【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年8月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　民野　誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）
愛称として「スゴ６」という名称を用いることがあります。

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

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

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。また、確定拠出年金によるお申込みについては１円以上１円単位とします。

（７）【申込期間】

2022年 8月11日から2023年 2月10日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。
＜申込みコース＞

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

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

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

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

＜信託金限度額＞

上限　5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

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

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

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

［投資対象地域による区分］

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

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

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

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

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

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

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

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

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

［独立した区分］

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

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

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

［補足分類］

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

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

＜属性区分表定義＞

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

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

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

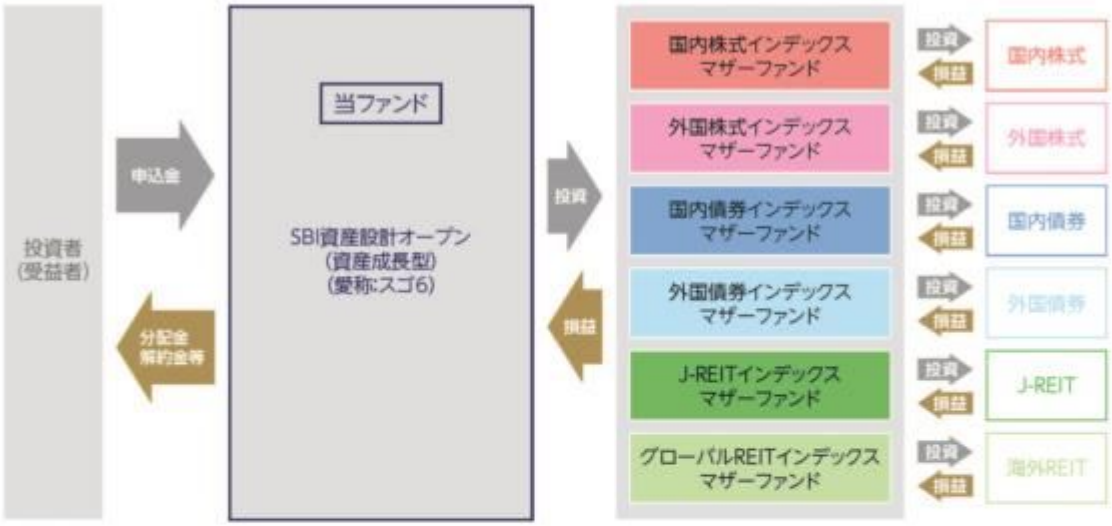
[特殊型]
(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左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

＜ファンドの特色＞

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。

ファンドのしくみ



? 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JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会

社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
「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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
「東証REIT指数」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
「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)及び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又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。

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

基本組入比率

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

4. ノーロードファンドです。

●購入時手数料が無料のノーロードファンドです。
（運用管理費用(信託報酬)は純資産総額に対して**年率0.748%(税抜0.68%)**です。）

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

●株式への直接投資は行いません。

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

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

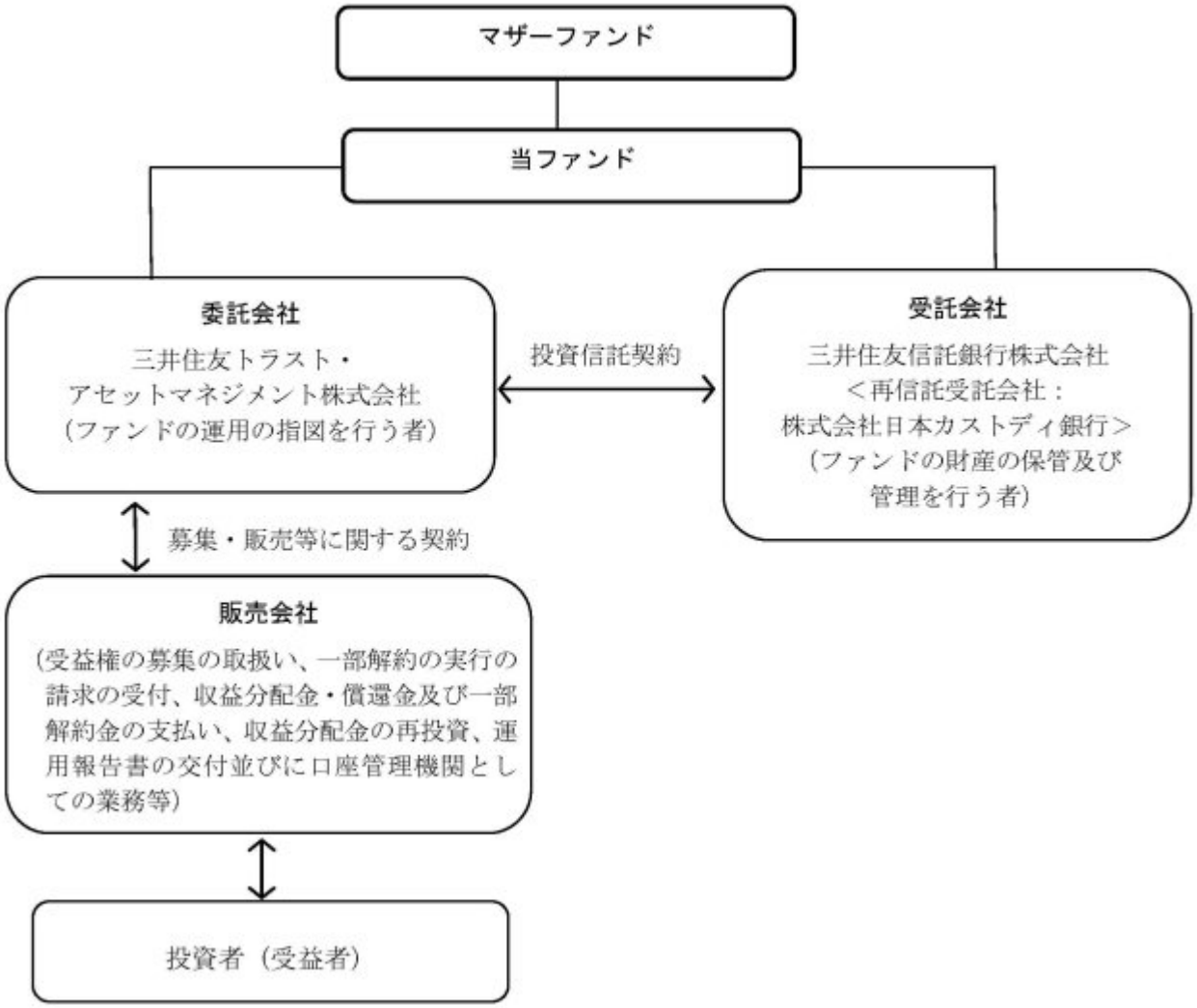
（2）【ファンドの沿革】

2008年1月9日　　本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

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

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2022年 5月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
1987年2月20日：	投資顧問業の登録
1987年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
1990年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
1999年2月15日：	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
1999年3月25日：	証券投資信託委託業の認可

2007年9月30日：　金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）

2012年4月1日：　中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

2018年10月1日：　三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ．大株主の状況

株　主　名	住　　所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

（イ）基本方針

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

（ロ）運用方法

①投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、主要投資対象の見直しおよび追加が行われる場合があります。

②投資態度

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

2)各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。

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

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

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

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

ん。

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

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

（２）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1.国内債券インデックス マザーファンド

2.国内株式インデックス マザーファンド

3.外国債券インデックス マザーファンド

4.外国株式インデックス マザーファンド

5.J-REITインデックス マザーファンド

6.グローバルREITインデックス マザーファンド

7.コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

9.国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

10.外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、第9号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

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

1.預金

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

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

(参考)マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

３．運用制限

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

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場している株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

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

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券また

はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

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

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

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

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

３．運用制限

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

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

ることとなる投資の指図をしません。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1．基本方針

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

2．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

を行うこととします。

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

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

３．運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

④外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

３．運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

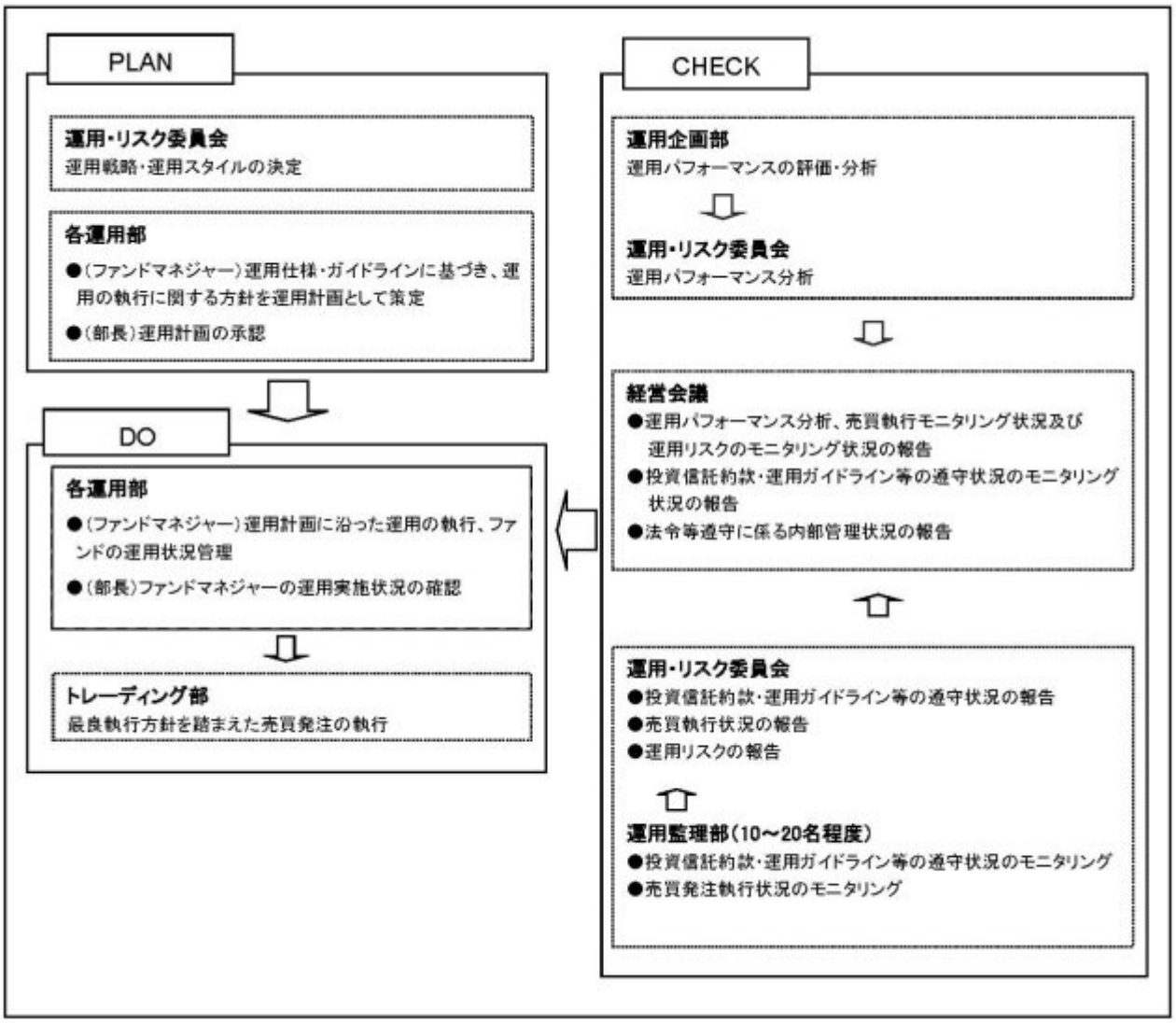
③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（4）【分配方針】

- **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＞

①株式への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

②外貨建資産への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

④外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑤委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第19条）

⑥委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、また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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第26条）

⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

＜その他の投資制限＞

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

投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3【投資リスク】

（イ）ファンドのリスク

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

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

②リートの価格変動リスク
リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

③為替変動リスク
為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

④金利変動リスク
債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

⑤信用リスク
有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

⑦カントリーリスク
投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われ

ると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

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

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

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

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

⑤確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

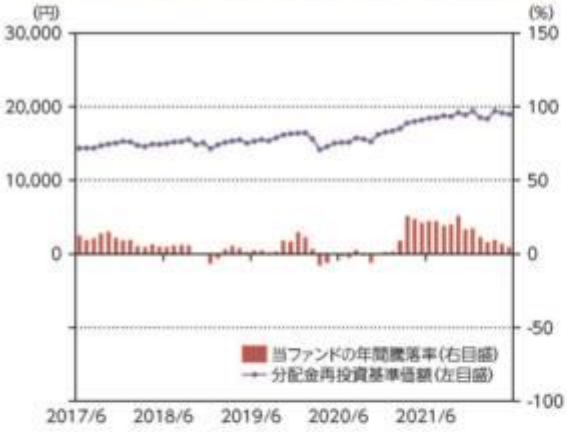
（ロ）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

＊2017年6月～2022年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.15%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（※）として当該基準価額から控除します。

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.748%（税抜　0.68%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ケ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（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

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

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

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。
ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。
販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

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

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

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

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

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

⑤確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

※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、2022年 5月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2022年5月31日現在の状況について記載してあります。

【ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）】

（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	35,893,214,969	98.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	541,488,052	1.49
合計(純資産総額)		36,434,703,021	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、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	1,890,423,151	4.2295	7,995,731,601	4.2448	8,024,468,191	22.02
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	3,987,575,452	1.9530	7,788,126,137	1.8888	7,531,732,513	20.67
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	2,173,427,423	3.1257	6,793,695,031	3.0959	6,728,713,958	18.47
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	4,042,778,448	1.4096	5,699,100,693	1.3825	5,589,141,204	15.34
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	1,676,137,226	2.4690	4,138,386,885	2.5788	4,322,422,678	11.86
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	1,696,840,368	2.1865	3,710,310,371	2.1786	3,696,736,425	10.15

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.51
合計	98.51

(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5期計算期間末 (2012年11月12日)	4,476,232,662	4,476,232,662	7,995	7,995
第6期計算期間末 (2013年11月11日)	7,540,466,177	7,554,112,856	11,051	11,071
第7期計算期間末 (2014年11月10日)	12,528,899,676	12,548,085,801	13,060	13,080
第8期計算期間末 (2015年11月10日)	20,717,882,420	20,717,882,420	13,952	13,952
第9期計算期間末 (2016年11月10日)	23,607,510,913	23,607,510,913	12,934	12,934
第10期計算期間末 (2017年11月10日)	27,121,536,141	27,121,536,141	14,990	14,990
第11期計算期間末 (2018年11月12日)	28,791,451,233	28,791,451,233	15,040	15,040
第12期計算期間末 (2019年11月11日)	31,489,407,387	31,489,407,387	16,058	16,058
第13期計算期間末 (2020年11月10日)	30,935,776,510	30,935,776,510	15,922	15,922
第14期計算期間末 (2021年11月10日)	36,212,394,728	36,212,394,728	19,104	19,104
2021年 5月末日	34,080,858,691	—	18,107	—
6月末日	34,663,733,433	—	18,371	—
7月末日	34,856,381,745	—	18,435	—
8月末日	35,420,757,761	—	18,679	—
9月末日	35,268,109,695	—	18,598	—
10月末日	36,240,996,890	—	19,091	—
11月末日	35,691,653,390	—	18,799	—
12月末日	36,691,849,774	—	19,315	—
2022年 1月末日	35,116,258,721	—	18,457	—
2月末日	34,849,650,597	—	18,275	—
3月末日	36,936,700,967	—	19,345	—
4月末日	36,558,457,181	—	19,068	—
5月末日	36,434,703,021	—	18,896	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第5期計算期間	2011年11月11日～2012年11月12日	0
第6期計算期間	2012年11月13日～2013年11月11日	20
第7期計算期間	2013年11月12日～2014年11月10日	20
第8期計算期間	2014年11月11日～2015年11月10日	0
第9期計算期間	2015年11月11日～2016年11月10日	0
第10期計算期間	2016年11月11日～2017年11月10日	0
第11期計算期間	2017年11月11日～2018年11月12日	0

第12期計算期間	2018年11月13日～2019年11月11日	0
第13期計算期間	2019年11月12日～2020年11月10日	0
第14期計算期間	2020年11月11日～2021年11月10日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第5期計算期間	2011年11月11日～2012年11月12日	9.7
第6期計算期間	2012年11月13日～2013年11月11日	38.5
第7期計算期間	2013年11月12日～2014年11月10日	18.4
第8期計算期間	2014年11月11日～2015年11月10日	6.8
第9期計算期間	2015年11月11日～2016年11月10日	△7.3
第10期計算期間	2016年11月11日～2017年11月10日	15.9
第11期計算期間	2017年11月11日～2018年11月12日	0.3
第12期計算期間	2018年11月13日～2019年11月11日	6.8
第13期計算期間	2019年11月12日～2020年11月10日	△0.8
第14期計算期間	2020年11月11日～2021年11月10日	20.0
第15期中間計算期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	△3.1

(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5期計算期間	2011年11月11日～2012年11月12日	1,886,342,012	715,055,600	5,598,521,881
第6期計算期間	2012年11月13日～2013年11月11日	2,961,482,673	1,736,664,711	6,823,339,843
第7期計算期間	2013年11月12日～2014年11月10日	4,666,930,535	1,897,207,667	9,593,062,711
第8期計算期間	2014年11月11日～2015年11月10日	7,846,529,569	2,590,666,593	14,848,925,687
第9期計算期間	2015年11月11日～2016年11月10日	5,479,073,321	2,075,827,603	18,252,171,405
第10期計算期間	2016年11月11日～2017年11月10日	4,118,820,314	4,278,001,562	18,092,990,157
第11期計算期間	2017年11月11日～2018年11月12日	3,341,067,362	2,290,283,079	19,143,774,440
第12期計算期間	2018年11月13日～2019年11月11日	3,005,808,834	2,540,093,265	19,609,490,009
第13期計算期間	2019年11月12日～2020年11月10日	2,721,021,122	2,900,335,059	19,430,176,072
第14期計算期間	2020年11月11日～2021年11月10日	2,155,351,244	2,630,620,467	18,954,906,849
第15期中間計算期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	1,009,114,434	765,875,040	19,198,146,243

(注)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	524,142,688,300	83.82
地方債証券	日本	33,482,118,855	5.35
特殊債券	日本	36,454,342,440	5.83
社債券	日本	27,615,165,120	4.42
	フランス	1,297,775,000	0.21
	オーストラリア	400,192,000	0.06
	スペイン	399,096,000	0.06
	小計	29,712,228,120	4.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,551,489,523	0.25
合計(純資産総額)		625,342,867,238	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１５０回利付国債（５年）	7,880,000,000	100.06	7,885,118,400	100.06	7,885,358,400	0.005	2026/12/20	1.26
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	7,750,000,000	100.36	7,778,597,500	100.38	7,779,450,000	0.100	2024/9/20	1.24
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	6,950,000,000	100.12	6,958,409,500	100.12	6,958,409,500	0.005	2026/6/20	1.11
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	6,890,000,000	100.28	6,909,292,000	100.27	6,909,223,100	0.100	2023/12/20	1.10
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	100.24	6,776,359,200	100.24	6,776,291,600	0.100	2023/9/20	1.08
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	6,770,000,000	98.87	6,693,905,200	98.83	6,690,791,000	0.100	2031/12/20	1.07
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	6,630,000,000	100.34	6,653,006,100	100.28	6,649,160,700	0.100	2028/3/20	1.06
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	6,310,000,000	100.45	6,338,899,800	100.45	6,338,899,800	0.100	2025/6/20	1.01
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	5,900,000,000	100.51	5,930,503,000	100.51	5,930,444,000	0.100	2026/9/20	0.95
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	100.48	5,777,600,000	0.100	2027/3/20	0.92
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	100.47	5,777,542,500	0.100	2025/9/20	0.92
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	5,590,000,000	100.30	5,607,105,400	100.31	5,607,608,500	0.100	2024/3/20	0.90
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	5,415,000,000	100.12	5,421,629,500	100.03	5,416,732,800	0.100	2028/12/20	0.87

日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	5,340,000,000	101.21	5,404,614,000	101.20	5,404,560,600	0.300	2025/12/20	0.86
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	5,460,000,000	99.11	5,411,406,000	98.97	5,404,198,800	0.100	2031/6/20	0.86
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	5,130,000,000	100.10	5,135,489,100	100.10	5,135,489,100	0.005	2026/9/20	0.82
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	5,110,000,000	98.99	5,058,644,500	98.90	5,054,045,500	0.100	2031/9/20	0.81
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	5,000,000,000	100.41	5,020,800,000	100.36	5,018,000,000	0.100	2027/12/20	0.80
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	4,940,000,000	100.27	4,953,387,400	100.21	4,950,374,000	0.100	2028/6/20	0.79
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	4,910,000,000	100.43	4,931,358,500	100.43	4,931,309,400	0.100	2025/3/20	0.79
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	4,830,000,000	101.47	4,901,145,900	101.47	4,901,097,600	0.400	2025/9/20	0.78
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	4,890,000,000	99.46	4,863,936,300	99.30	4,855,965,600	0.100	2030/9/20	0.78
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	101.05	4,850,832,000	101.05	4,850,736,000	0.600	2023/12/20	0.78
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	4,750,000,000	101.37	4,815,360,000	101.37	4,815,312,500	0.400	2025/6/20	0.77
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	4,790,000,000	100.06	4,793,209,300	99.93	4,786,742,800	0.100	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	4,760,000,000	100.49	4,783,514,400	100.49	4,783,514,400	0.100	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	4,660,000,000	100.33	4,675,797,400	100.34	4,676,263,400	0.100	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	101.27	4,618,231,200	101.27	4,618,140,000	0.400	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	4,510,000,000	100.18	4,518,478,800	100.12	4,515,637,500	0.100	2028/9/20	0.72
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	4,370,000,000	100.40	4,387,873,300	100.42	4,388,441,400	0.100	2024/12/20	0.70

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.82
地方債証券	5.35
特殊債券	5.83
社債券	4.75
合計	99.75

(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	488,121,622,150	98.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	7,568,821,799	1.53
合計(純資産総額)		495,690,443,949	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	7,597,820,000	1.53

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,187,700	2,126.48	19,537,486,850	2,122.50	19,500,893,250	3.93
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,217,300	11,995.51	14,602,137,500	12,115.00	14,747,589,500	2.98
日本	株式	キーエンス	電気機器	176,100	51,639.77	9,093,764,000	51,590.00	9,084,999,000	1.83
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,486,300	738.26	8,479,913,030	729.70	8,381,553,110	1.69
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,089,800	3,988.66	8,335,518,000	3,911.00	8,173,207,800	1.65
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	123,300	59,746.87	7,366,790,000	58,980.00	7,272,234,000	1.47
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,364,400	4,694.17	6,404,725,600	4,734.00	6,459,069,600	1.30
日本	株式	任天堂	その他製品	109,700	58,325.85	6,398,346,000	57,420.00	6,298,974,000	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	934,700	6,779.76	6,337,046,000	6,725.00	6,285,857,500	1.27
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,390,200	4,549.72	6,325,032,400	4,486.00	6,236,437,200	1.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,143,500	5,358.08	6,126,975,900	5,379.00	6,150,886,500	1.24

日本	株式	三菱商事	卸売業	1,314,800	4,498.71	5,914,915,600	4,433.00	5,828,508,400	1.18
日本	株式	信越化学工業	化学	310,100	18,250.38	5,659,444,000	18,335.00	5,685,683,500	1.15
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,527,400	3,743.82	5,718,319,100	3,703.00	5,655,962,200	1.14
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	375,200	14,024.08	5,261,836,000	13,810.00	5,181,512,000	1.05
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,271,500	3,980.74	5,061,517,000	3,922.00	4,986,823,000	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	1,448,900	3,463.80	5,018,710,600	3,419.00	4,953,789,100	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,457,200	3,184.01	4,639,743,400	3,187.00	4,644,096,400	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	224,000	20,640.18	4,623,400,500	20,685.00	4,633,440,000	0.93
日本	株式	三井物産	卸売業	1,420,300	3,188.18	4,528,184,800	3,232.00	4,590,409,600	0.93
日本	株式	村田製作所	電気機器	543,800	8,247.22	4,484,840,500	8,300.00	4,513,540,000	0.91
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,211,300	3,720.88	4,507,112,100	3,695.00	4,475,753,500	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,888,300	1,491.45	4,307,758,000	1,480.00	4,274,684,000	0.86
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	560,700	7,366.42	4,130,356,200	7,466.00	4,186,186,200	0.84
日本	株式	日本電産	電気機器	455,900	8,642.16	3,939,961,800	8,679.00	3,956,756,100	0.80
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	204,800	19,703.02	4,035,180,000	19,200.00	3,932,160,000	0.79
日本	株式	ＳＭＣ	機械	56,900	66,420.66	3,779,336,000	66,610.00	3,790,109,000	0.76
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	677,500	5,410.99	3,665,949,600	5,410.00	3,665,275,000	0.74
日本	株式	ファナック	電気機器	170,500	21,314.13	3,634,060,500	21,105.00	3,598,402,500	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,349,200	1,530.94	3,596,504,000	1,519.00	3,568,434,800	0.72

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別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	0.36
		建設業	2.09
		食料品	3.17
		繊維製品	0.43
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.29
		医薬品	5.10
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.71
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.59
		機械	5.32
		電気機器	18.04

		輸送用機器	7.85
		精密機器	2.69
		その他製品	2.38
		電気・ガス業	1.22
		陸運業	2.90
		海運業	0.68
		空運業	0.42
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.82
		卸売業	5.63
		小売業	4.03
		銀行業	5.09
		証券、商品先物取引業	0.73
		保険業	2.23
		その他金融業	1.14
		不動産業	1.95
		サービス業	5.32
		小計	98.47
合計			98.47

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	398	円	7,655,400,550	7,597,820,000	1.53

(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	148,955,462,724	48.24
	フランス	27,610,535,955	8.94

	イタリア	24,931,955,193	8.07
	ドイツ	20,410,293,100	6.61
	スペイン	16,401,625,977	5.31
	イギリス	15,804,755,785	5.12
	カナダ	6,224,089,321	2.02
	ベルギー	6,191,111,323	2.01
	オランダ	5,292,381,711	1.71
	中国	5,177,743,927	1.68
	オーストラリア	4,663,083,309	1.51
	オーストリア	3,902,508,484	1.26
	メキシコ	2,328,239,086	0.75
	アイルランド	2,094,148,915	0.68
	フィンランド	1,621,033,409	0.52
	マレーシア	1,486,076,262	0.48
	シンガポール	1,314,110,644	0.43
	ポーランド	1,292,132,346	0.42
	イスラエル	1,224,295,000	0.40
	デンマーク	1,195,397,207	0.39
	スウェーデン	827,013,945	0.27
	ノルウェー	761,328,212	0.25
	小計	299,709,321,835	97.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	9,071,992,648	2.94
合計(純資産総額)		308,781,314,483	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	2,874,664,534	0.93
	買建	ドイツ	2,907,210,583	0.94

(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	—	6,031,624,100	1.95

(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 1.375% 11/15/31	18,030,000	11,365.61	2,049,220,607	11,365.61	2,049,220,607	1.375	2031/11/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	16,120,000	11,277.47	1,817,928,462	11,277.47	1,817,928,462	1.250	2031/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	12,699.80	1,694,153,526	12,699.80	1,694,153,526	2.625	2029/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	11,682.63	1,693,982,142	11,682.63	1,693,982,142	1.250	2028/9/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	11,238.40	1,691,380,375	11,238.40	1,691,380,375	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	12,345.22	1,604,878,700	12,345.22	1,604,878,700	0.250	2024/3/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	15,150,000	10,283.84	1,558,002,420	10,283.84	1,558,002,420	2.000	2051/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,900.85	1,537,020,552	10,900.85	1,537,020,552	0.625	2030/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	12,000,000	12,497.97	1,499,756,512	12,497.97	1,499,756,512	0.250	2023/9/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/41	14,500,000	10,163.64	1,473,728,885	10,163.64	1,473,728,885	1.750	2041/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	11,803.83	1,396,393,551	11,803.83	1,396,393,551	0.750	2026/8/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	12,456.90	1,370,259,396	12,456.90	1,370,259,396	0.250	2023/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	11,810.84	1,358,247,228	11,810.84	1,358,247,228	0.500	2026/2/28	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	12,264.08	1,331,879,936	12,264.08	1,331,879,936	0.750	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	11,904.99	1,309,549,965	11,904.99	1,309,549,965	0.750	2026/3/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	11,695.15	1,304,009,886	11,695.15	1,304,009,886	1.625	2031/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	10,841.75	1,295,590,096	10,841.75	1,295,590,096	0.625	2030/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	12,717.33	1,290,809,010	12,717.33	1,290,809,010	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,416.33	1,268,949,661	12,416.33	1,268,949,661	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	12,374.51	1,237,451,868	12,374.51	1,237,451,868	0.125	2024/1/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,039.08	1,230,857,575	11,039.08	1,230,857,575	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,286.37	1,228,637,430	12,286.37	1,228,637,430	0.250	2024/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	11,605.50	1,184,922,475	11,605.50	1,184,922,475	1.125	2028/8/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	11,399.67	1,139,967,202	11,399.67	1,139,967,202	0.625	2027/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,540.03	1,122,333,565	12,540.03	1,122,333,565	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	11,722.20	1,113,609,028	11,722.20	1,113,609,028	1.250	2028/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,263.58	1,104,949,190	12,263.58	1,104,949,190	0.375	2024/7/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,256.07	1,103,046,722	12,256.07	1,103,046,722	0.250	2024/6/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,072.41	1,098,082,596	13,072.41	1,098,082,596	3.125	2028/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000	15,156.90	1,088,265,868	15,064.74	1,081,648,677	2.500	2030/5/25	0.35

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	97.06
合計	97.06

(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	74	アメリカドル	8,385,702.94	1,075,130,974	8,385,702.94	1,075,130,974	0.35
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	57	アメリカドル	6,848,015.91	877,984,120	6,848,015.91	877,984,120	0.28
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	51	アメリカドル	7,187,812.5	921,549,440	7,187,812.5	921,549,440	0.30
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	33	ユーロ	3,642,210	501,750,849	3,637,095	501,046,207	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	45	ユーロ	5,736,150	790,212,024	5,712,300	786,926,448	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	77	ユーロ	11,837,980	1,630,800,125	11,754,050	1,619,237,928	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	25,220,000.00	3,201,620,994	3,231,564,700	1.05
	カナダドル	買建	2,380,000.00	237,530,902	240,463,300	0.08
	ユーロ	買建	16,020,000.00	2,183,779,116	2,207,155,500	0.71
	イギリスポンド	買建	2,180,000.00	349,481,468	352,440,600	0.11

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

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

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	348,121,484,761	65.59
	イギリス	22,843,709,803	4.30
	カナダ	20,291,739,526	3.82
	スイス	17,049,300,985	3.21
	フランス	15,874,926,271	2.99
	ドイツ	12,380,090,299	2.33
	オーストラリア	11,238,167,505	2.12
	オランダ	9,329,916,957	1.76
	アイルランド	9,220,640,830	1.74
	スウェーデン	4,983,326,741	0.94
	デンマーク	4,118,759,914	0.78
	スペイン	3,850,918,362	0.73
	香港	3,287,313,744	0.62
	イタリア	2,732,540,697	0.51
	フィンランド	1,843,519,150	0.35
	ジャージー	1,680,973,256	0.32
	シンガポール	1,643,432,894	0.31
	ベルギー	1,252,888,477	0.24
	ノルウェー	1,142,224,264	0.22
	ケイマン	1,064,651,325	0.20
	イスラエル	1,032,900,088	0.19
	バミューダ	787,796,876	0.15
	キュラソー	662,146,245	0.12
	ルクセンブルク	497,130,811	0.09
	ニュージーランド	406,173,712	0.08
	オーストリア	321,539,506	0.06
	ポルトガル	260,437,152	0.05
	リベリア	125,090,873	0.02
	マン島	117,291,254	0.02
	パナマ	111,230,501	0.02
	小計	498,272,262,779	93.88
投資信託受益証券	オーストラリア	152,350,981	0.03
	香港	63,839,440	0.01
	小計	216,190,421	0.04
投資証券	アメリカ	10,446,378,238	1.97
	オーストラリア	715,193,428	0.13
	イギリス	296,091,110	0.06
	フランス	241,434,366	0.05
	シンガポール	225,744,219	0.04
	香港	198,518,094	0.04
	カナダ	59,846,051	0.01

小計		12,183,205,506	2.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	20,089,536,182	3.79
合計(純資産総額)		530,761,194,888	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	14,519,037,279	2.74
	買建	カナダ	1,353,935,244	0.26
	買建	ドイツ	3,130,130,947	0.59
	買建	イギリス	368,400,312	0.07
	買建	オーストラリア	620,467,106	0.12

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	2,168,337,545	0.41

(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	1,284,469	19,185.34	24,642,980,136	19,185.34	24,642,980,136	4.64
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	558,777	35,032.10	19,575,131,965	35,032.10	19,575,131,965	3.69
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,733	295,258.65	10,550,477,530	295,258.65	10,550,477,530	1.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	23,507	288,001.96	6,770,062,292	288,001.96	6,770,062,292	1.28

アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,795	97,392.16	6,505,309,481	97,392.16	6,505,309,481	1.23
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	22,377	289,239.19	6,472,305,484	289,239.19	6,472,305,484	1.22
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,563	65,016.57	4,782,814,167	65,016.57	4,782,814,167	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	205,370	23,217.54	4,768,188,018	23,217.54	4,768,188,018	0.90
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	196,119	24,117.58	4,729,916,280	24,117.58	4,729,916,280	0.89
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	185,146	25,017.61	4,631,911,773	25,017.61	4,631,911,773	0.87
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	101,985	40,913.09	4,172,521,800	40,913.09	4,172,521,800	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	330,112	12,512.01	4,130,365,933	12,512.01	4,130,365,933	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	231,226	16,830.12	3,891,562,876	16,830.12	3,891,562,876	0.73
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	189,391	19,067.39	3,611,192,287	19,067.39	3,611,192,287	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	130,637	27,293.34	3,565,520,685	27,293.34	3,565,520,685	0.67
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	150,711	22,857.27	3,444,843,345	22,857.27	3,444,843,345	0.65
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	219,354	15,557.60	3,412,622,009	15,608.31	3,423,745,670	0.65
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	81,549	39,547.65	3,225,071,848	39,547.65	3,225,071,848	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	68,686	45,870.97	3,150,693,706	45,870.97	3,150,693,706	0.59
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	437,000	6,911.80	3,020,457,081	6,911.80	3,020,457,081	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	576,261	4,746.33	2,735,127,292	4,746.33	2,735,127,292	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	319,753	8,292.62	2,651,591,018	8,292.62	2,651,591,018	0.50
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	137,691	19,231.50	2,648,004,467	19,231.50	2,648,004,467	0.50
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	63,296	41,473.37	2,625,098,478	41,473.37	2,625,098,478	0.49
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,248	74,569.48	2,404,716,849	76,608.33	2,470,465,619	0.47
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	32,460	74,782.32	2,427,434,393	74,782.32	2,427,434,393	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	54,689	44,011.80	2,406,961,877	44,131.91	2,413,530,299	0.45
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	107,665	22,022.63	2,371,066,642	22,022.63	2,371,066,642	0.45
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	197,066	11,933.78	2,351,743,630	11,933.78	2,351,743,630	0.44

イギリス	株式	SHELL PLC-NEW	エネルギー	598,230	3,849.88	2,303,118,498	3,840.18	2,297,312,317	0.43

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	5.30
		素材	4.42
		資本財	5.85
		商業・専門サービス	1.13
		運輸	1.87
		自動車・自動車部品	2.04
		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	1.71
		メディア・娯楽	5.52
		小売	4.40
		食品・生活必需品小売り	1.43
		食品・飲料・タバコ	4.07
		家庭用品・パーソナル用品	1.65
		ヘルスケア機器・サービス	4.70
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.55
		銀行	5.88
		各種金融	4.57
		保険	3.08
		不動産	0.43
		ソフトウェア・サービス	10.36
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.07
		電気通信サービス	1.57
		公益事業	3.14
		半導体・半導体製造装置	4.56
		小計	93.88
投資信託受益証券	—	—	0.04
投資証券	—	—	2.30
合計			96.21

(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	545	アメリカドル	113,244,187.5	14,519,037,279	113,244,187.5	14,519,037,279	2.74
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	53	カナダドル	13,297,357	1,344,362,793	13,392,040	1,353,935,244	0.26
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	81	スイスフラン	9,434,331	1,259,011,471	9,502,110	1,268,056,579	0.24
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	352	ユーロ	13,392,771.5	1,844,988,202	13,516,800	1,862,074,368	0.35
	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	6,650,121	611,478,626	6,747,875	620,467,106	0.12
	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	30	イギリスポンド	2,274,677.5	367,951,832	2,277,450	368,400,312	0.07

(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	12,335,000.00	1,567,655,665	1,581,404,575	0.30
	カナダドル	買建	700,000.00	69,903,120	70,766,990	0.01
	ユーロ	買建	1,010,000.00	137,656,132	139,138,610	0.03
	イギリスポンド	買建	860,000.00	137,927,058	139,108,440	0.03
	スイスフラン	買建	500,000.00	66,296,600	66,725,650	0.01
	デンマーククローネ	買建	1,300,000.00	23,816,780	24,076,000	0.00
	オーストラリアドル	買建	1,600,000.00	145,626,880	147,117,280	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。

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	113,599,942,400	96.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	4,156,341,183	3.53
合計(純資産総額)		117,756,283,583	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	4,148,408,000	3.52

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	11,925	705,226.36	8,409,824,422	700,000	8,347,500,000	7.09
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,229	674,423.8	6,898,681,063	639,000	6,536,331,000	5.55
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,735	369,595.04	6,185,173,132	343,000	5,740,105,000	4.87
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	51,610	101,017.7	5,213,523,874	108,900	5,620,329,000	4.77
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	33,078	165,589.48	5,477,368,871	167,800	5,550,488,400	4.71
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	33,129	183,645.41	6,083,988,985	165,700	5,489,475,300	4.66
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,359	324,964.33	4,991,127,177	318,500	4,891,841,500	4.15
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	20,381	180,318.95	3,675,080,614	186,200	3,794,942,200	3.22
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,227	358,678.77	3,668,207,878	360,500	3,686,833,500	3.13
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	23,027	141,747.48	3,264,019,297	143,800	3,311,282,600	2.81
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,989	409,957.39	2,865,192,244	410,500	2,868,984,500	2.44
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,521	204,848.12	2,974,599,627	190,400	2,764,798,400	2.35
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	31,049	84,525.56	2,624,434,285	79,500	2,468,395,500	2.10
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,532	633,124.91	2,236,197,201	670,000	2,366,440,000	2.01
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,522	189,183.19	2,368,951,907	183,100	2,292,778,200	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	4,029	584,054.1	2,353,153,982	556,000	2,240,124,000	1.90
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,452	448,823.55	2,446,986,035	410,500	2,238,046,000	1.90
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,897	328,385.43	2,264,874,352	324,000	2,234,628,000	1.90
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,164	706,513.95	2,235,410,152	662,000	2,094,568,000	1.78
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	31,337	65,965.22	2,067,152,389	66,800	2,093,311,600	1.78
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	45,021	42,945.8	1,933,462,992	42,800	1,926,898,800	1.64
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,586	507,315.77	1,819,234,356	531,000	1,904,166,000	1.62
日本	投資証券	イオンリート投資法人	12,029	153,847.12	1,850,627,032	154,100	1,853,668,900	1.57
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,028	154,277.03	1,855,644,206	152,200	1,830,661,600	1.55

日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	13,822	112,867.43	1,560,053,641	118,000	1,630,996,000	1.39
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,758	323,247.31	1,538,010,705	339,000	1,612,962,000	1.37
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	7,319	213,656.61	1,563,752,795	214,100	1,566,997,900	1.33
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,543	170,068.46	1,622,963,322	162,100	1,546,920,300	1.31
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,163	728,789.05	1,576,370,736	695,000	1,503,285,000	1.28
日本	投資証券	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	9,805	152,065.08	1,490,998,191	152,100	1,491,340,500	1.27

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	96.47
合計	96.47

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	2,068	円	3,911,208,400	4,148,408,000	3.52

(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。

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	76,405,011,240	75.94
	オーストラリア	6,684,184,831	6.64
	イギリス	5,205,518,908	5.17
	シンガポール	3,623,624,749	3.60
	カナダ	1,915,482,272	1.90
	フランス	1,799,791,644	1.79

	香港	1,485,243,864	1.48
	ベルギー	1,282,350,341	1.27
	スペイン	433,840,134	0.43
	ニュージーランド	343,870,872	0.34
	ガーンジー	288,893,705	0.29
	韓国	246,350,126	0.24
	オランダ	206,944,808	0.21
	アイルランド	121,987,403	0.12
	イスラエル	78,046,525	0.08
	ドイツ	58,310,226	0.06
	イタリア	34,956,008	0.03
	小計	100,214,407,656	99.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	395,752,052	0.39
合計(純資産総額)		100,610,159,708	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	—	112,370,670	0.11

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	392,499	19,030.34	7,469,389,759	16,316.00	6,404,015,489	6.37
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	47,631	101,405.18	4,830,030,445	88,936.71	4,236,144,567	4.21
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	81,010	42,080.38	3,408,932,229	43,049.07	3,487,405,298	3.47
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	150,799	19,967.30	3,011,049,343	18,142.99	2,735,945,820	2.72
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	231,305	10,967.05	2,536,734,122	11,560.69	2,674,046,719	2.66
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	300,633	8,814.78	2,650,016,015	8,891.36	2,673,037,283	2.66
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	174,670	21,050.26	3,676,849,425	14,581.32	2,546,919,741	2.53
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	74,086	30,731.53	2,276,776,753	27,040.77	2,003,342,568	1.99
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	181,231	10,970.58	1,988,210,777	10,017.04	1,815,399,499	1.80
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	448,821	3,757.03	1,686,236,843	3,957.84	1,776,362,918	1.77

オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	897,829	2,155.27	1,935,071,489	1,873.94	1,682,478,574	1.67
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	77,219	26,300.23	2,030,878,154	21,614.92	1,669,082,809	1.66
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	71,039	25,338.34	1,800,010,405	23,081.64	1,639,697,072	1.63
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	316,727	5,185.21	1,642,298,790	4,941.21	1,565,015,697	1.56
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	211,810	6,791.16	1,438,437,105	7,359.25	1,558,763,590	1.55
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	60,817	26,001.66	1,581,343,055	23,567.56	1,433,308,430	1.42
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	200,836	7,252.21	1,456,505,153	6,848.97	1,375,521,386	1.37
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	61,174	24,641.37	1,507,411,260	21,304.65	1,303,291,008	1.30
香港	投資証券	LINK REIT	1,112,000	1,130.69	1,257,336,688	1,164.32	1,294,733,848	1.29
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	34,415	43,453.91	1,495,466,544	37,012.94	1,273,800,499	1.27
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	637,633	2,130.67	1,358,589,970	1,826.27	1,164,490,274	1.16
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	101,774	9,876.64	1,005,185,961	10,917.08	1,111,075,053	1.10
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	284,704	4,334.36	1,234,011,353	3,856.55	1,097,977,147	1.09
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	75,046	15,100.50	1,133,232,497	14,446.70	1,084,167,258	1.08
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	152,471	6,101.51	930,303,926	7,043.85	1,073,983,982	1.07
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	53,975	20,896.39	1,127,883,098	18,587.88	1,003,281,136	1.00
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	375,710	2,343.67	880,543,562	2,653.94	997,114,427	0.99
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	324,627	2,989.85	970,588,373	3,043.70	988,068,953	0.98
アメリカ	投資証券	UDR INC	157,970	7,079.63	1,118,370,232	6,229.72	984,109,484	0.98
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	90,856	10,776.05	979,068,844	9,915.76	900,906,418	0.90

(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	99.61
合計	99.61

(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	530,000.00	67,316,658	67,948,650	0.07
	イギリスポンド	買建	130,000.00	20,841,496	21,028,020	0.02
	シンガポールドル	買建	250,000.00	23,207,750	23,394,000	0.02

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

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

≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2008年1月９日
作成基準日：2022年5月31日

基準価額・純資産の推移

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

基準価額	18,896円
純資産総額	364.35億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年11月	0円
2018年11月	0円
2019年11月	0円
2020年11月	0円
2021年11月	0円
設定来分配金合計額	40円

