【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12月28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】	ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ
【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】

ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ

（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】

1円以上1円単位とします。

（7）【申込期間】

2022年12月29日から2023年 6月30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「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。
＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞
収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）

における取引の停止、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。

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、わが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指します。

＜信託金限度額＞

上限　3,000億円

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（債券 一般）） 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 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 （NOMURA-BPI総合）	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。

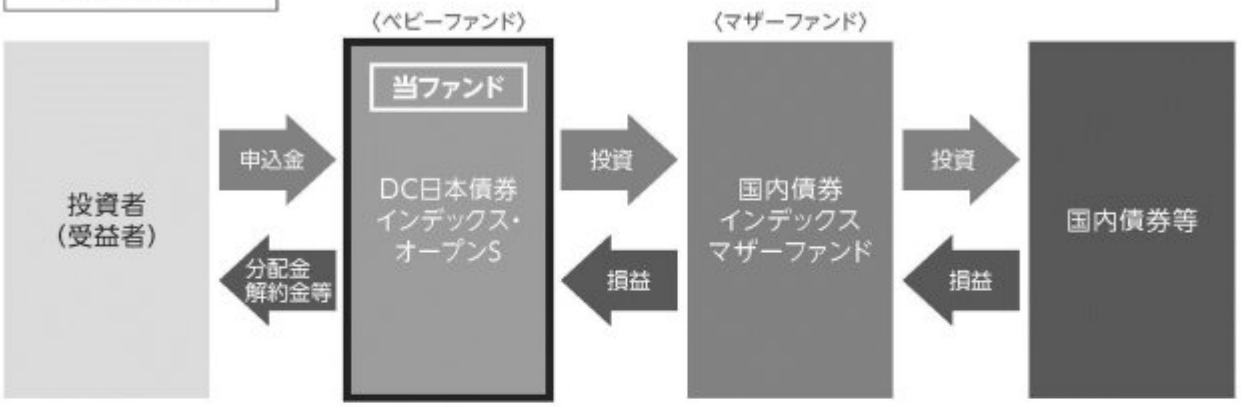
[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[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. わが国の公社債を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

ファンドのしくみ



? ファミリーファンド方式とは

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しくみです。

〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
国内債券インデックス マザーファンド	わが国の公社債	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。

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目指します。

? 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。

分配方針

●原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
●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。
●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。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●外貨建資産への投資は行いません。

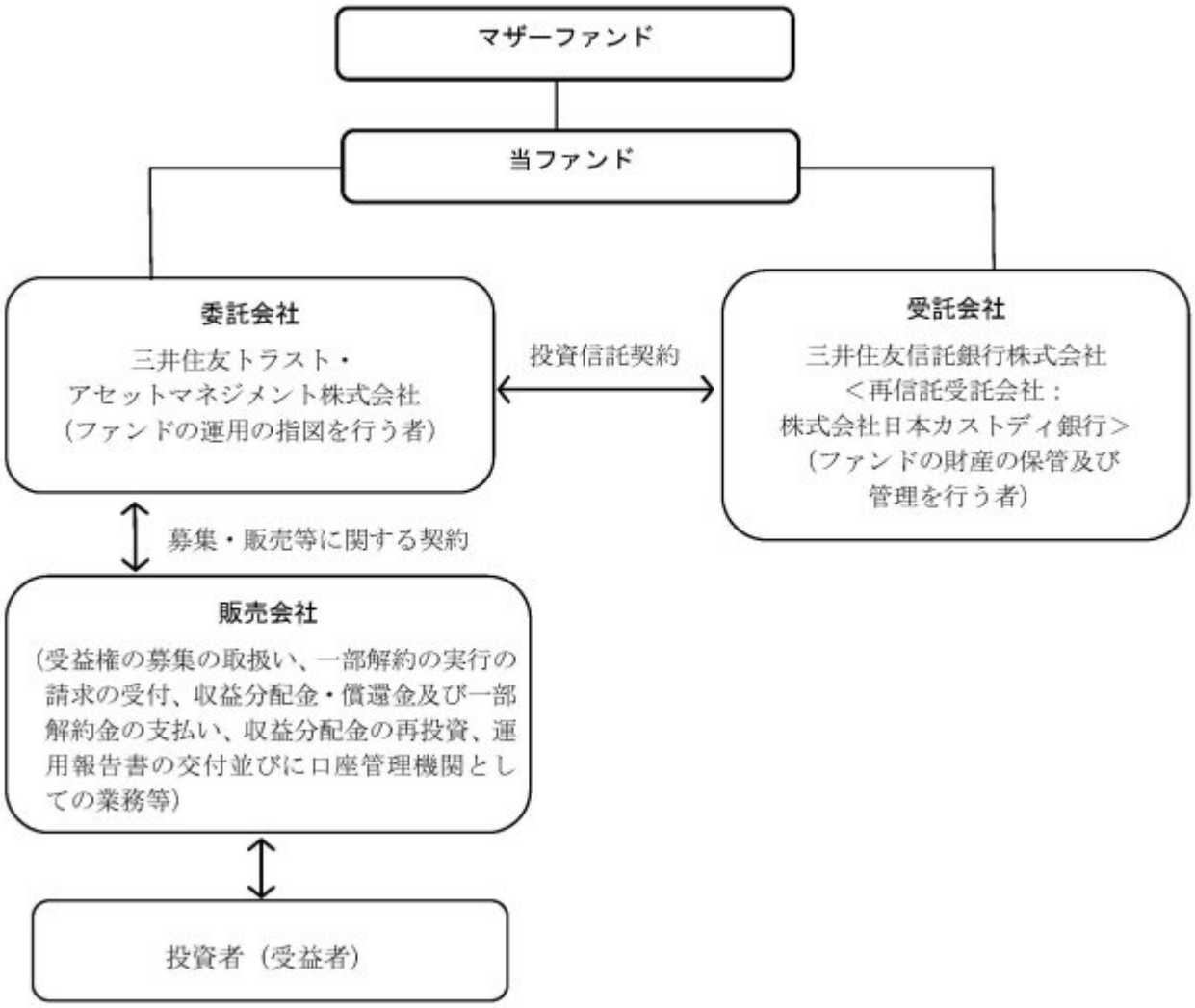
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2003年 2月 3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	本ファンドの名称を「すみしん DC日本債券インデックス・オープンS」から「DC日本債券インデックス・オープンS」に変更 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10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、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

（ロ）運用方法

①投資対象

国内債券インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。なお、債券等に直接投資することもあります。

②投資態度

1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2)運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の実質組入総額と債券先物取引等の買建玉の実質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)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効率的な運用に資するため、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。

（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．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．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）委託者は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、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.株券または新株引受権証書

2.国債証券
3.地方債証券
4.特別の法律により法人の発行する債券
5.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10.コマーシャル・ペーパー
11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13.証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14.投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16.オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18.外国法人が発行する譲渡性預金証書
19.指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22.外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

（ハ）委託者は、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

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

（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、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記（ハ）第1号から第4号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。

