【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（分配型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

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

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

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

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

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

（7）【申込期間】

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＞
当ファンドは「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）専用ファンドです。
＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞
取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品

市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

＜受付不可日＞

申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

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

＜信託金限度額＞

上限　5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

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

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

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

［投資対象地域による区分］

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

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

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

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

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

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

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

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

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

［独立した区分］

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

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

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

［補足分類］

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

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

＜属性区分表定義＞

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

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

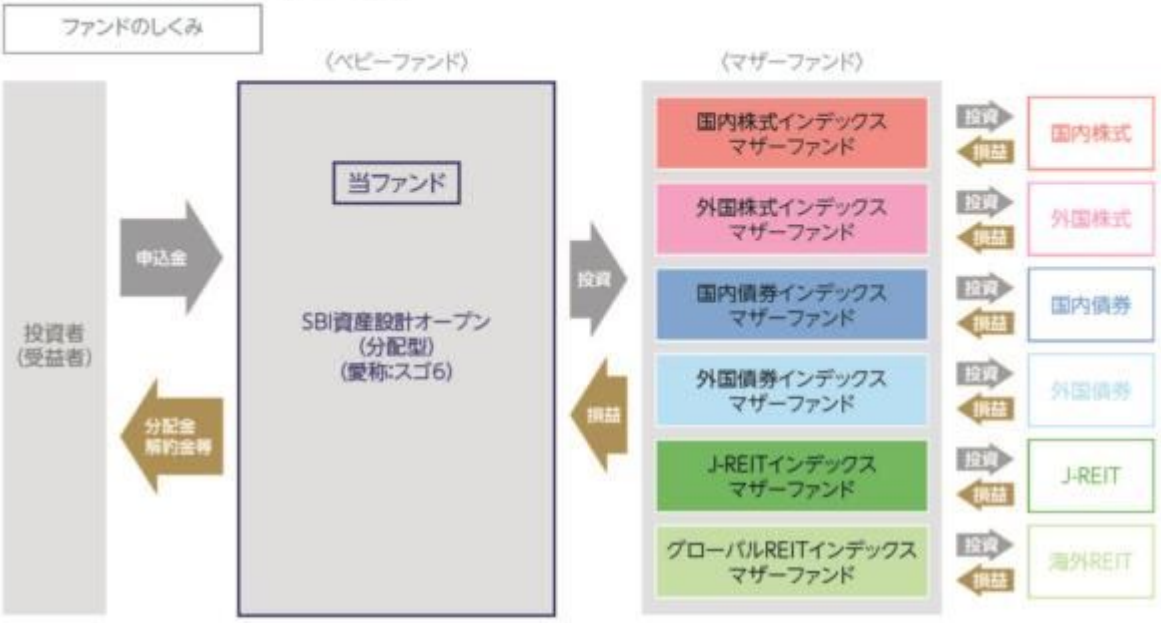
[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

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

＜ファンドの特色＞

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

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

ポートフォリオ構築プロセス

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

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

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資　産	インデックス
国　内　株　式	TOPIX（東証株価指数）
外　国　株　式	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
国　内　債　券	NOMURA-BPI 総合
外　国　債　券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
J - R E I T	東証REIT指数（配当込み）
海　外　R E I T	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）

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

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

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社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。）

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

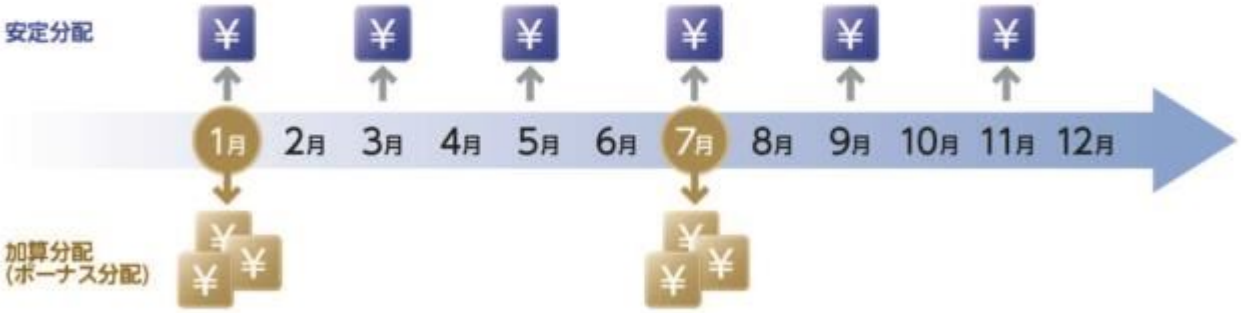
分配方針

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

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

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

収益分配のイメージ



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

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

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

[収益分配金に関する留意事項]

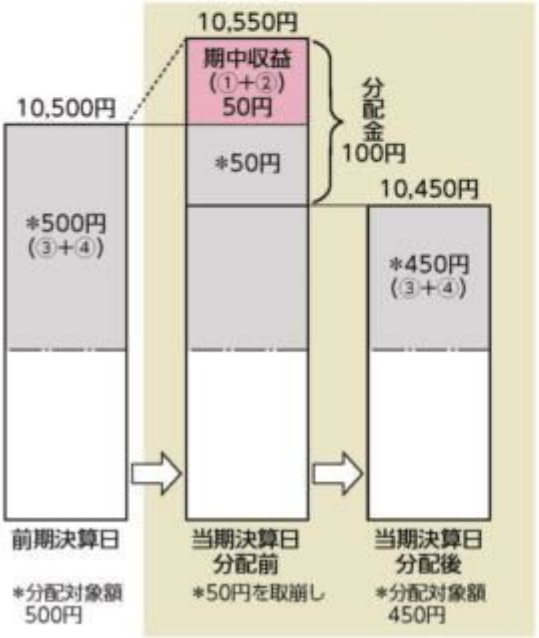
●分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ

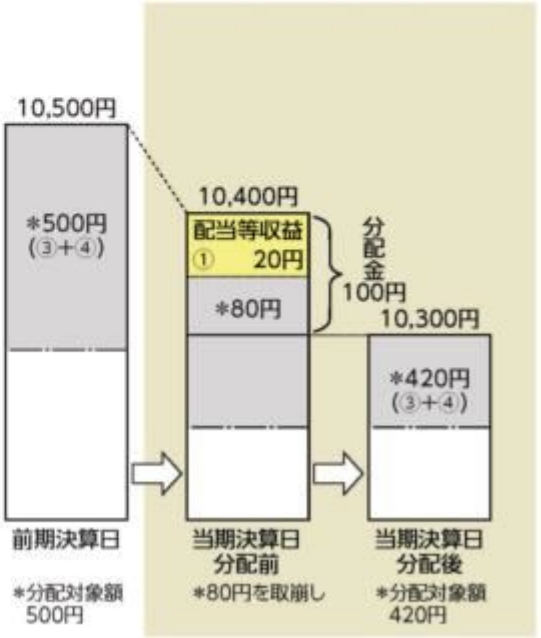
●分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

（前期決算日から基準価額が上昇した場合）



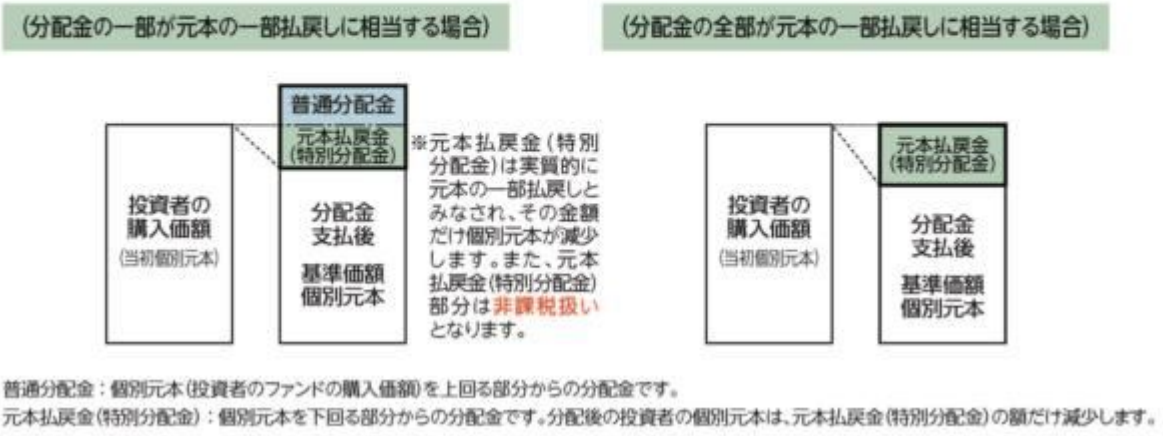
（前期決算日から基準価額が下落した場合）



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

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

●投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。
ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。



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

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

主な投資制限

●株式への直接投資は行いません。

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

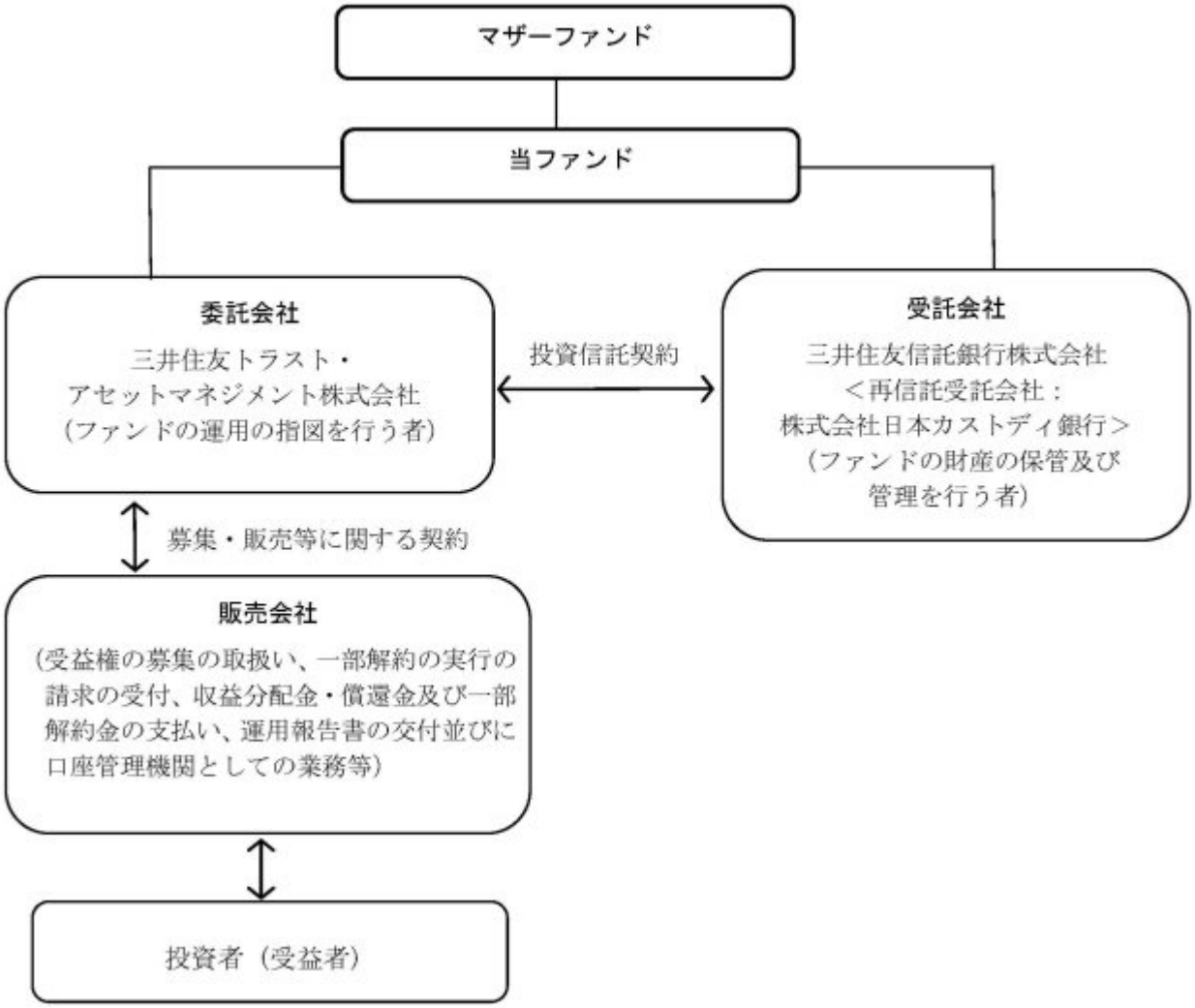
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

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

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（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、安定したインカムゲインの確保と投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

（ロ）運用方法

①投資対象

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

②投資態度

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

2)各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。

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

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

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

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

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

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

（2）【投資対象】

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

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

定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1.国内債券インデックス マザーファンド

2.国内株式インデックス マザーファンド

3.外国債券インデックス マザーファンド

4.外国株式インデックス マザーファンド

5.J-REITインデックス マザーファンド

6.グローバルREITインデックス マザーファンド

7.コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

10.外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

1.預金

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

3.コール・ローン

4.手形割引市場において売買される手形

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

(参考)マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

３．運用制限

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

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する

外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場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。

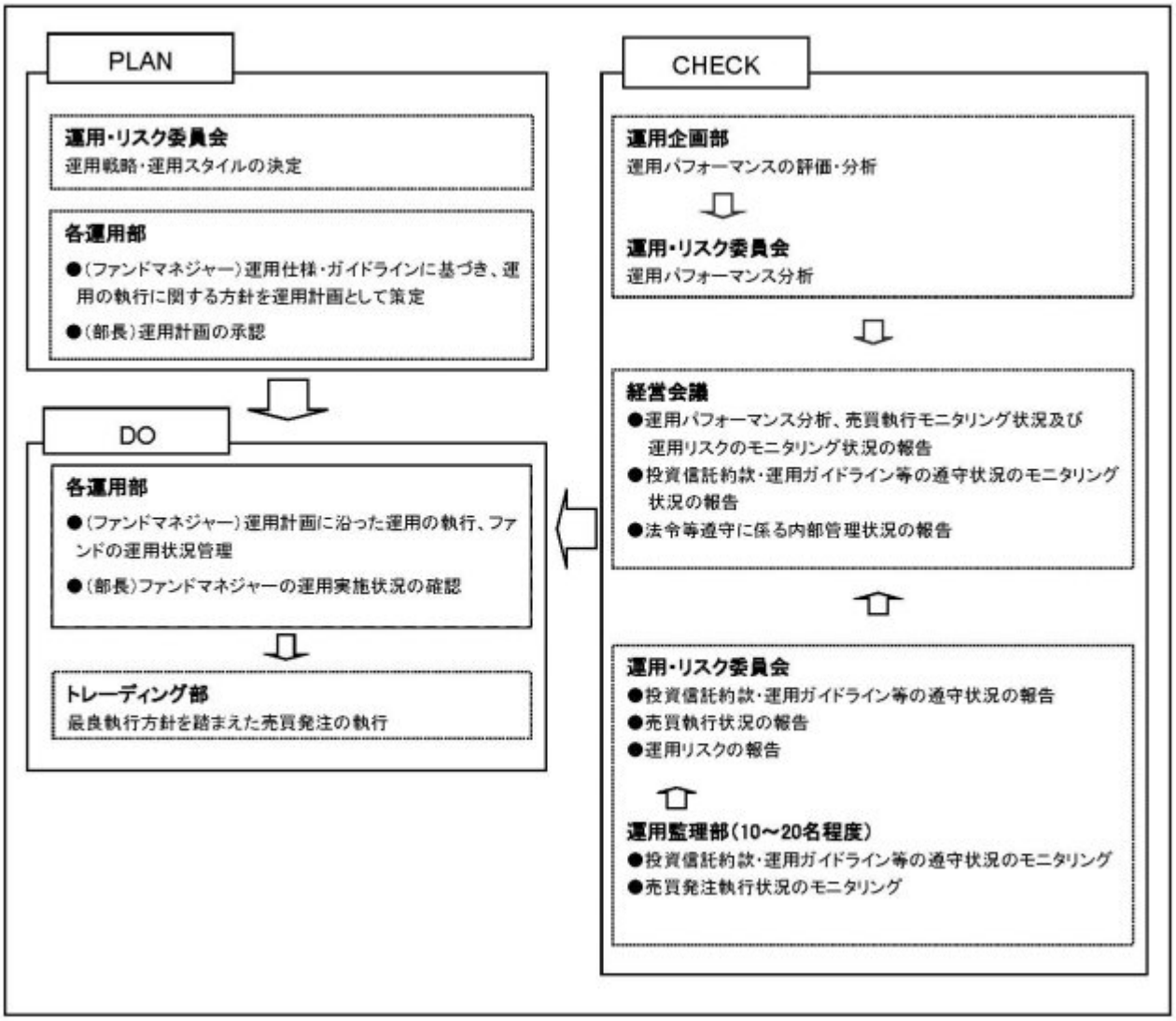
③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

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】

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

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

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

・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

①株式への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

②外貨建資産への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

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

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

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

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

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

＜その他の投資制限＞

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

投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3【投資リスク】

（イ）ファンドのリスク

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

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

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

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

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

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

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

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
②ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適

用はありません。

③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。

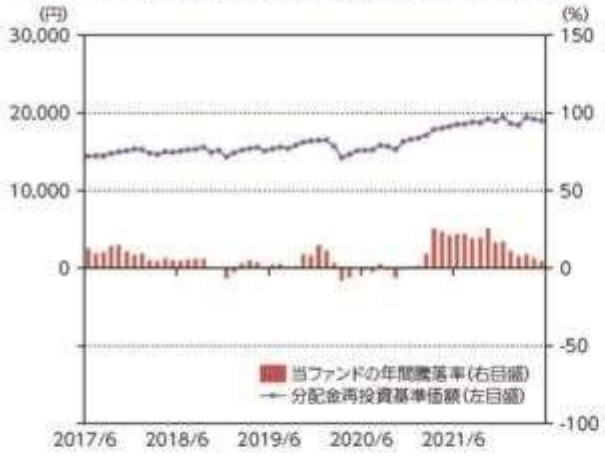
（ロ）リスクの管理体制

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により算出されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性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認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

③信託報酬に係る消費税等に相当する額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（4）【その他の手数料等】

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

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※上記における役務提供の内容は以下の通りです。
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
①個人の受益者に対する課税
イ．収益分配金に対する課税
収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。
なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（原則として配当控除の適用が可能です。）のいずれかを選択することもできます。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）
ロ．一部解約金及び償還金に対する課税
一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。
ハ．損益通算について
一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。
ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合
NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。
ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。
販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

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

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

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

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

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

※上記は、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（分配型）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	129,493,587	98.53

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,927,106	1.47
合計(純資産総額)		131,420,693	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	6,439,733	4.0808	26,279,262	4.2448	27,335,378	20.80
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	14,307,969	1.8383	26,302,339	1.8888	27,024,891	20.56
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	8,653,367	3.0825	26,674,003	3.0959	26,789,958	20.38
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス　マザーファンド	15,462,539	1.3798	21,335,211	1.3825	21,376,960	16.27
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	6,248,422	2.1215	13,256,027	2.1786	13,612,812	10.36
日本	親投資信託受益証券	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	5,178,218	2.5048	12,970,400	2.5788	13,353,588	10.16

(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	98.53
合計	98.53

(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10特定期間末 (2012年11月12日)	117,895,984	118,311,884	7,087	7,112
第11特定期間末 (2013年 5月10日)	147,321,414	147,697,364	9,797	9,822
第12特定期間末 (2013年11月11日)	122,040,492	122,357,417	9,627	9,652
第13特定期間末 (2014年 5月12日)	104,682,013	104,940,638	10,119	10,144
第14特定期間末 (2014年11月10日)	115,231,346	115,486,796	11,277	11,302
第15特定期間末 (2015年 5月11日)	152,350,349	152,677,449	11,644	11,669
第16特定期間末 (2015年11月10日)	203,190,644	203,656,069	10,914	10,939
第17特定期間末 (2016年 5月10日)	184,525,169	184,988,894	9,948	9,973
第18特定期間末 (2016年11月10日)	177,476,666	177,936,466	9,650	9,675
第19特定期間末 (2017年 5月10日)	181,966,182	182,396,932	10,561	10,586
第20特定期間末 (2017年11月10日)	168,947,238	169,332,538	10,962	10,987
第21特定期間末 (2018年 5月10日)	124,494,067	124,793,617	10,390	10,415
第22特定期間末 (2018年11月12日)	121,941,464	122,235,614	10,364	10,389
第23特定期間末 (2019年 5月10日)	116,468,041	116,749,791	10,334	10,359
第24特定期間末 (2019年11月11日)	114,747,322	115,010,172	10,914	10,939
第25特定期間末 (2020年 5月11日)	94,892,059	95,144,959	9,380	9,405
第26特定期間末 (2020年11月10日)	104,375,978	104,632,353	10,178	10,203
第27特定期間末 (2021年 5月10日)	118,923,786	119,183,611	11,443	11,468
第28特定期間末 (2021年11月10日)	153,328,366	153,661,291	11,514	11,539
第29特定期間末 (2022年 5月10日)	128,778,971	129,082,496	10,607	10,632
2021年 5月末日	119,668,443	—	11,486	—
6月末日	121,284,707	—	11,652	—
7月末日	113,958,771	—	11,167	—
8月末日	122,474,921	—	11,311	—
9月末日	150,740,896	—	11,239	—
10月末日	153,492,617	—	11,531	—
11月末日	150,825,708	—	11,333	—
12月末日	155,096,763	—	11,638	—
2022年 1月末日	142,454,303	—	10,636	—
2月末日	141,460,957	—	10,528	—
3月末日	149,000,992	—	11,087	—
4月末日	148,004,486	—	10,932	—
5月末日	131,420,693	—	10,823	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第10特定期間	2012年 5月11日～2012年11月12日	75
第11特定期間	2012年11月13日～2013年 5月10日	75

第12特定期間	2013年 5月11日～2013年11月11日	75
第13特定期間	2013年11月12日～2014年 5月12日	75
第14特定期間	2014年 5月13日～2014年11月10日	75
第15特定期間	2014年11月11日～2015年 5月11日	575
第16特定期間	2015年 5月12日～2015年11月10日	575
第17特定期間	2015年11月11日～2016年 5月10日	425
第18特定期間	2016年 5月11日～2016年11月10日	75
第19特定期間	2016年11月11日～2017年 5月10日	75
第20特定期間	2017年 5月11日～2017年11月10日	125
第21特定期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	575
第22特定期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	75
第23特定期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	75
第24特定期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	75
第25特定期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	575
第26特定期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	75
第27特定期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	75
第28特定期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	575
第29特定期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	575

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第10特定期間	2012年 5月11日～2012年11月12日	2.2
第11特定期間	2012年11月13日～2013年 5月10日	39.3
第12特定期間	2013年 5月11日～2013年11月11日	△1.0
第13特定期間	2013年11月12日～2014年 5月12日	5.9
第14特定期間	2014年 5月13日～2014年11月10日	12.2
第15特定期間	2014年11月11日～2015年 5月11日	8.4
第16特定期間	2015年 5月12日～2015年11月10日	△1.3
第17特定期間	2015年11月11日～2016年 5月10日	△5.0
第18特定期間	2016年 5月11日～2016年11月10日	△2.2
第19特定期間	2016年11月11日～2017年 5月10日	10.2
第20特定期間	2017年 5月11日～2017年11月10日	5.0
第21特定期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.0
第22特定期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.5
第23特定期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0.4
第24特定期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	6.3
第25特定期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	△8.8
第26特定期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	9.3
第27特定期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	13.2
第28特定期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	5.6

第29特定期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	△2.9

(注1)収益率とは、各特定期間末の基準価額(分配落)から前特定期間末の基準価額(分配落)を控除した額に特定期間中の分配金累計額を加算し、前特定期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第10特定期間	2012年 5月11日～2012年11月12日	3,110,000	4,650,000	166,360,000
第11特定期間	2012年11月13日～2013年 5月10日	18,410,000	34,390,000	150,380,000
第12特定期間	2013年 5月11日～2013年11月11日	4,390,000	28,000,000	126,770,000
第13特定期間	2013年11月12日～2014年 5月12日	2,830,000	26,150,000	103,450,000
第14特定期間	2014年 5月13日～2014年11月10日	8,870,000	10,140,000	102,180,000
第15特定期間	2014年11月11日～2015年 5月11日	34,550,000	5,890,000	130,840,000
第16特定期間	2015年 5月12日～2015年11月10日	83,140,000	27,810,000	186,170,000
第17特定期間	2015年11月11日～2016年 5月10日	18,390,000	19,070,000	185,490,000
第18特定期間	2016年 5月11日～2016年11月10日	8,720,000	10,290,000	183,920,000
第19特定期間	2016年11月11日～2017年 5月10日	30,870,000	42,490,000	172,300,000
第20特定期間	2017年 5月11日～2017年11月10日	61,680,000	79,860,000	154,120,000
第21特定期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	780,000	35,080,000	119,820,000
第22特定期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	190,000	2,350,000	117,660,000
第23特定期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	490,000	5,450,000	112,700,000
第24特定期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	1,020,000	8,580,000	105,140,000
第25特定期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	3,890,000	7,870,000	101,160,000
第26特定期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	1,960,000	570,000	102,550,000
第27特定期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	6,200,000	4,820,000	103,930,000
第28特定期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	33,460,000	4,220,000	133,170,000
第29特定期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	2,490,000	14,250,000	121,410,000

(注)当該特定期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	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。

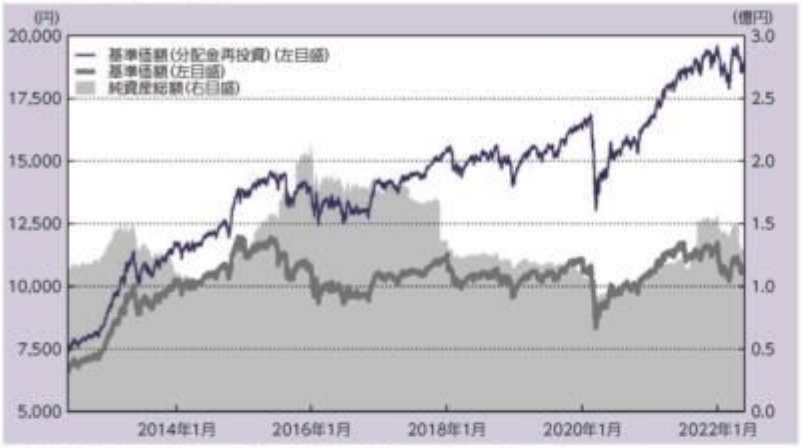
≪参考情報≫

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	10,823円
純資産総額	1.31億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2021年9月	25円
2021年11月	25円
2022年1月	525円
2022年3月	25円
2022年5月	25円
直近1年間分配金合計額	1,150円
設定来分配金合計額	5,693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	20.8%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	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	20.6%	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	20.4%	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	16.3%	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%
J-REITインデックスマザーファンド	10.4%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.6%
グローバルREITインデックスマザーファンド	10.2%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%

※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＞

当ファンドは「分配金受取りコース」専用ファンドです。

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

＜申込手数料＞

ありません。

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

＜申込受付の中止等＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきまし

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

＜一部解約単位＞
販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞
一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。
解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞
受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

＜受付不可日＞
一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

＜一部解約受付の中止等＞
委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

・株式および不動産投資信託証券

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

・公社債

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

a.日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）

b.価格情報会社の提供する価額

c.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

・外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2008年 1月 9日設定）

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき
・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理

由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

③収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29特定期間(2021年11月11日から2022年5月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第28特定期間 （2021年11月10日現在）	第29特定期間 （2022年 5月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,843,619	1,747,634
親投資信託受益証券	151,005,634	126,817,242
未収入金	-	700,000
流動資産合計	153,849,253	129,264,876
資産合計	153,849,253	129,264,876
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	332,925	303,525
未払受託者報酬	10,980	10,655
未払委託者報酬	175,622	170,411
未払利息	6	-
その他未払費用	1,354	1,314
流動負債合計	520,887	485,905
負債合計	520,887	485,905
純資産の部		
元本等		
元本	133,170,000	121,410,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	20,158,366	7,368,971
（分配準備積立金）	11,575,523	4,472,177
元本等合計	153,328,366	128,778,971
純資産合計	153,328,366	128,778,971
負債純資産合計	153,849,253	129,264,876

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第28特定期間 自 2021年 5月11日 至 2021年11月10日	第29特定期間 自 2021年11月11日 至 2022年 5月10日
営業収益		
受取利息	5	5
有価証券売買等損益	7,753,375	△3,518,392
営業収益合計	7,753,380	△3,518,387
営業費用		
支払利息	499	332
受託者報酬	28,641	32,077
委託者報酬	458,215	513,108
その他費用	3,525	3,952
営業費用合計	490,880	549,469
営業利益又は営業損失（△）	7,262,500	△4,067,856
経常利益又は経常損失（△）	7,262,500	△4,067,856
当期純利益又は当期純損失（△）	7,262,500	△4,067,856
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（△）	17,982	739,254
期首剰余金又は期首欠損金（△）	14,993,786	20,158,366
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,522,791	223,806
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,522,791	223,806
剰余金減少額又は欠損金増加額	536,129	569,966
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	536,129	569,966
分配金	6,066,600	7,636,125
期末剰余金又は期末欠損金（△）	20,158,366	7,368,971

（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28特定期間 (2021年11月10日現在)		第29特定期間 (2022年 5月10日現在)	
１．特定期間の末日における受益権の総数		133,170,000口		121,410,000口
２．特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	1.1514円	1口当たり純資産額	1.0607円
	(1万口当たり純資産額)	(11,514円)	(1万口当たり純資産額)	(10,607円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第28特定期間
自 2021年 5月11日
至 2021年11月10日

分配金の計算過程

第80期
自 2021年 5月11日
至 2021年 7月12日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	333,873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	2,749,676円
収益調整金額	C	16,146,051円
分配準備積立金額	D	10,703,624円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	29,933,224円
当ファンドの期末残存口数	F	104,060,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,876円
1万口当たり分配金額	H	525円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	5,463,150円

第81期
自 2021年 7月13日
至 2021年 9月10日

第29特定期間
自 2021年11月11日
至 2022年 5月10日

分配金の計算過程

第83期
自 2021年11月11日
至 2022年 1月11日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	211,715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	23,811,552円
分配準備積立金額	D	11,564,436円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	35,587,703円
当ファンドの期末残存口数	F	133,270,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,670円
1万口当たり分配金額	H	525円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	6,996,675円

第84期
自 2022年 1月12日
至 2022年 3月10日

第28特定期間
自 2021年 5月11日
至 2021年11月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	289,333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	1,910,554円
収益調整金額	C	17,328,030円
分配準備積立金額	D	8,124,646円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	27,652,563円
当ファンドの期末残存口数	F	108,210,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,555円
1万口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	270,525円

第29特定期間
自 2021年11月11日
至 2022年 5月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	194,825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	24,050,628円
分配準備積立金額	D	4,777,089円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	29,022,542円
当ファンドの期末残存口数	F	134,370,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,159円
1万口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	335,925円

第82期
自 2021年 9月11日
至 2021年11月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	520,660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	1,440,422円
収益調整金額	C	23,773,548円
分配準備積立金額	D	9,947,366円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	35,681,996円
当ファンドの期末残存口数	F	133,170,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,679円
1万口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	332,925円

第85期
自 2022年 3月11日
至 2022年 5月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	612,022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	21,765,123円
分配準備積立金額	D	4,163,680円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,540,825円
当ファンドの期末残存口数	F	121,410,000口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,186円
1万口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	303,525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29特定期間 自 2021年11月11日 至 2022年 5月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。

	第29特定期間 自 2021年11月11日 至 2022年 5月10日
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第29特定期間 (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	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第28特定期間 自 2021年 5月11日 至 2021年11月10日	第29特定期間 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	103,930,000円	133,170,000円
期中追加設定元本額	33,460,000円	2,490,000円
期中一部解約元本額	4,220,000円	14,250,000円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第28特定期間 （2021年11月10日現在）	第29特定期間 （2022年 5月10日現在）
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,156,883	3,023,432
合計	2,156,883	3,023,432

（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	6,248,422	13,256,027	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	5,178,218	12,970,400	
	国内株式インデックス　マザーファンド	14,307,969	26,302,339	
	外国株式インデックス　マザーファンド	6,439,733	26,279,262	
	国内債券インデックス　マザーファンド	15,462,539	21,335,211	
	外国債券インデックス　マザーファンド	8,653,367	26,674,003	
合計		56,290,248	126,817,242	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 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
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）
1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2022年 5月10日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 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
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

区分	2022年 5月10日現在
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
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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△14,912,860,850
地方債証券	△601,638,507
特殊債券	△589,945,215
社債券	△444,131,740
合計	△16,548,576,312

(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４２５回利付国債（２年）	2,810,000,000	2,812,360,400	
	第４２６回利付国債（２年）	620,000,000	620,564,200	
	第４２７回利付国債（２年）	3,260,000,000	3,262,966,600	
	第４２８回利付国債（２年）	230,000,000	230,225,400	
	第４２９回利付国債（２年）	950,000,000	950,988,000	
	第４３０回利付国債（２年）	2,010,000,000	2,012,211,000	
	第４３４回利付国債（２年）	1,915,000,000	1,917,240,550	
	第４３５回利付国債（２年）	780,000,000	780,959,400	
	第４３６回利付国債（２年）	230,000,000	230,248,400	
	第１３６回利付国債（５年）	4,330,000,000	4,338,400,200	
	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	6,775,615,600	
	第１３８回利付国債（５年）	6,890,000,000	6,908,327,400	
	第１３９回利付国債（５年）	5,590,000,000	5,606,099,200	
	第１４０回利付国債（５年）	5,120,000,000	5,135,667,200	
	第１４１回利付国債（５年）	7,960,000,000	7,986,268,000	
	第１４２回利付国債（５年）	4,370,000,000	4,385,950,500	
	第１４３回利付国債（５年）	4,910,000,000	4,929,640,000	
	第１４４回利付国債（５年）	6,310,000,000	6,336,502,000	
	第１４５回利付国債（５年）	5,820,000,000	5,845,433,400	
	第１４６回利付国債（５年）	3,150,000,000	3,164,206,500	
	第１４７回利付国債（５年）	4,170,000,000	4,173,210,900	
	第１４８回利付国債（５年）	6,950,000,000	6,954,239,500	
	第１４９回利付国債（５年）	5,130,000,000	5,131,077,300	
	第１５０回利付国債（５年）	5,880,000,000	5,880,000,000	
	第１５１回利付国債（５年）	920,000,000	919,549,200	

第１回利付国債（４０年）	400,000,000	533,692,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,458,773,500	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	712,426,000	
第４回利付国債（４０年）	950,000,000	1,232,910,000	
第５回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,337,542,800	
第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,549,321,200	
第７回利付国債（４０年）	1,240,000,000	1,463,857,200	
第８回利付国債（４０年）	1,230,000,000	1,353,344,400	
第９回利付国債（４０年）	2,050,000,000	1,675,321,500	
第１０回利付国債（４０年）	2,100,000,000	2,009,343,000	
第１１回利付国債（４０年）	1,790,000,000	1,656,161,700	
第１２回利付国債（４０年）	1,290,000,000	1,072,944,600	
第１３回利付国債（４０年）	2,140,000,000	1,770,785,800	
第１４回利付国債（４０年）	2,020,000,000	1,785,457,800	
第３２９回利付国債（１０年）	4,410,000,000	4,452,821,100	
第３３０回利付国債（１０年）	3,910,000,000	3,956,333,500	
第３３１回利付国債（１０年）	900,000,000	908,217,000	
第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	4,851,456,000	
第３３３回利付国債（１０年）	3,030,000,000	3,066,875,100	
第３３４回利付国債（１０年）	4,260,000,000	4,317,978,600	
第３３５回利付国債（１０年）	2,310,000,000	2,339,475,600	
第３３６回利付国債（１０年）	1,110,000,000	1,125,662,100	
第３３７回利付国債（１０年）	2,800,000,000	2,824,864,000	
第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	4,617,364,800	
第３３９回利付国債（１０年）	4,750,000,000	4,814,315,000	
第３４０回利付国債（１０年）	4,830,000,000	4,899,841,800	
第３４１回利付国債（１０年）	5,340,000,000	5,402,691,600	
第３４２回利付国債（１０年）	4,840,000,000	4,861,441,200	
第３４３回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,682,068,400	
第３４４回利付国債（１０年）	5,900,000,000	5,925,724,000	
第３４５回利付国債（１０年）	3,780,000,000	3,796,518,600	
第３４６回利付国債（１０年）	5,750,000,000	5,773,690,000	
第３４７回利付国債（１０年）	4,050,000,000	4,063,405,500	
第３４８回利付国債（１０年）	4,340,000,000	4,351,587,800	
第３４９回利付国債（１０年）	5,000,000,000	5,009,750,000	
第３５０回利付国債（１０年）	6,630,000,000	6,637,690,800	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	5,030,000,000	5,030,000,000	
第３５２回利付国債（１０年）	4,510,000,000	4,505,715,500	
第３５３回利付国債（１０年）	5,150,000,000	5,139,854,500	
第３５４回利付国債（１０年）	4,790,000,000	4,775,342,600	
第３５５回利付国債（１０年）	3,710,000,000	3,693,045,300	
第３５６回利付国債（１０年）	4,080,000,000	4,054,785,600	