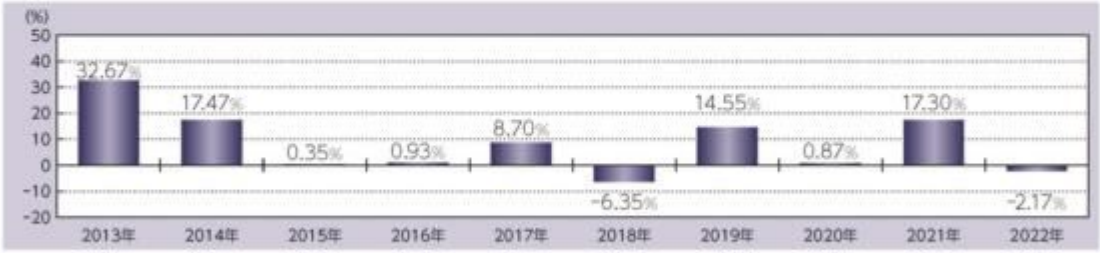
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	22.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	1.0%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
国内株式インデックスマザーファンド	20.7%	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	18.5%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 1.25% 08/15/31	アメリカ	国債	-	1.250%	2031/08/15	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	15.3%	第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	0.2%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.2%
グローバルREITインデックスマザーファンド	11.9%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
		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)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※2022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。
ただし、確定拠出年金によるお申込みは1円以上1円単位とします。

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

＜申込受付の中止等＞

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

＜その他＞

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

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください（ただし、確定拠出年金による一部解約は１口単位）。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

＜一部解約代金の支払い＞

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

＜受付不可日＞

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

＜一部解約受付の中止等＞

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

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投

資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

・株式および不動産投資信託証券

原則として、本ファンドの基準価額計算日（外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日）の当該取引所における最終相場で評価します。

・公社債

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

a.日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）

b.価格情報会社の提供する価額

c.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

・外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2008年 1月 9日設定）

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

とができます。

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

委託会社は、毎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14期計算期間(2020年11月11日から2021年11月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 （2020年11月10日現在）	第14期 （2021年11月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	617,598,911	743,027,419
親投資信託受益証券	30,332,457,536	35,623,017,691
未収入金	124,030,000	30,810,000
流動資産合計	31,074,086,447	36,396,855,110
資産合計	31,074,086,447	36,396,855,110
負債の部		
流動負債		
未払解約金	25,435,983	50,750,154
未払受託者報酬	6,544,964	7,767,014
未払委託者報酬	104,719,388	124,272,149
未払利息	877	1,651
その他未払費用	1,608,725	1,669,414
流動負債合計	138,309,937	184,460,382
負債合計	138,309,937	184,460,382
純資産の部		
元本等		
元本	19,430,176,072	18,954,906,849
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,505,600,438	17,257,487,879
（分配準備積立金）	4,957,035,575	9,542,243,407
元本等合計	30,935,776,510	36,212,394,728
純資産合計	30,935,776,510	36,212,394,728
負債純資産合計	31,074,086,447	36,396,855,110

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自　2019年11月12日 至　2020年11月10日	第14期 自　2020年11月11日 至　2021年11月10日
営業収益		
受取利息	2,560	3,825
有価証券売買等損益	△52,771,573	6,271,160,155
営業収益合計	△52,769,013	6,271,163,980
営業費用		
支払利息	292,864	271,229
受託者報酬	13,114,363	14,773,631
委託者報酬	209,829,818	236,377,941
その他費用	1,609,710	1,669,414
営業費用合計	224,846,755	253,092,215
営業利益又は営業損失（△）	△277,615,768	6,018,071,765
経常利益又は経常損失（△）	△277,615,768	6,018,071,765
当期純利益又は当期純損失（△）	△277,615,768	6,018,071,765
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（△）	△191,028,950	354,391,895
期首剰余金又は期首欠損金（△）	11,879,917,378	11,505,600,438
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,454,373,345	1,655,110,310
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,454,373,345	1,655,110,310
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,742,103,467	1,566,902,739
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,742,103,467	1,566,902,739
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,505,600,438	17,257,487,879

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第13期 (2020年11月10日現在)	第14期 (2021年11月10日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	19,430,176,072口	18,954,906,849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 1.5922円 (1万口当たり純資産額) (15,922円)	1口当たり純資産額 1.9104円 (1万口当たり純資産額) (19,104円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第13期 自 2019年11月12日 至 2020年11月10日	第14期 自 2020年11月11日 至 2021年11月10日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	419,456,388円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	9,436,436,347円
分配準備積立金額	D	4,537,579,187円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,393,471,922円
当ファンドの期末残存口数	F	19,430,176,072口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,407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

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	621,772,427円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	4,601,409,048円
収益調整金額	C	9,729,121,265円
分配準備積立金額	D	4,319,061,932円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,271,364,672円
当ファンドの期末残存口数	F	18,954,906,849口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	10,166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14期 自 2020年11月11日 至 2021年11月10日
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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14期 (2021年11月10日現在)
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第13期 自 2019年11月12日 至 2020年11月10日	第14期 自 2020年11月11日 至 2021年11月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	19,609,490,009円	19,430,176,072円
期中追加設定元本額	2,721,021,122円	2,155,351,244円
期中一部解約元本額	2,900,335,059円	2,630,620,467円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 (2020年11月10日現在)	第14期 (2021年11月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	△17,809,423	6,050,192,458
合計	△17,809,423	6,050,192,458

（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	1,657,099,646	3,628,219,674	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	1,688,304,507	4,169,943,301	
	国内株式インデックス　マザーファンド	3,898,361,583	7,624,025,747	
	外国株式インデックス　マザーファンド	1,931,661,003	8,175,368,862	
	国内債券インデックス　マザーファンド	3,845,211,962	5,427,516,684	
	外国債券インデックス　マザーファンド	2,109,249,520	6,597,943,423	
合計		15,129,888,221	35,623,017,691	

(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11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	335,805,389
国債証券	541,644,438,250
地方債証券	35,257,830,442
特殊債券	40,727,666,151
社債券	29,302,542,560
未収入金	451,491,300
未収利息	1,077,134,618
前払費用	30,520,583
流動資産合計	648,827,429,293
資産合計	648,827,429,293
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	229,448,943
未払利息	746
流動負債合計	429,449,689
負債合計	429,449,689
純資産の部	
元本等	

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
元本	459,359,027,915
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	189,038,951,689
元本等合計	648,397,979,604
純資産合計	648,397,979,604
負債純資産合計	648,827,429,293

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年11月10日現在	
1．	計算期間の末日における受益権の総数	459,359,027,915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　101,246,000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　1.4115円
		(1万口当たり純資産額)　(14,115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11月10日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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11月10日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	421,545,977,936円
期中追加設定元本額	71,425,490,703円
期中一部解約元本額	33,612,440,724円
期末元本額	459,359,027,915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）	3,845,211,962円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	17,032,122円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	20,892,679,816円
世界経済インデックスファンド	3,059,512,291円
ＤＣマイセレクション２５	24,926,805,607円
ＤＣマイセレクション５０	28,306,848,761円
ＤＣマイセレクション７５	8,230,136,134円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	443,638,092円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	93,182,370,103円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	68,740,136,194円
ＤＣマイセレクションＳ２５	11,972,934,092円
ＤＣマイセレクションＳ５０	13,398,274,946円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,821,411,138円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	883,217,507円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	2,059,146,401円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	749,168,846円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,113,620,735円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	8,515,469円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,229,247円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	36,130,719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）	1,065,314円

区分	2021年11月10日現在
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	102,687,358円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	167,870,693円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	34,930,870円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	33,874,240円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,242,737,533円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	787,140,774円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,339,016,534円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	167,336,042円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	82,459,266円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,080,289,727円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,201,928,427円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,513,641,833円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	146,170,033円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	5,819,118,506円
日本債券ファンド・シリーズ１	14,801,412,240円
分散投資コア戦略ファンドＡ	25,782,175,370円
分散投資コア戦略ファンドＳ	32,758,547,405円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	141,331,727円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,283,192,625円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	61,302,700円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	34,957,308円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	57,950,323円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	29,947,689円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	55,964,619円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	91,267,563円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,539,525円
グローバル経済コア	229,462,339円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	25,256,878円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	14,337,053円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	8,263,967円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	3,708,382円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	1,185,839円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	875,887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）	79,394,668,196円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	60,527,480円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,383,436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）	89,248,963円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	2021年11月10日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△581,291,950
地方債証券	△14,335,836
特殊債券	△29,613,545
社債券	34,324,400
合計	△590,916,931

(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４１９回利付国債（２年）	570,000,000	571,293,900	
	第４２０回利付国債（２年）	500,000,000	501,255,000	
	第４２１回利付国債（２年）	590,000,000	591,587,100	
	第４２２回利付国債（２年）	80,000,000	80,228,800	
	第４２３回利付国債（２年）	1,310,000,000	1,312,266,300	
	第４２４回利付国債（２年）	570,000,000	571,043,100	
	第４２５回利付国債（２年）	2,870,000,000	2,875,567,800	
	第４２６回利付国債（２年）	620,000,000	621,264,800	
	第４２７回利付国債（２年）	3,870,000,000	3,878,320,500	
	第４２８回利付国債（２年）	230,000,000	230,519,800	
	第４２９回利付国債（２年）	950,000,000	952,242,000	
	第４３０回利付国債（２年）	100,000,000	100,247,000	
	第１３４回利付国債（５年）	5,700,000,000	5,713,224,000	
	第１３５回利付国債（５年）	4,080,000,000	4,091,872,800	
	第１３６回利付国債（５年）	4,400,000,000	4,415,180,000	
	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	6,787,648,400	
	第１３８回利付国債（５年）	6,800,000,000	6,831,552,000	
	第１３９回利付国債（５年）	5,690,000,000	5,719,531,100	

第１４０回利付国債（５年）	6,300,000,000	6,335,343,000	
第１４１回利付国債（５年）	7,250,000,000	7,295,675,000	
第１４２回利付国債（５年）	5,380,000,000	5,416,906,800	
第１４３回利付国債（５年）	4,800,000,000	4,835,520,000	
第１４４回利付国債（５年）	6,310,000,000	6,359,091,800	
第１４５回利付国債（５年）	7,410,000,000	7,471,725,300	
第１４６回利付国債（５年）	3,150,000,000	3,177,279,000	
第１４７回利付国債（５年）	4,420,000,000	4,441,260,200	
第１４８回利付国債（５年）	7,020,000,000	7,054,047,000	
第１４９回利付国債（５年）	670,000,000	673,269,600	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	574,292,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,571,434,500	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	768,823,000	
第４回利付国債（４０年）	1,200,000,000	1,691,856,000	
第５回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,460,261,100	
第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,696,728,600	
第７回利付国債（４０年）	1,440,000,000	1,866,628,800	
第８回利付国債（４０年）	1,230,000,000	1,493,084,700	
第９回利付国債（４０年）	1,950,000,000	1,780,584,000	
第１０回利付国債（４０年）	2,100,000,000	2,241,246,000	
第１１回利付国債（４０年）	1,790,000,000	1,852,596,300	
第１２回利付国債（４０年）	1,450,000,000	1,358,084,500	
第１３回利付国債（４０年）	2,040,000,000	1,905,115,200	
第１４回利付国債（４０年）	1,060,000,000	1,058,357,000	
第３２６回利付国債（１０年）	3,120,000,000	3,147,986,400	
第３２７回利付国債（１０年）	5,190,000,000	5,242,315,200	
第３２８回利付国債（１０年）	5,940,000,000	5,997,142,800	
第３２９回利付国債（１０年）	4,260,000,000	4,322,323,800	
第３３０回利付国債（１０年）	1,900,000,000	1,932,357,000	
第３３１回利付国債（１０年）	900,000,000	911,970,000	
第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	4,872,960,000	
第３３３回利付国債（１０年）	3,030,000,000	3,081,116,100	
第３３４回利付国債（１０年）	4,860,000,000	4,950,784,800	
第３３５回利付国債（１０年）	2,160,000,000	2,198,383,200	
第３３６回利付国債（１０年）	1,050,000,000	1,070,128,500	
第３３７回利付国債（１０年）	2,800,000,000	2,836,652,000	
第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	4,639,024,800	
第３３９回利付国債（１０年）	4,750,000,000	4,838,540,000	
第３４０回利付国債（１０年）	5,230,000,000	5,335,384,500	
第３４１回利付国債（１０年）	5,340,000,000	5,431,420,800	
第３４２回利付国債（１０年）	5,130,000,000	5,175,964,800	
第３４３回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,695,311,600	

第３４４回利付国債（１０年）	6,640,000,000	6,706,400,000	
第３４５回利付国債（１０年）	3,740,000,000	3,778,372,400	
第３４６回利付国債（１０年）	6,350,000,000	6,418,326,000	
第３４７回利付国債（１０年）	3,880,000,000	3,923,727,600	
第３４８回利付国債（１０年）	5,090,000,000	5,149,960,200	
第３４９回利付国債（１０年）	4,130,000,000	4,180,716,400	
第３５０回利付国債（１０年）	7,830,000,000	7,927,561,800	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）	4,510,000,000	4,567,547,600	
第３５３回利付国債（１０年）	3,450,000,000	3,495,609,000	
第３５４回利付国債（１０年）	5,090,000,000	5,155,813,700	
第３５５回利付国債（１０年）	5,150,000,000	5,214,941,500	
第３５６回利付国債（１０年）	5,040,000,000	5,101,639,200	
第３５７回利付国債（１０年）	2,500,000,000	2,529,475,000	
第３５８回利付国債（１０年）	3,290,000,000	3,327,209,900	
第３５９回利付国債（１０年）	3,230,000,000	3,263,398,200	
第３６０回利付国債（１０年）	5,260,000,000	5,308,918,000	
第３６１回利付国債（１０年）	4,920,000,000	4,960,245,600	
第３６２回利付国債（１０年）	3,950,000,000	3,977,610,500	
第３６３回利付国債（１０年）	5,990,000,000	6,024,382,600	
第３６４回利付国債（１０年）	1,810,000,000	1,817,982,100	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	134,677,400	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	192,419,200	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	143,822,400	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	138,788,100	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	60,300,000	
第６回利付国債（３０年）	350,000,000	431,609,500	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	221,688,000	
第８回利付国債（３０年）	350,000,000	414,911,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	274,120,800	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	177,561,600	
第１１回利付国債（３０年）	260,000,000	306,844,200	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	233,707,600	
第１３回利付国債（３０年）	400,000,000	488,572,000	
第１４回利付国債（３０年）	800,000,000	1,018,312,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	438,304,200	
第１６回利付国債（３０年）	200,000,000	258,796,000	
第１７回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,478,796,500	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	440,371,800	
第１９回利付国債（３０年）	530,000,000	678,315,200	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	629,284,800	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	643,615,000	

第２２回利付国債（３０年）	420,000,000	553,623,000	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	568,331,000	
第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	503,560,800	
第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	454,776,000	
第２６回利付国債（３０年）	1,140,000,000	1,502,394,600	
第２７回利付国債（３０年）	1,920,000,000	2,573,030,400	
第２８回利付国債（３０年）	2,140,000,000	2,880,632,600	
第２９回利付国債（３０年）	1,670,000,000	2,230,936,300	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,346,170,400	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,444,443,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,560,000,000	2,082,802,800	
第３３回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,338,809,200	
第３４回利付国債（３０年）	1,795,000,000	2,379,649,450	
第３５回利付国債（３０年）	2,300,000,000	2,974,245,000	
第３６回利付国債（３０年）	2,210,000,000	2,867,408,700	
第３７回利付国債（３０年）	2,240,000,000	2,873,001,600	
第３８回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,900,050,000	
第３９回利付国債（３０年）	1,120,000,000	1,444,038,400	
第４０回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,828,670,400	
第４１回利付国債（３０年）	1,040,000,000	1,301,383,200	
第４２回利付国債（３０年）	1,400,000,000	1,753,640,000	
第４３回利付国債（３０年）	1,390,000,000	1,742,921,000	
第４４回利付国債（３０年）	1,300,000,000	1,631,708,000	
第４５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,747,324,800	
第４６回利付国債（３０年）	1,850,000,000	2,246,251,500	
第４７回利付国債（３０年）	1,480,000,000	1,831,455,600	
第４８回利付国債（３０年）	1,780,000,000	2,123,718,000	
第４９回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,718,812,800	
第５０回利付国債（３０年）	1,790,000,000	1,892,191,100	
第５１回利付国債（３０年）	1,660,000,000	1,561,595,200	
第５２回利付国債（３０年）	1,740,000,000	1,713,465,000	
第５３回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,268,290,800	
第５４回利付国債（３０年）	1,910,000,000	2,009,530,100	
第５５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,514,001,600	
第５６回利付国債（３０年）	1,680,000,000	1,763,092,800	
第５７回利付国債（３０年）	1,610,000,000	1,688,390,900	
第５８回利付国債（３０年）	2,600,000,000	2,721,420,000	
第５９回利付国債（３０年）	1,000,000,000	1,020,600,000	
第６０回利付国債（３０年）	1,530,000,000	1,634,269,500	
第６１回利付国債（３０年）	1,550,000,000	1,576,939,000	
第６２回利付国債（３０年）	120,000,000	115,819,200	
第６３回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,180,733,400	
第６４回利付国債（３０年）	2,510,000,000	2,348,130,100	

第６５回利付国債（３０年）	1,590,000,000	1,484,932,800	
第６６回利付国債（３０年）	1,030,000,000	961,443,200	
第６７回利付国債（３０年）	1,530,000,000	1,504,280,700	
第６８回利付国債（３０年）	1,640,000,000	1,614,186,400	
第６９回利付国債（３０年）	1,050,000,000	1,061,550,000	
第７０回利付国債（３０年）	1,920,000,000	1,938,873,600	
第７１回利付国債（３０年）	1,430,000,000	1,444,157,000	
第７２回利付国債（３０年）	380,000,000	383,309,800	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	204,010,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	355,855,500	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	243,609,600	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	324,681,600	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	206,142,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	332,000,000	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	229,361,000	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	343,345,200	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	136,164,600	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	200,355,000	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	410,334,600	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	426,288,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	212,098,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	670,005,000	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	383,738,400	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	213,812,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	139,692,800	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	288,314,100	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	310,645,100	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	182,367,500	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	290,619,900	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	237,597,800	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	421,878,600	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	651,366,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	316,439,300	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	510,908,800	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	317,964,700	
第８６回利付国債（２０年）	510,000,000	563,641,800	
第８７回利付国債（２０年）	1,830,000,000	2,014,464,000	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	466,746,000	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	387,334,500	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	700,723,800	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	502,713,000	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	979,369,600	

第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	456,338,200	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	682,224,000	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	692,520,800	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,787,175,900	
第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	454,072,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	496,887,600	
第９９回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,463,917,800	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	550,238,400	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	828,763,650	
第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,467,988,200	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	463,372,000	
第１０４回利付国債（２０年）	160,000,000	183,222,400	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,357,365,800	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	439,739,800	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	300,510,600	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	753,403,200	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	595,717,200	
第１１０回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,276,429,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,137,489,900	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	920,373,700	
第１１３回利付国債（２０年）	2,020,000,000	2,363,521,200	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,736,631,600	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	827,862,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,768,987,600	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,273,168,800	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	774,925,800	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	613,146,400	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,789,234,800	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,753,215,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,090,343,600	
第１２３回利付国債（２０年）	1,870,000,000	2,225,580,500	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	720,446,600	
第１２５回利付国債（２０年）	1,820,000,000	2,190,406,400	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	864,940,500	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,199,020,200	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,143,183,800	
第１２９回利付国債（２０年）	890,000,000	1,040,374,400	
第１３０回利付国債（２０年）	1,285,000,000	1,505,583,100	
第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,161,850,000	
第１３２回利付国債（２０年）	1,160,000,000	1,350,425,600	
第１３３回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,444,266,000	
第１３４回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,330,258,600	
第１３５回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,201,948,200	

第１３６回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,677,171,500	
第１３７回利付国債（２０年）	1,090,000,000	1,275,016,600	
第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	712,206,400	
第１３９回利付国債（２０年）	730,000,000	846,237,900	
第１４０回利付国債（２０年）	2,520,000,000	2,954,649,600	
第１４１回利付国債（２０年）	1,740,000,000	2,044,691,400	
第１４２回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,209,811,800	
第１４３回利付国債（２０年）	1,800,000,000	2,099,556,000	
第１４４回利付国債（２０年）	970,000,000	1,120,553,700	
第１４５回利付国債（２０年）	3,155,000,000	3,723,436,350	
第１４６回利付国債（２０年）	2,810,000,000	3,323,218,400	
第１４７回利付国債（２０年）	2,310,000,000	2,709,884,100	
第１４８回利付国債（２０年）	1,990,000,000	2,314,429,700	
第１４９回利付国債（２０年）	2,880,000,000	3,354,768,000	
第１５０回利付国債（２０年）	2,660,000,000	3,069,719,800	
第１５１回利付国債（２０年）	2,395,000,000	2,707,787,000	
第１５２回利付国債（２０年）	3,290,000,000	3,722,733,700	
第１５３回利付国債（２０年）	2,530,000,000	2,898,595,700	
第１５４回利付国債（２０年）	2,600,000,000	2,946,606,000	
第１５５回利付国債（２０年）	2,860,000,000	3,165,219,200	
第１５６回利付国債（２０年）	2,310,000,000	2,361,282,000	
第１５７回利付国債（２０年）	2,980,000,000	2,956,905,000	
第１５８回利付国債（２０年）	2,530,000,000	2,616,854,900	
第１５９回利付国債（２０年）	2,910,000,000	3,049,359,900	
第１６０回利付国債（２０年）	2,300,000,000	2,443,980,000	
第１６１回利付国債（２０年）	2,190,000,000	2,293,061,400	
第１６２回利付国債（２０年）	1,070,000,000	1,119,434,000	
第１６３回利付国債（２０年）	2,060,000,000	2,153,297,400	
第１６４回利付国債（２０年）	1,660,000,000	1,706,430,200	
第１６５回利付国債（２０年）	2,180,000,000	2,238,336,800	
第１６６回利付国債（２０年）	1,330,000,000	1,407,459,200	
第１６７回利付国債（２０年）	2,340,000,000	2,396,651,400	
第１６８回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,458,279,500	
第１６９回利付国債（２０年）	1,690,000,000	1,667,675,100	
第１７０回利付国債（２０年）	2,360,000,000	2,324,529,200	
第１７１回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,268,211,900	
第１７２回利付国債（２０年）	2,520,000,000	2,517,832,800	
第１７３回利付国債（２０年）	3,080,000,000	3,071,992,000	
第１７４回利付国債（２０年）	2,480,000,000	2,469,162,400	
第１７５回利付国債（２０年）	1,560,000,000	1,579,266,000	
第１７６回利付国債（２０年）	2,810,000,000	2,840,067,000	
第１７７回利付国債（２０年）	2,620,000,000	2,596,393,800	

	第１７８回利付国債（２０年）	920,000,000	928,381,200	
国債証券合計		507,890,000,000	541,644,438,250	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	105,309,000	
	第５回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年））	100,000,000	100,621,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	106,689,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	132,255,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	130,787,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	127,004,000	
	第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	126,312,000	
	第１６回東京都公募公債（２０年）	300,000,000	341,769,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	114,490,000	
	第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	115,806,000	
	第１９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	100,140,000	
	第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	233,060,000	
	第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	232,668,000	
	第３３回東京都公募公債（５年）	200,000,000	200,040,000	
	第７１７回東京都公募公債	100,000,000	100,848,000	
	第７２０回東京都公募公債	100,000,000	101,391,000	
	第７２６回東京都公募公債	200,000,000	203,060,000	
	第７２８回東京都公募公債	100,000,000	101,361,000	
	第７５１回東京都公募公債	100,000,000	101,498,000	
	第７６５回東京都公募公債	100,000,000	101,043,000	
	第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,867,000	
	第７８１回東京都公募公債	300,000,000	302,571,000	
	第８００回東京都公募公債	200,000,000	200,242,000	
	平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,028,000	
	平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,901,000	
	平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,334,000	
	平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,135,000	
	平成３０年度第１４回北海道公募公債	200,000,000	201,988,000	
	第２９回１号宮城県公募公債（１０年）	100,000,000	101,321,000	
	第４回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	270,202,000	
	第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	115,593,000	
	第１５回神奈川県公募公債（２０年）	200,000,000	233,036,000	
	第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	116,175,000	
	第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,290,000	
	第７８回神奈川県公募公債（５年）	200,000,000	200,000,000	
	第２０１回神奈川県公募公債	200,250,000	202,853,250	
	第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	202,774,000	
	第２１５回神奈川県公募公債	100,000,000	101,764,000	
	第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,780,000	
	第２２６回神奈川県公募公債	100,000,000	100,962,000	

第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,867,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	200,160,000	
第６回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	233,028,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	233,230,000	
第１０回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	116,416,000	
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,830,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,485,000	
第３７７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,416,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,543,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	153,221,210	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,970,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,954,000	
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	156,555,360	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,914,000	
第４３９回大阪府公募公債（１０年）	500,000,000	504,895,000	
第４４０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,042,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	116,752,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	116,221,000	
平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	101,477,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	101,976,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	100,024,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	104,104,000	
令和２年度第１２回京都府公募公債	140,500,000	140,879,350	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	113,733,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	101,903,000	
第６回兵庫県公募公債（１５年）	400,000,000	435,160,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	107,631,000	
第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	107,737,000	
第９回兵庫県公募公債（２０年）	400,000,000	469,756,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	101,499,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	102,923,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	302,082,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	120,665,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	103,404,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,422,000	
第１８回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	115,150,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	100,916,000	
平成２６年度第３回静岡県公募公債	100,000,000	101,714,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,923,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	101,035,000	

平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	101,138,000	
平成２９年度第１４回静岡県公募公債（５年）	100,000,000	100,047,000	
令和２年度第１１回静岡県公募公債	310,000,000	313,189,900	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	116,943,000	
平成２５年度第２回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,832,000	
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,629,000	
平成２６年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	203,334,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,579,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,301,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	202,248,000	
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	310,947,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,999,000	
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	102,185,000	
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,410,000	
令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,559,000	
令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年）	200,000,000	200,160,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	115,819,000	
平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年）	200,000,000	232,554,000	
平成２５年度第４回広島県公募公債	100,000,000	101,361,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	127,613,126	
平成２９年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,829,000	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	113,400,000	
第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	114,697,000	
第６回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	230,540,000	
第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	107,322,000	
第７回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	234,062,000	
第８回埼玉県公募公債（１５年）	200,000,000	201,568,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	233,036,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	200,206,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,543,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	101,913,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,390,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,236,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,925,000	

令和２年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	100,303,000	
令和２年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	100,270,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	113,602,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,207,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	106,711,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	117,899,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	107,498,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	131,217,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	112,772,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	101,892,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	102,185,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	103,839,000	
令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	302,052,000	
令和３年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	100,425,000	
令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	99,696,000	
第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	230,540,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	116,424,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	116,422,000	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	101,495,000	
平成２５年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	101,475,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	101,396,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	101,921,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,389,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	121,029,600	
令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	300,369,000	
令和２年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	100,519,000	
令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	300,000,000	302,238,000	
平成３０年度第３回茨城県公募公債	350,000,000	350,154,000	
第１回群馬県公募公債（２０年）	200,000,000	231,130,000	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	101,102,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,594,000	
第１１９回共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,104,000	
第１２１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,822,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,916,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,321,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,335,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,334,000	

第１３１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,499,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,659,000	
第１３４回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,898,400	
第１３５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,714,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,638,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,561,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,040,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,770,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,870,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,945,620	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,983,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,415,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,333,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,600,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,422,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	401,052,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,226,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,858,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,216,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,798,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,722,276	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,159,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,898,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,145,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	234,426,000	
第１５回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	99,738,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	301,305,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	104,622,000	
平成２５年度第８回大阪市公募公債	100,000,000	101,695,000	
令和３年度第２回大阪市公募公債	200,000,000	201,036,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	129,376,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	134,205,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	114,349,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	125,365,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,127,000	
第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	302,052,000	
平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	101,040,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	201,718,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	134,008,800	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	230,672,000	
	100,000,000	117,721,000	

平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）			
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	116,722,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	98,788,000	
令和３年度第６回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	99,958,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	107,813,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	348,627,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,831,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	101,227,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	101,059,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	203,584,000	
第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	228,258,000	
令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	302,046,000	
令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	100,471,000	
平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	107,764,000	
平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,321,000	
第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	115,556,000	
第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,739,000	
第９３回川崎市公募公債	100,000,000	100,167,000	
平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,376,000	
平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,944,000	
平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	100,309,000	
平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	116,349,000	
平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	115,356,000	
平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	203,164,000	
平成３０年度第５回福岡市公募公債（５年）	200,000,000	200,088,000	
平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,801,000	
平成３０年度第１０回福岡市公募公債（５年）	100,000,000	100,031,000	
平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	152,283,000	
平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,408,000	
平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,805,350	
平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	172,135,200	
令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	552,266,000	
令和２年度第３回広島市公募公債（５年）	200,000,000	200,118,000	
令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	200,246,000	
平成２５年度第４回福井県公募公債	100,000,000	101,706,000	
平成２４年度第１回徳島県公募公債	100,000,000	100,923,000	
平成２４年度第２回岡山県公募公債（１０年）	150,000,000	151,398,000	

	平成２４年度第１回岡山市公募公債（１０年）	200,000,000	202,054,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	202,094,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	113,474,000	
地方債証券合計		33,529,680,000	35,257,830,442	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	103,488,180	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	413,759,700	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	310,668,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,356,000	
	第１１９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,961,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	96,363,000	
	第１４回道路債券	100,000,000	102,108,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	101,697,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	128,492,000	
	第２７回道路債券	400,000,000	422,612,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	260,648,000	
	第３３回道路債券	200,000,000	264,540,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,660,000	
	第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	150,122,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,417,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	107,385,000	
	第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,232,000	
	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	142,348,000	
	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	232,458,000	
	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	234,772,000	
	第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,642,000	
	第１０２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	605,334,000	
	第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	908,604,000	
	第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,394,000	
	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	130,853,000	
	第１１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,050,000	

第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,354,000	
第１１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,581,000	
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	118,302,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,187,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,417,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,903,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,212,000	
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	302,541,000	
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	116,274,000	
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	101,039,000	
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	303,240,000	
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	201,840,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	619,608,000	
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	304,455,260	
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	634,047,640	
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	202,934,000	
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	150,276,240	
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	101,408,000	
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	269,425,512	
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	202,934,000	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,858,000	
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	428,967,220	
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	101,524,000	
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	230,126,000	
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	103,670,760	
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	101,681,000	
	100,000,000	101,621,000	

第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	228,742,000	
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	101,587,000	
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	101,426,000	
第２３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,997,000	
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	111,568,000	
第２４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,722,000	
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	202,616,000	
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	100,580,000	
第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,780,000	
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	106,945,430	
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	206,068,050	
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	100,699,000	
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	201,366,000	
第３２１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,834,000	
第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	121,396,800	
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	201,766,000	
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	310,920,000	
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	217,038,800	
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	99,809,000	
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	99,690,000	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	375,678,000	
第３回公営企業債券（２０年）	210,000,000	212,914,800	
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	107,895,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	391,593,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	105,171,000	
第７回公営企業債券（３０年）	200,000,000	262,470,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	42,115,600	
第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	129,272,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	233,440,000	

第１０回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	228,792,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年）	200,000,000	194,264,000	
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	233,252,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	116,055,000	
第３４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	500,000,000	581,075,000	
第４４回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,026,000	
第４４回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,896,000	
第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,055,000	
第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,840,000	
第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,802,000	
第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,937,000	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,495,000	
第５４回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,408,050	
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,972,000	
第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,499,000	
第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,733,000	
第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,668,000	
第６７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,536,000	
第６９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,544,000	
第７６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,836,000	
Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,455,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,507,000	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,043,000	
第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,317,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,356,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,701,780	
Ｆ９５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,296,000	
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,830,000	
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,822,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,273,800	
Ｆ１０７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,620,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,043,600	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,412,000	
第１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,573,000	
第１２０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,778,000	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,014,000	
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,910,000	

Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,586,000	
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,848,000	
第７回阪神高速道路債券	100,000,000	107,178,000	
第２２回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,958,000	
第４回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	116,511,000	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	118,948,000	
第２５回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	202,140,000	
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,054,180	
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,833,000	
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,984,900	
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,479,620	
第８７回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,910,000	
第８８回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,962,000	
第１１７回都市再生債券	200,000,000	212,208,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	171,672,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	94,082,000	
第１７１回都市再生債券	200,000,000	201,872,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	106,801,000	
第３４４回東京交通債券	100,000,000	102,038,000	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,340,400	
第５９回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,989,000	
第６２回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	100,682,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,955,000	11,125,240	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,266,000	11,481,518	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,484,000	11,743,997	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	149,934,000	149,857,533	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	107,458,000	107,482,715	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,302,000	11,534,821	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,278,000	12,605,945	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	193,626,000	193,180,660	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	20,332,000	20,481,440	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,149,000	12,462,930	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	214,152,000	213,447,439	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	76,478,000	76,443,584	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,652,000	10,809,223	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,627,000	13,001,516	
	251,502,000	251,388,824	

第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券			
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,804,000	10,964,223	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	174,042,000	174,076,808	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,754,000	13,155,751	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,538,000	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,790,000	17,755,592	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,032,000	18,066,694	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,944,000	20,224,235	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,782,000	22,078,796	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,030,000	24,617,918	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,429,000	24,999,914	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,856,000	53,073,207	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,102,000	11,256,872	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,458,000	23,720,588	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,267,000	11,467,214	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,878,000	11,067,821	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,191,000	24,487,376	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,114,000	10,189,652	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,877,000	24,191,741	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,627,000	22,806,104	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,212,000	12,603,150	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,846,000	48,074,115	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,250,000	25,472,200	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,889,000	12,203,701	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,688,000	36,561,152	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,150,000	34,910,596	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,457,000	35,266,019	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,986,000	77,862,866	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,388,000	85,127,778	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,781,000	43,661,145	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,092,000	44,340,975	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,258,000	44,570,357	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,894,000	38,749,768	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,371,000	37,932,407	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,929,000	44,256,898	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	177,246,000	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,802,000	115,546,541	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,504,000	155,926,691	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,670,000	44,439,524	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,039,000	45,898,326	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,985,000	46,760,108	

第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,625,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,651,000	147,206,552	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,643,000	50,356,206	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,508,000	105,449,979	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,836,000	58,662,140	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,635,000	62,417,669	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,226,000	62,297,172	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,747,000	193,933,024	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,462,000	130,158,042	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,789,000	62,936,067	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,885,000	68,270,037	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,066,000	72,459,480	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,491,000	78,097,754	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,276,000	77,718,018	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,630,000	78,425,707	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,008,000	79,150,817	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,734,000	79,769,352	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,266,000	81,300,628	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,888,000	82,025,285	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,705,000	81,622,615	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,958,000	81,876,063	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,475,000	82,444,552	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,934,000	166,547,054	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,620,000	82,535,776	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,368,000	168,645,577	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,880,000	83,821,516	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,078,000	167,707,225	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,892,000	84,855,919	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,702,000	170,318,165	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,898,000	171,510,332	

第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	129,470,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,163,000	87,450,275	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,920,000	87,384,936	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,953,000	86,722,279	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,612,000	177,463,269	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,443,000	88,788,812	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,072,000	88,542,304	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,776,000	178,490,659	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,022,000	89,749,233	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,265,000	270,092,325	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,552,000	181,071,503	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,512,000	93,087,424	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,299,000	93,589,159	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,916,000	192,502,511	
第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,352,000	97,034,172	
第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,244,000	194,583,180	
第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,146,000	195,151,676	
第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,114,000	97,861,777	
第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,724,000	197,019,795	
第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,900,000	198,099,957	
第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,450,000	99,464,035	
第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,134,000	99,472,046	
第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	298,311,000	299,301,392	
第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,829,000	100,308,179	
第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,482,000	
第３２０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,948,000	
第６２回日本学生支援債券	100,000,000	99,988,000	
第６４回日本学生支援債券	300,000,000	299,949,000	
第６５回日本学生支援債券	200,000,000	199,962,000	

	第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	107,283,000	
	い第８２３号商工債	200,000,000	200,552,000	
	い第８２９号商工債	200,000,000	200,472,000	
	い第８３２号商工債	200,000,000	200,056,000	
	い第８３３号商工債	100,000,000	100,000,000	
	い第８４３号商工債	200,000,000	200,454,000	
	い第８４７号商工債	100,000,000	100,123,000	
	い第８５０号商工債	200,000,000	200,174,000	
	第３３７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,101,000	
	第３３８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,103,000	
	第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	200,220,000	
	第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,130,000	
	第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,110,000	
	第３６０回信金中金債（５年）	200,000,000	199,878,000	
	第３７６回信金中金債（５年）	100,000,000	100,065,000	
	第２５４号商工債（３年）	300,000,000	300,069,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	101,877,000	
	第２１回国際協力機構債券	100,000,000	117,093,000	
	第４８回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,462,000	
	第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,159,000	
	第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,546,000	
	第７３回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	502,770,000	
	第８３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,028,000	
	第６０回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,895,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,255,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,190,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	200,048,000	
	第１４１回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,978,000	
特殊債券合計		39,119,123,000	40,727,666,151	
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	100,206,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	299,445,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,146,000	
	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	100,488,000	
	第３回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,107,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,116,000	

第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,162,000	
第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,966,000	
第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,083,000	
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	400,456,000	
第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,967,000	
第３９回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,578,000	
第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,500,000	
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	199,550,000	
第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	300,252,000	
第２５回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,459,000	
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	100,349,000	
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	199,716,000	
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	100,384,000	
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	199,772,000	
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	101,665,000	
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	199,668,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,143,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,003,000	
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	100,344,000	
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	99,864,000	
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	101,130,000	
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	200,556,000	
第１３回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,017,000	
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	101,414,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,862,000	
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	101,019,000	
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	200,408,000	
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	200,628,000	
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	100,084,000	
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	100,195,000	

第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,778,000	
第７回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,712,000	
第４回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,283,000	
第６回株式会社電通無担保社債	200,000,000	202,932,000	
第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,278,000	
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	100,142,000	
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	100,041,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	99,437,000	
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	199,890,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,316,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,760,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,560,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,389,000	
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	100,130,000	
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	100,038,000	
第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,633,000	
第８回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,956,000	
第１７回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	108,034,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,122,000	
第１回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	100,105,000	
第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,212,000	
第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,538,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,370,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,974,000	
第２０回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,967,000	
第２１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,238,000	
第２３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,790,000	
第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,689,000	
第１９回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,610,000	
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,491,000	
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,392,000	
第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,172,000	
第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,098,000	
第２７回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	201,180,000	
第１６回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	199,074,000	
第１２回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,890,000	
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	100,130,000	

第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,208,000	
第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,544,000	
第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	97,678,000	
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,765,000	
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,833,000	
第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,545,000	
第７３回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	200,980,000	
第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,784,000	
第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,408,000	
第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	100,109,000	
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	117,088,000	
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	111,578,000	
第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	100,895,000	
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	101,212,000	
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,329,000	
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	303,678,000	
第３回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,321,000	
第４回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,361,000	
第９回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,726,000	
第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,802,000	
第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,500,000	
第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	99,697,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,130,000	
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	100,280,000	
第６７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,196,000	
第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,255,000	
第４１回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,883,000	
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	199,914,000	
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	99,921,000	
第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,284,000	
第３２回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,016,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,937,000	

第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,273,000	
第８０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,031,000	
第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,888,000	
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	200,408,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,136,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	202,008,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,521,000	
第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,555,000	
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	100,392,000	
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	200,160,000	
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	99,947,000	
第７回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	200,040,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,322,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	200,876,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,910,000	
第１３５回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,179,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,893,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,924,000	
第１０９回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,945,000	
第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,607,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,914,000	
第１２４回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,777,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,557,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,014,000	
第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,696,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,248,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,910,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,398,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,598,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,238,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,348,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	231,380,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,765,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,558,000	

第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,537,000	
第１４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,749,000	
第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,022,000	
第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,453,000	
第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,802,000	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,423,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,775,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,288,000	
第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	500,965,000	
第７５回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,120,000	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,031,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,323,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,701,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,478,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,807,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,028,000	
第５４回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	102,326,000	
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	193,886,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,898,000	
第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,070,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	101,490,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	101,100,000	
第１１回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	401,144,000	
第３１回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	202,922,000	
第３３回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,662,000	
第３６回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,131,000	
第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,642,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,049,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,373,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,656,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,607,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,429,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,402,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,242,000	
第５２４回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,909,000	
第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,062,000	
第５３８回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,626,000	

第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,242,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,478,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,017,000	
第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,456,000	
第４１６回中国電力株式会社社債	200,000,000	201,776,000	
第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,969,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,249,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,170,000	
第３３０回北陸電力株式会社社債	200,000,000	201,406,000	
第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	128,905,560	
第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,518,000	
第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,104,000	
第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,722,000	
第５２１回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,748,000	
第５２７回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,181,000	
第５３５回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,736,000	
第３０９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,958,000	
第３１４回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,954,000	
第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,752,000	
第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,957,000	
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	201,572,000	
第４８９回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,207,000	
第４９４回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,815,000	
第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,681,000	
第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,372,000	
第３５０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,842,000	
第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	106,890,000	
第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,204,000	
第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,375,000	
第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,717,000	
第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	207,606,000	
第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	304,086,000	
第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,555,000	
第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	305,583,000	
第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,724,000	
第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,741,000	
第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,870,000	

	第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,431,000	
	第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,094,000	
	第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,680,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,468,000	
	第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,094,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,300,000	
	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	202,644,000	
社債券合計		28,926,000,000	29,302,542,560	
合計			646,932,477,403	

(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11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,363,426,305
株式	484,965,890,370
派生商品評価勘定	31,782,000
未収配当金	4,111,927,796
前払金	70,054,900
差入委託証拠金	219,300,000
流動資産合計	491,762,381,371
資産合計	491,762,381,371
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	101,904,550
未払解約金	71,156,267
未払利息	5,253
流動負債合計	173,066,070
負債合計	173,066,070
純資産の部	
元本等	
元本	251,362,690,536
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	240,226,624,765

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	491,589,315,301
純資産合計	491,589,315,301
負債純資産合計	491,762,381,371

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年11月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	251,362,690,536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 1.9557円 (1万口当たり純資産額) (19,557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11月10日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月10日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年11月10日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	224,126,876,199円
期中追加設定元本額	69,102,064,773円
期中一部解約元本額	41,866,250,436円
期末元本額	251,362,690,536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）	412,453,826円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,898,361,583円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	15,937,230円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	10,966,882,031円
世界経済インデックスファンド	3,246,336,748円
日本株式インデックス・オープン	3,407,973,799円
ＤＣマイセレクション２５	6,043,130,680円
ＤＣマイセレクション５０	17,964,847,745円
ＤＣマイセレクション７５	18,058,258,597円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,985,476,632円

区分	2021年11月10日現在
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,985,343,818円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,591,616,955円
ＤＣマイセレクションＳ７５	6,288,213,751円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	7,917,295,236円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	222,954,159円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	692,620,574円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	494,320,789円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,380,101,262円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,696,047,916円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,257,008円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	21,712,749円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	20,260,254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）	190,609,221円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,239,914円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	34,754,887円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	148,169,853円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	26,316,407円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	87,513,343円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,008,809,306円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	449,748,923円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,947,677,334円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	100,887,417円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	27,116,588円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	523,166,540円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	290,980,566円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	372,414,747円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	37,370,650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）	595,292,191円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	3,528,653,872円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,908,233,949円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,370,121,973円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,782,035,999円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,322,664,148円
分散投資コア戦略ファンドＳ	5,718,049,945円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	434,751,983円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	400,750,822円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,001,144,658円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	213,142,210円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,620,124円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	59,503,174円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	25,867,962,641円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	546,578,818円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	39,271,066円

区分	2021年11月10日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	138,357,190円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	25,870,776円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,733,277円
グローバル経済コア	217,558,036円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	24,322,277円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	79,049,276円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	19,858,349円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,226,885,412円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	157,096,979円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	5,135,154円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	3,561,085円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	1,755,515円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	2,147,224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）	41,992,296,798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）	1,074,242,823円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	235,182,961円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	36,102,836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）	47,686,777,614円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,685,065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）	61,115,278円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	20,787,486,800
合計	20,787,486,800

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,781,784,900	－	6,711,730,000	△70,054,900
合計		6,781,784,900	－	6,711,730,000	△70,054,900