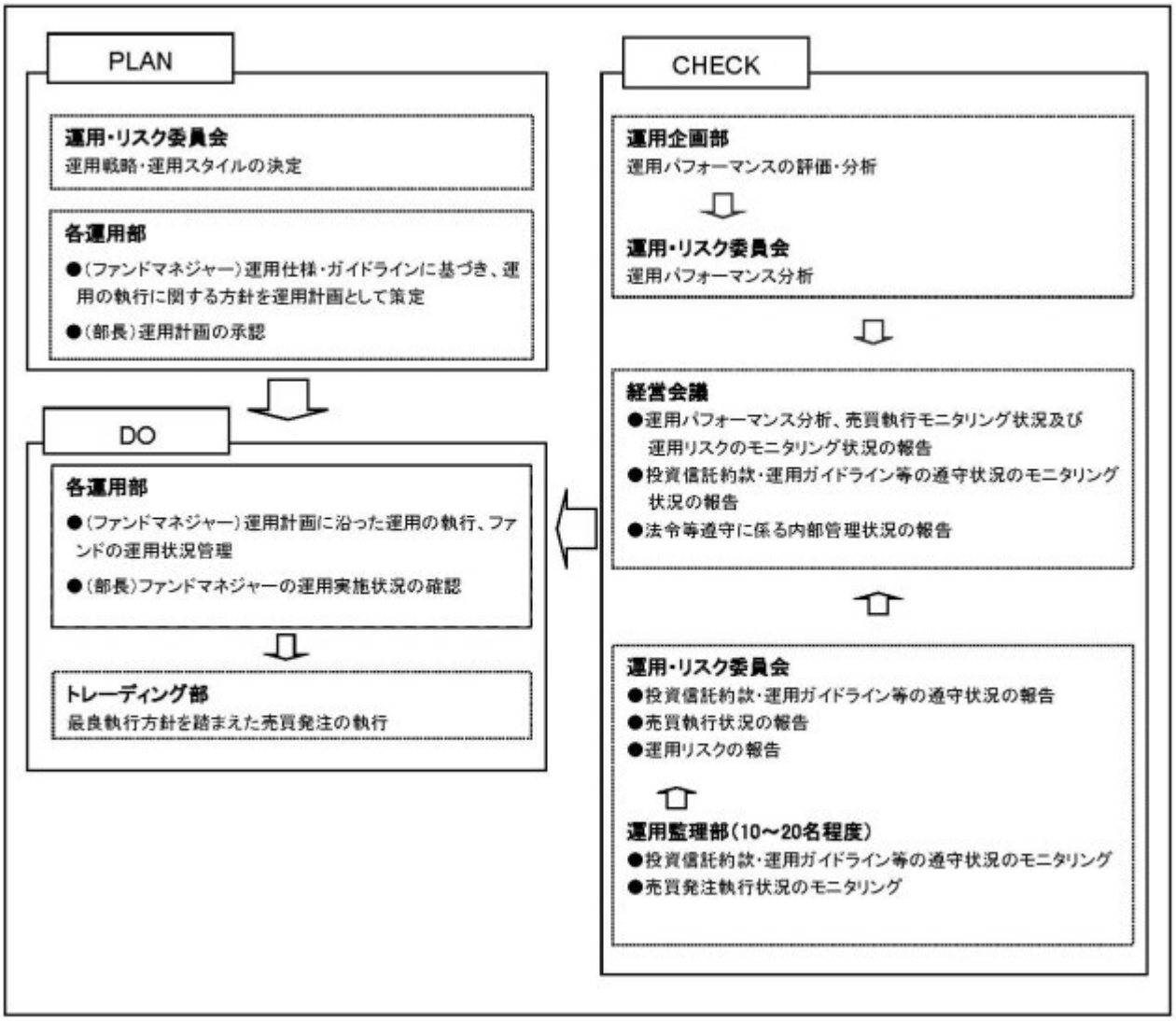
④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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。

（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

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

・分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

・留保益の運用方針

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株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

④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実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑥マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑦外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑧委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

⑨委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

1.投資信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券
5.投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6.投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑩委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。（投資信託約款第23条）

⑪委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第24条）

⑫委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。また、金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。（投資信託約款第25条）

⑬委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第26条）

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

⑭委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、売付けの指図は、当該売付け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27条）

⑮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28条）

⑯委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第36条）

⑰一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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑱デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

※前記①から⑥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、本ファンドの投資信託財産に属する前記①から⑥に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各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合計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当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記⑪および⑫における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(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。
②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。
③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。

※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ファンドは、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が、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。
②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。
③分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
④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。
⑤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。
⑥確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

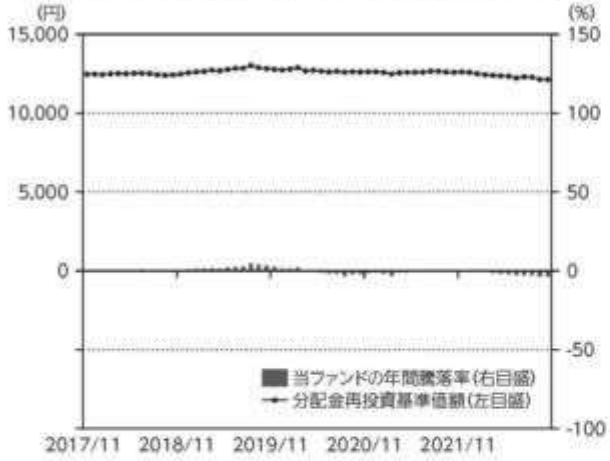
(ロ)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

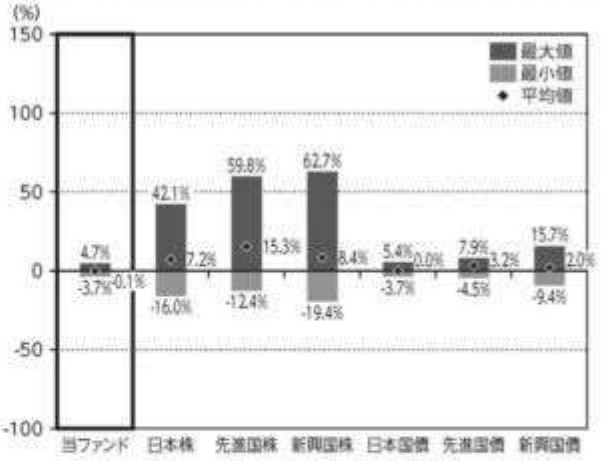
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2017年11月～2022年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

ご解約時に、信託財産留保額（※）の控除はありません。

※「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0.176%（税抜　0.16%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.055%　（税抜　0.05%）	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　0.088%　（税抜　0.08%）	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　0.033%　（税抜　0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

（4）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

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

※上記は、2022年10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10月31日現在の状況について記載してあります。

【ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ】

（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	125,500,291,582	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	62,693,452	0.05
合計(純資産総額)		125,562,985,034	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	国内債券インデックス　マザーファンド	92,313,564,974	1.3607	125,619,893,697	1.3595	125,500,291,582	99.95

(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	99.95
合計	99.95

(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11期計算期間末 (2013年 9月30日)	55,606,456,808	55,606,456,808	11,536	11,536
第12期計算期間末 (2014年 9月30日)	66,679,832,574	66,679,832,574	11,776	11,776
第13期計算期間末 (2015年 9月30日)	77,722,887,184	77,722,887,184	12,013	12,013
第14期計算期間末 (2016年 9月30日)	92,641,543,534	92,641,543,534	12,657	12,657
第15期計算期間末 (2017年10月 2日)	99,162,998,614	99,162,998,614	12,417	12,417
第16期計算期間末 (2018年10月 1日)	107,862,353,130	107,862,353,130	12,396	12,396
第17期計算期間末 (2019年 9月30日)	124,719,163,968	124,719,163,968	12,873	12,873
第18期計算期間末 (2020年 9月30日)	129,160,198,924	129,160,198,924	12,623	12,623
第19期計算期間末 (2021年 9月30日)	131,638,452,963	131,638,452,963	12,597	12,597
第20期計算期間末 (2022年 9月30日)	125,879,542,675	125,879,542,675	12,137	12,137
2021年10月末日	131,755,201,014	—	12,582	—
11月末日	131,774,937,804	—	12,610	—
12月末日	131,523,823,565	—	12,580	—
2022年 1月末日	130,581,641,099	—	12,490	—
2月末日	129,203,048,876	—	12,425	—