第３５７回利付国債（１０年）	2,770,000,000	2,749,225,000	
第３５８回利付国債（１０年）	3,560,000,000	3,529,704,400	
第３５９回利付国債（１０年）	3,420,000,000	3,387,270,600	
第３６０回利付国債（１０年）	4,890,000,000	4,837,823,700	
第３６１回利付国債（１０年）	3,940,000,000	3,895,084,000	
第３６２回利付国債（１０年）	3,850,000,000	3,803,222,500	
第３６３回利付国債（１０年）	5,560,000,000	5,488,109,200	
第３６４回利付国債（１０年）	5,110,000,000	5,042,139,200	
第３６５回利付国債（１０年）	6,970,000,000	6,875,068,600	
第３６６回利付国債（１０年）	540,000,000	537,656,400	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	131,033,100	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	187,112,000	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	139,902,000	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	134,791,800	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	58,734,000	
第６回利付国債（３０年）	350,000,000	421,015,000	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	216,190,800	
第８回利付国債（３０年）	350,000,000	404,229,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	267,146,400	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	173,185,600	
第１１回利付国債（３０年）	260,000,000	298,490,400	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	226,827,700	
第１３回利付国債（３０年）	400,000,000	473,904,000	
第１４回利付国債（３０年）	800,000,000	986,712,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	424,425,400	
第１６回利付国債（３０年）	200,000,000	250,356,000	
第１７回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,428,691,000	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	425,416,050	
第１９回利付国債（３０年）	530,000,000	655,027,000	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	606,696,000	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	620,620,000	
第２２回利付国債（３０年）	540,000,000	685,735,200	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	547,312,600	
第２４回利付国債（３０年）	780,000,000	994,359,600	
第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	437,269,000	
第２６回利付国債（３０年）	1,140,000,000	1,442,544,600	
第２７回利付国債（３０年）	1,920,000,000	2,467,795,200	
第２８回利付国債（３０年）	2,140,000,000	2,756,683,800	
第２９回利付国債（３０年）	1,670,000,000	2,132,155,800	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,235,775,500	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,374,571,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,360,000,000	1,724,561,600	

第３３回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,217,579,000	
第３４回利付国債（３０年）	1,795,000,000	2,254,789,250	
第３５回利付国債（３０年）	2,300,000,000	2,814,602,000	
第３６回利付国債（３０年）	2,130,000,000	2,608,185,000	
第３７回利付国債（３０年）	2,255,000,000	2,722,687,000	
第３８回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,677,011,700	
第３９回利付国債（３０年）	1,480,000,000	1,788,535,600	
第４０回利付国債（３０年）	1,420,000,000	1,689,842,600	
第４１回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,346,903,000	
第４２回利付国債（３０年）	1,120,000,000	1,312,404,800	
第４３回利付国債（３０年）	1,290,000,000	1,512,370,200	
第４４回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,348,869,500	
第４５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,629,878,400	
第４６回利付国債（３０年）	1,650,000,000	1,867,767,000	
第４７回利付国債（３０年）	1,560,000,000	1,798,134,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,710,000,000	1,898,852,400	
第４９回利付国債（３０年）	1,700,000,000	1,887,561,000	
第５０回利付国債（３０年）	1,590,000,000	1,560,298,800	
第５１回利付国債（３０年）	1,710,000,000	1,490,487,300	
第５２回利付国債（３０年）	1,680,000,000	1,533,470,400	
第５３回利付国債（３０年）	1,320,000,000	1,231,520,400	
第５４回利付国債（３０年）	1,680,000,000	1,637,546,400	
第５５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,401,883,200	
第５６回利付国債（３０年）	1,480,000,000	1,439,033,600	
第５７回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,367,841,000	
第５８回利付国債（３０年）	2,350,000,000	2,274,447,500	
第５９回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,329,291,600	
第６０回利付国債（３０年）	1,530,000,000	1,509,084,900	
第６１回利付国債（３０年）	1,460,000,000	1,369,377,800	
第６２回利付国債（３０年）	240,000,000	213,463,200	
第６３回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,088,312,400	
第６４回利付国債（３０年）	1,830,000,000	1,575,483,600	
第６５回利付国債（３０年）	1,590,000,000	1,367,304,600	
第６６回利付国債（３０年）	1,030,000,000	883,791,500	
第６７回利付国債（３０年）	1,885,000,000	1,704,586,650	
第６８回利付国債（３０年）	1,490,000,000	1,344,933,600	
第６９回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,240,907,000	
第７０回利付国債（３０年）	1,740,000,000	1,606,890,000	
第７１回利付国債（３０年）	1,430,000,000	1,319,875,700	
第７２回利付国債（３０年）	1,070,000,000	985,951,500	
第７３回利付国債（３０年）	1,920,000,000	1,766,208,000	
第７４回利付国債（３０年）	720,000,000	715,060,800	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	323,107,200	

第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	204,164,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	328,588,800	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	226,969,600	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	339,923,100	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	134,725,500	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	197,966,700	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	405,627,300	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	420,648,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	209,480,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	661,865,400	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	379,191,600	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	211,186,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	137,958,600	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	284,982,300	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	306,924,400	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	180,239,100	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	287,101,800	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	234,621,200	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	416,640,900	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	643,002,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	312,272,000	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	504,394,600	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	313,672,700	
第８６回利付国債（２０年）	510,000,000	555,568,500	
第８７回利付国債（２０年）	1,830,000,000	1,986,446,700	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	459,887,400	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	381,797,500	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	690,448,500	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	495,139,500	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	964,981,600	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	449,503,500	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	671,732,000	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	680,467,200	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,757,458,800	
第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	445,984,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	488,228,400	
第９９回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,436,750,400	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	539,481,600	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	811,946,850	
第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,436,412,600	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	453,572,000	
第１０４回利付国債（２０年）	160,000,000	179,486,400	

第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,328,337,800	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	430,171,400	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	293,667,400	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	736,810,800	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	582,358,400	
第１１０回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,246,861,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,109,486,000	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	898,048,300	
第１１３回利付国債（２０年）	2,020,000,000	2,302,598,000	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,663,865,700	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	805,553,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,721,188,400	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,239,213,600	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	754,498,800	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	597,431,900	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,744,693,900	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,707,600,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,062,378,600	
第１２３回利付国債（２０年）	1,870,000,000	2,167,086,900	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	701,756,200	
第１２５回利付国債（２０年）	1,820,000,000	2,132,148,200	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	842,522,200	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,168,369,200	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,114,530,000	
第１２９回利付国債（２０年）	740,000,000	843,659,200	
第１３０回利付国債（２０年）	1,285,000,000	1,469,872,950	
第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,134,710,000	
第１３２回利付国債（２０年）	1,160,000,000	1,319,720,400	
第１３３回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,410,908,400	
第１３４回利付国債（２０年）	830,000,000	954,682,600	
第１３５回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,174,807,700	
第１３６回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,639,892,000	
第１３７回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,210,350,400	
第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	695,726,800	
第１３９回利付国債（２０年）	830,000,000	939,551,700	
第１４０回利付国債（２０年）	2,470,000,000	2,823,160,600	
第１４１回利付国債（２０年）	1,600,000,000	1,831,280,000	
第１４２回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,177,936,800	
第１４３回利付国債（２０年）	1,920,000,000	2,180,160,000	
第１４４回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,293,738,500	
第１４５回利付国債（２０年）	2,635,000,000	3,025,085,400	
第１４６回利付国債（２０年）	2,700,000,000	3,103,380,000	
第１４７回利付国債（２０年）	2,380,000,000	2,711,914,800	

	第１４８回利付国債（２０年）	2,000,000,000	2,257,980,000	
	第１４９回利付国債（２０年）	2,600,000,000	2,938,806,000	
	第１５０回利付国債（２０年）	2,730,000,000	3,055,170,300	
	第１５１回利付国債（２０年）	2,125,000,000	2,327,682,500	
	第１５２回利付国債（２０年）	2,860,000,000	3,134,016,600	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,440,000,000	2,705,106,000	
	第１５４回利付国債（２０年）	2,810,000,000	3,079,479,000	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,800,000,000	2,995,580,000	
	第１５６回利付国債（２０年）	2,710,000,000	2,680,081,600	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,950,000,000	2,831,469,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,530,000,000	2,526,609,800	
	第１５９回利付国債（２０年）	2,400,000,000	2,426,064,000	
	第１６０回利付国債（２０年）	1,890,000,000	1,934,244,900	
	第１６１回利付国債（２０年）	1,990,000,000	2,005,263,300	
	第１６２回利付国債（２０年）	630,000,000	633,559,500	
	第１６３回利付国債（２０年）	1,980,000,000	1,987,088,400	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,320,000,000	1,301,823,600	
	第１６５回利付国債（２０年）	2,180,000,000	2,144,814,800	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,620,000,000	1,640,460,600	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,150,000,000	2,104,785,500	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,410,000,000	1,354,375,500	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,990,000,000	1,874,082,500	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,390,000,000	2,243,732,000	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,670,000,000	1,562,802,700	
	第１７２回利付国債（２０年）	2,500,000,000	2,375,275,000	
	第１７３回利付国債（２０年）	2,350,000,000	2,225,943,500	
	第１７４回利付国債（２０年）	2,480,000,000	2,341,789,600	
	第１７５回利付国債（２０年）	1,960,000,000	1,879,973,200	
	第１７６回利付国債（２０年）	2,910,000,000	2,785,190,100	
	第１７７回利付国債（２０年）	2,390,000,000	2,240,816,200	
	第１７８回利付国債（２０年）	1,690,000,000	1,611,753,000	
	第１７９回利付国債（２０年）	3,015,000,000	2,868,953,400	
	第１８０回利付国債（２０年）	540,000,000	542,322,000	
国債証券合計		503,880,000,000	522,045,299,300	
地方債証券	第２回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（５年））	100,000,000	100,114,000	
	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	104,150,000	
	第５回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年））	100,000,000	91,401,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	105,594,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	126,218,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	123,943,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	119,954,000	

第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	118,185,000	
第１６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	223,330,000	
第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	112,187,000	
第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	113,133,000	
第１９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	91,595,000	
第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	228,138,000	
第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	226,756,000	
第３３回東京都公募公債（５年）	200,000,000	199,674,000	
第７２０回東京都公募公債	100,000,000	100,955,000	
第７２６回東京都公募公債	200,000,000	202,302,000	
第７２８回東京都公募公債	100,000,000	101,023,000	
第７５１回東京都公募公債	100,000,000	101,135,000	
第７６５回東京都公募公債	100,000,000	100,580,000	
第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,329,000	
第７８１回東京都公募公債	300,000,000	299,364,000	
第８００回東京都公募公債	200,000,000	196,798,000	
平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,587,000	
平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,079,000	
平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	100,716,000	
平成３０年度第１４回北海道公募公債	200,000,000	199,412,000	
第２９回１号宮城県公募公債（１０年）	100,000,000	100,977,000	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	258,824,000	
第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	112,877,000	
第１５回神奈川県公募公債（２０年）	200,000,000	226,928,000	
第１７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,794,000	
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	113,736,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	110,973,000	
第７８回神奈川県公募公債（５年）	200,000,000	199,872,000	
第２０１回神奈川県公募公債	200,250,000	202,144,365	
第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	202,148,000	
第２１５回神奈川県公募公債	100,000,000	101,395,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,504,000	
第２２６回神奈川県公募公債	100,000,000	100,507,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,329,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	196,724,000	
第６回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	226,980,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	227,582,000	
第１０回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	113,545,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,075,000	
第３７７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,059,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,211,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	152,744,050	

第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,576,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,551,000	
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	156,152,880	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,418,000	
第４３９回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,386,000	
第４４０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	99,702,000	
第４６５回大阪府公募公債（１０年）	160,000,000	156,926,400	
第４６８回大阪府公募公債（１０年）	182,000,000	178,569,300	
第４６９回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	196,156,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	113,862,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	113,467,000	
平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	101,075,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	101,577,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	96,602,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	100,136,000	
令和２年度第１２回京都府公募公債	140,500,000	138,032,820	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	111,882,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	101,509,000	
第６回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	107,025,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	105,843,000	
第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	105,760,000	
第９回兵庫県公募公債（２０年）	400,000,000	458,092,000	
平成２５年度第７回兵庫県公募公債	100,000,000	101,015,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	101,175,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	98,738,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	296,604,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	112,232,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	95,659,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	113,484,000	
第１８回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	111,800,000	
平成２６年度第３回静岡県公募公債	100,000,000	101,316,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,380,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	100,482,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	100,424,000	
令和２年度第１１回静岡県公募公債	310,000,000	306,729,500	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	114,181,000	
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,251,000	
平成２６年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	202,558,000	

平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,186,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,000,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,954,000	
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	298,779,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,029,000	
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	94,411,000	
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	196,812,000	
令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	98,593,000	
令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年）	200,000,000	182,148,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	113,415,000	
平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年）	200,000,000	227,224,000	
平成２５年度第４回広島県公募公債	100,000,000	101,021,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	127,093,422	
平成２９年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,300,000	
令和２年度第７回広島県公募公債	390,000,000	385,940,100	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	111,702,000	
第６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,912,000	
第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	99,542,000	
第７回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	228,522,000	
第８回埼玉県公募公債（１５年）	200,000,000	194,882,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	226,928,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	193,582,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,172,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	101,480,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,043,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	100,759,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,356,000	
令和２年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	98,358,000	
令和２年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	98,243,000	
令和３年度第８回埼玉県公募公債	150,000,000	147,109,500	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	111,816,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	111,926,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	105,695,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,838,000	
	100,000,000	106,421,000	

平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）			
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	123,667,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	109,202,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	101,462,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	94,411,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	99,475,000	
令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	296,175,000	
令和３年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	98,428,000	
令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	96,318,000	
第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	225,824,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	113,795,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	113,484,000	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	101,072,000	
平成２５年度第８回千葉県公募公債	300,000,000	303,027,000	
平成２５年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	101,113,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	101,087,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	101,527,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,043,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	120,534,000	
令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	294,972,000	
令和２年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	98,573,000	
令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	300,000,000	296,316,000	
平成３０年度第３回茨城県公募公債	350,000,000	350,087,500	
第１回群馬県公募公債（２０年）	200,000,000	225,090,000	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	100,325,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,092,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,969,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,993,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,530,000	
第１３１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,136,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,540,000	
第１３４回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,457,120	
第１３５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,325,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,259,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,202,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,340,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,132,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,080,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,417,686	

第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,559,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,135,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,059,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,000,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,832,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,740,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,886,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,445,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,740,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,664,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,350,518	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,379,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,000,000	
第２１９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,317,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	100,384,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	228,116,000	
第１５回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	90,667,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	291,105,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	100,774,000	
平成２５年度第８回大阪市公募公債	100,000,000	101,290,000	
令和３年度第２回大阪市公募公債	200,000,000	196,960,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	124,982,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	128,139,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	112,056,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	117,144,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,630,000	
第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	296,061,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	200,892,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	132,172,800	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	226,234,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	114,675,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	113,684,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	90,464,000	
令和３年度第６回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	90,964,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	106,604,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	339,930,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,421,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	100,625,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	100,088,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,502,000	

	第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	221,436,000	
	令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	296,073,000	
	令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	98,478,000	
	平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	106,677,000	
	平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,019,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	112,537,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,390,000	
	第９３回川崎市公募公債	100,000,000	98,209,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,078,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,544,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	100,058,000	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	113,492,000	
	平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	112,052,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	202,462,000	
	平成３０年度第５回福岡市公募公債（５年）	200,000,000	200,048,000	
	平成３０年度第１０回福岡市公募公債（５年）	100,000,000	100,006,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	151,731,000	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,093,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,410,550	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	170,634,100	
	令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	542,250,500	
	令和２年度第３回広島市公募公債（５年）	200,000,000	199,754,000	
	令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	196,648,000	
	平成２５年度第４回福井県公募公債	100,000,000	101,311,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	201,580,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	111,493,000	
地方債証券合計		32,361,680,000	33,429,716,111	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	202,000,000	204,058,380	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	307,383,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,137,000	
	第５２回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,976,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	83,933,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	124,803,000	
	第２７回道路債券	400,000,000	417,696,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	252,814,000	
	第３３回道路債券	200,000,000	256,218,000	

第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,731,000	
第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	139,483,000	
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,301,000	
第４２回道路債券	100,000,000	106,204,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,624,000	
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	132,109,000	
第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,994,000	
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	228,928,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,766,000	
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	124,266,000	
第１１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,748,000	
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,971,000	
第１１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,191,000	
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	115,289,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,919,000	
第１３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,010,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,100,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,239,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,216,000	
第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,316,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	596,166,000	
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	202,054,000	
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	149,685,720	
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	101,060,000	
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	268,649,376	
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	202,328,000	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,449,000	

第２０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	533,000,000	540,014,280	
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	101,224,000	
第２１４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	223,768,000	
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	103,355,580	
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	101,364,000	
第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,314,000	
第２２８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	222,332,000	
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	101,297,000	
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	101,188,000	
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	302,496,000	
第２３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,268,000	
第２４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,864,000	
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	202,158,000	
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	100,417,000	
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	87,833,000	
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	106,756,040	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,481,750	
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	100,340,000	
第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,594,000	
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	100,258,000	
第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	120,379,200	
第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,820,000	
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	297,795,000	
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	214,464,380	
第３８５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,417,000	
第３９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,137,000	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	364,836,000	

第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	106,114,000	
第４回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	100,000,000	100,401,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	379,128,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	104,027,000	
第７回公営企業債券（３０年）	200,000,000	253,406,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	41,648,000	
第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	124,824,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	227,208,000	
第１０回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	222,882,000	
第１１回政府保証地方公共団体金融機構債券（４年）	600,000,000	599,874,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年）	200,000,000	177,356,000	
第１８回公営企業債券（２０年）	100,000,000	110,285,000	
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	228,292,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	113,209,000	
第３４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	500,000,000	565,020,000	
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,079,000	
第５４回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,100,400	
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,392,000	
第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,209,000	
第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,305,000	
第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,588,000	
第６７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,187,000	
第６９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,199,000	
第７６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,996,000	
Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,375,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,270,000	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,942,000	
第８３回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,158,000	
第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,956,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,137,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,800,690	
Ｆ９５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,526,000	
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,316,000	
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,276,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,377,300	
Ｆ１０７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,818,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,357,240	

第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,248,000	
第１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,340,000	
第１２０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,341,000	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,327,000	
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,430,000	
Ｆ２０２回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,030,000	
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,954,000	
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,074,000	
第２９回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,045,000	
第７回阪神高速道路債券	100,000,000	106,059,000	
第１９回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,746,000	
第４回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	113,687,000	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	115,834,000	
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,926,920	
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,318,000	
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,775,300	
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	187,396,440	
第５４回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,951,600	
第８７回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,856,000	
第８８回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,924,000	
第８９回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,943,000	
第１１７回都市再生債券	200,000,000	207,520,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	153,956,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	84,619,000	
第１７１回都市再生債券	200,000,000	180,724,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	105,650,000	
第１６回政府保証民間都市開発債券	180,000,000	181,870,200	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,236,400	
第６２回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,651,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,245,000	10,320,198	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,648,000	10,778,438	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,742,000	10,902,485	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	134,739,000	134,144,801	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	95,042,000	94,686,542	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,702,000	10,847,868	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,619,000	11,849,520	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	169,236,000	168,229,045	

第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,501,000	11,721,589	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	192,255,000	190,791,939	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	68,772,000	68,417,824	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	9,987,000	10,056,409	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,929,000	12,258,717	
第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	230,094,000	228,550,069	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,194,000	10,265,663	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	158,322,000	157,417,981	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,070,000	12,387,441	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,880,000	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,938,000	16,736,015	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,069,000	16,922,263	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,978,000	19,052,904	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,816,000	20,891,414	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,714,000	23,015,102	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,275,000	23,581,206	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,492,000	49,089,508	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,407,000	10,477,975	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,992,000	22,084,423	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,670,000	10,793,238	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,307,000	10,389,868	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,375,000	22,480,087	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,015,000	22,134,679	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,831,000	20,832,465	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,492,000	11,766,314	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,464,000	44,373,181	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,311,000	23,339,760	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,196,000	11,413,090	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,588,000	30,915,613	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,330,000	29,583,035	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,630,000	29,920,354	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,376,000	67,121,636	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,318,000	79,043,315	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,271,000	40,628,205	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,842,000	41,558,393	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,092,000	41,868,476	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,047,000	36,481,123	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,329,000	35,471,812	

第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,865,000	41,669,289	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	172,765,500	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,565,000	108,044,923	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,232,000	146,944,146	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,575,000	41,829,984	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,885,000	43,204,377	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,880,000	44,103,795	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,000,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,922,000	138,707,911	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,395,000	47,505,232	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,682,000	99,325,011	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,295,000	55,377,642	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,033,000	59,005,052	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,478,000	58,728,146	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,620,000	183,178,382	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,492,000	123,403,086	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,204,000	59,493,218	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,181,000	64,586,145	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,494,000	68,838,671	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,109,000	74,576,477	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,747,000	74,039,145	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,046,000	74,656,511	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,502,000	75,432,538	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,026,000	75,823,010	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,872,000	77,597,111	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,273,000	78,074,969	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,125,000	77,709,375	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,131,000	77,709,873	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,840,000	78,442,646	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,830,000	158,656,847	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,103,000	78,648,157	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,548,000	160,958,349	
	80,142,000	79,670,765	

第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,908,000	159,659,353	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,458,000	80,953,774	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,600,000	162,287,928	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,636,000	163,281,045	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,909,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,408,000	83,131,085	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,925,000	82,827,977	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,194,000	82,398,665	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,234,000	168,829,874	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,907,000	84,601,213	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,264,000	84,089,062	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,908,000	170,246,945	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,589,000	85,612,992	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	264,483,000	257,146,241	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,290,000	172,329,425	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,165,000	88,875,640	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,795,000	89,241,497	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,272,000	183,874,679	
第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,267,000	92,924,637	
第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,800,000	186,049,184	
第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,028,000	186,894,438	
第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,657,000	93,337,481	
第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,498,000	188,596,829	
第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,824,000	189,959,470	
第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,517,000	95,473,651	
第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,503,000	95,912,726	

	第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	292,386,000	287,567,478	
	第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,777,000	96,289,811	
	第１７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,349,000	99,256,605	
	第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	94,200,000	
	第３２０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	91,199,000	
	第６４回日本学生支援債券	300,000,000	299,898,000	
	第６５回日本学生支援債券	200,000,000	199,908,000	
	第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	106,184,000	
	第２４回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	600,504,000	
	い第８２３号商工債	200,000,000	200,322,000	
	い第８２９号商工債	200,000,000	200,126,000	
	い第８３２号商工債	200,000,000	199,786,000	
	い第８３３号商工債	100,000,000	99,840,000	
	い第８４３号商工債	200,000,000	199,928,000	
	い第８４７号商工債	100,000,000	99,855,000	
	い第８５０号商工債	200,000,000	199,536,000	
	第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,033,000	
	第３６０回信金中金債（５年）	200,000,000	199,620,000	
	第３７６回信金中金債（５年）	100,000,000	99,729,000	
	第３７９回信金中金債（５年）	100,000,000	99,650,000	
	第３８５回信金中金債（５年）	100,000,000	99,540,000	
	第２５４号商工債（３年）	300,000,000	299,772,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	101,394,000	
	第２１回国際協力機構債券	100,000,000	113,943,000	
	第５３回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,108,000	
	第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,599,000	
	第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,192,000	
	第７３回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	494,205,000	
	第８６回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,633,000	
	第６０回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,880,000	
	第６３回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,888,000	
	第５７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	400,000,000	403,596,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,899,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,914,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	194,936,000	
特殊債券合計		35,352,796,000	36,348,012,167	
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	99,888,000	

第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	298,692,000	
第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,670,000	
第２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	400,000,000	400,900,000	
第８回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,616,000	
第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,169,000	
第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,893,000	
第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,531,000	
第１回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,636,000	
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	400,152,000	
第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,604,000	
第３９回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,624,000	
第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,736,000	
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	199,562,000	
第１１回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,051,000	
第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,803,000	
第２５回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,358,000	
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	100,160,000	
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	199,674,000	
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	100,208,000	
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	199,770,000	
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	101,215,000	
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	198,840,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,053,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,572,000	
第１０回Ｊ．フロント　リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,138,000	
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	99,926,000	
第２５回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,793,000	
第１４回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,936,000	
第１３回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,752,000	
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	99,887,000	

第２５回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	100,051,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,523,000	
第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,038,000	
第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,346,000	
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	200,100,000	
第４０回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,561,000	
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	94,758,000	
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,867,000	
第７回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,686,000	
第４回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,972,000	
第６回株式会社電通無担保社債	200,000,000	198,944,000	
第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	293,910,000	
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	100,061,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	97,429,000	
第１５回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,667,000	
第１９回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	95,460,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,754,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,297,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,882,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,965,000	
第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,479,000	
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,903,000	
第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,012,000	
第８回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,689,000	
第１７回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	106,237,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,677,000	
第１回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,705,000	
第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,972,000	
第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	98,732,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,209,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,732,000	
第２０回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,885,000	
第２１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,860,000	
第２３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,090,000	
第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,685,000	
第１９回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,496,000	

	第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,065,000	
	第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,759,000	
	第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,064,000	
	第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,726,000	
	第２７回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,326,000	
	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	99,977,000	
	第８回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	97,102,000	
	第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,795,000	
	第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	92,995,000	
	第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,290,000	
	第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,056,000	
	第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	114,549,000	
	第７３回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,626,000	
	第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,903,000	
	第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,890,000	
	第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	99,084,000	
	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	115,822,000	
	第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	110,316,000	
	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	101,050,000	
	第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,012,000	
	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	303,108,000	
	第３回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,956,000	
	第４回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
	第９回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,091,000	
	第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,008,000	
	第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,744,000	
	第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,241,000	
	第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,821,000	
	第６４回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,686,000	
	第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,920,000	
	第６７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,825,000	
	第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,911,000	
	第４１回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,401,000	
	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	99,618,000	

第１７回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,507,000	
第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,784,000	
第３２回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,462,000	
第３５回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,307,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,835,000	
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,151,000	
第８０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,912,000	
第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,778,000	
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	200,198,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,056,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	200,062,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,231,000	
第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,852,000	
第３１回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,696,000	
第１回野村ホールディングス株式会社無担保社債	800,000,000	800,136,000	
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	99,452,000	
第７回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	199,472,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,580,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,656,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,720,000	
第１３５回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,176,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,385,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,400,000	
第１０９回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	98,120,000	
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	101,065,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,150,000	
第１２４回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,737,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,006,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,994,000	
第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,644,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,518,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,229,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	88,947,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,445,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,705,000	
	100,000,000	109,813,000	

第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債			
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	226,464,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,456,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,149,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,301,000	
第１４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,919,000	
第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	92,248,000	
第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	94,767,000	
第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	88,917,000	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,425,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	92,749,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,049,000	
第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,695,000	
第７５回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,460,000	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,106,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,149,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,895,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	97,320,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	83,939,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	80,212,000	
第５４回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	91,119,000	
第５６回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	97,378,000	
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	178,884,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,431,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	101,123,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,824,000	
第１１回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	397,780,000	
第３１回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	195,880,000	
第３３回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	97,660,000	
第３６回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	97,065,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,378,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,771,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,658,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	93,189,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,389,000	

第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	201,038,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,078,000	
第５２４回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,245,000	
第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,609,000	
第５３８回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,141,000	
第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,681,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,392,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,894,000	
第４１６回中国電力株式会社社債	200,000,000	198,366,000	
第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,708,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,245,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,102,000	
第３３０回北陸電力株式会社社債	200,000,000	198,028,000	
第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	128,100,420	
第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,856,000	
第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,815,000	
第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,799,000	
第５２１回東北電力株式会社社債	200,000,000	198,146,000	
第５２７回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,702,000	
第５３５回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,472,000	
第３０９回四国電力株式会社社債	100,000,000	98,993,000	
第３１４回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,691,000	
第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,778,000	
第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,529,000	
第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,839,000	
第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	197,468,000	
第４８９回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,920,000	
第４９４回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,402,000	
第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,919,000	
第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,510,000	
第３５０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	97,759,000	
第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,679,000	
第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,272,000	
第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,491,000	
第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,350,000	
第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	201,710,000	
第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,425,000	
第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,313,000	
第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,437,000	
	100,000,000	101,252,000	

	第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債			
	第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,617,000	
	第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,854,000	
	第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	287,514,000	
	第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	91,454,000	
	第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	197,096,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	196,522,000	
	第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	94,106,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	100,887,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	200,142,000	
社債券合計		29,626,000,000	29,525,342,420	
合計			621,348,369,998	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 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

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
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
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）

１．金融商品の状況に関する事項

	2022年 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 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
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

区分	2022年 5月10日現在
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
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

区分	2022年 5月10日現在
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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△15,277,649,112
合計	△15,277,649,112

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 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。

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	8,800	3,225.00	28,380,000	
日本水産	250,700	572.00	143,400,400	
マルハニチロ	38,100	2,428.00	92,506,800	
雪国まいたけ	18,700	1,025.00	19,167,500	
カネコ種苗	7,300	1,762.00	12,862,600	
サカタのタネ	29,700	4,355.00	129,343,500	
ホクト	20,900	2,010.00	42,009,000	
ホクリヨウ	3,500	667.00	2,334,500	
住石ホールディングス	44,900	173.00	7,767,700	
日鉄鉱業	5,600	6,020.00	33,712,000	
三井松島ホールディングス	10,700	1,947.00	20,832,900	
ＩＮＰＥＸ	949,700	1,471.00	1,397,008,700	
石油資源開発	30,200	2,523.00	76,194,600	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	11,100	1,674.00	18,581,400	
ショーボンドホールディングス	34,400	5,410.00	186,104,000	
ミライト・ホールディングス	82,700	1,840.00	152,168,000	
タマホーム	15,600	2,645.00	41,262,000	
サンヨーホームズ	3,000	730.00	2,190,000	
日本アクア	10,200	596.00	6,079,200	
ファーストコーポレーション	6,300	806.00	5,077,800	
ベステラ	5,200	1,192.00	6,198,400	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	42,800	195.00	8,346,000	
キャンディル	4,200	513.00	2,154,600	
ダイセキ環境ソリューション	4,900	999.00	4,895,100	
第一カッター興業	6,100	1,322.00	8,064,200	
安藤・間	124,000	893.00	110,732,000	
東急建設	73,100	595.00	43,494,500	
コムシスホールディングス	82,800	2,722.00	225,381,600	
ビーアールホールディングス	34,100	300.00	10,230,000	
高松コンストラクショングループ	15,000	2,205.00	33,075,000	
東建コーポレーション	7,100	8,630.00	61,273,000	

ソネック	2,600	1,004.00	2,610,400	
ヤマウラ	12,000	924.00	11,088,000	
オリエンタル白石	86,300	233.00	20,107,900	
大成建設	157,100	3,520.00	552,992,000	
大林組	578,800	901.00	521,498,800	
清水建設	540,000	693.00	374,220,000	
飛島建設	15,900	1,017.00	16,170,300	
長谷工コーポレーション	170,700	1,391.00	237,443,700	
松井建設	22,100	631.00	13,945,100	
錢高組	2,400	3,675.00	8,820,000	
鹿島建設	424,100	1,438.00	609,855,800	
不動テトラ	12,600	1,549.00	19,517,400	
大末建設	6,200	1,329.00	8,239,800	
鉄建建設	12,600	1,850.00	23,310,000	
西松建設	35,900	3,800.00	136,420,000	
三井住友建設	133,700	420.00	56,154,000	
大豊建設	8,700	4,465.00	38,845,500	
佐田建設	12,800	445.00	5,696,000	
ナカノフドー建設	14,200	307.00	4,359,400	
奥村組	33,400	3,105.00	103,707,000	
東鉄工業	26,100	2,222.00	57,994,200	
イチケン	4,300	1,777.00	7,641,100	
富士ピー・エス	7,600	475.00	3,610,000	
淺沼組	6,600	5,070.00	33,462,000	
戸田建設	239,900	743.00	178,245,700	
熊谷組	29,300	2,703.00	79,197,900	
北野建設	3,600	2,050.00	7,380,000	
植木組	5,100	1,396.00	7,119,600	
矢作建設工業	25,300	774.00	19,582,200	
ピーエス三菱	19,500	562.00	10,959,000	
日本ハウスホールディングス	40,300	411.00	16,563,300	
大東建託	60,700	11,760.00	713,832,000	
新日本建設	25,200	707.00	17,816,400	
東亜道路工業	3,100	5,040.00	15,624,000	
日本道路	5,200	7,150.00	37,180,000	
東亜建設工業	14,100	2,857.00	40,283,700	
日本国土開発	53,800	542.00	29,159,600	
若築建設	9,600	1,939.00	18,614,400	
東洋建設	66,500	894.00	59,451,000	
五洋建設	229,500	618.00	141,831,000	
世紀東急工業	28,500	739.00	21,061,500	
福田組	6,300	4,615.00	29,074,500	

住友林業	144,400	1,943.00	280,569,200	
日本基礎技術	15,700	731.00	11,476,700	
巴コーポレーション	24,700	465.00	11,485,500	
大和ハウス工業	521,400	3,066.00	1,598,612,400	
ライト工業	34,800	1,874.00	65,215,200	
積水ハウス	616,300	2,223.00	1,370,034,900	
日特建設	12,200	732.00	8,930,400	
北陸電気工事	11,700	738.00	8,634,600	
ユアテック	33,900	681.00	23,085,900	
日本リーテック	12,000	1,063.00	12,756,000	
四電工	6,200	1,723.00	10,682,600	
中電工	26,200	2,115.00	55,413,000	
関電工	96,400	834.00	80,397,600	
きんでん	128,500	1,528.00	196,348,000	
東京エネシス	19,000	927.00	17,613,000	
トーエネック	6,000	3,345.00	20,070,000	
住友電設	14,600	2,314.00	33,784,400	
日本電設工業	30,100	1,625.00	48,912,500	
エクシオグループ	86,900	2,187.00	190,050,300	
新日本空調	14,700	1,813.00	26,651,100	
九電工	43,000	2,874.00	123,582,000	
三機工業	38,500	1,496.00	57,596,000	
日揮ホールディングス	177,600	1,415.00	251,304,000	
中外炉工業	5,800	1,477.00	8,566,600	
ヤマト	16,300	731.00	11,915,300	
太平電業	12,300	2,728.00	33,554,400	
高砂熱学工業	50,900	1,683.00	85,664,700	
三晃金属工業	2,300	2,602.00	5,984,600	
朝日工業社	7,700	1,539.00	11,850,300	
明星工業	34,200	672.00	22,982,400	
大氣社	27,500	3,165.00	87,037,500	
ダイダン	12,500	2,075.00	25,937,500	
日比谷総合設備	18,100	1,872.00	33,883,200	
フィル・カンパニー	3,300	1,103.00	3,639,900	
テスホールディングス	16,500	1,365.00	22,522,500	
インフロニア・ホールディングス	241,400	965.00	232,951,000	
東洋エンジニアリング	24,900	610.00	15,189,000	
レイズネクスト	27,600	1,082.00	29,863,200	
ニップン	52,400	1,699.00	89,027,600	
日清製粉グループ本社	202,500	1,730.00	350,325,000	
日東富士製粉	2,800	4,005.00	11,214,000	
昭和産業	17,000	2,609.00	44,353,000	

鳥越製粉	15,800	641.00	10,127,800	
中部飼料	20,800	991.00	20,612,800	
フィード・ワン	24,100	645.00	15,544,500	
東洋精糖	3,200	975.00	3,120,000	
日本甜菜製糖	9,900	1,652.00	16,354,800	
DM三井製糖ホールディングス	16,600	1,902.00	31,573,200	
塩水港精糖	22,600	207.00	4,678,200	
日新製糖	9,000	1,708.00	15,372,000	
森永製菓	42,400	4,035.00	171,084,000	
中村屋	4,300	3,120.00	13,416,000	
江崎グリコ	49,600	3,630.00	180,048,000	
名糖産業	7,900	1,622.00	12,813,800	
井村屋グループ	10,200	2,285.00	23,307,000	
不二家	10,600	2,380.00	25,228,000	
山崎製パン	133,600	1,697.00	226,719,200	
第一屋製パン	3,700	515.00	1,905,500	
モロゾフ	5,900	3,065.00	18,083,500	
亀田製菓	10,500	4,200.00	44,100,000	
寿スピリッツ	17,700	6,330.00	112,041,000	
カルビー	86,500	2,338.00	202,237,000	
森永乳業	34,100	4,985.00	169,988,500	
六甲バター	13,400	1,488.00	19,939,200	
ヤクルト本社	133,900	6,730.00	901,147,000	
明治ホールディングス	116,100	6,550.00	760,455,000	
雪印メグミルク	44,300	1,911.00	84,657,300	
プリマハム	23,700	2,159.00	51,168,300	
日本ハム	70,500	4,050.00	285,525,000	
林兼産業	5,800	499.00	2,894,200	
丸大食品	18,200	1,497.00	27,245,400	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	17,000	2,946.00	50,082,000	
柿安本店	6,600	2,382.00	15,721,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	122,200	660.00	80,652,000	
サッポロホールディングス	61,700	2,710.00	167,207,000	
アサヒグループホールディングス	426,600	4,712.00	2,010,139,200	
キリンホールディングス	697,400	1,917.00	1,336,915,800	
宝ホールディングス	121,100	1,054.00	127,639,400	
オエノンホールディングス	52,600	301.00	15,832,600	
養命酒製造	5,600	1,720.00	9,632,000	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,200	1,474.00	190,440,800	
サントリー食品インターナショナル	127,000	5,010.00	636,270,000	
ダイドーグループホールディングス	9,700	5,020.00	48,694,000	
伊藤園	57,600	5,470.00	315,072,000	

