678,576.80	
		BGB 1.7% 06/22/50	1,140,000.00	1,421,272.20	
		BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,316,490.00	
		BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,454,397.20	
		BGB 1% 06/22/31	1,980,000.00	2,197,522.80	
		BGB 2.15% 06/22/66	770,000.00	1,127,002.80	
		BGB 2.25% 06/22/23	1,010,000.00	1,063,863.30	
		BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,112,241.90	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,339,918.80	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,040,564.00	
		BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,409,709.50	
		BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	3,191,903.00	
		BGB 4.25% 09/28/22	1,820,000.00	1,915,986.80	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,411,240.20	
		BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,548,806.40	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,895,586.20	
		BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,460,531.10	
		BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,223,406.80	
		BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	4,995,936.00	
		BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,045,001.70	
		BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,677,110.40	

		BTPS 0.3% 08/15/23	2,900,000.00	2,940,919.00	
		BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	591,269.40	
		BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,800,932.10	
		BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,306,060.40	
		BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,131,733.80	
		BTPS 0.6% 08/01/31	2,290,000.00	2,267,351.90	
		BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	685,262.60	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,341,102.50	
		BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,887,970.00	
		BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,042,440.00	
		BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	985,636.20	
		BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,636,373.00	
		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,301,694.50	
		BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,488,409.00	
		BTPS 0.95% 12/01/31	1,700,000.00	1,733,031.00	
		BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,008,700.00	
		BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	3,024,960.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,072,343.00	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,073,064.60	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,450,000.00	1,517,410.50	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,438,989.00	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,029,760.20	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,530,944.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,560,866.00	
		BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,046,947.80	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,279,786.30	
		BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,775,026.20	
		BTPS 1.7% 09/01/51	1,120,000.00	1,117,480.00	
		BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,385,696.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,925,550.40	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,117,720.00	
		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,905,902.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,043,290.60	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,526,112.00	
		BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	733,861.70	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,550,681.60	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,123,580.80	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,100,600.80	
		BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	2,119,473.80	
		BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,084,018.00	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,273,733.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,213,258.00	

		BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	2,705,238.90	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,020,000.00	1,230,222.00	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,220,655.50	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,574,205.50	
		BTPS 2% 02/01/28	2,690,000.00	2,991,253.10	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,276,281.70	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,822,073.00	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,611,089.00	
		BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,862,623.40	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,943,026.40	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,946,752.80	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,409,913.50	
		BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,764,220.40	
		BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	4,028,102.40	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,083,657.50	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,507,377.60	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,876,531.40	
		BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	4,013,978.00	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,734,572.70	
		BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	4,956,341.50	
		BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,948,416.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	4,760,550.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,932,558.00	
		BTPS 5.5% 09/01/22	1,400,000.00	1,482,866.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,688,912.50	
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	3,498,705.60	
		BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,329,121.20	
		BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,413,509.10	
		BTPS 5% 09/01/40	2,880,000.00	4,626,950.40	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,983,156.00	
		BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	4,422,906.60	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,922,382.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	962,440.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,089,595.90	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,129,662.90	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,309,601.00	
		DBR 0.5% 02/15/25	1,350,000.00	1,409,062.50	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,165,180.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,565,999.60	
		DBR 0.5% 08/15/27	4,040,000.00	4,321,345.60	
		DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,719,368.80	
		DBR 0% 02/15/31	800,000.00	831,304.00	
		DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,882,970.60	

		DBR 0% 05/15/36	1,670,000.00	1,695,851.60	
		DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,502,989.50	
		DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,647,350.00	
		DBR 0% 08/15/30	6,450,000.00	6,713,418.00	
		DBR 0% 08/15/30	670,000.00	701,503.40	
		DBR 0% 08/15/31	750,000.00	777,855.00	
		DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,243,907.20	
		DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,245,082.40	
		DBR 0% 11/15/28	900,000.00	936,189.00	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,677,055.20	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,057,236.00	
		DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,135,243.20	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,430,697.60	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,862,664.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,752,382.50	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,105,000.00	
		DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,909,203.20	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,585,093.40	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	6,144,196.50	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,014,783.20	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,784,287.70	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,848,095.20	
		DBR 4.25% 07/04/39	2,310,000.00	4,148,436.60	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,508,060.50	
		DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,980,861.60	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,461,984.90	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,469,790.80	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,322,266.40	
		DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,762,659.30	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,976,825.00	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,400,576.80	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,867,902.00	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,824,724.10	
		FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,344,449.10	
		FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,671,160.50	
		FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,161,094.00	
		FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	809,681.40	
		FRTR 0.5% 06/25/44	1,230,000.00	1,207,564.80	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,770,430.20	
		FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,761,430.00	
		FRTR 0.75% 05/25/53	770,000.00	755,254.50	
		FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	6,309,985.50	

		FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,071,279.00	
		FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,557,400.00	
		FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,340,145.80	
		FRTR 0% 02/25/27	1,660,000.00	1,701,616.20	
		FRTR 0% 03/25/23	7,190,000.00	7,268,514.80	
		FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,052,637.50	
		FRTR 0% 03/25/25	5,490,000.00	5,611,603.50	
		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,353,628.00	
		FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,106,742.00	
		FRTR 0% 11/25/31	2,910,000.00	2,915,849.10	
		FRTR 1.25% 05/25/34	4,490,000.00	5,106,970.90	
		FRTR 1.25% 05/25/36	5,930,000.00	6,767,671.80	
		FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,806,542.90	
		FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	4,301,753.40	
		FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,607,574.00	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,137,158.20	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,740,658.20	
		FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,484,604.80	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,044,087.50	
		FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,638,459.20	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,429,476.00	
		FRTR 2.25% 10/25/22	2,940,000.00	3,038,842.80	
		FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,895,505.20	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,160,418.00	
		FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,713,119.60	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,050,000.00	4,865,177.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,561,516.50	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,555,081.80	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	7,974,093.60	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,130,000.00	5,076,922.60	
		FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	4,710,457.40	
		FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	4,139,190.30	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,434,630.50	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,495,621.10	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,134,222.20	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,426,452.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,151,460.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	964,363.50	
		IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,057,521.60	
		IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	776,119.60	
		IRISH 0.55% 04/22/41	390,000.00	392,640.30	
		IRISH 0.9% 05/15/28	720,000.00	780,760.80	
		IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	533,757.70	

		IRISH 0% 10/18/31	880,000.00	878,838.40	
		IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,324,620.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	763,290.80	
		IRISH 1.35% 03/18/31	620,000.00	705,938.20	
		IRISH 1.5% 05/15/50	780,000.00	927,981.60	
		IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	991,634.20	
		IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,522,879.00	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,483,677.80	
		IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,506,753.00	
		IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,069,939.10	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,081,235.30	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,832,294.40	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,395,146.60	
		NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,797,996.60	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,563,321.60	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,451,544.00	
		NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,276,373.50	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,760,194.80	
		NETHER 0% 01/15/24	1,420,000.00	1,445,020.40	
		NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,898,548.80	
		NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	694,589.00	
		NETHER 0% 01/15/52	980,000.00	918,083.60	
		NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,975,046.40	
		NETHER 0% 07/15/31	860,000.00	880,941.00	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,030,927.80	
		NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,647,614.00	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,230,000.00	3,700,818.80	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,147,150.30	
		NETHER 3.75% 01/15/23	1,560,000.00	1,655,940.00	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,937,275.00	
		NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,543,808.00	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,404,284.80	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	222,570.00	
		OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,395,967.30	
		OBL 0% 04/10/26	4,070,000.00	4,205,449.60	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,850,237.50	
		OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,246,262.60	
		OBL 0% 10/07/22	3,110,000.00	3,134,320.20	
		OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	3,001,326.00	
		OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,606,330.00	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,534,341.20	
		OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,572,084.80	

		RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,879,456.80	
		RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	942,599.00	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,747,186.20	
		RAGB 0.75% 03/20/51	680,000.00	727,307.60	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,222,688.00	
		RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	320,819.40	
		RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,478,536.00	
		RAGB 0% 02/20/31	880,000.00	891,844.80	
		RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	952,059.60	
		RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,521,195.00	
		RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,469,160.00	
		RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	322,380.80	
		RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	394,153.20	
		RAGB 1.2% 10/20/25	700,000.00	754,467.00	
		RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,171,093.20	
		RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	452,096.70	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,064,537.10	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,401,540.70	
		RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	1,398,748.50	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,404,842.40	
		RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,344,873.90	
		RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,478,873.20	
		RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,010,561.10	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,948,036.00	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,717,569.00	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,658,619.80	
		RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	540,864.00	
		RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	423,508.20	
		RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	410,932.00	
		RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	401,212.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	652,407.40	
		RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	924,105.30	
		RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	692,139.50	
		RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	810,593.20	
		RFGB 0.75% 04/15/31	620,000.00	677,709.60	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	733,000.80	
		RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	547,932.60	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,820.00	
		RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	642,883.50	
		RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	640,292.80	
		RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	619,551.10	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	673,705.50	
		RFGB 1.625% 09/15/22	850,000.00	870,544.50	

		RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	881,648.80	
		RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	513,907.80	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	782,735.20	
		RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	981,441.80	
		SPGB 0.1% 04/30/31	2,180,000.00	2,146,471.60	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,342,372.30	
		SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,655,697.00	
		SPGB 0.45% 10/31/22	2,460,000.00	2,491,512.60	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,994,018.00	
		SPGB 0.5% 10/31/31	930,000.00	945,605.40	
		SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	3,079,151.00	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,585,009.20	
		SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	966,691.20	
		SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,389,879.50	
		SPGB 0% 01/31/26	1,530,000.00	1,554,755.40	
		SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,944,069.70	
		SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,404,585.40	
		SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,277,967.60	
		SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	2,355,869.20	
		SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,342,678.00	
		SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,983,117.50	
		SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,740,992.00	
		SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,642,408.00	
		SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,989,235.60	
		SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,348,225.60	
		SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	602,045.40	
		SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,916,484.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,284,850.00	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,199,322.50	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,115,334.60	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,410,311.80	
		SPGB 1% 10/31/50	2,330,000.00	2,185,353.60	
		SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,115,194.10	
		SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,976,995.20	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,504,271.00	
		SPGB 2.75% 10/31/24	2,500,000.00	2,761,225.00	
		SPGB 2.9% 10/31/46	2,050,000.00	2,856,019.00	
		SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	2,802,236.20	
		SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,814,235.20	
		SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,840,236.40	
		SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,982,376.10	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,413,197.20	

		SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,457,217.60	
		SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,713,944.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,852,922.50	
		SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,900,594.70	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,810,000.00	3,352,825.90	
		SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,278,500.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	4,523,261.60	
		SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,555,737.60	
		SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,523,014.50	
	ユーロ 小計		775,140,000.00	909,289,118.30 (118,598,579,699)	
	イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,508,767.20	
		UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,510,947.10	
		UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,965,248.00	
		UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,213,692.60	
		UKT 0.25% 07/31/31	2,670,000.00	2,552,653.50	
		UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,363,614.00	
		UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,136,360.20	
		UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,725,653.00	
		UKT 0.625% 07/31/35	2,360,000.00	2,266,638.40	
		UKT 0.625% 10/22/50	1,860,000.00	1,656,664.80	
		UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,388,461.60	
		UKT 0.875% 01/31/46	960,000.00	915,820.80	
		UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,743,316.00	
		UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	507,085.00	
		UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,141,742.50	
		UKT 1.25% 07/31/51	180,000.00	187,997.40	
		UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,899,624.00	
		UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,117,260.00	
		UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,599,439.70	
		UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,752,597.00	
		UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,162,064.00	
		UKT 1.625% 10/22/71	1,120,000.00	1,460,502.40	
		UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,511,289.00	
		UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,702,874.20	
		UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,172,540.80	
		UKT 1.75% 09/07/37	2,930,000.00	3,266,217.50	
		UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,635,216.00	
		UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,606,675.00	
		UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	2,981,606.40	
		UKT 2.75% 09/07/24	1,470,000.00	1,583,190.00	
		UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,905,401.00	
		UKT 3.25% 01/22/44	2,580,000.00	3,701,732.40	

	UKT 3.5% 01/22/45	2,550,000.00	3,834,639.00	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,805,670.50	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,740,656.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,090,000.00	3,042,371.20	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,864,085.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,491,657.20	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,695,470.90	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,900,000.00	2,974,754.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,713,303.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,689,853.60	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	3,693,538.90	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,569,278.90	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,885,991.20	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	2,002,127.20	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,644,455.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	3,028,625.60	
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,100,330.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,741,312.50	
イギリスポンド 小計		98,050,000.00	121,361,011.20 (18,462,650,633)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,970,000.00	5,927,493.60	
	SGB 0.75% 05/12/28	7,380,000.00	7,741,398.60	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,811,381.90	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,993,500.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,524,561.10	
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,539,937.50	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	10,233,627.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,580,000.00	8,373,013.20	
スウェーデンクローナ 小計		60,920,000.00	67,144,912.90 (861,469,232)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,990,790.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,040,000.00	5,084,301.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,856,005.40	
	NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	6,268,282.20	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,770,000.00	4,900,077.90	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,640,000.00	7,937,119.60	
	NGB 2% 04/26/28	4,510,000.00	4,750,518.30	
	NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,913,068.40	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,753,612.80	
ノルウェークローネ 小計		54,780,000.00	56,453,776.20 (714,140,268)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	7,170,000.00	7,240,481.10	

	DGB 0.25% 11/15/52	4,000,000.00	3,850,480.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	10,992,162.20	
	DGB 0.5% 11/15/29	14,260,000.00	15,120,733.60	
	DGB 0% 11/15/24	1,830,000.00	1,861,567.50	
	DGB 0% 11/15/31	3,880,000.00	3,905,957.20	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,760,355.40	
	DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	7,975,240.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	14,980,000.00	26,743,794.00	
デンマーククローネ 小計		71,240,000.00	85,450,771.00 (1,498,806,523)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,900,000.00	1,785,411.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,536,646.40	
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,220,209.20	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,944,616.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,101,583.80	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,035,155.40	
	POLGB 2.5% 04/25/24	2,270,000.00	2,376,349.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,394,451.40	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,995,233.20	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,380,000.00	5,792,161.80	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	6,698,442.40	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	5,312,816.40	
	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	4,038,540.80	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	776,412.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,120,000.00	3,305,421.60	
ポーランドズロチ 小計		56,730,000.00	59,313,451.40 (1,716,365,205)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,926,396.10	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,315,898.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	2,024,006.40	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,730,273.00	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,273,578.00	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,616,859.20	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,610,000.00	1,682,755.90	
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	3,171,285.00	
	ACGB 1% 12/21/30	3,930,000.00	3,866,609.10	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,786,252.80	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,245,478.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,226,987.00	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,479,042.60	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,850,196.70	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	1,211,815.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,156,311.80	