3月末日	129,418,324,285	—	12,389	—
4月末日	128,359,841,106	—	12,356	—
5月末日	128,111,425,691	—	12,336	—
6月末日	126,717,663,415	—	12,221	—
7月末日	127,650,741,103	—	12,299	—
8月末日	127,319,853,747	—	12,269	—
9月末日	125,879,542,675	—	12,137	—
10月末日	125,562,985,034	—	12,122	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第11期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	0
第12期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	0
第13期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第14期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第15期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第16期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0
第17期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0
第18期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	0
第19期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	0
第20期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第11期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	1.5
第12期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	2.1
第13期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	2.0
第14期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	5.4
第15期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	△1.9
第16期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	△0.2
第17期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	3.8
第18期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	△1.9
第19期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	△0.2
第20期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	△3.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第11期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	14,634,423,857	9,392,904,790	48,203,153,133
第12期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	15,188,845,805	6,770,315,303	56,621,683,635
第13期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	19,243,039,521	11,166,087,370	64,698,635,786
第14期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	18,117,945,354	9,623,693,563	73,192,887,577
第15期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	18,253,866,221	11,587,271,655	79,859,482,143
第16期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	18,644,169,393	11,486,712,098	87,016,939,438
第17期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	20,530,113,814	10,663,546,119	96,883,507,133
第18期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	22,505,297,293	17,067,890,434	102,320,913,992
第19期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	18,948,661,063	16,770,150,659	104,499,424,396
第20期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	17,183,585,775	17,967,803,923	103,715,206,248

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

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	523,717,502,450	84.21
地方債証券	日本	32,405,876,159	5.21
特殊債券	日本	36,673,332,708	5.90
社債券	日本	26,588,451,860	4.27
	フランス	894,858,000	0.14
	スペイン	398,372,000	0.06
	小計	27,881,681,860	4.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,276,719,376	0.21
合計(純資産総額)		621,955,112,553	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	7,650,000,000	100.36	7,677,612,900	100.27	7,670,884,500	0.100	2024/9/20	1.23

日本	国債証券	第１５０回利付国債（５年）	6,960,000,000	100.06	6,964,176,000	99.93	6,955,684,800	0.005	2026/12/20	1.12
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	100.21	6,904,813,500	0.100	2023/12/20	1.11
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	6,770,000,000	100.12	6,778,124,000	100.09	6,776,093,000	0.005	2026/6/20	1.09
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	6,540,000,000	98.86	6,465,451,600	98.70	6,455,241,600	0.100	2031/12/20	1.04
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	6,390,000,000	100.33	6,411,087,000	100.02	6,391,661,400	0.100	2028/3/20	1.03
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	100.38	5,922,892,000	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	100.28	5,766,330,000	0.100	2027/3/20	0.93
日本	国債証券	第３６６回利付国債（１０年）	5,740,000,000	99.71	5,723,354,000	100.04	5,742,640,400	0.200	2032/3/20	0.92
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	5,670,000,000	100.46	5,696,615,000	100.40	5,692,906,800	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	100.22	5,602,353,900	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	99.75	5,401,787,400	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	101.06	5,396,924,400	0.300	2025/12/20	0.87
日本	国債証券	第３６７回利付国債（１０年）	5,360,000,000	99.82	5,350,504,000	99.62	5,339,792,800	0.200	2032/6/20	0.86
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	5,230,000,000	100.45	5,253,535,000	100.38	5,249,978,600	0.100	2025/6/20	0.84
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	5,210,000,000	99.01	5,158,819,000	98.56	5,135,340,700	0.100	2031/9/20	0.83
日本	国債証券	第１５３回利付国債（５年）	5,090,000,000	99.92	5,086,155,100	99.76	5,078,191,200	0.005	2027/6/20	0.82
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	100.07	5,003,800,000	0.100	2027/12/20	0.80
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	5,070,000,000	99.11	5,024,877,000	98.64	5,001,504,300	0.100	2031/6/20	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	99.94	4,937,233,600	0.100	2028/6/20	0.79
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	98.91	4,836,992,400	0.100	2030/9/20	0.78
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	4,820,000,000	100.10	4,824,820,000	100.01	4,820,915,800	0.005	2026/9/20	0.78
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	4,760,000,000	100.49	4,783,514,400	100.45	4,781,705,600	0.100	2026/3/20	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	99.68	4,774,815,700	0.100	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	4,750,000,000	100.43	4,770,465,500	100.34	4,766,387,500	0.100	2025/3/20	0.77
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	4,670,000,000	101.37	4,733,979,000	101.17	4,724,779,100	0.400	2025/6/20	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	100.24	4,671,417,000	0.100	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	4,600,000,000	101.05	4,648,300,000	100.78	4,636,018,000	0.600	2023/12/20	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	101.06	4,608,336,000	0.400	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	4,600,000,000	99.27	4,566,559,600	98.80	4,544,984,000	0.100	2030/12/20	0.73

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.21
地方債証券	5.21
特殊債券	5.90
社債券	4.48
合計	99.79

(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。

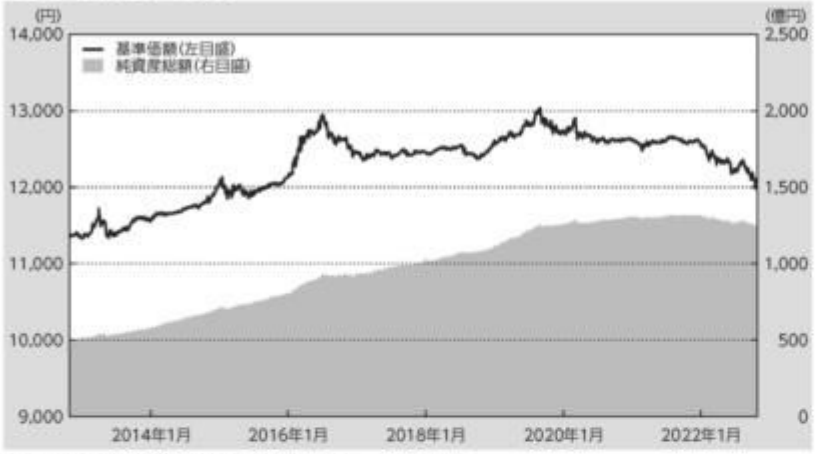
≪参考情報≫

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：2003年 2 月 3 日
作成基準日：2022年10月31日

基準価額・純資産の推移



※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	12,122円
純資産総額	1,255.63億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年10月	0円
2019年 9 月	0円
2020年 9 月	0円
2021年 9 月	0円
2022年 9 月	0円
設定来分配金合計額	0円

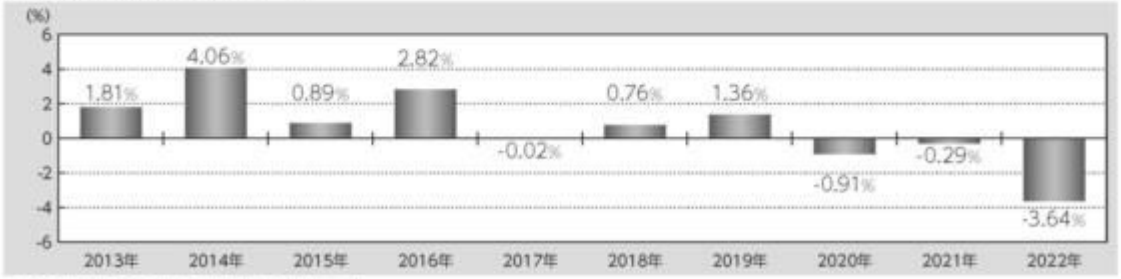
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