キーコーヒー	18,200	2,026.00	36,873,200	
ユニカフェ	5,700	915.00	5,215,500	
ジャパンフーズ	2,700	1,140.00	3,078,000	
日清オイリオグループ	23,100	3,075.00	71,032,500	
不二製油グループ本社	41,100	1,860.00	76,446,000	
かどや製油	1,900	3,535.00	6,716,500	
Ｊ－オイルミルズ	17,700	1,603.00	28,373,100	
キッコーマン	129,000	7,200.00	928,800,000	
味の素	399,300	3,013.00	1,203,090,900	
ブルドックソース	7,600	1,850.00	14,060,000	
キユーピー	94,100	2,238.00	210,595,800	
ハウス食品グループ本社	67,000	3,000.00	201,000,000	
カゴメ	72,000	3,210.00	231,120,000	
焼津水産化学工業	8,700	914.00	7,951,800	
アリアケジャパン	17,300	5,100.00	88,230,000	
ピエトロ	2,500	1,751.00	4,377,500	
エバラ食品工業	4,100	2,801.00	11,484,100	
やまみ	1,600	1,637.00	2,619,200	
ニチレイ	81,300	2,366.00	192,355,800	
東洋水産	89,000	4,160.00	370,240,000	
イートアンドホールディングス	7,200	2,182.00	15,710,400	
大冷	2,100	1,878.00	3,943,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,800	517.00	5,066,600	
日清食品ホールディングス	69,300	8,930.00	618,849,000	
永谷園ホールディングス	8,400	1,952.00	16,396,800	
一正蒲鉾	7,900	817.00	6,454,300	
フジッコ	17,600	2,012.00	35,411,200	
ロック・フィールド	19,900	1,398.00	27,820,200	
日本たばこ産業	1,017,400	2,258.50	2,297,797,900	
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,398.00	14,399,400	
わらべや日洋ホールディングス	12,100	1,686.00	20,400,600	
なとり	10,600	1,995.00	21,147,000	
イフジ産業	3,300	1,000.00	3,300,000	
ピックルスコーポレーション	9,100	1,275.00	11,602,500	
ファーマフーズ	23,900	1,629.00	38,933,100	
ユーグレナ	97,100	805.00	78,165,500	
紀文食品	14,700	1,039.00	15,273,300	
ミヨシ油脂	7,100	1,122.00	7,966,200	
理研ビタミン	18,500	1,660.00	30,710,000	
片倉工業	19,500	2,461.00	47,989,500	
グンゼ	11,600	3,785.00	43,906,000	
東洋紡	73,700	1,103.00	81,291,100	

ユニチカ	52,600	274.00	14,412,400	
富士紡ホールディングス	8,200	3,195.00	26,199,000	
倉敷紡績	15,300	1,839.00	28,136,700	
シキボウ	9,700	883.00	8,565,100	
日本毛織	53,000	965.00	51,145,000	
トーア紡コーポレーション	6,800	385.00	2,618,000	
帝国繊維	20,700	1,580.00	32,706,000	
帝人	170,800	1,415.00	241,682,000	
東レ	1,277,700	640.80	818,750,160	
住江織物	3,500	1,945.00	6,807,500	
日本フエルト	11,600	421.00	4,883,600	
イチカワ	2,700	1,398.00	3,774,600	
日東製網	2,000	1,339.00	2,678,000	
アツギ	14,300	516.00	7,378,800	
ダイニック	6,700	707.00	4,736,900	
セーレン	36,900	2,073.00	76,493,700	
ソトー	7,000	830.00	5,810,000	
東海染工	2,300	1,128.00	2,594,400	
小松マテーレ	29,700	1,420.00	42,174,000	
ワコールホールディングス	43,800	1,832.00	80,241,600	
ホギメディカル	24,400	3,190.00	77,836,000	
ＴＳＩホールディングス	60,700	310.00	18,817,000	
マツオカコーポレーション	5,900	1,119.00	6,602,100	
ワールド	24,400	1,350.00	32,940,000	
三陽商会	8,600	821.00	7,060,600	
ナイガイ	7,000	305.00	2,135,000	
オンワードホールディングス	109,000	247.00	26,923,000	
ルックホールディングス	6,000	1,501.00	9,006,000	
ゴールドウイン	32,500	6,370.00	207,025,000	
デサント	34,700	2,235.00	77,554,500	
キング	9,100	509.00	4,631,900	
ヤマトインターナショナル	16,200	283.00	4,584,600	
特種東海製紙	10,800	3,510.00	37,908,000	
王子ホールディングス	754,300	605.00	456,351,500	
日本製紙	84,200	1,056.00	88,915,200	
三菱製紙	25,400	298.00	7,569,200	
北越コーポレーション	117,800	679.00	79,986,200	
中越パルプ工業	7,100	938.00	6,659,800	
巴川製紙所	5,500	759.00	4,174,500	
大王製紙	86,000	1,564.00	134,504,000	
阿波製紙	4,600	327.00	1,504,200	
レンゴー	164,400	793.00	130,369,200	

トーモク	10,600	1,554.00	16,472,400	
ザ・パック	13,200	2,405.00	31,746,000	
北の達人コーポレーション	66,200	179.00	11,849,800	
クラレ	263,900	1,064.00	280,789,600	
旭化成	1,200,100	1,062.00	1,274,506,200	
共和レザー	11,000	666.00	7,326,000	
昭和電工	161,300	2,464.00	397,443,200	
住友化学	1,328,100	574.00	762,329,400	
住友精化	7,900	3,075.00	24,292,500	
日産化学	95,100	7,000.00	665,700,000	
ラサ工業	6,500	1,648.00	10,712,000	
クレハ	14,200	10,000.00	142,000,000	
多木化学	6,800	4,955.00	33,694,000	
テイカ	12,600	1,190.00	14,994,000	
石原産業	31,600	1,028.00	32,484,800	
片倉コープアグリ	4,200	1,262.00	5,300,400	
日本曹達	22,500	3,455.00	77,737,500	
東ソー	254,400	1,833.00	466,315,200	
トクヤマ	57,800	1,813.00	104,791,400	
セントラル硝子	29,400	2,429.00	71,412,600	
東亞合成	98,000	1,044.00	102,312,000	
大阪ソーダ	16,200	3,235.00	52,407,000	
関東電化工業	38,300	958.00	36,691,400	
デンカ	65,800	3,515.00	231,287,000	
信越化学工業	309,800	17,855.00	5,531,479,000	
日本カーバイド工業	6,600	1,371.00	9,048,600	
堺化学工業	12,600	1,871.00	23,574,600	
第一稀元素化学工業	16,700	965.00	16,115,500	
エア・ウォーター	166,300	1,700.00	282,710,000	
日本酸素ホールディングス	169,500	2,312.00	391,884,000	
日本化学工業	5,600	2,325.00	13,020,000	
東邦アセチレン	4,000	1,112.00	4,448,000	
日本パーカライジング	88,200	927.00	81,761,400	
高圧ガス工業	28,300	649.00	18,366,700	
チタン工業	2,100	1,722.00	3,616,200	
四国化成工業	23,000	1,251.00	28,773,000	
戸田工業	3,900	2,440.00	9,516,000	
ステラ　ケミファ	9,300	2,496.00	23,212,800	
保土谷化学工業	5,600	3,725.00	20,860,000	
日本触媒	29,500	5,310.00	156,645,000	
大日精化工業	14,600	1,935.00	28,251,000	
カネカ	45,200	3,480.00	157,296,000	

三菱瓦斯化学	163,400	2,015.00	329,251,000	
三井化学	160,200	3,030.00	485,406,000	
ＪＳＲ	172,500	3,725.00	642,562,500	
東京応化工業	29,200	6,940.00	202,648,000	
大阪有機化学工業	14,900	2,630.00	39,187,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,208,500	810.80	979,851,800	
ＫＨネオケム	29,800	2,573.00	76,675,400	
ダイセル	260,800	793.00	206,814,400	
住友ベークライト	28,100	4,285.00	120,408,500	
積水化学工業	378,300	1,728.00	653,702,400	
日本ゼオン	157,700	1,385.00	218,414,500	
アイカ工業	48,900	3,035.00	148,411,500	
ＵＢＥ	87,300	2,066.00	180,361,800	
積水樹脂	27,100	1,766.00	47,858,600	
タキロンシーアイ	40,100	547.00	21,934,700	
旭有機材	10,500	1,880.00	19,740,000	
ニチバン	10,600	1,710.00	18,126,000	
リケンテクノス	42,700	438.00	18,702,600	
大倉工業	9,000	1,804.00	16,236,000	
積水化成品工業	23,900	424.00	10,133,600	
群栄化学工業	4,100	2,688.00	11,020,800	
タイガースポリマー	9,400	432.00	4,060,800	
ミライアル	5,900	1,649.00	9,729,100	
ダイキアクシス	7,200	720.00	5,184,000	
ダイキョーニシカワ	39,000	514.00	20,046,000	
竹本容器	6,600	788.00	5,200,800	
森六ホールディングス	9,600	1,798.00	17,260,800	
恵和	5,000	4,340.00	21,700,000	
日本化薬	136,800	1,116.00	152,668,800	
カーリットホールディングス	17,400	636.00	11,066,400	
日本精化	13,900	1,934.00	26,882,600	
扶桑化学工業	16,000	3,760.00	60,160,000	
トリケミカル研究所	19,100	2,303.00	43,987,300	
ＡＤＥＫＡ	81,200	2,373.00	192,687,600	
日油	60,000	4,830.00	289,800,000	
新日本理化	29,200	266.00	7,767,200	
ハリマ化成グループ	13,300	781.00	10,387,300	
花王	409,000	5,290.00	2,163,610,000	
第一工業製薬	6,700	2,556.00	17,125,200	
石原ケミカル	9,100	1,265.00	11,511,500	
日華化学	6,200	794.00	4,922,800	
ニイタカ	3,700	2,418.00	8,946,600	

三洋化成工業	11,100	5,060.00	56,166,000	
有機合成薬品工業	12,900	268.00	3,457,200	
大日本塗料	22,100	779.00	17,215,900	
日本ペイントホールディングス	695,700	1,004.00	698,482,800	
関西ペイント	181,400	1,790.00	324,706,000	
神東塗料	14,600	154.00	2,248,400	
中国塗料	42,500	956.00	40,630,000	
日本特殊塗料	12,900	808.00	10,423,200	
藤倉化成	23,000	463.00	10,649,000	
太陽ホールディングス	27,300	3,125.00	85,312,500	
ＤＩＣ	74,500	2,513.00	187,218,500	
サカタインクス	36,700	994.00	36,479,800	
東洋インキＳＣホールディングス	38,000	1,980.00	75,240,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	14,900	815.00	12,143,500	
富士フイルムホールディングス	332,300	7,098.00	2,358,665,400	
資生堂	352,200	5,357.00	1,886,735,400	
ライオン	211,800	1,396.00	295,672,800	
高砂香料工業	12,200	2,613.00	31,878,600	
マンダム	38,700	1,260.00	48,762,000	
ミルボン	23,300	5,150.00	119,995,000	
ファンケル	76,500	2,435.00	186,277,500	
コーセー	35,600	11,860.00	422,216,000	
コタ	13,200	1,415.00	18,678,000	
シーボン	2,500	1,700.00	4,250,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	80,700	1,539.00	124,197,300	
ノエビアホールディングス	15,400	5,130.00	79,002,000	
アジュバンホールディングス	4,200	980.00	4,116,000	
新日本製薬	6,400	1,360.00	8,704,000	
エステー	12,200	1,462.00	17,836,400	
アグロ　カネショウ	6,300	1,149.00	7,238,700	
コニシ	30,300	1,522.00	46,116,600	
長谷川香料	32,600	2,597.00	84,662,200	
星光ＰＭＣ	10,700	565.00	6,045,500	
小林製薬	53,000	8,980.00	475,940,000	
荒川化学工業	15,000	1,023.00	15,345,000	
メック	13,700	2,304.00	31,564,800	
日本高純度化学	4,900	2,291.00	11,225,900	
タカラバイオ	49,500	2,109.00	104,395,500	
ＪＣＵ	20,500	3,395.00	69,597,500	
新田ゼラチン	11,500	620.00	7,130,000	
ＯＡＴアグリオ	7,800	1,121.00	8,743,800	
デクセリアルズ	49,200	2,818.00	138,645,600	

アース製薬	15,600	5,530.00	86,268,000	
北興化学工業	17,000	980.00	16,660,000	
大成ラミック	5,500	2,567.00	14,118,500	
クミアイ化学工業	70,400	901.00	63,430,400	
日本農薬	33,700	615.00	20,725,500	
アキレス	12,100	1,326.00	16,044,600	
有沢製作所	27,000	916.00	24,732,000	
日東電工	114,300	9,060.00	1,035,558,000	
レック	23,900	868.00	20,745,200	
三光合成	21,600	339.00	7,322,400	
きもと	28,900	211.00	6,097,900	
藤森工業	16,200	3,525.00	57,105,000	
前澤化成工業	11,700	1,295.00	15,151,500	
未来工業	6,800	1,449.00	9,853,200	
ウェーブロックホールディングス	7,200	683.00	4,917,600	
ＪＳＰ	11,100	1,475.00	16,372,500	
エフピコ	34,700	2,845.00	98,721,500	
天馬	14,900	2,242.00	33,405,800	
信越ポリマー	33,900	1,050.00	35,595,000	
東リ	45,800	211.00	9,663,800	
ニフコ	63,100	2,739.00	172,830,900	
バルカー	15,400	2,606.00	40,132,400	
ユニ・チャーム	364,400	4,275.00	1,557,810,000	
ショーエイコーポレーション	5,100	580.00	2,958,000	
協和キリン	211,400	2,629.00	555,770,600	
武田薬品工業	1,486,000	3,774.00	5,608,164,000	
アステラス製薬	1,616,400	1,952.00	3,155,212,800	
住友ファーマ	116,800	1,273.00	148,686,400	
塩野義製薬	231,700	7,089.00	1,642,521,300	
わかもと製薬	21,100	267.00	5,633,700	
日本新薬	46,700	8,690.00	405,823,000	
中外製薬	591,300	3,717.00	2,197,862,100	
科研製薬	28,800	3,935.00	113,328,000	
エーザイ	220,500	5,592.00	1,233,036,000	
ロート製薬	94,700	3,390.00	321,033,000	
小野薬品工業	413,500	3,398.00	1,405,073,000	
久光製薬	46,700	3,600.00	168,120,000	
持田製薬	22,800	3,685.00	84,018,000	
参天製薬	345,000	1,094.00	377,430,000	
扶桑薬品工業	6,500	2,107.00	13,695,500	
日本ケミファ	2,200	1,921.00	4,226,200	
ツムラ	57,100	3,255.00	185,860,500	

日医工	57,300	777.00	44,522,100	
キッセイ薬品工業	31,400	2,547.00	79,975,800	
生化学工業	33,300	842.00	28,038,600	
栄研化学	31,500	1,655.00	52,132,500	
日水製薬	6,900	977.00	6,741,300	
鳥居薬品	10,100	3,115.00	31,461,500	
ＪＣＲファーマ	53,300	2,308.00	123,016,400	
東和薬品	27,200	2,756.00	74,963,200	
富士製薬工業	11,100	954.00	10,589,400	
ゼリア新薬工業	32,200	1,980.00	63,756,000	
第一三共	1,447,800	3,288.00	4,760,366,400	
キョーリン製薬ホールディングス	36,700	1,857.00	68,151,900	
大幸薬品	28,500	586.00	16,701,000	
ダイト	12,200	2,665.00	32,513,000	
大塚ホールディングス	382,000	4,441.00	1,696,462,000	
大正製薬ホールディングス	41,600	5,180.00	215,488,000	
ペプチドリーム	99,200	1,898.00	188,281,600	
あすか製薬ホールディングス	20,300	1,153.00	23,405,900	
サワイグループホールディングス	39,700	4,140.00	164,358,000	
日本コークス工業	159,700	134.00	21,399,800	
ニチレキ	22,900	1,233.00	28,235,700	
ユシロ化学工業	9,500	1,023.00	9,718,500	
ビーピー・カストロール	6,700	1,225.00	8,207,500	
富士石油	47,400	265.00	12,561,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	6,300	1,185.00	7,465,500	
出光興産	204,000	3,455.00	704,820,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,844,100	469.90	1,336,442,590	
コスモエネルギーホールディングス	61,400	3,125.00	191,875,000	
横浜ゴム	102,800	1,717.00	176,507,600	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	96,500	1,486.00	143,399,000	
ブリヂストン	530,700	4,738.00	2,514,456,600	
住友ゴム工業	164,700	1,163.00	191,546,100	
藤倉コンポジット	15,100	671.00	10,132,100	
オカモト	10,500	3,960.00	41,580,000	
フコク	8,300	936.00	7,768,800	
ニッタ	19,000	2,856.00	54,264,000	
住友理工	36,600	568.00	20,788,800	
三ツ星ベルト	23,000	2,018.00	46,414,000	
バンドー化学	30,500	860.00	26,230,000	
日東紡績	26,600	2,439.00	64,877,400	
ＡＧＣ	169,100	4,905.00	829,435,500	
日本板硝子	89,000	389.00	34,621,000	

石塚硝子	3,100	1,739.00	5,390,900	
日本山村硝子	7,100	780.00	5,538,000	
日本電気硝子	74,000	2,716.00	200,984,000	
オハラ	7,600	1,098.00	8,344,800	
住友大阪セメント	33,600	3,480.00	116,928,000	
太平洋セメント	107,500	2,109.00	226,717,500	
日本ヒューム	18,000	668.00	12,024,000	
日本コンクリート工業	36,500	308.00	11,242,000	
三谷セキサン	8,500	4,680.00	39,780,000	
アジアパイルホールディングス	28,600	425.00	12,155,000	
東海カーボン	154,200	1,056.00	162,835,200	
日本カーボン	9,800	4,195.00	41,111,000	
東洋炭素	12,000	2,803.00	33,636,000	
ノリタケカンパニーリミテド	10,200	4,230.00	43,146,000	
ＴＯＴＯ	128,200	4,435.00	568,567,000	
日本碍子	198,700	1,788.00	355,275,600	
日本特殊陶業	139,900	2,301.00	321,909,900	
ＭＡＲＵＷＡ	6,500	15,680.00	101,920,000	
品川リフラクトリーズ	4,500	3,635.00	16,357,500	
黒崎播磨	3,200	4,070.00	13,024,000	
ヨータイ	12,100	1,336.00	16,165,600	
東京窯業	22,600	280.00	6,328,000	
ニッカトー	8,500	475.00	4,037,500	
フジミインコーポレーテッド	15,200	5,620.00	85,424,000	
クニミネ工業	6,000	937.00	5,622,000	
エーアンドエーマテリアル	3,200	850.00	2,720,000	
ニチアス	42,500	2,257.00	95,922,500	
ニチハ	25,600	2,334.00	59,750,400	
日本製鉄	818,200	1,938.50	1,586,080,700	
神戸製鋼所	341,400	559.00	190,842,600	
中山製鋼所	28,600	421.00	12,040,600	
合同製鐵	9,800	1,233.00	12,083,400	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	480,900	1,509.00	725,678,100	
東京製鐵	60,700	1,381.00	83,826,700	
共英製鋼	20,300	1,271.00	25,801,300	
大和工業	33,100	4,140.00	137,034,000	
東京鐵鋼	8,100	1,275.00	10,327,500	
大阪製鐵	10,000	1,310.00	13,100,000	
淀川製鋼所	23,200	2,359.00	54,728,800	
丸一鋼管	57,600	2,739.00	157,766,400	
モリ工業	5,200	2,484.00	12,916,800	
大同特殊鋼	28,900	3,550.00	102,595,000	

日本高周波鋼業	7,100	331.00	2,350,100	
日本冶金工業	13,400	2,128.00	28,515,200	
山陽特殊製鋼	18,200	1,957.00	35,617,400	
愛知製鋼	10,500	2,123.00	22,291,500	
日立金属	201,400	2,030.00	408,842,000	
日本金属	4,700	1,147.00	5,390,900	
大平洋金属	11,500	3,200.00	36,800,000	
新日本電工	115,200	306.00	35,251,200	
栗本鐵工所	8,200	1,592.00	13,054,400	
虹技	2,600	907.00	2,358,200	
三菱製鋼	12,100	1,035.00	12,523,500	
日亜鋼業	23,600	258.00	6,088,800	
日本精線	3,100	4,045.00	12,539,500	
エンビプロ・ホールディングス	12,400	902.00	11,184,800	
シンニッタン	22,900	213.00	4,877,700	
新家工業	4,400	1,560.00	6,864,000	
大紀アルミニウム工業所	26,600	1,315.00	34,979,000	
日本軽金属ホールディングス	47,400	1,631.00	77,309,400	
三井金属鉱業	50,500	3,185.00	160,842,500	
東邦亜鉛	10,100	2,630.00	26,563,000	
三菱マテリアル	118,400	1,992.00	235,852,800	
住友金属鉱山	227,600	5,220.00	1,188,072,000	
ＤＯＷＡホールディングス	48,500	5,200.00	252,200,000	
古河機械金属	30,200	1,265.00	38,203,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	21,700	1,180.00	25,606,000	
東邦チタニウム	33,600	1,353.00	45,460,800	
ＵＡＣＪ	27,500	2,108.00	57,970,000	
ＣＫサンエツ	3,800	3,900.00	14,820,000	
古河電気工業	56,800	2,142.00	121,665,600	
住友電気工業	683,600	1,424.50	973,788,200	
フジクラ	208,600	613.00	127,871,800	
昭和電線ホールディングス	16,400	1,685.00	27,634,000	
東京特殊電線	2,700	2,672.00	7,214,400	
タツタ電線	33,200	459.00	15,238,800	
カナレ電気	2,900	1,681.00	4,874,900	
平河ヒューテック	10,500	1,140.00	11,970,000	
リョービ	21,800	1,064.00	23,195,200	
アーレスティ	20,300	348.00	7,064,400	
アサヒホールディングス	74,900	2,080.00	155,792,000	
稲葉製作所	10,200	1,292.00	13,178,400	
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,335.00	18,676,000	
トーカロ	48,200	1,267.00	61,069,400	

アルファＣｏ	7,000	939.00	6,573,000	
ＳＵＭＣＯ	294,600	1,920.00	565,632,000	
川田テクノロジーズ	3,700	3,605.00	13,338,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	6,100	5,890.00	35,929,000	
ジェイテックコーポレーション	2,400	1,655.00	3,972,000	
信和	11,600	792.00	9,187,200	
東洋製罐グループホールディングス	111,100	1,419.00	157,650,900	
ホッカンホールディングス	9,800	1,250.00	12,250,000	
コロナ	9,900	825.00	8,167,500	
横河ブリッジホールディングス	30,300	1,893.00	57,357,900	
駒井ハルテック	3,300	1,882.00	6,210,600	
高田機工	1,700	2,713.00	4,612,100	
三和ホールディングス	176,300	1,174.00	206,976,200	
文化シヤッター	57,900	958.00	55,468,200	
三協立山	23,500	597.00	14,029,500	
アルインコ	13,200	867.00	11,444,400	
東洋シヤッター	4,100	565.00	2,316,500	
ＬＩＸＩＬ	294,300	2,433.00	716,031,900	
日本フイルコン	12,600	504.00	6,350,400	
ノーリツ	33,800	1,500.00	50,700,000	
長府製作所	19,000	1,874.00	35,606,000	
リンナイ	34,300	8,740.00	299,782,000	
ダイニチ工業	8,900	620.00	5,518,000	
日東精工	22,700	496.00	11,259,200	
三洋工業	2,300	1,741.00	4,004,300	
岡部	32,800	651.00	21,352,800	
ジーテクト	22,400	1,277.00	28,604,800	
東プレ	32,800	1,097.00	35,981,600	
高周波熱錬	30,400	580.00	17,632,000	
東京製綱	11,500	832.00	9,568,000	
サンコール	16,000	503.00	8,048,000	
モリテック　スチール	14,600	291.00	4,248,600	
パイオラックス	26,100	1,452.00	37,897,200	
エイチワン	17,800	592.00	10,537,600	
日本発條	167,200	846.00	141,451,200	
中央発條	9,000	685.00	6,165,000	
アドバネクス	2,400	1,739.00	4,173,600	
立川ブラインド工業	7,900	1,042.00	8,231,800	
三益半導体工業	14,600	2,256.00	32,937,600	
日本ドライケミカル	4,600	1,520.00	6,992,000	
日本製鋼所	53,900	2,554.00	137,660,600	
三浦工業	78,500	2,768.00	217,288,000	

タクマ	60,300	1,454.00	87,676,200	
ツガミ	40,300	1,188.00	47,876,400	
オークマ	20,500	4,750.00	97,375,000	
芝浦機械	21,200	2,829.00	59,974,800	
アマダ	295,400	1,019.00	301,012,600	
アイダエンジニアリング	46,500	968.00	45,012,000	
滝澤鉄工所	5,500	1,270.00	6,985,000	
ＦＵＪＩ	82,300	2,131.00	175,381,300	
牧野フライス製作所	20,000	4,120.00	82,400,000	
オーエスジー	85,500	1,633.00	139,621,500	
ダイジェット工業	2,300	942.00	2,166,600	
旭ダイヤモンド工業	48,400	573.00	27,733,200	
DMG森精機	108,600	1,631.00	177,126,600	
ソディック	40,800	736.00	30,028,800	
ディスコ	27,500	31,200.00	858,000,000	
日東工器	9,900	1,511.00	14,958,900	
日進工具	14,800	1,425.00	21,090,000	
パンチ工業	15,900	463.00	7,361,700	
冨士ダイス	9,500	638.00	6,061,000	
豊和工業	9,900	792.00	7,840,800	
ＯＫＫ	6,800	1,245.00	8,466,000	
東洋機械金属	12,300	575.00	7,072,500	
津田駒工業	3,500	571.00	1,998,500	
エンシュウ	4,500	660.00	2,970,000	
島精機製作所	27,500	1,793.00	49,307,500	
オプトラン	23,500	1,809.00	42,511,500	
ＮＣホールディングス	4,400	1,685.00	7,414,000	
イワキポンプ	12,000	1,033.00	12,396,000	
フリュー	16,700	1,022.00	17,067,400	
ヤマシンフィルタ	35,200	343.00	12,073,600	
日阪製作所	21,900	752.00	16,468,800	
やまびこ	34,600	1,379.00	47,713,400	
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,675.00	23,520,000	
平田機工	8,600	4,760.00	40,936,000	
ペガサスミシン製造	19,100	592.00	11,307,200	
マルマエ	7,700	2,083.00	16,039,100	
タツモ	8,800	1,287.00	11,325,600	
ナブテスコ	104,300	2,906.00	303,095,800	
三井海洋開発	19,900	1,193.00	23,740,700	
レオン自動機	20,100	1,103.00	22,170,300	
ＳＭＣ	55,400	61,550.00	3,409,870,000	
ホソカワミクロン	12,900	2,440.00	31,476,000	

ユニオンツール	7,000	3,730.00	26,110,000	
オイレス工業	25,600	1,508.00	38,604,800	
日精エー・エス・ビー機械	6,600	2,966.00	19,575,600	
サトーホールディングス	24,700	1,830.00	45,201,000	
技研製作所	16,600	3,535.00	58,681,000	
日本エアーテック	8,700	1,030.00	8,961,000	
カワタ	5,900	949.00	5,599,100	
日精樹脂工業	12,900	942.00	12,151,800	
オカダアイヨン	6,000	1,494.00	8,964,000	
ワイエイシイホールディングス	7,400	1,411.00	10,441,400	
小松製作所	856,900	3,098.00	2,654,676,200	
住友重機械工業	105,900	2,777.00	294,084,300	
日立建機	75,800	3,030.00	229,674,000	
日工	25,500	614.00	15,657,000	
巴工業	7,300	2,316.00	16,906,800	
井関農機	16,800	1,241.00	20,848,800	
ＴＯＷＡ	16,200	1,948.00	31,557,600	
丸山製作所	3,700	1,536.00	5,683,200	
北川鉄工所	8,300	1,268.00	10,524,400	
ローツェ	9,300	10,150.00	94,395,000	
タカキタ	6,500	582.00	3,783,000	
クボタ	916,000	2,287.50	2,095,350,000	
荏原実業	8,800	2,341.00	20,600,800	
三菱化工機	6,000	1,939.00	11,634,000	
月島機械	33,300	1,039.00	34,598,700	
帝国電機製作所	12,900	1,632.00	21,052,800	
新東工業	39,900	676.00	26,972,400	
澁谷工業	16,100	2,324.00	37,416,400	
アイチ　コーポレーション	27,200	891.00	24,235,200	
小森コーポレーション	47,100	748.00	35,230,800	
鶴見製作所	14,300	1,825.00	26,097,500	
住友精密工業	2,900	2,210.00	6,409,000	
日本ギア工業	7,100	257.00	1,824,700	
酒井重工業	3,300	3,075.00	10,147,500	
荏原製作所	75,700	5,830.00	441,331,000	
石井鐵工所	2,600	2,864.00	7,446,400	
酉島製作所	16,700	1,264.00	21,108,800	
北越工業	17,200	873.00	15,015,600	
ダイキン工業	229,400	19,625.00	4,501,975,000	
オルガノ	5,500	8,720.00	47,960,000	
トーヨーカネツ	7,000	2,399.00	16,793,000	
栗田工業	100,100	4,500.00	450,450,000	

椿本チエイン	24,800	2,981.00	73,928,800	
大同工業	8,400	904.00	7,593,600	
木村化工機	15,600	772.00	12,043,200	
アネスト岩田	29,500	804.00	23,718,000	
ダイフク	99,100	7,520.00	745,232,000	
サムコ	4,900	2,380.00	11,662,000	
加藤製作所	9,300	772.00	7,179,600	
油研工業	3,200	1,689.00	5,404,800	
タダノ	96,600	919.00	88,775,400	
フジテック	64,500	2,595.00	167,377,500	
ＣＫＤ	53,200	1,643.00	87,407,600	
キトー	15,700	1,650.00	25,905,000	
平和	52,800	1,903.00	100,478,400	
理想科学工業	14,700	2,376.00	34,927,200	
ＳＡＮＫＹＯ	40,900	3,765.00	153,988,500	
日本金銭機械	19,300	706.00	13,625,800	
マースグループホールディングス	12,100	1,640.00	19,844,000	
フクシマガリレイ	12,500	3,705.00	46,312,500	
オーイズミ	6,800	457.00	3,107,600	
ダイコク電機	8,800	1,235.00	10,868,000	
竹内製作所	28,800	2,461.00	70,876,800	
アマノ	49,500	2,502.00	123,849,000	
ＪＵＫＩ	26,300	710.00	18,673,000	
ジャノメ	16,200	691.00	11,194,200	
マックス	24,200	1,607.00	38,889,400	
グローリー	47,400	2,150.00	101,910,000	
新晃工業	17,600	1,583.00	27,860,800	
大和冷機工業	27,400	1,099.00	30,112,600	
セガサミーホールディングス	187,600	2,220.00	416,472,000	
日本ピストンリング	7,000	1,309.00	9,163,000	
リケン	7,800	2,418.00	18,860,400	
ＴＰＲ	24,100	1,261.00	30,390,100	
ツバキ・ナカシマ	41,600	886.00	36,857,600	
ホシザキ	55,300	8,040.00	444,612,000	
大豊工業	15,600	634.00	9,890,400	
日本精工	345,300	727.00	251,033,100	
ＮＴＮ	385,500	213.00	82,111,500	
ジェイテクト	174,800	933.00	163,088,400	
不二越	15,100	3,690.00	55,719,000	
日本トムソン	49,100	494.00	24,255,400	
ＴＨＫ	106,700	2,586.00	275,926,200	
ユーシン精機	14,800	628.00	9,294,400	

前澤給装工業	13,600	902.00	12,267,200	
イーグル工業	22,500	1,036.00	23,310,000	
前澤工業	12,300	628.00	7,724,400	
日本ピラー工業	18,200	2,442.00	44,444,400	
キッツ	60,300	665.00	40,099,500	
マキタ	224,700	3,791.00	851,837,700	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	68,300	360.00	24,588,000	
日立造船	156,900	698.00	109,516,200	
三菱重工業	290,500	4,424.00	1,285,172,000	
ＩＨＩ	118,100	2,854.00	337,057,400	
スター精密	27,300	1,477.00	40,322,100	
日清紡ホールディングス	109,100	962.00	104,954,200	
イビデン	96,700	4,570.00	441,919,000	
コニカミノルタ	405,700	490.00	198,793,000	
ブラザー工業	226,300	2,307.00	522,074,100	
ミネベアミツミ	318,000	2,462.00	782,916,000	
日立製作所	909,300	6,448.00	5,863,166,400	
東芝	330,400	5,345.00	1,765,988,000	
三菱電機	1,848,700	1,351.00	2,497,593,700	
富士電機	111,000	5,690.00	631,590,000	
東洋電機製造	6,700	936.00	6,271,200	
安川電機	198,300	4,175.00	827,902,500	
シンフォニアテクノロジー	21,600	1,255.00	27,108,000	
明電舎	30,300	2,288.00	69,326,400	
オリジン	4,600	1,309.00	6,021,400	
山洋電気	8,100	5,450.00	44,145,000	
デンヨー	15,200	1,594.00	24,228,800	
ＰＨＣホールディングス	29,800	1,580.00	47,084,000	
東芝テック	20,300	4,390.00	89,117,000	
芝浦メカトロニクス	3,500	6,920.00	24,220,000	
マブチモーター	44,100	3,470.00	153,027,000	
日本電産	466,800	8,315.00	3,881,442,000	
トレックス・セミコンダクター	9,600	2,226.00	21,369,600	
東光高岳	11,300	1,645.00	18,588,500	
ダイヘン	19,600	3,680.00	72,128,000	
ヤーマン	31,800	1,182.00	37,587,600	
ＪＶＣケンウッド	160,500	201.00	32,260,500	
ミマキエンジニアリング	18,700	691.00	12,921,700	
Ｉ－ＰＥＸ	9,600	1,438.00	13,804,800	
日新電機	44,300	1,355.00	60,026,500	
大崎電気工業	33,700	499.00	16,816,300	
オムロン	157,400	7,085.00	1,115,179,000	

日東工業	23,700	1,542.00	36,545,400	
ＩＤＥＣ	23,400	2,240.00	52,416,000	
正興電機製作所	6,700	1,081.00	7,242,700	
不二電機工業	4,600	1,134.00	5,216,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	60,500	2,258.00	136,609,000	
サクサホールディングス	4,400	1,492.00	6,564,800	
メルコホールディングス	4,900	3,870.00	18,963,000	
テクノメディカ	5,000	1,548.00	7,740,000	
日本電気	234,900	5,350.00	1,256,715,000	
富士通	170,100	19,470.00	3,311,847,000	
沖電気工業	75,100	864.00	64,886,400	
岩崎通信機	7,700	802.00	6,175,400	
電気興業	9,600	2,419.00	23,222,400	
サンケン電気	17,200	4,780.00	82,216,000	
ナカヨ	3,300	1,068.00	3,524,400	
アイホン	10,000	1,738.00	17,380,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,027,800	1,354.00	1,391,641,200	
セイコーエプソン	226,800	1,958.00	444,074,400	
ワコム	147,900	954.00	141,096,600	
アルバック	37,700	4,990.00	188,123,000	
アクセル	8,900	841.00	7,484,900	
ＥＩＺＯ	14,200	3,445.00	48,919,000	
日本信号	45,500	911.00	41,450,500	
京三製作所	39,400	429.00	16,902,600	
能美防災	24,400	1,951.00	47,604,400	
ホーチキ	14,000	1,206.00	16,884,000	
星和電機	10,600	511.00	5,416,600	
エレコム	44,100	1,558.00	68,707,800	
パナソニック　ホールディングス	2,016,500	1,155.50	2,330,065,750	
シャープ	203,600	1,085.00	220,906,000	
アンリツ	121,800	1,487.00	181,116,600	
富士通ゼネラル	51,300	2,166.00	111,115,800	
ソニーグループ	1,184,300	10,500.00	12,435,150,000	
ＴＤＫ	274,100	4,065.00	1,114,216,500	
帝国通信工業	9,200	1,390.00	12,788,000	
タムラ製作所	71,300	544.00	38,787,200	
アルプスアルパイン	164,100	1,326.00	217,596,600	
池上通信機	5,600	602.00	3,371,200	
日本電波工業	19,900	1,117.00	22,228,300	
鈴木	10,900	758.00	8,262,200	
メイコー	20,800	3,365.00	69,992,000	
日本トリム	4,100	2,351.00	9,639,100	

ローランド　ディー．ジー．	11,500	3,210.00	36,915,000	
フォスター電機	18,600	729.00	13,559,400	
ＳＭＫ	4,400	2,162.00	9,512,800	
ヨコオ	14,000	2,534.00	35,476,000	
ホシデン	45,300	1,300.00	58,890,000	
ヒロセ電機	28,400	17,730.00	503,532,000	
日本航空電子工業	41,500	1,884.00	78,186,000	
ＴＯＡ	20,300	792.00	16,077,600	
マクセル	37,600	1,145.00	43,052,000	
古野電気	23,700	973.00	23,060,100	
ユニデンホールディングス	4,100	3,495.00	14,329,500	
スミダコーポレーション	19,100	807.00	15,413,700	
アイコム	6,700	2,463.00	16,502,100	
リオン	7,500	2,394.00	17,955,000	
本多通信工業	17,300	459.00	7,940,700	
横河電機	184,000	2,007.00	369,288,000	
新電元工業	7,100	2,849.00	20,227,900	
アズビル	110,800	3,820.00	423,256,000	
東亜ディーケーケー	10,700	912.00	9,758,400	
日本光電工業	76,800	3,130.00	240,384,000	
チノー	6,000	1,624.00	9,744,000	
共和電業	18,100	341.00	6,172,100	
日本電子材料	9,400	1,858.00	17,465,200	
堀場製作所	34,100	6,240.00	212,784,000	
アドバンテスト	140,600	8,380.00	1,178,228,000	
小野測器	10,000	469.00	4,690,000	
エスペック	15,600	1,724.00	26,894,400	
キーエンス	171,300	50,400.00	8,633,520,000	
日置電機	9,200	7,140.00	65,688,000	
シスメックス	151,900	7,631.00	1,159,148,900	
日本マイクロニクス	32,100	1,461.00	46,898,100	
メガチップス	17,100	3,260.00	55,746,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,600	2,861.00	24,604,600	
澤藤電機	3,100	1,452.00	4,501,200	
原田工業	10,300	921.00	9,486,300	
コーセル	22,500	767.00	17,257,500	
イリソ電子工業	16,300	3,110.00	50,693,000	
オプテックスグループ	31,700	1,633.00	51,766,100	
千代田インテグレ	8,200	2,079.00	17,047,800	
レーザーテック	81,200	17,130.00	1,390,956,000	
スタンレー電気	129,200	2,283.00	294,963,600	
岩崎電気	7,100	2,309.00	16,393,900	