	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,868,496.00	
	ACGB 2.75% 11/21/29	2,420,000.00	2,741,230.80	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,838,962.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,564,716.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,193,659.60	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,086,300.80	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,987,742.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,890,000.00	2,207,746.80	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,566,371.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,834,761.60	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,722,425.00	
オーストラリアドル 小計		61,950,000.00	67,176,157.60 (5,484,261,506)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	744,390.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	300,000.00	306,735.00	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	815,912.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	420,000.00	424,666.20	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	786,405.40	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	959,313.20	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	522,261.60	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	472,140.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	582,639.60	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,190,000.00	1,399,225.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,042,056.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,115,903.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	590,000.00	663,626.10	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	859,278.80	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	425,346.30	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,350,000.00	1,387,732.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	994,348.30	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	999,979.20	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,709,345.40	
シンガポールドル 小計		14,920,000.00	16,211,304.40 (1,326,733,152)	
マレーシアリンギット	MGS 3.478% 06/14/24	1,270,000.00	1,310,297.10	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,387,877.20	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,558,425.70	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,630,000.00	2,746,403.80	
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,123,746.40	
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	536,800.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,533,210.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	963,247.50	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,696,436.10	

		MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,078,863.20	
		MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,574,685.00	
		MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,189,765.70	
		MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,076,833.10	
		MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,527,609.60	
		MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	633,288.00	
		MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,506,735.00	
		MGS 4.059% 09/30/24	960,000.00	1,007,894.40	
		MGS 4.065% 06/15/50	1,560,000.00	1,540,453.20	
		MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,344,281.60	
		MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,236,940.00	
		MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,160,265.10	
		MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,126,387.60	
		MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	3,130,670.40	
		MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,084,954.70	
		MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,575,622.80	
		MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,511,670.80	
		MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,549,108.10	
		MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,835,517.60	
		MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,135,060.00	
	マレーシアリンギット 小計		49,740,000.00	52,683,049.70 (1,396,374,768)	
	イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	701,080.66	
		ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	865,089.30	
		ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,440,528.60	
		ILGOV 1.25% 11/30/22	4,960,000.00	5,036,190.56	
		ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,111,209.49	
		ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,805,463.08	
		ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,144,921.28	
		ILGOV 1% 03/31/30	3,180,000.00	3,175,210.27	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	2,360,000.00	2,598,665.61	
		ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,458,886.75	
		ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	4,071,705.56	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	2,410,000.00	3,880,463.18	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	4,940,000.00	6,396,789.20	
	イスラエルシェケル 小計		34,060,000.00	38,686,203.54 (1,325,884,516)	
合計				293,225,691,251 (293,225,691,251)	

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　215銘柄	100.0%	45.7%
カナダドル	国債証券　32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券　13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券　340銘柄	100.0%	40.4%
イギリスポンド	国債証券　50銘柄	100.0%	6.3%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券　9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　27銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	国債証券　19銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリンギット	国債証券　29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　13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 9月 6日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,674,334,644
コール・ローン	434,545,025
株式	514,344,571,346
投資信託受益証券	309,493,083
投資証券	12,143,646,622
派生商品評価勘定	465,559,514
未収入金	21,922,008
未収配当金	911,584,775
差入委託証拠金	4,003,991,620

	2021年 9月 6日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	539,309,648,637
資産合計	539,309,648,637
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,009,698
前受金	464,417,884
未払解約金	238,843,938
未払利息	410
流動負債合計	704,271,930
負債合計	704,271,930
純資産の部	
元本等	
元本	134,161,147,802
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	404,444,228,905
元本等合計	538,605,376,707
純資産合計	538,605,376,707
負債純資産合計	539,309,648,637

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 9月 6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。 (1)先物取引

	2021年 9月 6日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 9月 6日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	134,161,147,802口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　4.0146円 (1万口当たり純資産額)　(40,146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 9月 6日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	145,539,517,095円
期中追加設定元本額	19,168,563,323円
期中一部解約元本額	30,546,932,616円
期末元本額	134,161,147,802円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,976,137,716円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,574,851円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	28,428,015,471円
世界経済インデックスファンド	8,941,124,874円
外国株式インデックス・オープン	833,525,354円
ＤＣマイセレクション２５	850,935,906円
ＤＣマイセレクション５０	3,986,775,651円
ＤＣマイセレクション７５	4,479,187,867円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	11,338,018,517円
ＤＣマイセレクションＳ２５	414,457,704円

区分	2021年 9月 6日現在
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,869,301,052円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,521,905,642円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	52,315,357円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	161,437,282円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	115,320,919円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,882,564,996円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,858,965,632円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,294,989円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,085,097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）	30,666,847円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	18,320,346円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	79,124,755円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	14,286,366円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	42,489,441円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	365,845,289円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	206,541,462円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,504,175,531円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	329,770,618円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	41,332,731円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	203,797,051円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	69,460,136円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,150,842,543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）	1,309,223,349円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,127,835,948円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,175,668,297円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,441,608,434円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,517,087,653円
分散投資コア戦略ファンドＳ	8,477,877,522円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,236,853,792円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,120,519,606円
コア投資戦略ファンド（切替型）	999,532,971円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	631,982,639円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,901,641円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	171,979,807円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	656,763,819円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	24,186,907,944円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	165,293,184円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	576,234,452円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	110,672,717円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,474,462円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	120,917,048円
グローバル経済コア	670,727,349円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,954,112円

区分	2021年 9月 6日現在
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	4,505,860円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	664,326,699円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	82,299,236円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	12,252,424円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	9,266,229円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	4,265,250円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	4,090,069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）	545,621,113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）	876,390,775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）	1,455,344,425円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	934,132,560円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	148,108,870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）	4,684,544円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	34,174円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	21,644円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	277,587,747円
ＳＭＴＡＭバランスファンド２００２（適格機関投資家専用）	260,107,582円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	279,785,392円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	270,292,284円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	268,409,933円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	265,829,351円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	266,176,902円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 9月 6日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	33,366,768,363
投資信託受益証券	17,114,713
投資証券	1,266,679,581
合計	34,650,562,657

(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 9月 6日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建	11,302,601,581	－	11,767,019,465	464,417,884
合計		11,302,601,581	－	11,767,019,465	464,417,884

(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 9月 6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	195,857,740	－	195,989,672	131,932
	アメリカドル	147,112,540	－	146,950,864	△161,676
	カナダドル	48,745,200	－	49,038,808	293,608
合計		195,857,740	－	195,989,672	131,932

(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	23.16	1,342,816.80	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	89.92	1,711,537.28	
	CHEVRON CORP	162,537	97.49	15,845,732.13	
	CONOCOPHILLIPS	113,805	56.24	6,400,393.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	57,000	29.17	1,662,690.00	
	EOG RESOURCES INC	48,739	67.99	3,313,764.61	
	EXXON MOBIL	357,409	54.87	19,611,031.83	

HALLIBURTON CO	77,539	20.17	1,563,961.63	
HESS CORP	22,781	69.91	1,592,619.71	
KINDER MORGAN INC	169,739	16.34	2,773,535.26	
MARATHON PETROLEUM CORP	54,237	58.24	3,158,762.88	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	25.92	2,050,427.52	
ONEOK INC	37,709	53.17	2,004,987.53	
PHILLIPS 66	38,113	69.62	2,653,427.06	
PIONEER NATURAL RESOURCES	19,754	149.88	2,960,729.52	
SCHLUMBERGER	116,716	28.09	3,278,552.44	
VALERO ENERGY CORP	34,683	64.70	2,243,990.10	
WILLIAMS COS	104,984	24.97	2,621,450.48	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,561	268.28	4,979,545.08	
ALBEMARLE CORP	10,180	241.86	2,462,134.80	
AMCOR PLC	132,975	12.68	1,686,123.00	
AVERY DENNISON CORP	7,457	225.73	1,683,268.61	
BALL CORP	27,925	97.38	2,719,336.50	
CELANESE CORP-SERIES A	9,842	155.14	1,526,887.88	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	45.43	866,395.53	
CORTEVA INC	58,500	44.92	2,627,820.00	
CROWN HOLDINGS INC	11,212	111.80	1,253,501.60	
DOW INC	63,659	62.12	3,954,497.08	
DUPONT DE NEMOURS INC	46,139	72.08	3,325,699.12	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	112.56	1,246,602.00	
ECOLAB INC	22,189	225.14	4,995,631.46	
FMC CORP	10,507	95.28	1,001,106.96	
FREEPORT-MCMORAN INC	125,342	36.14	4,529,859.88	
INT'L PAPER CO	30,800	59.92	1,845,536.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,184	150.91	3,196,877.44	
LINDE PLC	44,125	313.43	13,830,098.75	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	95.73	2,170,486.29	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	374.48	1,992,608.08	
MOSAIC CO/THE	31,911	32.15	1,025,938.65	
NEWMONT CORPORATION	68,576	59.67	4,091,929.92	
NUCOR CORP	25,565	114.05	2,915,688.25	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	152.45	1,171,883.15	
PPG INDUSTRIES INC	20,538	155.66	3,196,945.08	
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	81.80	855,300.80	
SEALED AIR CORP	14,689	61.22	899,260.58	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20,917	307.43	6,430,513.31	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	66.77	1,220,088.21	
VULCAN MATERIALS CO	11,347	180.31	2,045,977.57	
WESTROCK CO	21,356	52.60	1,123,325.60	

3 M COMPANY	48,764	194.39	9,479,233.96	
ALLEGION PLC	7,601	148.13	1,125,936.13	
AMETEK INC	19,666	135.40	2,662,776.40	
BOEING CO	46,662	218.17	10,180,248.54	
CARRIER GLOBAL CORP	70,603	57.41	4,053,318.23	
CATERPILLAR	45,919	210.37	9,659,980.03	
CUMMINS INC	12,028	238.57	2,869,519.96	
DEERE&CO	25,063	389.34	9,758,028.42	
DOVER CORP	12,202	174.93	2,134,495.86	
EATON CORP	33,384	166.38	5,554,429.92	
EMERSON ELECTRIC CO	51,393	105.38	5,415,794.34	
FASTENAL CO	48,796	55.89	2,727,208.44	
FORTIVE CORP	25,722	75.50	1,942,011.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	98.14	1,011,823.40	
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	453.75	2,364,491.25	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,350	202.46	4,120,061.00	
GENERAL ELECTRIC CO	92,290	104.75	9,667,377.50	
GRAINGER (WW) INC	3,846	429.65	1,652,433.90	
HEICO CORP	3,640	124.44	452,961.60	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	113.34	730,929.66	
HONEYWELL INTL INC	58,647	228.36	13,392,628.92	
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	31.37	991,103.78	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	203.17	715,564.74	
IDEX CORP	5,916	222.57	1,316,724.12	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,587	228.53	6,075,927.11	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	52.94	1,670,892.28	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	55.93	989,961.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	60,279	75.02	4,522,130.58	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	16,974	231.74	3,933,554.76	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	332.79	1,019,002.98	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,206	356.00	7,549,336.00	
MASCO CORP	19,462	61.19	1,190,879.78	
NORDSON CORP	4,880	241.45	1,178,276.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,693	365.93	4,644,749.49	
OTIS WORLDWIDE CORP	35,040	91.82	3,217,372.80	
OWENS CORNING	8,642	95.40	824,446.80	
PACCAR INC	30,155	84.43	2,545,986.65	
PARKER HANNIFIN CORP	11,234	289.91	3,256,848.94	
PENTAIR PLC	14,533	77.87	1,131,684.71	
PLUG POWER INC	41,884	26.40	1,105,737.60	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	128,033	83.65	10,709,960.45	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,938	324.00	3,219,912.00	

ROPER TECHNOLOGIES INC	8,784	486.22	4,270,956.48	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	58.21	804,927.88	
SMITH (A.O.) CORP	12,146	73.24	889,573.04	
SNAP-ON INC	4,900	226.90	1,111,810.00	
STANLEY BLACK&DECKER	13,718	191.10	2,621,509.80	
SUNRUN INC	13,917	45.54	633,780.18	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	448.81	1,749,910.19	
TEXTRON	18,893	72.55	1,370,687.15	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,642	199.94	4,127,161.48	
TRANSDIGM GROUP INC	4,425	602.27	2,665,044.75	
UNITED RENTALS INC	6,103	351.37	2,144,411.11	
WABTEC CORP	15,024	90.23	1,355,615.52	
XYLEM INC	15,209	137.25	2,087,435.25	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	83.12	944,575.68	
CINTAS CORP	8,043	396.53	3,189,290.79	
CLARIVATE PLC	27,357	26.26	718,394.82	
COPART INC	18,067	145.63	2,631,097.21	
COSTAR GROUP INC	34,030	87.86	2,989,875.80	
EQUIFAX INC	10,409	278.28	2,896,616.52	
IHS MARKIT LTD	32,602	122.24	3,985,268.48	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	137.10	1,461,623.10	
LEIDOS HOLDINGS	11,220	99.02	1,111,004.40	
REPUBLIC SERVICES INC	18,483	125.47	2,319,062.01	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	103.65	991,515.90	
ROLLINS INC	17,468	39.71	693,654.28	
TRANSUNION	15,741	124.47	1,959,282.27	
VERISK ANALYTICS INC	13,390	205.08	2,746,021.20	
WASTE CONNECTIONS INC	22,454	131.28	2,947,761.12	
WASTE MANAGEMENT INC	36,263	155.40	5,635,270.20	
AMERCO	1,000	655.02	655,020.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	90.09	1,017,296.28	
CSX CORP	192,089	32.00	6,146,848.00	
DELTA AIR LINES INC	14,609	40.25	588,012.25	
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	123.57	1,763,591.04	
FEDEX CORP	21,597	266.04	5,745,665.88	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	181.08	1,276,976.16	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,965	291.63	2,322,832.95	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	53.19	569,133.00	
LYFT INC-A	21,288	48.21	1,026,294.48	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,133	250.40	5,291,703.20	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	301.15	2,410,103.45	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	48.86	661,222.38	