銘柄名	国／地域	種類	利率	償還期限	実質投資比率
第141回利付国債(5年)	日本	国債	0.100%	2024/09/20	1.2%
第150回利付国債(5年)	日本	国債	0.005%	2026/12/20	1.1%
第138回利付国債(5年)	日本	国債	0.100%	2023/12/20	1.1%
第148回利付国債(5年)	日本	国債	0.005%	2026/06/20	1.1%
第365回利付国債(10年)	日本	国債	0.100%	2031/12/20	1.0%
第350回利付国債(10年)	日本	国債	0.100%	2028/03/20	1.0%
第344回利付国債(10年)	日本	国債	0.100%	2026/09/20	1.0%
第346回利付国債(10年)	日本	国債	0.100%	2027/03/20	0.9%
第366回利付国債(10年)	日本	国債	0.200%	2032/03/20	0.9%
第145回利付国債(5年)	日本	国債	0.100%	2025/09/20	0.9%

※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)



※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
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、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。
※「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

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

＜申込単位＞
1円以上1円単位とします。

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

＜申込手数料＞
ありません。

＜申込代金の支払い＞
販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞
ありません。

＜申込受付の中止等＞
収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、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＞

1口以上1口単位とします。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の基準価額（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、4営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

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

＜受付不可日＞

ありません。

＜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、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行

の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①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である公社債の評価方法

原則として、次のいずれかから入手した価額で評価します。
1)日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）
2)価格情報会社の提供する価額
3)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。）

＜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。（2003年 2月 3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10月1日から翌年9月30日までとします。（第1計算期間は2003年2月3日から2003年9月30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）における公告等の手続き

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、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、ファンドの繰上償還を行いません。

④委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④までの規定は、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②の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞

(1)投資信託約款の変更

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における公告等の手続き

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。）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、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、当該約款変更を行いません。

④委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただ

し、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

＜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背いた場合、又は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と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

＜反対者の買取請求権＞

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約
当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

②収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎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。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間(2021年10月1日から2022年9月30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】

【ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第19期 （2021年 9月30日現在）	第20期 （2022年 9月30日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	361,805,188	303,138,323
親投資信託受益証券	131,572,648,597	125,816,631,355
未収入金	-	70,230,432
流動資産合計	131,934,453,785	126,190,000,110
資産合計	131,934,453,785	126,190,000,110
負債の部		
流動負債		
未払解約金	178,434,619	195,958,943
未払受託者報酬	21,630,817	21,056,947
未払委託者報酬	93,733,463	91,246,713
未払利息	879	734
その他未払費用	2,201,044	2,194,098
流動負債合計	296,000,822	310,457,435
負債合計	296,000,822	310,457,435
純資産の部		
元本等		
元本	104,499,424,396	103,715,206,248
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	27,139,028,567	22,164,336,427
（分配準備積立金）	5,497,443,634	4,624,777,933
元本等合計	131,638,452,963	125,879,542,675
純資産合計	131,638,452,963	125,879,542,675
負債純資産合計	131,934,453,785	126,190,000,110

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期 自　2020年10月 1日 至　2021年 9月30日	第20期 自　2021年10月 1日 至　2022年 9月30日
営業収益		
受取利息	1,427	1,191
有価証券売買等損益	△35,934,029	△4,550,087,739
営業収益合計	△35,932,602	△4,550,086,548
営業費用		
支払利息	86,301	86,566
受託者報酬	42,978,406	42,561,300
委託者報酬	186,239,646	184,432,158
その他費用	2,201,044	2,194,098
営業費用合計	231,505,397	229,274,122
営業利益又は営業損失（△）	△267,437,999	△4,779,360,670
経常利益又は経常損失（△）	△267,437,999	△4,779,360,670
当期純利益又は当期純損失（△）	△267,437,999	△4,779,360,670
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（△）	△34,225,355	△334,559,455
期首剰余金又は期首欠損金（△）	26,839,284,932	27,139,028,567
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,928,212,264	4,120,228,065
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,928,212,264	4,120,228,065
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,395,255,985	4,650,118,990
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,395,255,985	4,650,118,990
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	27,139,028,567	22,164,336,427

（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19期 (2021年 9月30日現在)	第20期 (2022年 9月30日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	104,499,424,396口	103,715,206,248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 1.2597円 (1万口当たり純資産額) (12,597円)	1口当たり純資産額 1.2137円 (1万口当たり純資産額) (12,137円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第19期
自 2020年10月 1日
至 2021年 9月30日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－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	21,720,553,948円
分配準備積立金額	D	5,497,443,634円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	27,217,997,582円
当ファンドの期末残存口数	F	104,499,424,396口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,604円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第20期
自 2021年10月 1日
至 2022年 9月30日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－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	22,388,953,212円
分配準備積立金額	D	4,624,777,933円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	27,013,731,145円
当ファンドの期末残存口数	F	103,715,206,248口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,604円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第20期 自 2021年10月 1日 至 2022年 9月30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、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第20期 (2022年 9月30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19期 自 2020年10月 1日 至 2021年 9月30日	第20期 自 2021年10月 1日 至 2022年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	102,320,913,992円	104,499,424,396円
期中追加設定元本額	18,948,661,063円	17,183,585,775円
期中一部解約元本額	16,770,150,659円	17,967,803,923円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第19期 (2021年 9月30日現在)	第20期 (2022年 9月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	130,155,134	△4,196,969,188
合計	130,155,134	△4,196,969,188

（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	国内債券インデックス　マザーファンド	92,444,255,221	125,816,631,355	
合計		92,444,255,221	125,816,631,355	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,558,120,913
国債証券	524,623,346,850
地方債証券	32,937,311,293
特殊債券	36,905,161,716
社債券	28,317,177,860
未収入金	2,351,452,500
未収利息	602,267,037
前払費用	10,277,586
流動資産合計	627,305,115,755
資産合計	627,305,115,755
負債の部	
流動負債	
未払金	3,459,127,700
未払解約金	198,441,734
未払利息	3,775
流動負債合計	3,657,573,209
負債合計	3,657,573,209
純資産の部	
元本等	
元本	458,239,606,430
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	165,407,936,116
元本等合計	623,647,542,546
純資産合計	623,647,542,546
負債純資産合計	627,305,115,755

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 9月30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 9月30日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	458,239,606,430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　99,972,000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　1.3610円
		(1万口当たり純資産額)　(13,610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 9月30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 9月30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 9月30日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2022年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月 1日
期首元本額	471,608,130,011円
期中追加設定元本額	42,162,303,295円
期中一部解約元本額	55,530,826,876円
期末元本額	458,239,606,430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）	4,163,501,932円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	16,022,136円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	20,710,389,967円
世界経済インデックスファンド	4,122,367,230円
ＤＣマイセレクション２５	26,150,499,367円
ＤＣマイセレクション５０	30,020,680,653円
ＤＣマイセレクション７５	8,800,669,292円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	432,974,004円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	92,444,255,221円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	67,120,766,554円
ＤＣマイセレクションＳ２５	13,387,190,440円
ＤＣマイセレクションＳ５０	14,908,836,492円
ＤＣマイセレクションＳ７５	3,417,338,205円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	692,522,238円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	2,352,296,284円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	892,924,329円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,548,135,601円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,404,466円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	29,000,496円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	9,937,325円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	979,351円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	81,354,182円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	115,659,680円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	33,135,779円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	26,289,986円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,704,999,017円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	745,232,914円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,095,355,287円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	74,777,744円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	54,508,503円