ウシオ電機	95,100	1,685.00	160,243,500	
岡谷電機産業	17,800	273.00	4,859,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	20,300	287.00	5,826,100	
エノモト	6,000	1,530.00	9,180,000	
日本セラミック	18,100	2,323.00	42,046,300	
遠藤照明	10,000	807.00	8,070,000	
古河電池	14,500	1,192.00	17,284,000	
双信電機	11,100	531.00	5,894,100	
山一電機	14,000	1,691.00	23,674,000	
図研	12,700	2,542.00	32,283,400	
日本電子	38,500	5,800.00	223,300,000	
カシオ計算機	126,700	1,341.00	169,904,700	
ファナック	165,900	19,460.00	3,228,414,000	
日本シイエムケイ	38,100	520.00	19,812,000	
エンプラス	5,100	3,475.00	17,722,500	
大真空	25,800	1,106.00	28,534,800	
ローム	82,800	9,290.00	769,212,000	
浜松ホトニクス	132,600	5,690.00	754,494,000	
三井ハイテック	17,900	10,980.00	196,542,000	
新光電気工業	55,700	4,995.00	278,221,500	
京セラ	266,200	6,921.00	1,842,370,200	
太陽誘電	89,400	5,230.00	467,562,000	
村田製作所	542,300	8,250.00	4,473,975,000	
双葉電子工業	34,200	665.00	22,743,000	
北陸電気工業	8,100	1,212.00	9,817,200	
ニチコン	57,500	1,245.00	71,587,500	
日本ケミコン	18,600	1,910.00	35,526,000	
ＫＯＡ	28,500	1,598.00	45,543,000	
市光工業	25,800	372.00	9,597,600	
小糸製作所	100,900	4,625.00	466,662,500	
ミツバ	33,000	348.00	11,484,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	31,800	10,490.00	333,582,000	
キヤノン電子	18,100	1,500.00	27,150,000	
キヤノン	939,500	3,130.00	2,940,635,000	
リコー	499,700	990.00	494,703,000	
象印マホービン	50,600	1,341.00	67,854,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	3,000	2,228.00	6,684,000	
東京エレクトロン	120,000	53,450.00	6,414,000,000	
トヨタ紡織	73,500	2,070.00	152,145,000	
芦森工業	3,600	959.00	3,452,400	
ユニプレス	29,100	762.00	22,174,200	
豊田自動織機	146,700	8,260.00	1,211,742,000	

モリタホールディングス	30,300	1,324.00	40,117,200	
三櫻工業	26,100	703.00	18,348,300	
デンソー	400,900	7,489.00	3,002,340,100	
東海理化電機製作所	49,800	1,362.00	67,827,600	
川崎重工業	134,700	2,253.00	303,479,100	
名村造船所	54,100	345.00	18,664,500	
日本車輌製造	6,600	2,062.00	13,609,200	
三菱ロジスネクスト	25,000	771.00	19,275,000	
近畿車輛	2,800	1,166.00	3,264,800	
日産自動車	2,229,700	507.10	1,130,680,870	
いすゞ自動車	578,100	1,517.00	876,977,700	
トヨタ自動車	9,258,500	2,178.50	20,169,642,250	
日野自動車	236,100	700.00	165,270,000	
三菱自動車工業	699,800	333.00	233,033,400	
エフテック	12,800	537.00	6,873,600	
レシップホールディングス	7,500	558.00	4,185,000	
ＧＭＢ	3,400	709.00	2,410,600	
ファルテック	3,300	633.00	2,088,900	
武蔵精密工業	42,200	1,330.00	56,126,000	
日産車体	27,700	570.00	15,789,000	
新明和工業	52,100	968.00	50,432,800	
極東開発工業	33,400	1,315.00	43,921,000	
トピー工業	15,100	1,052.00	15,885,200	
ティラド	4,600	2,249.00	10,345,400	
曙ブレーキ工業	103,800	150.00	15,570,000	
タチエス	32,400	1,026.00	33,242,400	
ＮＯＫ	84,700	1,152.00	97,574,400	
フタバ産業	45,600	374.00	17,054,400	
ＫＹＢ	18,600	2,856.00	53,121,600	
大同メタル工業	36,300	556.00	20,182,800	
プレス工業	89,100	391.00	34,838,100	
ミクニ	23,300	378.00	8,807,400	
太平洋工業	38,400	980.00	37,632,000	
河西工業	23,200	272.00	6,310,400	
アイシン	138,400	3,780.00	523,152,000	
マツダ	581,000	955.00	554,855,000	
今仙電機製作所	12,400	581.00	7,204,400	
本田技研工業	1,453,300	3,349.00	4,867,101,700	
スズキ	413,200	3,925.00	1,621,810,000	
ＳＵＢＡＲＵ	526,800	1,959.00	1,032,001,200	
安永	8,600	678.00	5,830,800	
ヤマハ発動機	246,700	2,780.00	685,826,000	

ＴＢＫ	20,200	344.00	6,948,800	
エクセディ	28,500	1,683.00	47,965,500	
豊田合成	58,500	1,914.00	111,969,000	
愛三工業	29,600	744.00	22,022,400	
盟和産業	2,700	1,013.00	2,735,100	
日本プラスト	14,400	491.00	7,070,400	
ヨロズ	16,700	740.00	12,358,000	
エフ・シー・シー	30,900	1,360.00	42,024,000	
シマノ	73,800	22,345.00	1,649,061,000	
テイ・エス　テック	79,800	1,404.00	112,039,200	
ジャムコ	11,000	781.00	8,591,000	
テルモ	535,000	3,727.00	1,993,945,000	
クリエートメディック	5,700	975.00	5,557,500	
日機装	53,800	835.00	44,923,000	
日本エム・ディ・エム	10,900	1,504.00	16,393,600	
島津製作所	237,500	4,320.00	1,026,000,000	
ＪＭＳ	15,500	573.00	8,881,500	
長野計器	13,300	1,112.00	14,789,600	
ブイ・テクノロジー	8,300	3,060.00	25,398,000	
東京計器	12,100	1,137.00	13,757,700	
愛知時計電機	7,700	1,431.00	11,018,700	
インターアクション	9,500	1,885.00	17,907,500	
オーバル	17,000	307.00	5,219,000	
東京精密	31,100	4,385.00	136,373,500	
マニー	73,200	1,408.00	103,065,600	
ニコン	281,300	1,440.00	405,072,000	
トプコン	88,900	1,594.00	141,706,600	
オリンパス	966,100	2,214.50	2,139,428,450	
理研計器	14,400	3,835.00	55,224,000	
タムロン	14,200	2,327.00	33,043,400	
ＨＯＹＡ	368,900	12,510.00	4,614,939,000	
シード	8,900	523.00	4,654,700	
ノーリツ鋼機	17,000	2,078.00	35,326,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	21,300	852.00	18,147,600	
朝日インテック	207,300	2,374.00	492,130,200	
シチズン時計	209,200	480.00	100,416,000	
リズム	5,900	1,723.00	10,165,700	
大研医器	15,000	505.00	7,575,000	
メニコン	61,300	2,615.00	160,299,500	
シンシア	2,100	424.00	890,400	
松風	7,400	1,579.00	11,684,600	
セイコーホールディングス	26,700	2,076.00	55,429,200	

ニプロ	137,600	1,013.00	139,388,800	
中本パックス	5,300	1,569.00	8,315,700	
スノーピーク	24,600	2,155.00	53,013,000	
パラマウントベッドホールディングス	36,200	2,115.00	76,563,000	
トランザクション	10,900	984.00	10,725,600	
粧美堂	5,200	422.00	2,194,400	
ニホンフラッシュ	15,700	948.00	14,883,600	
前田工繊	19,600	2,642.00	51,783,200	
永大産業	23,300	272.00	6,337,600	
アートネイチャー	16,200	739.00	11,971,800	
バンダイナムコホールディングス	165,100	8,239.00	1,360,258,900	
アイフィスジャパン	4,800	626.00	3,004,800	
共立印刷	29,700	132.00	3,920,400	
ＳＨＯＥＩ	17,300	4,695.00	81,223,500	
フランスベッドホールディングス	24,300	874.00	21,238,200	
パイロットコーポレーション	30,300	5,120.00	155,136,000	
萩原工業	12,000	1,065.00	12,780,000	
フジシールインターナショナル	43,600	1,750.00	76,300,000	
タカラトミー	78,100	1,146.00	89,502,600	
広済堂ホールディングス	11,700	780.00	9,126,000	
エステールホールディングス	4,400	637.00	2,802,800	
タカノ	6,500	795.00	5,167,500	
プロネクサス	14,600	1,046.00	15,271,600	
ホクシン	13,300	179.00	2,380,700	
ウッドワン	5,800	1,284.00	7,447,200	
大建工業	10,600	2,104.00	22,302,400	
凸版印刷	273,700	2,182.00	597,213,400	
大日本印刷	217,300	2,766.00	601,051,800	
共同印刷	5,200	2,739.00	14,242,800	
ＮＩＳＳＨＡ	36,800	1,491.00	54,868,800	
光村印刷	1,600	1,301.00	2,081,600	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	11,300	1,927.00	21,775,100	
アシックス	159,800	1,877.00	299,944,600	
ツツミ	4,700	1,898.00	8,920,600	
ローランド	13,200	4,235.00	55,902,000	
小松ウオール工業	5,800	1,835.00	10,643,000	
ヤマハ	109,900	4,995.00	548,950,500	
河合楽器製作所	5,100	2,881.00	14,693,100	
クリナップ	17,600	525.00	9,240,000	
ピジョン	114,300	2,124.00	242,773,200	
兼松サステック	1,200	1,739.00	2,086,800	
キングジム	15,700	925.00	14,522,500	

リンテック	39,000	2,416.00	94,224,000	
イトーキ	34,800	358.00	12,458,400	
任天堂	106,700	56,360.00	6,013,612,000	
三菱鉛筆	29,200	1,334.00	38,952,800	
タカラスタンダード	36,200	1,309.00	47,385,800	
コクヨ	88,200	1,744.00	153,820,800	
ナカバヤシ	16,300	488.00	7,954,400	
グローブライド	16,000	2,424.00	38,784,000	
オカムラ	61,000	1,196.00	72,956,000	
美津濃	17,700	2,087.00	36,939,900	
東京電力ホールディングス	1,414,900	519.00	734,333,100	
中部電力	563,600	1,345.00	758,042,000	
関西電力	698,000	1,269.00	885,762,000	
中国電力	287,900	915.00	263,428,500	
北陸電力	168,700	555.00	93,628,500	
東北電力	433,000	775.00	335,575,000	
四国電力	165,900	801.00	132,885,900	
九州電力	380,400	881.00	335,132,400	
北海道電力	164,300	515.00	84,614,500	
沖縄電力	40,100	1,245.00	49,924,500	
電源開発	154,000	1,830.00	281,820,000	
エフオン	11,400	535.00	6,099,000	
イーレックス	26,700	1,830.00	48,861,000	
レノバ	37,100	1,516.00	56,243,600	
東京瓦斯	353,800	2,547.00	901,128,600	
大阪瓦斯	334,300	2,413.00	806,665,900	
東邦瓦斯	82,400	3,160.00	260,384,000	
北海道瓦斯	9,400	1,547.00	14,541,800	
広島ガス	35,100	321.00	11,267,100	
西部ガスホールディングス	20,200	2,056.00	41,531,200	
静岡ガス	47,700	908.00	43,311,600	
メタウォーター	19,600	2,043.00	40,042,800	
ＳＢＳホールディングス	14,000	2,938.00	41,132,000	
東武鉄道	180,600	2,973.00	536,923,800	
相鉄ホールディングス	59,100	2,243.00	132,561,300	
東急	464,600	1,579.00	733,603,400	
京浜急行電鉄	232,000	1,296.00	300,672,000	
小田急電鉄	266,800	1,882.00	502,117,600	
京王電鉄	93,100	4,670.00	434,777,000	
京成電鉄	124,800	3,250.00	405,600,000	
富士急行	21,500	3,835.00	82,452,500	
新京成電鉄	4,400	2,658.00	11,695,200	

東日本旅客鉄道	318,000	6,610.00	2,101,980,000	
西日本旅客鉄道	219,600	4,770.00	1,047,492,000	
東海旅客鉄道	149,100	16,160.00	2,409,456,000	
西武ホールディングス	240,500	1,287.00	309,523,500	
鴻池運輸	29,000	1,146.00	33,234,000	
西日本鉄道	50,100	2,576.00	129,057,600	
ハマキョウレックス	13,000	2,946.00	38,298,000	
サカイ引越センター	8,700	4,590.00	39,933,000	
近鉄グループホールディングス	175,300	3,740.00	655,622,000	
阪急阪神ホールディングス	218,900	3,430.00	750,827,000	
南海電気鉄道	78,200	2,463.00	192,606,600	
京阪ホールディングス	76,400	2,923.00	223,317,200	
神戸電鉄	4,300	3,230.00	13,889,000	
名古屋鉄道	188,600	2,149.00	405,301,400	
山陽電気鉄道	13,400	2,063.00	27,644,200	
アルプス物流	12,500	1,062.00	13,275,000	
ヤマトホールディングス	250,900	2,429.00	609,436,100	
山九	45,900	3,725.00	170,977,500	
丸運	9,600	239.00	2,294,400	
丸全昭和運輸	13,700	3,180.00	43,566,000	
センコーグループホールディングス	89,100	889.00	79,209,900	
トナミホールディングス	4,000	3,575.00	14,300,000	
ニッコンホールディングス	58,800	1,994.00	117,247,200	
日本石油輸送	2,000	2,554.00	5,108,000	
福山通運	27,300	3,815.00	104,149,500	
セイノーホールディングス	113,800	1,095.00	124,611,000	
エスライン	5,200	872.00	4,534,400	
神奈川中央交通	4,400	3,300.00	14,520,000	
日立物流	34,600	8,510.00	294,446,000	
丸和運輸機関	35,300	1,499.00	52,914,700	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	17,100	1,114.00	19,049,400	
九州旅客鉄道	132,300	2,525.00	334,057,500	
ＳＧホールディングス	325,800	2,329.00	758,788,200	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	59,100	7,610.00	449,751,000	
日本郵船	150,000	9,270.00	1,390,500,000	
商船三井	291,300	3,150.00	917,595,000	
川崎汽船	55,100	8,200.00	451,820,000	
ＮＳユナイテッド海運	10,200	3,830.00	39,066,000	
飯野海運	82,800	690.00	57,132,000	
共栄タンカー	5,600	1,128.00	6,316,800	
乾汽船	11,700	1,627.00	19,035,900	
日本航空	402,000	2,134.00	857,868,000	

ＡＮＡホールディングス	445,400	2,402.50	1,070,073,500	
パスコ	3,400	1,299.00	4,416,600	
トランコム	5,000	7,100.00	35,500,000	
日新	13,900	1,620.00	22,518,000	
三菱倉庫	53,400	3,085.00	164,739,000	
三井倉庫ホールディングス	18,500	2,368.00	43,808,000	
住友倉庫	59,000	2,027.00	119,593,000	
澁澤倉庫	10,100	2,237.00	22,593,700	
東陽倉庫	28,500	308.00	8,778,000	
日本トランスシティ	36,800	583.00	21,454,400	
ケイヒン	3,100	1,333.00	4,132,300	
中央倉庫	10,400	948.00	9,859,200	
川西倉庫	3,300	1,127.00	3,719,100	
安田倉庫	13,800	961.00	13,261,800	
ファイズホールディングス	3,800	679.00	2,580,200	
東洋埠頭	5,300	1,417.00	7,510,100	
上組	94,800	2,226.00	211,024,800	
サンリツ	4,800	778.00	3,734,400	
キムラユニティー	4,700	1,440.00	6,768,000	
キユーソー流通システム	8,900	1,075.00	9,567,500	
近鉄エクスプレス	33,800	3,070.00	103,766,000	
東海運	10,200	297.00	3,029,400	
エーアイテイー	11,200	1,518.00	17,001,600	
内外トランスライン	6,900	1,899.00	13,103,100	
日本コンセプト	5,700	1,332.00	7,592,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	61,500	1,801.00	110,761,500	
クロスキャット	10,300	852.00	8,775,600	
システナ	265,100	414.00	109,751,400	
デジタルアーツ	10,000	6,770.00	67,700,000	
日鉄ソリューションズ	28,700	3,715.00	106,620,500	
キューブシステム	9,600	894.00	8,582,400	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	2,700	1,098.00	2,964,600	
コア	8,000	1,380.00	11,040,000	
手間いらず	2,700	4,750.00	12,825,000	
ラクーンホールディングス	15,900	1,396.00	22,196,400	
ソリトンシステムズ	9,400	1,292.00	12,144,800	
ソフトクリエイトホールディングス	8,100	3,755.00	30,415,500	
ＴＩＳ	172,100	2,939.00	505,801,900	
ＪＮＳホールディングス	8,600	393.00	3,379,800	
グリー	84,600	914.00	77,324,400	
GMOペパボ	2,000	1,894.00	3,788,000	
コーエーテクモホールディングス	59,200	4,105.00	243,016,000	

三菱総合研究所	9,700	4,305.00	41,758,500	
電算	2,100	2,207.00	4,634,700	
ＡＧＳ	9,000	754.00	6,786,000	
ファインデックス	15,900	595.00	9,460,500	
ブレインパッド	15,900	1,136.00	18,062,400	
ＫＬａｂ	33,300	427.00	14,219,100	
ポールトゥウィンホールディングス	27,100	1,005.00	27,235,500	
ネクソン	420,100	2,944.00	1,236,774,400	
アイスタイル	49,100	155.00	7,610,500	
エムアップホールディングス	21,600	945.00	20,412,000	
エイチーム	12,600	698.00	8,794,800	
エニグモ	20,400	551.00	11,240,400	
テクノスジャパン	14,800	445.00	6,586,000	
コロプラ	61,300	616.00	37,760,800	
ブロードリーフ	92,500	360.00	33,300,000	
クロス・マーケティンググループ	7,200	858.00	6,177,600	
デジタルハーツホールディングス	8,500	1,651.00	14,033,500	
システム情報	14,100	909.00	12,816,900	
メディアドゥ	6,600	1,686.00	11,127,600	
じげん	53,100	289.00	15,345,900	
ブイキューブ	19,100	1,055.00	20,150,500	
エンカレッジ・テクノロジ	4,400	519.00	2,283,600	
サイバーリンクス	6,400	1,025.00	6,560,000	
フィックスターズ	19,300	742.00	14,320,600	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,600	2,292.00	17,419,200	
オプティム	13,200	802.00	10,586,400	
セレス	7,100	1,327.00	9,421,700	
ＳＨＩＦＴ	10,100	21,350.00	215,635,000	
ティーガイア	16,600	1,711.00	28,402,600	
セック	2,800	2,182.00	6,109,600	
テクマトリックス	31,400	1,594.00	50,051,600	
プロシップ	6,300	1,375.00	8,662,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	48,200	2,576.00	124,163,200	
GMOペイメントゲートウェイ	36,000	9,750.00	351,000,000	
ザッパラス	7,400	417.00	3,085,800	
システムリサーチ	5,500	1,922.00	10,571,000	
インターネットイニシアティブ	49,500	3,925.00	194,287,500	
さくらインターネット	20,200	567.00	11,453,400	
ヴィンクス	5,400	1,097.00	5,923,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,200	5,030.00	21,126,000	
ＳＲＡホールディングス	9,000	2,798.00	25,182,000	
システムインテグレータ	6,200	479.00	2,969,800	

朝日ネット	17,200	572.00	9,838,400	
ｅＢＡＳＥ	22,600	415.00	9,379,000	
アバント	20,000	1,191.00	23,820,000	
アドソル日進	6,700	1,542.00	10,331,400	
ＯＤＫソリューションズ	4,200	602.00	2,528,400	
フリービット	9,800	921.00	9,025,800	
コムチュア	20,900	2,852.00	59,606,800	
サイバーコム	3,000	1,121.00	3,363,000	
アステリア	13,500	880.00	11,880,000	
アイル	9,900	1,307.00	12,939,300	
マークラインズ	9,400	2,499.00	23,490,600	
メディカル・データ・ビジョン	23,700	933.00	22,112,100	
ｇｕｍｉ	26,000	518.00	13,468,000	
ショーケース	4,400	429.00	1,887,600	
モバイルファクトリー	4,400	986.00	4,338,400	
テラスカイ	6,900	1,263.00	8,714,700	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,400	1,158.00	9,727,200	
ＰＣＩホールディングス	8,100	977.00	7,913,700	
パイプドＨＤ	3,500	2,650.00	9,275,000	
アイビーシー	3,300	482.00	1,590,600	
ネオジャパン	5,400	1,158.00	6,253,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	4,000	2,009.00	8,036,000	
ラクス	85,200	1,333.00	113,571,600	
ランドコンピュータ	4,400	900.00	3,960,000	
ダブルスタンダード	5,700	1,762.00	10,043,400	
オープンドア	11,100	1,644.00	18,248,400	
マイネット	6,600	513.00	3,385,800	
アカツキ	8,300	2,885.00	23,945,500	
ベネフィットジャパン	1,500	2,005.00	3,007,500	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,900	2,599.00	12,735,100	
カナミックネットワーク	21,100	489.00	10,317,900	
ノムラシステムコーポレーション	10,400	227.00	2,360,800	
チェンジ	35,800	1,724.00	61,719,200	
シンクロ・フード	10,200	287.00	2,927,400	
オークネット	10,000	1,467.00	14,670,000	
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	723.00	2,747,400	
セグエグループ	5,100	550.00	2,805,000	
エイトレッド	2,700	2,003.00	5,408,100	
マクロミル	39,000	1,097.00	42,783,000	
ビーグリー	4,500	1,341.00	6,034,500	
オロ	5,900	1,832.00	10,808,800	
ユーザーローカル	5,700	1,602.00	9,131,400	

テモナ	4,300	368.00	1,582,400	
ニーズウェル	4,900	678.00	3,322,200	
マネーフォワード	37,700	3,465.00	130,630,500	
サインポスト	6,000	843.00	5,058,000	
電算システムホールディングス	7,700	2,562.00	19,727,400	
ソルクシーズ	16,200	380.00	6,156,000	
フェイス	5,100	723.00	3,687,300	
プロトコーポレーション	19,900	1,032.00	20,536,800	
ハイマックス	5,100	1,269.00	6,471,900	
野村総合研究所	346,600	3,330.00	1,154,178,000	
サイバネットシステム	13,400	797.00	10,679,800	
ＣＥホールディングス	9,900	455.00	4,504,500	
日本システム技術	3,600	2,400.00	8,640,000	
インテージホールディングス	21,500	1,540.00	33,110,000	
東邦システムサイエンス	5,100	895.00	4,564,500	
ソースネクスト	81,000	173.00	14,013,000	
インフォコム	20,400	2,089.00	42,615,600	
シンプレクス・ホールディングス	29,400	1,787.00	52,537,800	
ＨＥＲＯＺ	5,500	881.00	4,845,500	
ラクスル	21,000	2,320.00	48,720,000	
ＩＰＳ	5,200	2,185.00	11,362,000	
ＦＩＧ	20,800	284.00	5,907,200	
システムサポート	6,900	1,022.00	7,051,800	
イーソル	11,600	604.00	7,006,400	
アルテリア・ネットワークス	21,700	1,365.00	29,620,500	
東海ソフト	3,100	932.00	2,889,200	
ウイングアーク１ｓｔ	14,300	1,290.00	18,447,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,300	1,495.00	6,428,500	
サーバーワークス	3,300	1,975.00	6,517,500	
東名	1,800	747.00	1,344,600	
ヴィッツ	1,900	1,172.00	2,226,800	
トビラシステムズ	4,000	752.00	3,008,000	
Ｓａｎｓａｎ	63,700	1,120.00	71,344,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,600	636.00	2,289,600	
ギフティ	16,500	911.00	15,031,500	
ベース	3,200	5,950.00	19,040,000	
ＪＭＤＣ	23,200	5,310.00	123,192,000	
フォーカスシステムズ	12,300	891.00	10,959,300	
クレスコ	13,600	1,862.00	25,323,200	
フジ・メディア・ホールディングス	174,300	1,137.00	198,179,100	
オービック	58,500	18,240.00	1,067,040,000	
ジャストシステム	26,400	5,350.00	141,240,000	

ＴＤＣソフト	15,900	1,135.00	18,046,500	
Ｚホールディングス	2,675,600	436.40	1,167,631,840	
トレンドマイクロ	96,400	7,200.00	694,080,000	
ＩＤホールディングス	11,900	830.00	9,877,000	
日本オラクル	30,100	8,460.00	254,646,000	
アルファシステムズ	5,000	3,720.00	18,600,000	
フューチャー	39,300	1,719.00	67,556,700	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10,600	1,357.00	14,384,200	
ＳＢテクノロジー	8,100	2,057.00	16,661,700	
トーセ	5,100	715.00	3,646,500	
オービックビジネスコンサルタント	17,700	4,360.00	77,172,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	84,600	3,005.00	254,223,000	
アイティフォー	22,700	798.00	18,114,600	
東計電算	2,200	5,710.00	12,562,000	
エックスネット	3,100	998.00	3,093,800	
大塚商会	100,400	4,135.00	415,154,000	
サイボウズ	24,900	1,214.00	30,228,600	
電通国際情報サービス	25,600	3,865.00	98,944,000	
ＡＣＣＥＳＳ	21,300	562.00	11,970,600	
デジタルガレージ	30,700	4,105.00	126,023,500	
ＥＭシステムズ	30,800	945.00	29,106,000	
ウェザーニューズ	6,100	6,360.00	38,796,000	
ＣＩＪ	14,600	748.00	10,920,800	
ビジネスエンジニアリング	2,200	3,915.00	8,613,000	
日本エンタープライズ	20,000	164.00	3,280,000	
ＷＯＷＯＷ	8,600	1,551.00	13,338,600	
スカラ	15,800	749.00	11,834,200	
インテリジェント　ウェイブ	9,600	582.00	5,587,200	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	15,200	648.00	9,849,600	
ネットワンシステムズ	68,500	2,958.00	202,623,000	
システムソフト	46,700	101.00	4,716,700	
アルゴグラフィックス	14,500	2,984.00	43,268,000	
マーベラス	29,500	753.00	22,213,500	
エイベックス	32,100	1,354.00	43,463,400	
ＢＩＰＲＯＧＹ	58,000	2,860.00	165,880,000	
兼松エレクトロニクス	10,100	3,785.00	38,228,500	
都築電気	9,200	1,466.00	13,487,200	
ＴＢＳホールディングス	104,200	1,761.00	183,496,200	
日本テレビホールディングス	155,000	1,269.00	196,695,000	
朝日放送グループホールディングス	17,500	709.00	12,407,500	
テレビ朝日ホールディングス	44,700	1,509.00	67,452,300	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	157,600	468.00	73,756,800	

テレビ東京ホールディングス	12,600	2,005.00	25,263,000	
日本ＢＳ放送	6,500	1,018.00	6,617,000	
ビジョン	30,900	1,229.00	37,976,100	
スマートバリュー	4,600	555.00	2,553,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	16,600	2,046.00	33,963,600	
ワイヤレスゲート	8,200	295.00	2,419,000	
コネクシオ	13,300	1,448.00	19,258,400	
クロップス	3,600	989.00	3,560,400	
日本電信電話	1,986,900	3,851.00	7,651,551,900	
ＫＤＤＩ	1,352,500	4,343.00	5,873,907,500	
ソフトバンク	2,810,000	1,512.00	4,248,720,000	
光通信	21,400	14,970.00	320,358,000	
エムティーアイ	17,200	446.00	7,671,200	
GMOインターネット	65,100	2,409.00	156,825,900	
ファイバーゲート	8,600	1,182.00	10,165,200	
アイドママーケティングコミュニケーション	4,600	284.00	1,306,400	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	100,900	3,080.00	310,772,000	
学研ホールディングス	26,400	868.00	22,915,200	
ゼンリン	30,500	916.00	27,938,000	
昭文社ホールディングス	7,900	404.00	3,191,600	
インプレスホールディングス	15,400	225.00	3,465,000	
アイネット	9,400	1,233.00	11,590,200	
松竹	11,700	12,760.00	149,292,000	
東宝	109,500	4,800.00	525,600,000	
東映	5,800	17,120.00	99,296,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	494,000	2,265.00	1,118,910,000	
ピー・シー・エー	11,000	1,280.00	14,080,000	
ビジネスブレイン太田昭和	5,600	1,505.00	8,428,000	
ＤＴＳ	34,600	2,966.00	102,623,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	86,300	5,280.00	455,664,000	
シーイーシー	20,000	1,210.00	24,200,000	
カプコン	175,000	3,325.00	581,875,000	
アイ・エス・ビー	8,800	1,010.00	8,888,000	
ジャステック	10,900	1,130.00	12,317,000	
ＳＣＳＫ	128,500	2,157.00	277,174,500	
日本システムウエア	7,100	2,292.00	16,273,200	
アイネス	17,400	1,470.00	25,578,000	
ＴＫＣ	30,400	3,560.00	108,224,000	
富士ソフト	19,200	6,850.00	131,520,000	
ＮＳＤ	58,200	2,311.00	134,500,200	
コナミホールディングス	67,400	7,570.00	510,218,000	
福井コンピュータホールディングス	8,600	3,230.00	27,778,000	

ＪＢＣＣホールディングス	12,600	1,491.00	18,786,600	
ミロク情報サービス	16,500	1,284.00	21,186,000	
ソフトバンクグループ	1,112,500	4,900.00	5,451,250,000	
高千穂交易	7,000	1,512.00	10,584,000	
オルバヘルスケアホールディングス	3,100	1,703.00	5,279,300	
伊藤忠食品	4,200	4,815.00	20,223,000	
エレマテック	14,900	1,180.00	17,582,000	
あらた	14,500	3,705.00	53,722,500	
トーメンデバイス	2,800	5,670.00	15,876,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,500	5,580.00	30,690,000	
フィールズ	16,300	856.00	13,952,800	
双日	200,800	1,975.00	396,580,000	
アルフレッサ　ホールディングス	202,400	1,820.00	368,368,000	
横浜冷凍	49,900	860.00	42,914,000	
ラサ商事	9,000	977.00	8,793,000	
アルコニックス	23,300	1,361.00	31,711,300	
神戸物産	139,200	2,910.00	405,072,000	
ハイパー	4,700	469.00	2,204,300	
あい　ホールディングス	26,600	1,662.00	44,209,200	
ディーブイエックス	6,400	1,012.00	6,476,800	
ダイワボウホールディングス	86,700	1,661.00	144,008,700	
マクニカ・富士エレホールディングス	44,400	2,753.00	122,233,200	
ラクト・ジャパン	6,400	2,008.00	12,851,200	
グリムス	8,300	1,597.00	13,255,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,500	739.00	23,278,500	
八洲電機	13,500	939.00	12,676,500	
メディアスホールディングス	10,700	963.00	10,304,100	
レスターホールディングス	17,700	2,028.00	35,895,600	
ジューテックホールディングス	4,100	1,047.00	4,292,700	
大光	8,000	713.00	5,704,000	
ＯＣＨＩホールディングス	5,000	1,227.00	6,135,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	90,200	885.00	79,827,000	
黒谷	5,100	576.00	2,937,600	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,300	728.00	2,402,400	
三洋貿易	18,200	964.00	17,544,800	
ビューティガレージ	3,000	2,624.00	7,872,000	
ウイン・パートナーズ	13,500	990.00	13,365,000	
ミタチ産業	4,700	874.00	4,107,800	
シップヘルスケアホールディングス	57,700	2,117.00	122,150,900	
明治電機工業	6,000	1,029.00	6,174,000	
デリカフーズホールディングス	7,300	526.00	3,839,800	
スターティアホールディングス	4,300	530.00	2,279,000	

コメダホールディングス	40,700	2,242.00	91,249,400	
ピーバンドットコム	2,700	550.00	1,485,000	
アセンテック	6,400	693.00	4,435,200	
富士興産	4,700	896.00	4,211,200	
協栄産業	1,900	1,293.00	2,456,700	
フルサト・マルカホールディングス	17,400	3,470.00	60,378,000	
ヤマエグループホールディングス	11,900	1,046.00	12,447,400	
小野建	17,600	1,494.00	26,294,400	
南陽	3,700	1,800.00	6,660,000	
佐鳥電機	11,600	1,272.00	14,755,200	
エコートレーディング	4,000	570.00	2,280,000	
伯東	11,400	2,888.00	32,923,200	
コンドーテック	14,000	1,090.00	15,260,000	
中山福	9,900	346.00	3,425,400	
ナガイレーベン	24,000	1,921.00	46,104,000	
三菱食品	17,900	3,060.00	54,774,000	
松田産業	13,600	2,210.00	30,056,000	
第一興商	35,400	3,575.00	126,555,000	
メディパルホールディングス	191,400	2,224.00	425,673,600	
ＳＰＫ	7,400	1,304.00	9,649,600	
萩原電気ホールディングス	6,700	1,895.00	12,696,500	
アズワン	26,700	6,400.00	170,880,000	
スズデン	6,300	1,965.00	12,379,500	
尾家産業	4,800	889.00	4,267,200	
シモジマ	11,400	913.00	10,408,200	
ドウシシャ	17,600	1,550.00	27,280,000	
小津産業	4,100	2,001.00	8,204,100	
高速	10,700	1,540.00	16,478,000	
たけびし	6,800	1,445.00	9,826,000	
リックス	4,100	1,584.00	6,494,400	
丸文	16,000	677.00	10,832,000	
ハピネット	15,100	1,512.00	22,831,200	
橋本総業ホールディングス	3,600	1,979.00	7,124,400	
日本ライフライン	55,200	1,051.00	58,015,200	
タカショー	14,300	701.00	10,024,300	
ＩＤＯＭ	56,500	664.00	37,516,000	
進和	11,000	2,003.00	22,033,000	
エスケイジャパン	4,600	432.00	1,987,200	
ダイトロン	7,700	2,006.00	15,446,200	
シークス	25,700	996.00	25,597,200	
田中商事	5,800	601.00	3,485,800	
オーハシテクニカ	9,700	1,268.00	12,299,600	

白銅	6,000	2,426.00	14,556,000	
ダイコー通産	2,200	1,283.00	2,822,600	
伊藤忠商事	1,240,400	3,693.00	4,580,797,200	
丸紅	1,768,800	1,285.00	2,272,908,000	
高島	2,700	2,286.00	6,172,200	
長瀬産業	94,700	1,881.00	178,130,700	
蝶理	10,400	1,907.00	19,832,800	
豊田通商	180,100	4,395.00	791,539,500	
三共生興	23,900	537.00	12,834,300	
兼松	67,800	1,352.00	91,665,600	
ツカモトコーポレーション	3,100	1,213.00	3,760,300	
三井物産	1,414,000	3,148.00	4,451,272,000	
日本紙パルプ商事	9,400	3,810.00	35,814,000	
カメイ	21,400	1,044.00	22,341,600	
東都水産	1,000	4,465.00	4,465,000	
ＯＵＧホールディングス	2,700	2,651.00	7,157,700	
スターゼン	13,400	1,950.00	26,130,000	
山善	74,600	956.00	71,317,600	
椿本興業	3,600	3,675.00	13,230,000	
住友商事	1,150,900	1,868.00	2,149,881,200	
内田洋行	7,800	4,805.00	37,479,000	
三菱商事	1,337,200	4,127.00	5,518,624,400	
第一実業	8,000	3,645.00	29,160,000	
キヤノンマーケティングジャパン	46,200	3,045.00	140,679,000	
西華産業	8,900	1,570.00	13,973,000	
佐藤商事	14,500	1,146.00	16,617,000	
菱洋エレクトロ	11,000	2,098.00	23,078,000	
東京産業	16,300	697.00	11,361,100	
ユアサ商事	16,800	2,840.00	47,712,000	
神鋼商事	4,200	3,615.00	15,183,000	
トルク	10,100	200.00	2,020,000	
阪和興業	35,600	3,105.00	110,538,000	
正栄食品工業	12,100	3,950.00	47,795,000	
カナデン	15,200	924.00	14,044,800	
菱電商事	14,800	1,680.00	24,864,000	
岩谷産業	43,600	5,120.00	223,232,000	
ナイス	6,200	1,886.00	11,693,200	
ニチモウ	2,500	2,574.00	6,435,000	
極東貿易	5,400	2,190.00	11,826,000	
アステナホールディングス	25,600	437.00	11,187,200	
三愛オブリ	44,500	947.00	42,141,500	
稲畑産業	39,300	2,087.00	82,019,100	