UBER TECHNOLOGIES INC	103,109	40.32	4,157,354.88	
UNION PACIFIC CORP	56,461	214.91	12,134,033.51	
UNITED PARCEL SERVICE B	60,637	197.34	11,966,105.58	
APTIV PLC	23,540	149.93	3,529,352.20	
AUTOLIV INC	6,776	87.72	594,390.72	
BORGWARNER INC	19,781	43.14	853,352.34	
FORD MOTOR COMPANY	334,463	12.89	4,311,228.07	
GENERAL MOTORS CO	108,886	48.82	5,315,814.52	
LEAR CORP	5,287	159.37	842,589.19	
TESLA INC	69,152	733.57	50,727,832.64	
DR HORTON INC	29,632	94.96	2,813,854.72	
GARMIN LTD	12,854	176.11	2,263,717.94	
HASBRO INC	10,572	99.36	1,050,433.92	
LENNAR CORP-CL A	22,762	105.61	2,403,894.82	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,358	388.33	4,022,322.14	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	194.07	982,382.34	
NEWELL BRANDS INC	31,461	25.66	807,289.26	
NIKE B	107,303	163.29	17,521,506.87	
NVR INC	297	5,100.64	1,514,890.08	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	98.56	2,142,300.16	
PULTE GROUP INC	21,609	53.39	1,153,704.51	
VF CORP	28,638	76.23	2,183,074.74	
WHIRLPOOL CORP	5,220	225.87	1,179,041.40	
AIRBNB INC-CLASS A	10,665	158.00	1,685,070.00	
ARAMARK	20,955	34.13	715,194.15	
BOOKING HOLDINGS INC	3,445	2,304.45	7,938,830.25	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	103.56	1,818,513.60	
CARNIVAL CORPORATION	70,520	22.96	1,619,139.20	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,399	1,920.01	4,606,103.99	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	148.05	1,585,911.60	
DOMINO'S PIZZA INC	3,251	514.50	1,672,639.50	
DRAFTKINGS INC - CL A	27,674	61.02	1,688,667.48	
EXPEDIA GROUP INC	11,638	142.64	1,660,044.32	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,788	123.08	2,927,827.04	
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	43.13	1,266,728.10	
MARRIOTT INTL A	23,009	133.00	3,060,197.00	
MCDONALD'S CORP	62,893	238.82	15,020,106.26	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	13.81	243,912.22	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	42.54	1,406,542.56	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	79.43	1,530,377.81	
STARBUCKS CORP	99,234	117.19	11,629,232.46	
VAIL RESORTS INC	3,574	291.58	1,042,106.92	

WYNN RESORTS LTD	9,302	100.30	932,990.60	
YUM BRANDS INC	25,844	130.92	3,383,496.48	
ACTIVISION BLIZZARD INC	65,003	81.18	5,276,943.54	
ALPHABET INC-CL A	25,315	2,874.79	72,775,308.85	
ALPHABET INC-CL C	24,578	2,895.50	71,165,599.00	
ALTICE USA INC- A	22,505	28.27	636,216.35	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	44,000	44.02	1,936,880.00	
CABLE ONE INC	445	2,085.43	928,016.35	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	11,040	811.33	8,957,083.20	
COMCAST CORP-CL A	385,983	61.72	23,822,870.76	
DISCOVERY INC - A	12,804	28.31	362,481.24	
DISCOVERY INC-C	28,190	27.16	765,640.40	
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	45.43	914,596.76	
ELECTRONIC ARTS INC	24,944	146.60	3,656,790.40	
FACEBOOK INC-A	201,989	376.26	76,000,381.14	
FOX CORP - CLASS A	27,658	36.89	1,020,303.62	
FOX CORP- CLASS B	15,092	34.13	515,089.96	
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	132.06	887,575.26	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	37.30	1,262,008.20	
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	185.31	477,914.49	
LIBERTY BROADBAND-C	13,516	190.80	2,578,852.80	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	51.40	790,480.60	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	50.10	680,558.40	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	50.16	320,221.44	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	86.08	1,197,200.64	
MATCH GROUP INC	21,851	148.19	3,238,099.69	
NETFLIX INC	37,386	590.53	22,077,554.58	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	22.56	755,286.24	
OMNICOM GROUP	18,031	73.74	1,329,605.94	
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	56.59	2,589,954.53	
ROKU INC	9,122	342.27	3,122,186.94	
SEA LTD-ADR	5,838	353.36	2,062,915.68	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.33	630,138.84	
SNAP INC - A	78,901	75.08	5,923,887.08	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,738	160.56	1,563,533.28	
THE WALT DISNEY CO	153,336	181.00	27,753,816.00	
TWITTER INC	66,866	64.66	4,323,555.56	
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	41.28	2,005,630.08	
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	97.08	533,648.76	
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	97.56	1,309,938.12	
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	199.44	1,061,818.56	
AMAZON.COM	38,355	3,478.05	133,400,607.75	

AUTOZONE INC	1,779	1,537.25	2,734,767.75	
BATH & BODY WORKS INC	19,806	65.60	1,299,273.60	
BEST BUY COMPANY INC	19,870	114.02	2,265,577.40	
BURLINGTON STORES INC	5,808	297.50	1,727,880.00	
CARMAX INC	13,891	127.15	1,766,240.65	
CARVANA CO	5,700	328.66	1,873,362.00	
CHEWY INC - CLASS A	6,878	76.75	527,886.50	
DOLLAR GENERAL CORP	19,606	222.45	4,361,354.70	
DOLLAR TREE INC	20,151	92.81	1,870,214.31	
DOORDASH INC - A	6,300	193.46	1,218,798.00	
EBAY	56,933	76.53	4,357,082.49	
ETSY INC	11,000	220.38	2,424,180.00	
GENUINE PARTS CO	12,119	122.18	1,480,699.42	
HOME DEPOT	89,370	330.34	29,522,485.80	
LKQ CORP	26,705	50.84	1,357,682.20	
LOWES COMPANIES	59,222	205.98	12,198,547.56	
MERCADOLIBRE INC	3,770	1,946.01	7,336,457.70	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,067	584.80	3,547,981.60	
POOL CORP	3,304	496.89	1,641,724.56	
ROSS STORES INC	29,776	115.38	3,435,554.88	
TARGET (DAYTON HUDSON)	42,191	244.31	10,307,683.21	
TJX COMPANIES INC	103,121	71.07	7,328,809.47	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,932	198.80	1,974,481.60	
ULTA BEAUTY INC	4,520	382.11	1,727,137.20	
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	273.54	1,641,240.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,370	462.55	17,285,493.50	
KROGER CO	61,306	46.65	2,859,924.90	
SYSCO CORP	43,568	77.35	3,369,984.80	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,310	51.29	3,247,169.90	
WALMART INC	129,910	149.25	19,389,067.50	
ALTRIA GROUP INC	156,266	50.97	7,964,878.02	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,339	60.20	2,910,007.80	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	744	562.51	418,507.44	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	70.93	1,859,784.60	
BUNGE LIMITED	11,604	77.39	898,033.56	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	43.05	683,160.45	
COCA-COLA CO	345,573	56.73	19,604,356.29	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	61.06	939,957.64	
CONAGRA BRANDS INC	41,157	33.49	1,378,347.93	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,180	211.83	3,003,749.40	
GENERAL MILLS INC	53,282	57.77	3,078,101.14	
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,532	177.99	2,230,570.68	

HORMEL FOODS CORP	27,157	42.81	1,162,591.17	
JM SMUCKER CO	9,145	120.61	1,102,978.45	
KELLOGG CO	21,630	63.44	1,372,207.20	
KEURIG DR PEPPER INC	59,596	35.24	2,100,163.04	
KRAFT HEINZ CO/THE	57,338	35.83	2,054,420.54	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	63.58	821,707.92	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	88.08	1,857,431.04	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	46.98	855,176.94	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	118,747	61.72	7,329,064.84	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,258	97.58	3,342,895.64	
PEPSICO INC	116,436	157.09	18,290,931.24	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	131,310	106.10	13,931,991.00	
TYSON FOODS INC	25,074	78.23	1,961,539.02	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	84.39	1,776,831.45	
CLOROX COMPANY	10,830	169.51	1,835,793.30	
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,648	77.91	5,270,455.68	
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,298	341.83	6,596,635.34	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,913	140.75	4,069,504.75	
PROCTER & GAMBLE CO	205,787	144.05	29,643,617.35	
ABBOTT LABORATORIES	149,509	128.94	19,277,690.46	
ABIOMED INC	3,781	372.69	1,409,140.89	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,263	721.50	4,518,754.50	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	125.14	1,613,805.44	
ANTHEM INC	20,600	378.73	7,801,838.00	
BAXTER INTERNATIONAL	44,024	82.71	3,641,225.04	
BECTON DICKINSON & CO	24,401	257.83	6,291,309.83	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	118,882	44.92	5,340,179.44	
CARDINAL HEALTH	24,692	53.64	1,324,478.88	
CENTENE CORP	48,540	64.37	3,124,519.80	
CERNER CORP	25,323	75.69	1,916,697.87	
CIGNA CORP	28,583	216.92	6,200,224.36	
CVS HEALTH CORP	110,398	87.47	9,656,513.06	
DANAHER CORP	54,077	332.43	17,976,817.11	
DAVITA INC	5,784	132.17	764,471.28	
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	62.43	1,109,630.82	
DEXCOM INC	8,037	542.43	4,359,509.91	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,513	121.07	6,478,818.91	
HCA HEALTHCARE INC	22,436	252.95	5,675,186.20	
HENRY SCHEIN INC	11,747	78.38	920,729.86	
HOLOGIC INC	21,687	80.25	1,740,381.75	
HUMANA INC	11,040	415.56	4,587,782.40	
IDEXX LABORATORIES INC	7,161	688.33	4,929,131.13	

INSULET CORP	5,923	302.59	1,792,240.57	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,913	1,071.77	10,624,456.01	
LABORATORY CRP OF AMER	8,285	306.65	2,540,595.25	
MASIMO CORP	4,835	276.98	1,339,198.30	
MCKESSON CORP	13,893	206.28	2,865,848.04	
MEDTRONIC PLC	113,657	134.63	15,301,641.91	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	274.75	1,357,265.00	
NOVOCURE LTD	7,933	138.55	1,099,117.15	
OAK STREET HEALTH INC	7,613	49.89	379,812.57	
QUEST DIAGNOSTICS	11,335	155.84	1,766,446.40	
RESMED INC	12,370	295.80	3,659,046.00	
STERIS PLC	8,963	217.82	1,952,320.66	
STRYKER CORP	28,475	276.65	7,877,608.75	
TELADOC HEALTH INC	11,375	144.56	1,644,370.00	
TELEFLEX INC	3,934	398.43	1,567,423.62	
THE COOPER COS INC	4,134	455.92	1,884,773.28	
UNITEDHEALTH GROUP INC	79,346	422.86	33,552,249.56	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	156.22	1,132,282.56	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,775	317.64	3,740,211.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,317	464.38	2,933,488.46	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,300	146.74	2,538,602.00	
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	185.21	1,047,362.55	
ABBVIE INC	149,024	111.62	16,634,058.88	
AGILENT TECHNOLOGIES	26,029	179.28	4,666,479.12	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	197.46	1,904,106.78	
AMGEN	48,679	226.37	11,019,465.23	
AVANTOR INC	42,980	40.72	1,750,145.60	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	819.70	1,518,904.10	
BIO-TECHNE CORP	3,245	513.09	1,664,977.05	
BIOGEN INC	12,750	333.60	4,253,400.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	84.95	1,255,815.85	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	188,895	65.61	12,393,400.95	
CATALENT INC	15,232	140.35	2,137,811.20	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	449.55	1,889,908.20	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	34.15	1,231,483.15	
EXACT SCIENCES CORP	14,756	107.98	1,593,352.88	
GILEAD SCIENCES INC	105,658	71.96	7,603,149.68	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	110.01	1,972,039.26	
ILLUMINA INC	12,501	466.98	5,837,716.98	
INCYTE CORP	15,212	76.09	1,157,481.08	
IQVIA HOLDINGS INC	16,036	263.22	4,220,995.92	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	136.93	680,679.03	

JOHNSON & JOHNSON	222,152	175.04	38,885,486.08	
LILLY (ELI) & CO	68,743	259.53	17,840,870.79	
MERCK & CO	213,503	77.26	16,495,241.78	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,917	1,575.31	3,019,869.27	
MODERNA INC	29,089	416.70	12,121,386.30	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	95.87	812,402.38	
NOVAVAX INC	5,754	251.49	1,447,073.46	
PERKINELMER INC	9,372	190.50	1,785,366.00	
PFIZER	470,870	46.84	22,055,550.80	
PPD INC	11,027	46.72	515,181.44	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,829	679.57	5,999,923.53	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	39.31	610,641.54	
SEAGEN INC	11,471	152.22	1,746,115.62	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.48	762,201.48	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,232	568.11	18,879,431.52	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,458	198.05	4,447,806.90	
VIATRIS INC	103,541	14.89	1,541,725.49	
WATERS CORP	5,228	423.40	2,213,535.20	
ZOETIS INC	39,976	209.69	8,382,567.44	
BANK OF AMERICA CORP	648,153	41.05	26,606,680.65	
CITIGROUP	175,488	71.17	12,489,480.96	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	43.07	1,552,285.87	
FIFTH THIRD BANCORP	61,361	38.51	2,363,012.11	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,827	202.13	2,996,981.51	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	127,582	15.25	1,945,625.50	
JPMORGAN CHASE & CO	254,617	159.49	40,608,865.33	
KEY CORP	83,212	20.05	1,668,400.60	
M & T BANK CORP	10,537	138.96	1,464,221.52	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,597	191.52	6,817,537.44	
REGIONS FINL CORP	81,824	19.71	1,612,751.04	
SVB FINANCIAL GROUP	4,993	571.51	2,853,549.43	
TRUIST FINANCIAL CORP	115,723	56.45	6,532,563.35	
US BANCORP	118,032	56.15	6,627,496.80	
WELLS FARGO & CO	348,776	44.17	15,405,435.92	
ALLY FINANCIAL INC	31,445	51.06	1,605,581.70	
AMERICAN EXPRESS	57,665	159.30	9,186,034.50	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,185	272.35	2,773,884.75	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	61.81	936,606.93	
BANK NEW YORK CO	71,298	53.93	3,845,101.14	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	111,528	281.89	31,438,627.92	
BLACKROCK INC	12,861	937.28	12,054,358.08	
BLACKSTONE INC	58,748	129.00	7,578,492.00	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,568	157.26	6,065,203.68	
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	50.09	630,883.55	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	126.25	1,120,468.75	
CME GROUP INC	30,156	195.30	5,889,466.80	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,121	122.99	3,212,621.79	
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	31.21	1,024,156.15	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	385.91	1,214,844.68	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	32.00	834,240.00	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	106.35	459,006.60	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,459	411.31	11,705,471.29	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,143	121.13	5,710,431.59	
INVESCO LTD	26,420	24.88	657,329.60	
KKR & CO INC	43,643	64.44	2,812,354.92	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	475.22	1,524,030.54	
MOODY'S CORP	14,125	385.39	5,443,633.75	
MORGAN STANLEY	116,905	104.25	12,187,346.25	
MSCI INC	6,908	650.75	4,495,381.00	
NASDAQ INC	9,657	198.53	1,917,204.21	
NORTHERN TRUST CORP	17,625	117.35	2,068,293.75	
PRICE T ROWE GROUP INC	19,057	218.57	4,165,288.49	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,324	139.04	1,435,448.96	
S&P GLOBAL INC	20,253	452.08	9,155,976.24	
SCHWAB (CHARLES) CORP	121,361	72.09	8,748,914.49	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	62.04	592,482.00	
STATE STREET CORP	29,894	92.89	2,776,853.66	
SYNCHRONY FINANCIAL	49,509	47.38	2,345,736.42	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	88.41	801,083.01	
VOYA FINANCIAL INC	10,050	64.43	647,521.50	
AFLAC	54,481	55.71	3,035,136.51	
ALLEGHANY CORP	1,276	662.77	845,694.52	
ALLSTATE CORP	24,717	133.97	3,311,336.49	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	137.80	870,758.20	
AMERICAN INT'L GROUP	71,038	55.10	3,914,193.80	
AON PLC	19,359	291.43	5,641,793.37	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	39.43	1,341,842.33	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	145.49	2,380,070.91	
ASSURANT INC	4,726	170.37	805,168.62	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	69.11	705,405.77	
BROWN & BROWN INC	19,873	58.94	1,171,314.62	
CHUBB LTD	37,517	183.46	6,882,868.82	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	121.08	1,548,734.28	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	180.87	391,764.42	