区分	2022年 9月30日現在
バランスD（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	964,351,342円
バランスE（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,097,583,546円
バランスF（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,405,321,712円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	136,135,455円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	5,571,025,390円
日本債券ファンド・シリーズ１	16,478,841,291円
分散投資コア戦略ファンドA	20,452,828,218円
分散投資コア戦略ファンドS	25,702,211,927円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	177,676,675円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,455,618,146円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	72,844,033円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	36,746,584円
SMT　インデックスバランス・オープン	61,654,655円
SMT　世界経済インデックス・オープン	40,981,414円
SMT　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	80,915,028円
SMT　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	126,973,445円
SMT　８資産インデックスバランス・オープン	11,795,184円
グローバル経済コア	233,420,662円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	32,478,414円
DCターゲット・イヤー　ファンド２０５５	21,001,215円
DCターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	36,355,317円
DCターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	20,106,368円
DCターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	5,224,052円
DCターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	3,793,533円
My　SMT　国内債券インデックス（ノーロード）	12,109,090円
１０資産分散投資ファンド	89,612円
ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	83,419,995,160円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	90,414,877円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,016,798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）	318,865,372円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2022年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△10,595,662,800
地方債証券	△404,428,017
特殊債券	△439,068,457
社債券	△411,093,520
合計	△11,850,252,794

(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４３０回利付国債（２年）	990,000,000	991,277,100	
	第４３２回利付国債（２年）	1,550,000,000	1,551,922,000	
	第４３３回利付国債（２年）	1,910,000,000	1,912,272,900	
	第４３４回利付国債（２年）	1,915,000,000	1,917,144,800	
	第４３５回利付国債（２年）	3,120,000,000	3,123,494,400	
	第４３６回利付国債（２年）	720,000,000	720,792,000	
	第４３７回利付国債（２年）	2,390,000,000	2,392,581,200	
	第４３８回利付国債（２年）	370,000,000	370,384,800	
	第４３９回利付国債（２年）	470,000,000	470,512,300	
	第４４０回利付国債（２年）	1,930,000,000	1,932,026,500	
	第１３８回利付国債（５年）	6,890,000,000	6,906,742,700	
	第１３９回利付国債（５年）	5,590,000,000	5,604,701,700	
	第１４０回利付国債（５年）	4,660,000,000	4,672,349,000	
	第１４１回利付国債（５年）	7,650,000,000	7,672,491,000	
	第１４２回利付国債（５年）	4,370,000,000	4,384,508,400	
	第１４３回利付国債（５年）	4,750,000,000	4,767,527,500	
	第１４４回利付国債（５年）	5,830,000,000	5,852,911,900	
	第１４５回利付国債（５年）	5,620,000,000	5,643,323,000	
	第１４６回利付国債（５年）	4,120,000,000	4,137,880,800	
	第１４７回利付国債（５年）	4,170,000,000	4,174,295,100	
	第１４８回利付国債（５年）	6,770,000,000	6,773,723,500	
	第１４９回利付国債（５年）	4,820,000,000	4,820,000,000	
	第１５０回利付国債（５年）	7,600,000,000	7,595,136,000	
	第１５１回利付国債（５年）	4,000,000,000	3,994,640,000	
	第１５２回利付国債（５年）	210,000,000	210,606,900	

第１５３回利付国債（５年）	5,090,000,000	5,075,646,200	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	499,452,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,356,937,900	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	662,227,500	
第４回利付国債（４０年）	950,000,000	1,140,646,000	
第５回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,234,812,100	
第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,420,309,800	
第７回利付国債（４０年）	1,240,000,000	1,337,302,800	
第８回利付国債（４０年）	1,490,000,000	1,490,000,000	
第９回利付国債（４０年）	2,050,000,000	1,502,424,500	
第１０回利付国債（４０年）	2,100,000,000	1,811,691,000	
第１１回利付国債（４０年）	1,635,000,000	1,359,061,050	
第１２回利付国債（４０年）	1,290,000,000	956,625,300	
第１３回利付国債（４０年）	2,120,000,000	1,560,998,400	
第１４回利付国債（４０年）	2,130,000,000	1,671,581,400	
第１５回利付国債（４０年）	1,010,000,000	867,610,200	
第３３２回利付国債（１０年）	4,600,000,000	4,639,100,000	
第３３３回利付国債（１０年）	3,320,000,000	3,353,000,800	
第３３４回利付国債（１０年）	4,260,000,000	4,307,797,200	
第３３５回利付国債（１０年）	2,310,000,000	2,334,971,100	
第３３６回利付国債（１０年）	1,210,000,000	1,224,737,800	
第３３７回利付国債（１０年）	2,800,000,000	2,821,700,000	
第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	4,610,524,800	
第３３９回利付国債（１０年）	4,670,000,000	4,726,413,600	
第３４０回利付国債（１０年）	4,830,000,000	4,893,031,500	
第３４１回利付国債（１０年）	5,340,000,000	5,397,511,800	
第３４２回利付国債（１０年）	4,760,000,000	4,780,563,200	
第３４３回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,680,893,600	
第３４４回利付国債（１０年）	5,900,000,000	5,922,184,000	
第３４５回利付国債（１０年）	3,780,000,000	3,792,700,800	
第３４６回利付国債（１０年）	5,750,000,000	5,766,617,500	
第３４７回利付国債（１０年）	3,850,000,000	3,857,199,500	
第３４８回利付国債（１０年）	4,460,000,000	4,465,485,800	
第３４９回利付国債（１０年）	5,000,000,000	5,002,550,000	
第３５０回利付国債（１０年）	6,890,000,000	6,888,070,800	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	4,940,000,000	4,934,368,400	
第３５２回利付国債（１０年）	4,510,000,000	4,500,619,200	
第３５３回利付国債（１０年）	5,415,000,000	5,399,946,300	
第３５４回利付国債（１０年）	4,790,000,000	4,771,606,400	
第３５５回利付国債（１０年）	3,970,000,000	3,950,229,400	
第３５６回利付国債（１０年）	4,280,000,000	4,253,506,800	
第３５７回利付国債（１０年）	2,770,000,000	2,747,369,100	

第３５８回利付国債（１０年）	3,560,000,000	3,523,438,800	
第３５９回利付国債（１０年）	3,360,000,000	3,320,587,200	
第３６０回利付国債（１０年）	4,890,000,000	4,828,923,900	
第３６１回利付国債（１０年）	4,600,000,000	4,537,118,000	
第３６２回利付国債（１０年）	3,750,000,000	3,695,737,500	
第３６３回利付国債（１０年）	5,070,000,000	4,992,378,300	
第３６４回利付国債（１０年）	5,210,000,000	5,127,942,500	
第３６５回利付国債（１０年）	6,740,000,000	6,651,908,200	
第３６６回利付国債（１０年）	5,970,000,000	5,972,746,200	
第３６７回利付国債（１０年）	5,360,000,000	5,337,112,800	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	129,867,100	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	185,408,000	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	138,567,600	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	133,283,700	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	58,209,500	
第６回利付国債（３０年）	350,000,000	416,808,000	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	214,387,200	
第８回利付国債（３０年）	350,000,000	401,450,000	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	265,634,400	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	172,195,200	
第１１回利付国債（３０年）	260,000,000	295,934,600	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	224,397,600	
第１３回利付国債（３０年）	400,000,000	468,684,000	
第１４回利付国債（３０年）	800,000,000	974,256,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	418,710,000	
第１６回利付国債（３０年）	200,000,000	246,546,000	
第１７回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,406,358,000	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	418,329,750	
第１９回利付国債（３０年）	530,000,000	643,642,600	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	595,790,400	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	608,535,000	
第２２回利付国債（３０年）	540,000,000	671,965,200	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	535,547,800	
第２４回利付国債（３０年）	780,000,000	972,831,600	
第２５回利付国債（３０年）	600,000,000	733,104,000	
第２６回利付国債（３０年）	1,390,000,000	1,718,331,900	
第２７回利付国債（３０年）	1,920,000,000	2,402,764,800	
第２８回利付国債（３０年）	2,090,000,000	2,620,295,700	
第２９回利付国債（３０年）	1,670,000,000	2,071,718,500	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,170,374,000	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,332,012,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,360,000,000	1,668,692,800	