ＧＳＩクレオス	8,900	1,214.00	10,804,600	
明和産業	17,200	720.00	12,384,000	
クワザワホールディングス	7,200	492.00	3,542,400	
ワキタ	37,700	1,076.00	40,565,200	
東邦ホールディングス	56,700	2,152.00	122,018,400	
サンゲツ	47,500	1,567.00	74,432,500	
ミツウロコグループホールディングス	25,000	983.00	24,575,000	
シナネンホールディングス	6,700	3,205.00	21,473,500	
伊藤忠エネクス	41,200	1,079.00	44,454,800	
サンリオ	55,800	2,544.00	141,955,200	
サンワテクノス	10,700	1,340.00	14,338,000	
リョーサン	20,100	2,369.00	47,616,900	
新光商事	26,800	938.00	25,138,400	
トーホー	8,000	1,111.00	8,888,000	
三信電気	8,300	1,510.00	12,533,000	
東陽テクニカ	18,400	1,044.00	19,209,600	
モスフードサービス	24,400	3,015.00	73,566,000	
加賀電子	16,300	3,115.00	50,774,500	
ソーダニッカ	17,400	638.00	11,101,200	
立花エレテック	13,600	1,624.00	22,086,400	
フォーバル	7,600	805.00	6,118,000	
ＰＡＬＴＡＣ	26,100	4,695.00	122,539,500	
三谷産業	29,100	314.00	9,137,400	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4,200	2,562.00	10,760,400	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	2,041.00	3,469,700	
コーア商事ホールディングス	11,700	848.00	9,921,600	
国際紙パルプ商事	37,400	295.00	11,033,000	
ヤマタネ	8,500	1,659.00	14,101,500	
丸紅建材リース	1,600	1,750.00	2,800,000	
日鉄物産	12,700	5,150.00	65,405,000	
泉州電業	4,900	4,820.00	23,618,000	
トラスコ中山	38,800	1,950.00	75,660,000	
オートバックスセブン	61,000	1,400.00	85,400,000	
モリト	13,600	754.00	10,254,400	
加藤産業	24,600	3,330.00	81,918,000	
北恵	4,700	886.00	4,164,200	
イノテック	11,300	1,358.00	15,345,400	
イエローハット	31,300	1,667.00	52,177,100	
ＪＫホールディングス	14,400	1,022.00	14,716,800	
日伝	14,500	2,137.00	30,986,500	
北沢産業	12,000	221.00	2,652,000	
杉本商事	8,700	2,131.00	18,539,700	

因幡電機産業	48,600	2,580.00	125,388,000	
東テク	6,000	2,605.00	15,630,000	
ミスミグループ本社	233,800	2,847.00	665,628,600	
アルテック	12,300	248.00	3,050,400	
タキヒヨー	5,400	1,043.00	5,632,200	
蔵王産業	3,600	1,939.00	6,980,400	
スズケン	70,800	3,920.00	277,536,000	
ジェコス	12,900	791.00	10,203,900	
グローセル	21,300	408.00	8,690,400	
ローソン	41,200	4,965.00	204,558,000	
サンエー	13,700	4,095.00	56,101,500	
カワチ薬品	14,600	2,067.00	30,178,200	
エービーシー・マート	29,100	5,480.00	159,468,000	
ハードオフコーポレーション	8,600	816.00	7,017,600	
アスクル	42,300	1,518.00	64,211,400	
ゲオホールディングス	24,300	1,283.00	31,176,900	
アダストリア	20,200	2,217.00	44,783,400	
くら寿司	19,500	3,090.00	60,255,000	
キャンドゥ	7,000	2,355.00	16,485,000	
アイケイ	6,400	552.00	3,532,800	
パルグループホールディングス	16,500	1,504.00	24,816,000	
エディオン	85,800	1,222.00	104,847,600	
サーラコーポレーション	38,300	621.00	23,784,300	
ワッツ	9,400	720.00	6,768,000	
ハローズ	8,600	3,140.00	27,004,000	
フジオフードグループ本社	15,100	1,316.00	19,871,600	
あみやき亭	4,500	2,905.00	13,072,500	
大黒天物産	6,000	4,865.00	29,190,000	
ハニーズホールディングス	16,100	1,087.00	17,500,700	
ファーマライズホールディングス	4,800	724.00	3,475,200	
アルペン	14,000	1,932.00	27,048,000	
ハブ	6,600	482.00	3,181,200	
クオールホールディングス	23,100	1,080.00	24,948,000	
ジンズホールディングス	11,800	4,210.00	49,678,000	
ビックカメラ	110,700	1,128.00	124,869,600	
ＤＣＭホールディングス	115,200	1,097.00	126,374,400	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	235,500	2,019.00	475,474,500	
東京一番フーズ	5,100	595.00	3,034,500	
きちりホールディングス	5,000	369.00	1,845,000	
アークランドサービスホールディングス	13,700	2,054.00	28,139,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	217,400	990.00	215,226,000	
ドトール・日レスホールディングス	31,500	1,506.00	47,439,000	

マツキヨココカラ&カンパニー	112,800	4,260.00	480,528,000	
ブロンコビリー	10,500	2,282.00	23,961,000	
ＺＯＺＯ	128,200	2,684.00	344,088,800	
トレジャー・ファクトリー	5,800	958.00	5,556,400	
物語コーポレーション	9,300	5,160.00	47,988,000	
三越伊勢丹ホールディングス	310,800	978.00	303,962,400	
Ｈａｍｅｅ	7,000	1,050.00	7,350,000	
マーケットエンタープライズ	2,300	737.00	1,695,100	
ウエルシアホールディングス	98,600	2,594.00	255,768,400	
クリエイトＳＤホールディングス	27,600	2,940.00	81,144,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	21,700	378.00	8,202,600	
ミサワ	4,300	608.00	2,614,400	
ティーライフ	2,700	1,413.00	3,815,100	
チムニー	5,700	1,135.00	6,469,500	
シュッピン	15,700	1,093.00	17,160,100	
オイシックス・ラ・大地	26,900	2,467.00	66,362,300	
ネクステージ	37,900	1,915.00	72,578,500	
ジョイフル本田	56,200	1,588.00	89,245,600	
鳥貴族ホールディングス	6,800	1,726.00	11,736,800	
ホットランド	14,200	1,360.00	19,312,000	
すかいらーくホールディングス	236,100	1,524.00	359,816,400	
ＳＦＰホールディングス	9,100	1,379.00	12,548,900	
綿半ホールディングス	13,900	1,321.00	18,361,900	
ヨシックスホールディングス	3,800	2,002.00	7,607,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	54,400	1,092.00	59,404,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	10,000	945.00	9,450,000	
ＢＥＥＮＯＳ	9,600	1,375.00	13,200,000	
あさひ	15,700	1,330.00	20,881,000	
日本調剤	11,600	1,191.00	13,815,600	
コスモス薬品	18,800	11,870.00	223,156,000	
トーエル	9,100	825.00	7,507,500	
セブン&アイ・ホールディングス	693,800	5,705.00	3,958,129,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	107,700	805.00	86,698,500	
ツルハホールディングス	40,700	6,730.00	273,911,000	
サンマルクホールディングス	14,900	1,492.00	22,230,800	
フェリシモ	4,400	1,184.00	5,209,600	
トリドールホールディングス	46,400	2,239.00	103,889,600	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	18,100	310.00	5,611,000	
ウイルプラスホールディングス	3,800	921.00	3,499,800	
ＪＭホールディングス	13,300	1,628.00	21,652,400	
サツドラホールディングス	8,800	659.00	5,799,200	

アレンザホールディングス	13,900	989.00	13,747,100	
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,657.00	8,616,400	
バロックジャパンリミテッド	13,300	783.00	10,413,900	
クスリのアオキホールディングス	18,000	5,420.00	97,560,000	
力の源ホールディングス	9,500	579.00	5,500,500	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	104,600	3,180.00	332,628,000	
メディカルシステムネットワーク	18,000	432.00	7,776,000	
はるやまホールディングス	9,400	453.00	4,258,200	
ノジマ	30,200	2,936.00	88,667,200	
カッパ・クリエイト	26,100	1,327.00	34,634,700	
ライトオン	13,900	701.00	9,743,900	
良品計画	214,500	1,264.00	271,128,000	
パリミキホールディングス	24,300	262.00	6,366,600	
アドヴァングループ	18,300	779.00	14,255,700	
アルビス	5,900	2,229.00	13,151,100	
コナカ	21,300	332.00	7,071,600	
ハウス　オブ　ローゼ	2,500	1,662.00	4,155,000	
Ｇ－７ホールディングス	20,900	1,556.00	32,520,400	
イオン北海道	30,200	1,023.00	30,894,600	
コジマ	32,500	609.00	19,792,500	
ヒマラヤ	6,600	915.00	6,039,000	
コーナン商事	26,600	3,700.00	98,420,000	
エコス	6,800	2,000.00	13,600,000	
ワタミ	22,500	895.00	20,137,500	
マルシェ	6,000	462.00	2,772,000	
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	372,400	2,002.00	745,544,800	
西松屋チェーン	39,700	1,553.00	61,654,100	
ゼンショーホールディングス	91,000	2,938.00	267,358,000	
幸楽苑ホールディングス	11,500	1,246.00	14,329,000	
ハークスレイ	8,400	458.00	3,847,200	
サイゼリヤ	27,800	2,310.00	64,218,000	
ＶＴホールディングス	70,800	457.00	32,355,600	
魚力	5,300	2,189.00	11,601,700	
フジ・コーポレーション	10,100	1,130.00	11,413,000	
ユナイテッドアローズ	19,700	1,843.00	36,307,100	
ハイデイ日高	27,000	1,904.00	51,408,000	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	12,500	204.00	2,550,000	
コロワイド	76,500	1,615.00	123,547,500	
ピーシーデポコーポレーション	22,700	313.00	7,105,100	
壱番屋	13,200	4,870.00	64,284,000	

ＰＬＡＮＴ	5,100	671.00	3,422,100	
スギホールディングス	37,200	5,280.00	196,416,000	
薬王堂ホールディングス	9,500	1,875.00	17,812,500	
スクロール	29,100	844.00	24,560,400	
ヨンドシーホールディングス	16,900	1,716.00	29,000,400	
木曽路	25,400	2,079.00	52,806,600	
ＳＲＳホールディングス	26,700	813.00	21,707,100	
千趣会	34,400	393.00	13,519,200	
リテールパートナーズ	28,600	1,145.00	32,747,000	
ケーヨー	34,600	958.00	33,146,800	
上新電機	20,400	1,902.00	38,800,800	
日本瓦斯	90,700	1,881.00	170,606,700	
ロイヤルホールディングス	32,600	2,029.00	66,145,400	
いなげや	21,700	1,324.00	28,730,800	
チヨダ	17,900	706.00	12,637,400	
ライフコーポレーション	16,500	2,866.00	47,289,000	
リンガーハット	22,400	2,191.00	49,078,400	
ＭｒＭａｘＨＤ	23,800	607.00	14,446,600	
ＡＯＫＩホールディングス	36,600	626.00	22,911,600	
オークワ	28,500	883.00	25,165,500	
コメリ	28,900	2,826.00	81,671,400	
青山商事	38,000	705.00	26,790,000	
しまむら	21,700	11,660.00	253,022,000	
はせがわ	11,100	265.00	2,941,500	
高島屋	132,300	1,218.00	161,141,400	
松屋	35,700	776.00	27,703,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	86,000	873.00	75,078,000	
近鉄百貨店	6,700	2,521.00	16,890,700	
丸井グループ	143,000	2,234.00	319,462,000	
アクシアル　リテイリング	13,800	3,065.00	42,297,000	
イオン	682,500	2,387.00	1,629,127,500	
イズミ	32,300	2,816.00	90,956,800	
平和堂	33,300	1,957.00	65,168,100	
フジ	47,700	2,369.00	113,001,300	
ヤオコー	21,200	6,860.00	145,432,000	
ゼビオホールディングス	25,700	924.00	23,746,800	
ケーズホールディングス	167,600	1,384.00	231,958,400	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	9,700	644.00	6,246,800	
日産東京販売ホールディングス	28,900	220.00	6,358,000	
シルバーライフ	4,000	1,351.00	5,404,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	8,300	3,145.00	26,103,500	
ナルミヤ・インターナショナル	4,500	846.00	3,807,000	

ブックオフグループホールディングス	10,900	1,019.00	11,107,100	
ギフトホールディングス	3,100	2,061.00	6,389,100	
アインホールディングス	24,300	5,610.00	136,323,000	
元気寿司	5,300	2,452.00	12,995,600	
ヤマダホールディングス	697,480	480.00	334,790,400	
アークランドサカモト	29,400	1,563.00	45,952,200	
ニトリホールディングス	73,900	12,705.00	938,899,500	
グルメ杵屋	15,100	1,000.00	15,100,000	
愛眼	13,600	197.00	2,679,200	
ケーユーホールディングス	10,000	1,064.00	10,640,000	
吉野家ホールディングス	65,100	2,375.00	154,612,500	
松屋フーズホールディングス	9,000	3,745.00	33,705,000	
サガミホールディングス	28,200	1,111.00	31,330,200	
関西フードマーケット	17,700	1,319.00	23,346,300	
王将フードサービス	12,400	6,110.00	75,764,000	
プレナス	21,000	1,940.00	40,740,000	
ミニストップ	13,900	1,383.00	19,223,700	
アークス	34,900	2,078.00	72,522,200	
バローホールディングス	40,300	1,995.00	80,398,500	
ベルク	8,300	5,440.00	45,152,000	
大庄	10,300	1,025.00	10,557,500	
ファーストリテイリング	24,900	58,020.00	1,444,698,000	
サンドラッグ	70,200	2,955.00	207,441,000	
サックスバー　ホールディングス	18,200	516.00	9,391,200	
ヤマザワ	4,400	1,500.00	6,600,000	
やまや	3,800	2,480.00	9,424,000	
ベルーナ	40,400	711.00	28,724,400	
島根銀行	5,900	521.00	3,073,900	
じもとホールディングス	13,000	620.00	8,060,000	
めぶきフィナンシャルグループ	852,400	267.00	227,590,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,800	1,741.00	39,694,800	
九州フィナンシャルグループ	362,700	402.00	145,805,400	
ゆうちょ銀行	440,200	981.00	431,836,200	
富山第一銀行	43,500	327.00	14,224,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,017,700	478.00	486,460,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	109,800	783.00	85,973,400	
三十三フィナンシャルグループ	16,500	1,427.00	23,545,500	
第四北越フィナンシャルグループ	29,000	2,507.00	72,703,000	
ひろぎんホールディングス	262,800	633.00	166,352,400	
おきなわフィナンシャルグループ	16,500	2,215.00	36,547,500	
十六フィナンシャルグループ	23,900	2,229.00	53,273,100	
北國フィナンシャルホールディングス	16,900	4,345.00	73,430,500	

プロクレアホールディングス	19,600	1,828.00	35,828,800	
新生銀行	121,600	2,217.00	269,587,200	
あおぞら銀行	104,100	2,636.00	274,407,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,435,400	750.20	8,578,837,080	
りそなホールディングス	2,067,200	545.90	1,128,484,480	
三井住友トラスト・ホールディングス	337,800	4,097.00	1,383,966,600	
三井住友フィナンシャルグループ	1,264,000	3,922.00	4,957,408,000	
千葉銀行	590,400	748.00	441,619,200	
群馬銀行	333,300	373.00	124,320,900	
武蔵野銀行	26,500	1,780.00	47,170,000	
千葉興業銀行	42,600	269.00	11,459,400	
筑波銀行	72,700	199.00	14,467,300	
七十七銀行	55,500	1,668.00	92,574,000	
秋田銀行	11,700	1,664.00	19,468,800	
山形銀行	19,100	882.00	16,846,200	
岩手銀行	11,900	1,908.00	22,705,200	
東邦銀行	148,200	205.00	30,381,000	
東北銀行	8,700	990.00	8,613,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	149,600	2,349.00	351,410,400	
静岡銀行	430,900	854.00	367,988,600	
スルガ銀行	163,500	415.00	67,852,500	
八十二銀行	400,000	455.00	182,000,000	
山梨中央銀行	19,700	993.00	19,562,100	
大垣共立銀行	35,200	1,912.00	67,302,400	
福井銀行	15,600	1,354.00	21,122,400	
清水銀行	7,300	1,506.00	10,993,800	
富山銀行	3,200	1,893.00	6,057,600	
滋賀銀行	33,500	2,494.00	83,549,000	
南都銀行	27,800	2,037.00	56,628,600	
百五銀行	171,500	340.00	58,310,000	
京都銀行	63,800	5,640.00	359,832,000	
紀陽銀行	60,600	1,422.00	86,173,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	110,900	888.00	98,479,200	
山陰合同銀行	108,300	660.00	71,478,000	
中国銀行	145,200	964.00	139,972,800	
鳥取銀行	5,900	1,187.00	7,003,300	
伊予銀行	234,400	632.00	148,140,800	
百十四銀行	18,900	1,714.00	32,394,600	
四国銀行	27,100	802.00	21,734,200	
阿波銀行	27,300	2,152.00	58,749,600	
大分銀行	10,500	1,873.00	19,666,500	
宮崎銀行	11,100	2,070.00	22,977,000	

佐賀銀行	10,300	1,462.00	15,058,600	
琉球銀行	40,500	817.00	33,088,500	
セブン銀行	553,800	249.00	137,896,200	
みずほフィナンシャルグループ	2,335,300	1,585.00	3,701,450,500	
高知銀行	6,500	745.00	4,842,500	
山口フィナンシャルグループ	206,900	730.00	151,037,000	
長野銀行	6,000	1,311.00	7,866,000	
名古屋銀行	12,800	3,065.00	39,232,000	
北洋銀行	265,500	241.00	63,985,500	
愛知銀行	6,400	4,740.00	30,336,000	
中京銀行	6,400	1,684.00	10,777,600	
大光銀行	6,100	1,269.00	7,740,900	
愛媛銀行	25,500	935.00	23,842,500	
トマト銀行	6,300	1,021.00	6,432,300	
京葉銀行	77,800	493.00	38,355,400	
栃木銀行	87,900	249.00	21,887,100	
北日本銀行	5,700	1,562.00	8,903,400	
東和銀行	32,000	536.00	17,152,000	
福島銀行	20,800	216.00	4,492,800	
大東銀行	8,700	653.00	5,681,100	
トモニホールディングス	141,000	326.00	45,966,000	
フィデアホールディングス	17,000	1,288.00	21,896,000	
池田泉州ホールディングス	209,000	187.00	39,083,000	
ＦＰＧ	63,000	801.00	50,463,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,600	1,137.00	16,600,200	
マーキュリアホールディングス	8,700	583.00	5,072,100	
ＳＢＩホールディングス	230,300	2,859.00	658,427,700	
ジャフコ　グループ	71,400	1,537.00	109,741,800	
大和証券グループ本社	1,363,700	624.60	851,767,020	
野村ホールディングス	2,847,500	484.00	1,378,190,000	
岡三証券グループ	143,300	358.00	51,301,400	
丸三証券	55,900	511.00	28,564,900	
東洋証券	61,200	179.00	10,954,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	204,600	386.00	78,975,600	
光世証券	4,400	465.00	2,046,000	
水戸証券	49,300	259.00	12,768,700	
いちよし証券	34,500	568.00	19,596,000	
松井証券	91,600	824.00	75,478,400	
マネックスグループ	154,100	533.00	82,135,300	
極東証券	24,100	699.00	16,845,900	
岩井コスモホールディングス	17,800	1,261.00	22,445,800	
アイザワ証券グループ	29,200	649.00	18,950,800	

マネーパートナーズグループ	20,800	238.00	4,950,400	
スパークス・グループ	87,000	248.00	21,576,000	
かんぽ生命保険	187,700	2,147.00	402,991,900	
ＳＯＭＰＯホールディングス	292,500	5,229.00	1,529,482,500	
アニコム　ホールディングス	57,300	628.00	35,984,400	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	406,600	3,928.00	1,597,124,800	
第一生命ホールディングス	867,600	2,597.00	2,253,157,200	
東京海上ホールディングス	572,100	6,921.00	3,959,504,100	
Ｔ＆Ｄホールディングス	461,000	1,676.00	772,636,000	
アドバンスクリエイト	8,900	930.00	8,277,000	
全国保証	44,600	4,545.00	202,707,000	
あんしん保証	8,700	292.00	2,540,400	
イントラスト	8,600	519.00	4,463,400	
日本モーゲージサービス	10,700	964.00	10,314,800	
Ｃａｓａ	7,000	803.00	5,621,000	
アルヒ	27,900	996.00	27,788,400	
プレミアグループ	9,500	3,710.00	35,245,000	
ネットプロテクションズホールディングス	57,100	602.00	34,374,200	
クレディセゾン	116,400	1,551.00	180,536,400	
芙蓉総合リース	18,400	7,260.00	133,584,000	
みずほリース	27,000	3,015.00	81,405,000	
東京センチュリー	33,800	4,215.00	142,467,000	
日本証券金融	73,700	950.00	70,015,000	
アイフル	313,900	379.00	118,968,100	
リコーリース	16,600	3,440.00	57,104,000	
イオンフィナンシャルサービス	101,700	1,204.00	122,446,800	
アコム	368,900	345.00	127,270,500	
ジャックス	20,000	3,280.00	65,600,000	
オリエントコーポレーション	507,400	128.00	64,947,200	
オリックス	1,108,000	2,304.00	2,552,832,000	
三菱ＨＣキャピタル	660,900	585.00	386,626,500	
九州リースサービス	9,400	579.00	5,442,600	
日本取引所グループ	455,300	1,906.50	868,029,450	
イー・ギャランティ	27,700	2,034.00	56,341,800	
アサックス	10,300	582.00	5,994,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,800	1,966.00	15,334,800	
いちご	212,700	277.00	58,917,900	
日本駐車場開発	207,300	157.00	32,546,100	
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	1,443.00	15,873,000	
ＳＲＥホールディングス	5,200	2,318.00	12,053,600	
ＡＤワークスグループ	36,900	149.00	5,498,100	
ヒューリック	433,500	1,040.00	450,840,000	

三栄建築設計	8,400	1,646.00	13,826,400	
野村不動産ホールディングス	96,900	3,120.00	302,328,000	
三重交通グループホールディングス	41,000	466.00	19,106,000	
サムティ	29,800	2,053.00	61,179,400	
ディア・ライフ	26,500	518.00	13,727,000	
地主	12,600	1,937.00	24,406,200	
プレサンスコーポレーション	24,000	1,487.00	35,688,000	
ハウスコム	4,500	1,130.00	5,085,000	
日本管理センター	10,400	988.00	10,275,200	
サンセイランディック	7,200	811.00	5,839,200	
フージャースホールディングス	23,800	646.00	15,374,800	
オープンハウスグループ	59,600	4,745.00	282,802,000	
東急不動産ホールディングス	537,500	649.00	348,837,500	
飯田グループホールディングス	156,300	2,111.00	329,949,300	
イーグランド	4,000	1,341.00	5,364,000	
ムゲンエステート	14,400	502.00	7,228,800	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	9,200	909.00	8,362,800	
シーアールイー	6,700	1,489.00	9,976,300	
ケイアイスター不動産	8,700	5,320.00	46,284,000	
グッドコムアセット	9,400	1,093.00	10,274,200	
ジェイ・エス・ビー	4,200	3,450.00	14,490,000	
ロードスターキャピタル	5,700	1,416.00	8,071,200	
テンポイノベーション	7,000	808.00	5,656,000	
フェイスネットワーク	3,500	1,328.00	4,648,000	
パーク２４	111,200	1,816.00	201,939,200	
パラカ	5,900	1,735.00	10,236,500	
三井不動産	807,800	2,683.50	2,167,731,300	
三菱地所	1,171,500	1,823.50	2,136,230,250	
平和不動産	31,500	3,850.00	121,275,000	
東京建物	176,800	1,780.00	314,704,000	
京阪神ビルディング	28,400	1,328.00	37,715,200	
住友不動産	373,100	3,335.00	1,244,288,500	
テーオーシー	34,000	673.00	22,882,000	
東京楽天地	3,300	3,955.00	13,051,500	
スターツコーポレーション	26,000	2,316.00	60,216,000	
フジ住宅	24,000	620.00	14,880,000	
空港施設	21,500	548.00	11,782,000	
明和地所	11,300	594.00	6,712,200	
ゴールドクレスト	15,600	1,661.00	25,911,600	
エスリード	8,200	1,665.00	13,653,000	
日神グループホールディングス	33,600	446.00	14,985,600	
日本エスコン	34,700	738.00	25,608,600	

タカラレーベン	78,100	292.00	22,805,200	
ＡＶＡＮＴＩＡ	11,100	840.00	9,324,000	
イオンモール	94,400	1,561.00	147,358,400	
毎日コムネット	8,400	700.00	5,880,000	
ファースト住建	8,300	1,104.00	9,163,200	
カチタス	46,700	2,889.00	134,916,300	
トーセイ	27,100	1,114.00	30,189,400	
穴吹興産	4,700	2,222.00	10,443,400	
サンフロンティア不動産	27,200	1,061.00	28,859,200	
ＦＪネクストホールディングス	19,800	1,016.00	20,116,800	
インテリックス	4,200	637.00	2,675,400	
ランドビジネス	7,300	236.00	1,722,800	
サンネクスタグループ	7,200	1,119.00	8,056,800	
グランディハウス	15,500	521.00	8,075,500	
日本空港ビルデング	67,700	5,180.00	350,686,000	
明豊ファシリティワークス	8,700	680.00	5,916,000	
日本工営	11,600	2,908.00	33,732,800	
ＬＩＦＵＬＬ	56,600	215.00	12,169,000	
ミクシィ	41,500	2,253.00	93,499,500	
ジェイエイシーリクルートメント	14,800	1,744.00	25,811,200	
日本M&Aセンターホールディングス	296,500	1,400.00	415,100,000	
メンバーズ	5,300	2,873.00	15,226,900	
中広	3,800	379.00	1,440,200	
ＵＴグループ	26,200	2,585.00	67,727,000	
アイティメディア	8,800	1,660.00	14,608,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	10,700	1,139.00	12,187,300	
夢真ビーネックスグループ	59,100	1,347.00	79,607,700	
コシダカホールディングス	48,700	716.00	34,869,200	
アルトナー	4,800	833.00	3,998,400	
パソナグループ	19,700	1,930.00	38,021,000	
ＣＤＳ	4,700	1,790.00	8,413,000	
リンクアンドモチベーション	39,800	435.00	17,313,000	
エス・エム・エス	61,500	2,936.00	180,564,000	
サニーサイドアップグループ	6,700	780.00	5,226,000	
パーソルホールディングス	180,800	2,315.00	418,552,000	
リニカル	10,600	791.00	8,384,600	
クックパッド	57,900	249.00	14,417,100	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,400	566.00	5,320,400	
学情	7,700	921.00	7,091,700	
スタジオアリス	8,200	2,207.00	18,097,400	
シミックホールディングス	9,900	1,457.00	14,424,300	
エプコ	4,300	687.00	2,954,100	

ＮＪＳ	4,100	2,023.00	8,294,300	
綜合警備保障	70,000	3,705.00	259,350,000	
カカクコム	132,700	2,625.00	348,337,500	
アイロムグループ	6,500	2,013.00	13,084,500	
セントケア・ホールディング	12,200	781.00	9,528,200	
サイネックス	3,600	591.00	2,127,600	
ルネサンス	12,900	855.00	11,029,500	
ディップ	31,900	3,940.00	125,686,000	
デジタルホールディングス	12,800	1,401.00	17,932,800	
新日本科学	22,200	1,335.00	29,637,000	
キャリアデザインセンター	4,600	1,032.00	4,747,200	
ベネフィット・ワン	65,900	1,878.00	123,760,200	
エムスリー	318,900	3,836.00	1,223,300,400	
ツカダ・グローバルホールディング	11,500	305.00	3,507,500	
アウトソーシング	103,700	1,169.00	121,225,300	
ウェルネット	18,200	445.00	8,099,000	
ワールドホールディングス	7,400	2,313.00	17,116,200	
ディー・エヌ・エー	69,000	1,886.00	130,134,000	
博報堂ＤＹホールディングス	244,200	1,511.00	368,986,200	
ぐるなび	29,300	387.00	11,339,100	
タカミヤ	22,800	333.00	7,592,400	
ジャパンベストレスキューシステム	11,500	743.00	8,544,500	
ファンコミュニケーションズ	44,400	419.00	18,603,600	
ライク	6,200	2,094.00	12,982,800	
ビジネス・ブレークスルー	7,500	408.00	3,060,000	
エスプール	51,300	1,194.00	61,252,200	
ＷＤＢホールディングス	8,400	2,584.00	21,705,600	
ティア	11,300	431.00	4,870,300	
ＣＤＧ	2,200	1,300.00	2,860,000	
アドウェイズ	27,400	779.00	21,344,600	
バリューコマース	14,300	3,070.00	43,901,000	
インフォマート	198,500	494.00	98,059,000	
ＪＰホールディングス	48,000	208.00	9,984,000	
エコナックホールディングス	35,900	88.00	3,159,200	
ＣＬホールディングス	4,100	1,068.00	4,378,800	
プレステージ・インターナショナル	68,300	604.00	41,253,200	
アミューズ	10,000	1,939.00	19,390,000	
ドリームインキュベータ	5,300	1,950.00	10,335,000	
クイック	12,200	1,462.00	17,836,400	
ＴＡＣ	11,300	224.00	2,531,200	
電通グループ	180,700	4,665.00	842,965,500	
イオンファンタジー	7,100	2,057.00	14,604,700	

シーティーエス	20,800	848.00	17,638,400	
ネクシィーズグループ	6,700	512.00	3,430,400	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	47,300	2,958.00	139,913,400	
アルプス技研	14,600	1,925.00	28,105,000	
ダイオーズ	3,900	1,032.00	4,024,800	
日本空調サービス	19,300	803.00	15,497,900	
オリエンタルランド	206,400	17,200.00	3,550,080,000	
ダスキン	41,000	2,796.00	114,636,000	
明光ネットワークジャパン	21,800	573.00	12,491,400	
ファルコホールディングス	8,600	2,103.00	18,085,800	
ラウンドワン	50,700	1,270.00	64,389,000	
リゾートトラスト	80,800	2,078.00	167,902,400	
ビー・エム・エル	23,100	3,345.00	77,269,500	
りらいあコミュニケーションズ	27,000	1,032.00	27,864,000	
リソー教育	83,400	367.00	30,607,800	
早稲田アカデミー	10,400	1,027.00	10,680,800	
ユー・エス・エス	202,400	2,188.00	442,851,200	
東京個別指導学院	16,500	581.00	9,586,500	
サイバーエージェント	425,700	1,372.00	584,060,400	
楽天グループ	899,100	854.00	767,831,400	
クリーク・アンド・リバー社	9,600	1,965.00	18,864,000	
モーニングスター	32,200	536.00	17,259,200	
テー・オー・ダブリュー	35,500	319.00	11,324,500	
山田コンサルティンググループ	9,600	1,162.00	11,155,200	
セントラルスポーツ	6,900	2,308.00	15,925,200	
フルキャストホールディングス	15,500	2,198.00	34,069,000	
エン・ジャパン	30,300	3,090.00	93,627,000	
リソルホールディングス	2,000	4,410.00	8,820,000	
テクノプロ・ホールディングス	108,300	2,894.00	313,420,200	
アトラグループ	4,000	253.00	1,012,000	
インターワークス	6,100	376.00	2,293,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	8,500	3,865.00	32,852,500	
ＫｅｅＰｅｒ技研	11,700	2,320.00	27,144,000	
ファーストロジック	3,700	769.00	2,845,300	
三機サービス	3,400	1,182.00	4,018,800	
Ｇｕｎｏｓｙ	10,300	937.00	9,651,100	
デザインワン・ジャパン	6,600	182.00	1,201,200	
イー・ガーディアン	7,000	2,808.00	19,656,000	
リブセンス	12,000	162.00	1,944,000	
ジャパンマテリアル	55,700	1,859.00	103,546,300	
ベクトル	25,600	1,182.00	30,259,200	
ウチヤマホールディングス	10,000	306.00	3,060,000	

チャーム・ケア・コーポレーション	13,700	1,072.00	14,686,400	
キャリアリンク	6,900	1,428.00	9,853,200	
ＩＢＪ	15,300	665.00	10,174,500	
アサンテ	8,200	1,464.00	12,004,800	
バリューＨＲ	15,100	1,291.00	19,494,100	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	15,000	3,240.00	48,600,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,300	1,146.00	8,365,800	
ＥＲＩホールディングス	5,300	1,277.00	6,768,100	
アビスト	2,900	2,753.00	7,983,700	
シグマクシス・ホールディングス	22,100	1,039.00	22,961,900	
ウィルグループ	13,700	1,071.00	14,672,700	
エスクロー・エージェント・ジャパン	24,400	164.00	4,001,600	
メドピア	13,600	2,599.00	35,346,400	
レアジョブ	3,800	767.00	2,914,600	
リクルートホールディングス	1,360,700	4,368.00	5,943,537,600	
エラン	25,200	946.00	23,839,200	
土木管理総合試験所	9,400	327.00	3,073,800	
ネットマーケティング	9,300	672.00	6,249,600	
日本郵政	2,261,300	911.90	2,062,079,470	
ベルシステム２４ホールディングス	26,200	1,444.00	37,832,800	
鎌倉新書	21,100	550.00	11,605,000	
ＳＭＮ	4,500	590.00	2,655,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,600	698.00	2,512,800	
エアトリ	11,400	2,861.00	32,615,400	
アトラエ	12,800	1,580.00	20,224,000	
ストライク	7,300	3,775.00	27,557,500	
ソラスト	44,800	825.00	36,960,000	
セラク	6,000	1,186.00	7,116,000	
インソース	18,500	1,894.00	35,039,000	
ベイカレント・コンサルティング	12,800	41,650.00	533,120,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,600	2,372.00	8,539,200	
アイモバイル	6,700	1,309.00	8,770,300	
キャリアインデックス	6,700	522.00	3,497,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	7,700	813.00	6,260,100	
船場	4,100	695.00	2,849,500	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	57,500	1,630.00	93,725,000	
フルテック	2,800	1,335.00	3,738,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	6,000	468.00	2,808,000	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	3,100	704.00	2,182,400	
ウェルビー	12,200	898.00	10,955,600	
エル・ティー・エス	2,400	2,706.00	6,494,400	
ミダックホールディングス	8,300	1,967.00	16,326,100	

日総工産	14,600	624.00	9,110,400	
キュービーネットホールディングス	8,600	1,339.00	11,515,400	
ＲＰＡホールディングス	26,400	402.00	10,612,800	
スプリックス	5,800	1,175.00	6,815,000	
マネジメントソリューションズ	8,900	4,495.00	40,005,500	
プロレド・パートナーズ	4,600	556.00	2,557,600	
テノ．ホールディングス	2,700	610.00	1,647,000	
フロンティア・マネジメント	5,000	932.00	4,660,000	
ピアラ	3,300	826.00	2,725,800	
コプロ・ホールディングス	3,900	1,003.00	3,911,700	
ギークス	3,400	1,131.00	3,845,400	
カーブスホールディングス	50,000	672.00	33,600,000	
フォーラムエンジニアリング	12,400	833.00	10,329,200	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	3,500	1,813.00	6,345,500	
ダイレクトマーケティングミックス	20,300	1,555.00	31,566,500	
ポピンズ	4,300	1,938.00	8,333,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	14,700	2,340.00	34,398,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	9,800	490.00	4,802,000	
リログループ	99,000	1,830.00	181,170,000	
東祥	13,700	1,512.00	20,714,400	
ビーウィズ	5,100	1,458.00	7,435,800	
ＴＲＥホールディングス	28,000	2,066.00	57,848,000	
人・夢・技術グループ	7,300	2,218.00	16,191,400	
エイチ・アイ・エス	39,400	2,012.00	79,272,800	
ラックランド	5,600	2,942.00	16,475,200	
共立メンテナンス	32,300	4,540.00	146,642,000	
イチネンホールディングス	18,800	1,222.00	22,973,600	
建設技術研究所	10,400	2,286.00	23,774,400	
スペース	12,900	897.00	11,571,300	
燦ホールディングス	8,100	1,570.00	12,717,000	
スバル興業	1,100	8,370.00	9,207,000	
東京テアトル	6,900	1,211.00	8,355,900	
タナベ経営	7,400	640.00	4,736,000	
ナガワ	5,600	8,950.00	50,120,000	
東京都競馬	13,600	3,845.00	52,292,000	
カナモト	31,300	1,951.00	61,066,300	
西尾レントオール	16,200	2,750.00	44,550,000	
トランス・コスモス	23,000	3,150.00	72,450,000	
乃村工藝社	77,800	866.00	67,374,800	
藤田観光	7,900	2,225.00	17,577,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	11,200	1,417.00	15,870,400	
日本管財	19,500	2,756.00	53,742,000	

トーカイ	15,500	1,706.00	26,443,000	
セコム	178,100	9,308.00	1,657,754,800	
セントラル警備保障	8,900	2,146.00	19,099,400	
丹青社	36,400	778.00	28,319,200	
メイテック	21,500	6,330.00	136,095,000	
応用地質	19,500	1,882.00	36,699,000	
船井総研ホールディングス	36,100	2,054.00	74,149,400	
進学会ホールディングス	6,900	321.00	2,214,900	
オオバ	12,400	771.00	9,560,400	
いであ	4,900	1,786.00	8,751,400	
学究社	6,000	1,586.00	9,516,000	
ベネッセホールディングス	60,400	2,284.00	137,953,600	
イオンディライト	22,400	2,884.00	64,601,600	
ナック	8,900	949.00	8,446,100	
ダイセキ	33,000	4,475.00	147,675,000	
ステップ	6,800	1,758.00	11,954,400	
合　計	201,034,180		471,620,602,660	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 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