EVEREST RE GROUP LTD	3,288	256.64	843,832.32	
FNF GROUP	24,961	48.08	1,200,124.88	
GLOBE LIFE INC	8,106	94.29	764,314.74	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,371	68.09	2,067,961.39	
JACKSON FINANCIAL INC-A W/I	5,633	28.77	162,061.41	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	67.56	1,105,551.84	
LOEWS CORP	18,851	54.76	1,032,280.76	
MARKEL CORP	1,156	1,255.66	1,451,542.96	
MARSH & MCLENNAN COS	42,677	159.50	6,806,981.50	
METLIFE INC	64,294	61.22	3,936,078.68	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	66.00	1,522,752.00	
PROGRESSIVE CORP	50,582	96.23	4,867,505.86	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,127	104.89	3,474,691.03	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	152.47	741,614.08	
TRAVELERS COS INC/THE	21,022	159.17	3,346,071.74	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,021	228.52	2,518,518.92	
WR BERKLEY CORP	11,715	74.45	872,181.75	
CBRE GROUP INC-A	27,882	98.56	2,748,049.92	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.22	416,514.00	
WEYERHAEUSER CO	63,665	36.64	2,332,685.60	
ACCENTURE PLC-CL A	53,519	343.33	18,374,678.27	
ADOBE INC	40,430	666.59	26,950,233.70	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	13,673	113.80	1,555,987.40	
ANSYS INC	7,474	368.38	2,753,272.12	
AUTODESK INC	18,457	288.75	5,329,458.75	
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,984	207.38	7,462,361.92	
AVALARA INC	7,698	189.78	1,460,926.44	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	67.18	940,251.28	
BLACK KNIGHT INC	14,413	75.89	1,093,802.57	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	170.75	1,663,446.50	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	23,282	165.71	3,858,060.22	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	12,296	115.96	1,425,844.16	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	124.36	1,010,300.64	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	102.75	1,073,121.00	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,762	130.44	2,577,755.28	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,007	76.55	3,521,835.85	
COUPA SOFTWARE INC	6,059	261.91	1,586,912.69	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,457	278.23	4,578,831.11	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	170.00	527,000.00	
DATADOG INC - CLASS A	16,871	138.06	2,329,210.26	
DOCUSIGN INC	16,740	310.05	5,190,237.00	
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	32.39	934,289.55	

DYNATRACE INC	14,790	70.93	1,049,054.70	
EPAM SYSTEMS INC	4,753	643.39	3,058,032.67	
FAIR ISAAC CORP	2,615	467.23	1,221,806.45	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	52,242	125.39	6,550,624.38	
FISERV INC	51,693	115.66	5,978,812.38	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,523	261.92	1,708,504.16	
FORTINET INC	11,565	320.19	3,702,997.35	
GARTNER INC	7,500	313.35	2,350,125.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	25,292	158.01	3,996,388.92	
GODADDY INC - CLASS A	13,798	74.96	1,034,298.08	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	123.01	777,177.18	
HUBSPOT INC	3,646	704.09	2,567,112.14	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,281	139.58	10,507,721.98	
INTUIT INC	23,082	563.25	13,000,936.50	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	175.74	1,105,580.34	
MASTERCARD INC-CLASS A	74,900	340.23	25,483,227.00	
MICROSOFT CORP	603,908	301.14	181,860,855.12	
MONGODB INC	4,623	507.41	2,345,756.43	
NORTONLIFELOCK INC	50,376	27.28	1,374,257.28	
OKTA INC	10,230	270.40	2,766,192.00	
ORACLE CORP	157,134	90.00	14,142,060.00	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	133,290	26.64	3,550,845.60	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,311	468.22	3,891,376.42	
PAYCHEX INC	27,703	113.60	3,147,060.80	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	496.26	2,101,661.10	
PAYPAL HOLDINGS INC	93,989	289.13	27,175,039.57	
PTC INC	9,984	132.99	1,327,772.16	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	250.81	1,603,428.33	
SALESFORCE.COM INC	81,590	267.08	21,791,057.20	
SERVICENOW INC	16,513	678.63	11,206,217.19	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,660	310.00	5,164,600.00	
SPLUNK INC	13,355	158.44	2,115,966.20	
SQUARE INC - A	33,292	269.74	8,980,184.08	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	74.00	1,430,790.00	
SYNOPSYS INC	12,728	336.64	4,284,753.92	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35,780	78.20	2,797,996.00	
TWILIO INC - A	13,692	367.23	5,028,113.16	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	488.10	1,629,765.90	
UNITY SOFTWARE INC	4,329	133.61	578,397.69	
VERISIGN INC	8,760	220.23	1,929,214.80	
VISA INC-CLASS A SHARES	142,243	225.11	32,020,321.73	
VMWARE INC-CLASS A	6,812	145.11	988,489.32	

WESTERN UNION CO	38,757	21.72	841,802.04	
WIX.COM LTD	5,010	233.72	1,170,937.20	
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	277.74	4,306,358.70	
ZENDESK INC	10,500	125.08	1,313,340.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,545	298.29	5,233,498.05	
ZSCALER INC	6,234	287.40	1,791,651.60	
AMPHENOL CORPORATION	51,451	77.04	3,963,785.04	
APPLE INC	1,408,133	154.30	217,274,921.90	
ARISTA NETWORKS INC	4,720	363.12	1,713,926.40	
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	117.43	716,323.00	
CDW CORP/DE	11,982	202.70	2,428,751.40	
CISCO SYSTEMS	356,369	59.42	21,175,445.98	
COGNEX CORP	14,352	88.46	1,269,577.92	
CORNING	64,989	39.49	2,566,415.61	
DELL TECHNOLOGIES -C	24,030	97.14	2,334,274.20	
F5 NETWORKS INC	5,350	203.61	1,089,313.50	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	15.48	1,689,626.52	
HP INC	106,353	29.86	3,175,700.58	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	174.22	558,723.54	
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	28.98	907,189.92	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,004	181.28	2,901,205.12	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,091	244.85	3,450,181.35	
NETAPP INC	18,303	91.35	1,671,979.05	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,940	90.32	1,620,340.80	
TE CONNECTIVITY LTD	27,668	149.67	4,141,069.56	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	94.86	2,008,755.36	
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	61.41	1,583,763.90	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,612	590.60	2,723,847.20	
AT&T INC	601,777	27.56	16,584,974.12	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	28.66	444,688.56	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	28.85	971,668.00	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	86,131	12.13	1,044,769.03	
T-MOBILE US INC	52,257	136.00	7,106,952.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	349,306	55.43	19,362,031.58	
AES CORP	54,375	24.64	1,339,800.00	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	61.47	1,277,223.66	
AMEREN CORPORATION	20,898	88.11	1,841,322.78	
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,494	90.41	3,751,472.54	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,464	185.15	2,863,159.60	
ATMOS ENERGY CORP	11,419	97.50	1,113,352.50	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	25.94	1,249,322.28	
CMS ENERGY CORP	23,697	64.96	1,539,357.12	

CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	76.30	2,193,243.50	
DOMINION ENERGY INC	69,073	78.38	5,413,941.74	
DTE ENERGY COMPANY	16,240	120.75	1,960,980.00	
DUKE ENERGY CORP	66,012	105.68	6,976,148.16	
EDISON INTL	32,117	58.65	1,883,662.05	
ENTERGY CORP	16,926	112.56	1,905,190.56	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	49.43	1,029,824.62	
EVERGY INC	18,475	68.50	1,265,537.50	
EVERSOURCE ENERGY	29,303	91.99	2,695,582.97	
EXELON CORP	81,616	49.82	4,066,109.12	
FIRSTENERGY CORP	45,787	39.59	1,812,707.33	
NEXTERA ENERGY INC	165,232	85.69	14,158,730.08	
NISOURCE INC	35,781	25.06	896,671.86	
NRG ENERGY INC	23,078	45.43	1,048,433.54	
PG&E CORP	135,327	9.15	1,238,242.05	
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	77.18	831,382.96	
PPL CORPORATION	63,429	30.09	1,908,578.61	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,258	64.14	2,774,568.12	
SEMPRA ENERGY	27,056	133.41	3,609,540.96	
SOUTHERN CO	88,673	66.27	5,876,359.71	
UGI CORP	18,019	46.88	844,730.72	
VISTRA CORP	37,797	19.11	722,300.67	
WEC ENERGY GROUP INC	26,821	96.08	2,576,961.68	
XCEL ENERGY INC	46,423	69.80	3,240,325.40	
ADVANCED MICRO DEVICES	102,014	109.92	11,213,378.88	
ANALOG DEVICES	45,192	162.44	7,340,988.48	
APPLIED MATERIALS	77,306	135.83	10,500,473.98	
BROADCOM INC	34,444	497.68	17,142,089.92	
ENPHASE ENERGY INC	10,113	173.94	1,759,055.22	
INTEL CORP	338,928	53.51	18,136,037.28	
KLA CORP	12,889	341.75	4,404,815.75	
LAM RESEARCH CORP	12,019	610.71	7,340,123.49	
MARVELL TECHNOLOGY INC	66,930	61.51	4,116,864.30	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,404	156.83	3,513,619.32	
MICRON TECHNOLOGY	94,036	73.81	6,940,797.16	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	502.13	1,773,021.03	
NVIDIA CORP	210,465	228.43	48,076,519.95	
NXP SEMICONDUCTORS NV	23,203	212.99	4,942,006.97	
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	45.71	1,645,377.16	
QORVO INC	9,678	185.36	1,793,914.08	
QUALCOMM	95,794	144.63	13,854,686.22	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,359	183.01	2,627,840.59	

	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	285.80	1,314,680.00	
	TERADYNE INC	14,398	121.88	1,754,828.24	
	TEXAS INSTRUMENTS	77,615	189.88	14,737,536.20	
	XILINX INC	20,982	155.96	3,272,352.72	
アメリカドル 小計		26,557,017		3,402,525,816.35 (373,699,410,409)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	27.04	726,835.20	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	102,786	43.82	4,504,082.52	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	10.98	1,061,392.68	
	ENBRIDGE	173,165	50.12	8,679,029.80	
	IMPERIAL OIL	24,763	34.32	849,866.16	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	19.97	708,036.35	
	KEYERA CORP	18,607	30.41	565,838.87	
	PARKLAND CORP	14,075	37.30	524,997.50	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	38.96	1,779,147.36	
	SUNCOR ENERGY	132,181	23.47	3,102,288.07	
	TC ENERGY CORP	82,908	60.57	5,021,737.56	
	AGNICO EAGLE MINES	20,293	73.72	1,495,999.96	
	B2GOLD CORP	90,243	5.00	451,215.00	
	BARRICK GOLD CORP	153,589	25.43	3,905,768.27	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	72.27	949,555.53	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	25.67	1,103,810.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	185.27	2,846,303.01	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	10.03	520,025.41	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	7.75	840,495.25	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	52.77	1,236,295.56	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	10.21	635,501.03	
	NUTRIEN LTD	48,966	76.60	3,750,795.60	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	33.32	613,454.52	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	30.78	1,248,467.58	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	100.60	784,680.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	58.36	2,306,854.08	
	YAMANA GOLD INC	81,672	5.53	451,646.16	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	20.54	405,130.96	
	CAE INC	25,999	38.06	989,521.94	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	107.06	824,897.30	
	WSP GLOBAL INC	8,602	163.91	1,409,953.82	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	45.27	611,371.35	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	78.82	807,510.90	
	THOMSON REUTERS CORP	15,013	148.81	2,234,084.53	
	AIR CANADA	13,805	24.02	331,596.10	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,870	159.01	9,678,938.70	