第３３回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,142,831,600	
第３４回利付国債（３０年）	1,795,000,000	2,172,991,100	
第３５回利付国債（３０年）	2,300,000,000	2,709,837,000	
第３６回利付国債（３０年）	2,130,000,000	2,509,672,500	
第３７回利付国債（３０年）	2,255,000,000	2,616,679,450	
第３８回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,609,782,900	
第３９回利付国債（３０年）	1,480,000,000	1,715,897,200	
第４０回利付国債（３０年）	1,360,000,000	1,549,896,800	
第４１回利付国債（３０年）	1,230,000,000	1,378,264,200	
第４２回利付国債（３０年）	1,280,000,000	1,433,241,600	
第４３回利付国債（３０年）	1,300,000,000	1,453,257,000	
第４４回利付国債（３０年）	1,270,000,000	1,418,590,000	
第４５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,549,728,000	
第４６回利付国債（３０年）	1,700,000,000	1,827,398,000	
第４７回利付国債（３０年）	1,630,000,000	1,781,329,200	
第４８回利付国債（３０年）	1,740,000,000	1,828,983,600	
第４９回利付国債（３０年）	1,600,000,000	1,679,440,000	
第５０回利付国債（３０年）	1,710,000,000	1,581,886,800	
第５１回利付国債（３０年）	1,640,000,000	1,343,963,600	
第５２回利付国債（３０年）	1,670,000,000	1,432,425,800	
第５３回利付国債（３０年）	1,320,000,000	1,155,145,200	
第５４回利付国債（３０年）	1,720,000,000	1,572,062,800	
第５５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,311,465,600	
第５６回利付国債（３０年）	1,480,000,000	1,343,055,600	
第５７回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,274,907,900	
第５８回利付国債（３０年）	2,350,000,000	2,117,115,000	
第５９回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,235,061,300	
第６０回利付国債（３０年）	1,630,000,000	1,494,726,300	
第６１回利付国債（３０年）	1,460,000,000	1,270,097,800	
第６２回利付国債（３０年）	480,000,000	394,305,600	
第６３回利付国債（３０年）	1,630,000,000	1,296,713,900	
第６４回利付国債（３０年）	1,790,000,000	1,417,411,500	
第６５回利付国債（３０年）	1,405,000,000	1,111,692,200	
第６６回利付国債（３０年）	1,110,000,000	878,498,400	
第６７回利付国債（３０年）	1,865,000,000	1,548,546,800	
第６８回利付国債（３０年）	1,490,000,000	1,234,316,000	
第６９回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,138,772,200	
第７０回利付国債（３０年）	2,270,000,000	1,923,121,300	
第７１回利付国債（３０年）	1,430,000,000	1,210,123,200	
第７２回利付国債（３０年）	1,150,000,000	971,094,500	
第７３回利付国債（３０年）	1,870,000,000	1,577,326,300	
第７４回利付国債（３０年）	1,740,000,000	1,586,549,400	
第７５回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,314,633,800	

第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	225,346,000	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	337,616,400	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	133,762,200	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	196,332,700	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	402,429,300	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	416,828,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	207,728,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	656,630,100	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	376,354,800	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	209,528,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	136,884,800	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	282,968,100	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	304,642,100	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	178,977,700	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	284,993,100	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	232,815,000	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	413,610,600	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	638,106,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	309,917,200	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	500,770,900	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	311,341,100	
第８６回利付国債（２０年）	510,000,000	551,065,200	
第８７回利付国債（２０年）	1,830,000,000	1,971,001,500	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	456,027,600	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	378,724,500	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	684,810,000	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	490,932,000	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	957,061,600	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	445,875,000	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	666,095,600	
第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	674,202,500	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,742,417,400	
第９７回利付国債（２０年）	900,000,000	994,833,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	484,184,800	
第９９回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,424,921,100	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	534,739,200	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	804,303,500	
第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,423,384,200	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	449,596,000	
第１０４回利付国債（２０年）	160,000,000	178,022,400	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,317,576,200	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	426,553,800	

第１０７回利付国債（２０年）	760,000,000	852,020,800	
第１０８回利付国債（２０年）	870,000,000	964,612,500	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	578,219,200	
第１１０回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,237,236,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,101,037,300	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	891,483,400	
第１１３回利付国債（２０年）	2,020,000,000	2,286,761,200	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,643,851,000	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	799,267,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,705,901,000	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,228,575,600	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	747,958,200	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	592,603,600	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,731,678,600	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,693,920,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,054,181,800	
第１２３回利付国債（２０年）	1,870,000,000	2,148,424,300	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	695,912,400	
第１２５回利付国債（２０年）	1,770,000,000	2,055,093,900	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	835,492,300	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,158,954,600	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,105,518,700	
第１２９回利付国債（２０年）	740,000,000	837,080,600	
第１３０回利付国債（２０年）	1,285,000,000	1,457,074,350	
第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,125,160,000	
第１３２回利付国債（２０年）	660,000,000	745,516,200	
第１３３回利付国債（２０年）	730,000,000	831,156,100	
第１３４回利付国債（２０年）	430,000,000	490,913,800	
第１３５回利付国債（２０年）	630,000,000	713,430,900	
第１３６回利付国債（２０年）	1,050,000,000	1,179,360,000	
第１３７回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,202,888,000	
第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	691,845,600	
第１３９回利付国債（２０年）	830,000,000	934,032,200	
第１４０回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,749,120,000	
第１４１回利付国債（２０年）	1,600,000,000	1,819,280,000	
第１４２回利付国債（２０年）	980,000,000	1,124,001,200	
第１４３回利付国債（２０年）	1,920,000,000	2,164,358,400	
第１４４回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,284,745,500	
第１４５回利付国債（２０年）	2,675,000,000	3,044,711,750	
第１４６回利付国債（２０年）	2,700,000,000	3,073,518,000	
第１４７回利付国債（２０年）	2,250,000,000	2,538,405,000	
第１４８回利付国債（２０年）	2,050,000,000	2,290,813,500	
第１４９回利付国債（２０年）	2,460,000,000	2,748,902,400	