	2022年 5月10日現在
項目	金額（円）
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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。

	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)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）

1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2022年 5月10日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 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
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

区分	2022年 5月10日現在
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
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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△34,130,895,038
合計	△34,130,895,038

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 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。

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	9,609,375.00	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,514,884.57	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,356,005.85	
		T 0.125% 05/31/23	6,800,000.00	6,658,953.10	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,870,996.10	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,824,811.69	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,746,875.04	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,130,981.45	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,459,687.50	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,539,062.50	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	7,838,125.04	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,562,656.25	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	922,578.13	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,785,015.61	
		T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,656,171.92	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,868,945.35	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,290,343.76	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,645,507.84	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,291,875.04	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,709,335.92	

		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,445,937.52	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,576,041.81	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,815,937.50	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,746,289.05	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,249,117.20	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,967,812.48	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,747,226.57	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,656,406.24	
		T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	10,510,820.37	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,761,417.22	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,609,824.21	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,096,542.96	
		T 0.5% 06/30/27	3,100,000.00	2,737,445.32	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,095,703.12	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,562,500.00	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	11,712,914.13	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,270,625.04	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,871,820.31	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,198,242.20	
		T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,773,046.90	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,495,273.48	
		T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,132,460.91	
		T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,758,593.75	
		T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,669,687.52	
		T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,790,716.04	
		T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,332,271.87	
		T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,274,823.81	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,364,062.48	
		T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,492,812.50	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,372,968.75	
		T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,509,671.89	
		T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,879,507.81	
		T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,121,816.38	
		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,206,562.48	
		T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,192,858.60	
		T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	5,060,953.12	
		T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,096,073.07	
		T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,662,158.21	
		T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,229,687.52	
		T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,492,750.00	
		T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,218,750.00	
		T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,555,937.50	

		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,495,879.88	
		T 1.25% 08/15/31	12,680,000.00	10,875,081.25	
		T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,999,023.51	
		T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,500,976.58	
		T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,609,175.81	
		T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,852,343.76	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,956,054.70	
		T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,504,609.37	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,470,068.35	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,946,953.12	
		T 1.375% 11/15/31	18,030,000.00	15,579,046.87	
		T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,342,031.28	
		T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,415,359.37	
		T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,620,312.50	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,798,737.50	
		T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,068,750.00	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,261,933.61	
		T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,815,625.00	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,732,652.36	
		T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,159,869.54	
		T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,933,082.08	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	994,843.75	
		T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,144,609.37	
		T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,472,265.62	
		T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,646,656.26	
		T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,853,179.72	
		T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,516,166.41	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,678,612.88	
		T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,355,093.74	
		T 1.75% 08/15/41	14,500,000.00	11,110,625.00	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,749,218.75	
		T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,245,320.35	
		T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,956,703.15	
		T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,810,937.52	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,977,534.37	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,888,671.86	
		T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,996,070.35	
		T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,196,367.17	
		T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,648,750.00	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,062,746.08	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,340,453.16	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,351,625.00	
		T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,492,281.26	

		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,744,500.00	
		T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,932,421.90	
		T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,667,332.81	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,981,328.12	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,670,312.50	
		T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,896,601.57	
		T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,320,703.12	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,954,609.41	
		T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,421,857.83	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,247,410.19	
		T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,394,554.68	
		T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,502,265.62	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,226,417.95	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,023,521.45	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,308,562.50	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,365,216.81	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,482,246.10	
		T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,327,648.42	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,743,350.02	
		T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,549,117.19	
		T 2.375% 05/15/27	2,690,000.00	2,617,391.00	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,681,464.88	
		T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	2,321,816.42	
		T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,964,453.15	
		T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	5,142,109.37	
		T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,467,627.94	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,962,890.65	
		T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,456,973.43	
		T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	3,408,437.52	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,884,261.69	
		T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	4,301,574.24	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,563,774.39	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,646,031.25	
		T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	13,007,542.25	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,214,599.62	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	4,924,308.60	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,508,681.64	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,771,121.07	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,010,078.14	
		T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,462,496.12	
		T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	3,905,159.39	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,487,753.92	

		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,006,015.63	
		T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,173,148.44	
		T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,631,078.12	
		T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,508,496.09	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,876,011.73	
		T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,331,373.42	
		T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,530,756.26	
		T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,736,421.87	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,007,500.00	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,203,564.82	
		T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,808,273.43	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	5,181,840.62	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,825,670.33	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,465,545.33	
		T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,885,240.61	
		T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,098,750.00	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,784,418.92	
		T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,516,357.42	
		T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,287,695.32	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,045,988.65	
		T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,498,828.12	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,282,538.30	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,859,375.00	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,160,034.17	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,269,271.47	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,426,953.12	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,706,446.12	
		T 2% 08/15/51	15,150,000.00	11,738,882.81	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,811,599.19	
		T 2% 11/15/41	5,700,000.00	4,562,226.58	
		T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,011,527.34	
		T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,913,437.50	
		T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,742,371.12	
		T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	3,941,732.83	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,444,625.00	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,686,015.62	
		T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,986,719.54	
		T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,388,609.37	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	800,980.47	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,475,375.00	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,065,156.26	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,108,281.26	
		T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,155,625.00	

	T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,563,281.25	
	T 3% 02/15/47	800,000.00	748,500.00	
	T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,200,730.49	
	T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,759,375.00	
	T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,528,115.62	
	T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,329,882.82	
	T 3% 05/15/47	3,210,000.00	3,007,368.75	
	T 3% 08/15/48	5,450,000.00	5,148,972.68	
	T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,218,703.14	
	T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,020,703.15	
	T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,606,843.76	
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,024,945.31	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,650,910.16	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,157,656.25	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,188,859.37	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,231,378.91	
	T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,413,481.26	
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,278,280.47	
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	645,132.81	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,992,718.75	
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,640,475.00	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	901,406.25	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,353,601.56	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,470,929.69	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,302,980.47	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,888,128.90	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,679,734.37	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,292,156.25	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,732,854.48	
アメリカドル 小計		1,219,330,000.00	1,131,413,943.70 (147,117,755,099)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,075,712.00	
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,296,272.00	
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,546,284.00	
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,323,456.80	
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,306,697.60	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,590,000.00	2,101,085.70	
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,259,622.00	
	CAN 0.75% 10/01/24	450,000.00	430,168.50	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,384,387.20	
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,774,976.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,174,414.20	

		CAN 1.5% 05/01/24	490,000.00	479,269.00	
		CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,059,396.30	
		CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,296,284.00	
		CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,497,609.70	
		CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,169,208.00	
		CAN 1.5% 12/01/31	4,170,000.00	3,649,041.90	
		CAN 1.75% 12/01/53	1,830,000.00	1,376,050.20	
		CAN 1% 06/01/27	810,000.00	742,907.70	
		CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,421,002.80	
		CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,286,476.00	
		CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,776,978.00	
		CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,207,546.20	
		CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,326,262.70	
		CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,577,482.50	
		CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	713,792.00	
		CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,249,766.20	
		CAN 2% 06/01/32	700,000.00	637,770.00	
		CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,437,856.00	
		CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,816,701.40	
		CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,399,918.00	
		CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,187,403.00	
		CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,380,752.10	
		CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,199,836.80	
		CAN 5% 06/01/37	420,000.00	515,772.60	
	カナダドル 小計		64,110,000.00	60,078,159.10 (6,000,606,530)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,056,844.00	
		MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	31,304,136.00	
		MBONO 5.5% 03/04/27	8,390,000.00	7,256,930.50	
		MBONO 5.75% 03/05/26	47,710,000.00	42,820,202.10	
		MBONO 5% 03/06/25	3,700,000.00	3,337,215.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,649,718.10	
		MBONO 7.75% 05/29/31	35,980,000.00	32,922,059.80	
		MBONO 7.75% 11/13/42	24,040,000.00	20,495,302.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	9,433,364.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	38,660,000.00	37,567,081.80	
		MBONO 8.5% 11/18/38	25,720,000.00	24,058,745.20	
		MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,799,558.50	
		MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	24,627,060.00	
		MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,718,253.00	
	メキシコペソ 小計		364,760,000.00	342,046,470.00 (2,176,783,735)	
	ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,233,205.50	

		BGB 0.2% 10/22/23	1,030,000.00	1,033,265.10	
		BGB 0.35% 06/22/32	480,000.00	420,811.20	
		BGB 0.4% 06/22/40	1,240,000.00	936,237.20	
		BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,621,166.40	
		BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	349,132.80	
		BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,693,507.20	
		BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,672,305.70	
		BGB 0.8% 06/22/28	1,260,000.00	1,235,505.60	
		BGB 0.9% 06/22/29	1,560,000.00	1,520,391.60	
		BGB 0% 10/22/27	430,000.00	406,160.80	
		BGB 0% 10/22/31	1,020,000.00	877,077.60	
		BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,446,495.00	
		BGB 1.4% 06/22/53	610,000.00	506,641.60	
		BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	747,720.00	
		BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	1,122,547.20	
		BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,189,227.00	
		BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,043,164.50	
		BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,296,142.40	
		BGB 1% 06/22/31	2,770,000.00	2,647,427.50	
		BGB 2.15% 06/22/66	780,000.00	781,926.60	
		BGB 2.25% 06/22/23	1,180,000.00	1,211,659.40	
		BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	795,078.90	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,242,227.80	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,567,704.00	
		BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,166,402.90	
		BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	2,507,539.10	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,304,878.20	
		BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,316,066.40	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,490,178.80	
		BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	3,111,148.20	
		BKO 0% 06/16/23	1,090,000.00	1,091,744.00	
		BKO 0% 09/15/23	3,150,000.00	3,152,268.00	
		BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,877,875.60	
		BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,478,904.00	
		BTPS 0.3% 08/15/23	2,900,000.00	2,892,576.00	
		BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	560,720.80	
		BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,788,231.60	
		BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,811,997.90	
		BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,018,803.20	
		BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,114,218.00	
		BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,539,755.20	
		BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	669,417.10	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,118,217.50	

		BTPS 0.9% 04/01/31	2,230,000.00	1,865,774.10	
		BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	747,741.60	
		BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	2,076,439.50	
		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,914,700.30	
		BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,217,898.20	
		BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,765,200.40	
		BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	983,200.00	
		BTPS 0% 04/01/26	1,460,000.00	1,349,113.00	
		BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,929,770.00	
		BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,361,577.20	
		BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,453,395.00	
		BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,779,998.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,876,660.50	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,740,645.60	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,370,642.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,279,507.00	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,392,128.00	
		BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	885,262.50	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,394,720.60	
		BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,784,493.60	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	2,659,335.00	
		BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,290,800.60	
		BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,165,063.20	
		BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	1,008,080.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,774,732.80	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,479,620.50	
		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,702,538.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,704,928.00	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,206,272.00	
		BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	515,613.60	
		BTPS 2.15% 09/01/52	920,000.00	698,261.60	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,275,622.40	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	1,638,170.40	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,471,092.80	
		BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,498,861.00	
		BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,981,906.10	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,011,714.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,022,953.50	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	1,982,281.60	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	966,319.50	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	1,920,353.40	
		BTPS 2.95% 09/01/38	1,550,000.00	1,486,992.50	

		BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,213,579.60	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,098,067.40	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,378,749.00	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	1,926,912.00	
		BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,848,519.40	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,152,881.20	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,179,186.00	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,266,100.00	
		BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,008,502.40	
		BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,426,729.60	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,919,730.00	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,281,323.20	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,729,250.20	
		BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,841,515.50	
		BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,972,320.80	
		BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,567,166.00	
		BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,871,346.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,671,220.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,197,453.60	
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,833,675.20	
		BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,002,832.20	
		BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,541,101.30	
		BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,761,449.60	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,386,456.00	
		BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,662,505.00	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,712,368.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	896,624.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,805,742.60	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,950,948.00	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,532,216.60	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,086,129.20	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,988,540.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,612,104.00	
		DBR 0.5% 08/15/27	1,940,000.00	1,912,316.20	
		DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,293,864.30	
		DBR 0% 02/15/31	3,120,000.00	2,856,703.20	
		DBR 0% 02/15/32	2,390,000.00	2,150,020.10	
		DBR 0% 05/15/35	2,260,000.00	1,932,571.20	
		DBR 0% 05/15/36	3,380,000.00	2,849,678.00	
		DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,229,113.50	
		DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,273,200.00	
		DBR 0% 08/15/30	4,190,000.00	3,865,694.00	
		DBR 0% 08/15/30	670,000.00	619,401.60	

		DBR 0% 08/15/31	3,450,000.00	3,131,185.50	
		DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	3,149,736.20	
		DBR 0% 08/15/52	1,260,000.00	870,307.20	
		DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,832,453.60	
		DBR 0% 11/15/28	2,500,000.00	2,363,250.00	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,632,160.60	
		DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,071,702.40	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,346,700.40	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,695,952.50	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,029,660.00	
		DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,761,779.20	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,160,000.00	3,981,284.00	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	4,895,202.30	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,936,905.40	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,052,847.70	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,039,122.20	
		DBR 4.25% 07/04/39	1,960,000.00	2,883,316.80	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,148,663.50	
		DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,224,092.60	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,480,000.00	3,908,678.40	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,901,535.20	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,989,931.20	
		DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,560,009.10	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,741,450.00	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,263,386.60	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,533,141.60	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,560,932.00	
		FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,590,519.70	
		FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,077,845.50	
		FRTR 0.5% 05/25/40	2,760,000.00	2,157,795.60	
		FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	511,889.40	
		FRTR 0.5% 06/25/44	1,530,000.00	1,132,582.50	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,149,104.00	
		FRTR 0.75% 05/25/52	3,350,000.00	2,386,975.50	
		FRTR 0.75% 05/25/53	2,060,000.00	1,440,990.60	
		FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,689,066.50	
		FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,828,854.00	
		FRTR 0% 02/25/25	1,000,000.00	981,960.00	
		FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,049,011.00	
		FRTR 0% 02/25/27	3,560,000.00	3,392,074.80	
		FRTR 0% 03/25/24	3,750,000.00	3,727,575.00	
		FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,273,765.90	

		FRTR 0% 05/25/32	1,970,000.00	1,674,736.40	
		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,759,090.20	
		FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,335,373.60	
		FRTR 0% 11/25/31	4,990,000.00	4,299,733.30	
		FRTR 1.25% 05/25/34	4,090,000.00	3,863,209.50	
		FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,756,125.60	
		FRTR 1.5% 05/25/31	6,770,000.00	6,787,331.20	
		FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	3,201,418.40	
		FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,484,748.60	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,634,289.20	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	3,280,326.00	
		FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,285,632.00	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,646,094.00	
		FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,322,028.80	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,256,579.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	6,941,376.20	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,110,000.00	5,570,257.70	
		FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,573,243.20	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	4,207,330.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	5,050,000.00	5,572,826.50	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,994,593.50	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	6,338,441.20	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,630,000.00	4,886,088.90	
		FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,555,948.00	
		FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	3,075,571.80	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,396,299.80	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,647,120.70	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	6,068,708.80	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,240,955.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	892,567.50	
		IRISH 0.2% 10/18/30	1,090,000.00	972,094.70	
		IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	404,388.00	
		IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	504,433.40	
		IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	385,980.00	
		IRISH 0.9% 05/15/28	690,000.00	674,516.40	
		IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	724,633.50	
		IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,178,988.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	633,210.30	
		IRISH 1.35% 03/18/31	620,000.00	610,811.60	
		IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	698,520.00	
		IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	796,605.40	
		IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,663,435.60	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,297,168.40	

		IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,143,732.50	
		IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,024,805.00	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,314,628.00	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,283,596.70	
		NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,475,156.30	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,040,000.00	881,649.60	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,294,665.60	
		NETHER 0.5% 07/15/32	700,000.00	642,131.00	
		NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,546,771.20	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,593,448.20	
		NETHER 0% 01/15/24	2,230,000.00	2,224,447.30	
		NETHER 0% 01/15/26	790,000.00	768,093.30	
		NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,767,522.40	
		NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,289,822.70	
		NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	757,795.20	
		NETHER 0% 01/15/52	1,490,000.00	992,816.80	
		NETHER 0% 07/15/30	1,500,000.00	1,359,075.00	
		NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,220,478.20	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,540,000.00	1,574,573.00	
		NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,240,826.40	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	3,002,391.40	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,061,162.40	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,113,392.50	
		NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,894,211.60	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,162,897.90	
		OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,316,347.00	
		OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,996,381.40	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,699,487.50	
		OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,059,454.00	
		OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,811,521.00	
		OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,435,215.00	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,511,510.00	
		OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,388,261.80	
		RAGB 0.25% 10/20/36	390,000.00	316,914.00	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,680,597.30	
		RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	867,545.30	
		RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	276,012.00	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,184,723.10	
		RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	604,320.60	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,059,616.00	
		RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	173,718.60	
		RAGB 0.9% 02/20/32	510,000.00	477,064.20	

		RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,300,389.00	
		RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,439,165.60	
		RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	911,465.10	
		RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,121,265.60	
		RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,429,502.40	
		RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	483,009.70	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,085,343.80	
		RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	988,532.20	
		RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	223,497.90	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,019,412.90	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,363,875.10	
		RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	807,788.70	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,174,230.00	
		RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,059,644.40	
		RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	652,965.60	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,420,017.60	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,585,048.90	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,493,962.60	
		RFGB 0.125% 04/15/36	330,000.00	266,385.90	
		RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	294,390.80	
		RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	474,967.80	
		RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	384,735.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	611,599.00	
		RFGB 0.5% 04/15/43	380,000.00	298,178.40	
		RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	846,327.30	
		RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	622,765.00	
		RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	718,534.40	
		RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	754,752.00	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	693,705.30	
		RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	569,994.30	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	415,854.60	
		RFGB 0% 09/15/26	200,000.00	191,798.00	
		RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	560,882.70	
		RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	529,172.00	
		RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	467,293.40	
		RFGB 2.625% 07/04/42	640,000.00	740,083.20	
		RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	604,114.50	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	754,681.30	
		RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	917,830.60	
		SPGB 0.1% 04/30/31	3,180,000.00	2,675,016.00	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,265,657.30	
		SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,601,631.60	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,611,711.00	

		SPGB 0.5% 10/31/31	1,960,000.00	1,687,638.40	
		SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	2,708,188.50	
		SPGB 0.7% 04/30/32	1,650,000.00	1,429,032.00	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,355,673.60	
		SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,151,560.40	
		SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,224,573.20	
		SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,598,388.80	
		SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,457,773.20	
		SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,765,737.70	
		SPGB 0% 04/30/23	1,630,000.00	1,630,815.00	
		SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,081,050.80	
		SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	1,799,886.60	
		SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,886,794.50	
		SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,749,175.00	
		SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,465,199.60	
		SPGB 1.4% 07/30/28	3,570,000.00	3,525,767.70	
		SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,642,521.50	
		SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,030,515.20	
		SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	406,903.20	
		SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,657,287.50	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,105,571.00	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,582,635.00	
		SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	735,669.00	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	2,886,544.40	
		SPGB 1.95% 07/30/30	1,990,000.00	1,997,701.30	
		SPGB 1% 07/30/42	650,000.00	491,452.00	
		SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	1,653,763.80	
		SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,911,665.80	
		SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,467,059.60	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	1,872,385.00	
		SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,197,925.00	
		SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,319,944.00	
		SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,983,489.60	
		SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,676,592.80	
		SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,097,757.30	
		SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,855,085.30	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,161,658.40	
		SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	2,988,361.60	
		SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,580,336.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,055,410.00	
		SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	4,239,931.20	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,511,568.20	

	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,814,124.60	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,453,254.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,341,564.00	
ユーロ 小計		761,530,000.00	776,687,971.30 (106,615,957,820)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,444,988.00	
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,227,466.00	
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,071,809.80	
	UKT 0.25% 01/31/25	1,110,000.00	1,072,670.70	
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,808,897.30	
	UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,809,629.50	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,147,653.20	
	UKT 0.5% 01/31/29	1,020,000.00	937,992.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	794,325.20	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,658,792.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,360,000.00	1,946,433.60	
	UKT 0.625% 10/22/50	880,000.00	598,954.40	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,344,966.80	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	885,140.10	
	UKT 0.875% 07/31/33	510,000.00	451,727.40	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,595,994.00	
	UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	424,545.00	
	UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	390,863.20	
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	934,762.00	
	UKT 1.25% 07/31/51	830,000.00	668,208.10	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,375,716.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,599,424.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,054,387.10	
	UKT 1.5% 07/31/53	200,000.00	172,498.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,617,586.20	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	1,649,187.60	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,320,000.00	1,195,075.20	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,189,110.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,037,354.80	
	UKT 1.75% 09/07/37	2,630,000.00	2,476,618.40	
	UKT 1% 01/31/32	400,000.00	365,480.00	
	UKT 1% 04/22/24	800,000.00	794,248.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,529,375.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,510,000.00	1,735,337.30	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,740,953.50	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,810,847.40	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,180,000.00	2,566,688.40	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,812,898.60	

	UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	2,813,264.50	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,170,672.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	2,050,000.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,539,614.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,100,605.40	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,560,347.80	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,293,882.50	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,661,926.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,156,280.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,902,130.40	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,860,000.00	2,347,785.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,210,000.00	3,046,286.10	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,800,223.80	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,242,762.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,334,547.60	
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	1,972,674.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,584,537.50	
イギリスポンド 小計		91,810,000.00	97,516,143.30 (15,638,663,901)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,505,711.20	
	SGB 0.75% 05/12/28	7,800,000.00	7,300,722.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	6,941,440.80	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,531,250.00	
	SGB 1% 11/12/26	8,440,000.00	8,147,638.40	
	SGB 2.25% 06/01/32	4,980,000.00	5,113,165.20	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,521,154.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,408,957.60	
スウェーデンクローナ 小計		62,360,000.00	61,470,039.20 (791,119,404)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,590,000.00	3,092,892.70	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,746,723.20	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,670,000.00	4,463,305.80	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,680,000.00	4,461,958.80	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,720,000.00	5,579,230.80	
	NGB 1.75% 09/06/29	6,340,000.00	5,859,554.80	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,220,000.00	2,986,678.80	
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,785,365.20	
	NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,678,441.80	
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,844,040.80	
ノルウェークローネ 小計		58,140,000.00	55,498,192.70 (743,675,782)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,050,000.00	4,210,679.00	

	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,566,180.50	
	DGB 0.5% 11/15/29	12,410,000.00	11,727,077.70	
	DGB 0% 11/15/24	2,130,000.00	2,097,432.30	
	DGB 0% 11/15/31	5,830,000.00	5,099,326.10	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,709,758.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,683,675.20	
	DGB 4.5% 11/15/39	12,840,000.00	18,660,115.20	
デンマーククローネ 小計		61,170,000.00	63,754,244.00 (1,176,265,801)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,850,000.00	2,112,306.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	2,980,004.80	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,857,211.20	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,694,927.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	650,000.00	412,548.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,521,555.10	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,284,495.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	5,044,344.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,026,419.20	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,569,525.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,721,726.40	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,422,338.80	
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,324,396.80	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	561,612.00	
ポーランドズロチ 小計		50,580,000.00	41,533,410.30 (1,213,842,989)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,212,503.70	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,121,210.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	1,820,659.20	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,216,249.00	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,693,986.90	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,111,404.80	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,910,000.00	2,453,071.80	
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	2,591,777.50	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,926,137.60	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,140,000.00	1,074,187.80	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,830,000.00	2,643,220.00	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,381,159.20	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,389,868.40	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	952,938.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,880,785.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,602,165.60	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,348,129.20	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,580,761.60	

	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,182,950.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,044,915.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,626,852.60	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,445,052.00	
	ACGB 3% 11/21/33	1,000,000.00	945,980.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,890,000.00	1,970,570.70	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,508,221.10	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,484,534.40	
オーストラリアドル 小計		53,750,000.00	49,209,291.30 (4,432,280,867)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	700,140.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	498,449.10	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	583,537.50	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	658,554.30	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	258,070.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,059,501.60	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	811,955.90	
	SIGB 2.375% 06/01/25	730,000.00	728,204.20	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	391,515.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	526,030.30	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	729,805.20	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	603,792.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	620,000.00	625,059.20	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	651,807.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,020,000.00	1,018,551.60	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	408,442.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	863,498.80	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	911,662.40	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,611,910.20	
シンガポールドル 小計		14,110,000.00	13,640,486.70 (1,274,430,672)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	790,000.00	675,197.20	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,909,382.40	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,459,762.30	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,870,000.00	2,776,753.70	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,520,000.00	1,303,734.40	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	940,341.60	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,180,000.00	1,068,419.20	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,546,319.80	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,035,788.60	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,438,080.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,116,553.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,934,067.20	

	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,103,739.60	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	596,838.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,122,246.40	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,794,489.20	
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	1,979,499.60	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,292,185.60	
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	2,900,160.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	1,902,028.80	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,526,775.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,838,693.00	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,742,175.60	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,406,976.80	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,268,052.80	
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,291,820.30	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,627,684.80	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,008,823.20	
マレーシアリンギット 小計		50,200,000.00	48,606,588.10 (1,441,831,804)	
イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	840,000.00	830,115.63	
	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,050,000.00	1,014,622.14	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	812,078.56	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,324,529.30	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	1,806,668.97	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,245,684.92	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,243,122.06	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,536,116.10	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	2,002,191.35	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,731,735.05	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,247,444.83	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,406,192.45	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,030,000.00	2,733,561.86	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	3,060,000.00	3,602,215.17	
イスラエルシェケル 小計		30,720,000.00	31,536,278.39 (1,193,026,872)	
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,137,716.00	
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,699,321.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	18,980,000.00	19,033,523.60	
	CGB 2.48% 04/15/27	9,000,000.00	8,952,930.00	
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,586,112.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,172,024.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,318,786.80	
	CGB 2.8% 03/24/29	7,900,000.00	7,890,283.00	

		CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,771,975.50	
		CGB 2.85% 06/04/27	12,330,000.00	12,439,243.80	
		CGB 2.89% 11/18/31	5,510,000.00	5,532,921.60	
		CGB 2.91% 10/14/28	10,280,000.00	10,343,736.00	
		CGB 3.01% 05/13/28	3,950,000.00	4,007,551.50	
		CGB 3.02% 05/27/31	6,850,000.00	6,932,131.50	
		CGB 3.03% 03/11/26	26,760,000.00	27,245,158.80	
		CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,079,543.50	
		CGB 3.28% 12/03/27	5,410,000.00	5,580,739.60	
		CGB 3.39% 03/16/50	5,520,000.00	5,536,946.40	
		CGB 3.53% 10/18/51	2,950,000.00	3,059,032.00	
		CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,544,585.20	
		CGB 3.81% 09/14/50	7,460,000.00	8,055,382.60	
		CGB 3.86% 07/22/49	5,580,000.00	6,062,112.00	
		CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,621,037.40	
	オフショア人民元 小計		262,860,000.00	265,602,793.80 (5,106,744,916)	
合計				294,922,986,192 (294,922,986,192)	

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　219銘柄	100.0%	49.9%
カナダドル	国債証券　35銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券　344銘柄	100.0%	36.2%
イギリスポンド	国債証券　55銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　10銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券　26銘柄	100.0%	1.5%
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　28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　14銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券　23銘柄	100.0%	1.7%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 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
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。 (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。

	2022年 5月10日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (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）

1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 5月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 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

区分	2022年 5月10日現在
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
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

区分	2022年 5月10日現在
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
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

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△35,465,840,287

投資信託受益証券	10,171,836
投資証券	△297,232,719
合計	△35,752,901,170

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 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。

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	62,788	30.05	1,886,779.40	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	134.34	2,557,027.56	
	CHEVRON CORP	150,711	159.25	24,000,726.75	
	CONOCOPHILLIPS	104,031	97.20	10,111,813.20	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	29.32	1,876,480.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	51,677	62.02	3,205,007.54	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	129.49	1,717,943.83	
	EOG RESOURCES INC	46,119	117.94	5,439,274.86	
	EXXON MOBIL	330,112	84.46	27,881,259.52	
	HALLIBURTON CO	68,269	33.36	2,277,453.84	
	HESS CORP	22,781	106.73	2,431,416.13	
	KINDER MORGAN INC	159,310	18.60	2,963,166.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	48,069	90.86	4,367,549.34	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,966	57.84	4,046,833.44	
	ONEOK INC	33,279	61.71	2,053,647.09	
	PHILLIPS 66	35,503	89.48	3,176,808.44	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	244.39	4,453,763.36	
	SCHLUMBERGER	107,126	38.04	4,075,073.04	
	VALERO ENERGY CORP	30,763	118.45	3,643,877.35	
	WILLIAMS COS	98,553	34.74	3,423,731.22	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	233.22	4,090,912.02	
	ALBEMARLE CORP	9,440	221.64	2,092,281.60	
	AMCOR PLC	111,485	12.61	1,405,825.85	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	176.41	1,171,009.58	
	BALL CORP	25,605	69.49	1,779,291.45	
	CELANESE CORP-SERIES A	8,582	142.92	1,226,539.44	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,951	90.88	1,358,746.88	
	CORTEVA INC	58,500	53.08	3,105,180.00	
	CROWN HOLDINGS INC	9,940	101.73	1,011,196.20	
	DOW INC	57,346	66.63	3,820,963.98	
	DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	64.33	2,636,243.40	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	103.42	1,145,376.50	
	ECOLAB INC	19,895	163.81	3,258,999.95	
	FMC CORP	10,507	113.91	1,196,852.37	
	FREEPORT-MCMORAN INC	113,194	35.52	4,020,650.88	
	INT'L PAPER CO	30,800	47.81	1,472,548.00	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	119.49	2,329,338.06	

LINDE PLC	40,161	300.27	12,059,143.47	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,803	106.60	2,110,999.80	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,631	332.79	1,541,150.49	
MOSAIC CO/THE	27,732	55.86	1,549,109.52	
NEWMONT CORPORATION	61,555	68.92	4,242,370.60	
NUCOR CORP	22,299	130.03	2,899,538.97	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	160.78	1,235,915.86	
PPG INDUSTRIES INC	19,278	127.14	2,451,004.92	
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	84.94	888,132.64	
SEALED AIR CORP	11,690	64.21	750,614.90	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	276.97	5,461,571.43	
STEEL DYNAMICS INC	15,552	77.22	1,200,925.44	
VULCAN MATERIALS CO	10,247	162.95	1,669,748.65	
WESTROCK CO	21,356	51.31	1,095,776.36	
3 M COMPANY	44,860	152.38	6,835,766.80	
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	41.79	459,898.95	
ALLEGION PLC	7,601	113.85	865,373.85	
AMETEK INC	18,006	121.84	2,193,851.04	
BOEING CO	43,246	133.31	5,765,124.26	
CARRIER GLOBAL CORP	63,164	38.13	2,408,443.32	
CATERPILLAR	42,499	206.29	8,767,118.71	
CUMMINS INC	11,214	202.71	2,273,189.94	
DEERE&CO	23,252	364.53	8,476,051.56	
DOVER CORP	10,672	132.10	1,409,771.20	
EATON CORP	31,624	147.96	4,679,087.04	
EMERSON ELECTRIC CO	46,305	84.41	3,908,605.05	
FASTENAL CO	44,846	53.10	2,381,322.60	
FORTIVE CORP	25,722	59.23	1,523,514.06	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	71.22	734,278.20	
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	227.44	1,185,189.84	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	229.37	4,351,148.90	
GENERAL ELECTRIC CO	85,187	72.97	6,216,095.39	
GRAINGER (WW) INC	3,236	476.82	1,542,989.52	
HEICO CORP	3,640	133.00	484,120.00	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	108.65	700,683.85	
HONEYWELL INTL INC	53,646	193.96	10,405,178.16	
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	33.27	1,051,132.38	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	209.98	739,549.56	
IDEX CORP	5,916	189.00	1,118,124.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,227	209.44	5,074,102.88	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	43.25	1,365,056.50	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	54.12	957,924.00	

JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	51.77	2,934,789.53	
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	56.79	157,649.04	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	239.25	3,752,397.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	215.83	545,186.58	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,332	438.84	8,483,654.88	
MASCO CORP	19,462	53.76	1,046,277.12	
NORDSON CORP	4,121	208.73	860,176.33	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,737	453.98	5,328,363.26	
OTIS WORLDWIDE CORP	30,653	73.31	2,247,171.43	
OWENS CORNING	8,642	91.65	792,039.30	
PACCAR INC	28,106	85.35	2,398,847.10	
PARKER HANNIFIN CORP	9,900	271.19	2,684,781.00	
PENTAIR PLC	14,533	51.19	743,944.27	
PLUG POWER INC	41,884	16.63	696,530.92	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	117,233	91.75	10,756,127.75	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	203.22	1,848,895.56	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	432.92	3,599,296.88	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	44.52	615,622.56	
SMITH (A.O.) CORP	9,016	59.79	539,066.64	
SNAP-ON INC	4,000	217.96	871,840.00	
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	125.66	1,583,064.68	
SUNRUN INC	13,917	21.09	293,509.53	
TEXTRON	16,934	64.28	1,088,517.52	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	134.53	2,507,370.14	
TRANSDIGM GROUP INC	4,075	545.69	2,223,686.75	
UNITED RENTALS INC	5,393	286.82	1,546,820.26	
WABTEC CORP	15,024	86.87	1,305,134.88	
XYLEM INC	13,269	84.98	1,127,599.62	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	81.40	925,029.60	
CINTAS CORP	7,423	374.23	2,777,909.29	
CLARIVATE PLC	27,357	14.49	396,402.93	
COPART INC	16,617	108.69	1,806,101.73	
COSTAR GROUP INC	32,116	58.06	1,864,654.96	
EQUIFAX INC	9,509	199.63	1,898,281.67	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	130.26	1,388,701.86	
LEIDOS HOLDINGS	11,220	99.38	1,115,043.60	
REPUBLIC SERVICES INC	16,942	130.95	2,218,554.90	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	95.18	910,491.88	
ROLLINS INC	17,468	33.61	587,099.48	
TRANSUNION	15,741	82.51	1,298,789.91	
VERISK ANALYTICS INC	12,503	177.98	2,225,283.94	
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	122.92	2,615,123.00	

WASTE MANAGEMENT INC	32,770	159.24	5,218,294.80	
AMERCO	734	529.02	388,300.68	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	107.95	1,218,971.40	
CSX CORP	173,146	33.62	5,821,168.52	
DELTA AIR LINES INC	14,609	38.25	558,794.25	
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	109.76	1,566,494.72	
FEDEX CORP	19,524	208.27	4,066,263.48	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	2.80	232,430.80	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	172.50	1,216,470.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	49.88	533,716.00	
LYFT INC-A	21,288	18.61	396,169.68	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	249.50	4,762,206.50	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	271.20	2,170,413.60	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	43.83	593,151.39	
UBER TECHNOLOGIES INC	113,645	23.05	2,619,517.25	
UNION PACIFIC CORP	50,721	225.25	11,424,905.25	
UNITED PARCEL SERVICE B	56,644	181.43	10,276,920.92	
APTIV PLC	20,714	95.21	1,972,179.94	
BORGWARNER INC	19,781	36.82	728,336.42	
FORD MOTOR COMPANY	305,209	13.37	4,080,644.33	
GENERAL MOTORS CO	103,796	38.26	3,971,234.96	
LEAR CORP	5,287	128.00	676,736.00	
LUCID GROUP INC	31,234	16.35	510,675.90	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	22.78	304,409.14	
TESLA INC	66,795	787.11	52,575,012.45	
DR HORTON INC	27,764	69.93	1,941,536.52	
GARMIN LTD	12,854	102.70	1,320,105.80	
HASBRO INC	10,572	88.50	935,622.00	
LENNAR CORP-CL A	20,844	77.28	1,610,824.32	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	292.68	2,723,387.40	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	148.19	750,137.78	
NEWELL BRANDS INC	31,461	24.26	763,243.86	
NIKE B	99,467	111.21	11,061,725.07	
NVR INC	247	4,370.16	1,079,429.52	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	14.13	307,129.68	
PULTE GROUP INC	21,609	42.67	922,056.03	
VF CORP	25,718	47.51	1,221,862.18	
WHIRLPOOL CORP	5,220	193.34	1,009,234.80	
AIRBNB INC-CLASS A	23,026	119.37	2,748,613.62	
ARAMARK	20,955	34.27	718,127.85	
BOOKING HOLDINGS INC	3,187	2,023.57	6,449,117.59	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	52.95	929,802.00	