CP RAILWAY LIMITED	57,581	90.59	5,216,262.79	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	100.68	2,344,031.76	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	50.05	854,803.95	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	80.54	1,858,299.42	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	31.79	483,208.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	37.25	1,319,469.50	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	191.76	1,037,229.84	
DOLLARAMA INC	26,700	56.86	1,518,162.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	66,914	50.42	3,373,803.88	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	40.19	613,018.07	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	89.81	1,159,716.53	
METRO INC	18,840	64.43	1,213,861.20	
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	136.27	937,946.41	
SAPUTO INC	24,489	35.21	862,257.69	
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	36.73	1,021,094.00	
CANOPY GROWTH CORP	20,989	21.25	446,016.25	
BANK MONTREAL	53,539	127.73	6,838,536.47	
BANK NOVA SCOTIA	100,660	78.12	7,863,559.20	
CANADIAN IMPERIAL BANK	36,854	145.57	5,364,836.78	
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	98.18	2,679,234.02	
ROYAL BANK OF CANADA	119,310	129.48	15,448,258.80	
TORONTO-DOMINION BANK	151,853	82.45	12,520,279.85	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	106,335	71.21	7,572,115.35	
IGM FINANCIAL INC	7,685	47.04	361,502.40	
ONEX CORP	6,603	88.41	583,771.23	
TMX GROUP LTD	4,685	139.78	654,869.30	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	567.02	1,209,453.66	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.70	920,595.60	
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	70.45	711,474.55	
INTACT FINANCIAL CORP	16,043	173.04	2,776,080.72	
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	24.42	3,981,827.52	
POWER CORP OF CANADA	43,577	43.03	1,875,118.31	
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,702	64.69	3,279,912.38	
FIRSTSERVICE CORP	3,690	236.21	871,614.90	
BLACKBERRY LIMITED	39,400	13.88	546,872.00	
CGI INC - CL A	18,428	115.44	2,127,328.32	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	2,192.52	3,641,775.72	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	150.19	1,245,976.24	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	153.56	660,461.56	
OPEN TEXT CORP	24,643	68.66	1,691,988.38	
SHOPIFY INC - CLASS A	9,429	1,946.48	18,353,359.92	
BCE INC	6,203	65.73	407,723.19	

	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	63.49	1,941,778.16	
	TELUS CORP	32,908	29.18	960,255.44	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.61	1,016,150.98	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	25.51	622,316.45	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	42.26	221,484.66	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	55.48	626,646.60	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	35.62	367,740.88	
	EMERA INC	18,723	59.18	1,108,027.14	
	FORTIS INC	36,823	57.79	2,128,001.17	
	HYDRO ONE LTD	32,299	31.82	1,027,754.18	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	42.55	759,687.70	
カナダドル 小計		3,457,507		207,184,675.65 (18,143,162,046)	
ユーロ	ENI	218,529	10.53	2,301,110.37	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	8.48	417,263.50	
	NESTE OIL OYJ	37,233	53.22	1,981,540.26	
	OMV AG	12,549	47.30	593,567.70	
	REPSOL SA	127,332	9.59	1,221,241.21	
	TENARIS SA	40,648	8.49	345,182.81	
	TOTALENERGIES SE	208,459	37.26	7,768,224.63	
	VOPAK	6,360	35.88	228,196.80	
	AIR LIQUIDE	40,492	151.14	6,119,960.88	
	AKZO NOBEL	15,301	102.00	1,560,702.00	
	ARCELORMITTAL	61,651	28.21	1,739,174.71	
	ARKEMA	5,949	111.35	662,421.15	
	BASF SE	78,752	64.81	5,103,917.12	
	COVESTRO AG	17,254	57.28	988,309.12	
	CRH PLC	64,773	44.68	2,894,057.64	
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	28.30	559,038.20	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	43.54	250,877.48	
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	72.04	939,473.64	
	KONINKLIJKE DSM NV	14,947	177.85	2,658,323.95	
	LANXESS	7,293	63.28	461,501.04	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	49.35	962,522.40	
	SOLVAY SA	6,906	110.70	764,494.20	
	STORA ENSO OYJ R	42,169	16.88	711,812.72	
	SYMRISE AG	11,456	119.95	1,374,147.20	
	UMICORE	17,605	54.60	961,233.00	
	UPM KYMMENE OYJ	45,603	34.80	1,586,984.40	
	VOESTALPINE AG	7,152	37.90	271,060.80	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,729	23.27	482,363.83	
	AIRBUS SE	50,151	114.48	5,741,286.48	

ALSTOM	24,388	34.62	844,312.56	
BOUYGUES ORD	21,446	35.89	769,696.94	
BRENNTAG SE	12,514	85.22	1,066,443.08	
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	14.04	1,138,010.17	
DASSAULT AVIATION SA	213	943.00	200,859.00	
EIFFAGE	7,964	91.18	726,157.52	
FERROVIAL SA	41,438	24.93	1,033,049.34	
GEA GROUP AG	13,382	40.44	541,168.08	
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	94.12	1,166,899.76	
KION GROUP AG	5,887	89.68	527,946.16	
KNORR-BREMSE AG	6,822	102.25	697,549.50	
KONE OYJ-B	29,051	69.82	2,028,340.82	
LEGRAND SA	21,768	97.38	2,119,767.84	
MTU AERO ENGINES AG	4,753	194.20	923,032.60	
PRYSMIAN SPA	21,155	32.46	686,691.30	
RATIONAL AG	483	944.00	455,952.00	
SAFRAN SA	28,410	104.44	2,967,140.40	
SAINT-GOBAIN	43,973	61.00	2,682,353.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,808	153.88	6,895,055.04	
SIEMENS	63,910	142.58	9,112,287.80	
SIEMENS ENERGY AG	36,181	25.28	914,655.68	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	25.66	575,682.10	
THALES SA	9,665	85.82	829,450.30	
VINCI S.A.	43,434	91.14	3,958,574.76	
WARTSILA OYJ	41,917	11.83	496,087.69	
BUREAU VERITAS SA	25,073	28.13	705,303.49	
RANDSTAD NV	11,218	61.92	694,618.56	
TELEPERFORMANCE	4,734	377.10	1,785,191.40	
WOLTERS KLUWER	22,949	97.32	2,233,396.68	
ADP	2,382	98.02	233,483.64	
AENA SME SA	6,542	133.90	875,973.80	
ATLANTIA SPA	46,597	15.76	734,601.70	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	8.28	192,855.06	
DEUTSCHE POST AG-REG	81,964	59.19	4,851,449.16	
GETLINK	29,362	13.71	402,699.83	
INPOST SA	12,480	15.75	196,609.92	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,684	79.40	2,277,509.60	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	68.00	339,388.00	
CONTINENTAL AG	9,928	110.88	1,100,816.64	
DAIMLER AG	73,367	70.17	5,148,162.39	
FAURECIA	10,948	39.99	437,810.52	
FERRARI NV	10,170	184.30	1,874,331.00	

MICHELIN	13,839	136.85	1,893,867.15	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	87.60	1,028,862.00	
RENAULT SA	17,362	30.11	522,769.82	
STELLANTIS NV	170,174	17.13	2,915,080.62	
VALEO SA	21,538	23.31	502,050.78	
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,167	201.90	3,062,217.30	
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	288.80	717,956.80	
ADIDAS AG	16,242	299.05	4,857,170.10	
ESSILORLUXOTTICA	23,442	166.46	3,902,155.32	
HERMES INTERNATIONAL	2,731	1,255.00	3,427,405.00	
KERING	6,205	683.30	4,239,876.50	
LVMH	23,334	634.90	14,814,756.60	
MONCLER SPA	14,361	54.02	775,781.22	
PUMA SE	9,220	102.55	945,511.00	
SEB SA	2,282	137.60	314,003.20	
ACCOR	14,436	28.67	413,880.12	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	168.95	2,452,816.10	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	44.54	361,130.32	
SODEXO	8,135	69.42	564,731.70	
BOLLORE	83,646	5.06	423,666.99	
PUBLICIS GROUPE	17,077	55.78	952,555.06	
SCOUT24 AG	7,492	71.70	537,176.40	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	55.54	392,723.34	
VIVENDI SE	61,243	32.93	2,016,731.99	
DELIVERY HERO SE	13,414	129.25	1,733,759.50	
HELLOFRESH SE	13,805	93.66	1,292,976.30	
INDITEX	95,060	29.57	2,810,924.20	
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	81.05	1,262,110.60	
PROSUS	78,855	77.36	6,100,222.80	
ZALANDO SE	17,664	94.70	1,672,780.80	
CARREFOUR	52,544	15.53	816,008.32	
COLRUYT SA	5,424	47.81	259,321.44	
JERONIMO MARTINS	24,901	18.24	454,194.24	
KESKO OYJ-B SHS	20,083	34.78	698,486.74	
KONINKLIJKE AHOLD NV	87,400	28.29	2,472,983.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,788	50.29	3,207,898.52	
DANONE (GROUPE)	54,643	61.51	3,361,090.93	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	11.91	584,507.07	
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	77.40	828,257.40	
HEINEKEN NV	22,407	91.80	2,056,962.60	
JDE PEET'S BV	7,000	28.98	202,860.00	
KERRY GROUP PLC-A	13,050	124.25	1,621,462.50	

PERNOD-RICARD	16,970	183.70	3,117,389.00	
REMY COINTREAU	2,382	168.60	401,605.20	
BEIERSDORF AG	9,190	102.60	942,894.00	
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	76.05	667,719.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	82.10	1,185,441.90	
LOREAL	21,038	394.85	8,306,854.30	
AMPLIFON SPA	11,650	44.12	513,998.00	
BIOMERIEUX	4,175	110.65	461,963.75	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	190.90	654,787.00	
DIASORIN SPA	2,070	201.90	417,933.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,472	65.16	1,138,475.52	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	43.73	1,473,219.97	
KONINKLIJKE PHILIPS	77,215	39.94	3,084,353.17	
ORPEA	4,336	105.60	457,881.60	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,224	578.40	1,286,361.60	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	25,758	58.74	1,513,024.92	
ARGENX SE	4,178	295.00	1,232,510.00	
BAYER	83,832	47.47	3,979,924.20	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	122.70	1,253,994.00	
GRIFOLS SA	27,685	20.92	579,170.20	
IPSEN	3,532	82.82	292,520.24	
MERCK KGAA	10,555	205.90	2,173,274.50	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	35.15	346,368.10	
QIAGEN N.V.	17,038	47.70	812,712.60	
RECORDATI SPA	9,859	55.46	546,780.14	
SANOFI	94,644	87.85	8,314,475.40	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	531.00	1,284,489.00	
UCB (GROUPE)	9,389	98.04	920,497.56	
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	11.86	473,542.90	
BANCO BILBAO VIZCAYA	576,942	5.56	3,212,413.05	
BANCO SANTANDER SA	1,470,387	3.07	4,522,910.41	
BNP PARIBAS	93,068	53.87	5,013,573.16	
CAIXABANK	380,168	2.64	1,004,784.02	
COMMERZBANK AG	94,388	5.45	514,414.60	
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	12.11	1,084,742.77	
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	34.87	833,567.35	
FINECOBANK SPA	53,120	15.38	817,251.20	
ING GROEP NV-CVA	320,768	11.79	3,782,496.25	
INTESA SANPAOLO	1,346,514	2.38	3,214,802.17	
KBC GROEP NV	21,052	72.12	1,518,270.24	
MEDIOBANCA	53,990	9.88	533,745.14	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	20.94	261,540.60	

SOCIETE GENERALE	67,846	26.56	1,802,328.99	
UNICREDIT SPA	168,352	10.85	1,827,629.31	
AMUNDI SA	6,226	79.20	493,099.20	
DEUTSCHE BANK NAMEN	177,263	10.54	1,868,706.54	
DEUTSCHE BOERSE	16,510	145.50	2,402,205.00	
EURAZEO SA	3,357	86.60	290,716.20	
EXOR NV	10,345	70.02	724,356.90	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	96.94	825,444.10	
SOFINA	1,238	371.80	460,288.40	
WENDEL	2,023	122.00	246,806.00	
AEGON	166,267	4.16	692,169.52	
AGEAS	16,065	42.46	682,119.90	
ALLIANZ SE-REG	34,366	196.68	6,759,104.88	
ASSICURAZIONI GENERALI	97,567	17.32	1,689,860.44	
AXA SA	166,887	23.59	3,936,864.33	
CNP ASSURANCES	16,287	14.41	234,777.10	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	154.55	669,665.15	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,376	241.65	2,749,010.40	
NN GROUP NV	22,611	43.92	993,075.12	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	11.42	525,949.87	
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	43.76	1,884,962.00	
SCOR SE	13,354	25.43	339,592.22	
AROUNDTOWN SA	94,068	6.31	594,321.62	
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,092	52.34	1,470,335.28	
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	130.45	688,123.75	
VONOVIA SE	45,080	54.66	2,464,072.80	
ADYEN NV	1,666	2,670.00	4,448,220.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,094	51.40	2,009,431.60	
ATOS SE	9,750	45.18	440,505.00	
BECHTLE AG	7,659	62.74	480,525.66	
CAPGEMINI SA	13,914	191.55	2,665,226.70	
DASSAULT SYSTEMES SA	57,125	48.79	2,787,128.75	
EDENRED	18,664	46.95	876,274.80	
NEMETSCHEK SE	5,455	83.80	457,129.00	
NEXI SPA	41,348	17.65	729,792.20	
SAP SE	87,453	125.60	10,984,096.80	
TEAMVIEWER AG	14,174	28.25	400,415.50	
WORLDLINE SA	20,332	72.39	1,471,833.48	
NOKIA OYJ	450,608	5.12	2,307,112.96	
CELLNEX TELECOM SA	41,435	57.52	2,383,341.20	
DEUTSCHE TELEKOM	285,034	17.80	5,074,745.33	
ELISA A	13,387	54.34	727,449.58	

	ILIAD SA	1,253	182.00	228,046.00	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.99	303,507.00	
	KPN (KON.)	282,927	2.70	764,468.75	
	ORANGE	171,535	9.54	1,637,987.71	
	PROXIMUS	13,141	16.69	219,388.99	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.36	315,273.72	
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.39	185,943.13	
	TELEFONICA	456,377	4.12	1,881,642.37	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.41	238,001.86	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	36.42	346,463.46	
	E.ON SE	185,377	11.12	2,061,762.99	
	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	23.16	497,152.56	
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	10.96	433,150.16	
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	106.90	312,682.50	
	ENAGAS	25,299	19.22	486,373.27	
	ENDESA	25,972	20.81	540,477.32	
	ENEL	692,930	7.72	5,350,805.46	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.78	1,080,679.61	
	ENGIE	158,224	11.99	1,897,738.65	
	FORTUM OYJ	32,550	26.32	856,716.00	
	IBERDROLA SA	487,356	10.55	5,144,042.58	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	21.77	507,458.70	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.25	683,652.00	
	RWE STAMM	55,390	33.35	1,847,256.50	
	SNAM SPA	147,559	4.93	728,498.78	
	SUEZ	32,549	19.61	638,285.89	
	TERNA SPA	130,230	6.69	871,759.62	
	UNIPER SE	7,335	34.40	252,324.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	29.59	1,285,004.93	
	VERBUND AG	6,430	94.30	606,349.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	4,217	334.20	1,409,321.40	
	ASML HOLDING NV	35,340	721.80	25,508,412.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES	112,361	36.95	4,151,738.95	
	STMICROELECTRONICS	55,076	37.90	2,087,380.40	
ユーロ 小計		15,998,398		417,630,268.03 (54,471,515,859)	
イギリスポンド	BP PLC	1,696,535	2.96	5,031,922.81	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,807	14.33	4,900,145.15	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	308,298	14.31	4,412,360.97	
	ANGLO AMERICAN PLC	108,946	30.91	3,367,520.86	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	14.24	510,768.72	
	BHP GROUP PLC	175,556	21.19	3,720,031.64	

CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	92.00	1,005,008.00	
EVRAZ PLC	43,000	5.92	254,818.00	
GLENCORE PLC	823,141	3.33	2,741,471.10	
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	29.00	488,592.00	
MONDI PLC	36,710	20.40	748,884.00	
RIO TINTO PLC REG	96,096	54.08	5,196,871.68	
ASHTEAD GROUP PLC	37,034	57.34	2,123,529.56	
BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.64	1,467,506.76	
BUNZL PLC	24,880	25.94	645,387.20	
DCC PLC	9,127	62.96	574,635.92	
FERGUSON PLC	19,417	106.10	2,060,143.70	
MELROSE INDUSTRIES PLC	410,961	1.88	774,661.48	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.11	710,310.35	
SMITHS GROUP PLC	37,146	14.40	534,902.40	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	164.65	907,880.10	
EXPERIAN PLC	79,162	32.47	2,570,390.14	
INTERTEK GROUP PLC	13,890	53.48	742,837.20	
RELX PLC	158,847	21.91	3,480,337.77	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.81	816,188.80	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	7.11	686,280.46	
BURBERRY GROUP PLC	29,776	18.92	563,361.92	
PERSIMMON PLC	25,686	28.70	737,188.20	
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.77	468,388.44	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,829	47.51	561,995.79	
COMPASS GROUP PLC	155,632	14.96	2,329,032.88	
ENTAIN PLC	49,630	19.43	964,310.90	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	45.89	736,121.49	
WHITBREAD PLC	17,434	32.06	558,934.04	
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.34	459,554.00	
INFORMA PLC	141,175	5.49	775,897.80	
PEARSON	66,305	7.62	505,244.10	
WPP PLC	95,821	9.90	949,011.18	
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	10.32	427,093.62	
KINGFISHER PLC	198,587	3.48	692,075.69	
NEXT PLC	11,468	79.14	907,577.52	
OCADO GROUP PLC	44,612	20.05	894,470.60	
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	2.90	607,164.30	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	3.03	450,641.73	
TESCO PLC	666,000	2.55	1,702,962.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	19.63	657,576.15	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	181,738	27.11	4,926,917.18	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.36	473,425.60	

	DIAGEO	195,886	35.30	6,915,755.23	
	IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	15.55	1,259,737.23	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,534	56.89	3,443,779.26	
	UNILEVER PLC	220,661	39.78	8,777,894.58	
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	13.99	959,987.02	
	ASTRAZENECA	129,707	85.09	11,036,768.63	
	GLAXOSMITHKLINE	418,936	14.78	6,195,225.56	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	25.72	423,196.88	
	BARCLAYS	1,426,525	1.84	2,634,791.67	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,705,000	3.84	6,554,872.50	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,838,937	0.43	2,534,682.55	
	NATWEST GROUP PLC	539,149	2.14	1,153,778.86	
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	4.53	963,230.16	
	3I GROUP PLC	88,121	13.35	1,176,855.95	
	ABRDN PLC	210,980	2.63	556,143.28	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	14.93	494,034.86	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	80.68	2,226,122.56	
	M&G PLC	229,107	2.02	463,712.56	
	SCHRODERS PLC	11,794	37.93	447,346.42	
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	16.70	683,597.80	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	34.86	566,649.30	
	AVIVA PIC	332,730	4.13	1,374,174.90	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.13	355,927.95	
	LEGAL & GENERAL GROUP	514,539	2.79	1,435,563.81	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.25	318,858.25	
	PRUDENTIAL	225,330	15.37	3,463,322.10	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	41.76	455,893.92	
	SAGE GROUP PLC	95,210	7.43	707,981.56	
	HALMA PLC	31,069	30.40	944,497.60	
	BT GROUP PLC	769,485	1.62	1,246,950.44	
	VODAFONE GROUP PLC	2,376,986	1.20	2,871,874.48	
	NATIONAL GRID PLC	306,760	9.41	2,888,145.40	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	28.02	629,553.36	
	SSE PLC	92,294	16.62	1,533,926.28	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.56	618,604.80	
イギリスポンド 小計		24,694,236		150,135,769.61 (22,840,154,630)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.29	335,607.42	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	982.50	563,955.00	
	GIVAUDAN-REG	795	4,584.00	3,644,280.00	
	HOLCIM LTD	45,387	51.96	2,358,308.52	
	SIKA AG-BR	11,766	329.90	3,881,603.40	

	ABB LTD	149,042	34.42	5,130,025.64	
	GEBERIT AG-REG	2,964	763.00	2,261,532.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	282.00	595,584.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	295.30	1,112,690.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	51.14	745,263.22	
	SGS SA	506	2,883.00	1,458,798.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	337.70	1,545,652.90	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,541	101.50	4,419,411.50	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	258.50	641,855.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	50.35	198,278.30	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,332.00	652,960.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	109,200.00	1,092,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,730.00	879,860.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	243,137	115.22	28,014,245.14	
	ALCON INC	42,603	77.24	3,290,655.72	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,677	358.30	1,675,769.10	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,781.00	1,520,974.00	
	LONZA GROUP AG-REG	6,195	768.80	4,762,716.00	
	NOVARTIS	187,008	83.37	15,590,856.96	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	405.60	1,135,274.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	59,238	364.75	21,607,060.50	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	133.20	597,535.20	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	77.70	221,755.80	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.68	2,066,440.29	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	62.52	1,181,440.44	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,941	1,622.50	3,149,272.50	
	UBS GROUP AG	315,017	15.29	4,818,185.01	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	147.40	642,958.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	478.80	1,364,101.20	
	SWISS RE LTD	24,674	82.62	2,038,565.88	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,740	399.30	5,087,082.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	97.65	554,554.35	
	TEMENOS AG - REG	5,150	139.45	718,167.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	94.36	1,385,770.96	
	SWISSCOM	2,187	535.20	1,170,482.40	
スイスフラン 小計		1,479,172		134,111,529.95 (16,108,135,862)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	263.20	4,532,830.40	
	BOLIDEN AB	23,903	300.00	7,170,900.00	
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	155.20	8,841,278.40	
	ALFA LAVAL AB	27,268	351.90	9,595,609.20	
	ASSA ABLOY AB-B	86,548	274.70	23,774,735.60	

	ATLAS COPCO A	55,390	591.20	32,746,568.00	
	ATLAS COPCO B	31,902	497.90	15,884,005.80	
	EPIROC AB-A	58,039	192.15	11,152,193.85	
	EPIROC AB-B	37,972	167.00	6,341,324.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	303.30	4,246,806.60	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	124.80	13,431,475.20	
	SANDVIK AB	96,684	220.70	21,338,158.80	
	SKANSKA B	25,507	249.80	6,371,648.60	
	SKF AB-B	35,405	219.30	7,764,316.50	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	196.50	2,655,501.00	
	VOLVO B	123,279	192.28	23,704,086.12	
	SECURITAS B	29,533	142.90	4,220,265.70	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	217.90	4,634,515.10	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	116.05	4,492,527.60	
	EVOLUTION AB	14,096	1,473.40	20,769,046.40	
	EMBRACER GROUP AB	18,755	207.00	3,882,285.00	
	HENNES & MAURITZ B	65,999	175.66	11,593,384.34	
	ICA GRUPPEN AB	9,493	421.70	4,003,198.10	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	80.24	10,212,144.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	275.50	13,630,087.00	
	NORDEA BANK ABP	280,957	105.60	29,669,059.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	118.25	16,374,077.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	131,166	98.40	12,906,734.40	
	SWEDBANK AB-A	72,526	168.44	12,216,279.44	
	EQT AB	20,102	417.80	8,398,615.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	315.60	3,192,294.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	299.40	3,343,699.20	
	INVESTOR AB-B SHS	157,664	205.90	32,463,017.60	
	KINNEVIK AB - B	18,792	343.70	6,458,810.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	546.00	3,974,880.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	598.40	5,654,880.00	
	SINCH AB	44,150	200.60	8,856,490.00	
	ERICSSON (LM) B	253,862	102.92	26,127,477.04	
	HEXAGON AB-B SHS	169,708	150.15	25,481,656.20	
	TELE2 AB-B SHS	32,829	130.40	4,280,901.60	
	TELIA CO AB	230,643	36.72	8,469,210.96	
スウェーデンクローナ 小計		2,774,709		484,856,975.25 (6,220,714,992)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	76,370	194.30	14,838,691.00	
	NORSK HYDRO	126,800	62.20	7,886,960.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	437.80	7,183,422.40	
	ADEVINTA ASA	19,117	167.00	3,192,539.00	

	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	412.00	3,820,888.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	463.90	3,285,339.80	
	MOWI ASA	40,968	232.10	9,508,672.80	
	ORKLA	69,804	78.14	5,454,484.56	
	DNB BANK ASA	71,795	189.95	13,637,460.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	203.80	3,785,381.20	
	TELENOR ASA	51,193	152.60	7,812,051.80	
ノルウェークローネ 小計		507,385		80,405,890.81 (1,017,134,518)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	561.00	4,758,963.00	
	NOVOZYMES A/S	17,111	496.70	8,499,033.70	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	3,324.00	2,509,620.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	87,375	265.50	23,198,062.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	17,570.00	5,253,430.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	514	18,615.00	9,568,110.00	
	DSV PANALPINA A S	17,354	1,646.00	28,564,684.00	
	PANDORA A/S	8,163	775.60	6,331,222.80	
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,088.50	9,411,171.00	
	AMBU A/S-B	13,555	210.40	2,851,972.00	
	COLOPLAST-B	9,208	1,104.00	10,165,632.00	
	DEMANT A/S	8,512	364.90	3,106,028.80	
	GN STORE NORD A/S	11,967	487.00	5,827,929.00	
	GENMAB A/S	5,792	3,062.00	17,735,104.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	141,003	629.60	88,775,488.80	
	DANSKE BANK A/S	56,132	106.85	5,997,704.20	
	TRYG A/S	29,772	154.75	4,607,217.00	
	ORSTED A/S	15,439	989.00	15,269,171.00	
デンマーククローネ 小計		440,080		252,430,543.80 (4,427,631,738)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	28.24	582,562.96	
	OIL SEARCH LTD	186,117	3.83	712,828.11	
	SANTOS	156,437	6.25	977,731.25	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	35.99	461,139.87	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	19.90	1,480,639.60	
	BHP GROUP LTD	245,638	42.35	10,402,769.30	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	23.92	831,698.40	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	3.90	476,400.60	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	20.85	2,887,370.55	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	54.31	2,006,645.88	
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	24.58	1,821,328.84	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	9.76	991,889.28	
	ORICA LTD	38,288	13.44	514,590.72	

	RIO TINTO LTD	32,028	111.37	3,566,958.36	
	SOUTH32 LTD	341,133	3.28	1,118,916.24	
	REECE LTD	16,814	19.83	333,421.62	
	BRAMBLES LTD	108,007	12.17	1,314,445.19	
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.79	725,750.89	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.34	453,900.00	
	TRANSURBAN GROUP	233,493	14.32	3,343,619.76	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	44,067	46.07	2,030,166.69	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	9.41	285,386.48	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	156.71	554,910.11	
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	4.87	886,403.31	
	REA GROUP LTD	5,276	155.57	820,787.32	
	SEEK LTD	31,593	33.18	1,048,255.74	
	WESFARMERS LTD	92,850	57.78	5,364,873.00	
	COLES GROUP LTD	115,478	17.74	2,048,579.72	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.79	746,227.79	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	109,901	40.72	4,475,168.72	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	12.37	872,555.06	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	237.36	1,135,292.88	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	71.95	1,169,043.60	
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	43.75	1,753,325.00	
	CSL LIMITED	38,878	303.87	11,813,857.86	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	239,681	27.87	6,679,909.47	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	148,199	101.84	15,092,586.16	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	278,638	28.70	7,996,910.60	
	WESTPAC BANKING	302,673	26.02	7,875,551.46	
	ASX LTD	14,549	86.96	1,265,181.04	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,813	169.18	5,043,763.34	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	43.87	478,709.44	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	5.40	1,238,797.80	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.57	963,400.20	
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	11.70	1,305,614.70	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	12.66	1,511,021.64	
	AFTERPAY LTD	19,441	130.71	2,541,133.11	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	16.57	735,310.32	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	49.23	679,423.23	
	XERO LTD	11,340	151.01	1,712,453.40	
	TELSTRA CORP	308,467	3.85	1,187,597.95	
	AGL ENERGY LTD	64,235	6.41	411,746.35	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.95	364,932.75	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.46	738,553.70	
		5,714,921		127,832,037.36	

オーストラリアドル 小計				(10,436,207,530)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.25	854,564.75	
	A2 MILK CO LTD	66,854	5.98	399,786.92	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	33.45	1,823,694.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	15.80	573,808.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.83	836,159.94	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.68	431,614.84	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.21	576,486.96	
ニュージーランドドル 小計		623,837		5,496,116.01 (431,609,990)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	57.05	13,092,746.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	117,500	173.90	20,433,250.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	30.85	5,306,200.00	
	MTR CORP	125,000	43.85	5,481,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	31.60	3,792,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	50.65	8,813,100.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	25.60	5,068,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	6.95	917,400.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	9.10	1,281,280.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	15.88	2,734,536.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	19.68	2,871,312.00	
	WH GROUP LTD	936,500	6.11	5,722,015.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	23.40	6,587,100.00	
	HANG SENG BANK	59,400	140.20	8,327,880.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	101,400	487.60	49,442,640.00	
	AIA GROUP LTD	1,020,200	92.70	94,572,540.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	49.70	8,175,451.20	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	24.00	3,768,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	18.78	3,248,940.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	34.75	4,351,673.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	36.35	4,957,231.25	
	SINO LAND CO	315,400	11.40	3,595,560.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	108.30	11,696,400.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	53.05	2,148,525.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	21.00	2,020,200.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	39.70	6,232,900.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	45.80	3,091,500.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	76.85	10,566,875.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	12.44	11,253,933.08	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	48.10	5,387,200.00	
香港ドル 小計		6,820,752		314,938,438.33 (4,450,080,133)	

シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.19	712,587.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.76	554,224.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.04	545,993.28	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.78	479,700.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.15	741,190.00	
	DBS GROUP	155,200	30.12	4,674,624.00	
	OCBC BANK	291,200	11.62	3,383,744.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	25.56	2,400,084.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	10.17	796,311.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	4.02	898,470.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.86	293,608.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.07	335,825.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.90	485,730.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.38	1,790,338.34	
シンガポールドル 小計		2,896,975		18,092,428.62 (1,480,684,358)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	22.70	1,538,061.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	461.10	989,520.60	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	27.80	2,733,018.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	26.65	2,901,225.60	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	16.90	1,681,550.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	105.80	1,322,817.40	
	AZRIELI GROUP	4,323	305.90	1,322,405.70	
	NICE LTD	5,891	941.60	5,546,965.60	
イスラエルシェケル 小計		399,293		18,035,564.10 (618,129,281)	
合　計		92,364,282		514,344,571,346 (514,344,571,346)	

(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	1,046,878.95	
		LENDLEASE GROUP	64,786	770,953.40	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	987,689.43	
	オーストラリアドル 小計		303,750	2,805,521.78 (229,042,798)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,711,080.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,982,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,693,580.00 (80,450,285)	
			899,250	309,493,083	

投資信託受益証券合計				(309,493,083)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	748,486.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,286,575.82	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	38,637	11,668,760.37	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,082,825.28	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,025	2,800,021.25	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,483,742.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	1,348,430.72	
		CROWN CASTLE INTL CORP	36,859	7,316,511.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,924	4,009,662.40	
		DUKE REALTY CORP	31,540	1,691,174.80	
		EQUINIX INC	7,500	6,621,225.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,241,751.70	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,400	2,516,346.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,849,045.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	2,105,240.28	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,645,382.75	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	918,019.41	
		INVITATION HOMES INC	46,840	1,964,938.00	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,151,837.88	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,083,279.40	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,883,532.42	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	709,780.34	
		PROLOGIS INC	63,163	8,779,025.37	
		PUBLIC STORAGE	13,171	4,356,439.96	
		REALTY INCOME CORP	31,608	2,285,258.40	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	867,512.74	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,113	3,339,732.24	
		SIMON PROPERTY GROUP	28,176	3,824,892.00	
		SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,895,763.45	
		UDR INC	24,265	1,343,553.05	
		VENTAS INC	31,565	1,777,425.15	
		VEREIT INC	21,159	1,071,280.17	
		VICI PROPERTIES INC	43,921	1,406,789.63	
		VORNADO REALTY TRUST	15,390	644,225.40	
		WELLTOWER INC	35,679	3,095,153.25	
		WP CAREY INC	14,258	1,130,801.98	
	アメリカドル 小計		1,020,602	93,944,423.23 (10,317,916,003)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	552,327.05	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	349,454.40	
			24,377	901,781.45	

	カナダドル 小計			(78,969,001)	
	ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	385,249.68	
		GECINA SA	4,459	573,427.40	
		KLEPIERRE	17,225	352,423.50	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	733,313.70	
	ユーロ 小計		37,101	2,044,414.28 (266,652,954)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	430,265.05	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	487,930.54	
		SEGRO PLC	106,999	1,386,707.04	
	イギリスポンド 小計		252,762	2,304,902.63 (350,644,837)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,001,117.60	
		GOODMAN GROUP	139,848	3,233,285.76	
		GPT GROUP	167,884	837,741.16	
		MIRVAC GROUP	266,683	829,384.13	
		SCENTRE GROUP	486,663	1,411,322.70	
		STOCKLAND	207,412	966,539.92	
		VICINITY CENTERS	365,149	648,139.47	
	オーストラリアドル 小計		1,727,729	8,927,530.74 (728,843,609)	
	香港ドル	LINK REIT	170,500	12,131,075.00	
	香港ドル 小計		170,500	12,131,075.00 (171,412,089)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	880,827.80	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	426,560	891,510.40	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	457,600.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	570,747.65	
	シンガポールドル 小計		1,203,783	2,800,685.85 (229,208,129)	
投資証券合計			4,436,854	12,143,646,622 (12,143,646,622)	
合計				12,453,139,705 (12,453,139,705)	

(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　599銘柄	97.3%	—	—	70.9%
	投資証券　36銘柄	—	—	2.7%	2.0%
カナダドル	株式　89銘柄	99.6%	—	—	3.4%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.4%	0.0%
ユーロ	株式　231銘柄	99.5%	—	—	10.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式　83銘柄	98.5%	—	—	4.3%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.5%	0.1%
スイスフラン	株式　40銘柄	100.0%	—	—	3.1%
スウェーデンクローナ	株式　41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　18銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　54銘柄	91.6%	—	—	2.0%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.0%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　30銘柄	94.6%	—	—	0.8%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.7%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.6%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	86.6%	—	—	0.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	13.4%	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 9月 6日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,827,066,137
投資証券	108,558,224,570
派生商品評価勘定	28,274,400
未収入金	53,038,934
未収配当金	1,182,430,293
差入委託証拠金	226,746,000
流動資産合計	112,875,780,334
資産合計	112,875,780,334
負債の部	
流動負債	
前受金	28,274,400
未払金	162,933,406
未払解約金	173,431,910
未払利息	2,668
流動負債合計	364,642,384
負債合計	364,642,384
純資産の部	
元本等	
元本	49,131,603,828
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	63,379,534,122
元本等合計	112,511,137,950
純資産合計	112,511,137,950
負債純資産合計	112,875,780,334

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 9月 6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。

	2021年 9月 6日現在
	(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 9月 6日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	49,131,603,828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　2.2900円 (1万口当たり純資産額)　(22,900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 9月 6日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 9月 6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 9月 6日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	63,382,035,403円
期中追加設定元本額	6,459,198,500円

区分	2021年 9月 6日現在
期中一部解約元本額	20,709,630,075円
期末元本額	49,131,603,828円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,653,022,162円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,584,896円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	15,815,368,601円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	22,465,265,938円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,286,420,154円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,886,625,627円
分散投資コア戦略ファンドＡ	717,967,520円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,534,862,514円
コア投資戦略ファンド（切替型）	764,643,554円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	27,254,430円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	257,938,774円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,665,681円
グローバル経済コア	261,734,616円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	10,127,160円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	400,278,336円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	50,414,618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）	486,942,786円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	11,806,114円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	41,981,103円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	17,781円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	879,111,626円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用）	265,925,609円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	302,644,228円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 9月 6日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	20,664,579,665
合計	20,664,579,665

(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 9月 6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	3,917,289,600	－	3,945,564,000	28,274,400
合計		3,917,289,600	－	3,945,564,000	28,274,400

(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	1,849	255,162,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	2,908	367,571,200	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	3,851	727,068,800	
	東海道リート投資法人	703	75,502,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,170	2,089,030,000	
	森ヒルズリート投資法人	10,795	1,708,848,500	
	産業ファンド投資法人	13,033	2,888,112,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	9,179	3,469,662,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,270	1,447,116,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,724	2,175,402,000	
	ＧＬＰ投資法人	29,733	5,994,172,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,134	1,448,967,000	
	日本プロロジスリート投資法人	14,545	5,868,907,500	
	星野リゾート・リート投資法人	1,416	1,022,352,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	1,431	458,635,500	
	イオンリート投資法人	10,797	1,615,231,200	
	ヒューリックリート投資法人	8,070	1,459,056,000	
	日本リート投資法人	2,833	1,249,353,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	20,419	464,123,870	

積水ハウス・リート投資法人	27,002	2,500,385,200	
トーセイ・リート投資法人	1,918	268,903,600	
ケネディクス商業リート投資法人	3,665	1,098,767,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	1,958	295,853,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,080	251,264,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	29,688	5,082,585,600	
いちごホテルリート投資法人	1,521	142,365,600	
ラサールロジポート投資法人	11,239	2,242,180,500	
スターアジア不動産投資法人	9,487	545,502,500	
マリモ地方創生リート投資法人	860	112,058,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,413	2,218,450,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,482	121,079,400	
投資法人みらい	10,466	564,117,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,154	291,220,800	
三菱地所物流リート投資法人	2,333	1,224,825,000	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	3,149	702,856,800	
ザイマックス・リート投資法人	1,333	152,228,600	
タカラレーベン不動産投資法人	3,620	398,200,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,580	590,700,000	
日本ビルファンド投資法人	10,404	7,678,152,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,180	6,380,100,000	
日本都市ファンド投資法人	46,320	5,197,104,000	
オリックス不動産投資法人	18,292	3,587,061,200	
日本プライムリアルティ投資法人	6,033	2,488,612,500	
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	8,292	1,311,794,400	
東急リアル・エステート投資法人	6,155	1,179,913,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,375	792,412,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	20,667	3,250,919,100	
森トラスト総合リート投資法人	6,561	1,014,986,700	
インヴィンシブル投資法人	40,407	1,765,785,900	
フロンティア不動産投資法人	3,218	1,538,204,000	
平和不動産リート投資法人	5,947	990,175,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	5,998	2,096,301,000	
福岡リート投資法人	4,748	835,648,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,840	2,249,280,000	
いちごオフィスリート投資法人	7,522	719,103,200	
大和証券オフィス投資法人	1,941	1,515,921,000	
阪急阪神リート投資法人	4,147	701,257,700	
スターツプロシード投資法人	1,430	383,526,000	
大和ハウスリート投資法人	13,785	4,700,685,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	28,125	1,887,187,500	
大和証券リビング投資法人	12,008	1,476,984,000	

	ジャパンエクセレント投資法人	8,519	1,229,291,700	
合計		549,722	108,558,224,570	

(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 9月 6日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	557,845,876
コール・ローン	6,793,259
投資証券	97,989,118,087
派生商品評価勘定	252,698
未収入金	2,445,873
未収配当金	88,299,502
流動資産合計	98,644,755,295
資産合計	98,644,755,295
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	99,450
未払解約金	259,006,308
未払利息	6
流動負債合計	259,105,764
負債合計	259,105,764
純資産の部	
元本等	
元本	41,266,058,193
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	57,119,591,338
元本等合計	98,385,649,531
純資産合計	98,385,649,531
負債純資産合計	98,644,755,295

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 9月 6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 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 9月 6日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	41,266,058,193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 2.3842円 (1万口当たり純資産額) (23,842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 9月 6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 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月 8日
期首元本額	53,636,262,825円
期中追加設定元本額	5,812,697,828円
期中一部解約元本額	18,182,902,460円
期末元本額	41,266,058,193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	68,825,047円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	108,282,995円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,684,530,895円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,770,649円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	11,885,394,625円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	18,327,871,974円
コア投資戦略ファンド（安定型）	856,900,086円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,859,017,722円
分散投資コア戦略ファンドＡ	697,129,614円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,491,756,379円

区分	2021年 9月 6日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	738,238,286円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	151,378,933円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	255,657,000円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,926,001円
グローバル経済コア	264,558,966円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	10,488,369円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	408,099,388円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	48,879,405円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,189,919,484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）	400,388,506円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	109,164,563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）	3,392,209円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	12,981円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	117,496,637円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	120,314,866円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	116,232,884円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	115,423,480円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	112,555,727円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	112,450,522円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 9月 6日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	22,443,092,665
合計	22,443,092,665

(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 9月 6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	65,898,000	－	65,896,800	△1,200
	アメリカドル	65,898,000	－	65,896,800	△1,200
	売建	250,586,628	－	250,432,180	154,448
	アメリカドル	214,397,478	－	214,165,180	232,298

	オーストラリアドル	12,147,750	—	12,246,000	△98,250
	香港ドル	24,041,400	—	24,021,000	20,400
合計		316,484,628	—	316,328,980	153,248

(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	1,003,107.80	
		AGREE REALTY CORP	38,105	2,843,014.05	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	951,537.30	
		ALEXANDER'S INC	1,190	306,948.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,254	15,892,858.68	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,157	1,080,577.03	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	76,794	3,992,520.06	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	507,706.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,152	6,467,981.52	
		AMERICOLD REALTY TRUST	140,340	5,288,011.20	
		APARTMENT INCOME REIT CO	87,139	4,558,241.09	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	92,751	687,284.91	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	1,745,865.83	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	30,500	416,325.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	77,599	18,068,927.15	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	162,013.50	
		BOSTON PROPERTIES	78,945	8,990,256.60	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,310,680.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	164,985	3,898,595.55	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	2,419,394.12	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	102,600.00	

		CAMDEN PROPERTY TRUST	54,356	8,340,384.64	
		CARETRUST REIT INC	52,477	1,171,286.64	
		CENTERSPACE	7,499	786,795.08	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	301,530.40	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	13,000	91,000.00	
		CITY OFFICE REIT INC	25,050	408,565.50	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	63,291.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	66,331	1,097,114.74	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	13,843	686,197.51	
		COREPOINT LODGING INC	22,000	313,720.00	
		CORESITE REALTY CORP	24,029	3,709,597.02	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	1,788,031.29	
		COUSINS PROPERTIES INC	82,626	3,226,545.30	
		CTO REALTY GROWTH INC	2,800	159,124.00	
		CUBESMART	111,990	6,142,651.50	
		CYRUSONE INC	68,129	5,498,010.30	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,014,451.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	157,220	26,350,072.00	
		DIGITALBRIDGE GROUP INC	280,923	1,924,322.55	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	494,016.00	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,697	3,065,430.71	
		DUKE REALTY CORP	208,231	11,165,346.22	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	1,035,348.96	
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	22,299	4,114,611.48	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	822,536.52	
		EPR PROPERTIES	41,912	2,171,041.60	
		EQUINIX INC	49,986	44,129,140.38	
		EQUITY COMMONWEALTH	67,845	1,796,535.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,169	8,299,113.97	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	192,392	16,466,831.28	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	67,664	2,211,259.52	
		ESSEX PROPERTY TRUST	36,165	12,136,250.70	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	74,300	14,392,653.00	
		FARMLAND PARTNERS INC	12,200	152,988.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,450	4,846,827.00	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	71,853	4,073,346.57	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	43,750	1,268,750.00	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	256,820.39	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	121,701	6,246,912.33	
		GEO GROUP INC/THE	64,306	508,660.46	
		GETTY REALTY CORP	21,985	698,463.45	