	第１５０回利付国債（２０年）	2,530,000,000	2,796,510,200	
	第１５１回利付国債（２０年）	2,445,000,000	2,643,509,550	
	第１５２回利付国債（２０年）	2,840,000,000	3,067,768,000	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,630,000,000	2,871,171,000	
	第１５４回利付国債（２０年）	2,655,000,000	2,863,815,750	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,780,000,000	2,925,088,200	
	第１５６回利付国債（２０年）	2,480,000,000	2,413,709,600	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,950,000,000	2,784,593,500	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,610,000,000	2,559,861,900	
	第１５９回利付国債（２０年）	2,480,000,000	2,459,044,000	
	第１６０回利付国債（２０年）	2,050,000,000	2,055,391,500	
	第１６１回利付国債（２０年）	2,070,000,000	2,041,020,000	
	第１６２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,237,899,600	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,590,000,000	2,536,930,900	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,320,000,000	1,269,879,600	
	第１６５回利付国債（２０年）	2,150,000,000	2,061,398,500	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,820,000,000	1,794,228,800	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,210,000,000	2,105,776,400	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,660,000,000	1,551,004,400	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,990,000,000	1,821,825,100	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,240,000,000	2,042,185,600	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,720,000,000	1,561,519,200	
	第１７２回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,218,115,800	
	第１７３回利付国債（２０年）	2,350,000,000	2,154,033,500	
	第１７４回利付国債（２０年）	2,830,000,000	2,583,195,700	
	第１７５回利付国債（２０年）	2,030,000,000	1,880,855,900	
	第１７６回利付国債（２０年）	2,850,000,000	2,632,032,000	
	第１７７回利付国債（２０年）	2,340,000,000	2,115,336,600	
	第１７８回利付国債（２０年）	2,120,000,000	1,947,898,400	
	第１７９回利付国債（２０年）	2,935,000,000	2,689,810,100	
	第１８０回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,329,578,300	
	第１８１回利付国債（２０年）	1,690,000,000	1,660,796,800	
国債証券合計		516,060,000,000	524,623,346,850	
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	99,874,000	
	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	103,268,000	
	第５回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年））	100,000,000	83,142,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	104,778,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	121,864,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	118,946,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	114,890,000	
	第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	112,156,000	

第１６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	221,354,000	
第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	111,166,000	
第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	112,124,000	
第１９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	83,498,000	
第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	225,058,000	
第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	224,256,000	
第３３回東京都公募公債（５年）	200,000,000	199,544,000	
第７２６回東京都公募公債	200,000,000	201,746,000	
第７２８回東京都公募公債	100,000,000	100,775,000	
第７５１回東京都公募公債	100,000,000	100,927,000	
第７６５回東京都公募公債	100,000,000	100,288,000	
第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,070,000	
第７８１回東京都公募公債	300,000,000	298,731,000	
第８００回東京都公募公債	200,000,000	196,406,000	
第８３０回東京都公募公債	300,000,000	296,217,000	
平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,440,000	
平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	99,946,000	
平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	100,393,000	
平成３０年度第１４回北海道公募公債	200,000,000	199,080,000	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	250,434,000	
第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	111,899,000	
第１５回神奈川県公募公債（２０年）	200,000,000	224,648,000	
第１７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	113,482,000	
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	112,211,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	109,096,000	
第７８回神奈川県公募公債（５年）	200,000,000	199,824,000	
第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	201,732,000	
第２１５回神奈川県公募公債	100,000,000	101,165,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,365,000	
第２２６回神奈川県公募公債	100,000,000	100,244,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,070,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	196,334,000	
第６回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	224,774,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	225,050,000	
第１０回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	112,400,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,959,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	152,398,260	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,301,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,282,000	
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	155,943,840	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,146,000	
第４３９回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,056,000	

第４４０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	99,534,000	
第４６５回大阪府公募公債（１０年）	160,000,000	156,288,000	
第４６８回大阪府公募公債（１０年）	182,000,000	177,799,440	
第４６９回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	195,322,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	112,864,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	112,293,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	101,323,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	94,621,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	97,485,000	
令和２年度第１２回京都府公募公債	140,500,000	137,484,870	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	110,773,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	101,258,000	
第６回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	106,362,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	105,243,000	
第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	105,168,000	
第９回兵庫県公募公債（２０年）	400,000,000	453,904,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	100,963,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	95,795,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	295,821,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	105,957,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	88,420,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	112,232,000	
第１８回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	110,010,000	
平成２６年度第３回静岡県公募公債	100,000,000	101,047,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,117,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	100,210,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	100,172,000	
令和２年度第１１回静岡県公募公債	310,000,000	305,412,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	113,113,000	
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,987,000	
平成２６年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	202,018,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,993,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,889,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	200,430,000	
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	290,583,000	
	100,000,000	99,780,000	

	平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）			
	平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	87,065,000	
	令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	196,192,000	
	令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	98,231,000	
	令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年）	200,000,000	165,292,000	
	平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	112,329,000	
	平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年）	200,000,000	225,070,000	
	平成２５年度第４回広島県公募公債	100,000,000	100,765,000	
	平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	126,805,393	
	平成２９年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,069,000	
	令和２年度第７回広島県公募公債	390,000,000	384,036,900	
	第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	110,548,000	
	第６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	111,858,000	
	第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	92,821,000	
	第７回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	226,378,000	
	第８回埼玉県公募公債（１５年）	200,000,000	191,156,000	
	第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	224,648,000	
	第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	189,786,000	
	平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	100,921,000	
	平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	101,252,000	
	平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	99,880,000	
	平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	100,476,000	
	平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,093,000	
	令和２年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	97,974,000	
	令和２年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	97,854,000	
	令和３年度第８回埼玉県公募公債	150,000,000	146,457,000	
	平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	110,683,000	
	平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	110,922,000	
	平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	104,996,000	
	平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	113,568,000	
	平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	105,650,000	
	平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	118,347,000	
	平成２６年度第８回福岡県公募公債	100,000,000	100,849,000	
	平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	107,242,000	
	平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	101,236,000	

平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	87,065,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	96,438,000	
令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	295,050,000	
令和３年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	97,949,000	
令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	94,366,000	
第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	223,716,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,737,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,232,000	
平成２５年度第８回千葉県公募公債	300,000,000	302,277,000	
平成２５年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	100,846,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	100,887,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	101,278,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	99,880,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	120,231,600	
令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	293,943,000	
令和２年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	98,219,000	
令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	300,000,000	294,786,000	
令和４年度第１回長野県公募公債（１０年）	200,000,000	198,140,000	
第１回群馬県公募公債（２０年）	200,000,000	222,900,000	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	100,050,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,748,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,942,000	
第１３１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,882,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,781,000	
第１３４回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,158,080	
第１３５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,044,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,007,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,956,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,904,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,750,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,576,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,100,424	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,321,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,052,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,964,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,778,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,596,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,276,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,690,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,193,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,459,000	

第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,140,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,915,286	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,100,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,256,000	
第２１９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,848,000	
第２２８回共同発行市場公募地方債	200,000,000	196,598,000	
第２３３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,098,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	100,102,000	
平成３０年度第１回浜松市公募公債	100,000,000	99,224,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	225,694,000	
第１５回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	82,370,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	285,372,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	98,241,000	
平成２５年度第８回大阪市公募公債	100,000,000	100,999,000	
令和３年度第２回大阪市公募公債	200,000,000	195,992,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	122,385,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	123,685,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	111,044,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	110,945,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,356,000	
第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	294,939,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	200,386,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	130,868,400	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	224,110,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	113,537,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	112,421,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	82,380,000	
令和３年度第６回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	82,547,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	105,716,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	337,008,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,171,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	100,332,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	99,835,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,207,000	
第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	217,690,000	
令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	294,951,000	
令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	97,995,000	
平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	105,898,000	
平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	100,819,000	

	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	111,442,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,125,000	
	第９３回川崎市公募公債	100,000,000	97,874,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	100,848,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,276,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	99,947,000	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	112,513,000	
	平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	110,470,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	201,992,000	
	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	151,344,000	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	100,883,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,132,300	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	170,136,000	
	令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	540,479,500	
	令和２年度第３回広島市公募公債（５年）	200,000,000	199,656,000	
	令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	195,962,000	
	令和３年度第８回千葉市公募公債	300,000,000	295,173,000	
	令和４年度第１回千葉市公募公債	100,000,000	98,840,000	
	平成２５年度第４回福井県公募公債	100,000,000	101,034,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	201,258,000	
	平成３０年度第３回岡山県公募公債（１０年）	100,000,000	99,172,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	110,533,000	
地方債証券合計		32,211,430,000	32,937,311,293	
特殊債券	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,916,000	
	第５２回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,932,000	
	第７８回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,134,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	72,003,000	
	第２０回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,433,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	122,964,000	
	第２７回道路債券	400,000,000	413,824,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	248,574,000	
	第３３回道路債券	200,000,000	251,260,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,435,000	
	第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,088,000	