CARNIVAL CORPORATION	62,102	14.14	878,122.28	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,164	1,276.57	2,762,497.48	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	125.11	1,340,178.32	
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	333.60	950,092.80	
DRAFTKINGS INC	27,674	10.99	304,137.26	
EXPEDIA GROUP INC	11,638	127.79	1,487,220.02	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	133.31	2,916,556.18	
LAS VEGAS SANDS CORP	24,370	31.86	776,428.20	
MARRIOTT INTL A	21,139	163.85	3,463,625.15	
MCDONALD'S CORP	58,134	247.49	14,387,583.66	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	4.55	80,362.10	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	35.14	1,014,632.36	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	61.41	1,029,661.47	
STARBUCKS CORP	91,531	73.49	6,726,613.19	
VAIL RESORTS INC	3,014	235.73	710,490.22	
WYNN RESORTS LTD	9,302	61.33	570,491.66	
YUM BRANDS INC	22,637	110.10	2,492,333.70	
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	77.17	4,756,990.31	
ALPHABET INC-CL A	23,507	2,250.22	52,895,921.54	
ALPHABET INC-CL C	22,377	2,261.68	50,609,613.36	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	12.52	479,390.80	
CABLE ONE INC	445	1,113.64	495,569.80	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	463.67	4,548,139.03	
COMCAST CORP-CL A	356,721	39.76	14,183,226.96	
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	21.30	428,811.60	
ELECTRONIC ARTS INC	21,814	112.04	2,444,040.56	
FOX CORP - CLASS A	27,658	33.21	918,522.18	
FOX CORP- CLASS B	10,345	30.57	316,246.65	
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	72.63	488,146.23	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	32.47	1,098,589.98	
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	109.99	283,664.21	
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	114.76	1,293,115.68	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	55.59	854,918.61	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	38.46	522,440.64	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	38.62	246,550.08	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	85.37	1,053,721.91	
MATCH GROUP INC	20,191	70.71	1,427,705.61	
META PLATFORMS INC-CLASS A	185,146	196.21	36,327,496.66	
NETFLIX INC	34,441	173.10	5,961,737.10	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	17.50	585,882.50	
OMNICOM GROUP	16,538	77.37	1,279,545.06	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	27.44	1,333,199.84	

PINTEREST INC- CLASS A	45,767	21.08	964,768.36	
ROKU INC	9,122	87.77	800,637.94	
SEA LTD-ADR	25,116	64.62	1,622,995.92	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.05	365,831.40	
SNAP INC - A	83,375	23.39	1,950,141.25	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,973	106.15	952,483.95	
THE WALT DISNEY CO	141,614	106.98	15,149,865.72	
TWITTER INC	63,066	47.96	3,024,645.36	
WARNER BROS DISCOVERY INC	175,398	17.10	2,999,305.80	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	21,935	42.34	928,727.90	
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	202.64	1,078,855.36	
AMAZON.COM	35,733	2,175.78	77,747,146.74	
AUTOZONE INC	1,639	1,951.66	3,198,770.74	
BATH & BODY WORKS INC	19,806	50.34	997,034.04	
BEST BUY COMPANY INC	18,175	91.08	1,655,379.00	
BURLINGTON STORES INC	5,108	188.62	963,470.96	
CARMAX INC	12,051	92.81	1,118,453.31	
CARVANA CO	5,700	38.77	220,989.00	
CHEWY INC - CLASS A	6,878	26.33	181,097.74	
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	231.37	4,323,379.82	
DOLLAR TREE INC	17,931	161.53	2,896,394.43	
DOORDASH INC - A	8,334	64.18	534,876.12	
EBAY	51,021	49.26	2,513,294.46	
ETSY INC	10,294	86.40	889,401.60	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,486	42.87	63,704.82	
GENUINE PARTS CO	10,119	131.94	1,335,100.86	
HOME DEPOT	81,549	297.03	24,222,499.47	
LKQ CORP	22,779	50.06	1,140,316.74	
LOWES COMPANIES	52,191	196.07	10,233,089.37	
MERCADOLIBRE INC	3,567	770.99	2,750,121.33	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	610.07	3,298,648.49	
POOL CORP	3,304	399.84	1,321,071.36	
ROSS STORES INC	28,076	93.41	2,622,579.16	
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,156	224.20	8,330,375.20	
TJX COMPANIES INC	93,142	59.14	5,508,417.88	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	198.24	1,768,697.28	
ULTA BEAUTY INC	3,990	381.09	1,520,549.10	
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	62.35	374,100.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,433	498.83	17,176,213.39	
KROGER CO	56,126	54.84	3,077,949.84	
SYSCO CORP	40,288	81.08	3,266,551.04	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	43.85	2,620,782.95	

WALMART INC	120,012	151.31	18,159,015.72	
ALTRIA GROUP INC	142,972	55.26	7,900,632.72	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,967	84.36	3,624,696.12	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	64.84	1,556,549.04	
BUNGE LIMITED	11,604	107.83	1,251,259.32	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	51.39	815,507.91	
COCA-COLA CO	319,753	64.61	20,659,241.33	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	48.85	751,996.90	
CONAGRA BRANDS INC	35,941	36.29	1,304,298.89	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	246.24	3,186,345.60	
GENERAL MILLS INC	46,541	73.50	3,420,763.50	
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	223.20	2,533,766.40	
HORMEL FOODS CORP	23,338	52.55	1,226,411.90	
JM SMUCKER CO	9,145	145.01	1,326,116.45	
KELLOGG CO	21,630	74.53	1,612,083.90	
KEURIG DR PEPPER INC	52,526	37.14	1,950,815.64	
KRAFT HEINZ CO/THE	52,188	44.19	2,306,187.72	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,909	98.52	1,862,914.68	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	53.67	787,285.23	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,376	66.28	7,183,161.28	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	83.57	2,696,553.19	
PEPSICO INC	107,665	171.70	18,486,080.50	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	121,262	99.87	12,110,435.94	
TYSON FOODS INC	21,804	92.84	2,024,283.36	
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,995	98.36	1,769,988.20	
CLOROX COMPANY	9,570	157.43	1,506,605.10	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	77.67	4,954,413.96	
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	233.58	4,306,748.04	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,886	140.34	3,632,841.24	
PROCTER & GAMBLE CO	189,391	155.61	29,471,133.51	
ABBOTT LABORATORIES	138,079	107.39	14,828,303.81	
ABIOMED INC	3,781	234.10	885,132.10	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	268.96	1,598,429.28	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	157.32	2,028,798.72	
ANTHEM INC	18,926	490.88	9,290,394.88	
BAXTER INTERNATIONAL	38,403	73.62	2,827,228.86	
BECTON DICKINSON & CO	22,232	252.20	5,606,910.40	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	38.29	4,319,188.58	
CARDINAL HEALTH	21,902	56.97	1,247,756.94	
CENTENE CORP	44,550	79.19	3,527,914.50	
CERNER CORP	22,894	93.67	2,144,480.98	
CIGNA CORP	26,327	261.41	6,882,141.07	

CVS HEALTH CORP	102,569	98.86	10,139,971.34	
DAVITA INC	5,784	104.37	603,676.08	
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	39.25	697,629.50	
DEXCOM INC	7,647	330.02	2,523,662.94	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,336	94.69	4,576,935.84	
HCA HEALTHCARE INC	19,440	224.10	4,356,504.00	
HENRY SCHEIN INC	11,747	85.00	998,495.00	
HOLOGIC INC	19,018	72.76	1,383,749.68	
HUMANA INC	9,953	424.51	4,225,148.03	
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	345.02	2,329,230.02	
INMODE LTD	5,500	21.90	120,450.00	
INSULET CORP	5,311	191.46	1,016,844.06	
INTUITIVE SURGICAL INC	27,694	208.71	5,780,014.74	
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	241.26	1,832,369.70	
MASIMO CORP	4,147	120.51	499,754.97	
MCKESSON CORP	12,089	326.47	3,946,695.83	
MEDTRONIC PLC	104,586	99.58	10,414,673.88	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	296.50	1,347,592.50	
NOVOCURE LTD	7,933	62.84	498,509.72	
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	136.21	1,362,781.05	
RESMED INC	11,440	192.74	2,204,945.60	
STERIS PLC	8,018	213.16	1,709,116.88	
STRYKER CORP	26,295	229.01	6,021,817.95	
TELADOC HEALTH INC	11,375	30.52	347,165.00	
TELEFLEX INC	3,934	259.70	1,021,659.80	
THE COOPER COS INC	4,134	311.61	1,288,195.74	
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,563	486.42	35,782,514.46	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	125.33	764,763.66	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	166.12	1,869,680.60	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	115.00	1,872,315.00	
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	47.40	268,047.00	
ABBVIE INC	137,691	150.96	20,785,833.36	
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	113.11	2,690,321.35	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	122.52	1,181,460.36	
AMGEN	44,045	239.24	10,537,325.80	
AVANTOR INC	42,980	29.37	1,262,322.60	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	479.05	887,679.65	
BIO-TECHNE CORP	3,245	347.06	1,126,209.70	
BIOGEN INC	11,860	187.54	2,224,224.40	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	74.62	1,103,107.46	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	172,791	76.27	13,178,769.57	
CATALENT INC	13,739	93.70	1,287,344.30	

CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	228.85	962,085.40	
DANAHER CORP	50,501	239.37	12,088,424.37	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	21.84	787,572.24	
EXACT SCIENCES CORP	14,756	50.27	741,784.12	
GILEAD SCIENCES INC	97,060	61.68	5,986,660.80	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	83.26	1,492,518.76	
ILLUMINA INC	11,258	220.68	2,484,415.44	
INCYTE CORP	15,212	72.65	1,105,151.80	
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	204.07	3,086,762.82	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	141.87	705,235.77	
JOHNSON & JOHNSON	205,370	177.33	36,418,262.10	
LILLY (ELI) & CO	63,296	289.23	18,307,102.08	
MERCK & CO	197,066	87.64	17,270,864.24	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,196.07	2,162,494.56	
MODERNA INC	27,309	135.80	3,708,562.20	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	75.79	642,244.46	
NOVAVAX INC	5,754	53.26	306,458.04	
PERKINELMER INC	9,372	142.45	1,335,041.40	
PFIZER	437,000	48.64	21,255,680.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,116	599.77	4,867,733.32	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	37.53	980,583.84	
SEAGEN INC	10,071	108.81	1,095,825.51	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	7.42	596,575.42	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,643	517.39	15,854,381.77	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,030	235.02	4,707,450.60	
VIATRIS INC	90,748	10.48	951,039.04	
WATERS CORP	4,749	316.29	1,502,061.21	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	296.82	1,711,760.94	
ZOETIS INC	36,750	161.81	5,946,517.50	
BANK OF AMERICA CORP	576,261	36.37	20,958,612.57	
CITIGROUP	155,162	49.89	7,741,032.18	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	32,251	39.42	1,271,334.42	
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	36.80	1,943,150.40	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	640.14	608,133.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	144.23	1,988,499.01	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.16	1,501,713.92	
JPMORGAN CHASE & CO	231,226	121.86	28,177,200.36	
KEY CORP	71,472	19.18	1,370,832.96	
M & T BANK CORP	14,037	168.03	2,358,637.11	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,936	163.67	5,390,635.12	
REGIONS FINL CORP	70,814	20.57	1,456,643.98	
SIGNATURE BANK	4,686	220.03	1,031,060.58	

SVB FINANCIAL GROUP	4,545	469.81	2,135,286.45	
TRUIST FINANCIAL CORP	103,413	48.57	5,022,769.41	
US BANCORP	109,092	49.44	5,393,508.48	
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	47.18	673,400.14	
WELLS FARGO & CO	311,895	43.96	13,710,904.20	
ALLY FINANCIAL INC	27,761	40.60	1,127,096.60	
AMERICAN EXPRESS	51,483	161.02	8,289,792.66	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	259.64	2,259,387.28	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	26,880	49.55	1,331,904.00	
BANK NEW YORK CO	61,254	43.21	2,646,785.34	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,985	312.96	31,917,225.60	
BLACKROCK INC	11,820	605.56	7,157,719.20	
BLACKSTONE INC	54,507	96.66	5,268,646.62	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	123.22	4,097,804.32	
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	35.52	447,374.40	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	107.19	951,311.25	
CME GROUP INC	27,828	201.60	5,610,124.80	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,868	83.51	239,506.68	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	107.27	2,510,439.81	
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,355	28.32	774,693.60	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	363.84	1,145,368.32	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	24.84	647,578.80	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	28.35	122,358.60	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,636	308.89	8,227,594.04	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	96.99	4,335,743.97	
INVESCO LTD	26,420	17.71	467,898.20	
KKR & CO INC	39,913	49.86	1,990,062.18	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	257.01	824,231.07	
MOODY'S CORP	13,365	285.63	3,817,444.95	
MORGAN STANLEY	106,388	81.15	8,633,386.20	
MSCI INC	6,518	379.08	2,470,843.44	
NASDAQ INC	9,657	146.18	1,411,660.26	
NORTHERN TRUST CORP	15,902	104.75	1,665,734.50	
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	122.44	2,192,533.08	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	93.63	1,449,954.18	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	13,050	9.50	123,975.00	
S&P GLOBAL INC	27,736	328.77	9,118,764.72	
SCHWAB (CHARLES) CORP	112,432	64.13	7,210,264.16	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	54.86	523,913.00	
SOFI TECHNOLOGIES INC	38,996	5.97	232,806.12	
STATE STREET CORP	27,998	69.25	1,938,861.50	
SYNCHRONY FINANCIAL	45,369	37.03	1,680,014.07	

TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	60.48	548,009.28	
UPSTART HOLDINGS INC	3,148	77.13	242,805.24	
AFLAC	50,591	57.56	2,912,017.96	
ALLEGHANY CORP	906	830.57	752,496.42	
ALLSTATE CORP	23,095	128.96	2,978,331.20	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	144.20	911,199.80	
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	59.61	3,928,179.78	
AON PLC	17,508	275.09	4,816,275.72	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	45.22	1,344,209.72	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	160.19	2,620,548.21	
ASSURANT INC	4,726	180.97	855,264.22	
BROWN & BROWN INC	19,873	56.58	1,124,414.34	
CHUBB LTD	33,670	205.11	6,906,053.70	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	125.02	1,599,130.82	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	165.81	359,144.46	
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	280.56	922,481.28	
FNF GROUP	20,461	40.37	826,010.57	
GLOBE LIFE INC	8,106	98.54	798,765.24	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	70.80	1,962,646.80	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	55.77	752,002.68	
LOEWS CORP	16,741	63.08	1,056,022.28	
MARKEL CORP	1,156	1,287.07	1,487,852.92	
MARSH & MCLENNAN COS	39,216	157.05	6,158,872.80	
METLIFE INC	57,127	65.64	3,749,816.28	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	68.99	1,429,403.81	
PROGRESSIVE CORP	45,110	108.75	4,905,712.50	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,511	105.11	3,101,901.21	
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	171.92	3,399,202.24	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,061	207.77	2,090,373.97	
WR BERKLEY CORP	17,572	67.23	1,181,365.56	
CBRE GROUP INC-A	25,382	79.51	2,018,122.82	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.72	465,864.00	
WEYERHAEUSER CO	58,295	39.22	2,286,329.90	
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	36.52	200,750.44	
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	37.18	499,215.86	
ACCENTURE PLC-CL A	49,381	287.49	14,196,543.69	
ADOBE INC	37,107	376.91	13,985,999.37	
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	20.59	263,881.44	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	13,673	95.50	1,305,771.50	
ANSYS INC	6,794	249.17	1,692,860.98	
ASANA INC - CL A	4,986	22.44	111,885.84	
AUTODESK INC	17,467	186.32	3,254,451.44	

AUTOMATIC DATA PROCESS	32,782	209.79	6,877,335.78	
AVALARA INC	6,847	75.61	517,701.67	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	36.18	506,375.28	
BILL.COM HOLDINGS INC	5,794	107.91	625,230.54	
BLACK KNIGHT INC	11,543	70.08	808,933.44	
BLOCK INC	39,674	83.86	3,327,061.64	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	137.71	1,341,570.82	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	137.18	3,007,259.96	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	52.43	559,323.24	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	119.29	969,111.96	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	100.02	1,044,608.88	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	56.56	1,147,206.48	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,421	76.27	3,082,909.67	
COUPA SOFTWARE INC	6,059	68.55	415,344.45	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,479	143.69	2,080,487.51	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	112.86	349,866.00	
DATADOG INC - CLASS A	17,059	97.53	1,663,764.27	
DOCUSIGN INC	14,969	68.63	1,027,322.47	
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	20.48	590,745.60	
DYNATRACE INC	14,790	31.92	472,096.80	
EPAM SYSTEMS INC	4,403	317.89	1,399,669.67	
FAIR ISAAC CORP	2,125	341.44	725,560.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	48,175	94.54	4,554,464.50	
FISERV INC	46,421	93.63	4,346,398.23	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	216.61	1,300,093.22	
FORTINET INC	10,645	245.22	2,610,366.90	
GARTNER INC	6,340	239.32	1,517,288.80	
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	118.38	2,671,481.46	
GODADDY INC - CLASS A	13,798	69.89	964,342.22	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	74.08	468,037.44	
HUBSPOT INC	3,646	332.91	1,213,789.86	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	69,612	134.44	9,358,637.28	
INTUIT INC	21,247	367.01	7,797,861.47	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	177.33	1,115,583.03	
MASTERCARD INC-CLASS A	68,686	327.99	22,528,321.14	
MICROSOFT CORP	558,777	264.58	147,841,218.66	
MONGODB INC	4,623	252.72	1,168,324.56	
NORTONLIFELOCK INC	43,549	24.57	1,069,998.93	
OKTA INC	11,505	88.83	1,021,989.15	
ORACLE CORP	128,255	71.54	9,175,362.70	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	7.46	934,320.24	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,648	459.51	3,514,332.48	

PAYCHEX INC	25,433	120.27	3,058,826.91	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	280.17	1,186,519.95	
PAYPAL HOLDINGS INC	88,224	79.53	7,016,454.72	
PTC INC	8,304	106.55	884,791.20	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	68.66	438,943.38	
SALESFORCE INC	76,228	163.60	12,470,900.80	
SERVICENOW INC	15,383	425.87	6,551,158.21	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,606	143.29	2,379,473.74	
SPLUNK INC	13,355	90.04	1,202,484.20	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	60.37	1,167,253.95	
SYNOPSYS INC	12,038	262.41	3,158,891.58	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,090	44.99	1,488,719.10	
TWILIO INC - A	12,842	100.75	1,293,831.50	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	354.20	1,182,673.80	
UNITY SOFTWARE INC	4,329	50.38	218,095.02	
VERISIGN INC	7,790	164.86	1,284,259.40	
VISA INC-CLASS A SHARES	130,637	193.00	25,212,941.00	
VMWARE INC-CLASS A	16,717	99.19	1,658,159.23	
WESTERN UNION CO	29,297	17.19	503,615.43	
WIX.COM LTD	5,010	64.63	323,796.30	
WORKDAY INC-CLASS A	14,681	176.21	2,586,939.01	
ZENDESK INC	8,890	99.14	881,354.60	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	92.34	1,572,365.52	
ZSCALER INC	6,234	153.09	954,363.06	
AMPHENOL CORPORATION	45,988	69.09	3,177,310.92	
APPLE INC	1,284,469	152.06	195,316,356.14	
ARISTA NETWORKS INC	18,880	102.48	1,934,822.40	
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	124.74	760,914.00	
CDW CORP/DE	10,882	164.80	1,793,353.60	
CISCO SYSTEMS	328,253	48.96	16,071,266.88	
COGNEX CORP	14,352	49.12	704,970.24	
CORNING	64,989	35.76	2,324,006.64	
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	45.19	1,015,916.39	
F5 INC	4,150	166.44	690,726.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	15.84	1,564,073.28	
HP INC	92,346	37.01	3,417,725.46	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	100.78	323,201.46	
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	30.70	777,354.70	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	132.20	1,981,545.80	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,961	202.08	2,619,158.88	
NETAPP INC	18,303	71.32	1,305,369.96	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,060	80.36	1,210,221.60	

TE CONNECTIVITY LTD	26,068	123.29	3,213,923.72	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	399.00	1,555,701.00	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	61.96	1,312,064.96	
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	56.53	1,457,908.70	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	328.54	1,367,383.48	
AT&T INC	555,579	19.55	10,861,569.45	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	21.85	339,024.60	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	22.76	625,604.12	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	11.15	822,524.35	
T-MOBILE US INC	49,657	121.73	6,044,746.61	
VERIZON COMMUNICATIONS	322,452	48.62	15,677,616.24	
AES CORP	54,375	20.06	1,090,762.50	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	58.72	1,220,084.16	
AMEREN CORPORATION	20,898	92.68	1,936,826.64	
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,104	99.69	3,798,587.76	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	145.79	2,066,427.46	
ATMOS ENERGY CORP	9,688	113.63	1,100,847.44	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	30.38	1,463,161.56	
CMS ENERGY CORP	23,697	69.18	1,639,358.46	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,507	94.38	2,596,110.66	
CONSTELLATION ENERGY	25,732	57.62	1,482,677.84	
DOMINION ENERGY INC	62,375	83.77	5,225,153.75	
DTE ENERGY COMPANY	14,651	129.52	1,897,597.52	
DUKE ENERGY CORP	59,845	110.80	6,630,826.00	
EDISON INTL	28,027	70.06	1,963,571.62	
ENTERGY CORP	15,166	119.26	1,808,697.16	
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,002	43.42	738,226.84	
EVERGY INC	18,475	67.90	1,254,452.50	
EVERSOURCE ENERGY	26,753	90.54	2,422,216.62	
EXELON CORP	77,196	46.73	3,607,369.08	
FIRSTENERGY CORP	41,156	42.17	1,735,548.52	
NEXTERA ENERGY INC	152,538	70.71	10,785,961.98	
NISOURCE INC	28,687	29.44	844,545.28	
NRG ENERGY INC	19,068	41.43	789,987.24	
PG&E CORP	118,132	12.09	1,428,215.88	
PPL CORPORATION	58,459	28.79	1,683,034.61	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	69.06	2,725,660.08	
SEMPRA ENERGY	24,535	162.03	3,975,406.05	
SOUTHERN CO	84,113	74.23	6,243,707.99	
UGI CORP	18,019	37.60	677,514.40	
VISTRA CORP	37,797	24.13	912,041.61	
WEC ENERGY GROUP INC	24,561	101.94	2,503,748.34	

	XCEL ENERGY INC	43,741	73.65	3,221,524.65	
	ADVANCED MICRO DEVICES	127,867	86.36	11,042,594.12	
	ANALOG DEVICES	41,625	152.25	6,337,406.25	
	APPLIED MATERIALS	71,368	105.75	7,547,166.00	
	BROADCOM INC	32,460	562.92	18,272,383.20	
	ENPHASE ENERGY INC	10,113	150.51	1,522,107.63	
	ENTEGRIS INC	10,491	105.50	1,106,800.50	
	INTEL CORP	318,822	43.07	13,731,663.54	
	KLA CORP	12,119	318.87	3,864,385.53	
	LAM RESEARCH CORP	10,992	447.15	4,915,072.80	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	63,360	53.73	3,404,332.80	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	42,031	64.31	2,703,013.61	
	MICRON TECHNOLOGY	87,336	67.93	5,932,734.48	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	406.74	1,436,198.94	
	NVIDIA CORP	196,119	169.50	33,242,170.50	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	172.90	3,604,619.20	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	31,766	50.82	1,614,348.12	
	QORVO INC	8,556	102.76	879,214.56	
	QUALCOMM	87,800	134.92	11,845,976.00	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	102.17	1,366,217.24	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	3,750	225.36	845,100.00	
	TERADYNE INC	12,318	100.22	1,234,509.96	
	TEXAS INSTRUMENTS	71,796	164.94	11,842,032.24	
アメリカドル 小計		25,007,719		2,709,861,102.90 (352,363,239,210)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	27.33	734,630.40	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	76.16	7,097,655.04	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	24.36	2,354,783.76	
	ENBRIDGE	156,497	56.45	8,834,255.65	
	IMPERIAL OIL	16,573	63.39	1,050,562.47	
	KEYERA CORP	18,607	31.53	586,678.71	
	PARKLAND CORP	14,075	34.09	479,816.75	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	49.18	2,245,853.88	
	SUNCOR ENERGY	116,208	45.28	5,261,898.24	
	TC ENERGY CORP	77,328	69.67	5,387,441.76	
	TOURMALINE OIL CORP	22,173	68.75	1,524,393.75	
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	70.33	2,556,776.82	
	BARRICK GOLD CORP	139,009	27.93	3,882,521.37	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	54.69	718,571.91	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	31.24	1,343,320.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	184.09	2,828,174.67	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	9.18	475,955.46	

KINROSS GOLD CORP	108,451	5.93	643,114.43	
LUNDIN MINING CORP	62,243	10.47	651,684.21	
NUTRIEN LTD	44,786	120.85	5,412,388.10	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	29.06	535,023.66	
TECK RESOURCES LTD-CL B	34,747	47.64	1,655,347.08	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	117.31	915,018.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	55.31	1,893,703.78	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	8.97	176,924.28	
CAE INC	25,999	29.06	755,530.94	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,585	107.84	602,286.40	
WSP GLOBAL INC	8,602	138.50	1,191,377.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	36.54	493,472.70	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	66.31	679,345.95	
THOMSON REUTERS CORP	13,293	122.57	1,629,323.01	
AIR CANADA	13,805	20.63	284,797.15	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	55,489	144.31	8,007,617.59	
CP RAILWAY LIMITED	73,737	89.99	6,635,592.63	
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	104.19	608,157.03	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	74.95	1,744,985.90	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	38.87	663,860.73	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	66.11	1,525,356.03	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.57	434,264.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	34.87	1,235,165.14	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,579	170.04	608,573.16	
DOLLARAMA INC	22,000	70.17	1,543,740.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	54.92	3,705,287.64	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	42.36	646,117.08	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	116.18	1,500,232.34	
METRO INC	18,840	69.14	1,302,597.60	
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	158.84	830,097.84	
SAPUTO INC	20,898	26.04	544,183.92	
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	16.78	349,024.00	
CANOPY GROWTH CORP	20,989	7.23	151,750.47	
BANK MONTREAL	51,389	132.49	6,808,528.61	
BANK NOVA SCOTIA	96,500	81.40	7,855,100.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK	34,494	139.31	4,805,359.14	
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	89.40	2,439,636.60	
ROYAL BANK OF CANADA	110,677	127.73	14,136,773.21	
TORONTO-DOMINION BANK	141,487	92.49	13,086,132.63	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	110,505	60.27	6,660,136.35	
IGM FINANCIAL INC	7,685	36.48	280,348.80	
ONEX CORP	6,603	71.94	475,019.82	

	TMX GROUP LTD	4,685	132.32	619,919.20	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	667.79	1,424,396.07	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	33.74	802,607.12	
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	66.42	670,775.58	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,312	177.31	2,360,350.72	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	147,886	24.53	3,627,643.58	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	36.46	1,588,817.42	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	64.10	2,929,498.20	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	155.63	418,644.70	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.67	262,798.00	
	CGI INC - CL A	16,178	102.59	1,659,701.02	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,527	1,922.75	2,936,039.25	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	23.51	195,038.96	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	58.22	250,404.22	
	OPEN TEXT CORP	20,463	47.96	981,405.48	
	SHOPIFY INC - CLASS A	8,756	442.39	3,873,566.84	
	BCE INC	6,203	69.97	434,023.91	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	64.19	1,679,659.73	
	TELUS CORP	32,908	31.81	1,046,803.48	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	17.66	915,105.88	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	28.40	692,818.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	45.35	512,228.25	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	39.57	408,520.68	
	EMERA INC	18,723	63.00	1,179,549.00	
	FORTIS INC	36,823	63.96	2,355,199.08	
	HYDRO ONE LTD	23,269	35.59	828,143.71	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	38.46	686,664.84	
カナダドル 小計		3,100,298		188,806,588.51 (18,858,002,060)	
ユーロ	ENI	197,669	13.07	2,585,115.18	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	27,945	10.25	286,436.25	
	NESTE OIL OYJ	32,126	38.93	1,250,665.18	
	OMV AG	12,549	45.51	571,104.99	
	REPSOL SA	111,112	13.57	1,507,789.84	
	TENARIS SA	40,648	13.98	568,259.04	
	TOTALENERGIES SE	194,564	48.13	9,365,338.14	
	AIR LIQUIDE	36,913	156.86	5,790,173.18	
	AKZO NOBEL	15,301	79.20	1,211,839.20	
	ARCELORMITTAL	55,231	25.95	1,433,244.45	
	ARKEMA	4,369	111.70	488,017.30	
	BASF SE	71,168	47.08	3,350,589.44	
	COVESTRO AG	14,454	37.54	542,603.16	

CRH PLC	59,653	36.27	2,163,912.57	
EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	24.70	396,113.90	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	27.90	160,759.80	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	53.74	700,823.34	
KONINKLIJKE DSM NV	13,707	142.00	1,946,394.00	
LANXESS	7,293	34.24	249,712.32	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	37.78	736,861.12	
SOLVAY SA	5,356	90.24	483,325.44	
STORA ENSO OYJ R	42,169	17.47	736,692.43	
SYMRISE AG	9,776	98.40	961,958.40	
UMICORE	17,605	38.40	676,032.00	
UPM KYMMENE OYJ	42,324	31.22	1,321,355.28	
VOESTALPINE AG	7,152	23.34	166,927.68	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,143	23.64	499,820.52	
AIRBUS SE	45,872	103.72	4,757,843.84	
ALSTOM	24,388	22.76	555,070.88	
BOUYGUES ORD	16,606	30.63	508,641.78	
BRENNTAG SE	12,514	65.82	823,671.48	
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.90	1,045,235.40	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	25.76	860,074.88	
DASSAULT AVIATION SA	2,130	155.60	331,428.00	
EIFFAGE	5,924	92.70	549,154.80	
FERROVIAL SA	33,914	22.98	779,343.72	
GEA GROUP AG	13,382	33.92	453,917.44	
IMCD NV	4,641	125.25	581,285.25	
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	76.90	953,406.20	
KION GROUP AG	5,887	46.74	275,158.38	
KNORR-BREMSE AG	5,022	66.66	334,766.52	
KONE OYJ-B	26,311	42.32	1,113,481.52	
LEGRAND SA	21,768	78.02	1,698,339.36	
MTU AERO ENGINES AG	3,962	179.30	710,386.60	
PRYSMIAN SPA	21,155	28.06	593,609.30	
RATIONAL AG	483	509.50	246,088.50	
SAFRAN SA	26,190	92.28	2,416,813.20	
SAINT-GOBAIN	40,093	51.80	2,076,817.40	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,726	121.90	5,086,399.40	
SIEMENS	59,486	111.70	6,644,586.20	
SIEMENS ENERGY AG	26,851	16.68	447,874.68	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	13.08	293,561.97	
THALES SA	7,437	118.20	879,053.40	
VINCI S.A.	41,084	89.34	3,670,444.56	
WARTSILA OYJ	41,917	7.02	294,257.34	

BUREAU VERITAS SA	25,073	25.46	638,358.58	
RANDSTAD NV	7,558	47.75	360,894.50	
TELEPERFORMANCE	4,734	304.70	1,442,449.80	
WOLTERS KLUWER	20,839	93.32	1,944,695.48	
ADP	2,382	130.95	311,922.90	
AENA SME SA	5,508	129.55	713,561.40	
ATLANTIA SPA	35,937	22.89	822,597.93	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.76	306,881.42	
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	36.26	2,854,169.64	
GETLINK	29,362	17.17	504,145.54	
INPOST SA	12,480	5.66	70,686.72	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	77.62	2,026,425.34	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	70.40	351,366.40	
CONTINENTAL AG	8,168	60.42	493,510.56	
FAURECIA	10,948	19.55	214,088.14	
FERRARI NV	10,170	182.00	1,850,940.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	66,777	60.56	4,044,015.12	
MICHELIN	13,839	113.60	1,572,110.40	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	74.56	875,707.20	
RENAULT SA	17,362	22.45	389,863.71	
STELLANTIS NV	159,744	12.70	2,028,748.80	
VALEO SA	21,538	16.84	362,699.92	
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,282	142.72	2,038,327.04	
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	190.80	474,328.80	
ADIDAS AG	14,703	173.54	2,551,558.62	
ESSILORLUXOTTICA	22,072	151.85	3,351,633.20	
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,015.00	2,577,085.00	
KERING	5,855	442.45	2,590,544.75	
LVMH	21,584	542.60	11,711,478.40	
MONCLER SPA	14,361	41.83	600,720.63	
PUMA SE	9,220	63.30	583,626.00	
SEB SA	2,282	105.30	240,294.60	
ACCOR	14,436	28.91	417,344.76	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	93.02	1,213,724.96	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.04	259,780.32	
SODEXO	6,027	67.50	406,822.50	
BOLLORE SE	83,646	4.55	380,589.30	
PUBLICIS GROUPE	17,077	52.60	898,250.20	
SCOUT24 SE	7,492	58.08	435,135.36	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	44.01	311,194.71	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	19.75	1,210,039.19	
VIVENDI SE	61,243	10.85	664,792.76	

DELIVERY HERO SE	13,414	25.64	343,934.96	
INDITEX	87,326	20.07	1,752,632.82	
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	18.57	289,296.61	
PROSUS	72,497	40.06	2,904,592.30	
ZALANDO SE	17,664	31.90	563,481.60	
CARREFOUR	52,544	20.60	1,082,406.40	
COLRUYT SA	5,424	34.26	185,826.24	
HELLOFRESH SE	13,805	34.48	475,996.40	
JERONIMO MARTINS	24,901	19.20	478,099.20	
KESKO OYJ-B SHS	20,083	23.77	477,372.91	
KONINKLIJKE AHOLD NV	79,170	27.66	2,189,842.20	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,711	50.92	3,498,764.12	
DANONE (GROUPE)	51,543	55.89	2,880,738.27	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	9.56	469,274.27	
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	70.95	656,358.45	
HEINEKEN NV	20,157	90.18	1,817,758.26	
JDE PEET'S BV	7,000	27.52	192,640.00	
KERRY GROUP PLC-A	13,050	95.22	1,242,621.00	
PERNOD-RICARD	15,976	176.20	2,814,971.20	
REMY COINTREAU	1,382	164.20	226,924.40	
BEIERSDORF AG	7,430	89.04	661,567.20	
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	60.35	529,873.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	61.42	886,843.38	
LOREAL	19,839	304.40	6,038,991.60	
AMPLIFON SPA	11,650	33.59	391,323.50	
BIOMERIEUX	3,044	88.38	269,028.72	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	105.45	361,693.50	
DIASORIN SPA	2,070	114.15	236,290.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	14,472	57.56	833,008.32	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	34.03	1,146,436.67	
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	23.44	1,682,295.97	
ORPEA	4,336	30.79	133,505.44	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	314.90	574,377.60	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	49.70	1,071,879.90	
ARGENX SE	3,428	277.60	951,612.80	
BAYER	76,002	58.72	4,462,837.44	
EUROAPI SASU	3,828	13.80	52,834.05	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	84.80	866,656.00	
GRIFOLS SA	27,685	17.35	480,334.75	
IPSEN	3,532	92.35	326,180.20	
MERCK KGAA	10,555	163.45	1,725,214.75	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	35.22	347,057.88	

QIAGEN N.V.	17,038	42.87	730,419.06	
RECORDATI SPA	9,859	41.44	408,556.96	
SANOFI	88,048	96.46	8,493,110.08	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,939	286.50	555,523.50	
UCB (GROUPE)	9,389	99.46	933,829.94	
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.97	438,132.97	
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.57	2,449,151.41	
BANCO SANTANDER SA	1,339,491	2.60	3,482,676.60	
BNP PARIBAS	86,730	49.85	4,323,490.50	
CAIXABANK	330,447	2.93	969,861.94	
COMMERZBANK AG	81,889	6.04	495,264.67	
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	9.90	886,198.50	
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	27.58	659,299.90	
FINECOBANK SPA	53,120	11.74	623,894.40	
ING GROEP NV-CVA	301,618	8.70	2,624,679.83	
INTESA SANPAOLO	1,251,055	1.83	2,289,430.65	
KBC GROEP NV	18,608	61.78	1,149,602.24	
MEDIOBANCA	53,990	9.62	519,383.80	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	10.84	135,391.60	
SOCIETE GENERALE	63,329	22.00	1,393,238.00	
UNICREDIT SPA	168,352	8.02	1,350,351.39	
AMUNDI SA	4,626	53.35	246,797.10	
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	8.95	1,438,450.02	
DEUTSCHE BOERSE	14,999	158.65	2,379,591.35	
EURAZEO SA	3,357	66.40	222,904.80	
EURONEXT NV	6,480	70.62	457,617.60	
EXOR NV	7,825	61.68	482,646.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	82.44	701,976.60	
SOFINA	1,238	269.40	333,517.20	
WENDEL	2,023	86.00	173,978.00	
AEGON	114,647	4.73	543,312.13	
AGEAS	11,086	43.31	480,134.66	
ALLIANZ SE-REG	32,037	191.66	6,140,211.42	
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	17.44	1,493,509.28	
AXA SA	148,584	22.24	3,304,508.16	
CNP ASSURANCES	16,287	20.90	340,398.30	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	137.20	594,487.60	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,795	213.70	2,306,891.50	
NN GROUP NV	22,611	45.24	1,022,921.64	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	8.76	403,634.88	
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	43.21	1,670,282.55	
AROUNDTOWN SA	64,068	4.44	284,718.19	

LEG IMMOBILIEN SE	5,275	92.18	486,249.50	
VONOVIA SE	59,080	32.71	1,932,506.80	
ADYEN NV	1,566	1,403.40	2,197,724.40	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	58.28	2,073,835.52	
BECHTLE AG	7,659	39.79	304,751.61	
CAPGEMINI SA	12,715	177.75	2,260,091.25	
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	37.74	1,991,426.58	
EDENRED	18,664	44.45	829,614.80	
NEMETSCHEK SE	5,455	61.74	336,791.70	
NEXI SPA	31,458	9.24	290,671.92	
SAP SE	81,213	90.77	7,371,704.01	
WORLDLINE SA	20,332	35.65	724,835.80	
NOKIA OYJ	427,600	4.55	1,949,642.20	
CELLNEX TELECOM SA	41,435	40.16	1,664,029.60	
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	17.14	4,424,573.04	
ELISA A	10,227	53.60	548,167.20	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.89	300,469.50	
KPN (KON.)	282,927	3.31	938,185.93	
ORANGE	153,815	11.64	1,790,714.23	
PROXIMUS	13,141	16.42	215,775.22	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.25	216,718.71	
TELEFONICA	417,939	4.63	1,935,475.50	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.85	281,535.18	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	30.38	289,004.94	
E.ON SE	170,377	9.76	1,663,220.27	
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	20.07	430,822.62	
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	8.05	318,381.17	
ELIA GROUP SA/NV	2,925	144.70	423,247.50	
ENAGAS	15,690	20.48	321,331.20	
ENDESA	25,972	19.29	500,999.88	
ENEL	617,915	5.87	3,629,014.79	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.34	980,219.52	
ENGIE	141,564	11.00	1,558,053.38	
FORTUM OYJ	32,550	14.99	487,924.50	
IBERDROLA SA	449,446	10.61	4,768,622.06	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	27.70	277,277.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	18.75	575,365.89	
RWE STAMM	49,680	40.03	1,988,690.40	
SNAM SPA	147,559	5.11	754,026.49	
TERNA SPA	102,810	7.45	766,345.74	
UNIPER SE	7,335	21.44	157,262.40	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	25.27	1,289,452.29	