(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	8,400	3,050.00	25,620,000	
日本水産	239,400	618.00	147,949,200	
マルハニチロ	37,500	2,452.00	91,950,000	
雪国まいたけ	17,500	1,373.00	24,027,500	
カネコ種苗	7,200	1,454.00	10,468,800	
サカタのタネ	28,500	3,365.00	95,902,500	
ホクト	20,100	1,960.00	39,396,000	
ホクリヨウ	3,200	752.00	2,406,400	
住石ホールディングス	41,900	139.00	5,824,100	
日鉄鉱業	5,500	6,340.00	34,870,000	
三井松島ホールディングス	10,000	1,409.00	14,090,000	
ＩＮＰＥＸ	960,400	969.00	930,627,600	
石油資源開発	28,200	2,371.00	66,862,200	
K&Oエナジーグループ	11,600	1,544.00	17,910,400	
ヒノキヤグループ	5,200	2,266.00	11,783,200	
ショーボンドホールディングス	34,200	4,825.00	165,015,000	
ミライト・ホールディングス	77,100	2,122.00	163,606,200	
タマホーム	14,500	2,302.00	33,379,000	
サンヨーホームズ	2,800	728.00	2,038,400	
日本アクア	9,500	645.00	6,127,500	
ファーストコーポレーション	7,300	770.00	5,621,000	
ベステラ	4,800	1,401.00	6,724,800	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	39,900	269.00	10,733,100	
キャンディル	4,100	513.00	2,103,300	
スペースバリューホールディングス	26,500	982.00	26,023,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,600	1,837.00	8,450,200	
第一カッター興業	5,900	1,385.00	8,171,500	
安藤・間	131,600	742.00	97,647,200	
東急建設	70,100	685.00	48,018,500	
コムシスホールディングス	77,200	2,831.00	218,553,200	

ビーアールホールディングス	32,600	426.00	13,887,600	
高松コンストラクショングループ	14,900	1,991.00	29,665,900	
東建コーポレーション	7,400	9,380.00	69,412,000	
ソネック	2,500	1,088.00	2,720,000	
ヤマウラ	11,500	925.00	10,637,500	
オリエンタル白石	80,500	269.00	21,654,500	
大成建設	159,800	3,645.00	582,471,000	
大林組	552,800	923.00	510,234,400	
清水建設	517,900	776.00	401,890,400	
飛島建設	14,800	1,048.00	15,510,400	
長谷工コーポレーション	164,600	1,473.00	242,455,800	
松井建設	21,800	737.00	16,066,600	
錢高組	2,400	4,000.00	9,600,000	
鹿島建設	405,100	1,400.00	567,140,000	
不動テトラ	11,700	1,767.00	20,673,900	
大末建設	5,800	1,186.00	6,878,800	
鉄建建設	12,000	1,800.00	21,600,000	
西松建設	33,500	3,415.00	114,402,500	
三井住友建設	124,600	416.00	51,833,600	
大豊建設	8,100	3,730.00	30,213,000	
佐田建設	12,200	486.00	5,929,200	
ナカノフドー建設	13,200	339.00	4,474,800	
奥村組	32,600	2,962.00	96,561,200	
東鉄工業	25,700	2,351.00	60,420,700	
イチケン	4,000	1,896.00	7,584,000	
富士ピー・エス	7,100	521.00	3,699,100	
淺沼組	6,200	4,550.00	28,210,000	
戸田建設	229,600	716.00	164,393,600	
熊谷組	28,200	2,756.00	77,719,200	
北野建設	3,400	2,167.00	7,367,800	
植木組	4,900	1,489.00	7,296,100	
矢作建設工業	24,400	706.00	17,226,400	
ピーエス三菱	18,200	628.00	11,429,600	
日本ハウスホールディングス	37,700	379.00	14,288,300	
大東建託	56,600	13,440.00	760,704,000	
新日本建設	23,500	838.00	19,693,000	
ＮＩＰＰＯ	45,700	4,120.00	188,284,000	
東亜道路工業	2,900	5,070.00	14,703,000	
日本道路	5,300	8,080.00	42,824,000	
東亜建設工業	13,500	2,547.00	34,384,500	
日本国土開発	53,800	578.00	31,096,400	
若築建設	9,200	2,003.00	18,427,600	

東洋建設	62,000	556.00	34,472,000	
五洋建設	219,100	758.00	166,077,800	
世紀東急工業	26,500	791.00	20,961,500	
福田組	5,900	4,565.00	26,933,500	
住友林業	141,400	2,326.00	328,896,400	
日本基礎技術	15,200	480.00	7,296,000	
巴コーポレーション	24,500	456.00	11,172,000	
大和ハウス工業	510,500	3,463.00	1,767,861,500	
ライト工業	34,800	1,949.00	67,825,200	
積水ハウス	599,600	2,381.50	1,427,947,400	
日特建設	11,400	691.00	7,877,400	
北陸電気工事	9,600	1,039.00	9,974,400	
ユアテック	31,600	643.00	20,318,800	
日本リーテック	11,600	1,525.00	17,690,000	
四電工	6,000	1,583.00	9,498,000	
中電工	25,500	2,157.00	55,003,500	
関電工	89,900	862.00	77,493,800	
きんでん	123,500	1,822.00	225,017,000	
東京エネシス	18,400	1,076.00	19,798,400	
トーエネック	5,600	3,270.00	18,312,000	
住友電設	13,900	2,058.00	28,606,200	
日本電設工業	30,300	1,705.00	51,661,500	
エクシオグループ	83,800	2,665.00	223,327,000	
新日本空調	14,600	2,259.00	32,981,400	
九電工	42,700	3,500.00	149,450,000	
三機工業	35,900	1,450.00	52,055,000	
日揮ホールディングス	170,300	1,089.00	185,456,700	
中外炉工業	5,500	1,702.00	9,361,000	
ヤマト	16,200	761.00	12,328,200	
太平電業	12,200	2,616.00	31,915,200	
高砂熱学工業	50,000	2,094.00	104,700,000	
三晃金属工業	2,200	2,407.00	5,295,400	
朝日工業社	3,700	3,340.00	12,358,000	
明星工業	35,800	649.00	23,234,200	
大氣社	26,900	3,285.00	88,366,500	
ダイダン	12,300	2,240.00	27,552,000	
日比谷総合設備	17,800	1,935.00	34,443,000	
フィル・カンパニー	3,200	2,716.00	8,691,200	
テスホールディングス	10,100	2,412.00	24,361,200	
インフロニア・ホールディングス	235,700	923.00	217,551,100	
東洋エンジニアリング	23,200	824.00	19,116,800	
レイズネクスト	26,700	1,230.00	32,841,000	

ニップン	51,800	1,611.00	83,449,800	
日清製粉グループ本社	199,900	1,720.00	343,828,000	
日東富士製粉	2,600	3,405.00	8,853,000	
昭和産業	16,700	2,783.00	46,476,100	
鳥越製粉	15,700	756.00	11,869,200	
中部飼料	19,900	1,049.00	20,875,100	
フィード・ワン	23,800	801.00	19,063,800	
東洋精糖	3,000	1,173.00	3,519,000	
日本甜菜製糖	9,200	1,646.00	15,143,200	
DM三井製糖ホールディングス	16,100	1,975.00	31,797,500	
塩水港精糖	21,100	218.00	4,599,800	
日新製糖	8,400	1,699.00	14,271,600	
森永製菓	41,500	3,870.00	160,605,000	
中村屋	4,300	3,705.00	15,931,500	
江崎グリコ	48,700	3,935.00	191,634,500	
名糖産業	7,800	1,712.00	13,353,600	
井村屋グループ	10,000	2,282.00	22,820,000	
不二家	9,900	2,311.00	22,878,900	
山崎製パン	132,600	1,665.00	220,779,000	
第一屋製パン	3,400	691.00	2,349,400	
モロゾフ	2,800	5,450.00	15,260,000	
亀田製菓	10,100	4,435.00	44,793,500	
寿スピリッツ	17,000	6,920.00	117,640,000	
カルビー	80,600	2,837.00	228,662,200	
森永乳業	32,700	6,390.00	208,953,000	
六甲バター	12,900	1,611.00	20,781,900	
ヤクルト本社	131,100	5,890.00	772,179,000	
明治ホールディングス	117,000	7,160.00	837,720,000	
雪印メグミルク	42,600	2,076.00	88,437,600	
プリマハム	22,100	2,530.00	55,913,000	
日本ハム	67,600	4,110.00	277,836,000	
林兼産業	5,400	579.00	3,126,600	
丸大食品	17,400	1,670.00	29,058,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	15,900	3,385.00	53,821,500	
柿安本店	6,100	2,634.00	16,067,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	113,900	683.00	77,793,700	
サッポロホールディングス	60,400	2,311.00	139,584,400	
アサヒグループホールディングス	416,200	4,919.00	2,047,287,800	
キリンホールディングス	650,300	1,880.50	1,222,889,150	
宝ホールディングス	120,200	1,425.00	171,285,000	
オエノンホールディングス	50,300	375.00	18,862,500	
養命酒製造	5,400	1,807.00	9,757,800	

コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	124,200	1,541.00	191,392,200	
サントリー食品インターナショナル	118,400	4,370.00	517,408,000	
ダイドーグループホールディングス	9,100	5,420.00	49,322,000	
伊藤園	53,700	7,480.00	401,676,000	
キーコーヒー	17,400	2,193.00	38,158,200	
ユニカフェ	5,300	1,093.00	5,792,900	
ジャパンフーズ	2,500	1,218.00	3,045,000	
日清オイリオグループ	22,100	2,990.00	66,079,000	
不二製油グループ本社	38,300	2,588.00	99,120,400	
かどや製油	1,900	4,070.00	7,733,000	
Ｊ－オイルミルズ	16,500	1,758.00	29,007,000	
キッコーマン	127,300	9,250.00	1,177,525,000	
味の素	390,700	3,500.00	1,367,450,000	
ブルドックソース	7,400	2,114.00	15,643,600	
キユーピー	92,900	2,498.00	232,064,200	
ハウス食品グループ本社	66,200	3,080.00	203,896,000	
カゴメ	67,100	2,961.00	198,683,100	
焼津水産化学工業	8,600	986.00	8,479,600	
アリアケジャパン	16,200	6,820.00	110,484,000	
ピエトロ	2,300	1,785.00	4,105,500	
エバラ食品工業	3,900	2,457.00	9,582,300	
やまみ	1,900	2,061.00	3,915,900	
ニチレイ	84,300	2,634.00	222,046,200	
東洋水産	85,000	4,865.00	413,525,000	
イートアンドホールディングス	6,700	2,159.00	14,465,300	
大冷	2,000	1,920.00	3,840,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,100	771.00	7,016,100	
日清食品ホールディングス	69,400	8,860.00	614,884,000	
永谷園ホールディングス	7,900	2,036.00	16,084,400	
一正蒲鉾	6,900	913.00	6,299,700	
フジッコ	19,200	1,895.00	36,384,000	
ロック・フィールド	19,100	1,726.00	32,966,600	
日本たばこ産業	948,600	2,326.00	2,206,443,600	
ケンコーマヨネーズ	9,900	1,489.00	14,741,100	
わらべや日洋ホールディングス	11,600	2,101.00	24,371,600	
なとり	9,900	1,954.00	19,344,600	
イフジ産業	3,100	943.00	2,923,300	
ピックルスコーポレーション	8,400	1,778.00	14,935,200	
ファーマフーズ	16,700	2,572.00	42,952,400	
ユーグレナ	90,100	844.00	76,044,400	
紀文食品	10,300	1,134.00	11,680,200	
ミヨシ油脂	6,800	1,309.00	8,901,200	

理研ビタミン	18,400	1,776.00	32,678,400	
片倉工業	19,500	2,255.00	43,972,500	
グンゼ	11,700	4,135.00	48,379,500	
東洋紡	68,600	1,322.00	90,689,200	
ユニチカ	48,700	316.00	15,389,200	
富士紡ホールディングス	7,800	4,045.00	31,551,000	
倉敷紡績	15,000	1,939.00	29,085,000	
シキボウ	9,000	925.00	8,325,000	
日本毛織	52,600	901.00	47,392,600	
トーア紡コーポレーション	6,400	435.00	2,784,000	
帝国繊維	19,700	2,073.00	40,838,100	
帝人	162,800	1,451.00	236,222,800	
東レ	1,250,700	699.90	875,364,930	
住江織物	3,800	1,746.00	6,634,800	
日本フエルト	10,800	446.00	4,816,800	
イチカワ	2,600	1,384.00	3,598,400	
日東製網	1,900	1,467.00	2,787,300	
アツギ	13,600	655.00	8,908,000	
ダイニック	6,500	753.00	4,894,500	
セーレン	35,600	2,285.00	81,346,000	
ソトー	6,500	841.00	5,466,500	
東海染工	2,200	1,115.00	2,453,000	
小松マテーレ	28,600	1,096.00	31,345,600	
ワコールホールディングス	43,200	2,185.00	94,392,000	
ホギメディカル	23,300	3,065.00	71,414,500	
ＴＳＩホールディングス	58,300	374.00	21,804,200	
マツオカコーポレーション	5,700	1,367.00	7,791,900	
ワールド	22,700	1,523.00	34,572,100	
三陽商会	8,300	912.00	7,569,600	
ナイガイ	6,600	318.00	2,098,800	
オンワードホールディングス	104,300	359.00	37,443,700	
ルックホールディングス	5,600	1,413.00	7,912,800	
ゴールドウイン	31,200	7,200.00	224,640,000	
デサント	33,700	4,425.00	149,122,500	
キング	8,800	543.00	4,778,400	
ヤマトインターナショナル	15,800	309.00	4,882,200	
特種東海製紙	10,600	4,300.00	45,580,000	
王子ホールディングス	721,700	581.00	419,307,700	
日本製紙	82,700	1,175.00	97,172,500	
三菱製紙	24,500	352.00	8,624,000	
北越コーポレーション	113,200	732.00	82,862,400	
中越パルプ工業	6,600	1,152.00	7,603,200	

巴川製紙所	5,300	808.00	4,282,400	
大王製紙	83,200	2,021.00	168,147,200	
阿波製紙	4,500	379.00	1,705,500	
レンゴー	163,200	822.00	134,150,400	
トーモク	10,600	1,869.00	19,811,400	
ザ・パック	13,100	2,819.00	36,928,900	
北の達人コーポレーション	61,800	418.00	25,832,400	
クラレ	252,500	1,052.00	265,630,000	
旭化成	1,144,300	1,148.00	1,313,656,400	
共和レザー	10,700	661.00	7,072,700	
昭和電工	149,700	2,728.00	408,381,600	
住友化学	1,268,400	572.00	725,524,800	
住友精化	7,600	3,245.00	24,662,000	
日産化学	93,900	6,490.00	609,411,000	
ラサ工業	6,100	1,888.00	11,516,800	
クレハ	13,700	8,280.00	113,436,000	
多木化学	6,700	6,000.00	40,200,000	
テイカ	12,700	1,306.00	16,586,200	
石原産業	28,700	1,292.00	37,080,400	
片倉コープアグリ	4,200	1,167.00	4,901,400	
日本曹達	22,100	3,320.00	73,372,000	
東ソー	249,100	1,761.00	438,665,100	
トクヤマ	55,200	1,983.00	109,461,600	
セントラル硝子	28,200	2,064.00	58,204,800	
東亞合成	98,300	1,240.00	121,892,000	
大阪ソーダ	16,100	2,686.00	43,244,600	
関東電化工業	37,800	1,050.00	39,690,000	
デンカ	63,000	3,550.00	223,650,000	
信越化学工業	296,400	19,870.00	5,889,468,000	
日本カーバイド工業	6,000	1,326.00	7,956,000	
堺化学工業	12,100	2,190.00	26,499,000	
第一稀元素化学工業	16,000	1,449.00	23,184,000	
エア・ウォーター	163,500	1,803.00	294,790,500	
日本酸素ホールディングス	165,900	2,720.00	451,248,000	
日本化学工業	5,400	2,895.00	15,633,000	
東邦アセチレン	2,900	1,230.00	3,567,000	
日本パーカライジング	87,100	1,127.00	98,161,700	
高圧ガス工業	27,400	761.00	20,851,400	
チタン工業	2,000	1,800.00	3,600,000	
四国化成工業	22,500	1,420.00	31,950,000	
戸田工業	3,700	3,365.00	12,450,500	
ステラ　ケミファ	8,700	2,668.00	23,211,600	

保土谷化学工業	5,500	5,130.00	28,215,000	
日本触媒	29,000	5,540.00	160,660,000	
大日精化工業	14,300	2,599.00	37,165,700	
カネカ	44,700	4,170.00	186,399,000	
三菱瓦斯化学	160,600	2,076.00	333,405,600	
三井化学	156,800	3,350.00	525,280,000	
ＪＳＲ	160,900	4,090.00	658,081,000	
東京応化工業	29,600	7,380.00	218,448,000	
大阪有機化学工業	14,700	3,765.00	55,345,500	
三菱ケミカルホールディングス	1,154,100	932.70	1,076,429,070	
ＫＨネオケム	28,500	3,195.00	91,057,500	
ダイセル	248,700	821.00	204,182,700	
住友ベークライト	27,100	5,330.00	144,443,000	
積水化学工業	361,300	1,886.00	681,411,800	
日本ゼオン	155,700	1,314.00	204,589,800	
アイカ工業	48,100	3,375.00	162,337,500	
宇部興産	81,400	2,071.00	168,579,400	
積水樹脂	26,100	2,114.00	55,175,400	
タキロンシーアイ	37,400	561.00	20,981,400	
旭有機材	9,800	1,450.00	14,210,000	
ニチバン	10,200	1,857.00	18,941,400	
リケンテクノス	42,100	529.00	22,270,900	
大倉工業	8,800	2,132.00	18,761,600	
積水化成品工業	23,100	527.00	12,173,700	
群栄化学工業	3,900	3,190.00	12,441,000	
タイガースポリマー	9,100	423.00	3,849,300	
ミライアル	5,500	1,598.00	8,789,000	
ダイキアクシス	6,700	874.00	5,855,800	
ダイキョーニシカワ	36,400	670.00	24,388,000	
竹本容器	6,200	863.00	5,350,600	
森六ホールディングス	9,300	1,843.00	17,139,900	
恵和	4,300	5,010.00	21,543,000	
日本化薬	136,000	1,214.00	165,104,000	
カーリットホールディングス	17,100	765.00	13,081,500	
日本精化	13,900	2,024.00	28,133,600	
扶桑化学工業	15,500	4,900.00	75,950,000	
トリケミカル研究所	17,800	3,435.00	61,143,000	
ＡＤＥＫＡ	79,500	2,558.00	203,361,000	
日油	58,900	5,970.00	351,633,000	
新日本理化	28,600	297.00	8,494,200	
ハリマ化成グループ	12,800	850.00	10,880,000	
花王	389,900	6,287.00	2,451,301,300	

第一工業製薬	6,400	3,365.00	21,536,000	
石原ケミカル	8,700	1,412.00	12,284,400	
日華化学	5,800	887.00	5,144,600	
ニイタカ	3,600	2,413.00	8,686,800	
三洋化成工業	10,300	5,400.00	55,620,000	
有機合成薬品工業	12,000	297.00	3,564,000	
大日本塗料	21,100	845.00	17,829,500	
日本ペイントホールディングス	648,700	1,175.00	762,222,500	
関西ペイント	179,000	2,715.00	485,985,000	
神東塗料	13,600	189.00	2,570,400	
中国塗料	40,700	819.00	33,333,300	
日本特殊塗料	12,900	1,002.00	12,925,800	
藤倉化成	21,800	526.00	11,466,800	
太陽ホールディングス	25,400	3,140.00	79,756,000	
ＤＩＣ	72,900	3,000.00	218,700,000	
サカタインクス	34,300	1,072.00	36,769,600	
東洋インキＳＣホールディングス	36,500	1,986.00	72,489,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	13,900	802.00	11,147,800	
富士フイルムホールディングス	309,800	9,118.00	2,824,756,400	
資生堂	328,400	7,589.00	2,492,227,600	
ライオン	212,800	1,827.00	388,785,600	
高砂香料工業	12,100	2,795.00	33,819,500	
マンダム	37,000	1,646.00	60,902,000	
ミルボン	21,700	6,930.00	150,381,000	
ファンケル	71,300	3,470.00	247,411,000	
コーセー	33,200	13,940.00	462,808,000	
コタ	11,200	1,569.00	17,572,800	
シーボン	2,300	1,804.00	4,149,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	75,200	2,265.00	170,328,000	
ノエビアホールディングス	15,000	5,780.00	86,700,000	
アジュバンホールディングス	3,900	1,237.00	4,824,300	
新日本製薬	4,800	1,637.00	7,857,600	
エステー	11,300	1,587.00	17,933,100	
アグロ　カネショウ	5,900	1,327.00	7,829,300	
コニシ	29,000	1,733.00	50,257,000	
長谷川香料	30,400	2,810.00	85,424,000	
星光ＰＭＣ	10,000	761.00	7,610,000	
小林製薬	49,400	9,360.00	462,384,000	
荒川化学工業	14,700	1,186.00	17,434,200	
メック	13,200	3,405.00	44,946,000	
日本高純度化学	4,800	2,797.00	13,425,600	
タカラバイオ	46,100	2,761.00	127,282,100	

ＪＣＵ	19,800	4,635.00	91,773,000	
新田ゼラチン	11,100	619.00	6,870,900	
ＯＡＴアグリオ	3,600	1,959.00	7,052,400	
デクセリアルズ	45,800	3,310.00	151,598,000	
アース製薬	14,500	6,510.00	94,395,000	
北興化学工業	16,400	964.00	15,809,600	
大成ラミック	5,400	2,828.00	15,271,200	
クミアイ化学工業	65,600	872.00	57,203,200	
日本農薬	31,400	546.00	17,144,400	
アキレス	11,300	1,308.00	14,780,400	
有沢製作所	25,700	945.00	24,286,500	
日東電工	106,500	8,550.00	910,575,000	
レック	23,000	989.00	22,747,000	
三光合成	18,500	413.00	7,640,500	
きもと	27,000	227.00	6,129,000	
藤森工業	15,800	4,740.00	74,892,000	
前澤化成工業	11,200	1,312.00	14,694,400	
未来工業	6,300	1,656.00	10,432,800	
ウェーブロックホールディングス	6,700	710.00	4,757,000	
ＪＳＰ	10,300	1,560.00	16,068,000	
エフピコ	32,400	3,865.00	125,226,000	
天馬	14,700	2,570.00	37,779,000	
信越ポリマー	31,700	1,029.00	32,619,300	
東リ	43,900	234.00	10,272,600	
ニフコ	58,800	3,625.00	213,150,000	
バルカー	14,300	2,414.00	34,520,200	
ユニ・チャーム	339,800	4,564.00	1,550,847,200	
ショーエイコーポレーション	4,700	793.00	3,727,100	
協和キリン	206,900	3,670.00	759,323,000	
武田薬品工業	1,385,500	3,232.00	4,477,936,000	
アステラス製薬	1,528,400	1,971.50	3,013,240,600	
大日本住友製薬	108,900	1,535.00	167,161,500	
塩野義製薬	221,700	7,191.00	1,594,244,700	
わかもと製薬	21,000	320.00	6,720,000	
日本新薬	46,100	8,950.00	412,595,000	
中外製薬	551,400	4,076.00	2,247,506,400	
科研製薬	27,700	4,295.00	118,971,500	
エーザイ	211,000	8,168.00	1,723,448,000	
ロート製薬	90,500	3,420.00	309,510,000	
小野薬品工業	404,800	2,411.50	976,175,200	
久光製薬	46,600	3,860.00	179,876,000	
持田製薬	22,200	3,375.00	74,925,000	

参天製薬	328,700	1,548.00	508,827,600	
扶桑薬品工業	6,200	2,482.00	15,388,400	
日本ケミファ	2,100	2,144.00	4,502,400	
ツムラ	54,600	3,575.00	195,195,000	
日医工	54,700	888.00	48,573,600	
キッセイ薬品工業	31,200	2,339.00	72,976,800	
生化学工業	31,100	995.00	30,944,500	
栄研化学	31,000	1,890.00	58,590,000	
日水製薬	6,500	963.00	6,259,500	
鳥居薬品	9,500	2,974.00	28,253,000	
ＪＣＲファーマ	49,700	2,839.00	141,098,300	
東和薬品	25,400	2,941.00	74,701,400	
富士製薬工業	10,800	1,135.00	12,258,000	
ゼリア新薬工業	32,000	2,035.00	65,120,000	
第一三共	1,385,300	2,761.50	3,825,505,950	
キョーリン製薬ホールディングス	35,400	1,789.00	63,330,600	
大幸薬品	26,600	844.00	22,450,400	
ダイト	11,300	3,075.00	34,747,500	
大塚ホールディングス	366,400	4,443.00	1,627,915,200	
大正製薬ホールディングス	41,900	5,980.00	250,562,000	
ペプチドリーム	92,500	2,541.00	235,042,500	
あすか製薬ホールディングス	20,100	1,002.00	20,140,200	
サワイグループホールディングス	38,600	5,020.00	193,772,000	
日本コークス工業	148,900	132.00	19,654,800	
ニチレキ	22,500	1,292.00	29,070,000	
ユシロ化学工業	9,100	1,154.00	10,501,400	
ビーピー・カストロール	6,300	1,405.00	8,851,500	
富士石油	47,100	266.00	12,528,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,800	1,155.00	6,699,000	
出光興産	195,600	3,115.00	609,294,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,651,900	464.30	1,231,277,170	
コスモエネルギーホールディングス	51,000	2,401.00	122,451,000	
横浜ゴム	102,100	1,858.00	189,701,800	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	92,800	1,871.00	173,628,800	
ブリヂストン	507,800	4,904.00	2,490,251,200	
住友ゴム工業	158,400	1,249.00	197,841,600	
藤倉コンポジット	14,100	727.00	10,250,700	
オカモト	10,500	4,010.00	42,105,000	
フコク	7,700	997.00	7,676,900	
ニッタ	18,200	2,658.00	48,375,600	
住友理工	34,200	615.00	21,033,000	
三ツ星ベルト	21,400	1,934.00	41,387,600	

バンドー化学	28,400	913.00	25,929,200	
日東紡績	26,300	3,345.00	87,973,500	
ＡＧＣ	161,800	5,700.00	922,260,000	
日本板硝子	84,600	570.00	48,222,000	
石塚硝子	3,000	2,078.00	6,234,000	
日本山村硝子	6,900	833.00	5,747,700	
日本電気硝子	70,800	2,616.00	185,212,800	
オハラ	7,000	1,475.00	10,325,000	
住友大阪セメント	32,600	3,325.00	108,395,000	
太平洋セメント	100,200	2,374.00	237,874,800	
日本ヒューム	17,800	736.00	13,100,800	
日本コンクリート工業	35,100	281.00	9,863,100	
三谷セキサン	8,200	7,490.00	61,418,000	
アジアパイルホールディングス	27,300	456.00	12,448,800	
東海カーボン	147,800	1,295.00	191,401,000	
日本カーボン	9,100	4,275.00	38,902,500	
東洋炭素	11,500	3,140.00	36,110,000	
ノリタケカンパニーリミテド	9,800	4,670.00	45,766,000	
ＴＯＴＯ	125,900	5,340.00	672,306,000	
日本碍子	191,000	1,953.00	373,023,000	
日本特殊陶業	134,100	1,950.00	261,495,000	
ＭＡＲＵＷＡ	6,100	13,220.00	80,642,000	
品川リフラクトリーズ	4,200	3,630.00	15,246,000	
黒崎播磨	3,000	4,120.00	12,360,000	
ヨータイ	11,300	1,248.00	14,102,400	
イソライト工業	7,900	859.00	6,786,100	
東京窯業	22,700	319.00	7,241,300	
ニッカトー	8,100	743.00	6,018,300	
フジミインコーポレーテッド	14,200	7,430.00	105,506,000	
クニミネ工業	5,600	1,094.00	6,126,400	
エーアンドエーマテリアル	3,100	946.00	2,932,600	
ニチアス	40,900	2,640.00	107,976,000	
ニチハ	24,500	3,065.00	75,092,500	
日本製鉄	780,200	1,891.50	1,475,748,300	
神戸製鋼所	325,500	595.00	193,672,500	
中山製鋼所	27,800	448.00	12,454,400	
合同製鐵	9,400	1,422.00	13,366,800	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	470,800	1,464.00	689,251,200	
東京製鐵	59,500	1,213.00	72,173,500	
共英製鋼	19,700	1,325.00	26,102,500	
大和工業	33,400	3,535.00	118,069,000	
東京鐵鋼	7,700	1,439.00	11,080,300	

大阪製鐵	9,300	1,064.00	9,895,200	
淀川製鋼所	22,900	2,415.00	55,303,500	
丸一鋼管	61,800	2,560.00	158,208,000	
モリ工業	5,200	2,598.00	13,509,600	
大同特殊鋼	28,600	4,115.00	117,689,000	
日本高周波鋼業	6,600	388.00	2,560,800	
日本冶金工業	12,700	2,228.00	28,295,600	
山陽特殊製鋼	17,900	1,995.00	35,710,500	
愛知製鋼	9,800	2,605.00	25,529,000	
日立金属	187,800	2,150.00	403,770,000	
日本金属	4,400	1,000.00	4,400,000	
大平洋金属	10,800	2,030.00	21,924,000	
新日本電工	112,700	313.00	35,275,100	
栗本鐵工所	7,900	1,543.00	12,189,700	
虹技	2,500	1,066.00	2,665,000	
三菱製鋼	11,200	1,017.00	11,390,400	
日亜鋼業	22,900	284.00	6,503,600	
日本精線	2,900	4,500.00	13,050,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,400	2,185.00	16,169,000	
シンニッタン	21,400	226.00	4,836,400	
新家工業	4,300	1,654.00	7,112,200	
大紀アルミニウム工業所	26,300	1,538.00	40,449,400	
日本軽金属ホールディングス	44,200	1,756.00	77,615,200	
三井金属鉱業	47,100	3,055.00	143,890,500	
東邦亜鉛	9,700	2,483.00	24,085,100	
三菱マテリアル	115,200	2,013.00	231,897,600	
住友金属鉱山	222,800	4,353.00	969,848,400	
ＤＯＷＡホールディングス	47,500	4,670.00	221,825,000	
古河機械金属	28,900	1,241.00	35,864,900	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,300	878.00	17,823,400	
東邦チタニウム	31,300	1,102.00	34,492,600	
ＵＡＣＪ	26,500	2,621.00	69,456,500	
ＣＫサンエツ	3,700	3,260.00	12,062,000	
古河電気工業	54,200	2,458.00	133,223,600	
住友電気工業	651,800	1,525.50	994,320,900	
フジクラ	194,500	571.00	111,059,500	
昭和電線ホールディングス	15,200	1,874.00	28,484,800	
東京特殊電線	2,600	2,791.00	7,256,600	
タツタ電線	30,900	488.00	15,079,200	
カナレ電気	2,700	1,724.00	4,654,800	
平河ヒューテック	9,700	1,192.00	11,562,400	
リョービ	21,500	1,116.00	23,994,000	

アーレスティ	18,800	380.00	7,144,000	
アサヒホールディングス	69,800	2,047.00	142,880,600	
稲葉製作所	9,800	1,343.00	13,161,400	
宮地エンジニアリンググループ	5,300	2,586.00	13,705,800	
トーカロ	45,000	1,331.00	59,895,000	
アルファＣｏ	6,700	1,227.00	8,220,900	
ＳＵＭＣＯ	268,300	2,365.00	634,529,500	
川田テクノロジーズ	3,600	3,835.00	13,806,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,700	6,640.00	37,848,000	
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,143.00	4,071,700	
信和	10,800	775.00	8,370,000	
東洋製罐グループホールディングス	111,000	1,446.00	160,506,000	
ホッカンホールディングス	9,600	1,484.00	14,246,400	
コロナ	9,600	900.00	8,640,000	
横河ブリッジホールディングス	29,900	2,183.00	65,271,700	
駒井ハルテック	3,300	1,618.00	5,339,400	
高田機工	1,600	2,725.00	4,360,000	
三和ホールディングス	164,400	1,275.00	209,610,000	
文化シヤッター	55,300	1,055.00	58,341,500	
三協立山	22,500	747.00	16,807,500	
アルインコ	12,700	963.00	12,230,100	
東洋シヤッター	3,800	654.00	2,485,200	
ＬＩＸＩＬ	274,400	2,925.00	802,620,000	
日本フイルコン	12,100	544.00	6,582,400	
ノーリツ	33,400	1,831.00	61,155,400	
長府製作所	17,700	2,046.00	36,214,200	
リンナイ	32,900	12,430.00	408,947,000	
ダイニチ工業	8,300	783.00	6,498,900	
日東精工	21,900	643.00	14,081,700	
三洋工業	2,100	1,860.00	3,906,000	
岡部	35,300	670.00	23,651,000	
ジーテクト	21,600	1,400.00	30,240,000	
東プレ	32,500	1,311.00	42,607,500	
高周波熱錬	31,200	579.00	18,064,800	
東京製綱	10,700	841.00	8,998,700	
サンコール	14,900	476.00	7,092,400	
モリテック　スチール	13,600	415.00	5,644,000	
パイオラックス	25,800	1,641.00	42,337,800	
エイチワン	17,100	681.00	11,645,100	
日本発條	160,300	855.00	137,056,500	
中央発條	8,400	895.00	7,518,000	
アドバネクス	2,400	1,055.00	2,532,000	

立川ブライインド工業	7,700	1,203.00	9,263,100	
三益半導体工業	13,600	2,501.00	34,013,600	
日本ドライケミカル	4,400	1,960.00	8,624,000	
日本製鋼所	53,000	3,315.00	175,695,000	
三浦工業	75,500	4,300.00	324,650,000	
タクマ	59,300	1,446.00	85,747,800	
ツガミ	42,400	1,489.00	63,133,600	
オークマ	20,400	5,340.00	108,936,000	
芝浦機械	19,800	2,994.00	59,281,200	
アマダ	275,500	1,131.00	311,590,500	
アイダエンジニアリング	46,000	986.00	45,356,000	
滝澤鉄工所	5,100	1,128.00	5,752,800	
ＦＵＪＩ	80,400	2,484.00	199,713,600	
牧野フライス製作所	19,200	3,805.00	73,056,000	
オーエスジー	80,800	1,863.00	150,530,400	
ダイジェット工業	2,300	1,106.00	2,543,800	
旭ダイヤモンド工業	46,300	684.00	31,669,200	
ＤＭＧ森精機	103,600	1,943.00	201,294,800	
ソディック	38,700	869.00	33,630,300	
ディスコ	25,700	32,900.00	845,530,000	
日東工器	9,600	1,878.00	18,028,800	
日進工具	13,800	1,572.00	21,693,600	
パンチ工業	14,700	564.00	8,290,800	
冨士ダイス	8,900	643.00	5,722,700	
豊和工業	9,400	811.00	7,623,400	
ＯＫＫ	6,700	374.00	2,505,800	
東洋機械金属	11,600	557.00	6,461,200	
津田駒工業	3,400	802.00	2,726,800	
エンシュウ	4,400	710.00	3,124,000	
島精機製作所	25,700	2,159.00	55,486,300	
オプトラン	21,900	2,147.00	47,019,300	
ＮＣホールディングス	5,000	1,607.00	8,035,000	
イワキポンプ	11,200	1,060.00	11,872,000	
フリュー	15,600	1,592.00	24,835,200	
ヤマシンフィルタ	35,300	632.00	22,309,600	
日阪製作所	21,600	848.00	18,316,800	
やまびこ	33,900	1,247.00	42,273,300	
野村マイクロ・サイエンス	4,600	4,940.00	22,724,000	
平田機工	8,300	6,880.00	57,104,000	
ペガサスミシン製造	17,900	511.00	9,146,900	
マルマエ	7,200	2,340.00	16,848,000	
タツモ	8,200	1,735.00	14,227,000	

ナブテスコ	99,500	3,710.00	369,145,000	
三井海洋開発	18,600	1,581.00	29,406,600	
レオン自動機	18,700	1,401.00	26,198,700	
ＳＭＣ	51,600	70,200.00	3,622,320,000	
ホソカワミクロン	12,300	3,090.00	38,007,000	
ユニオンツール	6,500	3,915.00	25,447,500	
オイレス工業	24,500	1,673.00	40,988,500	
日精エー・エス・ビー機械	5,900	3,840.00	22,656,000	
サトーホールディングス	23,000	2,606.00	59,938,000	
技研製作所	15,400	4,440.00	68,376,000	
日本エアーテック	8,100	1,255.00	10,165,500	
カワタ	5,600	967.00	5,415,200	
日精樹脂工業	12,500	1,098.00	13,725,000	
オカダアイヨン	5,600	1,265.00	7,084,000	
ワイエイシイホールディングス	6,900	926.00	6,389,400	
小松製作所	799,000	3,026.00	2,417,774,000	
住友重機械工業	101,000	2,851.00	287,951,000	
日立建機	70,700	3,645.00	257,701,500	
日工	24,700	659.00	16,277,300	
巴工業	7,000	2,240.00	15,680,000	
井関農機	16,600	1,653.00	27,439,800	
ＴＯＷＡ	15,100	2,912.00	43,971,200	
丸山製作所	3,800	1,480.00	5,624,000	
北川鉄工所	8,200	1,560.00	12,792,000	
ローツェ	8,700	11,900.00	103,530,000	
タカキタ	6,300	655.00	4,126,500	
クボタ	860,000	2,301.00	1,978,860,000	
荏原実業	8,200	2,611.00	21,410,200	
三菱化工機	5,800	2,463.00	14,285,400	
月島機械	32,800	1,157.00	37,949,600	
帝国電機製作所	12,400	1,390.00	17,236,000	
新東工業	39,300	723.00	28,413,900	
澁谷工業	15,500	2,988.00	46,314,000	
アイチ　コーポレーション	26,200	797.00	20,881,400	
小森コーポレーション	45,200	750.00	33,900,000	
鶴見製作所	13,800	1,766.00	24,370,800	
住友精密工業	2,700	2,298.00	6,204,600	
日本ギア工業	6,700	288.00	1,929,600	
酒井重工業	3,300	2,550.00	8,415,000	
荏原製作所	73,200	6,280.00	459,696,000	
石井鐵工所	2,600	2,966.00	7,711,600	
西島製作所	16,400	915.00	15,006,000	

北越工業	16,900	995.00	16,815,500	
ダイキン工業	224,600	25,150.00	5,648,690,000	
オルガノ	5,100	6,890.00	35,139,000	
トーヨーカネツ	6,800	2,569.00	17,469,200	
栗田工業	95,500	5,770.00	551,035,000	
椿本チエイン	23,200	3,135.00	72,732,000	
大同工業	8,200	990.00	8,118,000	
木村化工機	15,200	755.00	11,476,000	
アネスト岩田	27,500	917.00	25,217,500	
ダイフク	97,000	9,820.00	952,540,000	
サムコ	4,400	2,807.00	12,350,800	
加藤製作所	8,800	825.00	7,260,000	
油研工業	3,200	1,760.00	5,632,000	
タダノ	92,400	1,152.00	106,444,800	
フジテック	65,400	2,526.00	165,200,400	
ＣＫＤ	52,100	2,365.00	123,216,500	
キトー	15,000	1,721.00	25,815,000	
平和	49,200	2,124.00	104,500,800	
理想科学工業	14,800	1,998.00	29,570,400	
ＳＡＮＫＹＯ	38,100	3,015.00	114,871,500	
日本金銭機械	18,000	772.00	13,896,000	
マースグループホールディングス	11,300	1,634.00	18,464,200	
フクシマガリレイ	12,100	4,545.00	54,994,500	
オーイズミ	6,500	382.00	2,483,000	
ダイコク電機	8,200	1,245.00	10,209,000	
竹内製作所	26,900	2,930.00	78,817,000	
アマノ	46,200	2,708.00	125,109,600	
ＪＵＫＩ	24,500	771.00	18,889,500	
ジャノメ	15,100	683.00	10,313,300	
マックス	23,500	1,856.00	43,616,000	
グローリー	45,300	2,321.00	105,141,300	
新晃工業	16,400	1,930.00	31,652,000	
大和冷機工業	25,600	1,282.00	32,819,200	
セガサミーホールディングス	174,900	1,863.00	325,838,700	
日本ピストンリング	6,500	1,299.00	8,443,500	
リケン	7,600	2,715.00	20,634,000	
ＴＰＲ	23,800	1,452.00	34,557,600	
ツバキ・ナカシマ	38,700	1,592.00	61,610,400	
ホシザキ	51,500	9,110.00	469,165,000	
大豊工業	14,500	776.00	11,252,000	
日本精工	332,000	757.00	251,324,000	
ＮＴＮ	378,800	227.00	85,987,600	

ジェイテクト	169,200	1,003.00	169,707,600	
不二越	15,000	4,245.00	63,675,000	
日本トムソン	48,500	596.00	28,906,000	
ＴＨＫ	102,600	2,400.00	246,240,000	
ユーシン精機	13,800	762.00	10,515,600	
前澤給装工業	13,300	1,059.00	14,084,700	
イーグル工業	21,900	1,216.00	26,630,400	
前澤工業	10,700	661.00	7,072,700	
日本ピラー工業	17,900	2,853.00	51,068,700	
キッツ	59,500	769.00	45,755,500	
マキタ	214,600	5,188.00	1,113,344,800	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	63,700	430.00	27,391,000	
日立造船	149,500	838.00	125,281,000	
三菱重工業	277,100	2,829.00	783,915,900	
ＩＨＩ	110,200	2,563.00	282,442,600	
スター精密	27,200	1,492.00	40,582,400	
日清紡ホールディングス	107,800	889.00	95,834,200	
イビデン	92,700	6,880.00	637,776,000	
コニカミノルタ	387,100	506.00	195,872,600	
ブラザー工業	215,800	2,157.00	465,480,600	
ミネベアミツミ	304,200	3,105.00	944,541,000	
日立製作所	847,800	7,014.00	5,946,469,200	
東芝	308,100	4,903.00	1,510,614,300	
三菱電機	1,762,700	1,525.50	2,688,998,850	
富士電機	106,200	5,670.00	602,154,000	
東洋電機製造	6,900	1,017.00	7,017,300	
安川電機	189,700	5,040.00	956,088,000	
シンフォニアテクノロジー	21,200	1,342.00	28,450,400	
明電舎	29,900	2,669.00	79,803,100	
オリジン	4,500	1,336.00	6,012,000	
山洋電気	8,000	6,160.00	49,280,000	
デンヨー	15,000	1,961.00	29,415,000	
東芝テック	18,900	4,525.00	85,522,500	
芝浦メカトロニクス	3,300	7,730.00	25,509,000	
マブチモーター	41,600	3,775.00	157,040,000	
日本電産	457,000	12,805.00	5,851,885,000	
トレックス・セミコンダクター	9,300	2,682.00	24,942,600	
東光高岳	10,600	1,410.00	14,946,000	
ダイヘン	19,300	4,555.00	87,911,500	
ヤーマン	29,700	1,423.00	42,263,100	
ＪＶＣケンウッド	149,100	179.00	26,688,900	
ミマキエンジニアリング	17,000	996.00	16,932,000	

Ｉ－ＰＥＸ	8,800	2,035.00	17,908,000	
日新電機	41,300	1,437.00	59,348,100	
大崎電気工業	32,400	506.00	16,394,400	
オムロン	146,700	11,125.00	1,632,037,500	
日東工業	23,500	1,587.00	37,294,500	
ＩＤＥＣ	21,800	2,537.00	55,306,600	
正興電機製作所	6,400	1,225.00	7,840,000	
不二電機工業	4,200	1,268.00	5,325,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	59,300	2,167.00	128,503,100	
サクサホールディングス	4,100	1,422.00	5,830,200	
メルコホールディングス	5,100	4,275.00	21,802,500	
テクノメディカ	4,700	1,694.00	7,961,800	
日本電気	224,000	5,530.00	1,238,720,000	
富士通	158,600	20,485.00	3,248,921,000	
沖電気工業	71,600	958.00	68,592,800	
岩崎通信機	7,400	878.00	6,497,200	
電気興業	9,300	2,545.00	23,668,500	
サンケン電気	16,500	5,540.00	91,410,000	
ナカヨ	3,300	1,314.00	4,336,200	
アイホン	10,000	2,286.00	22,860,000	
ルネサスエレクトロニクス	955,000	1,453.00	1,387,615,000	
セイコーエプソン	218,700	1,941.00	424,496,700	
ワコム	138,200	804.00	111,112,800	
アルバック	32,400	6,600.00	213,840,000	
アクセル	9,000	758.00	6,822,000	
ＥＩＺＯ	13,700	4,195.00	57,471,500	
日本信号	44,900	925.00	41,532,500	
京三製作所	37,800	482.00	18,219,600	
能美防災	23,800	2,023.00	48,147,400	
ホーチキ	13,700	1,284.00	17,590,800	
星和電機	10,200	536.00	5,467,200	
エレコム	41,000	1,507.00	61,787,000	
パナソニック	1,880,200	1,380.00	2,594,676,000	
シャープ	200,900	1,316.00	264,384,400	
アンリツ	113,500	1,946.00	220,871,000	
富士通ゼネラル	47,900	2,728.00	130,671,200	
ソニーグループ	1,104,300	13,725.00	15,156,517,500	
ＴＤＫ	255,600	4,470.00	1,142,532,000	
帝国通信工業	8,600	1,331.00	11,446,600	
タムラ製作所	67,900	733.00	49,770,700	
アルプスアルパイン	156,900	1,085.00	170,236,500	
池上通信機	5,300	768.00	4,070,400	