		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	457,203.50	
		GLADSTONE LAND CORP	15,500	369,830.00	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	27,530	437,451.70	
		GLOBAL NET LEASE INC	51,412	886,857.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	78,310	2,422,911.40	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	121,604	3,803,773.12	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	299,312	10,879,991.20	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	202,644.00	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	57,872	2,677,158.72	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	392,121	6,340,596.57	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	2,317,365.50	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	59,131	1,237,611.83	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,941	1,056,277.44	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	12,688	3,198,391.04	
		INVITATION HOMES INC	317,681	13,326,717.95	
		IRON MOUNTAIN INC	160,432	7,922,132.16	
		JBG SMITH PROPERTIES	62,238	1,898,259.00	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	350,000	266,000.00	
		KILROY REALTY CORPORATION	58,949	3,924,824.42	
		KIMCO REALTY CORP	333,810	7,387,215.30	
		KITE REALTY GROUP TRUST	46,370	963,568.60	
		LEXINGTON CORP PROPERTIES	152,908	2,134,595.68	
		LIFE STORAGE INC	42,825	5,528,279.25	
		LTC PROPERTIES INC	23,274	804,582.18	
		MACERICH CO/THE	92,542	1,598,200.34	
		MACK-CALI REALTY CORP	50,236	898,722.04	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	537,691.72	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	326,646	7,071,885.90	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,596	12,473,719.44	
		MONMOUTH REIT -CL A	54,952	1,044,088.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	97,618	4,633,926.46	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	43,310	2,545,328.70	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,535,340.20	
		NETSTREIT CORP	14,992	391,441.12	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	45,000	394,200.00	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	831,054.12	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	741,947.80	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	130,739	4,421,592.98	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	274,566.07	
		PARAMOUNT GROUP INC	89,726	790,486.06	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	131,413	2,454,794.84	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,557,582.75	

PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	73,150.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,243,193.04	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,213,122.64	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	375,558.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	377,600.86	
PRIME US REIT	295,000	250,750.00	
PROLOGIS INC	412,609	57,348,524.91	
PS BUSINESS PARKS INC	11,172	1,786,291.08	
PUBLIC STORAGE	84,981	28,108,315.56	
REALTY INCOME CORP	208,923	15,105,132.90	
REGENCY CENTERS CORP	87,860	6,092,212.40	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	69,195	1,261,424.85	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	115,918	1,560,256.28	
RETAIL VALUE	9,529	246,229.36	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	74,605	4,732,941.20	
RLJ LODGING TRUST	92,291	1,328,990.40	
RPT REALTY	43,950	572,668.50	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	2,531,499.12	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,636	1,945,630.40	
SAFEHOLD INC	8,340	707,482.20	
SAUL CENTERS INC	6,800	309,196.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	313,425.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	1,064,109.70	
SIMON PROPERTY GROUP	183,466	24,905,509.50	
SITE CENTERS CORP	91,820	1,483,811.20	
SL GREEN REALTY CORP	38,655	2,713,581.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63,982	3,323,864.90	
STAG INDUSTRIAL INC	88,769	3,841,034.63	
STORE CAPITAL CORP	135,277	4,878,088.62	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	580,750.50	
SUN COMMUNITIES INC	62,166	13,000,775.58	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	126,030	1,487,154.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	57,370	999,385.40	
TERRENO REALTY CORP	38,649	2,676,829.74	
UDR INC	164,937	9,132,561.69	
UMH PROPERTIES INC	21,320	532,573.60	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	403,806.43	
URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,136,551.50	
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	288,358.00	
VENTAS INC	208,364	11,732,976.84	
VEREIT INC	127,297	6,445,047.11	

	VICI PROPERTIES INC	298,370	9,556,791.10	
	VORNADO REALTY TRUST	87,169	3,648,894.34	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,166,136.30	
	WELLTOWER INC	233,282	20,237,213.50	
	WHITESTONE REIT	19,090	187,463.80	
	WP CAREY INC	98,844	7,839,317.64	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,080,334.20	
アメリカドル 小計		13,938,266	671,627,758.22 (73,764,876,685)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	1,466,973.24	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	40,330	462,988.40	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	156,000.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,360	545,393.60	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	47,920	2,978,228.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,313,230.80	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	47,120	508,424.80	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	487,687.95	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	497,753.50	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	51,250	863,562.50	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	323,111.60	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,041,990.60	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,605	1,712,218.15	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	74,039	1,220,162.72	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	603,052.10	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	649,237.50	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	260,295.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	230,086.50	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,470	649,013.30	
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	114,500.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	89,631	2,022,075.36	
	SLATE GROCERY REIT	10,300	140,492.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	90,610.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	41,476	1,269,995.12	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	1,014,260.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	193,242.00	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	23,500	638,730.00	
カナダドル 小計		964,475	21,453,314.74	

			(1,878,666,771)	
ユーロ	AEDIFICA	19,919	2,436,093.70	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	99,700	1,637,074.00	
	ALTAREA	2,230	451,575.00	
	BEFIMMO S.C.A.	14,010	491,050.50	
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	417,750.00	
	CARMILA	25,000	296,500.00	
	COFINIMMO	16,367	2,266,829.50	
	COVIVIO(FP)	26,953	2,092,630.92	
	CROMWELL REIT EUR	160,000	417,600.00	
	EUROCOMMERCIAL	20,783	440,183.94	
	GECINA SA	30,262	3,891,693.20	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	353,942.00	
	HIBERNIA REIT PLC	365,550	467,904.00	
	ICADE	17,080	1,221,220.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	134,484.20	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	143,462	1,259,596.36	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	310,970.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	408,200.00	
	KLEPIERRE	111,985	2,291,213.10	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	187,340.00	
	MERCIALYS	19,000	182,590.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	187,486	1,842,987.38	
	MONTEA NV	5,300	669,920.00	
	NSI NV	10,050	356,775.00	
	RETAIL ESTATES	6,400	440,320.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	77,071	5,405,759.94	
	VASTNED RETAIL	10,650	254,002.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	75,722	2,942,556.92	
	WERELDHAVE NV	22,670	301,284.30	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	542,880.00	
ユーロ 小計		1,869,980	34,412,926.46 (4,488,477,998)	
イギリスポンド	AEW UK REIT PLC	118,000	125,316.00	
	ASSURA PLC	1,467,040	1,147,225.28	
	BIG YELLOW GROUP PLC	92,046	1,447,883.58	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	411,945.00	
	BRITISH LAND CO PLC	527,668	2,858,905.22	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	840,891.03	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	329,076.79	
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	226,310.61	
	DERWENT LONDON PLC	62,782	2,378,182.16	

		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	299,268.00	
		GCP STUDENT LIVING PLC	258,000	546,960.00	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	136,780	1,086,033.20	
		HAMMERSON PLC	2,291,000	826,821.90	
		HOME REIT PLC	132,934	150,880.09	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	204,667.67	
		INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	422,451	3,106,704.65	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	1,300,883.24	
		LXI REIT PLC	344,008	512,571.92	
		NEWRIVER REIT PL	186,000	147,126.00	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	310,200.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	1,215,056.29	
		REGIONAL REIT LTD	222,000	202,242.00	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	1,379,679.93	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	185,500.00	
		SEGRO PLC	668,947	8,669,553.12	
		SHAFTESBURY PLC	170,193	1,121,571.87	
		STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	181,746.93	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	466,000	552,210.00	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	214,263.44	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	971,658	2,312,546.04	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	392,000	313,600.00	
		UNITE GROUP PLC	220,572	2,719,652.76	
		WORKSPACE GROUP PLC	70,347	671,813.85	
イギリスポンド 小計			14,182,008	38,006,558.57 (5,781,937,755)	
オーストラリアドル		ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	805,197.36	
		APN INDUSTRIA REIT	75,000	279,750.00	
		ARENA REIT	201,053	894,685.85	
		AVENTUS GROUP	193,500	686,925.00	
		BWP TRUST	262,160	1,077,477.60	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	321,000	1,113,870.00	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	266,606	1,066,424.00	
		CENTURIA OFFICE REIT	220,945	572,247.55	
		CHARTER HALL GROUP	259,369	4,704,953.66	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	319,312	1,708,319.20	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	1,152,062.40	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	736,571.50	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	1,102,633	1,014,422.36	
		DEXUS	598,428	6,367,273.92	
		GDI PROPERTY GROUP	324,500	382,910.00	
		GOODMAN GROUP	934,143	21,597,386.16	

	GPT GROUP	1,072,455	5,351,550.45	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	738,746.80	
	HOME CONSORTIUM	91,000	645,190.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	268,642	432,513.62	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	82,885	295,899.45	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	1,009,714.72	
	IRONGATE GROUP	272,000	413,440.00	
	MIRVAC GROUP	2,190,726	6,813,157.86	
	NATIONAL STORAGE REIT	601,340	1,443,216.00	
	RURAL FUNDS GROUP	238,095	623,808.90	
	SCENTRE GROUP	2,886,991	8,372,273.90	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	1,597,213.80	
	STOCKLAND	1,328,376	6,190,232.16	
	VICINITY CENTERS	2,156,333	3,827,491.07	
	WAYPOINT REIT LTD	415,796	1,180,860.64	
オーストラリアドル 小計		18,310,122	83,095,785.93 (6,783,939,963)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	846,338.43	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	1,548,774.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	1,004,433.30	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	1,167,748.74	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	710,249.82	
ニュージーランドドル 小計		2,867,311	5,277,544.29 (414,445,553)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,138,000	4,973,060.00	
	FORTUNE REIT	756,000	6,305,040.00	
	LINK REIT	1,159,400	82,491,310.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,353,760.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,754,510.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	3,296,540.00	
香港ドル 小計		5,184,400	102,174,220.00 (1,443,721,728)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	437,250.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	681,653.95	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,837,318	5,695,685.80	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,021,633.31	
	CAPITALAND CHINA TRUST	507,721	670,191.72	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,540,044	5,308,691.96	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	504,812.00	
	EC WORLD REIT	180,000	146,700.00	
	ESR REIT	1,448,995	695,517.60	

		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	337,500.00	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	142,596.50	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	734,262	1,754,886.18	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	234,600.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,610,096	2,463,446.88	
		IREIT GLOBAL	405,985	261,860.32	
		KEPPEL DC REIT	709,903	1,796,054.59	
		KEPPEL REIT	1,051,400	1,135,512.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000	502,275.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,480,400	153,784.80	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,240,473	2,580,183.84	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,088,963	3,190,661.59	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,640,700	3,429,063.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,092,100	1,092,100.00	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	554,035.14	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	225,500	1,102,695.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	215,343.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	270,657.00	
		SPH REIT	576,800	545,076.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	859,400	550,016.00	
		SUNTEC REIT	1,180,700	1,723,822.00	
	シンガポールドル 小計		27,980,898	39,198,305.18 (3,207,989,295)	
	韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	54,685	362,561,550.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	62,229,090.00	
		JR REIT XXVII	64,338	342,278,160.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	122,800,000.00	
		LOTTE REIT CO LTD	72,480	409,512,000.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	200,576,500.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	156,562,600.00	
	韓国ウォン 小計		284,799	1,656,519,900.00 (157,203,738)	
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	1,979,955.00	
	イスラエルシェケル 小計		103,500	1,979,955.00 (67,858,601)	
合計			85,685,759	97,989,118,087 (97,989,118,087)	

(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　153銘柄	100.0%	75.3%
カナダドル	投資証券　27銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券　30銘柄	100.0%	4.6%
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%	6.9%
ニュージーランドドル	投資証券　5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券　6銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	投資証券　30銘柄	100.0%	3.3%
韓国ウォン	投資証券　7銘柄	100.0%	0.2%
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（つみたてＮＩＳＡ対応型）】

【純資産額計算書】

（2021年 9月30日現在）

Ⅰ　資産総額	221,606,579円
Ⅱ　負債総額	80,966円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	221,525,613円
Ⅳ　発行済口数	178,865,520口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2385円
（1万口当たり純資産額）	（12,385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 9月30日現在）

Ⅰ　資産総額	673,513,615,734円
Ⅱ　負債総額	8,503,041,220円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	665,010,574,514円
Ⅳ　発行済口数	471,608,130,011口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4101円
（1万口当たり純資産額）	（14,101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 9月30日現在）

Ⅰ　資産総額	494,486,406,552円
Ⅱ　負債総額	783,032,947円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	493,703,373,605円
Ⅳ　発行済口数	249,768,323,924口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9766円
（1万口当たり純資産額）	（19,766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 9月30日現在）

Ⅰ　資産総額	**298,249,604,626円**
Ⅱ　負債総額	**248,308,002円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**298,001,296,624円**
Ⅳ　発行済口数	**97,195,843,485口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**3.0660円**
（1万口当たり純資産額）	**（30,660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 9月30日現在）

Ⅰ　資産総額	**527,707,794,317円**
Ⅱ　負債総額	**10,679,222,349円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**517,028,571,968円**
Ⅳ　発行済口数	**132,221,776,468口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**3.9103円**
（1万口当たり純資産額）	**（39,103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 9月30日現在）

Ⅰ　資産総額	**109,293,518,917円**
Ⅱ　負債総額	**531,893,954円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**108,761,624,963円**
Ⅳ　発行済口数	**49,454,578,634口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.1992円**
（1万口当たり純資産額）	**（21,992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 9月30日現在）

Ⅰ　資産総額	93,985,234,525円
Ⅱ　負債総額	241,210,597円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	93,744,023,928円
Ⅳ　発行済口数	41,131,489,463口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2791円
（1万口当たり純資産額）	（22,791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。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2021年 9月30日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：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12月 6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9月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	535	14,650,754
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	76	276,621
単位型公社債投資信託	51	304,685
合計	662	15,232,060

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12月 6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
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年12月 7日	有価証券届出書
2020年12月 7日	有価証券報告書
2021年 6月 7日	有価証券届出書
2021年 6月 7日	半期報告書

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11月5日

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

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　松崎雅則　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2020年9月8日から2021年9月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2021年9月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。