	VERBUND AG	6,430	82.60	531,118.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,483	259.50	903,838.50	
	ASML HOLDING NV	32,248	486.75	15,696,714.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES	101,861	25.64	2,612,225.34	
	STMICROELECTRONICS	55,076	33.40	1,839,538.40	
ユーロ 小計		14,432,177		322,565,224.93 (44,278,528,426)	
イギリスポンド	BP PLC	1,555,608	4.04	6,297,101.18	
	SHELL PLC-NEW	598,230	22.25	13,310,617.50	
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	33.00	3,371,148.00	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	13.62	488,358.72	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	66.92	731,034.08	
	GLENCORE PLC	767,331	4.58	3,518,596.30	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	22.78	383,797.44	
	MONDI PLC	36,710	15.62	573,410.20	
	RIO TINTO PLC REG	87,100	51.88	4,518,748.00	
	ASHTEAD GROUP PLC	34,104	38.00	1,295,952.00	
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	7.44	1,935,693.96	
	BUNZL PLC	24,880	29.90	743,912.00	
	DCC PLC	6,622	60.46	400,366.12	
	FERGUSON PLC	17,761	91.10	1,618,027.10	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.07	344,080.05	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.78	499,188.56	
	SMITHS GROUP PLC	26,476	14.48	383,504.86	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	108.55	598,544.70	
	EXPERIAN PLC	74,115	26.30	1,949,224.50	
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	48.96	680,054.40	
	RELX PLC	149,517	22.99	3,437,395.83	
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.17	726,562.56	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.59	336,070.38	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	38.57	296,526.16	
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	14.89	443,513.52	
	PERSIMMON PLC	25,686	20.32	521,939.52	
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.20	317,585.06	
	COMPASS GROUP PLC	142,427	15.76	2,245,361.65	
	ENTAIN PLC	49,630	12.48	619,630.55	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	12,541	47.41	594,568.81	
	WHITBREAD PLC	17,434	25.61	446,484.74	
	AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.60	406,077.04	
	INFORMA PLC	110,598	5.43	601,210.72	
	PEARSON	66,305	7.57	502,326.68	
	WPP PLC	95,821	9.52	912,407.56	

JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.17	243,122.78	
KINGFISHER PLC	153,717	2.42	371,995.14	
NEXT PLC	11,468	59.04	677,070.72	
OCADO GROUP PLC	35,862	7.83	280,942.90	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.33	345,620.55	
TESCO PLC	601,050	2.75	1,655,892.75	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	15.60	401,544.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	168,277	33.02	5,556,506.54	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	15.67	281,433.20	
DIAGEO	180,509	37.27	6,728,472.97	
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	16.52	1,257,222.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,630	63.20	3,452,616.00	
UNILEVER PLC	201,915	36.36	7,341,629.40	
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	12.51	858,123.45	
ASTRAZENECA	120,234	101.40	12,191,727.60	
GLAXOSMITHKLINE	388,893	17.36	6,754,293.62	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	16.97	279,224.38	
BARCLAYS	1,339,545	1.45	1,955,467.79	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,583,882	4.92	7,803,786.61	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,443,807	0.42	2,305,180.07	
NATWEST GROUP PLC	443,701	2.04	905,593.74	
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.47	1,162,079.62	
3I GROUP PLC	74,757	12.35	923,248.95	
ABRDN PLC	153,430	1.79	274,716.41	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.54	282,494.66	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	24,732	70.50	1,743,606.00	
M&G PLC	229,107	2.06	471,960.42	
SCHRODERS PLC	11,794	27.52	324,570.88	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	11.81	483,635.21	
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.00	373,865.00	
AVIVA PIC	296,550	4.02	1,192,427.55	
LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.35	1,083,705.16	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.71	291,317.71	
PRUDENTIAL	210,968	8.81	1,858,628.08	
AVEVA GROUP PLC	10,917	20.77	226,746.09	
SAGE GROUP PLC	76,660	6.69	512,855.40	
HALMA PLC	31,069	21.92	681,032.48	
BT GROUP PLC	716,738	1.73	1,243,898.79	
VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.18	2,617,474.45	
NATIONAL GRID PLC	286,046	11.79	3,372,482.34	
SEVERN TRENT PLC	22,468	29.58	664,603.44	
SSE PLC	81,663	18.04	1,473,608.83	

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.78	631,492.40	
イギリスポンド 小計		22,479,764		139,586,936.53 (22,385,557,011)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	16.78	291,938.44	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	800.00	459,200.00	
	GIVAUDAN-REG	748	3,457.00	2,585,836.00	
	HOLCIM LTD	40,627	44.92	1,824,964.84	
	SIKA AG-BR	10,926	258.60	2,825,463.60	
	ABB LTD	127,656	27.86	3,556,496.16	
	GEBERIT AG-REG	2,964	498.20	1,476,664.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,375	177.40	243,925.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	178.40	551,612.80	
	VAT GROUP AG	1,956	261.60	511,689.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	33.88	354,046.00	
	SGS SA	506	2,372.00	1,200,232.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	243.90	1,116,330.30	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	100.65	4,160,971.65	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	228.70	567,862.10	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	43.82	172,563.16	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,170.00	607,600.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	102,400.00	819,200.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,750.00	799,500.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	219,354	120.38	26,405,834.52	
	ALCON INC	39,333	65.10	2,560,578.30	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,007	322.20	1,291,055.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	103.75	886,025.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	68.15	126,077.50	
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	519.60	3,063,042.00	
	NOVARTIS	170,286	83.38	14,198,446.68	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	374.20	1,047,385.80	
	ROCHE HOLDING GENUSS	54,689	346.00	18,922,394.00	
	VIFOR PHARMA AG/NEW	3,360	176.50	593,040.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	6.27	1,338,940.66	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	45.52	860,191.44	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	987.20	1,809,537.60	
	UBS GROUP AG	271,096	16.36	4,435,130.56	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	157.50	499,905.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	532.80	1,288,843.20	
	SWISS RE LTD	22,836	77.96	1,780,294.56	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,660	436.80	5,093,088.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	93.40	530,418.60	
	TEMENOS AG - REG	5,150	95.72	492,958.00	

	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	57.20	840,039.20	
	SWISSCOM	2,187	575.20	1,257,962.40	
スイスフラン 小計		1,354,054		113,447,284.87 (14,858,190,899)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	409.80	7,057,575.60	
	BOLIDEN AB	18,479	372.80	6,888,971.20	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	174.95	7,678,030.65	
	ALFA LAVAL AB	27,268	248.40	6,773,371.20	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	228.30	17,843,471.40	
	ATLAS COPCO A	51,320	421.20	21,615,984.00	
	ATLAS COPCO B	31,902	364.90	11,641,039.80	
	EPIROC AB-A	46,999	175.15	8,231,874.85	
	EPIROC AB-B	28,804	150.80	4,343,643.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	85.42	3,306,779.04	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	216.70	3,034,233.40	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	178.70	3,211,239.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	81.42	8,762,746.08	
	SANDVIK AB	87,644	176.15	15,438,490.60	
	SKANSKA B	25,507	162.00	4,132,134.00	
	SKF AB-B	24,865	161.35	4,011,967.75	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	157.20	2,124,400.80	
	VOLVO B	111,799	153.06	17,111,954.94	
	SECURITAS B	29,533	99.76	2,946,212.08	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	148.90	3,166,954.10	
	EVOLUTION AB	14,096	908.90	12,811,854.40	
	EMBRACER GROUP AB	37,510	66.93	2,510,544.30	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	118.68	6,554,577.72	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	76.06	9,680,156.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	254.40	12,586,185.60	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	282.70	5,030,929.20	
	NORDEA BANK ABP	253,851	93.23	23,666,528.73	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	120,740	104.30	12,593,182.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	95.74	10,601,864.64	
	SWEDBANK AB-A	72,526	146.75	10,643,190.50	
	EQT AB	23,207	235.20	5,458,286.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	236.30	2,792,593.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	233.90	2,612,195.20	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	180.85	7,039,586.25	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	168.46	24,052,213.42	
	KINNEVIK AB - B	18,792	160.75	3,020,814.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	425.40	3,096,912.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	402.90	3,807,405.00	

	SAGAX AB-B	12,402	203.40	2,522,566.80	
	SINCH AB	44,150	39.15	1,728,693.25	
	ERICSSON (LM) B	225,508	76.19	17,181,454.52	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	112.15	17,252,931.70	
	TELE2 AB-B SHS	32,829	129.10	4,238,223.90	
	TELIA CO AB	230,643	39.73	9,163,446.39	
スウェーデンクローナ 小計		2,658,493		369,967,409.21 (4,761,480,556)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	6,114	343.00	2,097,102.00	
	EQUINOR ASA	76,370	321.85	24,579,684.50	
	NORSK HYDRO	96,800	69.64	6,741,152.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	465.80	5,821,568.40	
	ADEVINTA ASA	19,117	56.30	1,076,287.10	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	152.00	1,409,648.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	169.10	1,197,566.20	
	MOWI ASA	31,968	245.10	7,835,356.80	
	ORKLA	69,804	75.32	5,257,637.28	
	DNB BANK ASA	71,795	176.75	12,689,766.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	192.30	3,571,780.20	
	TELENOR ASA	51,193	127.40	6,521,988.20	
ノルウェークローネ 小計		470,589		78,799,536.93 (1,055,913,794)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	514.00	4,360,262.00	
	NOVOZYMES A/S	17,111	433.20	7,412,485.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,758.00	1,327,290.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	153.68	12,548,586.72	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	18,960.00	4,152,240.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	19,610.00	8,510,740.00	
	DSV A/S	16,380	1,039.00	17,018,820.00	
	PANDORA A/S	8,163	515.80	4,210,475.40	
	CARLSBERG AS-B	7,077	850.80	6,021,111.60	
	AMBU A/S-B	13,555	80.84	1,095,786.20	
	COLOPLAST-B	9,208	850.60	7,832,324.80	
	DEMANT A/S	8,512	276.80	2,356,121.60	
	GN STORE NORD A/S	9,226	216.90	2,001,119.40	
	GENMAB A/S	5,250	2,089.00	10,967,250.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	132,369	755.80	100,044,490.20	
	DANSKE BANK A/S	56,132	103.70	5,820,888.40	
	TRYG A/S	29,772	154.30	4,593,819.60	
	ORSTED A/S	15,439	692.80	10,696,139.20	
デンマーククローネ 小計		419,739		210,969,950.32 (3,892,395,583)	

オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	33.24	685,707.96	
	SANTOS	236,159	8.08	1,908,164.72	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	27.14	347,744.82	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	31.58	2,349,678.32	
	BHP GROUP LTD	397,288	46.21	18,358,678.48	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	18.11	629,684.70	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	3.67	448,305.18	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	127,366	19.63	2,500,194.58	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	38.47	1,421,389.56	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	53.73	774,195.57	
	NEWCREST MINING LIMITED	61,178	26.01	1,591,239.78	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	9.06	920,749.68	
	ORICA LTD	38,288	15.83	606,099.04	
	RIO TINTO LTD	28,818	106.80	3,077,762.40	
	SOUTH32 LTD	341,133	4.63	1,579,445.79	
	REECE LTD	16,814	16.51	277,599.14	
	BRAMBLES LTD	108,007	10.47	1,130,833.29	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	4.01	479,559.91	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.38	457,300.00	
	TRANSURBAN GROUP	233,493	14.15	3,303,925.95	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	31.38	1,450,069.80	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.85	389,714.80	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	67.60	239,371.60	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	24.29	432,191.97	
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	5.10	928,266.30	
	REA GROUP LTD	3,586	107.28	384,706.08	
	SEEK LTD	28,001	24.60	688,824.60	
	WESFARMERS LTD	87,120	49.06	4,274,107.20	
	COLES GROUP LTD	108,486	18.79	2,038,451.94	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.65	840,742.65	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	38.36	3,832,202.36	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	45,808	11.15	510,759.20	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	216.48	1,035,423.84	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	78.75	1,279,530.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	35.61	1,326,508.11	
	CSL LIMITED	37,659	270.40	10,182,993.60	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	26.03	5,870,051.33	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,082	102.66	13,764,858.12	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	253,530	31.68	8,031,830.40	
	WESTPAC BANKING	283,793	24.60	6,981,307.80	
	ASX LTD	14,549	83.51	1,214,986.99	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,074	182.00	4,927,468.00	

	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	168,725	4.62	779,509.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.22	747,629.26	
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.42	1,385,960.22	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.28	1,070,065.92	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.15	1,071,680.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	39.33	542,793.33	
	XERO LTD	11,340	84.34	956,415.60	
	TELSTRA CORP	308,467	3.98	1,227,698.66	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	119,082	6.94	826,429.08	
オーストラリアドル 小計		5,112,487		122,080,807.53 (10,995,818,334)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.36	867,530.56	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	21.50	859,570.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	8.31	301,794.27	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.86	842,219.07	
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.65	365,063.45	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.57	505,186.08	
ニュージーランドドル 小計		542,443		3,741,363.43 (306,193,183)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	193,996	55.05	10,679,479.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	94.65	10,127,550.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	17.48	3,006,560.00	
	MTR CORP	125,000	42.75	5,343,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	26.90	3,228,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	43.10	7,499,400.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	16.50	3,267,000.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	12.50	2,152,500.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	19.40	2,830,460.00	
	WH GROUP LTD	474,801	5.32	2,525,941.32	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	29.70	8,360,550.00	
	HANG SENG BANK	59,400	140.10	8,321,940.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	327.60	31,384,080.00	
	AIA GROUP LTD	933,800	74.00	69,101,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	53.70	8,833,435.20	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	23.90	3,752,300.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	14.68	2,539,640.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	31.80	3,982,250.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	29.25	3,988,968.75	
	SINO LAND CO	315,400	10.66	3,362,164.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	92.80	10,022,400.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	44.75	1,812,375.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	18.96	1,823,952.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	36.55	4,349,450.00	

	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	52.75	3,560,625.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	76.00	10,450,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	8.54	7,725,770.78	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	54.05	6,053,600.00	
香港ドル 小計		5,910,253		240,085,342.25 (3,975,813,267)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	6.69	918,537.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.11	605,814.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.32	576,326.24	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.79	485,850.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.29	766,194.00	
	DBS GROUP	141,500	32.90	4,655,350.00	
	OCBC BANK	257,100	11.88	3,054,348.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	29.25	2,746,575.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	45,100	9.53	429,803.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.92	876,120.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.09	346,252.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.04	334,400.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.50	449,750.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.75	1,607,493.25	
シンガポールドル 小計		2,648,275		17,852,812.49 (1,667,988,270)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	42,053	35.32	1,485,311.96	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	684.00	1,467,864.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	28.96	2,847,057.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	32.64	3,553,320.96	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.69	1,859,655.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	109.00	1,362,827.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	256.00	1,106,688.00	
	NICE LTD	4,991	644.10	3,214,703.10	
イスラエルシェケル 小計		372,690		16,897,427.62 (639,234,756)	
合　計		84,508,981		480,038,355,349 (480,038,355,349)	

(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	918,719.23	
		LENDLEASE GROUP	64,786	736,616.82	
	オーストラリアドル 小計		147,479	1,655,336.05 (149,096,118)	

	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,711,080.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	205,000	2,312,400.00	
	香港ドル 小計		425,500	4,023,480.00 (66,628,828)	
投資信託受益証券合計			572,979	215,724,946 (215,724,946)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	567,147.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	1,835,119.17	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,326	8,163,485.34	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	95,067	626,491.53	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,308,555.04	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	1,283,638.59	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,110,974.13	
		CROWN CASTLE INTL CORP	33,199	5,822,440.62	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	2,957,568.12	
		DUKE REALTY CORP	27,540	1,313,933.40	
		EQUINIX INC	7,120	4,657,832.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	983,482.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27,140	1,988,276.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,770	1,411,776.90	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,841,365.24	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,358,855.30	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,084,932.03	
		INVITATION HOMES INC	46,840	1,677,808.80	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,236,511.26	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	1,118,394.95	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	895,644.40	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,403	1,491,868.62	
		PROLOGIS INC	57,379	7,595,258.23	
		PUBLIC STORAGE	12,441	3,902,617.29	
		REALTY INCOME CORP	44,162	2,851,098.72	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	837,486.34	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,773,167.30	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,518	3,015,972.42	
		SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,430,185.05	
		UDR INC	24,265	1,157,197.85	
		VENTAS INC	31,565	1,755,960.95	
		VICI PROPERTIES INC	75,321	2,053,250.46	
		VORNADO REALTY TRUST	11,390	403,889.40	
		WELLTOWER INC	32,739	2,850,257.34	
		WP CAREY INC	14,258	1,092,305.38	
			1,002,602	77,454,748.97	

	アメリカドル 小計			(10,071,441,008)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	226,707.93	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	338,146.70	
	カナダドル 小計		20,377	564,854.63 (56,417,680)	
	ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	320,049.00	
		GECINA SA	3,139	317,039.00	
		KLEPIERRE	17,225	372,232.25	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	703,098.75	
	ユーロ 小計		35,781	1,712,419.00 (235,063,756)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	380,790.13	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	323,467.53	
		SEGRO PLC	93,383	1,001,999.59	
	イギリスポンド 小計		219,086	1,706,257.25 (273,632,475)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,011,467.50	
		GOODMAN GROUP	133,807	2,563,742.12	
		GPT GROUP	167,884	794,091.32	
		MIRVAC GROUP	266,683	576,035.28	
		SCENTRE GROUP	382,183	1,039,537.76	
		STOCKLAND	207,412	798,536.20	
		VICINITY CENTERS	365,149	653,616.71	
	オーストラリアドル 小計		1,617,208	7,437,026.89 (669,853,011)	
	香港ドル	LINK REIT	170,500	11,423,500.00	
	香港ドル 小計		170,500	11,423,500.00 (189,173,160)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	792,745.02	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	769,369.54	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	6,805	9,050.65	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	409,200.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	475,757.52	
	シンガポールドル 小計		1,134,561	2,456,122.73 (229,475,546)	
投資証券合計			4,200,115	11,725,056,636 (11,725,056,636)	
合計				11,940,781,582 (11,940,781,582)	

(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　606銘柄	97.2%	—	—	71.6%
	投資証券　35銘柄	—	—	2.8%	2.0%
カナダドル	株式　86銘柄	99.7%	—	—	3.8%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式　228銘柄	99.5%	—	—	9.0%
	投資証券　4銘柄	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式　78銘柄	98.8%	—	—	4.6%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式　41銘柄	100.0%	—	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式　44銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　18銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　51銘柄	93.1%	—	—	2.2%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.3%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	5.7%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　6銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　28銘柄	94.0%	—	—	0.8%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.5%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	87.9%	—	—	0.3%
	投資証券　5銘柄	—	—	12.1%	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

	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
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。

	2022年 5月10日現在
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）

1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 5月10日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 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

区分	2022年 5月10日現在
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
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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△4,886,281,442
合計	△4,886,281,442

(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

（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。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,037	269,291,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,203	300,441,400	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	4,705	719,865,000	
	東海道リート投資法人	775	88,815,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,492	2,238,372,000	
	森ヒルズリート投資法人	11,893	1,755,406,800	
	産業ファンド投資法人	14,358	2,641,872,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	10,113	3,514,267,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,237	1,506,019,700	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,390	2,228,765,000	
	ＧＬＰ投資法人	32,757	5,562,138,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,705	1,543,240,000	
	日本プロロジスリート投資法人	16,548	5,659,416,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1,695	1,117,005,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	1,755	478,588,500	
	イオンリート投資法人	11,894	1,779,342,400	
	ヒューリックリート投資法人	9,435	1,495,447,500	
	日本リート投資法人	3,121	1,143,846,500	
	積水ハウス・リート投資法人	30,701	2,373,187,300	
	トーセイ・リート投資法人	2,113	278,493,400	

	ケネディクス商業リート投資法人	4,038	1,087,029,600	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	2,478	393,010,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,291	303,099,300	
	野村不動産マスターファンド投資法人	32,707	5,373,760,100	
	いちごホテルリート投資法人	1,676	150,002,000	
	ラサールロジポート投資法人	12,381	2,160,484,500	
	スターアジア不動産投資法人	10,452	604,125,600	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,184	158,892,800	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,984	2,143,392,000	
	大江戸温泉リート投資法人	1,632	116,035,200	
	投資法人みらい	12,251	605,811,950	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	2,373	300,421,800	
	三菱地所物流リート投資法人	2,938	1,319,162,000	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	3,917	760,289,700	
	ザイマックス・リート投資法人	1,632	200,083,200	
	タカラレーベン不動産投資法人	3,988	480,554,000	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,944	614,475,200	
	日本ビルファンド投資法人	11,791	7,994,298,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,114	6,321,250,000	
	日本都市ファンド投資法人	51,031	5,281,708,500	
	オリックス不動産投資法人	20,152	3,714,013,600	
	日本プライムリアルティ投資法人	6,911	2,719,478,500	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	9,695	1,430,012,500	
	東急リアル・エステート投資法人	6,781	1,242,279,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	6,929	755,261,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	22,768	3,239,886,400	
	森トラスト総合リート投資法人	7,228	1,006,860,400	
	インヴィンシブル投資法人	44,516	1,887,478,400	
	フロンティア不動産投資法人	3,546	1,794,276,000	
	平和不動産リート投資法人	6,552	978,868,800	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,820	2,127,840,000	
	福岡リート投資法人	5,231	844,806,500	
	ケネディクス・オフィス投資法人	3,129	2,096,430,000	
	いちごオフィスリート投資法人	8,287	690,307,100	
	大和証券オフィス投資法人	2,138	1,537,222,000	
	阪急阪神リート投資法人	4,568	673,780,000	
	スターツプロシード投資法人	1,575	371,070,000	
	大和ハウスリート投資法人	15,186	4,730,439,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,985	2,032,616,000	
	大和証券リビング投資法人	13,666	1,563,390,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	9,385	1,153,416,500	
合計		590,777	109,651,439,550	

(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

	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

	2022年 5月10日現在
	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		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）

1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 5月10日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 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
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

区分	2022年 5月10日現在
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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 5月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△12,740,388,667
合計	△12,740,388,667

(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

（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。

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	907,350.20	
		AGREE REALTY CORP	38,205	2,558,970.90	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	37,122	760,258.56	
		ALEXANDER'S INC	1,190	285,028.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	75,508	12,630,223.16	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	103,968.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,081	897,735.15	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	73,032	4,701,800.16	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	155,315	5,523,001.40	
		AMERICOLD REALTY TRUST	139,990	3,520,748.50	
		APARTMENT INCOME REIT CO	82,424	3,553,298.64	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	79,751	457,770.74	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	107,773	1,713,590.70	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,600	490,606.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	102,510.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	72,577	14,785,386.44	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	387,436.50	
		BOSTON PROPERTIES	73,522	8,382,243.22	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	160,146.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,038,245.80	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	156,266	3,658,187.06	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	1,703,663.94	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	97,850.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	52,836	7,575,097.32	
		CARETRUST REIT INC	52,477	872,692.51	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13,620	332,600.40	
		CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	185,912.00	
		CENTERSPACE	7,659	618,311.07	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	302,291.20	

		CITY OFFICE REIT INC	25,050	337,674.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	61,831.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	467,226.75	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	56,595	1,454,491.50	
		COUSINS PROPERTIES INC	77,846	2,649,099.38	
		CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	5,000	31,500.00	
		CTO REALTY GROWTH INC	2,800	168,924.00	
		CUBESMART	115,075	4,788,270.75	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,090,992.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	147,498	19,673,283.24	
		DIGITALBRIDGE GROUP INC	260,439	1,513,150.59	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	246,448.00	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,858	2,573,861.16	
		DUKE REALTY CORP	197,360	9,416,045.60	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	890,914.92	
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	21,355	3,484,708.90	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	666,789.96	
		EPR PROPERTIES	38,069	1,918,677.60	
		EQUINIX INC	46,854	30,651,418.26	
		EQUITY COMMONWEALTH	58,772	1,539,238.68	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	90,856	6,341,748.80	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	177,352	12,992,807.52	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	61,290	1,352,057.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST	33,809	10,006,449.73	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	69,461	11,768,777.23	
		FARMLAND PARTNERS INC	12,200	178,364.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	37,153	4,142,931.03	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	68,397	3,460,204.23	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	39,881	1,026,138.13	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	216,073.10	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	123,467	5,251,051.51	
		GETTY REALTY CORP	21,985	564,354.95	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	386,275.50	
		GLADSTONE LAND CORP	15,500	488,250.00	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	437,018.40	
		GLOBAL NET LEASE INC	57,012	758,259.60	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	76,980	2,360,976.60	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	115,803	3,346,706.70	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	279,047	8,376,990.94	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,650	132,814.50	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	54,799	2,100,445.67	

		HOST HOTELS AND RESORTS INC	375,710	7,179,818.10	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	79,230	1,682,052.90	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	115,571	2,559,897.65	
		INDUS REALTY TRUST INC	3,840	257,856.00	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	476,927.08	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	14,225	1,854,655.50	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	35,960	1,016,229.60	
		INVITATION HOMES INC	309,438	11,084,069.16	
		IRON MOUNTAIN INC	152,471	8,082,487.71	
		JBG SMITH PROPERTIES	59,353	1,439,903.78	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	338,400.00	
		KILROY REALTY CORPORATION	55,124	3,438,083.88	
		KIMCO REALTY CORP	324,627	7,580,040.45	
		KITE REALTY GROUP TRUST	114,476	2,391,403.64	
		LIFE STORAGE INC	43,142	4,814,647.20	
		LTC PROPERTIES INC	20,624	726,583.52	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	143,452	1,613,835.00	
		MACERICH CO/THE	110,615	1,453,481.10	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	957,964	574,778.40	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	313,989	5,620,403.10	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	59,782	10,613,696.28	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	92,186	3,904,077.10	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	42,860	2,131,856.40	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,344,861.90	
		NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	71,590	507,573.10	
		NETSTREIT CORP	20,992	426,137.60	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	890,892.99	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	557,434.90	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	125,306	3,511,074.12	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	214,889.01	
		ORION OFFICE REIT INC	30,374	388,787.20	
		PARAMOUNT GROUP INC	89,726	793,177.84	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	120,811	2,170,973.67	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	66,260	1,456,394.80	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	14,710.50	
		PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	60,769	1,946,431.07	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,100,918.64	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,024,973.16	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	16,890	351,818.70	
		POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	111,720.00	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	735,639.98	

	PRIME US REIT	295,000	209,450.00	
	PROLOGIS INC	385,483	51,026,384.71	
	PS BUSINESS PARKS INC	10,163	1,889,708.22	
	PUBLIC STORAGE	79,372	24,898,202.68	
	REALTY INCOME CORP	294,014	18,981,543.84	
	REGENCY CENTERS CORP	81,010	5,422,809.40	
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	61,972	1,075,833.92	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	84,311	5,702,796.04	
	RLJ LODGING TRUST	82,657	1,019,160.81	
	RPT REALTY	43,950	540,585.00	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,793	2,419,187.86	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,863	1,545,219.00	
	SAFEHOLD INC	8,335	356,571.30	
	SAUL CENTERS INC	6,800	330,820.00	
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	190,642.00	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	84,169	513,430.90	
	SIMON PROPERTY GROUP	170,767	20,182,951.73	
	SITE CENTERS CORP	90,280	1,331,630.00	
	SL GREEN REALTY CORP	33,508	2,204,491.32	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	66,872	2,660,836.88	
	STAG INDUSTRIAL INC	92,435	3,153,882.20	
	STORE CAPITAL CORP	128,717	3,416,149.18	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	463,487.50	
	SUN COMMUNITIES INC	60,067	9,476,770.59	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	109,637	1,219,163.44	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	53,323	948,082.94	
	TERRENO REALTY CORP	39,525	2,546,595.75	
	UDR INC	154,632	7,374,400.08	
	UMH PROPERTIES INC	25,320	520,326.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	343,768.90	
	URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,076,701.50	
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	255,699.50	
	VENTAS INC	206,874	11,508,400.62	
	VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	609,887.84	
	VICI PROPERTIES INC	439,286	11,974,936.36	
	VORNADO REALTY TRUST	83,354	2,955,732.84	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,032,160.50	
	WELLTOWER INC	226,205	19,693,407.30	
	WHITESTONE REIT	23,074	267,427.66	
	WP CAREY INC	100,355	7,688,196.55	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	56,515	989,012.50	

アメリカドル 小計		13,814,502	567,020,204.31 (73,729,637,166)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	30,942	1,195,598.88	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	367,599.60	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	153,960.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,260	555,118.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	79,400.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	44,074	2,044,592.86	
	CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,252,050.10	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	429,484.32	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	466,418.60	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	60,960	819,912.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	310,397.20	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	112,808.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	863,150.05	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,545	1,402,685.10	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	72,239	855,309.76	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	67,512.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	421,011.50	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	548,344.50	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	196,581.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	221,063.50	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,000	99,630.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	60,470	755,875.00	
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	112,750.00	
	PRIMARIS REIT	28,309	377,358.97	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	78,368	1,710,773.44	
	SLATE GROCERY REIT	17,300	251,715.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	82,790.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	36,116	1,035,084.56	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	859,160.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	158,670.00	
カナダドル 小計		975,045	17,806,803.94 (1,778,543,577)	
ユーロ	AEDIFICA	19,087	2,049,943.80	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	94,896.00	
	ALTAREA	2,480	341,248.00	
	BEFIMMO S.C.A.	12,210	573,259.50	

		CARE PROPERTY INVEST	15,000	350,250.00	
		CARMILA	25,000	356,500.00	
		COFINIMMO	15,427	1,885,179.40	
		COIMA RES SPA	11,900	117,215.00	
		COVIVIO(FP)	24,411	1,574,509.50	
		CROMWELL REIT EUR	160,000	345,600.00	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,783	439,352.62	
		GECINA SA	28,422	2,870,622.00	
		HAMBORNER REIT AG	37,000	300,070.00	
		HIBERNIA REIT PLC	365,550	590,728.80	
		ICADE	16,740	919,863.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	129,922.55	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	135,462	1,017,996.93	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	301,290.00	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	302,400.00	
		KLEPIERRE	101,585	2,195,251.85	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	167,960.00	
		MERCIALYS	28,000	223,160.00	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	172,874	1,690,707.72	
		MONTEA NV	5,300	514,100.00	
		NSI NV	10,050	355,267.50	
		RETAIL ESTATES	6,400	438,400.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	59,921	4,029,687.25	
		VASTNED RETAIL	10,650	248,145.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	72,072	2,227,024.80	
		WERELDHAVE NV	22,670	330,982.00	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	499,554.00	
	ユーロ 小計		1,686,524	27,481,087.22 (3,772,328,842)	
	イギリスポンド	AEW UK REIT PLC	68,000	81,872.00	
		ASSURA PLC	1,492,040	948,191.42	
		BIG YELLOW GROUP PLC	90,946	1,099,537.14	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	488,940.00	
		BRITISH LAND CO PLC	485,911	2,329,943.24	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	447,878	689,732.12	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	277,256.28	
		CUSTODIAN REIT PLC	234,276	234,744.55	
		DERWENT LONDON PLC	58,772	1,640,914.24	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	256,428.00	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	128,780	837,070.00	
		HAMMERSON PLC	1,784,000	467,586.40	
		HOME REIT PLC	309,934	373,160.53	

	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	217,791.94	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	390,106	2,726,060.72	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	506,380	1,172,776.08	
	LXI REIT PLC	486,008	680,411.20	
	NEWRIVER REIT PL	126,000	110,502.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	255,404.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	685,888	944,467.77	
	PRS REIT PLC/THE	269,000	282,988.00	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	182,040.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	110,637	1,174,964.94	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	192,500.00	
	SEGRO PLC	623,633	6,691,582.09	
	SHAFTESBURY PLC	155,193	869,080.80	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	211,212.36	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	494,000	602,680.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	179,704.82	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	966,516	1,898,237.42	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	424,340.00	
	UNITE GROUP PLC	209,572	2,110,390.04	
	WORKSPACE GROUP PLC	70,347	435,447.93	
イギリスポンド 小計		13,758,241	31,097,228.03 (4,987,062,459)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	197,716	585,239.36	
	ARENA REIT	171,053	737,238.43	
	BWP TRUST	262,160	1,069,612.80	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	826,616.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	269,606	938,228.88	
	CENTURIA OFFICE REIT	240,945	484,299.45	
	CHARTER HALL GROUP	244,969	3,270,336.15	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	307,782	1,486,587.06	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	261,160	1,070,756.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	687,340.50	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	822,633	662,219.56	
	DEXUS	561,242	6,033,351.50	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	351,430.00	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	337,480.00	
	GOODMAN GROUP	883,329	16,924,583.64	
	GPT GROUP	997,142	4,716,481.66	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	633,688.00	
	HEALTHCO REIT	137,130	235,863.60	
	HOME CONSORTIUM LTD	90,500	524,900.00	

	HOMECO DAILY NEEDS REIT	782,342	1,009,221.18	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	427,922.55	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	193,766	767,313.36	
	IRONGATE GROUP	272,000	523,600.00	
	MIRVAC GROUP	2,052,238	4,432,834.08	
	NATIONAL STORAGE REIT	546,840	1,252,263.60	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	179,201.60	
	RURAL FUNDS GROUP	191,095	557,997.40	
	SCENTRE GROUP	2,718,059	7,393,120.48	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	571,980	1,612,983.60	
	STOCKLAND	1,243,333	4,786,832.05	
	VICINITY CENTERS	2,002,663	3,584,766.77	
	WAYPOINT REIT LTD	390,099	944,039.58	
オーストラリアドル 小計		17,870,217	69,048,348.84 (6,219,184,780)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	532,029.45	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	535,300	1,156,248.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	879,952.25	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	949,222.66	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	249,502	748,506.00	
ニュージーランドドル 小計		2,743,464	4,265,958.36 (349,126,032)	
香港ドル	CHAMPION REIT	938,000	3,226,720.00	
	FORTUNE REIT	756,000	5,261,760.00	
	LINK REIT	1,095,000	73,365,000.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,060,480.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,114,970.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	4,131,172.40	
香港ドル 小計		5,417,660	90,160,102.40 (1,493,051,295)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	379,500.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,746,218	4,871,948.22	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,160,496.09	
	CAPITALAND CHINA TRUST	557,721	630,224.73	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,651,644	5,992,715.44	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	554,876.00	
	EC WORLD REIT	180,000	112,500.00	
	ESR-LOGOS REIT	2,769,764	1,052,510.32	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	359,100.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	166,811.00	

		FRASERS CENTREPOINT TRUST	574,262	1,343,773.08	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,483,196	2,150,634.20	
		IREIT GLOBAL	405,985	253,740.62	
		KEPPEL DC REIT	709,903	1,419,806.00	
		KEPPEL REIT	1,051,400	1,251,166.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	845,950	685,219.50	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,116,473	2,076,639.78	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	995,763	2,489,407.50	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,647,285	2,767,438.80	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,077,100	1,292,520.00	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	522,194.04	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	195,500	942,310.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	246,993.00	
		SPH REIT	446,800	424,460.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	659,400	392,343.00	
		SUNTEC REIT	1,105,200	1,945,152.00	
	シンガポールドル 小計		24,551,185	35,484,479.32 (3,315,314,902)	
	韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	150,236,800.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	554,738,800.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	67,743,060.00	
		JR REIT XXVII	64,338	367,369,980.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	171,927,080.00	
		LOTTE REIT CO LTD	72,480	418,209,600.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	208,737,000.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,380	201,279,400.00	
		SK REITS CO LTD	30,940	215,033,000.00	
	韓国ウォン 小計		383,354	2,355,274,720.00 (240,002,493)	
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	2,081,385.00	
	イスラエルシェケル 小計		103,500	2,081,385.00 (78,739,418)	
合計			81,303,692	95,962,990,964 (95,962,990,964)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券　153銘柄	100.0%	76.8%
カナダドル	投資証券　30銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券　31銘柄	100.0%	3.9%
イギリスポンド	投資証券　34銘柄	100.0%	5.2%
オーストラリアドル	投資証券　32銘柄	100.0%	6.5%
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%	1.6%
シンガポールドル	投資証券　26銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券　9銘柄	100.0%	0.3%
イスラエルシェケル	投資証券　1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

２【ファンドの現況】

【ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）】

【純資産額計算書】

（2022年 5月31日現在）

Ⅰ　資産総額	131,476,514円
Ⅱ　負債総額	55,821円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	131,420,693円
Ⅳ　発行済口数	121,430,000口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0823円
（1万口当たり純資産額）	（10,823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、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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSBI資産設計オープン（分配型）の2021年11月11日から2022年5月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SBI資産設計オープン（分配型）の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特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。