鈴木	9,100	981.00	8,927,100	
メイコー	14,700	4,105.00	60,343,500	
日本トリム	3,600	3,440.00	12,384,000	
ローランド　ディー．ジー．	10,800	2,999.00	32,389,200	
フォスター電機	17,800	779.00	13,866,200	
ＳＭＫ	4,100	2,399.00	9,835,900	
ヨコオ	13,500	2,458.00	33,183,000	
ホシデン	43,500	1,280.00	55,680,000	
ヒロセ電機	27,200	18,770.00	510,544,000	
日本航空電子工業	40,400	1,831.00	73,972,400	
ＴＯＡ	19,300	813.00	15,690,900	
マクセル	35,800	1,338.00	47,900,400	
古野電気	21,900	1,212.00	26,542,800	
ユニデンホールディングス	3,900	3,300.00	12,870,000	
スミダコーポレーション	17,400	1,285.00	22,359,000	
アイコム	6,700	2,415.00	16,180,500	
リオン	7,200	2,307.00	16,610,400	
本多通信工業	16,100	455.00	7,325,500	
横河電機	176,400	2,290.00	403,956,000	
新電元工業	6,800	3,660.00	24,888,000	
アズビル	103,300	4,990.00	515,467,000	
東亜ディーケーケー	10,000	840.00	8,400,000	
日本光電工業	73,100	3,375.00	246,712,500	
チノー	5,600	1,438.00	8,052,800	
共和電業	16,900	400.00	6,760,000	
日本電子材料	8,600	2,196.00	18,885,600	
堀場製作所	32,600	7,700.00	251,020,000	
アドバンテスト	131,000	9,890.00	1,295,590,000	
小野測器	9,500	505.00	4,797,500	
エスペック	14,800	2,314.00	34,247,200	
キーエンス	159,700	70,660.00	11,284,402,000	
日置電機	8,600	8,430.00	72,498,000	
シスメックス	149,100	13,660.00	2,036,706,000	
日本マイクロニクス	31,400	1,635.00	51,339,000	
メガチップス	16,700	4,270.00	71,309,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,300	3,685.00	30,585,500	
澤藤電機	2,700	1,935.00	5,224,500	
原田工業	9,400	968.00	9,099,200	
コーセル	22,700	925.00	20,997,500	
イリソ電子工業	15,000	5,040.00	75,600,000	
オプテックスグループ	29,700	1,500.00	44,550,000	
千代田インテグレ	7,900	2,137.00	16,882,300	

アイ・オー・データ機器	7,700	894.00	6,883,800	
レーザーテック	77,400	26,565.00	2,056,131,000	
スタンレー電気	123,700	3,060.00	378,522,000	
岩崎電気	7,000	2,125.00	14,875,000	
ウシオ電機	90,900	2,245.00	204,070,500	
岡谷電機産業	15,900	345.00	5,485,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	18,700	303.00	5,666,100	
エノモト	5,500	1,880.00	10,340,000	
日本セラミック	16,800	2,884.00	48,451,200	
遠藤照明	9,100	1,104.00	10,046,400	
古河電池	13,300	1,496.00	19,896,800	
双信電機	9,100	651.00	5,924,100	
山一電機	13,400	2,050.00	27,470,000	
図研	11,700	4,280.00	50,076,000	
日本電子	36,800	9,010.00	331,568,000	
カシオ計算機	127,600	1,568.00	200,076,800	
ファナック	154,700	22,200.00	3,434,340,000	
日本シイエムケイ	37,200	524.00	19,492,800	
エンプラス	4,700	2,780.00	13,066,000	
大真空	24,800	1,181.00	29,288,800	
ローム	79,000	11,120.00	878,480,000	
浜松ホトニクス	126,600	6,800.00	860,880,000	
三井ハイテック	17,400	9,420.00	163,908,000	
新光電気工業	52,000	4,885.00	254,020,000	
京セラ	248,200	6,922.00	1,718,040,400	
太陽誘電	85,700	6,090.00	521,913,000	
村田製作所	517,900	8,425.00	4,363,307,500	
双葉電子工業	31,600	810.00	25,596,000	
北陸電気工業	7,700	1,060.00	8,162,000	
ニチコン	56,500	1,134.00	64,071,000	
日本ケミコン	16,700	2,006.00	33,500,200	
ＫＯＡ	27,300	1,616.00	44,116,800	
市光工業	23,100	563.00	13,005,300	
小糸製作所	97,000	6,450.00	625,650,000	
ミツバ	32,400	601.00	19,472,400	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	30,600	11,040.00	337,824,000	
キヤノン電子	16,900	1,579.00	26,685,100	
キヤノン	875,900	2,566.00	2,247,559,400	
リコー	489,200	1,094.00	535,184,800	
象印マホービン	48,400	1,631.00	78,940,400	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,900	1,621.00	4,700,900	
東京エレクトロン	111,900	56,000.00	6,266,400,000	

トヨタ紡織	71,900	2,237.00	160,840,300	
芦森工業	3,300	984.00	3,247,200	
ユニプレス	26,300	878.00	23,091,400	
豊田自動織機	142,700	9,800.00	1,398,460,000	
モリタホールディングス	28,200	1,401.00	39,508,200	
三櫻工業	24,400	983.00	23,985,200	
デンソー	388,100	8,241.00	3,198,332,100	
東海理化電機製作所	46,400	1,592.00	73,868,800	
川崎重工業	128,700	2,073.00	266,795,100	
名村造船所	52,900	215.00	11,373,500	
日本車輌製造	6,400	2,078.00	13,299,200	
三菱ロジスネクスト	23,300	1,043.00	24,301,900	
近畿車輛	2,700	1,066.00	2,878,200	
日産自動車	2,079,000	634.00	1,318,086,000	
いすゞ自動車	553,100	1,575.00	871,132,500	
トヨタ自動車	8,929,000	2,005.50	17,907,109,500	
日野自動車	220,100	1,079.00	237,487,900	
三菱自動車工業	652,500	377.00	245,992,500	
エフテック	12,300	543.00	6,678,900	
レシップホールディングス	7,000	574.00	4,018,000	
ＧＭＢ	3,200	761.00	2,435,200	
ファルテック	3,100	710.00	2,201,000	
武蔵精密工業	39,300	1,829.00	71,879,700	
日産車体	25,800	742.00	19,143,600	
新明和工業	49,800	912.00	45,417,600	
極東開発工業	32,700	1,524.00	49,834,800	
トピー工業	14,500	1,112.00	16,124,000	
ティラド	5,000	2,851.00	14,255,000	
曙ブレーキ工業	96,800	236.00	22,844,800	
タチエス	30,900	1,383.00	42,734,700	
ＮＯＫ	85,300	1,323.00	112,851,900	
フタバ産業	44,100	419.00	18,477,900	
ＫＹＢ	18,300	3,075.00	56,272,500	
大同メタル工業	33,800	598.00	20,212,400	
プレス工業	87,400	410.00	35,834,000	
ミクニ	22,400	319.00	7,145,600	
太平洋工業	36,900	1,158.00	42,730,200	
河西工業	21,600	325.00	7,020,000	
アイシン	129,000	4,070.00	525,030,000	
マツダ	553,200	1,034.00	572,008,800	
今仙電機製作所	12,100	618.00	7,477,800	
本田技研工業	1,387,900	3,260.00	4,524,554,000	

スズキ	403,200	5,273.00	2,126,073,600	
ＳＵＢＡＲＵ	505,200	2,163.50	1,093,000,200	
安永	8,500	1,057.00	8,984,500	
ヤマハ発動機	230,000	3,145.00	723,350,000	
ＴＢＫ	20,000	415.00	8,300,000	
エクセディ	26,600	1,697.00	45,140,200	
豊田合成	56,900	2,308.00	131,325,200	
愛三工業	27,600	789.00	21,776,400	
盟和産業	2,600	1,025.00	2,665,000	
日本プラスト	13,800	609.00	8,404,200	
ヨロズ	16,500	1,193.00	19,684,500	
エフ・シー・シー	28,800	1,535.00	44,208,000	
シマノ	71,000	31,320.00	2,223,720,000	
テイ・エス　テック	74,400	1,377.00	102,448,800	
ジャムコ	10,300	985.00	10,145,500	
テルモ	498,800	4,753.00	2,370,796,400	
クリエートメディック	5,300	980.00	5,194,000	
日機装	52,900	1,000.00	52,900,000	
日本エム・ディ・エム	10,200	2,140.00	21,828,000	
島津製作所	226,900	4,665.00	1,058,488,500	
ＪＭＳ	14,900	635.00	9,461,500	
長野計器	12,800	1,399.00	17,907,200	
ブイ・テクノロジー	7,700	3,765.00	28,990,500	
東京計器	11,200	1,001.00	11,211,200	
愛知時計電機	2,500	4,490.00	11,225,000	
インターアクション	8,800	2,419.00	21,287,200	
オーバル	15,900	256.00	4,070,400	
東京精密	29,800	5,230.00	155,854,000	
マニー	70,200	1,887.00	132,467,400	
ニコン	269,200	1,160.00	312,272,000	
トプコン	82,900	1,952.00	161,820,800	
オリンパス	924,400	2,570.00	2,375,708,000	
理研計器	14,300	3,065.00	43,829,500	
タムロン	13,700	2,509.00	34,373,300	
ＨＯＹＡ	344,000	17,530.00	6,030,320,000	
シード	8,300	613.00	5,087,900	
ノーリツ鋼機	15,900	2,474.00	39,336,600	
エー・アンド・デイ	16,100	1,326.00	21,348,600	
朝日インテック	193,300	2,840.00	548,972,000	
シチズン時計	206,500	465.00	96,022,500	
リズム	5,500	1,355.00	7,452,500	
大研医器	14,000	562.00	7,868,000	

メニコン	58,400	4,265.00	249,076,000	
シンシア	1,900	580.00	1,102,000	
松風	7,400	2,318.00	17,153,200	
セイコーホールディングス	24,900	2,211.00	55,053,900	
ニプロ	131,400	1,133.00	148,876,200	
中本パックス	4,900	1,700.00	8,330,000	
スノーピーク	11,500	6,230.00	71,645,000	
パラマウントベッドホールディングス	33,800	2,009.00	67,904,200	
トランザクション	9,600	1,126.00	10,809,600	
粧美堂	5,100	405.00	2,065,500	
ニホンフラッシュ	15,100	1,094.00	16,519,400	
前田工繊	19,400	3,500.00	67,900,000	
永大産業	23,000	294.00	6,762,000	
アートネイチャー	15,100	685.00	10,343,500	
バンダイナムコホールディングス	157,900	9,274.00	1,464,364,600	
アイフィスジャパン	4,500	678.00	3,051,000	
共立印刷	29,500	154.00	4,543,000	
ＳＨＯＥＩ	16,500	5,030.00	82,995,000	
フランスベッドホールディングス	22,700	899.00	20,407,300	
パイロットコーポレーション	29,700	4,170.00	123,849,000	
萩原工業	11,400	1,482.00	16,894,800	
トッパン・フォームズ	25,200	1,022.00	25,754,400	
フジシールインターナショナル	42,800	2,465.00	105,502,000	
タカラトミー	73,800	1,056.00	77,932,800	
広済堂ホールディングス	10,900	916.00	9,984,400	
エステールホールディングス	4,500	642.00	2,889,000	
タカノ	6,000	717.00	4,302,000	
プロネクサス	13,700	1,049.00	14,371,300	
ホクシン	12,400	175.00	2,170,000	
ウッドワン	5,400	1,007.00	5,437,800	
大建工業	10,400	2,434.00	25,313,600	
凸版印刷	267,900	1,787.00	478,737,300	
大日本印刷	208,300	2,822.00	587,822,600	
共同印刷	5,400	2,740.00	14,796,000	
ＮＩＳＳＨＡ	36,200	1,855.00	67,151,000	
光村印刷	1,500	1,530.00	2,295,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,600	1,807.00	15,540,200	
アシックス	155,900	2,891.00	450,706,900	
ツツミ	4,400	2,236.00	9,838,400	
ローランド	12,200	4,935.00	60,207,000	
小松ウオール工業	5,400	1,942.00	10,486,800	
ヤマハ	104,800	6,350.00	665,480,000	

河合楽器製作所	4,900	3,470.00	17,003,000	
クリナップ	16,400	519.00	8,511,600	
ピジョン	106,500	2,454.00	261,351,000	
兼松サステック	1,100	1,799.00	1,978,900	
キングジム	14,200	893.00	12,680,600	
リンテック	37,800	2,513.00	94,991,400	
イトーキ	32,500	366.00	11,895,000	
任天堂	99,500	49,740.00	4,949,130,000	
三菱鉛筆	29,000	1,272.00	36,888,000	
タカラスタンダード	36,400	1,438.00	52,343,200	
コクヨ	84,600	1,727.00	146,104,200	
ナカバヤシ	16,000	550.00	8,800,000	
グローブライド	15,800	3,460.00	54,668,000	
オカムラ	60,600	1,375.00	83,325,000	
美津濃	17,500	2,673.00	46,777,500	
東京電力ホールディングス	1,319,300	306.00	403,705,800	
中部電力	539,300	1,141.00	615,341,300	
関西電力	667,900	1,051.00	701,962,900	
中国電力	275,500	868.00	239,134,000	
北陸電力	161,200	532.00	85,758,400	
東北電力	412,800	741.00	305,884,800	
四国電力	158,700	698.00	110,772,600	
九州電力	363,300	811.00	294,636,300	
北海道電力	153,200	454.00	69,552,800	
沖縄電力	37,400	1,394.00	52,135,600	
電源開発	150,300	1,442.00	216,732,600	
エフオン	10,700	786.00	8,410,200	
イーレックス	25,900	2,380.00	61,642,000	
レノバ	34,400	5,280.00	181,632,000	
東京瓦斯	337,900	1,986.00	671,069,400	
大阪瓦斯	319,300	1,827.00	583,361,100	
東邦瓦斯	80,900	3,220.00	260,498,000	
北海道瓦斯	8,700	1,516.00	13,189,200	
広島ガス	33,800	367.00	12,404,600	
西部ガスホールディングス	19,800	2,184.00	43,243,200	
静岡ガス	45,900	1,132.00	51,958,800	
メタウォーター	19,800	2,026.00	40,114,800	
ＳＢＳホールディングス	13,000	3,660.00	47,580,000	
東武鉄道	172,200	2,776.00	478,027,200	
相鉄ホールディングス	56,400	2,127.00	119,962,800	
東急	444,600	1,682.00	747,817,200	
京浜急行電鉄	226,400	1,272.00	287,980,800	

小田急電鉄	262,200	2,293.00	601,224,600	
京王電鉄	91,500	5,350.00	489,525,000	
京成電鉄	122,700	3,540.00	434,358,000	
富士急行	21,000	4,940.00	103,740,000	
新京成電鉄	4,100	2,034.00	8,339,400	
東日本旅客鉄道	310,300	7,103.00	2,204,060,900	
西日本旅客鉄道	213,700	5,381.00	1,149,919,700	
東海旅客鉄道	146,600	16,925.00	2,481,205,000	
西武ホールディングス	230,100	1,300.00	299,130,000	
鴻池運輸	28,100	1,211.00	34,029,100	
西日本鉄道	48,900	2,764.00	135,159,600	
ハマキョウレックス	12,500	3,065.00	38,312,500	
サカイ引越センター	8,100	4,585.00	37,138,500	
近鉄グループホールディングス	167,000	3,560.00	594,520,000	
阪急阪神ホールディングス	208,700	3,570.00	745,059,000	
南海電気鉄道	74,500	2,203.00	164,123,500	
京阪ホールディングス	74,300	2,980.00	221,414,000	
神戸電鉄	4,000	3,435.00	13,740,000	
名古屋鉄道	137,300	1,946.00	267,185,800	
山陽電気鉄道	12,800	2,007.00	25,689,600	
アルプス物流	11,600	1,042.00	12,087,200	
日本通運	57,800	7,000.00	404,600,000	
ヤマトホールディングス	233,900	2,756.00	644,628,400	
山九	46,400	4,750.00	220,400,000	
丸運	9,500	263.00	2,498,500	
丸全昭和運輸	13,500	3,445.00	46,507,500	
センコーグループホールディングス	83,700	985.00	82,444,500	
トナミホールディングス	4,000	4,215.00	16,860,000	
ニッコンホールディングス	56,000	2,124.00	118,944,000	
日本石油輸送	1,800	2,696.00	4,852,800	
福山通運	27,500	4,545.00	124,987,500	
セイノーホールディングス	113,700	1,348.00	153,267,600	
エスライン	5,000	916.00	4,580,000	
神奈川中央交通	4,100	3,425.00	14,042,500	
日立物流	32,200	4,470.00	143,934,000	
丸和運輸機関	35,300	1,480.00	52,244,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	16,900	1,635.00	27,631,500	
九州旅客鉄道	129,100	2,641.00	340,953,100	
ＳＧホールディングス	315,400	2,663.00	839,910,200	
日本郵船	140,000	7,600.00	1,064,000,000	
商船三井	92,900	6,780.00	629,862,000	
川崎汽船	51,400	5,220.00	268,308,000	

ＮＳユナイテッド海運	10,000	3,315.00	33,150,000	
飯野海運	83,400	507.00	42,283,800	
共栄タンカー	6,100	900.00	5,490,000	
乾汽船	11,400	2,028.00	23,119,200	
日本航空	382,800	2,527.00	967,335,600	
ＡＮＡホールディングス	424,100	2,766.00	1,173,060,600	
パスコ	3,200	1,421.00	4,547,200	
トランコム	4,700	8,540.00	40,138,000	
日新	13,300	1,745.00	23,208,500	
三菱倉庫	53,000	3,010.00	159,530,000	
三井倉庫ホールディングス	17,700	2,362.00	41,807,400	
住友倉庫	59,000	1,891.00	111,569,000	
澁澤倉庫	10,000	2,196.00	21,960,000	
東陽倉庫	28,000	327.00	9,156,000	
日本トランスシティ	36,700	604.00	22,166,800	
ケイヒン	3,000	1,413.00	4,239,000	
中央倉庫	10,200	966.00	9,853,200	
川西倉庫	3,100	1,201.00	3,723,100	
安田倉庫	13,700	955.00	13,083,500	
ファイズホールディングス	3,600	700.00	2,520,000	
東洋埠頭	5,100	1,438.00	7,333,800	
宇徳	11,900	520.00	6,188,000	
上組	91,800	2,261.00	207,559,800	
サンリツ	4,600	834.00	3,836,400	
キムラユニティー	4,500	1,301.00	5,854,500	
キユーソー流通システム	4,200	2,012.00	8,450,400	
近鉄エクスプレス	31,500	2,639.00	83,128,500	
東海運	9,500	307.00	2,916,500	
エーアイテイー	10,500	1,138.00	11,949,000	
内外トランスライン	6,400	1,946.00	12,454,400	
日本コンセプト	5,300	1,678.00	8,893,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	57,300	1,895.00	108,583,500	
クロスキャット	4,700	1,242.00	5,837,400	
システナ	61,800	2,035.00	125,763,000	
デジタルアーツ	9,300	9,890.00	91,977,000	
日鉄ソリューションズ	25,100	3,530.00	88,603,000	
キューブシステム	8,900	981.00	8,730,900	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	2,600	1,610.00	4,186,000	
コア	7,400	1,679.00	12,424,600	
ラクーンホールディングス	12,400	1,623.00	20,125,200	
ソリトンシステムズ	8,800	1,309.00	11,519,200	
ソフトクリエイトホールディングス	7,600	4,175.00	31,730,000	

ＴＩＳ	165,000	3,260.00	537,900,000	
ＪＮＳホールディングス	8,000	486.00	3,888,000	
グリー	106,300	985.00	104,705,500	
GMOペパボ	1,900	2,968.00	5,639,200	
コーエーテクモホールディングス	55,200	5,200.00	287,040,000	
三菱総合研究所	7,500	3,965.00	29,737,500	
電算	2,000	2,311.00	4,622,000	
ＡＧＳ	9,000	878.00	7,902,000	
ファインデックス	14,800	948.00	14,030,400	
ブレインパッド	4,500	5,700.00	25,650,000	
ＫＬａｂ	31,700	654.00	20,731,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	25,200	1,015.00	25,578,000	
イーブックイニシアティブジャパン	3,200	4,740.00	15,168,000	
ネクソン	389,800	2,383.00	928,893,400	
アイスタイル	53,200	339.00	18,034,800	
エムアップホールディングス	5,000	3,990.00	19,950,000	
エイチーム	12,000	1,830.00	21,960,000	
エニグモ	18,900	1,112.00	21,016,800	
テクノスジャパン	13,700	577.00	7,904,900	
コロプラ	57,100	766.00	43,738,600	
ブロードリーフ	86,100	566.00	48,732,600	
クロス・マーケティンググループ	6,800	864.00	5,875,200	
デジタルハーツホールディングス	8,000	2,269.00	18,152,000	
システム情報	13,200	953.00	12,579,600	
メディアドゥ	6,100	4,910.00	29,951,000	
じげん	49,400	418.00	20,649,200	
ブイキューブ	17,600	1,240.00	21,824,000	
エンカレッジ・テクノロジ	4,100	655.00	2,685,500	
サイバーリンクス	5,900	1,203.00	7,097,700	
フィックスターズ	18,700	733.00	13,707,100	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,000	2,556.00	17,892,000	
オプティム	12,200	1,723.00	21,020,600	
セレス	6,400	2,858.00	18,291,200	
ＳＨＩＦＴ	8,700	27,620.00	240,294,000	
ティーガイア	15,400	1,794.00	27,627,600	
セック	2,600	2,485.00	6,461,000	
テクマトリックス	29,300	1,804.00	52,857,200	
プロシップ	5,800	1,605.00	9,309,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	47,000	2,245.00	105,515,000	
GMOペイメントゲートウェイ	33,500	14,720.00	493,120,000	
ザッパラス	7,100	541.00	3,841,100	
システムリサーチ	5,100	1,900.00	9,690,000	

インターネットイニシアティブ	46,100	4,575.00	210,907,500	
さくらインターネット	18,900	575.00	10,867,500	
ヴィンクス	5,000	1,008.00	5,040,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	4,555.00	17,764,500	
ＳＲＡホールディングス	8,400	2,920.00	24,528,000	
システムインテグレータ	5,800	612.00	3,549,600	
朝日ネット	16,000	695.00	11,120,000	
ｅＢＡＳＥ	20,900	704.00	14,713,600	
アバント	18,600	1,360.00	25,296,000	
アドソル日進	6,300	1,927.00	12,140,100	
ＯＤＫソリューションズ	3,900	680.00	2,652,000	
フリービット	10,400	1,309.00	13,613,600	
コムチュア	19,500	3,355.00	65,422,500	
サイバーコム	2,800	1,226.00	3,432,800	
アステリア	12,700	711.00	9,029,700	
アイル	9,700	1,650.00	16,005,000	
マークラインズ	8,700	3,215.00	27,970,500	
メディカル・データ・ビジョン	22,000	1,452.00	31,944,000	
ｇｕｍｉ	24,200	888.00	21,489,600	
ショーケース	4,100	555.00	2,275,500	
モバイルファクトリー	4,100	1,046.00	4,288,600	
テラスカイ	6,400	2,473.00	15,827,200	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,564.00	12,199,200	
ＰＣＩホールディングス	7,900	1,037.00	8,192,300	
パイプドＨＤ	3,200	2,900.00	9,280,000	
アイビーシー	3,000	894.00	2,682,000	
ネオジャパン	5,000	1,304.00	6,520,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,700	3,535.00	13,079,500	
ラクス	59,600	3,590.00	213,964,000	
ランドコンピュータ	4,200	817.00	3,431,400	
ダブルスタンダード	5,300	3,640.00	19,292,000	
オープンドア	10,300	2,828.00	29,128,400	
マイネット	6,200	651.00	4,036,200	
アカツキ	7,800	3,220.00	25,116,000	
ベネフィットジャパン	1,400	2,715.00	3,801,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,600	2,838.00	13,054,800	
カナミックネットワーク	18,800	596.00	11,204,800	
ノムラシステムコーポレーション	9,500	285.00	2,707,500	
チェンジ	31,900	1,886.00	60,163,400	
シンクロ・フード	9,300	358.00	3,329,400	
オークネット	9,300	1,865.00	17,344,500	
キャピタル・アセット・プランニング	3,700	844.00	3,122,800	

セグエグループ	4,700	777.00	3,651,900	
エイトレッド	2,500	2,387.00	5,967,500	
マクロミル	35,600	912.00	32,467,200	
ビーグリー	4,200	1,644.00	6,904,800	
オロ	5,500	3,820.00	21,010,000	
ユーザーローカル	5,300	1,866.00	9,889,800	
テモナ	4,000	702.00	2,808,000	
ニーズウェル	4,200	693.00	2,910,600	
マネーフォワード	26,300	7,820.00	205,666,000	
サインポスト	5,500	1,802.00	9,911,000	
電算システムホールディングス	7,200	2,609.00	18,784,800	
ソルクシーズ	15,000	500.00	7,500,000	
フェイス	5,200	649.00	3,374,800	
プロトコーポレーション	18,500	1,373.00	25,400,500	
ハイマックス	4,800	1,167.00	5,601,600	
野村総合研究所	334,300	4,635.00	1,549,480,500	
サイバネットシステム	12,600	701.00	8,832,600	
ＣＥホールディングス	9,500	489.00	4,645,500	
日本システム技術	3,500	2,217.00	7,759,500	
インテージホールディングス	21,700	1,929.00	41,859,300	
東邦システムサイエンス	4,700	1,003.00	4,714,100	
ソースネクスト	75,500	193.00	14,571,500	
インフォコム	19,000	2,199.00	41,781,000	
シンプレクス・ホールディングス	18,000	2,940.00	52,920,000	
ＨＥＲＯＺ	5,000	1,691.00	8,455,000	
ラクスル	18,900	6,830.00	129,087,000	
ＩＰＳ	4,900	1,716.00	8,408,400	
ＦＩＧ	19,400	322.00	6,246,800	
システムサポート	5,300	1,365.00	7,234,500	
イーソル	10,800	781.00	8,434,800	
アルテリア・ネットワークス	22,000	1,632.00	35,904,000	
ＥｄｕＬａｂ	1,600	1,541.00	2,465,600	
東海ソフト	2,900	1,153.00	3,343,700	
ウイングアーク１ｓｔ	9,900	2,202.00	21,799,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,000	2,532.00	10,128,000	
サーバーワークス	3,000	4,345.00	13,035,000	
東名	1,800	1,265.00	2,277,000	
ヴィッツ	1,700	1,581.00	2,687,700	
トビラシステムズ	3,600	1,009.00	3,632,400	
Ｓａｎｓａｎ	15,400	13,490.00	207,746,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,200	1,188.00	3,801,600	
ギフティ	15,100	3,825.00	57,757,500	

ベース	3,000	5,070.00	15,210,000	
フォーカスシステムズ	11,800	1,038.00	12,248,400	
クレスコ	12,700	2,109.00	26,784,300	
フジ・メディア・ホールディングス	166,800	1,275.00	212,670,000	
オービック	54,500	20,580.00	1,121,610,000	
ジャストシステム	24,600	5,780.00	142,188,000	
ＴＤＣソフト	15,300	1,236.00	18,910,800	
Ｚホールディングス	2,514,400	798.30	2,007,245,520	
トレンドマイクロ	92,500	6,510.00	602,175,000	
ＩＤホールディングス	11,100	906.00	10,056,600	
日本オラクル	35,100	10,360.00	363,636,000	
アルファシステムズ	4,700	4,415.00	20,750,500	
フューチャー	18,300	3,930.00	71,919,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10,200	1,644.00	16,768,800	
ＳＢテクノロジー	7,500	3,010.00	22,575,000	
トーセ	4,900	790.00	3,871,000	
オービックビジネスコンサルタント	16,500	5,350.00	88,275,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	78,900	3,725.00	293,902,500	
アイティフォー	21,200	878.00	18,613,600	
東計電算	2,100	4,830.00	10,143,000	
エックスネット	2,900	1,000.00	2,900,000	
大塚商会	93,600	5,260.00	492,336,000	
サイボウズ	23,200	2,666.00	61,851,200	
電通国際情報サービス	25,000	3,965.00	99,125,000	
ＡＣＣＥＳＳ	19,700	867.00	17,079,900	
デジタルガレージ	28,600	5,430.00	155,298,000	
ＥＭシステムズ	28,800	748.00	21,542,400	
ウェザーニューズ	5,200	8,680.00	45,136,000	
ＣＩＪ	11,400	851.00	9,701,400	
ビジネスエンジニアリング	2,000	3,460.00	6,920,000	
日本エンタープライズ	18,500	195.00	3,607,500	
WOWOW	8,400	2,230.00	18,732,000	
スカラ	15,700	710.00	11,147,000	
インテリジェント　ウェイブ	10,400	548.00	5,699,200	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	15,000	657.00	9,855,000	
ネットワンシステムズ	65,900	3,825.00	252,067,500	
システムソフト	38,200	134.00	5,118,800	
アルゴグラフィックス	13,500	3,070.00	41,445,000	
マーベラス	27,500	768.00	21,120,000	
エイベックス	30,000	1,763.00	52,890,000	
日本ユニシス	54,100	3,410.00	184,481,000	
兼松エレクトロニクス	9,500	3,695.00	35,102,500	

都築電気	8,900	1,848.00	16,447,200	
ＴＢＳホールディングス	105,300	1,875.00	197,437,500	
日本テレビホールディングス	144,500	1,286.00	185,827,000	
朝日放送グループホールディングス	17,400	716.00	12,458,400	
テレビ朝日ホールディングス	41,700	1,778.00	74,142,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	146,900	432.00	63,460,800	
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,211.00	27,637,500	
日本ＢＳ放送	6,000	1,111.00	6,666,000	
ビジョン	29,700	1,402.00	41,639,400	
スマートバリュー	4,800	571.00	2,740,800	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	16,500	3,480.00	57,420,000	
ワイヤレスゲート	7,600	355.00	2,698,000	
コネクシオ	12,400	1,450.00	17,980,000	
クロップス	3,400	989.00	3,362,600	
日本電信電話	2,023,200	3,225.00	6,524,820,000	
ＫＤＤＩ	1,261,100	3,415.00	4,306,656,500	
ソフトバンク	2,620,100	1,513.00	3,964,211,300	
光通信	20,400	18,280.00	372,912,000	
エムティーアイ	17,000	654.00	11,118,000	
GMOインターネット	61,300	3,200.00	196,160,000	
ファイバーゲート	5,700	1,327.00	7,563,900	
アイドママーケティングコミュニケーション	4,200	371.00	1,558,200	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	50,500	6,560.00	331,280,000	
学研ホールディングス	24,600	1,094.00	26,912,400	
ゼンリン	28,400	1,031.00	29,280,400	
昭文社ホールディングス	7,400	498.00	3,685,200	
インプレスホールディングス	14,300	244.00	3,489,200	
アイネット	9,000	1,390.00	12,510,000	
松竹	11,500	12,260.00	140,990,000	
東宝	102,100	5,600.00	571,760,000	
東映	5,700	23,500.00	133,950,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	460,600	2,419.00	1,114,191,400	
ピー・シー・エー	10,200	1,595.00	16,269,000	
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,896.00	11,376,000	
ＤＴＳ	33,200	2,434.00	80,808,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	80,500	6,470.00	520,835,000	
シーイーシー	18,700	1,356.00	25,357,200	
カプコン	163,100	3,170.00	517,027,000	
アイ・エス・ビー	8,200	1,125.00	9,225,000	
ジャステック	10,200	1,302.00	13,280,400	
ＳＣＳＫ	119,800	2,157.00	258,408,600	
日本システムウエア	6,600	2,364.00	15,602,400	

アイネス	15,800	1,444.00	22,815,200	
ＴＫＣ	29,300	3,350.00	98,155,000	
富士ソフト	18,500	5,800.00	107,300,000	
ＮＳＤ	55,700	2,173.00	121,036,100	
コナミホールディングス	62,900	6,330.00	398,157,000	
福井コンピュータホールディングス	8,000	3,975.00	31,800,000	
ＪＢＣＣホールディングス	11,800	1,720.00	20,296,000	
ミロク情報サービス	15,300	1,841.00	28,167,300	
ソフトバンクグループ	1,037,300	6,554.00	6,798,464,200	
ホウスイ	1,400	925.00	1,295,000	
高千穂交易	6,700	1,246.00	8,348,200	
オルバヘルスケアホールディングス	2,800	1,554.00	4,351,200	
伊藤忠食品	4,200	5,120.00	21,504,000	
エレマテック	13,900	1,086.00	15,095,400	
ＪＡＬＵＸ	4,900	2,553.00	12,509,700	
あらた	13,800	4,075.00	56,235,000	
トーメンデバイス	2,600	6,110.00	15,886,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,200	7,240.00	37,648,000	
フィールズ	15,200	524.00	7,964,800	
双日	191,800	1,676.00	321,456,800	
アルフレッサ　ホールディングス	193,000	1,644.00	317,292,000	
横浜冷凍	48,700	873.00	42,515,100	
ラサ商事	9,200	916.00	8,427,200	
アルコニックス	18,500	1,598.00	29,563,000	
神戸物産	134,800	4,225.00	569,530,000	
ハイパー	4,400	556.00	2,446,400	
あい　ホールディングス	24,800	2,175.00	53,940,000	
ディーブイエックス	5,900	1,100.00	6,490,000	
ダイワボウホールディングス	84,400	1,852.00	156,308,800	
マクニカ・富士エレホールディングス	41,400	2,601.00	107,681,400	
ラクト・ジャパン	6,000	2,591.00	15,546,000	
グリムス	7,700	2,624.00	20,204,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,200	780.00	23,556,000	
八洲電機	12,600	928.00	11,692,800	
メディアスホールディングス	9,900	947.00	9,375,300	
レスターホールディングス	16,500	1,887.00	31,135,500	
ジューテックホールディングス	4,000	1,121.00	4,484,000	
大光	6,700	719.00	4,817,300	
ＯＣＨＩホールディングス	5,100	1,263.00	6,441,300	
ＴＯＫＡＩホールディングス	84,100	866.00	72,830,600	
黒谷	4,800	645.00	3,096,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,100	730.00	2,263,000	

三洋貿易	17,500	1,015.00	17,762,500	
ビューティガレージ	2,800	4,050.00	11,340,000	
ウイン・パートナーズ	12,600	928.00	11,692,800	
ミタチ産業	4,800	932.00	4,473,600	
シップヘルスケアホールディングス	55,700	2,773.00	154,456,100	
明治電機工業	5,600	1,313.00	7,352,800	
デリカフーズホールディングス	6,800	620.00	4,216,000	
スターティアホールディングス	4,000	1,350.00	5,400,000	
コメダホールディングス	37,900	2,033.00	77,050,700	
ピーバンドットコム	2,400	675.00	1,620,000	
アセンテック	6,000	1,348.00	8,088,000	
富士興産	4,300	1,078.00	4,635,400	
協栄産業	1,800	1,498.00	2,696,400	
フルサト・マルカホールディングス	16,700	2,035.00	33,984,500	
ヤマエグループホールディングス	11,700	1,126.00	13,174,200	
小野建	16,800	1,625.00	27,300,000	
南陽	3,500	1,996.00	6,986,000	
佐鳥電機	10,800	1,085.00	11,718,000	
エコートレーディング	3,700	638.00	2,360,600	
伯東	10,600	2,200.00	23,320,000	
コンドーテック	13,400	1,010.00	13,534,000	
中山福	9,200	383.00	3,523,600	
ナガイレーベン	23,000	2,381.00	54,763,000	
三菱食品	16,700	2,873.00	47,979,100	
松田産業	12,700	3,310.00	42,037,000	
第一興商	33,000	4,175.00	137,775,000	
メディパルホールディングス	187,400	2,041.00	382,483,400	
ＳＰＫ	6,900	1,364.00	9,411,600	
萩原電気ホールディングス	6,400	2,205.00	14,112,000	
アズワン	12,500	14,880.00	186,000,000	
スズデン	6,000	1,696.00	10,176,000	
尾家産業	4,900	1,052.00	5,154,800	
シモジマ	10,700	1,128.00	12,069,600	
ドウシシャ	16,400	1,637.00	26,846,800	
小津産業	3,800	1,908.00	7,250,400	
高速	10,400	1,523.00	15,839,200	
たけびし	6,500	1,458.00	9,477,000	
リックス	3,900	1,512.00	5,896,800	
丸文	15,400	841.00	12,951,400	
ハピネット	14,500	1,545.00	22,402,500	
橋本総業ホールディングス	3,500	2,087.00	7,304,500	
日本ライフライン	51,500	1,173.00	60,409,500	

タカショー	13,200	821.00	10,837,200	
ＩＤＯＭ	52,700	771.00	40,631,700	
進和	10,300	2,111.00	21,743,300	
エスケイジャパン	4,300	485.00	2,085,500	
ダイトロン	7,300	2,108.00	15,388,400	
シークス	24,900	1,276.00	31,772,400	
田中商事	5,400	669.00	3,612,600	
オーハシテクニカ	9,700	1,490.00	14,453,000	
白銅	5,600	2,880.00	16,128,000	
ダイコー通産	2,100	1,175.00	2,467,500	
伊藤忠商事	1,214,400	3,314.00	4,024,521,600	
丸紅	1,712,600	1,000.50	1,713,456,300	
高島	2,700	2,217.00	5,985,900	
長瀬産業	95,300	1,752.00	166,965,600	
蝶理	9,700	1,826.00	17,712,200	
豊田通商	174,400	5,170.00	901,648,000	
三共生興	23,100	551.00	12,728,100	
兼松	64,700	1,286.00	83,204,200	
ツカモトコーポレーション	2,900	1,340.00	3,886,000	
三井物産	1,348,300	2,457.50	3,313,447,250	
日本紙パルプ商事	9,100	3,810.00	34,671,000	
カメイ	20,600	1,111.00	22,886,600	
東都水産	900	4,505.00	4,054,500	
ＯＵＧホールディングス	2,500	2,680.00	6,700,000	
スターゼン	12,800	2,064.00	26,419,200	
山善	73,100	1,030.00	75,293,000	
椿本興業	3,600	3,735.00	13,446,000	
住友商事	1,095,800	1,622.00	1,777,387,600	
内田洋行	7,400	4,820.00	35,668,000	
三菱商事	1,301,000	3,355.00	4,364,855,000	
第一実業	7,900	5,060.00	39,974,000	
キヤノンマーケティングジャパン	43,100	2,286.00	98,526,600	
西華産業	9,100	1,632.00	14,851,200	
佐藤商事	14,400	1,176.00	16,934,400	
菱洋エレクトロ	10,300	2,341.00	24,112,300	
東京産業	15,800	745.00	11,771,000	
ユアサ商事	16,500	2,952.00	48,708,000	
神鋼商事	3,900	3,340.00	13,026,000	
トルク	9,400	220.00	2,068,000	
阪和興業	34,800	3,355.00	116,754,000	
正栄食品工業	11,200	4,035.00	45,192,000	
カナデン	14,100	1,046.00	14,748,600	

菱電商事	13,800	1,741.00	24,025,800	
岩谷産業	41,700	6,500.00	271,050,000	
ナイス	6,000	1,771.00	10,626,000	
ニチモウ	2,600	2,099.00	5,457,400	
極東貿易	5,000	2,465.00	12,325,000	
アステナホールディングス	24,500	567.00	13,891,500	
三愛石油	42,800	1,348.00	57,694,400	
稲畑産業	38,300	1,602.00	61,356,600	
ＧＳＩクレオス	8,300	862.00	7,154,600	
明和産業	16,100	813.00	13,089,300	
クワザワホールディングス	6,900	670.00	4,623,000	
ワキタ	37,100	1,026.00	38,064,600	
東邦ホールディングス	55,700	1,782.00	99,257,400	
サンゲツ	46,300	1,566.00	72,505,800	
ミツウロコグループホールディングス	25,600	1,289.00	32,998,400	
シナネンホールディングス	6,400	3,400.00	21,760,000	
伊藤忠エネクス	38,400	996.00	38,246,400	
サンリオ	53,600	2,726.00	146,113,600	
サンワテクノス	10,600	1,528.00	16,196,800	
リョーサン	19,200	2,390.00	45,888,000	
新光商事	26,000	865.00	22,490,000	
トーホー	7,900	1,525.00	12,047,500	
三信電気	8,000	1,557.00	12,456,000	
東陽テクニカ	17,200	1,121.00	19,281,200	
モスフードサービス	22,800	3,115.00	71,022,000	
加賀電子	15,700	2,930.00	46,001,000	
ソーダニッカ	18,000	618.00	11,124,000	
立花エレテック	13,900	1,603.00	22,281,700	
フォーバル	7,600	1,167.00	8,869,200	
ＰＡＬＴＡＣ	24,400	4,870.00	118,828,000	
三谷産業	20,400	342.00	6,976,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,900	3,970.00	15,483,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	2,006.00	3,209,600	
コーア商事ホールディングス	13,100	670.00	8,777,000	
国際紙パルプ商事	37,100	399.00	14,802,900	
ヤマタネ	8,100	1,588.00	12,862,800	
丸紅建材リース	1,600	1,861.00	2,977,600	
日鉄物産	12,400	4,800.00	59,520,000	
泉州電業	4,900	4,595.00	22,515,500	
トラスコ中山	36,100	2,673.00	96,495,300	
オートバックスセブン	58,400	1,408.00	82,227,200	
モリト	12,700	688.00	8,737,600	

加藤産業	25,100	3,155.00	79,190,500	
北恵	4,400	989.00	4,351,600	
イノテック	10,500	1,395.00	14,647,500	
イエローハット	30,100	1,720.00	51,772,000	
ＪＫホールディングス	14,000	964.00	13,496,000	
日伝	14,400	2,242.00	32,284,800	
北沢産業	11,900	246.00	2,927,400	
杉本商事	8,100	2,260.00	18,306,000	
因幡電機産業	46,300	2,627.00	121,630,100	
東テク	5,800	2,593.00	15,039,400	
ミスミグループ本社	217,800	4,790.00	1,043,262,000	
アルテック	11,800	310.00	3,658,000	
タキヒヨー	5,200	1,744.00	9,068,800	
蔵王産業	3,400	1,862.00	6,330,800	
スズケン	67,900	3,070.00	208,453,000	
ジェコス	12,000	820.00	9,840,000	
グローセル	20,300	405.00	8,221,500	
ローソン	38,500	5,910.00	227,535,000	
サンエー	13,200	4,210.00	55,572,000	
カワチ薬品	13,600	2,281.00	31,021,600	
エービーシー・マート	27,200	5,510.00	149,872,000	
ハードオフコーポレーション	8,200	768.00	6,297,600	
アスクル	28,300	1,554.00	43,978,200	
ゲオホールディングス	23,600	1,213.00	28,626,800	
アダストリア	18,900	2,098.00	39,652,200	
くら寿司	18,200	3,710.00	67,522,000	
キャンドゥ	8,400	2,557.00	21,478,800	
アイケイ	5,800	499.00	2,894,200	
パルグループホールディングス	15,500	1,666.00	25,823,000	
エディオン	80,100	1,080.00	86,508,000	
サーラコーポレーション	35,900	625.00	22,437,500	
ワッツ	9,000	761.00	6,849,000	
ハローズ	8,100	2,760.00	22,356,000	
フジオフードグループ本社	14,600	1,389.00	20,279,400	
あみやき亭	4,300	2,993.00	12,869,900	
大黒天物産	5,600	6,590.00	36,904,000	
ハニーズホールディングス	14,100	1,102.00	15,538,200	
ファーマライズホールディングス	4,700	807.00	3,792,900	
アルペン	13,400	2,401.00	32,173,400	
ハブ	6,200	730.00	4,526,000	
クオールホールディングス	21,500	1,622.00	34,873,000	
ジンズホールディングス	11,900	7,400.00	88,060,000	

ビックカメラ	103,400	1,011.00	104,537,400	
ＤＣＭホールディングス	107,500	1,119.00	120,292,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	219,600	2,461.00	540,435,600	
東京一番フーズ	5,100	594.00	3,029,400	
きちりホールディングス	4,600	525.00	2,415,000	
アークランドサービスホールディングス	12,900	2,286.00	29,489,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	207,700	1,041.00	216,215,700	
ドトール・日レスホールディングス	30,200	1,637.00	49,437,400	
マツキヨココカラ＆カンパニー	106,900	4,925.00	526,482,500	
ブロンコビリー	10,100	2,428.00	24,522,800	
ＺＯＺＯ	119,500	3,595.00	429,602,500	
トレジャー・ファクトリー	5,500	998.00	5,489,000	
物語コーポレーション	9,300	6,940.00	64,542,000	
三越伊勢丹ホールディングス	304,400	836.00	254,478,400	
Ｈａｍｅｅ	4,800	1,239.00	5,947,200	
マーケットエンタープライズ	1,700	700.00	1,190,000	
ウエルシアホールディングス	91,900	4,330.00	397,927,000	
クリエイトＳＤホールディングス	25,700	3,445.00	88,536,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	20,300	374.00	7,592,200	
ミサワ	4,100	677.00	2,775,700	
ティーライフ	2,600	1,440.00	3,744,000	
チムニー	5,300	1,433.00	7,594,900	
シュッピン	14,800	1,206.00	17,848,800	
オイシックス・ラ・大地	25,100	4,545.00	114,079,500	
ネクステージ	35,300	2,270.00	80,131,000	
ジョイフル本田	51,100	1,574.00	80,431,400	
鳥貴族ホールディングス	6,600	1,941.00	12,810,600	
ホットランド	13,300	1,360.00	18,088,000	
すかいらーくホールディングス	224,400	1,518.00	340,639,200	
ＳＦＰホールディングス	8,500	1,448.00	12,308,000	
綿半ホールディングス	13,400	1,234.00	16,535,600	
ヨシックスホールディングス	3,600	2,071.00	7,455,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,800	1,026.00	52,120,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,300	1,272.00	11,829,600	
ＢＥＥＮＯＳ	8,900	2,477.00	22,045,300	
あさひ	14,700	1,370.00	20,139,000	
日本調剤	10,800	1,468.00	15,854,400	
コスモス薬品	17,500	18,660.00	326,550,000	
トーエル	8,900	785.00	6,986,500	
セブン＆アイ・ホールディングス	679,200	5,022.00	3,410,942,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	82,900	734.00	60,848,600	

ツルハホールディングス	37,900	14,440.00	547,276,000	
サンマルクホールディングス	14,000	1,534.00	21,476,000	
フェリシモ	4,100	1,404.00	5,756,400	
トリドールホールディングス	43,300	2,850.00	123,405,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	16,500	764.00	12,606,000	
ウイルプラスホールディングス	3,100	1,006.00	3,118,600	
ＪＭホールディングス	11,900	1,868.00	22,229,200	
サツドラホールディングス	2,800	2,230.00	6,244,000	
アレンザホールディングス	13,600	1,165.00	15,844,000	
串カツ田中ホールディングス	4,800	2,297.00	11,025,600	
バロックジャパンリミテッド	12,500	889.00	11,112,500	
クスリのアオキホールディングス	17,300	7,740.00	133,902,000	
力の源ホールディングス	8,900	618.00	5,500,200	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	101,700	4,600.00	467,820,000	
メディカルシステムネットワーク	17,400	706.00	12,284,400	
はるやまホールディングス	8,800	583.00	5,130,400	
ノジマ	28,200	2,385.00	67,257,000	
カッパ・クリエイト	24,300	1,417.00	34,433,100	
ライトオン	13,000	699.00	9,087,000	
良品計画	200,000	2,104.00	420,800,000	
三城ホールディングス	23,100	258.00	5,959,800	
アドヴァングループ	18,100	967.00	17,502,700	
アルビス	5,800	2,304.00	13,363,200	
コナカ	20,500	330.00	6,765,000	
ハウス　オブ　ローゼ	2,400	1,665.00	3,996,000	
Ｇ－７ホールディングス	19,500	1,834.00	35,763,000	
イオン北海道	30,700	1,357.00	41,659,900	
コジマ	30,600	576.00	17,625,600	
ヒマラヤ	6,500	1,014.00	6,591,000	
コーナン商事	24,800	3,555.00	88,164,000	
エコス	6,600	1,853.00	12,229,800	
ワタミ	21,000	971.00	20,391,000	
マルシェ	4,200	473.00	1,986,600	
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	347,200	2,399.00	832,932,800	
西松屋チェーン	38,400	1,513.00	58,099,200	
ゼンショーホールディングス	84,900	2,670.00	226,683,000	
幸楽苑ホールディングス	11,000	1,499.00	16,489,000	
ハークスレイ	8,100	473.00	3,831,300	
サイゼリヤ	25,900	3,035.00	78,606,500	
ＶＴホールディングス	66,200	510.00	33,762,000	
魚力	5,100	2,006.00	10,230,600	

フジ・コーポレーション	9,500	1,211.00	11,504,500	
ユナイテッドアローズ	18,400	2,102.00	38,676,800	
ハイデイ日高	25,300	1,651.00	41,770,300	
ＹＵ−ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	12,000	223.00	2,676,000	
コロワイド	71,300	1,626.00	115,933,800	
ピーシーデポコーポレーション	21,100	463.00	9,769,300	
壱番屋	12,300	4,630.00	56,949,000	
ＰＬＡＮＴ	5,000	725.00	3,625,000	
スギホールディングス	34,700	8,240.00	285,928,000	
薬王堂ホールディングス	8,800	2,418.00	21,278,400	
スクロール	27,200	902.00	24,534,400	
ヨンドシーホールディングス	16,200	1,704.00	27,604,800	
木曽路	23,000	2,178.00	50,094,000	
ＳＲＳホールディングス	24,000	778.00	18,672,000	
リテールパートナーズ	21,400	1,231.00	26,343,400	
ケーヨー	32,300	824.00	26,615,200	
上新電機	20,100	2,236.00	44,943,600	
日本瓦斯	84,700	1,471.00	124,593,700	
ロイヤルホールディングス	29,800	2,063.00	61,477,400	
いなげや	21,600	1,399.00	30,218,400	
チヨダ	17,500	768.00	13,440,000	
ライフコーポレーション	16,300	3,610.00	58,843,000	
リンガーハット	21,400	2,225.00	47,615,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	22,400	589.00	13,193,600	
ＡＯＫＩホールディングス	34,200	676.00	23,119,200	
オークワ	27,400	1,091.00	29,893,400	
コメリ	27,000	2,653.00	71,631,000	
青山商事	36,400	753.00	27,409,200	
しまむら	20,200	9,740.00	196,748,000	
はせがわ	10,800	260.00	2,808,000	
高島屋	126,700	1,121.00	142,030,700	
松屋	35,200	962.00	33,862,400	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	82,400	864.00	71,193,600	
近鉄百貨店	6,800	2,596.00	17,652,800	
丸井グループ	147,000	2,220.00	326,340,000	
アクシアル　リテイリング	13,600	3,400.00	46,240,000	
イオン	668,100	2,706.00	1,807,878,600	
イズミ	31,400	3,470.00	108,958,000	
平和堂	32,100	1,956.00	62,787,600	
フジ	21,100	1,998.00	42,157,800	
ヤオコー	19,700	6,780.00	133,566,000	
ゼビオホールディングス	24,000	1,048.00	25,152,000	

ケーズホールディングス	160,400	1,185.00	190,074,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	9,500	713.00	6,773,500	
日産東京販売ホールディングス	27,200	235.00	6,392,000	
シルバーライフ	3,800	1,413.00	5,369,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	7,700	5,230.00	40,271,000	
ナルミヤ・インターナショナル	4,200	1,195.00	5,019,000	
ブックオフグループホールディングス	10,100	995.00	10,049,500	
ギフト	2,900	3,095.00	8,975,500	
アインホールディングス	25,300	6,300.00	159,390,000	
元気寿司	5,000	2,664.00	13,320,000	
ヤマダホールディングス	635,800	433.00	275,301,400	
アークランドサカモト	27,400	1,727.00	47,319,800	
ニトリホールディングス	68,900	21,210.00	1,461,369,000	
グルメ杵屋	14,200	987.00	14,015,400	
愛眼	12,700	200.00	2,540,000	
ケーユーホールディングス	9,400	1,059.00	9,954,600	
吉野家ホールディングス	60,800	2,367.00	143,913,600	
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	26,900	1,048.00	28,191,200	
関西スーパーマーケット	13,300	1,433.00	19,058,900	
王将フードサービス	11,500	6,030.00	69,345,000	
プレナス	19,600	1,966.00	38,533,600	
ミニストップ	13,000	1,423.00	18,499,000	
アークス	33,300	2,207.00	73,493,100	
バローホールディングス	38,600	2,414.00	93,180,400	
ベルク	7,800	5,430.00	42,354,000	
大庄	9,700	1,010.00	9,797,000	
ファーストリテイリング	23,200	75,720.00	1,756,704,000	
サンドラッグ	65,400	3,310.00	216,474,000	
サックスバー　ホールディングス	17,100	597.00	10,208,700	
ヤマザワ	4,300	1,719.00	7,391,700	
やまや	3,600	2,405.00	8,658,000	
ベルーナ	37,800	765.00	28,917,000	
島根銀行	5,800	569.00	3,300,200	
じもとホールディングス	12,400	636.00	7,886,400	
めぶきフィナンシャルグループ	903,400	238.00	215,009,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,800	1,474.00	32,133,200	
九州フィナンシャルグループ	355,000	398.00	141,290,000	
ゆうちょ銀行	410,400	862.00	353,764,800	
富山第一銀行	41,400	283.00	11,716,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	993,000	446.00	442,878,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	113,500	778.00	88,303,000	

三十三フィナンシャルグループ	16,100	1,391.00	22,395,100	
第四北越フィナンシャルグループ	28,300	2,583.00	73,098,900	
ひろぎんホールディングス	256,400	651.00	166,916,400	
おきなわフィナンシャルグループ	15,700	2,434.00	38,213,800	
十六フィナンシャルグループ	23,300	2,047.00	47,695,100	
北國フィナンシャルホールディングス	16,200	2,005.00	32,481,000	
新生銀行	113,400	1,790.00	202,986,000	
あおぞら銀行	97,100	2,633.00	255,664,300	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,149,900	630.00	7,024,437,000	
りそなホールディングス	1,990,000	445.10	885,749,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	328,600	3,873.00	1,272,667,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,203,500	3,790.00	4,561,265,000	
千葉銀行	580,200	712.00	413,102,400	
群馬銀行	334,000	347.00	115,898,000	
武蔵野銀行	25,900	1,709.00	44,263,100	
千葉興業銀行	40,900	265.00	10,838,500	
筑波銀行	67,800	169.00	11,458,200	
七十七銀行	54,500	1,193.00	65,018,500	
青森銀行	13,500	1,944.00	26,244,000	
秋田銀行	11,100	1,445.00	16,039,500	
山形銀行	19,500	799.00	15,580,500	
岩手銀行	11,400	1,630.00	18,582,000	
東邦銀行	145,100	201.00	29,165,100	
東北銀行	8,300	999.00	8,291,700	
みちのく銀行	11,200	873.00	9,777,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	146,500	2,085.00	305,452,500	
静岡銀行	423,400	897.00	379,789,800	
スルガ銀行	152,500	469.00	71,522,500	
八十二銀行	391,600	369.00	144,500,400	
山梨中央銀行	18,800	813.00	15,284,400	
大垣共立銀行	34,300	1,901.00	65,204,300	
福井銀行	14,900	1,489.00	22,186,100	
清水銀行	7,200	1,530.00	11,016,000	
富山銀行	3,100	1,881.00	5,831,100	
滋賀銀行	32,700	1,869.00	61,116,300	
南都銀行	27,100	1,948.00	52,790,800	
百五銀行	166,900	333.00	55,577,700	
京都銀行	62,300	5,100.00	317,730,000	
紀陽銀行	61,600	1,464.00	90,182,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	108,500	848.00	92,008,000	
山陰合同銀行	103,100	572.00	58,973,200	
中国銀行	138,900	844.00	117,231,600	

鳥取銀行	5,500	1,101.00	6,055,500	
伊予銀行	230,400	564.00	129,945,600	
百十四銀行	18,500	1,438.00	26,603,000	
四国銀行	26,400	742.00	19,588,800	
阿波銀行	26,600	2,073.00	55,141,800	
大分銀行	10,000	1,815.00	18,150,000	
宮崎銀行	10,900	2,003.00	21,832,700	
佐賀銀行	9,800	1,403.00	13,749,400	
琉球銀行	37,700	754.00	28,425,800	
セブン銀行	516,300	234.00	120,814,200	
みずほフィナンシャルグループ	2,223,500	1,523.50	3,387,502,250	
高知銀行	6,300	756.00	4,762,800	
山口フィナンシャルグループ	202,500	634.00	128,385,000	
長野銀行	5,700	1,076.00	6,133,200	
名古屋銀行	13,000	2,360.00	30,680,000	
北洋銀行	262,100	236.00	61,855,600	
愛知銀行	6,300	3,485.00	21,955,500	
中京銀行	6,300	1,311.00	8,259,300	
大光銀行	6,000	1,331.00	7,986,000	
愛媛銀行	24,300	776.00	18,856,800	
トマト銀行	6,300	1,038.00	6,539,400	
京葉銀行	74,100	441.00	32,678,100	
栃木銀行	84,000	180.00	15,120,000	
北日本銀行	5,400	1,510.00	8,154,000	
東和銀行	30,500	505.00	15,402,500	
福島銀行	19,900	226.00	4,497,400	
大東銀行	8,300	680.00	5,644,000	
トモニホールディングス	134,400	298.00	40,051,200	
フィデアホールディングス	15,900	1,154.00	18,348,600	
池田泉州ホールディングス	199,900	158.00	31,584,200	
ＦＰＧ	58,800	608.00	35,750,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,600	1,288.00	17,516,800	
マーキュリアホールディングス	6,100	731.00	4,459,100	
ＳＢＩホールディングス	214,500	2,785.00	597,382,500	
ジャフコ　グループ	22,200	7,290.00	161,838,000	
大和証券グループ本社	1,302,400	635.20	827,284,480	
野村ホールディングス	2,654,900	502.00	1,332,759,800	
岡三証券グループ	137,300	379.00	52,036,700	
丸三証券	52,000	565.00	29,380,000	
東洋証券	58,700	150.00	8,805,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	200,200	379.00	75,875,800	
光世証券	4,000	541.00	2,164,000	

水戸証券	47,100	287.00	13,517,700	
いちよし証券	32,800	637.00	20,893,600	
松井証券	85,400	816.00	69,686,400	
マネックスグループ	142,000	928.00	131,776,000	
極東証券	23,600	754.00	17,794,400	
岩井コスモホールディングス	16,600	1,313.00	21,795,800	
アイザワ証券グループ	28,800	1,029.00	29,635,200	
マネーパートナーズグループ	19,400	248.00	4,811,200	
スパークス・グループ	81,000	309.00	25,029,000	
かんぽ生命保険	175,000	1,791.00	313,425,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	306,500	4,821.00	1,477,636,500	
アニコム　ホールディングス	53,400	884.00	47,205,600	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	389,900	3,652.00	1,423,914,800	
第一生命ホールディングス	855,800	2,396.50	2,050,924,700	
東京海上ホールディングス	572,600	5,916.00	3,387,501,600	
Ｔ＆Ｄホールディングス	451,300	1,396.00	630,014,800	
アドバンスクリエイト	8,300	1,033.00	8,573,900	
全国保証	41,600	5,200.00	216,320,000	
あんしん保証	6,900	298.00	2,056,200	
イントラスト	8,000	816.00	6,528,000	
日本モーゲージサービス	10,200	1,087.00	11,087,400	
Ｃａｓａ	6,700	910.00	6,097,000	
アルヒ	26,100	1,297.00	33,851,700	
プレミアグループ	8,900	3,795.00	33,775,500	
クレディセゾン	112,000	1,268.00	142,016,000	
芙蓉総合リース	18,300	7,440.00	136,152,000	
みずほリース	27,000	3,210.00	86,670,000	
東京センチュリー	33,700	6,090.00	205,233,000	
日本証券金融	68,900	826.00	56,911,400	
アイフル	293,200	362.00	106,138,400	
リコーリース	15,500	3,645.00	56,497,500	
イオンフィナンシャルサービス	94,900	1,390.00	131,911,000	
アコム	344,400	365.00	125,706,000	
ジャックス	19,400	3,005.00	58,297,000	
オリエントコーポレーション	473,800	142.00	67,279,600	
オリックス	1,055,700	2,274.00	2,400,661,800	
三菱ＨＣキャピタル	643,200	565.00	363,408,000	
九州リースサービス	9,400	597.00	5,611,800	
日本取引所グループ	440,500	2,566.50	1,130,543,250	
イー・ギャランティ	25,700	2,577.00	66,228,900	
アサックス	9,800	706.00	6,918,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,300	1,989.00	14,519,700	

いちご	201,200	323.00	64,987,600	
日本駐車場開発	208,400	144.00	30,009,600	
スター・マイカ・ホールディングス	11,100	1,428.00	15,850,800	
ＳＲＥホールディングス	4,600	8,900.00	40,940,000	
ＡＤワークスグループ	34,700	162.00	5,621,400	
ヒューリック	417,600	1,114.00	465,206,400	
三栄建築設計	8,400	1,716.00	14,414,400	
野村不動産ホールディングス	90,800	2,640.00	239,712,000	
三重交通グループホールディングス	40,400	481.00	19,432,400	
サムティ	29,000	2,548.00	73,892,000	
ディア・ライフ	26,800	556.00	14,900,800	
日本商業開発	12,500	1,776.00	22,200,000	
プレサンスコーポレーション	24,000	1,927.00	46,248,000	
ハウスコム	5,000	1,252.00	6,260,000	
日本管理センター	10,600	1,085.00	11,501,000	
サンセイランディック	8,200	827.00	6,781,400	
フージャースホールディングス	23,300	683.00	15,913,900	
オープンハウス	55,600	6,900.00	383,640,000	
東急不動産ホールディングス	516,000	630.00	325,080,000	
飯田グループホールディングス	145,900	2,608.00	380,507,200	
イーグランド	4,400	1,684.00	7,409,600	
ムゲンエステート	15,900	481.00	7,647,900	
ハウスドゥ	8,600	959.00	8,247,400	
シーアールイー	6,200	1,739.00	10,781,800	
グッドコムアセット	9,500	1,303.00	12,378,500	
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,849.00	12,535,600	
テンポイノベーション	7,600	913.00	6,938,800	
フェイスネットワーク	3,600	1,288.00	4,636,800	
パーク２４	94,800	1,857.00	176,043,600	
パラカ	6,100	1,605.00	9,790,500	
三井不動産	793,600	2,556.00	2,028,441,600	
三菱地所	1,143,800	1,690.00	1,933,022,000	
平和不動産	30,500	3,335.00	101,717,500	
東京建物	173,200	1,629.00	282,142,800	
ダイビル	45,700	1,485.00	67,864,500	
京阪神ビルディング	29,700	1,384.00	41,104,800	
住友不動産	365,400	3,964.00	1,448,445,600	
テーオーシー	35,400	614.00	21,735,600	
東京楽天地	3,500	4,100.00	14,350,000	
スターツコーポレーション	24,600	2,582.00	63,517,200	
フジ住宅	23,900	693.00	16,562,700	
空港施設	22,100	536.00	11,845,600	

明和地所	12,400	611.00	7,576,400	
ゴールドクレスト	15,300	1,512.00	23,133,600	
エスリード	8,300	1,687.00	14,002,100	
日神グループホールディングス	33,300	492.00	16,383,600	
日本エスコン	32,400	820.00	26,568,000	
タカラレーベン	72,800	293.00	21,330,400	
ＡＶＡＮＴＩＡ	12,000	857.00	10,284,000	
イオンモール	88,700	1,690.00	149,903,000	
毎日コムネット	9,200	777.00	7,148,400	
ファースト住建	8,600	1,221.00	10,500,600	
カチタス	43,700	4,150.00	181,355,000	
トーセイ	26,300	1,078.00	28,351,400	
穴吹興産	5,000	2,061.00	10,305,000	
サンフロンティア不動産	26,400	1,005.00	26,532,000	
ＦＪネクストホールディングス	19,600	1,045.00	20,482,000	
インテリックス	3,900	714.00	2,784,600	
ランドビジネス	7,300	275.00	2,007,500	
サンネクスタグループ	8,000	1,012.00	8,096,000	
グランディハウス	17,100	503.00	8,601,300	
日本空港ビルデング	66,700	5,940.00	396,198,000	
明豊ファシリティワークス	8,100	890.00	7,209,000	
日本工営	10,000	3,510.00	35,100,000	
ＬＩＦＵＬＬ	52,500	357.00	18,742,500	
ミクシィ	38,700	2,233.00	86,417,100	
ジェイエイシーリクルートメント	13,800	2,211.00	30,511,800	
日本M&Aセンターホールディングス	276,400	3,575.00	988,130,000	
メンバーズ	5,100	2,619.00	13,356,900	
中広	3,600	401.00	1,443,600	
ＵＴグループ	24,400	4,195.00	102,358,000	
アイティメディア	8,100	2,218.00	17,965,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	9,100	1,272.00	11,575,200	
夢真ビーネックスグループ	45,100	1,606.00	72,430,600	
コシダカホールディングス	45,600	726.00	33,105,600	
アルトナー	4,500	875.00	3,937,500	
パソナグループ	18,400	3,525.00	64,860,000	
ＣＤＳ	4,400	1,593.00	7,009,200	
リンクアンドモチベーション	37,100	1,110.00	41,181,000	
エス・エム・エス	57,300	4,570.00	261,861,000	
サニーサイドアップグループ	6,300	804.00	5,065,200	
パーソルホールディングス	168,500	3,025.00	509,712,500	
リニカル	9,900	848.00	8,395,200	
クックパッド	54,500	247.00	13,461,500	

アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,700	659.00	5,733,300	
学情	7,100	1,246.00	8,846,600	
スタジオアリス	7,700	2,200.00	16,940,000	
シミックホールディングス	9,600	1,596.00	15,321,600	
エプコ	4,000	833.00	3,332,000	
ＮＪＳ	3,900	2,010.00	7,839,000	
綜合警備保障	67,100	4,540.00	304,634,000	
カカクコム	124,500	3,450.00	429,525,000	
アイロムグループ	6,100	1,872.00	11,419,200	
セントケア・ホールディング	11,300	846.00	9,559,800	
サイネックス	3,400	676.00	2,298,400	
ルネサンス	12,000	1,451.00	17,412,000	
ディップ	29,700	4,225.00	125,482,500	
デジタルホールディングス	11,900	1,720.00	20,468,000	
新日本科学	20,800	1,776.00	36,940,800	
キャリアデザインセンター	4,600	1,175.00	5,405,000	
ベネフィット・ワン	61,300	5,840.00	357,992,000	
エムスリー	297,300	6,348.00	1,887,260,400	
ツカダ・グローバルホールディング	10,700	332.00	3,552,400	
アウトソーシング	96,700	1,539.00	148,821,300	
ウェルネット	17,700	506.00	8,956,200	
ワールドホールディングス	6,900	2,920.00	20,148,000	
ディー・エヌ・エー	64,300	1,830.00	117,669,000	
博報堂ＤＹホールディングス	234,700	1,901.00	446,164,700	
ぐるなび	28,300	614.00	17,376,200	
タカミヤ	21,200	446.00	9,455,200	
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	920.00	10,488,000	
ファンコミュニケーションズ	42,900	423.00	18,146,700	
ライク	4,700	1,847.00	8,680,900	
ビジネス・ブレークスルー	7,100	443.00	3,145,300	
エスプール	47,900	1,208.00	57,863,200	
ＷＤＢホールディングス	7,800	3,655.00	28,509,000	
手間いらず	2,200	5,740.00	12,628,000	
ティア	10,600	481.00	5,098,600	
ＣＤＧ	2,000	1,499.00	2,998,000	
アドウェイズ	25,500	871.00	22,210,500	
バリューコマース	13,300	4,980.00	66,234,000	
インフォマート	184,900	1,237.00	228,721,300	
ＪＰホールディングス	44,700	247.00	11,040,900	
エコナックホールディングス	34,300	96.00	3,292,800	
レッグス	3,800	1,603.00	6,091,400	
プレステージ・インターナショナル	63,600	739.00	47,000,400	

アミューズ	9,300	2,261.00	21,027,300	
ドリームインキュベータ	5,000	777.00	3,885,000	
クイック	11,800	1,432.00	16,897,600	
ＴＡＣ	10,700	241.00	2,578,700	
電通グループ	173,700	4,265.00	740,830,500	
イオンファンタジー	6,700	2,012.00	13,480,400	
シーティーエス	19,500	824.00	16,068,000	
ネクシィーズグループ	6,300	881.00	5,550,300	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	44,100	2,667.00	117,614,700	
アルプス技研	15,100	2,070.00	31,257,000	
ダイオーズ	3,700	1,026.00	3,796,200	
日本空調サービス	18,100	796.00	14,407,600	
オリエンタルランド	199,100	18,905.00	3,763,985,500	
ダスキン	39,200	2,695.00	105,644,000	
明光ネットワークジャパン	20,400	561.00	11,444,400	
ファルコホールディングス	8,200	1,684.00	13,808,800	
ラウンドワン	47,300	1,542.00	72,936,600	
リゾートトラスト	77,400	2,057.00	159,211,800	
ビー・エム・エル	21,800	3,880.00	84,584,000	
りらいあコミュニケーションズ	25,900	1,119.00	28,982,100	
リソー教育	77,700	441.00	34,265,700	
早稲田アカデミー	9,700	1,035.00	10,039,500	
ユー・エス・エス	188,800	1,818.00	343,238,400	
東京個別指導学院	15,400	669.00	10,302,600	
サイバーエージェント	415,300	1,973.00	819,386,900	
楽天グループ	865,200	1,207.00	1,044,296,400	
クリーク・アンド・リバー社	9,000	1,984.00	17,856,000	
モーニングスター	30,200	526.00	15,885,200	
テー・オー・ダブリュー	30,600	349.00	10,679,400	
山田コンサルティンググループ	9,000	1,169.00	10,521,000	
セントラルスポーツ	6,400	2,599.00	16,633,600	
フルキャストホールディングス	14,500	2,792.00	40,484,000	
エン・ジャパン	27,300	4,590.00	125,307,000	
リソルホールディングス	1,900	4,130.00	7,847,000	
テクノプロ・ホールディングス	101,000	3,390.00	342,390,000	
アトラグループ	3,700	311.00	1,150,700	
インターワークス	5,700	404.00	2,302,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,800	8,250.00	64,350,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	10,900	3,240.00	35,316,000	
ファーストロジック	3,700	778.00	2,878,600	
三機サービス	3,600	1,039.00	3,740,400	
Ｇｕｎｏｓｙ	11,100	603.00	6,693,300	

デザインワン・ジャパン	5,700	223.00	1,271,100	
イー・ガーディアン	7,000	3,295.00	23,065,000	
リブセンス	10,800	236.00	2,548,800	
ジャパンマテリアル	52,000	1,552.00	80,704,000	
ベクトル	23,900	1,342.00	32,073,800	
ウチヤマホールディングス	9,300	374.00	3,478,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,700	1,423.00	18,072,100	
キャリアリンク	6,400	1,421.00	9,094,400	
ＩＢＪ	14,100	1,111.00	15,665,100	
アサンテ	7,600	1,713.00	13,018,800	
バリューＨＲ	6,900	2,012.00	13,882,800	
M&Aキャピタルパートナーズ	13,900	5,730.00	79,647,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,449.00	9,853,200	
ＥＲＩホールディングス	4,900	1,549.00	7,590,100	
アビスト	2,700	2,877.00	7,767,900	
シグマクシス・ホールディングス	10,300	3,090.00	31,827,000	
ウィルグループ	12,700	1,596.00	20,269,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	24,300	195.00	4,738,500	
メドピア	13,100	3,045.00	39,889,500	
レアジョブ	3,500	1,225.00	4,287,500	
リクルートホールディングス	1,299,500	7,809.00	10,147,795,500	
エラン	23,500	1,206.00	28,341,000	
土木管理総合試験所	8,800	350.00	3,080,000	
ネットマーケティング	8,900	551.00	4,903,900	
日本郵政	2,200,000	842.00	1,852,400,000	
ベルシステム２４ホールディングス	24,400	1,390.00	33,916,000	
鎌倉新書	19,600	957.00	18,757,200	
ＳＭＮ	4,100	659.00	2,701,900	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,500	907.00	3,174,500	
エアトリ	11,000	4,165.00	45,815,000	
アトラエ	11,900	2,463.00	29,309,700	
ストライク	6,400	5,650.00	36,160,000	
ソラスト	41,600	1,326.00	55,161,600	
セラク	5,500	2,064.00	11,352,000	
インソース	16,500	2,494.00	41,151,000	
ベイカレント・コンサルティング	11,900	50,300.00	598,570,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,300	5,040.00	16,632,000	
アイモバイル	5,000	1,451.00	7,255,000	
キャリアインデックス	6,100	1,023.00	6,240,300	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	7,200	997.00	7,178,400	
船場	3,800	781.00	2,967,800	
グレイステクノロジー	22,100	700.00	15,470,000	

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	53,600	2,355.00	126,228,000	
フルテック	2,600	1,456.00	3,785,600	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	5,700	538.00	3,066,600	
ソウルドアウト	4,300	1,335.00	5,740,500	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	3,000	774.00	2,322,000	
ウェルビー	11,300	1,617.00	18,272,100	
エル・ティー・エス	2,300	3,180.00	7,314,000	
ミダックホールディングス	7,400	5,440.00	40,256,000	
日総工産	13,700	755.00	10,343,500	
キュービーネットホールディングス	7,900	1,966.00	15,531,400	
ＲＰＡホールディングス	24,500	420.00	10,290,000	
スプリックス	5,100	1,232.00	6,283,200	
マネジメントソリューションズ	8,300	3,280.00	27,224,000	
プロレド・パートナーズ	4,000	1,230.00	4,920,000	
テノ．ホールディングス	2,500	788.00	1,970,000	
フロンティア・マネジメント	4,800	915.00	4,392,000	
ピアラ	3,200	719.00	2,300,800	
コプロ・ホールディングス	3,600	1,247.00	4,489,200	
ギークス	3,100	1,508.00	4,674,800	
カーブスホールディングス	46,700	917.00	42,823,900	
フォーラムエンジニアリング	12,100	846.00	10,236,600	
ダイレクトマーケティングミックス	9,100	4,230.00	38,493,000	
ポピンズホールディングス	4,000	3,815.00	15,260,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	13,700	3,770.00	51,649,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,900	813.00	7,235,700	
リログループ	92,200	2,188.00	201,733,600	
東祥	12,800	2,186.00	27,980,800	
ＴＲＥホールディングス	23,200	1,650.00	38,280,000	
人・夢・技術グループ	6,900	1,924.00	13,275,600	
エイチ・アイ・エス	37,600	2,635.00	99,076,000	
ラックランド	4,900	2,940.00	14,406,000	
共立メンテナンス	30,100	4,285.00	128,978,500	
イチネンホールディングス	17,500	1,425.00	24,937,500	
建設技術研究所	10,200	2,726.00	27,805,200	
スペース	12,400	984.00	12,201,600	
燦ホールディングス	7,600	1,436.00	10,913,600	
スバル興業	1,100	8,270.00	9,097,000	
東京テアトル	6,600	1,241.00	8,190,600	
タナベ経営	7,000	732.00	5,124,000	
ナガワ	5,400	10,850.00	58,590,000	
東京都競馬	12,700	4,535.00	57,594,500	
カナモト	29,800	2,419.00	72,086,200	

西尾レントオール	15,700	2,746.00	43,112,200	
トランス・コスモス	21,500	3,210.00	69,015,000	
乃村工藝社	72,500	1,082.00	78,445,000	
藤田観光	7,300	2,552.00	18,629,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	10,500	1,713.00	17,986,500	
日本管財	18,200	2,756.00	50,159,200	
トーカイ	15,000	2,133.00	31,995,000	
セコム	166,000	7,673.00	1,273,718,000	
セントラル警備保障	8,200	2,631.00	21,574,200	
丹青社	34,900	919.00	32,073,100	
メイテック	20,400	6,970.00	142,188,000	
応用地質	19,200	1,842.00	35,366,400	
船井総研ホールディングス	34,600	2,710.00	93,766,000	
進学会ホールディングス	6,700	395.00	2,646,500	
オオバ	12,300	813.00	9,999,900	
いであ	4,700	1,920.00	9,024,000	
学究社	5,700	1,402.00	7,991,400	
ベネッセホールディングス	56,300	2,387.00	134,388,100	
イオンディライト	20,900	3,565.00	74,508,500	
ナック	8,400	965.00	8,106,000	
ダイセキ	31,100	5,330.00	165,763,000	
ステップ	6,400	1,817.00	11,628,800	
合　計	191,559,700		484,965,890,370	

(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11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
流動資産	
預金	90,751,396
コール・ローン	3,900,360,600
国債証券	298,087,497,691
派生商品評価勘定	38,163,082
未収入金	6,911,414
未収利息	1,660,594,976
前払費用	49,731,983
差入委託証拠金	474,669,832
流動資産合計	304,308,680,974
資産合計	304,308,680,974
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,300,784
前受金	37,058,196
未払金	1,455,799
未払解約金	304,547,975
未払利息	8,669
流動負債合計	379,371,423
負債合計	379,371,423
純資産の部	
元本等	
元本	97,161,984,167
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	206,767,325,384
元本等合計	303,929,309,551
純資産合計	303,929,309,551
負債純資産合計	304,308,680,974

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引

	2021年11月10日現在
	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年11月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	97,161,984,167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　3.1281円 (1万口当たり純資産額)　(31,281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11月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年11月10日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	93,613,991,047円
期中追加設定元本額	18,002,834,367円
期中一部解約元本額	14,454,841,247円
期末元本額	97,161,984,167円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,377,607,198円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	595,885,716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）	2,109,249,520円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	9,539,655円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	7,589,020,663円
世界経済インデックスファンド	11,470,686,166円
ＤＣマイセレクション２５	1,898,406,082円
ＤＣマイセレクション５０	1,614,831,151円
ＤＣマイセレクション７５	1,118,111,315円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,250,750,402円
ＤＣマイセレクションＳ２５	900,856,298円
ＤＣマイセレクションＳ５０	704,388,116円
ＤＣマイセレクションＳ７５	381,883,885円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	33,832,347円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	87,518,576円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	44,082,410円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	11,855,298,631円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	652,967,853円

区分	2021年11月10日現在
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,076,012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）	29,979,836円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	52,915,215円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	93,640,010円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	78,570,045円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	87,078,306円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,446,886,159円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	461,222,944円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,841,566,827円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	156,811,415円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	59,007,531円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	484,781,809円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	177,053,226円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	224,631,051円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	775,296,052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）	2,054,681,704円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	722,945,345円
外国債券ファンド・シリーズ１	683,707,255円
コア投資戦略ファンド（安定型）	720,536,660円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,882,347,304円
分散投資コア戦略ファンドＡ	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドＳ	556,972,964円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	495,274,400円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,803,633,980円
コア投資戦略ファンド（切替型）	774,547,899円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	237,196,502円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,075,684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）	1,318,683,072円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	196,879,321円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	18,278,101,623円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	210,490,096円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	245,820,538円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	403,920,377円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,850,348円
グローバル経済コア	842,117,395円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	13,656,276円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,370,879円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	230,570,686円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,271,580円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	5,298,310円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	4,532,402円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	2,499,126円

区分	2021年11月10日現在
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	3,388,845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）	385,326,573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）	10,653,687,339円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	334,415,052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）	334,657,084円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	253,254,245円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	27,039,892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）	22,335,375円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,474,981,278
合計	2,474,981,278

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	3,826,966,383	－	3,864,024,579	37,058,196
合計		3,826,966,383	－	3,864,024,579	37,058,196

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,637,053,742	－	3,601,857,844	△35,195,898
	アメリカドル	1,730,078,762	－	1,714,267,450	△15,811,312
	カナダドル	155,006,052	－	153,277,423	△1,728,629
	ユーロ	1,498,247,179	－	1,484,977,250	△13,269,929
	イギリスポンド	253,721,749	－	249,335,721	△4,386,028
合計		3,637,053,742	－	3,601,857,844	△35,195,898

(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	9,919,531.30	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,669,891.42	
		T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,988,085.95	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,480,957.05	
		T 0.125% 05/31/23	6,800,000.00	6,781,007.80	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,980,175.80	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,022,218.75	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,957,343.76	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,226,513.68	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,395,500.03	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,910,117.22	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,147,224.58	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,913,281.30	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	7,992,031.28	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,914,921.92	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	977,929.69	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,766,796.90	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,310,449.20	

		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,502,828.11	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,797,812.48	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,966,093.75	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,875,312.48	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,948,056.25	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,084,375.00	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,962,890.65	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,625,625.04	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,930,273.43	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,903,593.76	
		T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,261,015.62	
		T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,796,709.37	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,146,389.86	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,838,822.66	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,374,765.62	
		T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,840,960.97	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,477,604.71	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,190,039.10	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,246,289.13	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,840,937.52	
		T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	14,948,140.62	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,411,914.07	
		T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,636,328.10	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,244,667.99	
		T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,877,539.09	
		T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,964,375.00	
		T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	11,657,633.23	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,938,125.04	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,660,445.31	
		T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,690,210.93	
		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,944,375.04	
		T 1.125% 05/15/40	6,260,000.00	5,551,837.50	
		T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	6,457,078.12	
		T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	10,086,363.33	
		T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,144,568.34	
		T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,988,437.52	
		T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	7,518,066.44	
		T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	9,472,539.11	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,620,649.39	
		T 1.25% 08/15/31	8,580,000.00	8,430,520.35	
		T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	4,078,125.00	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,086,425.80	

		T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,872,875.00	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,544,824.22	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,073,750.00	
		T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	11,993,515.69	
		T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,295,300.75	
		T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,123,281.28	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,544,809.37	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,929,187.50	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,068,984.36	
		T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,654,980.44	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,700,546.87	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,315,156.25	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,569,111.31	
		T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,330,474.23	
		T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	11,359,933.64	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,020,527.34	
		T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,897,656.25	
		T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,558,935.55	
		T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,876,125.00	
		T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,200,410.90	
		T 1.625% 11/15/50	11,300,000.00	10,767,664.11	
		T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,909,769.54	
		T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,657,234.38	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,692,447.28	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,771,223.24	
		T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,470,500.00	
		T 1.75% 08/15/41	2,500,000.00	2,455,468.75	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,096,093.75	
		T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	7,926,539.10	
		T 1.875% 02/15/51	13,600,000.00	13,733,874.99	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,389,490.62	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,203,671.86	
		T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,575,573.25	
		T 1% 07/31/28	5,000,000.00	4,901,953.15	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,287,265.62	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,675,187.50	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,506,781.25	
		T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,776,906.26	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,993,125.02	
		T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	5,207,031.25	
		T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,771,706.25	
		T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,437,102.35	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,154,531.24	

		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,465,673.85	
		T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,902,539.10	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,286,289.08	
		T 2.25% 05/15/41	4,600,000.00	4,901,515.64	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,060,328.12	
		T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	4,526,182.05	
		T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	6,009,609.37	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,588,914.09	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,618,248.02	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,627,218.77	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,111,390.62	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,669,628.89	
		T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,793,750.00	
		T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,132,617.20	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,003,000.00	
		T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,754,882.80	
		T 2.375% 05/15/27	5,840,000.00	6,222,565.61	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,605,743.75	
		T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	3,100,195.31	
		T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,236,328.15	
		T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	6,844,867.21	
		T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,623,303.52	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,277,539.05	
		T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,597,958.60	
		T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,510,937.52	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,175,534.16	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,275,867.22	
		T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,699,792.99	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,721,602.52	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,010,239.06	
		T 2.625% 02/15/29	7,490,000.00	8,166,440.62	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,443,695.31	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,691,230.50	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,083,558.60	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,659,550.79	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,215,578.12	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,151,289.07	
		T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,147,943.34	
		T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,730,500.00	
		T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,027,621.89	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,871,035.17	
		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,041,250.00	

		T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,501,500.00	
		T 2.75% 08/15/47	7,050,000.00	8,377,933.62	
		T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,564,013.67	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,377,609.37	
		T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,427,662.50	
		T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,258,642.20	
		T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,628,785.17	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,280,468.76	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,989,403.12	
		T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,895,703.12	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,843,702.37	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,091,428.91	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,858,835.96	
		T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	4,322,412.50	
		T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,754,609.37	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,971,079.10	
		T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,620,312.50	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,219,115.62	
		T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,078,320.35	
		T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,113,476.55	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,792,451.60	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,189,062.50	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,448,050.00	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,427,401.56	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,698,515.62	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,174,750.81	
		T 2% 08/15/51	4,500,000.00	4,682,460.95	
		T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,180,468.80	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,682,295.36	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,038,789.06	
		T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,281,082.03	
		T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	2,446,406.26	
		T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,570,478.93	
		T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	5,113,546.87	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,423,750.00	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,129,531.25	
		T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,852,800.00	
		T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	7,084,195.33	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	980,426.56	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,176,437.51	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,636,562.50	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,641,875.00	
		T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	4,031,484.39	

	T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,938,355.47	
	T 3% 02/15/47	800,000.00	990,500.00	
	T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,548,941.42	
	T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,784,453.16	
	T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,942,354.69	
	T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,270,000.00	
	T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,087,983.62	
	T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,811,222.68	
	T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,535,671.89	
	T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,404,296.90	
	T 3% 11/15/44	2,800,000.00	3,399,593.76	
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,250,648.44	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,287,429.68	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,400,859.38	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,691,617.19	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,780,882.81	
	T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,779,257.81	
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,522,593.75	
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	781,214.84	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,432,195.32	
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	2,006,390.62	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,114,570.31	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,628,945.31	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,646,835.94	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,630,062.50	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,528,031.25	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,058,593.75	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,867,158.19	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,464,750.00	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,821,541.98	
アメリカドル 小計		1,183,050,000.00	1,228,513,011.16 (138,649,978,439)	
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,042,894.60	
	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,179,338.00	
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,356,968.00	
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,579,720.00	
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,345,856.00	
	CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,763,380.20	
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,411,626.40	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,205,055.60	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,960,000.00	1,966,370.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,505,183.40	

		CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,081,641.60	
		CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,371,165.60	
		CAN 1.5% 06/01/31	3,260,000.00	3,234,115.60	
		CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,214,100.00	
		CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,667,856.40	
		CAN 1.75% 12/01/53	900,000.00	852,948.00	
		CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,693,341.30	
		CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,503,668.70	
		CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,366,424.00	
		CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,867,410.00	
		CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,332,664.20	
		CAN 2.5% 06/01/24	300,000.00	311,091.00	
		CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,202,081.60	
		CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	675,970.40	
		CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,356,727.70	
		CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,528,577.20	
		CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	4,768,404.00	
		CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,694,498.00	
		CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,414,465.50	
		CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,528,031.70	
		CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,366,675.20	
		CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,177,470.80	
	カナダドル 小計		63,500,000.00	65,565,720.70 (5,946,810,867)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,559,848.50	
		MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	33,076,616.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	42,990,000.00	40,823,733.90	
		MBONO 6.75% 03/09/23	22,180,000.00	22,267,167.40	
		MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	39,575,750.10	
		MBONO 7.75% 05/29/31	31,580,000.00	32,676,773.40	
		MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	24,458,025.20	
		MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	10,998,560.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	33,970,000.00	36,555,117.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	28,220,000.00	30,617,289.00	
		MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	35,321,409.00	
		MBONO 8% 11/07/47	24,630,000.00	25,500,177.90	
		MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	35,645,160.10	
	メキシコペソ 小計		365,720,000.00	378,075,627.50 (2,099,416,151)	
	ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,399,057.70	
		BGB 0.2% 10/22/23	1,030,000.00	1,049,549.40	
		BGB 0.4% 06/22/40	1,140,000.00	1,128,166.80	
		BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,678,644.00	

		BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	580,972.80	
		BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,820,003.20	
		BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,809,618.20	
		BGB 0.8% 06/22/28	2,160,000.00	2,325,844.80	
		BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,566,405.60	
		BGB 0% 10/22/27	430,000.00	440,371.60	
		BGB 0% 10/22/31	1,020,000.00	1,018,449.60	
		BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,705,305.00	
		BGB 1.45% 06/22/37	890,000.00	1,042,590.50	
		BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,697,524.20	
		BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,644,461.00	
		BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,311,954.00	
		BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,442,860.40	
		BGB 1% 06/22/31	2,480,000.00	2,734,993.60	
		BGB 2.15% 06/22/66	770,000.00	1,151,373.30	
		BGB 2.25% 06/22/23	1,010,000.00	1,060,116.20	
		BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,125,755.40	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,329,539.80	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,052,444.00	
		BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,398,029.30	
		BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	3,188,761.40	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,399,669.20	
		BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,532,520.00	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,849,382.60	
		BGB 5% 03/28/35	2,220,000.00	3,640,200.60	
		BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,222,717.10	
		BKO 0% 06/16/23	1,090,000.00	1,103,788.50	
		BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	4,992,372.00	
		BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,044,798.70	
		BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,669,852.80	
		BTPS 0.3% 08/15/23	2,900,000.00	2,941,760.00	
		BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	590,376.20	
		BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,792,213.60	
		BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,294,067.60	
		BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,130,967.90	
		BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	3,103,341.20	
		BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	684,639.50	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,331,967.50	
		BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,851,908.00	
		BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,039,400.00	
		BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	984,555.00	
		BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,632,245.00	
		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,283,341.60	

		BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,476,175.80	
		BTPS 0.95% 12/01/31	1,700,000.00	1,718,224.00	
		BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,007,940.00	
		BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	3,022,110.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,062,846.50	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,057,331.20	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,772,675.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,431,031.00	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,521,560.00	
		BTPS 1.5% 04/30/45	600,000.00	598,380.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,552,431.00	
		BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,033,618.50	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,247,308.40	
		BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,748,610.20	
		BTPS 1.7% 09/01/51	1,420,000.00	1,433,206.00	
		BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,373,280.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,926,310.60	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,584,431.50	
		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,895,426.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,024,302.40	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,508,736.00	
		BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	736,431.30	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,533,900.80	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,112,522.40	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,071,772.00	
		BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	2,145,266.30	
		BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,072,552.60	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,257,360.50	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,197,269.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	2,731,758.90	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,020,000.00	1,225,285.20	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,202,889.50	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,575,189.50	
		BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,497,458.20	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,266,855.80	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,820,866.00	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,628,346.50	
		BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,841,311.40	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,970,226.00	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,899,312.00	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,393,466.00	
		BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,792,864.40	

		BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,995,880.00	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,059,210.00	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,486,785.60	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,848,535.80	
		BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,982,953.00	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,690,577.10	
		BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	4,973,177.50	
		BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,931,198.50	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	4,755,810.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,883,786.00	
		BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,653,067.00	
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	3,465,850.80	
		BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,290,471.60	
		BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,376,740.50	
		BTPS 5% 09/01/40	2,880,000.00	4,629,945.60	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,927,176.00	
		BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	4,369,869.00	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,899,730.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	949,384.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,064,933.30	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,101,227.00	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,768,469.50	
		DBR 0.5% 02/15/25	1,350,000.00	1,404,513.00	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,148,500.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	2,710,000.00	2,891,082.20	
		DBR 0.5% 08/15/27	4,040,000.00	4,293,469.60	
		DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,696,877.80	
		DBR 0% 02/15/31	2,450,000.00	2,527,616.00	
		DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,893,940.40	
		DBR 0% 05/15/36	2,170,000.00	2,216,785.20	
		DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,480,369.50	
		DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,622,675.00	
		DBR 0% 08/15/30	4,190,000.00	4,333,298.00	
		DBR 0% 08/15/30	670,000.00	696,659.30	
		DBR 0% 08/15/31	3,450,000.00	3,552,465.00	
		DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,448,067.00	
		DBR 0% 08/15/52	700,000.00	699,174.00	
		DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,232,532.80	
		DBR 0% 11/15/28	900,000.00	930,690.00	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,844,563.40	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,046,313.60	
		DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,126,787.20	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,421,812.40	

		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,746,277.50	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,097,860.00	
		DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,894,352.00	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,708,993.40	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	6,312,484.20	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,003,543.40	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,846,014.10	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,857,793.50	
		DBR 4.25% 07/04/39	2,310,000.00	4,178,997.90	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,471,799.50	
		DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,953,562.90	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,680,000.00	5,219,219.60	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,421,056.40	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,284,954.80	
		DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,724,319.20	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,954,500.00	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,383,377.80	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,846,795.20	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,805,885.80	
		FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,321,086.00	
		FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,635,904.00	
		FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,171,865.50	
		FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	844,796.70	
		FRTR 0.5% 06/25/44	1,530,000.00	1,519,534.80	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,730,237.10	
		FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,854,796.00	
		FRTR 0.75% 05/25/53	770,000.00	774,958.80	
		FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	6,272,955.00	
		FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,070,172.00	
		FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,556,315.00	
		FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,325,088.90	
		FRTR 0% 02/25/27	2,560,000.00	2,614,860.80	
		FRTR 0% 03/25/23	5,060,000.00	5,113,028.80	
		FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,049,722.00	
		FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,518,758.50	
		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,323,751.20	
		FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,071,347.60	
		FRTR 0% 11/25/31	3,620,000.00	3,604,723.60	
		FRTR 1.25% 05/25/34	5,090,000.00	5,757,451.70	
		FRTR 1.25% 05/25/36	5,930,000.00	6,746,976.10	
		FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,751,824.80	
		FRTR 1.5% 05/25/50	3,890,000.00	4,751,362.70	

		FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,588,636.40	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,209,008.60	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,744,019.80	
		FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,464,470.40	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,017,303.50	
		FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,613,220.80	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,409,427.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,834,257.20	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,106,449.20	
		FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,790,656.40	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,050,000.00	4,904,461.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,495,667.00	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,516,277.20	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	7,980,331.20	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,130,000.00	5,034,166.80	
		FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	4,805,321.40	
		FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	4,239,979.80	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,418,656.70	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,413,883.40	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,065,693.60	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,401,980.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,135,270.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	957,648.90	
		IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,048,354.60	
		IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	769,872.40	
		IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	504,135.00	
		IRISH 0.9% 05/15/28	810,000.00	869,462.10	
		IRISH 0% 10/18/31	1,300,000.00	1,284,127.00	
		IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,311,936.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	753,810.30	
		IRISH 1.35% 03/18/31	620,000.00	697,698.40	
		IRISH 1.5% 05/15/50	780,000.00	941,834.40	
		IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	985,279.20	
		IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,517,113.80	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,466,447.40	
		IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,521,392.50	
		IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,064,410.10	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,072,933.10	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,394,354.80	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,385,929.70	
		NETHER 0.25% 07/15/29	2,070,000.00	2,161,887.30	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,569,960.00	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,439,155.20	

		NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,261,540.20	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,747,639.80	
		NETHER 0% 01/15/24	1,670,000.00	1,698,206.30	
		NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,888,796.80	
		NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	695,275.00	
		NETHER 0% 01/15/52	1,230,000.00	1,191,378.00	
		NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,961,548.80	
		NETHER 0% 07/15/31	970,000.00	986,548.20	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,024,719.80	
		NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,618,384.60	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,430,000.00	4,093,505.10	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,137,797.30	
		NETHER 3.75% 01/15/23	1,560,000.00	1,645,441.20	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,949,897.50	
		NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,522,487.60	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,377,971.50	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	219,784.00	
		OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,392,637.30	
		OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	3,156,973.10	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,840,187.50	
		OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,245,130.40	
		OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,985,202.00	
		OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,592,680.00	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,533,374.80	
		OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,566,047.10	
		RAGB 0.25% 10/20/36	730,000.00	733,270.40	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,868,553.60	
		RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	936,814.00	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,733,594.40	
		RAGB 0.75% 03/20/51	680,000.00	745,830.80	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,211,664.00	
		RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	339,352.20	
		RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,468,966.00	
		RAGB 0% 02/20/31	880,000.00	886,556.00	
		RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	948,879.00	
		RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,134,011.20	
		RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,465,948.80	
		RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	396,950.40	
		RAGB 1.2% 10/20/25	700,000.00	750,344.00	
		RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	1,321,593.00	
		RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	468,873.90	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,058,656.50	

		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,395,183.30	
		RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	1,455,116.40	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,397,530.80	
		RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,358,361.40	
		RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,460,252.80	
		RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,033,074.10	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,937,989.60	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,699,361.70	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,640,318.00	
		RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	539,465.40	
		RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	435,532.60	
		RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	407,964.00	
		RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	504,225.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	649,183.40	
		RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	917,623.80	
		RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	687,050.00	
		RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	805,782.40	
		RFGB 0.75% 04/15/31	620,000.00	671,559.20	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	730,068.30	
		RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	547,619.40	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,353.80	
		RFGB 0% 09/15/26	700,000.00	716,548.00	
		RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	639,059.40	
		RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	637,274.40	
		RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	629,703.90	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	671,697.00	
		RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	883,230.00	
		RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	508,733.40	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	779,596.20	
		RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	973,208.20	
		SPGB 0.1% 04/30/31	2,180,000.00	2,137,577.20	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,336,624.40	
		SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,652,142.90	
		SPGB 0.45% 10/31/22	2,460,000.00	2,487,035.40	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,976,502.00	
		SPGB 0.5% 10/31/31	1,710,000.00	1,730,143.80	
		SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	3,061,657.50	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,566,050.40	
		SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	969,043.20	
		SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,312,672.40	
		SPGB 0% 01/31/26	1,530,000.00	1,550,043.00	
		SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,933,512.60	
		SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,403,704.80	

	SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,275,132.60	
	SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	2,376,367.40	
	SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,324,469.50	
	SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,965,545.00	
	SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,721,196.50	
	SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,616,569.00	
	SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,967,500.40	
	SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,322,841.60	
	SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	622,017.00	
	SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,895,999.50	
	SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,266,794.00	
	SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,188,240.00	
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,094,034.80	
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,383,881.20	
	SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	2,381,697.50	
	SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,094,034.80	
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,956,914.00	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,553,499.50	
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,347,680.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,050,000.00	2,900,688.50	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	2,865,586.40	
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,792,815.20	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,829,838.10	
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,961,421.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,378,748.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,491,933.60	
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,690,280.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,865,500.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,832,340.80	
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,260,000.00	4,236,031.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,255,379.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	4,478,988.80	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,503,850.80	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,505,868.00	
ユーロ 小計		772,040,000.00	904,404,939.50 (118,323,298,234)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,496,242.40	
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,499,446.60	
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,949,210.00	
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,194,482.60	
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	3,096,232.20	
	UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,889,945.00	

		UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,341,229.00	
		UKT 0.5% 01/31/29	350,000.00	345,513.00	
		UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,199,983.40	
		UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,711,322.00	
		UKT 0.625% 07/31/35	2,360,000.00	2,258,331.20	
		UKT 0.625% 10/22/50	1,860,000.00	1,719,328.20	
		UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,375,340.00	
		UKT 0.875% 01/31/46	960,000.00	934,800.00	
		UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,725,211.00	
		UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	509,425.00	
		UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	986,651.00	
		UKT 1.25% 07/31/51	550,000.00	593,873.50	
		UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,922,528.00	
		UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,092,940.00	
		UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,661,462.60	
		UKT 1.5% 07/31/53	200,000.00	234,376.00	
		UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,731,682.80	
		UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,236,984.80	
		UKT 1.625% 10/22/71	1,120,000.00	1,552,678.40	
		UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,551,108.00	
		UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,805,307.70	
		UKT 1.75% 09/07/37	2,930,000.00	3,262,496.40	
		UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,623,376.00	
		UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,583,775.00	
		UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	3,132,134.40	
		UKT 2.75% 09/07/24	1,470,000.00	1,565,006.10	
		UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,883,631.60	
		UKT 3.25% 01/22/44	2,580,000.00	3,744,096.00	
		UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	3,488,082.20	
		UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,990,506.60	
		UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,812,080.00	
		UKT 4.25% 03/07/36	2,090,000.00	3,024,271.80	
		UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,822,337.00	
		UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,492,937.00	
		UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,668,043.50	
		UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,746,887.50	
		UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	3,314,668.80	
		UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,749,513.70	
		UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	3,791,732.00	
		UKT 4.5% 09/07/34	2,470,000.00	3,543,733.70	
		UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,909,367.80	
		UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,973,000.20	
		UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,642,788.50	

	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	3,137,703.80	
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,069,424.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,714,737.50	
イギリスポンド 小計		96,350,000.00	120,301,965.50 (18,402,591,662)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	6,420,504.50	
	SGB 0.75% 05/12/28	7,380,000.00	7,696,971.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,784,782.50	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,930,625.00	
	SGB 1% 11/12/26	10,030,000.00	10,534,910.20	
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,533,900.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	10,149,183.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,580,000.00	8,413,747.20	
スウェーデンクローナ 小計		62,440,000.00	68,464,623.40 (900,994,443)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,916,720.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	6,388,372.80	
	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,747,921.20	
	NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	6,139,386.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,220,000.00	5,276,584.80	
	NGB 1.75% 09/06/29	6,540,000.00	6,636,399.60	
	NGB 2% 04/26/28	4,510,000.00	4,643,856.80	
	NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,799,006.40	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,643,065.60	
ノルウェークローネ 小計		55,570,000.00	56,191,313.20 (745,658,726)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	7,170,000.00	7,236,896.10	
	DGB 0.25% 11/15/52	4,180,000.00	4,233,838.40	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	10,948,815.00	
	DGB 0.5% 11/15/29	12,410,000.00	13,119,231.50	
	DGB 0% 11/15/24	1,830,000.00	1,861,878.60	
	DGB 0% 11/15/31	5,830,000.00	5,862,764.60	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,747,296.20	
	DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	7,943,936.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	14,980,000.00	27,147,804.60	
デンマーククローネ 小計		71,520,000.00	86,102,461.00 (1,514,542,288)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,200,000.00	1,942,094.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,321,942.80	
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,182,854.10	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,639,716.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,869,595.90	

	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	5,858,535.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	2,890,000.00	2,869,018.60	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	5,984,492.40	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,720,540.60	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,380,000.00	5,363,537.20	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	6,185,976.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,985,417.60	
	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	3,849,450.40	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	720,456.00	
ポーランドズロチ 小計		54,530,000.00	53,493,627.20 (1,523,530,598)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,876,381.00	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,258,521.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	1,964,785.20	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,603,520.60	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,129,198.60	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,506,824.00	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,010,000.00	1,999,286.70	
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	3,030,495.00	
	ACGB 1% 12/21/30	3,310,000.00	3,117,589.70	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,686,310.40	
	ACGB 2.25% 11/21/22	2,760,000.00	2,818,815.60	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,049,842.40	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,451,622.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,731,907.60	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	1,147,009.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,078,996.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,797,431.40	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,720,000.00	1,869,347.60	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,190,000.00	3,430,940.70	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,464,638.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,122,501.80	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,971,248.40	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,857,458.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,890,000.00	2,139,309.90	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,444,532.60	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,735,442.40	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,683,750.00	
オーストラリアドル 小計		60,340,000.00	62,967,706.70 (5,239,542,874)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	731,985.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	300,000.00	297,486.00	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	811,776.00	

		SIGB 1.875% 03/01/50	680,000.00	656,757.60	
		SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	312,832.00	
		SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	768,919.20	
		SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	926,214.10	
		SIGB 2.375% 06/01/25	730,000.00	763,448.60	
		SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	455,580.70	
		SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	564,306.90	
		SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	856,580.80	
		SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,010,664.00	
		SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,106,187.40	
		SIGB 2.875% 07/01/29	950,000.00	1,031,348.50	
		SIGB 2.875% 09/01/30	1,020,000.00	1,114,319.40	
		SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	420,893.70	
		SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	961,214.70	
		SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	971,590.40	
		SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,680,804.90	
シンガポールドル 小計			14,580,000.00	15,442,909.90 (1,293,961,420)	
マレーシアリンギット		MGS 2.632% 04/15/31	790,000.00	736,374.80	
		MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,962,009.60	
		MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,368,887.70	
		MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,529,237.40	
		MGS 3.733% 06/15/28	2,630,000.00	2,687,754.80	
		MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,113,827.40	
		MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	522,329.50	
		MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	954,040.50	
		MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,659,295.30	
		MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,063,629.50	
		MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,539,465.00	
		MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,165,979.20	
		MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,032,843.00	
		MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,495,209.60	
		MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	621,366.00	
		MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,467,869.60	
		MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,848,013.80	
		MGS 4.065% 06/15/50	1,560,000.00	1,515,540.00	
		MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,329,907.20	
		MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,120,120.00	
		MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,078,882.40	
		MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,072,552.60	
		MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	3,047,558.80	
		MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,004,611.00	
		MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,551,794.80	

		MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,417,917.20	
		MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,483,180.70	
		MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,801,346.40	
		MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,115,047.10	
	マレーシアリンギット 小計		50,500,000.00	52,306,590.90 (1,422,247,590)	
	イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	699,563.69	
		ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	853,659.56	
		ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,416,835.84	
		ILGOV 1.25% 11/30/22	4,960,000.00	5,021,677.10	
		ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,080,941.06	
		ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,796,938.31	
		ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,134,967.57	
		ILGOV 1% 03/31/30	2,650,000.00	2,611,609.45	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	2,360,000.00	2,559,945.33	
		ILGOV 2% 03/31/27	1,050,000.00	1,116,124.80	
		ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,413,076.10	
		ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	4,003,227.11	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	2,410,000.00	3,821,551.94	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	4,940,000.00	6,269,787.23	
	イスラエルシェケル 小計		34,580,000.00	38,799,905.09 (1,409,600,551)	
	香港・オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	5,100,000.00	4,980,201.00	
		CGB 2.56% 10/21/23	8,110,000.00	8,119,002.10	
		CGB 2.68% 05/21/30	4,500,000.00	4,401,225.00	
		CGB 2.84% 04/08/24	3,100,000.00	3,121,266.00	
		CGB 2.85% 06/04/27	3,750,000.00	3,758,362.50	
		CGB 3.01% 05/13/28	1,050,000.00	1,057,507.50	
		CGB 3.02% 05/27/31	500,000.00	505,350.00	
		CGB 3.03% 03/11/26	3,300,000.00	3,343,131.00	
		CGB 3.27% 11/19/30	500,000.00	513,750.00	
		CGB 3.28% 12/03/27	1,060,000.00	1,088,206.60	
		CGB 3.39% 03/16/50	920,000.00	906,614.00	
		CGB 3.72% 04/12/51	540,000.00	569,143.80	
		CGB 3.81% 09/14/50	920,000.00	979,671.20	
		CGB 3.86% 07/22/49	760,000.00	810,562.80	
		CGB 4.08% 10/22/48	610,000.00	679,930.40	
	香港・オフショア人民元 小計		34,720,000.00	34,833,923.90 (615,323,848)	
合計				298,087,497,691 (298,087,497,691)	

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　218銘柄	100.0%	46.5%
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　336銘柄	100.0%	39.7%
イギリスポンド	国債証券　52銘柄	100.0%	6.2%
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%	0.3%
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　14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券　27銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券　19銘柄	100.0%	0.4%
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　14銘柄	100.0%	0.5%
香港・オフショア人民元	国債証券　15銘柄	100.0%	0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,909,881,517
コール・ローン	499,412,891
株式	517,030,486,552
投資信託受益証券	288,946,693
投資証券	11,753,086,958

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	545,689,542
未収入金	125,559,840
未収配当金	356,061,219
差入委託証拠金	4,309,375,929
流動資産合計	537,818,501,141
資産合計	537,818,501,141
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	221,076
前受金	545,467,038
未払解約金	410,239,011
未払利息	1,110
流動負債合計	955,928,235
負債合計	955,928,235
純資産の部	
元本等	
元本	126,848,172,131
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	410,014,400,775
元本等合計	536,862,572,906
純資産合計	536,862,572,906
負債純資産合計	537,818,501,141

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (1)先物取引

	2021年11月10日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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11月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	126,848,172,131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　4.2323円 (1万口当たり純資産額)　(42,323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11月10日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
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11月10日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2021年11月10日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	152,201,958,636円
期中追加設定元本額	12,447,242,377円
期中一部解約元本額	37,801,028,882円
期末元本額	126,848,172,131円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,931,661,003円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,957,688円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	29,034,810,940円
世界経済インデックスファンド	9,274,913,315円
外国株式インデックス・オープン	824,864,717円
ＤＣマイセレクション２５	838,317,022円
ＤＣマイセレクション５０	3,915,013,000円
ＤＣマイセレクション７５	4,461,281,152円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	11,460,210,433円
ＤＣマイセレクションＳ２５	403,322,698円

区分	2021年11月10日現在
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,836,359,078円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,527,792,774円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	52,281,065円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	163,693,176円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	116,832,209円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,813,690,420円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,692,071,138円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,866,954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）	30,833,020円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	17,534,296円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	72,287,258円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	12,319,933円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	40,952,858円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	336,648,416円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	195,308,733円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,439,569,450円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	235,746,247円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	38,020,046円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	191,012,544円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	63,754,612円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,153,399,892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）	1,265,313,113円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,184,412,486円
コア投資戦略ファンド（安定型）	761,067,560円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,614,408,687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	8,381,677,425円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,240,489,715円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,098,337,195円
コア投資戦略ファンド（切替型）	678,849,198円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	624,299,380円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,464,831円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	165,725,457円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	625,342,457円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	18,545,505,385円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	170,216,106円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	604,474,014円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	116,922,347円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,557,168円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	135,096,828円
グローバル経済コア	655,202,542円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	12,197,850円

区分	2021年11月10日現在
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	4,697,143円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	492,176,711円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	61,288,677円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	14,529,777円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	10,053,108円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	4,915,022円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	6,143,942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）	363,412,870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）	847,860,282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）	1,533,398,095円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,036,508,633円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	160,560,072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）	55,608,951円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	20,817,741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）	23,336,869円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	269,423,198円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	274,199,214円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	266,246,764円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	264,646,323円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	259,631,356円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	255,658,802円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	46,838,387,668
投資信託受益証券	14,750,101
投資証券	1,092,478,324
合計	47,945,616,093

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	7,145,626,720	－	7,691,093,758	545,467,038
合計		7,145,626,720	－	7,691,093,758	545,467,038

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	23,698,122	－	23,699,550	1,428
	アメリカドル	23,698,122	－	23,699,550	1,428
合計		23,698,122	－	23,699,550	1,428

(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	25.28	1,465,734.40	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	106.92	2,035,115.28	
	CHEVRON CORP	155,065	116.00	17,987,540.00	
	CONOCOPHILLIPS	107,649	75.75	8,154,411.75	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	21.36	1,367,040.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	51,677	43.99	2,273,271.23	
	EOG RESOURCES INC	46,119	97.11	4,478,616.09	
	EXXON MOBIL	340,008	66.36	22,562,930.88	
	HALLIBURTON CO	68,269	25.08	1,712,186.52	

HESS CORP	22,781	86.30	1,966,000.30	
KINDER MORGAN INC	169,739	16.82	2,855,009.98	
MARATHON PETROLEUM CORP	54,237	67.13	3,640,929.81	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	33.74	2,669,036.44	
ONEOK INC	37,709	64.67	2,438,641.03	
PHILLIPS 66	35,503	79.17	2,810,772.51	
PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	187.34	3,414,084.16	
SCHLUMBERGER	116,716	34.14	3,984,684.24	
VALERO ENERGY CORP	34,683	78.25	2,713,944.75	
WILLIAMS COS	98,553	28.53	2,811,717.09	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	313.84	5,505,067.44	
ALBEMARLE CORP	9,440	274.57	2,591,940.80	
AMCOR PLC	132,975	12.31	1,636,922.25	
AVERY DENNISON CORP	6,638	227.13	1,507,688.94	
BALL CORP	25,605	91.28	2,337,224.40	
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	172.91	1,483,913.62	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	63.22	1,205,668.62	
CORTEVA INC	58,500	47.85	2,799,225.00	
CROWN HOLDINGS INC	11,212	106.79	1,197,329.48	
DOW INC	60,946	58.79	3,583,015.34	
DUPONT DE NEMOURS INC	43,310	81.02	3,508,976.20	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	112.34	1,244,165.50	
ECOLAB INC	21,075	230.95	4,867,271.25	
FMC CORP	10,507	106.99	1,124,143.93	
FREEPORT-MCMORAN INC	119,724	39.20	4,693,180.80	
INT'L PAPER CO	30,800	49.28	1,517,824.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	153.12	2,984,921.28	
LINDE PLC	41,677	338.62	14,112,665.74	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	92.81	2,104,281.13	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	421.97	2,245,302.37	
MOSAIC CO/THE	31,911	37.51	1,196,981.61	
NEWMONT CORPORATION	65,375	56.75	3,710,031.25	
NUCOR CORP	23,355	113.40	2,648,457.00	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	134.19	1,031,518.53	
PPG INDUSTRIES INC	19,278	161.45	3,112,433.10	
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	90.41	945,326.96	
SEALED AIR CORP	11,690	64.62	755,407.80	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20,217	324.05	6,551,318.85	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	65.73	1,201,084.29	
VULCAN MATERIALS CO	10,247	205.78	2,108,627.66	
WESTROCK CO	21,356	48.42	1,034,057.52	
3 M COMPANY	46,302	181.33	8,395,941.66	

ALLEGION PLC	7,601	132.97	1,010,704.97	
AMETEK INC	18,006	139.36	2,509,316.16	
BOEING CO	44,447	220.79	9,813,453.13	
CARRIER GLOBAL CORP	67,383	54.81	3,693,262.23	
CATERPILLAR	43,764	209.81	9,182,124.84	
CUMMINS INC	12,028	236.20	2,841,013.60	
DEERE&CO	23,783	355.81	8,462,229.23	
DOVER CORP	12,202	175.39	2,140,108.78	
EATON CORP	31,624	174.66	5,523,447.84	
EMERSON ELECTRIC CO	49,115	97.50	4,788,712.50	
FASTENAL CO	44,846	58.82	2,637,841.72	
FORTIVE CORP	25,722	78.63	2,022,520.86	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	104.62	1,078,632.20	
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	439.80	2,291,797.80	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	202.88	3,848,633.60	
GENERAL ELECTRIC CO	87,737	111.29	9,764,250.73	
GRAINGER (WW) INC	3,846	482.13	1,854,271.98	
HEICO CORP	3,640	149.80	545,272.00	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	139.01	896,475.49	
HONEYWELL INTL INC	55,630	227.75	12,669,732.50	
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	33.09	1,045,445.46	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	194.75	685,909.50	
IDEX CORP	5,916	235.86	1,395,347.76	
ILLINOIS TOOL WORKS	25,097	234.82	5,893,277.54	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	59.50	1,877,939.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	59.31	1,049,787.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	76.41	4,331,606.49	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	16,974	224.72	3,814,397.28	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	309.58	947,933.96	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,938	338.17	6,742,433.46	
MASCO CORP	19,462	65.72	1,279,042.64	
NORDSON CORP	4,121	262.95	1,083,616.95	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,113	364.52	4,415,430.76	
OTIS WORLDWIDE CORP	33,153	83.54	2,769,601.62	
OWENS CORNING	8,642	97.70	844,323.40	
PACCAR INC	28,106	88.02	2,473,890.12	
PARKER HANNIFIN CORP	10,508	329.57	3,463,121.56	
PENTAIR PLC	14,533	74.57	1,083,725.81	
PLUG POWER INC	41,884	40.72	1,705,516.48	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	121,255	90.99	11,032,992.45	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	335.64	3,053,652.72	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	489.38	4,068,705.32	

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	58.76	812,533.28	
SMITH (A.O.) CORP	12,146	78.71	956,011.66	
SNAP-ON INC	4,000	214.85	859,400.00	
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	188.02	2,368,675.96	
SUNRUN INC	13,917	55.99	779,212.83	
TEXTRON	18,893	76.43	1,443,991.99	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	19,522	189.54	3,700,199.88	
TRANSDIGM GROUP INC	4,075	685.00	2,791,375.00	
UNITED RENTALS INC	6,103	391.50	2,389,324.50	
WABTEC CORP	15,024	96.52	1,450,116.48	
XYLEM INC	15,209	133.51	2,030,553.59	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	87.82	997,986.48	
CINTAS CORP	7,423	436.95	3,243,479.85	
CLARIVATE PLC	27,357	23.22	635,229.54	
COPART INC	16,617	154.40	2,565,664.80	
COSTAR GROUP INC	32,116	83.25	2,673,657.00	
EQUIFAX INC	9,509	288.34	2,741,825.06	
IHS MARKIT LTD	30,929	126.53	3,913,446.37	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	144.51	1,540,621.11	
LEIDOS HOLDINGS	11,220	94.38	1,058,943.60	
REPUBLIC SERVICES INC	18,483	133.14	2,460,826.62	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	117.44	1,123,431.04	
ROLLINS INC	17,468	35.45	619,240.60	
TRANSUNION	15,741	114.91	1,808,798.31	
VERISK ANALYTICS INC	12,503	216.29	2,704,273.87	
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	133.94	2,849,573.50	
WASTE MANAGEMENT INC	34,610	159.58	5,523,063.80	
AMERCO	734	745.26	547,020.84	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	94.18	1,063,480.56	
CSX CORP	186,396	35.54	6,624,513.84	
DELTA AIR LINES INC	14,609	44.53	650,538.77	
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	125.29	1,788,138.88	
FEDEX CORP	20,644	249.48	5,150,265.12	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	195.28	1,377,114.56	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,340	311.40	2,285,676.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	59.38	635,366.00	
LYFT INC-A	21,288	56.26	1,197,662.88	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,853	284.60	5,650,163.80	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	351.94	2,816,575.82	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	50.91	688,965.03	
UBER TECHNOLOGIES INC	99,588	45.51	4,532,249.88	
UNION PACIFIC CORP	53,166	241.00	12,813,006.00	

UNITED PARCEL SERVICE B	57,890	209.96	12,154,584.40	
APTIV PLC	22,055	172.47	3,803,825.85	
AUTOLIV INC	6,776	103.14	698,876.64	
BORGWARNER INC	19,781	46.50	919,816.50	
FORD MOTOR COMPANY	320,829	20.12	6,455,079.48	
GENERAL MOTORS CO	103,796	58.62	6,084,521.52	
LEAR CORP	5,287	180.16	952,505.92	
TESLA INC	65,911	1,023.50	67,459,908.50	
DR HORTON INC	27,764	97.52	2,707,545.28	
GARMIN LTD	12,854	144.94	1,863,058.76	
HASBRO INC	10,572	97.64	1,032,250.08	
LENNAR CORP-CL A	22,762	107.66	2,450,556.92	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,788	470.24	4,602,709.12	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	173.22	876,839.64	
NEWELL BRANDS INC	31,461	24.47	769,850.67	
NIKE B	102,256	173.82	17,774,137.92	
NVR INC	297	5,200.27	1,544,480.19	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	50.13	1,089,625.68	
PULTE GROUP INC	21,609	51.91	1,121,723.19	
VF CORP	25,718	75.18	1,933,479.24	
WHIRLPOOL CORP	5,220	221.06	1,153,933.20	
AIRBNB INC-CLASS A	10,665	194.68	2,076,262.20	
ARAMARK	20,955	38.57	808,234.35	
BOOKING HOLDINGS INC	3,268	2,648.20	8,654,317.60	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	103.07	1,809,909.20	
CARNIVAL CORPORATION	70,520	24.17	1,704,468.40	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,304	1,814.90	4,181,529.60	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	155.61	1,666,894.32	
DOMINO'S PIZZA INC	3,251	498.49	1,620,590.99	
DRAFTKINGS INC - CL A	27,674	43.05	1,191,365.70	
EXPEDIA GROUP INC	11,638	188.00	2,187,944.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	148.46	3,248,007.88	
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	41.08	1,206,519.60	
MARRIOTT INTL A	23,009	164.77	3,791,192.93	
MCDONALD'S CORP	59,837	252.65	15,117,818.05	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	11.45	202,229.90	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	47.33	1,564,919.12	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	91.35	1,760,040.45	
STARBUCKS CORP	94,298	114.13	10,762,230.74	
VAIL RESORTS INC	3,014	359.46	1,083,412.44	
WYNN RESORTS LTD	9,302	94.12	875,504.24	
YUM BRANDS INC	24,252	126.19	3,060,359.88	

ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	67.10	4,136,245.30	
ALPHABET INC-CL A	24,227	2,978.37	72,156,969.99	
ALPHABET INC-CL C	23,448	2,984.97	69,991,576.56	
ALTICE USA INC- A	22,505	17.54	394,737.70	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	39.93	1,528,919.70	
CABLE ONE INC	445	1,800.69	801,307.05	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	10,540	696.31	7,339,107.40	
COMCAST CORP-CL A	368,233	53.75	19,792,523.75	
DISCOVERY INC - A	12,804	26.65	341,226.60	
DISCOVERY INC-C	28,190	25.74	725,610.60	
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	36.86	742,065.52	
ELECTRONIC ARTS INC	23,411	139.79	3,272,623.69	
FACEBOOK INC-A	192,925	335.37	64,701,257.25	
FOX CORP - CLASS A	27,658	40.54	1,121,255.32	
FOX CORP- CLASS B	15,092	37.70	568,968.40	
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	140.93	947,190.53	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	36.03	1,219,039.02	
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	167.64	432,343.56	
LIBERTY BROADBAND-C	12,312	170.82	2,103,135.84	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	57.84	889,521.36	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	54.53	740,735.52	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	54.99	351,056.16	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	116.61	1,621,811.88	
MATCH GROUP INC	20,191	155.59	3,141,517.69	
NETFLIX INC	35,617	655.99	23,364,395.83	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	23.73	794,456.67	
OMNICOM GROUP	18,031	68.99	1,243,958.69	
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	46.64	2,134,572.88	
ROKU INC	9,122	279.77	2,552,061.94	
SEA LTD-ADR	5,838	340.91	1,990,232.58	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.43	640,093.64	
SNAP INC - A	75,611	54.82	4,144,995.02	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,738	186.81	1,819,155.78	
THE WALT DISNEY CO	146,028	175.11	25,570,963.08	
TWITTER INC	63,066	53.70	3,386,644.20	
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	35.50	1,724,803.00	
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	66.62	366,210.14	
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	66.40	891,552.80	
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	232.39	1,237,244.36	
AMAZON.COM	36,596	3,576.23	130,875,713.08	
AUTOZONE INC	1,779	1,866.38	3,320,290.02	
BATH & BODY WORKS INC	19,806	75.25	1,490,401.50	

BEST BUY COMPANY INC	18,175	132.94	2,416,184.50	
BURLINGTON STORES INC	5,108	299.25	1,528,569.00	
CARMAX INC	13,891	154.85	2,151,021.35	
CARVANA CO	5,700	295.85	1,686,345.00	
CHEWY INC - CLASS A	6,878	76.62	526,992.36	
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	220.18	4,114,283.48	
DOLLAR TREE INC	17,931	111.15	1,993,030.65	
DOORDASH INC - A	6,300	192.01	1,209,663.00	
EBAY	53,823	73.96	3,980,749.08	
ETSY INC	10,294	258.67	2,662,748.98	
GENUINE PARTS CO	12,119	134.73	1,632,792.87	
HOME DEPOT	85,480	370.65	31,683,162.00	
LKQ CORP	22,779	57.34	1,306,147.86	
LOWES COMPANIES	56,608	233.91	13,241,177.28	
MERCADOLIBRE INC	3,567	1,709.98	6,099,498.66	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,694	643.45	3,663,804.30	
POOL CORP	3,304	526.31	1,738,928.24	
ROSS STORES INC	28,076	119.27	3,348,624.52	
TARGET (DAYTON HUDSON)	39,551	255.16	10,091,833.16	
TJX COMPANIES INC	96,126	69.68	6,698,059.68	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	220.86	1,970,512.92	
ULTA BEAUTY INC	3,990	395.11	1,576,488.90	
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	250.61	1,503,660.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	35,500	508.71	18,059,205.00	
KROGER CO	56,126	41.93	2,353,363.18	
SYSCO CORP	40,288	79.60	3,206,924.80	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	49.10	2,934,559.70	
WALMART INC	124,190	149.79	18,602,420.10	
ALTRIA GROUP INC	147,613	44.79	6,611,586.27	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,402	64.43	2,925,250.86	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	744	484.97	360,817.68	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	72.50	1,900,950.00	
BUNGE LIMITED	11,604	92.89	1,077,895.56	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	41.28	655,072.32	
COCA-COLA CO	328,753	56.49	18,571,256.97	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	57.80	889,773.20	
CONAGRA BRANDS INC	41,157	32.54	1,339,248.78	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,180	221.64	3,142,855.20	
GENERAL MILLS INC	49,646	63.17	3,136,137.82	
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	176.18	1,999,995.36	
HORMEL FOODS CORP	23,338	43.25	1,009,368.50	
JM SMUCKER CO	9,145	128.58	1,175,864.10	

KELLOGG CO	21,630	62.94	1,361,392.20	
KEURIG DR PEPPER INC	59,596	35.78	2,132,344.88	
KRAFT HEINZ CO/THE	52,188	37.35	1,949,221.80	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	58.78	759,672.72	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	80.98	1,707,706.24	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	45.69	670,226.61	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	111,937	62.24	6,966,958.88	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	91.76	2,960,819.92	
PEPSICO INC	110,876	163.51	18,129,334.76	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,866	93.67	11,696,198.22	
TYSON FOODS INC	25,074	81.52	2,044,032.48	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	89.66	1,887,791.30	
CLOROX COMPANY	9,570	166.15	1,590,055.50	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	78.05	4,978,653.40	
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	347.07	6,399,276.66	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,550	132.46	3,649,273.00	
PROCTER & GAMBLE CO	196,819	145.39	28,615,514.41	
ABBOTT LABORATORIES	142,590	126.43	18,027,653.70	
ABIOMED INC	3,781	371.35	1,404,074.35	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	711.02	4,225,591.86	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	124.67	1,607,744.32	
ANTHEM INC	19,533	430.12	8,401,533.96	
BAXTER INTERNATIONAL	40,994	77.70	3,185,233.80	
BECTON DICKINSON & CO	23,131	243.66	5,636,099.46	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	42.79	4,826,797.58	
CARDINAL HEALTH	24,692	49.32	1,217,809.44	
CENTENE CORP	48,540	74.77	3,629,335.80	
CERNER CORP	25,323	74.16	1,877,953.68	
CIGNA CORP	27,283	216.20	5,898,584.60	
CVS HEALTH CORP	105,249	92.76	9,762,897.24	
DANAHER CORP	51,501	299.19	15,408,584.19	
DAVITA INC	5,784	106.81	617,789.04	
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	55.77	991,255.98	
DEXCOM INC	7,647	637.05	4,871,521.35	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51,036	120.04	6,126,361.44	
HCA HEALTHCARE INC	21,426	246.14	5,273,795.64	
HENRY SCHEIN INC	11,747	78.15	918,028.05	
HOLOGIC INC	21,687	71.26	1,545,415.62	
HUMANA INC	10,553	450.40	4,753,071.20	
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	629.26	4,248,134.26	
INSULET CORP	5,311	318.29	1,690,438.19	
INTUITIVE SURGICAL INC	28,389	364.15	10,337,854.35	

LABORATORY CRP OF AMER	7,595	276.55	2,100,397.25	
MASIMO CORP	4,147	287.79	1,193,465.13	
MCKESSON CORP	12,843	219.46	2,818,524.78	
MEDTRONIC PLC	108,067	122.29	13,215,513.43	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	305.38	1,508,577.20	
NOVOCURE LTD	7,933	106.11	841,770.63	
OAK STREET HEALTH INC	7,613	37.14	282,746.82	
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	142.03	1,421,010.15	
RESMED INC	11,440	261.65	2,993,276.00	
STERIS PLC	8,018	228.99	1,836,041.82	
STRYKER CORP	27,043	275.17	7,441,422.31	
TELADOC HEALTH INC	11,375	143.06	1,627,307.50	
TELEFLEX INC	3,934	342.32	1,346,686.88	
THE COOPER COS INC	4,134	433.63	1,792,626.42	
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,880	464.35	35,234,878.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	128.43	783,679.86	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	320.09	3,602,612.95	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	414.11	2,388,172.37	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,300	134.38	2,324,774.00	
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	168.19	951,114.45	
ABBVIE INC	141,675	115.61	16,379,046.75	
AGILENT TECHNOLOGIES	24,927	159.81	3,983,583.87	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	183.92	1,773,540.56	
AMGEN	45,952	211.71	9,728,497.92	
AVANTOR INC	42,980	39.10	1,680,518.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	732.08	1,356,544.24	
BIO-TECHNE CORP	3,245	502.14	1,629,444.30	
BIOGEN INC	11,860	270.03	3,202,555.80	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	82.76	1,223,441.08	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	178,823	59.46	10,632,815.58	
CATALENT INC	13,739	125.04	1,717,924.56	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	383.45	1,612,023.80	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	33.10	1,193,619.10	
EXACT SCIENCES CORP	14,756	99.38	1,466,451.28	
GILEAD SCIENCES INC	100,025	66.15	6,616,653.75	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	107.63	1,929,375.38	
ILLUMINA INC	11,968	395.36	4,731,668.48	
INCYTE CORP	15,212	66.53	1,012,054.36	
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	251.80	3,808,726.80	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	132.00	656,172.00	
JOHNSON & JOHNSON	211,820	162.51	34,422,868.20	
LILLY (ELI) & CO	65,377	262.02	17,130,081.54	

MERCK & CO	203,094	82.72	16,799,935.68	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,917	1,557.51	2,985,746.67	
MODERNA INC	27,309	236.85	6,468,136.65	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	92.07	780,201.18	
NOVAVAX INC	5,754	169.30	974,152.20	
PERKINELMER INC	9,372	174.55	1,635,882.60	
PFIZER	449,496	47.30	21,261,160.80	
PPD INC	11,027	47.23	520,805.21	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,586	616.31	5,291,637.66	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	39.60	615,146.40	
SEAGEN INC	11,471	185.86	2,132,000.06	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.30	747,729.30	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,550	618.58	19,516,199.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,153	191.09	4,042,126.77	
VIATRIS INC	103,541	14.57	1,508,592.37	
WATERS CORP	5,228	350.15	1,830,584.20	
ZOETIS INC	37,880	220.22	8,341,933.60	
BANK OF AMERICA CORP	619,949	46.88	29,063,209.12	
CITIGROUP	165,561	67.99	11,256,492.39	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	47.83	1,723,841.03	
FIFTH THIRD BANCORP	57,022	44.09	2,514,099.98	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	219.32	3,023,764.84	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	15.87	1,810,957.44	
JPMORGAN CHASE & CO	243,564	167.78	40,865,167.92	
KEY CORP	83,212	23.71	1,972,956.52	
M & T BANK CORP	10,537	154.61	1,629,125.57	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33,857	207.04	7,009,753.28	
REGIONS FINL CORP	81,824	24.34	1,991,596.16	
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	750.47	3,410,886.15	
TRUIST FINANCIAL CORP	107,118	64.74	6,934,819.32	
US BANCORP	112,812	60.07	6,776,616.84	
WELLS FARGO & CO	331,600	49.89	16,543,524.00	
ALLY FINANCIAL INC	31,445	49.08	1,543,320.60	
AMERICAN EXPRESS	54,596	179.86	9,819,636.56	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,404	305.20	2,870,100.80	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	76.29	1,156,022.37	
BANK NEW YORK CO	67,972	58.58	3,981,799.76	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	106,664	286.35	30,543,236.40	
BLACKROCK INC	12,198	966.75	11,792,416.50	
BLACKSTONE INC	54,507	146.39	7,979,279.73	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,066	155.42	5,760,797.72	
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	59.45	748,772.75	

CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	131.22	1,164,577.50	
CME GROUP INC	28,556	221.73	6,331,721.88	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	24,840	116.81	2,901,560.40	
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	34.51	1,132,445.65	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	445.78	1,403,315.44	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	35.72	931,220.40	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	54.76	236,344.16	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,184	405.35	11,019,034.40	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	135.48	6,056,362.44	
INVESCO LTD	26,420	26.01	687,184.20	
KKR & CO INC	43,643	79.65	3,476,164.95	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	387.19	1,241,718.33	
MOODY'S CORP	13,365	392.30	5,243,089.50	
MORGAN STANLEY	111,716	99.71	11,139,202.36	
MSCI INC	6,518	652.82	4,255,080.76	
NASDAQ INC	9,657	210.81	2,035,792.17	
NORTHERN TRUST CORP	15,902	121.89	1,938,294.78	
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	219.66	3,933,451.62	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	99.90	1,547,051.40	
S&P GLOBAL INC	19,238	461.98	8,887,571.24	
SCHWAB (CHARLES) CORP	115,518	80.78	9,331,544.04	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	64.29	613,969.50	
STATE STREET CORP	29,894	96.03	2,870,720.82	
SYNCHRONY FINANCIAL	45,369	49.31	2,237,145.39	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	95.55	865,778.55	
VOYA FINANCIAL INC	10,050	65.94	662,697.00	
AFLAC	50,591	56.28	2,847,261.48	
ALLEGHANY CORP	1,276	692.08	883,094.08	
ALLSTATE CORP	24,717	115.19	2,847,151.23	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	144.77	914,801.63	
AMERICAN INT'L GROUP	71,038	58.76	4,174,192.88	
AON PLC	18,508	297.53	5,506,685.24	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	42.02	1,429,982.62	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	161.56	2,642,960.04	
ASSURANT INC	4,726	160.43	758,192.18	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	86.44	882,293.08	
BROWN & BROWN INC	19,873	63.01	1,252,197.73	
CHUBB LTD	35,817	193.52	6,931,305.84	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	124.16	1,588,130.56	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	225.92	489,342.72	
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	272.44	895,782.72	
FNF GROUP	20,461	50.72	1,037,781.92	

GLOBE LIFE INC	8,106	92.34	748,508.04	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	72.17	2,000,624.57	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	72.21	973,679.64	
LOEWS CORP	18,851	57.66	1,086,948.66	
MARKEL CORP	1,156	1,304.39	1,507,874.84	
MARSH & MCLENNAN COS	40,497	164.92	6,678,765.24	
METLIFE INC	60,762	62.97	3,826,183.14	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	68.31	1,576,048.32	
PROGRESSIVE CORP	47,880	95.45	4,570,146.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,037	109.16	3,387,998.92	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,733	155.98	582,273.34	
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	157.40	3,112,112.80	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,061	233.38	2,348,036.18	
WR BERKLEY CORP	11,715	81.32	952,663.80	
CBRE GROUP INC-A	27,882	106.02	2,956,049.64	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.70	562,590.00	
WEYERHAEUSER CO	58,295	37.55	2,188,977.25	
ACCENTURE PLC-CL A	50,998	367.47	18,740,235.06	
ADOBE INC	38,396	667.92	25,645,456.32	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	13,673	109.32	1,494,732.36	
ANSYS INC	6,794	405.97	2,758,160.18	
AUTODESK INC	17,467	329.40	5,753,629.80	
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,910	229.20	7,772,172.00	
AVALARA INC	6,847	162.80	1,114,691.60	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	60.26	843,398.96	
BLACK KNIGHT INC	11,543	77.61	895,852.23	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	178.36	1,737,583.12	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	182.37	3,997,915.14	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	121.47	1,295,841.96	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	118.36	961,556.64	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	90.35	943,615.40	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,902	204.60	3,662,749.20	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	42,997	80.51	3,461,688.47	
COUPA SOFTWARE INC	6,059	241.52	1,463,369.68	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,466	293.18	4,534,321.88	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	198.81	616,311.00	
DATADOG INC - CLASS A	15,147	196.56	2,977,294.32	
DOCUSIGN INC	15,919	275.17	4,380,431.23	
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	28.53	822,947.85	
DYNATRACE INC	14,790	76.04	1,124,631.60	
EPAM SYSTEMS INC	4,403	717.08	3,157,303.24	
FAIR ISAAC CORP	2,125	403.74	857,947.50	

FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	50,915	115.47	5,879,155.05	
FISERV INC	49,211	99.62	4,902,399.82	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,523	244.08	1,592,133.84	
FORTINET INC	11,565	349.06	4,036,878.90	
GARTNER INC	6,968	339.34	2,364,521.12	
GLOBAL PAYMENTS INC	24,126	132.82	3,204,415.32	
GODADDY INC - CLASS A	13,798	71.71	989,454.58	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	127.83	807,629.94	
HUBSPOT INC	3,646	850.32	3,100,266.72	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,479	120.85	8,638,237.15	
INTUIT INC	21,881	612.78	13,408,239.18	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	159.04	1,000,520.64	
MASTERCARD INC-CLASS A	71,090	344.65	24,501,168.50	
MICROSOFT CORP	576,923	335.95	193,817,281.85	
MONGODB INC	4,623	576.77	2,666,407.71	
NORTONLIFELOCK INC	50,376	25.11	1,264,941.36	
OKTA INC	10,230	268.28	2,744,504.40	
ORACLE CORP	150,256	94.59	14,212,715.04	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	24.25	3,037,167.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,957	512.32	4,076,530.24	
PAYCHEX INC	25,433	122.97	3,127,496.01	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	507.33	2,148,542.55	
PAYPAL HOLDINGS INC	89,664	205.42	18,418,778.88	
PTC INC	8,304	122.37	1,016,160.48	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	233.64	1,493,660.52	
SALESFORCE.COM INC	78,035	309.71	24,168,219.85	
SERVICENOW INC	15,788	691.27	10,913,770.76	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	15,775	376.70	5,942,442.50	
SPLUNK INC	13,355	173.31	2,314,555.05	
SQUARE INC - A	31,267	230.78	7,215,798.26	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	79.18	1,530,945.30	
SYNOPSYS INC	12,038	348.26	4,192,353.88	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35,780	97.09	3,473,880.20	
TWILIO INC - A	12,842	310.60	3,988,725.20	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	541.77	1,808,970.03	
UNITY SOFTWARE INC	4,329	171.63	742,986.27	
VERISIGN INC	7,790	233.58	1,819,588.20	
VISA INC-CLASS A SHARES	136,046	213.39	29,030,855.94	
VMWARE INC-CLASS A	16,717	128.95	2,155,657.15	
WESTERN UNION CO	29,297	18.05	528,810.85	
WIX.COM LTD	5,010	200.90	1,006,509.00	
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	293.48	4,550,407.40	

ZENDESK INC	10,500	100.35	1,053,675.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,545	258.40	4,533,628.00	
ZSCALER INC	6,234	352.61	2,198,170.74	
AMPHENOL CORPORATION	48,807	82.29	4,016,328.03	
APPLE INC	1,345,437	150.81	202,905,353.97	
ARISTA NETWORKS INC	4,720	531.36	2,508,019.20	
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	119.98	731,878.00	
CDW CORP/DE	10,882	187.02	2,035,151.64	
CISCO SYSTEMS	338,342	57.44	19,434,364.48	
COGNEX CORP	14,352	83.20	1,194,086.40	
CORNING	64,989	38.22	2,483,879.58	
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	56.08	1,260,734.48	
F5 NETWORKS INC	5,350	225.56	1,206,746.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	15.53	1,695,083.97	
HP INC	98,163	31.77	3,118,638.51	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	168.52	540,443.64	
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	31.42	795,585.82	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	185.86	2,785,855.54	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,091	249.43	3,514,718.13	
NETAPP INC	18,303	91.80	1,680,215.40	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,940	99.29	1,781,262.60	
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	161.06	4,198,512.08	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	438.99	1,711,622.01	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	88.40	1,871,958.40	
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	56.25	1,450,687.50	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	595.72	2,479,386.64	
AT&T INC	572,789	24.71	14,153,616.19	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	28.52	442,516.32	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	28.44	781,730.28	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	14.00	1,032,766.00	
T-MOBILE US INC	49,657	119.86	5,951,888.02	
VERIZON COMMUNICATIONS	332,338	52.24	17,361,337.12	
AES CORP	54,375	23.89	1,299,018.75	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	55.43	1,151,724.54	
AMEREN CORPORATION	20,898	83.04	1,735,369.92	
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,494	83.04	3,445,661.76	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	169.52	2,402,776.48	
ATMOS ENERGY CORP	11,419	93.14	1,063,565.66	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	26.52	1,277,256.24	
CMS ENERGY CORP	23,697	60.07	1,423,478.79	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	77.83	2,237,223.35	
DOMINION ENERGY INC	66,075	74.58	4,927,873.50	

DTE ENERGY COMPANY	16,240	112.50	1,827,000.00	
DUKE ENERGY CORP	63,155	101.96	6,439,283.80	
EDISON INTL	32,117	64.60	2,074,758.20	
ENTERGY CORP	16,926	102.32	1,731,868.32	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	47.25	984,406.50	
EVERGY INC	18,475	64.12	1,184,617.00	
EVERSOURCE ENERGY	26,753	83.32	2,229,059.96	
EXELON CORP	77,196	54.09	4,175,531.64	
FIRSTENERGY CORP	45,787	38.30	1,753,642.10	
NEXTERA ENERGY INC	157,142	84.94	13,347,641.48	
NISOURCE INC	35,781	25.03	895,598.43	
NRG ENERGY INC	19,068	34.89	665,282.52	
PG&E CORP	118,132	12.18	1,438,847.76	
PINNACLE WEST CAPITAL	8,632	63.36	546,923.52	
PPL CORPORATION	63,429	28.75	1,823,583.75	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	62.16	2,453,330.88	
SEMPRA ENERGY	25,825	125.06	3,229,674.50	
SOUTHERN CO	84,113	63.35	5,328,558.55	
UGI CORP	18,019	44.60	803,647.40	
VISTRA CORP	37,797	19.34	730,993.98	
WEC ENERGY GROUP INC	24,561	89.79	2,205,332.19	
XCEL ENERGY INC	43,741	63.60	2,781,927.60	
ADVANCED MICRO DEVICES	97,184	148.92	14,472,641.28	
ANALOG DEVICES	42,907	185.00	7,937,795.00	
APPLIED MATERIALS	73,379	156.29	11,468,403.91	
BROADCOM INC	32,757	557.80	18,271,854.60	
ENPHASE ENERGY INC	10,113	239.39	2,420,951.07	
INTEL CORP	324,092	51.20	16,593,510.40	
KLA CORP	12,119	417.11	5,054,956.09	
LAM RESEARCH CORP	11,353	621.91	7,060,544.23	
MARVELL TECHNOLOGY INC	66,930	72.94	4,881,874.20	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,808	82.92	3,715,479.36	
MICRON TECHNOLOGY	89,326	75.59	6,752,152.34	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	553.47	1,954,302.57	
NVIDIA CORP	200,518	306.57	61,472,803.26	
NXP SEMICONDUCTORS NV	21,843	221.05	4,828,395.15	
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	58.20	2,094,967.20	
QORVO INC	9,678	157.64	1,525,639.92	
QUALCOMM	90,340	166.74	15,063,291.60	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	164.16	2,195,147.52	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	351.14	1,615,244.00	
TERADYNE INC	14,398	145.42	2,093,757.16	

	TEXAS INSTRUMENTS	74,049	190.79	14,127,808.71	
	XILINX INC	19,302	205.00	3,956,910.00	
アメリカドル 小計		25,534,686		3,355,148,974.40 (378,662,113,250)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	34.47	926,553.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	54.24	5,054,842.56	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	16.36	1,581,455.76	
	ENBRIDGE	163,399	52.62	8,598,055.38	
	IMPERIAL OIL	24,763	43.33	1,072,980.79	
	KEYERA CORP	18,607	30.62	569,746.34	
	PARKLAND CORP	14,075	35.97	506,277.75	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	42.89	1,958,614.74	
	SUNCOR ENERGY	116,208	32.67	3,796,515.36	
	TC ENERGY CORP	77,328	62.83	4,858,518.24	
	AGNICO EAGLE MINES	20,293	69.06	1,401,434.58	
	B2GOLD CORP	90,243	5.47	493,629.21	
	BARRICK GOLD CORP	139,009	24.41	3,393,209.69	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	70.46	925,773.94	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	27.63	1,188,090.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	181.23	2,784,236.49	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	9.76	506,026.72	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	7.77	842,664.27	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	54.33	1,272,843.24	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	10.78	670,979.54	
	NUTRIEN LTD	44,786	85.24	3,817,558.64	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	33.34	613,822.74	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	33.96	1,377,451.56	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	103.69	808,782.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	52.44	1,795,440.72	
	YAMANA GOLD INC	81,672	5.31	433,678.32	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	21.03	414,795.72	
	CAE INC	25,999	42.36	1,101,317.64	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	112.59	867,505.95	
	WSP GLOBAL INC	8,602	172.53	1,484,103.06	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	48.30	652,291.50	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	87.91	900,637.95	
	THOMSON REUTERS CORP	13,293	150.04	1,994,481.72	
	AIR CANADA	13,805	26.41	364,590.05	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,324	164.28	9,417,186.72	
	CP RAILWAY LIMITED	52,569	96.91	5,094,461.79	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	104.51	2,433,201.82	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	52.21	891,694.59	

RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	72.29	1,667,947.17	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.26	459,952.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	36.70	1,299,987.40	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	185.44	1,003,044.96	
DOLLARAMA INC	22,000	58.19	1,280,180.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	66,914	50.35	3,369,119.90	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	39.07	595,934.71	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	96.98	1,252,302.74	
METRO INC	18,840	65.29	1,230,063.60	
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	137.66	947,513.78	
SAPUTO INC	14,489	31.57	457,417.73	
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	34.30	953,540.00	
CANOPY GROWTH CORP	20,989	17.38	364,788.82	
BANK MONTREAL	51,389	139.40	7,163,626.60	
BANK NOVA SCOTIA	96,500	82.84	7,994,060.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK	36,854	148.43	5,470,239.22	
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	104.47	2,850,881.83	
ROYAL BANK OF CANADA	114,053	132.23	15,081,228.19	
TORONTO-DOMINION BANK	145,443	91.65	13,329,850.95	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	102,035	76.40	7,795,474.00	
IGM FINANCIAL INC	7,685	51.14	393,010.90	
ONEX CORP	6,603	94.42	623,455.26	
TMX GROUP LTD	4,685	134.38	629,570.30	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	526.56	1,123,152.48	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.59	917,978.92	
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	74.13	748,638.87	
INTACT FINANCIAL CORP	13,312	166.19	2,212,321.28	
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	24.82	4,047,049.92	
POWER CORP OF CANADA	43,577	42.75	1,862,916.75	
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	71.18	3,253,068.36	
FIRSTSERVICE CORP	3,690	244.28	901,393.20	
BLACKBERRY LIMITED	39,400	13.91	548,054.00	
CGI INC - CL A	18,428	114.77	2,114,981.56	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	2,189.05	3,636,012.05	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	88.68	735,689.28	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	139.66	600,677.66	
OPEN TEXT CORP	20,463	64.95	1,329,071.85	
SHOPIFY INC - CLASS A	9,030	1,935.30	17,475,759.00	
BCE INC	6,203	63.86	396,123.58	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	60.90	1,862,565.60	
TELUS CORP	32,908	29.23	961,900.84	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	17.77	920,805.86	

	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	25.14	613,290.30	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	41.04	215,090.64	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	50.16	566,557.20	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.96	360,927.04	
	EMERA INC	18,723	58.34	1,092,299.82	
	FORTIS INC	36,823	56.43	2,077,921.89	
	HYDRO ONE LTD	23,269	30.43	708,075.67	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	39.03	696,841.62	
カナダドル 小計		3,288,496		205,057,805.99 (18,598,743,003)	
ユーロ	ENI	197,669	12.62	2,494,582.78	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	8.89	437,433.04	
	NESTE OIL OYJ	32,126	48.39	1,554,577.14	
	OMV AG	12,549	53.60	672,626.40	
	REPSOL SA	111,112	10.80	1,200,676.27	
	TENARIS SA	40,648	10.85	441,030.80	
	TOTALENERGIES SE	199,789	43.53	8,697,814.11	
	VOPAK	6,360	33.51	213,123.60	
	AIR LIQUIDE	38,463	150.90	5,804,066.70	
	AKZO NOBEL	15,301	101.80	1,557,641.80	
	ARCELORMITTAL	55,231	27.74	1,532,384.09	
	ARKEMA	4,369	117.45	513,139.05	
	BASF SE	74,374	61.71	4,589,619.54	
	COVESTRO AG	14,454	55.28	799,017.12	
	CRH PLC	64,773	43.78	2,835,761.94	
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	27.65	546,198.10	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	41.50	239,123.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	64.68	843,491.88	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	190.20	2,607,071.40	
	LANXESS	7,293	54.92	400,531.56	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	45.59	889,187.36	
	SOLVAY SA	5,356	103.80	555,952.80	
	STORA ENSO OYJ R	42,169	14.47	610,396.27	
	SYMRISE AG	9,776	123.45	1,206,847.20	
	UMICORE	17,605	49.87	877,961.35	
	UPM KYMMENE OYJ	45,603	30.88	1,408,220.64	
	VOESTALPINE AG	7,152	33.46	239,305.92	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,729	23.21	481,120.09	
	AIRBUS SE	47,862	116.32	5,567,307.84	
	ALSTOM	24,388	31.90	777,977.20	
	BOUYGUES ORD	16,606	33.38	554,308.28	
	BRENNTAG SE	12,514	79.10	989,857.40	

CNH INDUSTRIAL NV	81,026	15.03	1,218,225.91	
DASSAULT AVIATION SA	2,130	95.55	203,521.50	
EIFFAGE	5,924	92.16	545,955.84	
FERROVIAL SA	41,438	26.87	1,113,439.06	
FERROVIAL SA-RTS	41,438	0.31	12,887.21	
GEA GROUP AG	13,382	44.13	590,547.66	
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	100.95	1,251,578.10	
KION GROUP AG	5,887	96.84	570,097.08	
KNORR-BREMSE AG	6,822	94.36	643,723.92	
KONE OYJ-B	26,311	58.82	1,547,613.02	
LEGRAND SA	21,768	94.54	2,057,946.72	
MTU AERO ENGINES AG	4,753	203.70	968,186.10	
PRYSMIAN SPA	21,155	33.58	710,384.90	
RATIONAL AG	483	894.80	432,188.40	
SAFRAN SA	28,410	120.62	3,426,814.20	
SAINT-GOBAIN	40,093	60.64	2,431,239.52	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,968	154.28	6,629,103.04	
SIEMENS	61,210	145.70	8,918,297.00	
SIEMENS ENERGY AG	36,181	24.58	889,328.98	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	20.60	462,161.00	
THALES SA	9,665	83.60	807,994.00	
VINCI S.A.	43,434	94.44	4,101,906.96	
WARTSILA OYJ	41,917	12.52	525,010.42	
BUREAU VERITAS SA	25,073	29.10	729,624.30	
RANDSTAD NV	11,218	62.46	700,676.28	
TELEPERFORMANCE	4,734	357.60	1,692,878.40	
WOLTERS KLUWER	20,839	94.54	1,970,119.06	
ADP	2,382	122.95	292,866.90	
AENA SME SA	6,542	149.80	979,991.60	
ATLANTIA SPA	35,937	17.09	614,163.33	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	7.00	162,973.81	
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	56.31	4,432,385.34	
GETLINK	29,362	13.83	406,223.27	
INPOST SA	12,480	14.32	178,738.56	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	90.66	2,366,860.62	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	77.00	384,307.00	
CONTINENTAL AG	8,168	105.50	861,724.00	
DAIMLER AG	69,397	87.42	6,066,685.74	
FAURECIA	10,948	46.48	508,863.04	
FERRARI NV	10,170	221.70	2,254,689.00	
MICHELIN	13,839	135.40	1,873,800.60	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	85.82	1,007,955.90	

RENAULT SA	17,362	33.65	584,318.11	
STELLANTIS NV	159,744	17.44	2,785,935.36	
VALEO SA	21,538	27.62	594,879.56	
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,167	185.72	2,816,815.24	
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	285.20	709,007.20	
ADIDAS AG	15,395	295.50	4,549,222.50	
ESSILORLUXOTTICA	23,442	184.64	4,328,330.88	
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,440.50	3,657,429.50	
KERING	5,855	681.90	3,992,524.50	
LVMH	22,273	707.30	15,753,692.90	
MONCLER SPA	14,361	66.02	948,113.22	
PUMA SE	9,220	111.50	1,028,030.00	
SEB SA	2,282	134.80	307,613.60	
ACCOR	14,436	33.16	478,697.76	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	145.65	1,900,441.20	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	45.37	367,859.96	
SODEXO	8,135	83.82	681,875.70	
BOLLORE	83,646	5.11	427,431.06	
PUBLICIS GROUPE	17,077	57.54	982,610.58	
SCOUT24 SE	7,492	63.46	475,442.32	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	47.00	332,337.00	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	61,243	26.46	1,620,489.78	
VIVENDI SE	61,243	10.97	671,835.71	
DELIVERY HERO SE	13,414	109.75	1,472,186.50	
HELLOFRESH SE	13,805	85.68	1,182,812.40	
INDITEX	87,326	31.89	2,784,826.14	
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	63.05	981,814.60	
PROSUS	75,024	72.66	5,451,243.84	
ZALANDO SE	17,664	76.44	1,350,236.16	
CARREFOUR	52,544	15.79	829,932.48	
COLRUYT SA	5,424	42.54	230,736.96	
JERONIMO MARTINS	24,901	20.65	514,205.65	
KESKO OYJ-B SHS	20,083	29.18	586,021.94	
KONINKLIJKE AHOLD NV	87,400	28.53	2,493,522.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,098	51.81	3,113,677.38	
DANONE (GROUPE)	51,543	57.26	2,951,352.18	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	12.78	627,204.06	
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	80.25	742,392.75	
HEINEKEN NV	20,157	96.14	1,937,893.98	
JDE PEET'S BV	7,000	25.70	179,900.00	
KERRY GROUP PLC-A	13,050	115.35	1,505,317.50	
PERNOD-RICARD	16,970	205.30	3,483,941.00	

REMY COINTREAU	2,382	178.90	426,139.80	
BEIERSDORF AG	7,430	92.96	690,692.80	
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	72.25	634,355.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	77.42	1,117,867.38	
LOREAL	20,148	414.55	8,352,353.40	
AMPLIFON SPA	11,650	46.54	542,191.00	
BIOMERIEUX	4,175	106.90	446,307.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	182.30	625,289.00	
DIASORIN SPA	2,070	182.80	378,396.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,472	58.34	1,019,316.48	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	37.77	1,272,433.53	
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	41.51	2,978,550.05	
ORPEA	4,336	91.22	395,529.92	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,224	557.60	1,240,102.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	59.52	1,283,667.84	
ARGENX SE	3,428	278.50	954,698.00	
BAYER	79,047	50.75	4,011,635.25	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	102.76	1,050,207.20	
GRIFOLS SA	27,685	18.43	510,372.97	
IPSEN	3,532	85.14	300,714.48	
MERCK KGAA	10,555	208.20	2,197,551.00	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	38.22	376,619.88	
QIAGEN N.V.	17,038	46.26	788,177.88	
RECORDATI SPA	9,859	56.00	552,104.00	
SANOFI	90,684	88.61	8,035,509.24	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	469.30	1,135,236.70	
UCB (GROUPE)	9,389	104.90	984,906.10	
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	12.73	508,513.69	
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	5.97	3,194,754.61	
BANCO SANTANDER SA	1,404,532	3.19	4,482,563.87	
BNP PARIBAS	89,478	58.87	5,267,569.86	
CAIXABANK	380,168	2.48	945,477.81	
COMMERZBANK AG	94,388	6.70	632,399.60	
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	13.10	1,172,646.50	
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	41.31	987,515.55	
FINECOBANK SPA	53,120	16.96	901,180.80	
ING GROEP NV-CVA	320,768	13.15	4,220,665.34	
INTESA SANPAOLO	1,346,514	2.47	3,326,562.83	
KBC GROEP NV	21,052	85.06	1,790,683.12	
MEDIOBANCA	53,990	10.71	578,502.85	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	28.50	355,965.00	
SOCIETE GENERALE	67,846	29.51	2,002,474.69	

UNICREDIT SPA	168,352	11.38	1,916,855.87	
AMUNDI SA	4,626	78.30	362,215.80	
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	10.99	1,765,458.09	
DEUTSCHE BOERSE	14,999	149.45	2,241,600.55	
EURAZEO SA	3,357	77.55	260,335.35	
EXOR NV	7,825	83.74	655,265.50	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	103.45	880,876.75	
SOFINA	1,238	396.00	490,248.00	
WENDEL	2,023	115.60	233,858.80	
AEGON	166,267	4.26	709,461.28	
AGEAS	16,065	42.40	681,156.00	
ALLIANZ SE-REG	32,896	203.30	6,687,756.80	
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	18.98	1,625,818.44	
AXA SA	155,519	25.35	3,943,184.24	
CNP ASSURANCES	16,287	21.67	352,939.29	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	162.20	702,812.60	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,376	253.95	2,888,935.20	
NN GROUP NV	22,611	46.43	1,049,828.73	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	12.44	572,675.40	
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	44.82	1,732,517.10	
SCOR SE	13,354	28.00	373,912.00	
AROUNDTOWN SA	94,068	6.21	584,914.82	
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	130.65	689,178.75	
VONOVIA SE	45,080	52.12	2,349,569.60	
ADYEN NV	1,566	2,606.00	4,080,996.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	64.24	2,285,916.16	
ATOS SE	9,750	42.80	417,300.00	
BECHTLE AG	7,659	69.14	529,543.26	
CAPGEMINI SA	12,715	212.20	2,698,123.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	54.82	2,892,686.94	
EDENRED	18,664	44.52	830,921.28	
NEMETSCHEK SE	5,455	114.15	622,688.25	
NEXI SPA	31,458	14.50	456,141.00	
SAP SE	83,616	128.32	10,729,605.12	
TEAMVIEWER AG	14,174	14.53	206,019.09	
WORLDLINE SA	20,332	50.05	1,017,616.60	
NOKIA OYJ	450,608	5.05	2,275,570.40	
CELLNEX TELECOM SA	41,435	53.58	2,220,087.30	
DEUTSCHE TELEKOM	269,906	16.53	4,463,705.42	
ELISA A	10,227	53.84	550,621.68	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.74	296,095.50	
KPN (KON.)	282,927	2.61	739,571.17	

	ORANGE	153,815	9.65	1,484,776.19	
	PROXIMUS	13,141	16.68	219,257.58	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.32	280,489.60	
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.34	161,871.61	
	TELEFONICA	402,460	3.81	1,536,391.05	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.44	241,358.17	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	34.44	327,627.72	
	E.ON SE	185,377	11.01	2,042,113.03	
	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	22.40	480,838.40	
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	12.91	510,216.11	
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	101.90	298,057.50	
	ENAGAS	15,690	19.80	310,662.00	
	ENDESA	25,972	19.54	507,492.88	
	ENEL	651,071	7.09	4,618,697.67	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.75	1,072,326.75	
	ENGIE	141,564	12.71	1,800,410.95	
	FORTUM OYJ	32,550	25.93	844,021.50	
	IBERDROLA SA	487,356	10.10	4,922,295.60	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	23.12	538,927.20	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.93	710,601.76	
	RWE STAMM	49,680	32.07	1,593,237.60	
	SNAM SPA	147,559	5.01	739,565.70	
	SUEZ	32,549	19.71	641,703.53	
	TERNA SPA	102,810	6.63	682,041.54	
	UNIPER SE	7,335	38.91	285,404.85	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	29.58	1,284,570.66	
	VERBUND AG	6,430	87.40	561,982.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,483	418.80	1,458,680.40	
	ASML HOLDING NV	33,716	731.70	24,669,997.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES	105,296	41.73	4,394,528.56	
	STMICROELECTRONICS	55,076	44.27	2,438,214.52	
ユーロ 小計		15,511,770		407,487,525.00 (53,311,592,895)	
イギリスポンド	BP PLC	1,615,015	3.44	5,562,919.16	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	327,167	16.77	5,486,590.59	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	295,308	16.82	4,968,261.79	
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	27.29	2,788,348.02	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	13.95	500,370.48	
	BHP GROUP PLC	167,196	18.94	3,167,361.02	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	96.12	1,050,014.88	
	EVRAZ PLC	43,000	6.11	262,816.00	
	GLENCORE PLC	823,141	3.55	2,925,854.68	

JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	27.26	459,276.48	
MONDI PLC	36,710	18.25	669,957.50	
RIO TINTO PLC REG	91,370	44.40	4,057,284.85	
ASHTEAD GROUP PLC	37,034	62.60	2,318,328.40	
BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.67	1,476,870.51	
BUNZL PLC	24,880	27.21	676,984.80	
DCC PLC	9,127	60.42	551,453.34	
FERGUSON PLC	17,761	114.30	2,030,082.30	
MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.65	528,431.49	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.46	933,895.95	
SMITHS GROUP PLC	37,146	14.03	521,344.11	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	163.50	901,539.00	
EXPERIAN PLC	74,115	34.49	2,556,226.35	
INTERTEK GROUP PLC	13,890	51.58	716,446.20	
RELX PLC	158,847	23.38	3,713,842.86	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	6.08	854,399.36	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	6.50	475,813.00	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	10,924	42.31	462,194.44	
BURBERRY GROUP PLC	29,776	19.87	591,649.12	
PERSIMMON PLC	25,686	26.50	680,679.00	
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.54	406,720.16	
COMPASS GROUP PLC	142,427	15.80	2,251,058.73	
ENTAIN PLC	49,630	19.72	978,703.60	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	52.20	837,340.20	
WHITBREAD PLC	17,434	33.15	577,937.10	
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.07	440,134.18	
INFORMA PLC	110,598	5.31	587,496.57	
PEARSON	66,305	6.12	406,317.04	
WPP PLC	95,821	10.95	1,049,239.95	
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	11.16	461,840.22	
KINGFISHER PLC	153,717	3.30	508,188.40	
NEXT PLC	11,468	80.16	919,274.88	
OCADO GROUP PLC	35,862	17.41	624,536.73	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.89	429,726.49	
TESCO PLC	601,050	2.78	1,673,924.25	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	20.07	516,601.80	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	173,638	25.45	4,419,955.29	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	25.70	461,572.00	
DIAGEO	186,926	37.41	6,992,901.66	
IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	15.30	1,239,490.73	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,728	61.25	3,535,840.00	
UNILEVER PLC	209,797	39.07	8,197,817.77	

	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	13.30	912,656.47	
	ASTRAZENECA	124,228	92.89	11,539,538.92	
	GLAXOSMITHKLINE	401,546	15.59	6,263,314.50	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	23.92	393,579.68	
	BARCLAYS	1,339,545	1.90	2,545,135.50	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,632,150	4.29	7,013,348.55	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,838,937	0.48	2,824,877.72	
	NATWEST GROUP PLC	443,701	2.14	949,520.14	
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	4.48	952,607.86	
	3I GROUP PLC	74,757	13.49	1,008,471.93	
	ABRDN PLC	153,430	2.57	395,082.25	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	15.05	497,838.95	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	70.46	1,944,132.32	
	M&G PLC	229,107	1.96	449,507.93	
	SCHRODERS PLC	11,794	36.32	428,358.08	
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	15.85	648,803.90	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	29.01	471,557.55	
	AVIVA PIC	332,730	3.95	1,314,948.96	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.76	313,853.40	
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.88	1,331,132.75	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.48	330,894.48	
	PRUDENTIAL	210,968	14.80	3,122,326.40	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	35.10	383,186.70	
	SAGE GROUP PLC	95,210	7.35	699,983.92	
	HALMA PLC	31,069	30.21	938,594.49	
	BT GROUP PLC	769,485	1.62	1,251,567.35	
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.11	2,464,465.07	
	NATIONAL GRID PLC	286,046	9.42	2,696,269.59	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	27.25	612,253.00	
	SSE PLC	81,663	16.15	1,318,857.45	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.47	613,625.50	
イギリスポンド 小計		23,412,164		146,036,144.74 (22,339,149,060)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.26	335,085.48	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	914.00	524,636.00	
	GIVAUDAN-REG	748	4,399.00	3,290,452.00	
	HOLCIM LTD	40,627	47.32	1,922,469.64	
	SIKA AG-BR	11,766	322.10	3,789,828.60	
	ABB LTD	141,281	31.89	4,505,451.09	
	GEBERIT AG-REG	2,964	723.20	2,143,564.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,375	243.60	334,950.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	248.40	768,052.80	

	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	46.22	673,564.06	
	SGS SA	506	2,806.00	1,419,836.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	300.90	1,377,219.30	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	123.50	5,105,613.50	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	265.70	659,733.10	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	51.20	201,625.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,158.00	604,240.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	117,400.00	939,200.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	11,700.00	959,400.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	231,607	122.96	28,478,396.72	
	ALCON INC	39,333	78.34	3,081,347.22	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,677	398.30	1,862,849.10	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	2,050.00	1,750,700.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	726.00	4,279,770.00	
	NOVARTIS	178,061	75.88	13,511,268.68	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	405.20	1,134,154.80	
	ROCHE HOLDING GENUSS	56,424	367.15	20,716,071.60	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	119.40	535,628.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	71.40	203,775.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.34	1,994,330.36	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	65.56	1,238,887.32	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	1,640.00	3,006,120.00	
	UBS GROUP AG	298,295	16.74	4,994,949.77	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	144.30	629,436.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	513.40	1,241,914.60	
	SWISS RE LTD	24,674	90.30	2,228,062.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,260	408.70	5,010,662.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	93.90	533,258.10	
	TEMENOS AG - REG	5,150	139.70	719,455.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	72.80	1,069,140.80	
	SWISSCOM	2,187	506.80	1,108,371.60	
スイスフラン 小計		1,418,388		128,883,472.44 (15,962,218,061)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	365.20	6,289,474.40	
	BOLIDEN AB	23,903	294.60	7,041,823.80	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	134.20	5,889,635.40	
	ALFA LAVAL AB	27,268	376.90	10,277,309.20	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	259.60	20,289,816.80	
	ATLAS COPCO A	55,390	556.60	30,830,074.00	
	ATLAS COPCO B	31,902	473.00	15,089,646.00	
	EPIROC AB-A	58,039	222.60	12,919,481.40	
	EPIROC AB-B	37,972	189.10	7,180,505.20	

	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	329.30	4,610,858.60	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	134.25	14,448,522.00	
	SANDVIK AB	87,644	222.50	19,500,790.00	
	SKANSKA B	25,507	220.00	5,611,540.00	
	SKF AB-B	35,405	209.80	7,427,969.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	208.40	2,816,317.60	
	VOLVO B	111,799	205.05	22,924,384.95	
	SECURITAS B	29,533	139.75	4,127,236.75	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	196.75	4,184,675.75	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	125.50	4,858,356.00	
	EVOLUTION AB	14,096	1,391.00	19,607,536.00	
	EMBRACER GROUP AB	37,510	87.02	3,264,120.20	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	165.74	9,153,654.46	
	ICA GRUPPEN AB	9,493	480.70	4,563,285.10	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	67.58	8,600,906.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	285.00	14,100,090.00	
	NORDEA BANK ABP	253,851	108.18	27,461,601.18	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	139.50	19,316,565.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	100.45	11,123,431.20	
	SWEDBANK AB-A	72,526	190.18	13,792,994.68	
	EQT AB	20,102	490.70	9,864,051.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	286.00	3,379,948.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	281.60	3,144,908.80	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	206.05	29,419,200.85	
	KINNEVIK AB - B	18,792	345.55	6,493,575.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	509.40	3,708,432.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	650.00	6,142,500.00	
	SINCH AB	44,150	121.40	5,359,810.00	
	ERICSSON (LM) B	225,508	95.89	21,623,962.12	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	142.85	21,975,758.30	
	TELE2 AB-B SHS	32,829	123.45	4,052,740.05	
	TELIA CO AB	230,643	34.43	7,942,191.70	
スウェーデンクローナ 小計		2,635,760		460,409,680.09 (6,058,991,389)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	76,370	225.30	17,206,161.00	
	NORSK HYDRO	96,800	60.72	5,877,696.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	461.40	5,766,577.20	
	ADEVINTA ASA	19,117	149.80	2,863,726.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	385.60	3,576,054.40	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	444.20	3,145,824.40	
	MOWI ASA	31,968	237.70	7,598,793.60	
	ORKLA	69,804	85.32	5,955,677.28	

	DNB BANK ASA	71,795	214.30	15,385,668.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	213.70	3,969,263.80	
	TELENOR ASA	51,193	135.75	6,949,449.75	
ノルウェークローネ 小計		464,475		78,294,892.53 (1,038,973,223)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	523.40	4,440,002.20	
	NOVOZYMES A/S	17,111	494.10	8,454,545.10	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	3,070.00	2,317,850.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	223.10	18,217,007.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	19,150.00	4,193,850.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	20,130.00	8,736,420.00	
	DSV A/S	16,380	1,574.50	25,790,310.00	
	PANDORA A/S	8,163	920.00	7,509,960.00	
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,100.00	9,510,600.00	
	AMBU A/S-B	13,555	185.60	2,515,808.00	
	COLOPLAST-B	9,208	1,115.50	10,271,524.00	
	DEMANT A/S	8,512	335.20	2,853,222.40	
	GN STORE NORD A/S	9,226	406.80	3,753,136.80	
	GENMAB A/S	5,250	2,924.00	15,351,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	134,949	734.60	99,133,535.40	
	DANSKE BANK A/S	56,132	110.50	6,202,586.00	
	TRYG A/S	29,772	156.40	4,656,340.80	
	ORSTED A/S	15,439	872.40	13,468,983.60	
デンマーククローネ 小計		423,888		247,376,681.70 (4,351,355,831)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	31.20	643,624.80	
	OIL SEARCH LTD	186,117	4.28	796,580.76	
	SANTOS	156,437	6.95	1,087,237.15	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	31.90	408,734.70	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	22.98	1,709,803.92	
	BHP GROUP LTD	234,548	36.73	8,614,948.04	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	21.24	738,514.80	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	3.93	480,065.22	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	14.59	2,020,466.97	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	53.94	1,992,975.12	
	NEWCREST MINING LIMITED	61,178	24.96	1,527,002.88	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	10.13	1,029,491.64	
	ORICA LTD	38,288	15.33	586,955.04	
	RIO TINTO LTD	28,818	88.98	2,564,225.64	
	SOUTH32 LTD	341,133	3.54	1,207,610.82	
	REECE LTD	16,814	21.18	356,120.52	
	BRAMBLES LTD	108,007	10.42	1,125,432.94	

	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.42	409,001.22	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.84	496,400.00	
	TRANSURBAN GROUP	233,493	13.68	3,194,184.24	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	47.58	2,198,671.80	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	9.78	296,607.84	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	117.55	416,244.55	
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	5.16	939,187.08	
	REA GROUP LTD	3,586	168.97	605,926.42	
	SEEK LTD	31,593	34.34	1,084,903.62	
	WESFARMERS LTD	92,850	59.85	5,557,072.50	
	COLES GROUP LTD	115,478	17.68	2,041,651.04	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.07	777,000.07	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	39.22	3,918,117.22	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	11.56	815,419.28	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	230.60	1,102,959.80	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	72.98	1,185,779.04	
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	39.53	1,584,204.28	
	CSL LIMITED	36,928	314.88	11,627,888.64	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	27.91	6,294,012.01	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	141,979	108.81	15,448,734.99	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	262,008	28.89	7,569,411.12	
	WESTPAC BANKING	302,673	22.52	6,816,195.96	
	ASX LTD	14,549	93.69	1,363,095.81	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,074	200.00	5,414,800.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	35.26	384,757.12	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	4.58	1,050,684.06	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.42	922,921.20	
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	11.67	1,302,266.97	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.23	1,065,322.72	
	AFTERPAY LTD	16,621	119.52	1,986,541.92	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	19.02	844,031.52	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	53.71	741,251.71	
	XERO LTD	11,340	148.00	1,678,320.00	
	TELSTRA CORP	308,467	3.92	1,209,190.64	
	AGL ENERGY LTD	64,235	5.36	344,299.60	
	AUSNET SERVICES	187,145	2.58	482,834.10	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.99	826,319.05	
オーストラリアドル 小計		5,537,235		120,886,000.10 (10,058,924,068)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	8.17	963,006.07	
	A2 MILK CO LTD	66,854	6.55	437,893.70	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	32.29	1,290,954.20	

	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.70	533,859.90	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.54	785,955.72	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.06	391,554.78	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.92	543,876.48	
ニュージーランドドル 小計		609,297		4,947,100.85 (397,845,850)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	52.70	12,094,439.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	161.20	17,248,400.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	20.50	3,526,000.00	
	MTR CORP	125,000	43.15	5,393,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	26.00	3,120,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	44.05	7,664,700.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	18.10	3,583,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	5.85	772,200.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	6.99	984,192.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	16.56	2,851,632.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	20.65	3,012,835.00	
	WH GROUP LTD	809,301	5.33	4,313,574.33	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	24.40	6,868,600.00	
	HANG SENG BANK	59,400	145.70	8,654,580.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	465.00	44,547,000.00	
	AIA GROUP LTD	968,400	85.60	82,895,040.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	48.00	7,895,808.00	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	25.80	4,050,600.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.62	3,048,260.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	33.35	4,176,353.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	33.75	4,602,656.25	
	SINO LAND CO	315,400	9.96	3,141,384.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	98.85	10,675,800.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	49.35	1,998,675.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	20.65	1,986,530.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	44.25	5,265,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	46.75	3,155,625.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	76.05	10,456,875.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	11.88	10,747,325.16	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	47.40	5,308,800.00	
香港ドル 小計		6,587,653		284,041,184.74 (4,115,756,766)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.31	729,063.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.81	561,594.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.48	593,659.36	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.81	501,225.00	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.38	782,268.00	
	DBS GROUP	141,500	32.30	4,570,450.00	
	OCBC BANK	257,100	11.88	3,054,348.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	27.90	2,619,810.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	9.55	747,765.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.45	771,075.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.24	309,872.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.12	338,200.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.41	473,137.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.57	1,502,275.51	
シンガポールドル 小計		2,681,475		17,554,741.87 (1,470,911,821)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	27.50	1,863,290.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	484.50	1,039,737.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	30.81	3,028,931.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	30.45	3,314,908.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.00	1,890,500.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	113.00	1,412,839.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	309.20	1,336,671.60	
	NICE LTD	4,991	879.10	4,387,588.10	
イスラエルシェケル 小計		398,393		18,274,465.60 (663,911,335)	
合　計		88,503,680		517,030,486,552 (517,030,486,552)	

(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	82,693	719,429.10	
		LENDLEASE GROUP	64,786	707,463.12	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	1,046,228.40	
	オーストラリアドル 小計		272,030	2,473,120.62 (205,788,366)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,726,515.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,012,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,739,015.00 (83,158,327)	
投資信託受益証券合計			867,530	288,946,693 (288,946,693)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	743,398.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,270,448.45	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,371	10,180,970.32	

	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,080,318.74	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,721,153.16	
	BOSTON PROPERTIES	11,259	1,323,045.09	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,262,699.55	
	CROWN CASTLE INTL CORP	34,399	6,221,059.15	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	3,484,644.10	
	DUKE REALTY CORP	31,540	1,786,741.00	
	EQUINIX INC	7,120	5,680,264.80	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,190,182.30	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,400	2,518,404.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,876,926.40	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	2,148,712.28	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,538,104.70	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,040,649.09	
	INVITATION HOMES INC	46,840	1,898,425.20	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,109,851.08	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,065,766.80	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,945,087.65	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	597,709.76	
	PROLOGIS INC	59,030	8,763,003.50	
	PUBLIC STORAGE	12,441	4,043,325.00	
	REALTY INCOME CORP	41,563	2,949,310.48	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	922,060.70	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,999,415.18	
	SIMON PROPERTY GROUP	26,818	4,491,746.82	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,756,343.75	
	UDR INC	24,265	1,339,913.30	
	VENTAS INC	31,565	1,667,263.30	
	VICI PROPERTIES INC	43,921	1,284,250.04	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	696,551.40	
	WELLTOWER INC	32,739	2,795,583.21	
	WP CAREY INC	14,258	1,094,586.66	
アメリカドル 小計		989,349	88,487,915.16 (9,986,746,104)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	540,773.95	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	354,411.20	
カナダドル 小計		24,377	895,185.15 (81,193,293)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	375,027.96	
	GECINA SA	3,139	384,841.40	
	KLEPIERRE	17,225	381,878.25	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	722,754.15	

	ユーロ 小計		35,781	1,864,501.76 (243,932,765)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	401,834.84	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	462,452.53	
		SEGRO PLC	93,383	1,236,857.83	
	イギリスポンド 小計		239,146	2,101,145.20 (321,412,181)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,055,689.80	
		GOODMAN GROUP	139,848	3,293,420.40	
		GPT GROUP	167,884	864,602.60	
		MIRVAC GROUP	266,683	762,713.38	
		SCENTRE GROUP	382,183	1,196,232.79	
		STOCKLAND	207,412	937,502.24	
		VICINITY CENTERS	365,149	646,313.73	
	オーストラリアドル 小計		1,623,249	8,756,474.94 (728,626,279)	
	香港ドル	LINK REIT	170,500	11,849,750.00	
	香港ドル 小計		170,500	11,849,750.00 (171,702,877)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	880,827.80	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	731,922.35	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	468,600.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	537,977.45	
	シンガポールドル 小計		1,117,652	2,619,327.60 (219,473,459)	
投資証券合計			4,200,054	11,753,086,958 (11,753,086,958)	
合計				12,042,033,651 (12,042,033,651)	

(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	97.4%	—	—	71.6%
	投資証券　35銘柄	—	—	2.6%	1.9%

カナダドル	株式　88銘柄	99.6%	—	—	3.5%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.4%	0.0%
ユーロ	株式　231銘柄	99.5%	—	—	10.1%
	投資証券　4銘柄	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式　82銘柄	98.6%	—	—	4.2%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.4%	0.1%
スイスフラン	株式　40銘柄	100.0%	—	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式　41銘柄	100.0%	—	—	1.1%
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	91.5%	—	—	1.9%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	1.9%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.6%	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	94.2%	—	—	0.8%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.9%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	87.0%	—	—	0.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	13.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,311,026,516
投資証券	106,812,580,450
未収入金	112,627,502
未収配当金	969,472,344

	2021年11月10日現在
項目	金額（円）
前払金	152,725,840
差入委託証拠金	183,018,000
流動資産合計	111,541,450,652
資産合計	111,541,450,652
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	152,725,840
未払金	31,183,715
未払解約金	237,164,222
未払利息	7,359
流動負債合計	421,081,136
負債合計	421,081,136
純資産の部	
元本等	
元本	50,752,359,768
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	60,368,009,748
元本等合計	111,120,369,516
純資産合計	111,120,369,516
負債純資産合計	111,541,450,652

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年11月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	50,752,359,768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　2.1895円
		(1万口当たり純資産額)　(21,895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11月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	2021年11月10日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(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。 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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	55,613,724,754円
期中追加設定元本額	7,731,734,385円
期中一部解約元本額	12,593,099,371円
期末元本額	50,752,359,768円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,657,099,646円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,840,543円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	15,835,438,347円

区分	2021年11月10日現在
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	23,397,493,075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	720,122,850円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,541,414,897円
コア投資戦略ファンド（切替型）	778,199,200円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	27,092,933円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	255,743,577円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,899,172円
グローバル経済コア	239,663,056円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	10,513,012円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	416,146,403円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	53,619,238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）	488,222,662円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	13,158,340円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	665,888,004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）	19,776,133円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	878,687,418円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用）	265,797,294円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	302,498,187円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	14,937,275,860
合計	14,937,275,860

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	4,401,431,840	－	4,248,706,000	△152,725,840
合計		4,401,431,840	－	4,248,706,000	△152,725,840

(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	1,908	268,074,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,002	367,745,000	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	3,976	677,510,400	
	東海道リート投資法人	726	78,480,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,273	2,075,082,000	
	森ヒルズリート投資法人	11,145	1,734,162,000	
	産業ファンド投資法人	13,455	2,787,876,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	9,476	3,420,836,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,473	1,400,109,900	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,051	2,298,205,000	
	ＧＬＰ投資法人	30,696	5,657,272,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,267	1,384,641,500	
	日本プロロジスリート投資法人	15,015	5,578,072,500	
	星野リゾート・リート投資法人	1,462	1,076,032,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	1,645	491,361,500	
	イオンリート投資法人	11,146	1,723,171,600	
	ヒューリックリート投資法人	8,841	1,511,811,000	
	日本リート投資法人	2,925	1,253,362,500	
	積水ハウス・リート投資法人	28,770	2,454,081,000	
	トーセイ・リート投資法人	1,980	262,548,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	3,784	1,084,494,400	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	2,021	326,189,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,148	255,397,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	30,648	5,109,021,600	
	いちごホテルリート投資法人	1,570	145,539,000	
	ラサールロジポート投資法人	11,602	2,212,501,400	

	スターアジア不動産投資法人	9,794	605,269,200	
	マリモ地方創生リート投資法人	888	118,015,200	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,523	2,071,524,000	
	大江戸温泉リート投資法人	1,530	126,072,000	
	投資法人みらい	10,804	554,245,200	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	2,224	310,915,200	
	三菱地所物流リート投資法人	2,409	1,156,320,000	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	3,671	800,278,000	
	ザイマックス・リート投資法人	1,376	160,579,200	
	タカラレーベン不動産投資法人	3,737	412,938,500	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,695	613,370,000	
	日本ビルファンド投資法人	10,741	7,647,592,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,478	6,454,518,000	
	日本都市ファンド投資法人	47,820	4,853,730,000	
	オリックス不動産投資法人	18,884	3,433,111,200	
	日本プライムリアルティ投資法人	6,229	2,585,035,000	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	9,084	1,382,584,800	
	東急リアル・エステート投資法人	6,354	1,200,906,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	6,581	780,506,600	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	21,336	3,040,380,000	
	森トラスト総合リート投資法人	6,774	990,358,800	
	インヴィンシブル投資法人	41,715	1,812,516,750	
	フロンティア不動産投資法人	3,323	1,694,730,000	
	平和不動産リート投資法人	6,140	970,120,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,193	2,049,883,000	
	福岡リート投資法人	4,902	828,928,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人	2,932	2,078,788,000	
	いちごオフィスリート投資法人	7,766	669,429,200	
	大和証券オフィス投資法人	2,005	1,467,660,000	
	阪急阪神リート投資法人	4,281	720,492,300	
	スターツプロシード投資法人	1,476	346,712,400	
	大和ハウスリート投資法人	14,231	4,625,075,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,035	1,939,538,000	
	大和証券リビング投資法人	12,806	1,448,358,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	8,794	1,228,521,800	
合計		549,536	106,812,580,450	

(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11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	66,834,435
コール・ローン	225,772,941
投資証券	101,604,075,350
未収入金	337,197,728
未収配当金	110,852,514
流動資産合計	102,344,732,968
資産合計	102,344,732,968
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,291
未払解約金	226,449,174
未払利息	501
流動負債合計	226,459,966
負債合計	226,459,966
純資産の部	
元本等	
元本	41,344,855,558
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	60,773,417,444
元本等合計	102,118,273,002
純資産合計	102,118,273,002
負債純資産合計	102,344,732,968

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 為替予約取引

	2021年11月10日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年11月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	41,344,855,558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　2.4699円 (1万口当たり純資産額)　(24,699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11月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年11月10日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2021年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年11月11日
期首元本額	47,638,239,657円
期中追加設定元本額	5,806,807,418円
期中一部解約元本額	12,100,191,517円
期末元本額	41,344,855,558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	65,498,256円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	102,813,861円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,688,304,507円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,003,794円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	11,900,520,336円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	18,527,832,170円
コア投資戦略ファンド（安定型）	773,880,033円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,749,701,772円
分散投資コア戦略ファンドＡ	686,275,561円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,476,522,681円
コア投資戦略ファンド（切替型）	707,282,641円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	148,832,557円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	243,042,473円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,057,416円
グローバル経済コア	234,147,354円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	10,849,517円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	395,165,566円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	50,672,643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）	1,332,838,008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）	380,060,218円

区分	2021年11月10日現在
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	120,780,943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）	40,337,933円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	13,960,331円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	115,466,049円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	117,898,872円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	114,483,266円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	113,795,776円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	111,276,286円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	109,554,738円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	23,233,744,266
合計	23,233,744,266

(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11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	189,157,880	－	189,168,171	△10,291
	アメリカドル	169,272,300	－	169,282,500	△10,200
	イギリスポンド	19,885,580	－	19,885,671	△91
合計		189,157,880	－	189,168,171	△10,291

(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	1,053,803.00	
		AGREE REALTY CORP	38,105	2,658,585.85	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	1,055,878.00	
		ALEXANDER'S INC	1,190	328,773.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,688	15,870,581.60	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	108,015.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,057	1,190,557.77	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	76,794	4,151,483.64	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	514,857.60	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,152	6,131,725.60	
		AMERICOLD REALTY TRUST	143,840	4,208,758.40	
		APARTMENT INCOME REIT CO	87,139	4,647,994.26	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	79,751	640,400.53	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	1,879,719.39	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	30,500	464,820.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	242,760.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	77,265	18,553,644.45	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	207,751.50	
		BOSTON PROPERTIES	79,135	9,299,153.85	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	156,989.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,306,935.20	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	164,985	4,071,829.80	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	2,265,464.30	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	101,450.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	56,019	9,128,296.05	
		CARETRUST REIT INC	52,477	1,108,839.01	
		CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	153,952.00	
		CENTERSPACE	7,499	756,274.15	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	341,345.60	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	13,000	106,340.00	
		CITY OFFICE REIT INC	25,050	471,942.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	70,810.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	66,258	1,268,840.70	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	594,412.77	

		COREPOINT LODGING INC	22,000	342,320.00
		CORESITE REALTY CORP	24,830	3,995,147.00
		CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	1,784,241.75
		COUSINS PROPERTIES INC	82,626	3,293,472.36
		CTO REALTY GROWTH INC	2,800	155,092.00
		CUBESMART	111,990	6,057,539.10
		CYRUSONE INC	68,096	5,541,652.48
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,182,384.00
		DIGITAL REALTY TRUST INC	156,521	24,597,275.15
		DIGITALBRIDGE GROUP INC	280,893	2,188,156.47
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	468,784.00
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	97,197	3,489,372.30
		DUKE REALTY CORP	208,984	11,838,943.60
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	1,030,105.48
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	22,299	4,421,222.73
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	847,683.10
		EPR PROPERTIES	41,912	2,184,872.56
		EQUINIX INC	49,977	39,871,150.83
		EQUITY COMMONWEALTH	67,845	1,757,185.50
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,155	7,953,272.85
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	190,281	16,299,470.46
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	68,320	2,003,142.40
		ESSEX PROPERTY TRUST	36,162	12,318,223.68
		EXTRA SPACE STORAGE INC	73,984	14,627,376.64
		FARMLAND PARTNERS INC	12,200	148,352.00
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,550	5,069,914.50
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	71,853	4,332,735.90
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,044	1,289,608.32
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	322,909.61
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	124,303	6,038,639.74
		GEO GROUP INC/THE	64,306	601,261.10
		GETTY REALTY CORP	21,985	719,569.05
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	456,800.50
		GLADSTONE LAND CORP	15,500	386,415.00
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	569,006.10
		GLOBAL NET LEASE INC	57,012	893,378.04
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	81,610	2,609,071.70
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	121,604	4,087,110.44
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	299,893	10,190,364.14
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	253,738.00
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	57,872	2,707,830.88

		HOST HOTELS AND RESORTS INC	401,344	7,356,635.52	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	2,251,276.10	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	58,331	1,435,525.91	
		INDUS REALTY TRUST INC	2,340	173,487.60	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	38,922	1,003,019.94	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,398	3,762,158.40	
		INVITATION HOMES INC	320,490	12,989,459.70	
		IRON MOUNTAIN INC	160,382	7,630,975.56	
		JBG SMITH PROPERTIES	65,943	1,978,949.43	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	376,000.00	
		KILROY REALTY CORPORATION	58,949	4,220,748.40	
		KIMCO REALTY CORP	339,870	7,901,977.50	
		KITE REALTY GROUP TRUST	118,586	2,557,900.02	
		LEXINGTON CORP PROPERTIES	152,908	2,267,625.64	
		LIFE STORAGE INC	44,161	5,780,233.29	
		LTC PROPERTIES INC	20,624	698,741.12	
		MACERICH CO/THE	118,542	2,543,911.32	
		MACK-CALI REALTY CORP	42,236	815,154.80	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	522,960.44	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	334,846	7,132,219.80	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	64,502	13,064,880.10	
		MONMOUTH REIT -CL A	54,952	1,156,190.08	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	97,618	4,476,761.48	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	45,310	2,817,375.80	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,407,436.90	
		NETSTREIT CORP	20,992	500,869.12	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	927,936.10	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	757,532.60	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	135,453	3,857,701.44	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	292,280.01	
		PARAMOUNT GROUP INC	89,726	834,451.80	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	131,413	2,754,416.48	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,813,957.29	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	56,700.00	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,193,397.00	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,281,046.64	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	442,338.00	
		POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	141,190.00	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	424,430.48	
		PRIME US REIT	295,000	246,325.00	
		PROLOGIS INC	410,213	60,896,119.85	
		PS BUSINESS PARKS INC	11,172	1,974,204.12	

	PUBLIC STORAGE	84,460	27,449,500.00	
	REALTY INCOME CORP	307,228	21,800,898.88	
	REGENCY CENTERS CORP	84,860	6,254,182.00	
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	69,259	1,258,436.03	
	RETAIL VALUE	9,529	59,270.38	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	76,595	5,298,842.10	
	RLJ LODGING TRUST	92,291	1,394,517.01	
	RPT REALTY	43,950	610,026.00	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	2,806,228.32	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	127,744	1,866,339.84	
	SAFEHOLD INC	8,340	620,412.60	
	SAUL CENTERS INC	6,800	350,064.00	
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	312,231.00	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	1,105,544.06	
	SIMON PROPERTY GROUP	182,102	30,500,263.98	
	SITE CENTERS CORP	99,620	1,670,627.40	
	SL GREEN REALTY CORP	37,875	2,903,118.75	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	66,382	3,238,113.96	
	STAG INDUSTRIAL INC	91,978	3,895,268.30	
	STORE CAPITAL CORP	135,277	4,627,826.17	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	651,836.90	
	SUN COMMUNITIES INC	64,445	12,486,218.75	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	124,047	1,591,523.01	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	57,370	1,157,726.60	
	TERRENO REALTY CORP	38,649	2,921,477.91	
	UDR INC	153,803	8,493,001.66	
	UMH PROPERTIES INC	25,320	601,350.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	415,939.45	
	URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,104,831.00	
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	315,297.50	
	VENTAS INC	218,755	11,554,639.10	
	VICI PROPERTIES INC	338,799	9,906,482.76	
	VORNADO REALTY TRUST	90,208	4,082,814.08	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,179,807.30	
	WELLTOWER INC	233,908	19,973,404.12	
	WHITESTONE REIT	19,090	185,173.00	
	WP CAREY INC	103,444	7,941,395.88	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,224,672.90	
アメリカドル 小計		14,155,365	683,603,994.16 (77,151,546,780)	
カナダドル		33,942	1,520,262.18	

		ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE			
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	40,330	487,186.40	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	163,320.00	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,360	622,300.80	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	83,000.00	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	45,920	2,794,232.00	
		CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,322,709.50	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	47,120	547,063.20	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	501,773.76	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	509,400.10	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	58,250	1,001,900.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	335,549.60	
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	108,506.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,097,195.40	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,705	1,884,341.70	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	81,239	1,371,314.32	
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	83,607.00	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	628,278.70	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	686,550.00	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	255,078.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	247,359.10	
		NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	9,000	117,810.00	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	60,470	819,368.50	
		PLAZA RETAIL REIT	25,000	114,000.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	89,131	2,039,317.28	
		SLATE GROCERY REIT	10,300	137,608.00	
		SLATE OFFICE REI	17,000	88,910.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	41,476	1,335,941.96	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	1,090,400.00	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	192,984.00	
	カナダドル 小計		1,026,375	22,187,267.50 (2,012,385,162)	
	ユーロ	AEDIFICA	19,919	2,302,636.40	
		ALSTRIA OFFICE REIT -AG	99,700	1,941,159.00	
		ALTAREA	1,880	352,312.00	
		BEFIMMO S.C.A.	14,010	498,055.50	
		CARE PROPERTY INVEST	15,000	408,750.00	
		CARMILA	25,000	352,500.00	

	COFINIMMO	15,767	2,232,607.20	
	COIMA RES SPA	11,900	87,346.00	
	COVIVIO(FP)	26,753	2,021,991.74	
	CROMWELL REIT EUR	160,000	411,200.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,783	432,390.31	
	GECINA SA	30,292	3,713,799.20	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	371,850.00	
	HIBERNIA REIT PLC	365,550	469,366.20	
	ICADE	18,140	1,244,404.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	137,018.45	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	143,462	1,229,469.34	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	326,700.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	426,400.00	
	KLEPIERRE	107,485	2,382,942.45	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	184,620.00	
	MERCIALYS	28,000	269,640.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	187,486	1,810,364.81	
	MONTEA NV	5,300	682,640.00	
	NSI NV	10,050	357,277.50	
	RETAIL ESTATES	6,400	449,920.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	65,171	4,505,271.23	
	VASTNED RETAIL	10,650	265,717.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	77,922	3,132,464.40	
	WERELDHAVE NV	22,670	321,233.90	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	537,660.00	
ユーロ 小計		1,876,620	33,859,707.13 (4,429,865,483)	
イギリスポンド	AEW UK REIT PLC	118,000	129,092.00	
	ASSURA PLC	1,467,040	1,071,672.72	
	BIG YELLOW GROUP PLC	97,046	1,460,542.30	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	432,390.00	
	BRITISH LAND CO PLC	528,668	2,675,060.08	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	799,504.90	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	309,602.84	
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	230,996.13	
	DERWENT LONDON PLC	62,782	2,154,050.42	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	272,034.00	
	GCP STUDENT LIVING PLC	258,000	543,090.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	141,780	1,063,350.00	
	HAMMERSON PLC	2,291,000	775,503.50	
	HOME REIT PLC	132,934	152,209.43	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	211,407.16	

		INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	411,457	2,867,855.29	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	1,341,691.36	
		LXI REIT PLC	391,008	561,487.48	
		NEWRIVER REIT PL	186,000	140,802.00	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	320,760.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	1,121,758.63	
		PRS REIT PLC/THE	255,000	257,550.00	
		REGIONAL REIT LTD	222,000	197,580.00	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	1,431,896.58	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	176,050.00	
		SEGRO PLC	669,364	8,865,726.18	
		SHAFTESBURY PLC	157,193	1,014,680.81	
		STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	195,045.48	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	466,000	552,210.00	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	198,203.85	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	941,704	2,143,318.30	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	380,240.00	
		UNITE GROUP PLC	220,572	2,442,834.90	
		WORKSPACE GROUP PLC	70,347	577,900.60	
	イギリスポンド 小計		14,539,477	37,077,366.94 (5,671,724,820)	
	オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	830,796.12	
		ARENA REIT	201,053	908,759.56	
		AVENTUS GROUP	233,500	810,245.00	
		BWP TRUST	262,160	1,090,585.60	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	1,190,042.00	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	301,606	1,121,974.32	
		CENTURIA OFFICE REIT	240,945	566,220.75	
		CHARTER HALL GROUP	259,369	4,964,322.66	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	320,312	1,553,513.20	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	1,255,718.40	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	710,062.50	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	862,633	720,298.55	
		DEXUS	596,428	6,691,922.16	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	380,810.00	
		GDI PROPERTY GROUP	324,500	365,062.50	
		GOODMAN GROUP	939,643	22,128,592.65	
		GPT GROUP	1,081,455	5,569,493.25	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	703,727.20	
		HOME CONSORTIUM	107,500	856,775.00	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	268,642	397,590.16	

	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	82,885	290,926.35	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	1,001,875.32	
	IRONGATE GROUP	272,000	432,480.00	
	MIRVAC GROUP	2,190,726	6,265,476.36	
	NATIONAL STORAGE REIT	601,340	1,449,229.40	
	RURAL FUNDS GROUP	191,095	548,442.65	
	SCENTRE GROUP	2,883,991	9,026,891.83	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	1,696,674.00	
	STOCKLAND	1,326,376	5,995,219.52	
	VICINITY CENTERS	2,156,333	3,816,709.41	
	WAYPOINT REIT LTD	390,099	1,080,574.23	
オーストラリアドル 小計		18,190,725	84,421,010.65 (7,024,672,296)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	758,439.78	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	1,440,720.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	978,678.60	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	1,092,630.40	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	661,113.04	
ニュージーランドドル 小計		2,867,311	4,931,581.82 (396,597,809)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,138,000	4,631,660.00	
	FORTUNE REIT	756,000	6,146,280.00	
	LINK REIT	1,163,400	80,856,300.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,271,040.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,524,500.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	2,756,660.00	
香港ドル 小計		5,188,400	99,186,440.00 (1,437,211,515)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	382,250.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	666,754.41	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,847,318	5,726,685.80	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,091,064.70	
	CAPITALAND CHINA TRUST	507,721	604,187.99	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,805,044	6,030,844.60	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	529,844.00	
	EC WORLD REIT	180,000	146,700.00	
	ESR REIT	1,448,995	688,272.62	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	342,900.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	142,596.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	634,262	1,490,515.70	

		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,610,096	2,431,244.96	
		IREIT GLOBAL	405,985	263,890.25	
		KEPPEL DC REIT	709,903	1,668,272.05	
		KEPPEL REIT	1,051,400	1,209,110.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000	499,500.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,241,473	2,644,337.49	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,088,963	2,929,310.47	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,580,700	3,113,979.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,222,100	1,209,879.00	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	560,403.36	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	225,500	1,093,675.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	252,909.00	
		SPH REIT	576,800	588,336.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	859,400	554,313.00	
		SUNTEC REIT	1,180,700	1,818,278.00	
	シンガポールドル 小計		24,807,958	38,680,053.90 (3,241,001,716)	
	韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	54,685	355,452,500.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	66,167,640.00	
		JR REIT XXVII	64,338	350,642,100.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	135,000,000.00	
		LOTTE REIT CO LTD	72,480	406,612,800.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	211,099,250.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	152,171,210.00	
	韓国ウォン 小計		284,799	1,677,145,500.00 (160,670,538)	
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	2,157,975.00	
	イスラエルシェケル 小計		103,500	2,157,975.00 (78,399,231)	
合計			83,040,530	101,604,075,350 (101,604,075,350)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率

アメリカドル	投資証券　156銘柄	100.0%	75.9%
カナダドル	投資証券　30銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券　31銘柄	100.0%	4.4%
イギリスポンド	投資証券　35銘柄	100.0%	5.6%
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%	1.4%
シンガポールドル	投資証券　27銘柄	100.0%	3.2%
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。

【中間財務諸表】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間計算期間(2021年11月11日から2022年5月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 （2021年11月10日現在）	第15期中間計算期間 （2022年 5月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	743,027,419	697,986,272
親投資信託受益証券	35,623,017,691	34,977,205,847
未収入金	30,810,000	18,800,000
流動資産合計	36,396,855,110	35,693,992,119
資産合計	36,396,855,110	35,693,992,119
負債の部		
流動負債		
未払解約金	50,750,154	36,529,368
未払受託者報酬	7,767,014	7,835,627
未払委託者報酬	124,272,149	125,369,910
未払利息	1,651	363
その他未払費用	1,669,414	834,218
流動負債合計	184,460,382	170,569,486
負債合計	184,460,382	170,569,486
純資産の部		
元本等		
元本	18,954,906,849	19,198,146,243
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	17,257,487,879	16,325,276,390
（分配準備積立金）	9,542,243,407	9,167,968,985
元本等合計	36,212,394,728	35,523,422,633
純資産合計	36,212,394,728	35,523,422,633
負債純資産合計	36,396,855,110	35,693,992,119

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自　2020年11月11日 至　2021年 5月10日	第15期中間計算期間 自　2021年11月11日 至　2022年 5月10日
営業収益		
受取利息	1,709	1,811
有価証券売買等損益	4,122,533,250	△1,014,981,844
営業収益合計	4,122,534,959	△1,014,980,033
営業費用		
支払利息	92,559	112,208
受託者報酬	7,006,617	7,835,627
委託者報酬	112,105,792	125,369,910
その他費用	823,857	834,218
営業費用合計	120,028,825	134,151,963
営業利益又は営業損失（△）	4,002,506,134	△1,149,131,996
経常利益又は経常損失（△）	4,002,506,134	△1,149,131,996
中間純利益又は中間純損失（△）	4,002,506,134	△1,149,131,996
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	149,422,931	△19,492,909
期首剰余金又は期首欠損金（△）	11,505,600,438	17,257,487,879
剰余金増加額又は欠損金減少額	793,121,717	892,220,744
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	793,121,717	892,220,744
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,072,426,509	694,793,146
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,072,426,509	694,793,146
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	15,079,378,849	16,325,276,390

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

	第14期 (2021年11月10日現在)	第15期中間計算期間 (2022年 5月10日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	18,954,906,849口	19,198,146,243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 1.9104円 (1万口当たり純資産額) (19,104円)	1口当たり純資産額 1.8504円 (1万口当たり純資産額) (18,504円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	第15期中間計算期間 (2022年 5月10日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第14期 自 2020年11月11日 至 2021年11月10日	第15期中間計算期間 自 2021年11月11日 至 2022年 5月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	19,430,176,072円	18,954,906,849円
期中追加設定元本額	2,155,351,244円	1,009,114,434円
期中一部解約元本額	2,630,620,467円	765,875,040円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	677,109,109
国債証券	522,045,299,300
地方債証券	33,429,716,111
特殊債券	36,348,012,167
社債券	29,525,342,420
未収入金	598,515,800
未収利息	1,042,666,082
前払費用	19,669,793
流動資産合計	623,686,330,782
資産合計	623,686,330,782

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
未払解約金	869,392,888
未払利息	352
流動負債合計	869,393,240
負債合計	869,393,240
純資産の部	
元本等	
元本	451,375,915,149
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	171,441,022,393
元本等合計	622,816,937,542
純資産合計	622,816,937,542
負債純資産合計	623,686,330,782

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 5月10日現在	
1.	計算期間の末日における受益権の総数	451,375,915,149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　100,116,000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　1.3798円
		(1万口当たり純資産額)　(13,798円)

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

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2022年 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	459,359,027,915円
期中追加設定元本額	22,184,388,785円
期中一部解約元本額	30,167,501,551円
期末元本額	451,375,915,149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）	4,023,957,143円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	15,462,539円

区分	2022年 5月10日現在
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	20,597,483,025円
世界経済インデックスファンド	3,648,871,652円
ＤＣマイセレクション２５	25,787,744,103円
ＤＣマイセレクション５０	29,360,378,983円
ＤＣマイセレクション７５	8,951,503,340円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	445,296,649円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	92,522,810,467円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	66,931,332,424円
ＤＣマイセレクションＳ２５	12,633,167,164円
ＤＣマイセレクションＳ５０	14,118,407,803円
ＤＣマイセレクションＳ７５	3,213,801,210円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	792,115,416円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	2,186,760,141円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	814,381,052円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,311,531,202円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,435,383円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	28,573,508円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	10,510,019円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	972,063円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	92,634,852円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	128,536,453円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	33,130,779円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	27,610,659円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,980,349,256円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	767,727,027円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,215,032,958円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	93,558,671円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	76,010,188円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,011,642,796円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,154,717,498円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,443,362,902円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	139,768,274円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	6,042,863,910円
日本債券ファンド・シリーズ１	15,922,437,141円
分散投資コア戦略ファンドＡ	19,869,312,536円
分散投資コア戦略ファンドＳ	25,440,115,400円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	157,934,126円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,348,347,656円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	66,309,024円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	37,579,792円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	61,201,912円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	35,897,362円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	70,395,689円

区分	2022年 5月10日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	112,826,864円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	10,453,400円
グローバル経済コア	229,446,594円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	29,974,545円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	18,877,507円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	16,781,175円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	9,296,960円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	2,425,629円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	1,844,524円
Ｍｙ　ＳＭＴ　国内債券インデックス（ノーロード）	362,803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）	80,818,430,644円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	87,936,511円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	11,823,886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）	410,234,720円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,099,869,039
株式	471,620,602,660
派生商品評価勘定	80,152,500
未収配当金	5,668,079,729
前払金	86,995,750
差入委託証拠金	328,665,000
流動資産合計	479,884,364,678
資産合計	479,884,364,678
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	167,213,150
未払解約金	318,107,132
未払利息	1,094
流動負債合計	485,321,376
負債合計	485,321,376
純資産の部	
元本等	
元本	260,787,797,765
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	218,611,245,537

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	479,399,043,302
純資産合計	479,399,043,302
負債純資産合計	479,884,364,678

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 5月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	260,787,797,765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 1.8383円 (1万口当たり純資産額) (18,383円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 5月10日現在
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	251,362,690,536円
期中追加設定元本額	19,949,421,017円
期中一部解約元本額	10,524,313,788円
期末元本額	260,787,797,765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）	403,209,977円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,971,031,818円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	14,307,969円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	11,716,727,619円

区分	2022年 5月10日現在
世界経済インデックスファンド	3,788,572,478円
日本株式インデックス・オープン	3,349,913,580円
ＤＣマイセレクション２５	6,238,840,654円
ＤＣマイセレクション５０	18,906,418,060円
ＤＣマイセレクション７５	19,247,639,681円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	6,179,238,781円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,069,560,990円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,021,231,654円
ＤＣマイセレクションＳ７５	6,910,945,824円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	8,208,532,311円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	196,203,587円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	699,067,941円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	511,238,392円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,562,556,561円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,790,380,469円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,350,367円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	19,058,334円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	22,371,205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）	186,484,057円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,356,825円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	31,325,672円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	113,885,822円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	25,967,549円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	74,211,525円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	927,379,823円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	438,903,473円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,844,332,276円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	58,713,979円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	26,007,286円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	489,333,644円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	279,614,742円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	352,914,775円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	35,341,535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）	586,771,531円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	3,598,569,767円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,899,845,367円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,089,649,570円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,418,670,019円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,097,040,794円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	472,632,111円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	417,011,666円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,762,760,621円

区分	2022年 5月10日現在
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	220,774,593円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,174,985円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	57,846,456円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	29,315,752,190円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	515,918,123円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	45,863,225円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	171,720,092円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	31,223,926円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	8,477,731円
グローバル経済コア	217,635,539円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	27,214,200円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	102,326,305円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	24,663,724円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,258,025,139円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	187,894,275円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	10,344,044円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	8,817,612円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	3,576,412円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	4,490,231円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	43,679,259,324円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	940,180,820円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	288,270,181円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	52,413,389円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	18,070,754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）	46,935,709,542円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	12,812,475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）	257,847,229円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,779,035,750	－	7,692,040,000	△86,995,750
合計		7,779,035,750	－	7,692,040,000	△86,995,750

(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。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	875,096,024
コール・ローン	15,604,284,647
国債証券	294,922,986,192
派生商品評価勘定	3,843,289
未収入金	80,151,868
未収利息	1,877,975,458
前払金	24,875,325
前払費用	102,417,404
差入委託証拠金	666,127,933
流動資産合計	314,157,758,140
資産合計	314,157,758,140
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	33,402,390
未払金	598,695,508
未払解約金	291,032,996
未払利息	8,131
流動負債合計	923,139,025
負債合計	923,139,025
純資産の部	
元本等	
元本	101,616,434,355
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	211,618,184,760
元本等合計	313,234,619,115
純資産合計	313,234,619,115
負債純資産合計	314,157,758,140

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 (1)先物取引

	2022年 5月10日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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）

		2022年 5月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	101,616,434,355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 3.0825円 (1万口当たり純資産額) (30,825円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2022年 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	2022年 5月10日現在
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	97,161,984,167円
期中追加設定元本額	7,967,283,939円
期中一部解約元本額	3,512,833,751円
期末元本額	101,616,434,355円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,325,694,178円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	573,403,020円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	387,700,518円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,163,457,603円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	8,653,367円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	8,158,471,655円

区分	2022年 5月10日現在
世界経済インデックスファンド	13,496,613,537円
ＤＣマイセレクション２５	1,951,687,787円
ＤＣマイセレクション５０	1,673,371,956円
ＤＣマイセレクション７５	1,154,332,537円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,295,643,558円
ＤＣマイセレクションＳ２５	925,247,860円
ＤＣマイセレクションＳ５０	732,085,523円
ＤＣマイセレクションＳ７５	414,437,730円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	30,275,780円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	91,673,396円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	47,019,824円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	12,568,572,862円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	595,029,548円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,650,011円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,395,846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）	23,165,922円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	47,930,499円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	71,940,031円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	73,784,318円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	70,266,398円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,330,421,986円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	448,324,524円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,774,225,416円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	86,819,755円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	53,860,232円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	453,490,427円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	170,008,549円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	212,422,323円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	747,594,702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）	2,037,953,800円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	744,152,939円
外国債券ファンド・シリーズ１	701,391,774円
コア投資戦略ファンド（安定型）	539,035,373円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,411,756,777円
分散投資コア戦略ファンドＡ	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドＳ	556,972,964円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	539,633,074円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,979,915,435円
コア投資戦略ファンド（切替型）	537,685,860円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	250,614,642円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	111,292,957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）	1,308,034,730円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	196,544,087円

区分	2022年 5月10日現在
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	19,485,147,850円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	246,894,754円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	305,906,068円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	494,922,494円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,019,868円
グローバル経済コア	841,930,138円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	16,292,013円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,744,201円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	193,600,906円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	28,394,173円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	10,674,689円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	11,274,149円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	5,078,311円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	7,088,489円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル債券インデックス（ノーロード）	159,736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）	283,515,955円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	11,008,271,484円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	331,764,704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）	305,231,105円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	360,436,892円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	164,843,298円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	72,507,626円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	100,532,987円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	2,970,959,220	－	2,946,083,895	△24,875,325
合計		2,970,959,220	－	2,946,083,895	△24,875,325

(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

（2022年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,724,378,213	－	2,718,480,761	△5,897,452
	アメリカドル	1,472,480,766	－	1,470,354,288	△2,126,478
	カナダドル	120,336,819	－	118,831,853	△1,504,966
	ユーロ	950,307,540	－	951,321,294	1,013,754
	イギリスポンド	181,251,826	－	177,972,072	△3,279,754
	イスラエルシェケル	1,262	－	1,254	△8
	売建	217,398,864	－	216,185,188	1,213,676
	アメリカドル	83,982,128	－	83,504,194	477,934
	ユーロ	48,136,054	－	48,012,935	123,119
	シンガポールドル	1,142,811	－	1,134,548	8,263
	マレーシアリンギット	84,137,871	－	83,533,511	604,360
合計		2,941,777,077	－	2,934,665,949	△4,683,776

(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。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,013,723,727
コール・ローン	1,489,343,186
株式	480,038,355,349
投資信託受益証券	215,724,946
投資証券	11,725,056,636
派生商品評価勘定	700,641
未収入金	40,881,457
未収配当金	595,158,105
前払金	705,533,394
差入委託証拠金	1,211,729,750
流動資産合計	505,036,207,191
資産合計	505,036,207,191

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	711,111,455
未払解約金	588,709,687
未払利息	776
流動負債合計	1,299,821,918
負債合計	1,299,821,918
純資産の部	
元本等	
元本	123,439,506,128
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	380,296,879,145
元本等合計	503,736,385,273
純資産合計	503,736,385,273
負債純資産合計	505,036,207,191

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。

	2022年 5月10日現在
	(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）

		2022年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		123,439,506,128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	4.0808円
	(1万口当たり純資産額)	(40,808円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2022年 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	2022年 5月10日現在
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	126,848,172,131円
期中追加設定元本額	7,509,382,388円
期中一部解約元本額	10,918,048,391円
期末元本額	123,439,506,128円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,883,678,610円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,439,733円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	31,392,580,628円
世界経済インデックスファンド	10,271,349,804円
外国株式インデックス・オープン	870,655,925円

区分	2022年 5月10日現在
ＤＣマイセレクション２５	802,669,251円
ＤＣマイセレクション５０	3,616,557,459円
ＤＣマイセレクション７５	4,015,993,494円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	11,852,901,405円
ＤＣマイセレクションＳ２５	393,404,481円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,806,901,714円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,462,446,739円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	45,750,253円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	162,700,967円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	118,931,244円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,573,463,611円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,486,148,740円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,828,753円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,004,952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）	29,927,997円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	15,432,161円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	52,688,817円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	11,319,798円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	32,345,308円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	286,175,381円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	176,305,325円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,293,284,462円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	125,096,346円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	33,352,178円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	166,222,459円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	56,515,180円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,070,240,865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）	1,131,684,373円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,137,007,530円
コア投資戦略ファンド（安定型）	581,693,447円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,345,785,667円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,421,677,202円
分散投資コア戦略ファンドＳ	8,037,948,513円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,272,339,033円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,076,922,108円
コア投資戦略ファンド（切替型）	530,929,433円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	595,405,872円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,262,210円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	156,482,916円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	383,790,568円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	15,741,252,776円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	188,527,218円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	715,581,162円

区分	2022年 5月10日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	135,308,413円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,596,274円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	163,224,573円
グローバル経済コア	641,701,183円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	13,085,867円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	5,685,293円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	444,599,492円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	66,705,541円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	28,495,824円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	24,249,522円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	9,775,879円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	12,504,775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）	266,018,338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）	195,518,788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）	963,574,039円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,184,416,206円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	212,666,118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）	121,952,881円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	54,069,270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）	85,558,147円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	232,787,423円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	249,093,423円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	247,805,125円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	225,480,922円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	221,972,924円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド２０２１－１１（適格機関投資家専用）	162,055,820円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	12,586,624,513	－	11,881,091,119	△705,533,394
合計		12,586,624,513	－	11,881,091,119	△705,533,394

(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

（2022年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,153,477,050	－	1,148,599,630	△4,877,420
	アメリカドル	1,086,123,900	－	1,081,804,114	△4,319,786
	スイスフラン	67,353,150	－	66,795,516	△557,634
合計		1,153,477,050	－	1,148,599,630	△4,877,420

(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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,133,646,742
投資証券	109,651,439,550
派生商品評価勘定	128,629,600
未収配当金	1,065,961,225
差入委託証拠金	206,800,000
流動資産合計	114,186,477,117
資産合計	114,186,477,117
負債の部	
流動負債	
前受金	128,629,600
未払金	342,378,155
未払解約金	15,243,792
未払利息	1,632
流動負債合計	486,253,179
負債合計	486,253,179
純資産の部	
元本等	
元本	53,594,140,102
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	60,106,083,836

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	113,700,223,938
純資産合計	113,700,223,938
負債純資産合計	114,186,477,117

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 5月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	53,594,140,102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 2.1215円 (1万口当たり純資産額) (21,215円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	50,752,359,768円
期中追加設定元本額	5,610,338,657円
期中一部解約元本額	2,768,558,323円
期末元本額	53,594,140,102円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,689,682,398円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,248,422円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	16,592,177,006円

区分	2022年 5月10日現在
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	25,446,898,197円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,311,353,253円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,959,775,127円
分散投資コア戦略ファンドＡ	795,726,284円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド（切替型）	822,252,995円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	26,329,022円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	253,602,124円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,293,318円
グローバル経済コア	241,384,045円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,802,592円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	472,620,333円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	69,373,515円
Ｍｙ　ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	228,802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）	482,421,981円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	19,843,519円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	186,830,875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）	90,580,139円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	862,717,717円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用）	260,498,840円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	297,017,822円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2022年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	3,911,208,400	－	4,039,838,000	128,629,600
合計		3,911,208,400	－	4,039,838,000	128,629,600

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	283,830,120
コール・ローン	311,268,392
投資証券	95,962,990,964
派生商品評価勘定	3,176
未収入金	4,932,599
未収配当金	119,146,183
流動資産合計	96,682,171,434
資産合計	96,682,171,434
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	512,269
未払株式払込金	6,314,066
未払解約金	211,858,453
未払利息	162
流動負債合計	218,684,950
負債合計	218,684,950
純資産の部	
元本等	
元本	38,512,077,705
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	57,951,408,779
元本等合計	96,463,486,484
純資産合計	96,463,486,484
負債純資産合計	96,682,171,434

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月10日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2 .デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。

	2022年 5月10日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 5月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	38,512,077,705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　2.5048円 (1万口当たり純資産額)　(25,048円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2022年 5月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2022年 5月10日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月11日
期首元本額	41,344,855,558円
期中追加設定元本額	3,936,037,464円
期中一部解約元本額	6,768,815,317円
期末元本額	38,512,077,705円
期末元本額の内訳	
グローバル３資産バランスオープン	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	92,933,067円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,670,619,232円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,178,218円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	12,144,066,051円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	16,461,304,677円
コア投資戦略ファンド（安定型）	691,010,554円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,572,384,701円
分散投資コア戦略ファンドＡ	647,769,269円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,393,496,043円
コア投資戦略ファンド（切替型）	574,452,616円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	132,369,799円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	193,215,417円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,501,844円
グローバル経済コア	233,946,661円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,397,968円

区分	2022年 5月10日現在
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	367,041,762円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	54,358,377円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	183,324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）	1,003,098,639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）	305,879,938円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	158,276,395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）	85,677,129円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	54,217,511円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	92,875,637円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	105,412,664円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	104,862,254円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	89,958,325円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	88,558,498円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド２０２１－１１（適格機関投資家専用）	113,853,667円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	279,446,410	－	278,937,317	△509,093
	アメリカドル	243,001,050	－	242,493,161	△507,889
	イギリスポンド	11,223,800	－	11,225,088	1,288
	オーストラリアドル	25,221,560	－	25,219,068	△2,492
合計		279,446,410	－	278,937,317	△509,093

(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。

２【ファンドの現況】

【ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）】

【純資産額計算書】

（2022年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	36,468,619,751円
Ⅱ　負債総額	33,916,730円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	36,434,703,021円
Ⅳ　発行済口数	19,281,505,145口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8896円
（1万口当たり純資産額）	（18,896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

（2022年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	640,621,120,580円
Ⅱ　負債総額	15,278,253,342円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	625,342,867,238円
Ⅳ　発行済口数	452,331,451,543口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3825円
（1万口当たり純資産額）	（13,825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

（2022年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	503,031,691,989円
Ⅱ　負債総額	7,341,248,040円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	495,690,443,949円
Ⅳ　発行済口数	262,442,463,772口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8888円
（1万口当たり純資産額）	（18,888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

（2022年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	308,837,425,207円
Ⅱ　負債総額	56,110,724円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	308,781,314,483円
Ⅳ　発行済口数	99,739,041,935口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0959円
（1万口当たり純資産額）	（30,959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

（2022年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	531,173,514,401円
Ⅱ　負債総額	412,319,513円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	530,761,194,888円
Ⅳ　発行済口数	125,038,360,296口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.2448円
（1万口当たり純資産額）	（42,448円）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	118,374,200,305円
Ⅱ　負債総額	617,916,722円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	117,756,283,583円
Ⅳ　発行済口数	54,051,737,441口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1786円
（1万口当たり純資産額）	（21,786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

（2022年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	100,929,662,873円
Ⅱ　負債総額	319,503,165円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	100,610,159,708円
Ⅳ　発行済口数	39,013,697,948口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5788円
（1万口当たり純資産額）	（25,788円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

則として取得申込者とします。）に支払います。

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2022年 5月31日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2022年 8月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年5月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	545	13,924,777
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	71	232,122
単位型公社債投資信託	51	228,981
合計	667	14,385,879

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（2）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

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

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本			
	利益剰余金			株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金	

当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		△3,857	△3,662	△3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	－	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△587	284	△302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				△3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,379	△349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	△349	1,029	4,360
当期末残高	791	△65	726	60,824

当事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	－	－	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	

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

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

２．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

３．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

４．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

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

５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

６．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

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

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

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

７．収益及び費用の計上基準

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

（1）投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応

じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

（2）投資一任業務

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

（3）投資助言業務

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

（4）成功報酬

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

８．ヘッジ会計の会計処理

（1）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

（2）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

（3）ヘッジ方針

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

（4）ヘッジ有効性評価の方法

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

９．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

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

（会計方針の変更）

１．「収益認識に関する会計基準」等の適用

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

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

２．「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

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

（未適用の会計基準等）

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

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

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

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

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

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

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。

これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針８．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付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.金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券	
その他有価証券	9,950
デリバティブ取引（*2）	
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(431)

(*1) 負債に計上されているものについては、（　　）で示しております。
(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2022年3月31日）

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

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。
(*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。
(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

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

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）　　（単位:百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	－	－	－
未収委託者報酬	8,471	－	－	－
未収運用受託報酬	6,151	－	－	－
投資有価証券 投資信託	－	10	5,751	0

当事業年度（2022年3月31日）　　（単位:百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	－	－	－
未収委託者報酬	9,067	－	－	－
未収運用受託報酬	6,252	－	－	－
投資有価証券				
投資信託	－	108	1,712	0

（有価証券関係）

１．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）　　（単位:百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	△1
小計	9	10	△1
合計	9,950	8,809	1,141

当事業年度（2022年3月31日）　　（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	△126
小計	1,585	1,711	△126
合計	6,474	5,115	1,358

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

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

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）　（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）　（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021年3月31日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	2,889	―	△41	△41
	英ポンド	128	―	△0	△0
	カナダドル	21	―	△0	△0
	スイスフラン	51	―	0	0
	香港ドル	128	―	△1	△1
	ユーロ	246	―	0	0
	買建				
	米ドル	99	―	1	1
	香港ドル	2	―	0	0
合計		3,567	―	△41	△41

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

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

当事業年度（2022年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	5,498	－	△54	△54
	英ポンド	277	－	△1	△1
	カナダドル	111	－	△1	△1
	スイスフラン	139	－	△2	△2
	香港ドル	190	－	△1	△1
	ユーロ	676	－	△18	△18
	買建				
	ユーロ	21	－	0	0
合計		6,915	－	△80	△80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	17,197	－	△1,333	△1,333
合計		17,197	－	△1,333	△1,333

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

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

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

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っております。

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

（単位：百万円）

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：百万円）

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

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

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

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

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,372百万円

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

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

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

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

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（2021年3月31日）

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

（１株当たり情報）

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

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20銭

（注）１．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	－	－
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

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

2022年 8月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2022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） （2022年3月末日現在）	事業の内容
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、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（2022年3月末日現在）

④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2022年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　三　上　和　彦
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　藤　澤　　孝

監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年４月１日から2022年３月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
　その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
　当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．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

2022年1月7日

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

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　後藤知弘　　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（資産成長型）の2020年11月11日から2021年11月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SBI資産設計オープン（資産成長型）の2021年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年7月22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　　後藤知弘　　印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSBI資産設計オープン（資産成長型）の2021年11月11日から2022年5月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SBI資産設計オープン（資産成長型）の2022年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年11月11日から2022年5月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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