第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,014,000	
第４２回道路債券	100,000,000	105,241,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,301,000	
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	123,008,000	
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	225,108,000	
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	226,910,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,830,000	
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	119,998,000	
第１１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,879,000	
第１２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,909,000	
第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,102,000	
第１２５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,872,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,132,000	
第１３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,761,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,843,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,604,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,810,000	
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	112,342,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	578,538,000	
第１９６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,725,000	
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	267,937,032	
第２０７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,774,000	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	89,678,000	
第２０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	533,000,000	538,393,960	
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,871,000	
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	220,958,000	
第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	103,062,840	

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	101,076,000	
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	101,053,000	
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	219,040,000	
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	101,053,000	
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	100,975,000	
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	302,031,000	
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	106,593,000	
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	214,446,000	
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	201,792,000	
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	100,322,000	
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	82,630,000	
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	106,555,950	
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	205,043,050	
第３０６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,111,000	
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	200,090,000	
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	100,000,000	
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	120,063,600	
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	199,384,000	
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	289,473,000	
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	213,944,360	
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	98,311,000	
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	98,013,000	
第４０３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	117,114,000	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	358,893,000	
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	105,336,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	371,475,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	103,160,000	
第７回公営企業債券（３０年）	200,000,000	247,748,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	41,293,600	

第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	121,915,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	224,594,000	
第１０回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	220,450,000	
第１１回政府保証地方公共団体金融機構債券（４年）	600,000,000	599,652,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年）	200,000,000	161,766,000	
第１８回公営企業債券（２０年）	100,000,000	109,104,000	
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	225,464,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	112,187,000	
第３４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	500,000,000	556,350,000	
第５４回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	105,817,950	
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	706,475,000	
第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,946,000	
第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,012,000	
第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,805,000	
第６７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,940,000	
第６９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,948,000	
第７６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,376,000	
Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,032,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,063,000	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,896,000	
第８３回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,786,000	
第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,702,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,916,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,168,170	
Ｆ９５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,938,000	
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,071,000	
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,024,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,088,000	
Ｆ１０７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,208,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	155,984,400	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,998,000	
第１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,978,000	
第１１９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,650,000	
第１２０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,242,000	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,807,000	
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,304,000	

Ｆ２０２回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,944,000	
Ｆ２０６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,257,000	
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,489,000	
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,401,000	
Ｆ４４１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,960,000	
第２９回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,478,000	
第７回阪神高速道路債券	100,000,000	105,065,000	
第１９回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,580,000	
第４回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	112,510,000	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	114,179,000	
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,868,960	
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,047,000	
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,273,400	
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	186,923,330	
第５４回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,848,200	
第８７回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,816,000	
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	99,843,000	
第１１７回都市再生債券	200,000,000	205,640,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	137,186,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	75,697,000	
第１７１回都市再生債券	200,000,000	160,158,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,663,000	
第６２回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,096,000	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,218,000	10,296,576	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,289,000	10,384,687	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	125,700,000	124,580,013	
第３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,213,000	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	87,254,000	86,422,469	
第４回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,376,000	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,233,000	10,320,696	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,168,000	11,335,631	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	154,986,000	153,197,461	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,970,000	11,129,942	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	177,426,000	175,030,749	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	63,304,000	62,568,407	
	11,447,000	11,676,283	

第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券			
第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	214,869,000	211,508,448	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	148,238,000	146,057,419	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,553,000	11,803,584	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,570,000	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,317,000	16,020,203	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,288,000	16,032,372	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,362,000	18,326,111	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,097,000	20,076,103	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,978,000	22,160,529	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,358,000	22,531,408	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,348,000	46,665,183	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,062,000	10,151,954	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,175,000	21,162,768	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,267,000	10,342,051	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,537,000	21,531,196	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,147,000	21,155,357	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,000,000	19,904,590	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,143,000	11,343,574	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,210,000	41,894,799	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,184,000	22,085,379	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,766,000	10,924,475	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,210,000	29,365,199	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,852,000	27,936,283	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,087,000	28,201,630	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,108,000	61,386,613	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,050,000	75,375,181	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,617,000	38,776,355	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,439,000	39,943,886	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,652,000	40,213,540	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,894,000	35,164,008	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,200,000	34,188,032	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,642,000	40,243,710	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	170,502,000	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,932,000	103,938,764	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,316,000	140,346,864	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,244,000	40,313,006	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,582,000	41,708,962	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,443,000	42,466,642	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,625,000	

第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,271,000	134,426,754	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,084,000	45,982,974	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,848,000	96,036,445	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,860,000	53,664,000	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,609,000	57,270,759	
第９６回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	318,642,000	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,047,000	56,978,501	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,799,000	177,280,193	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,214,000	119,371,909	
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,883,000	57,820,431	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,494,000	62,473,599	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,742,000	66,659,482	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,441,000	72,429,717	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,115,000	71,923,225	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,392,000	72,490,012	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,006,000	73,398,410	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,396,000	73,647,576	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,143,000	75,286,391	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,580,000	75,782,036	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,584,000	75,571,559	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,534,000	75,513,801	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,317,000	76,304,920	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,718,000	154,296,706	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,402,000	76,339,270	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,268,000	156,383,028	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,536,000	77,429,427	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,408,000	154,873,731	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,557,000	78,399,445	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,214,000	157,562,458	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,494,000	158,772,826	

第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,790,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,381,000	80,401,172	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,145,000	80,341,664	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,298,000	79,808,620	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,754,000	163,914,110	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,160,000	82,125,852	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,355,000	81,461,174	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,146,000	165,005,305	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,869,000	83,150,387	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	259,395,000	249,836,294	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,032,000	167,551,048	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,502,000	86,378,837	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,207,000	86,812,684	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,566,000	179,931,393	
第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,683,000	90,690,315	
第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,584,000	181,514,142	
第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,256,000	182,784,326	
第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,016,000	91,031,968	
第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,304,000	184,033,672	
第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,488,000	184,929,346	
第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,724,000	92,825,731	
第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,232,000	93,615,451	
第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,336,000	280,432,710	
第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,580,000	94,040,911	
第１７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,997,000	96,632,881	
第１８１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,800,000	97,508,684	
第１８３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,863,000	98,725,560	

	第１８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	197,190,000	
	第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	92,125,000	
	第３２０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	82,627,000	
	第６５回日本学生支援債券	200,000,000	199,910,000	
	第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	105,263,000	
	第２４回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	599,988,000	
	い第８２３号商工債	200,000,000	200,234,000	
	い第８２９号商工債	200,000,000	200,048,000	
	い第８３２号商工債	200,000,000	199,738,000	
	い第８３３号商工債	100,000,000	99,837,000	
	い第８４３号商工債	200,000,000	199,792,000	
	い第８４７号商工債	100,000,000	99,771,000	
	い第８５０号商工債	200,000,000	199,478,000	
	第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,000,000	
	第３６０回信金中金債（５年）	200,000,000	199,518,000	
	第３７６回信金中金債（５年）	100,000,000	99,635,000	
	第３７９回信金中金債（５年）	100,000,000	99,518,000	
	第３８５回信金中金債（５年）	100,000,000	99,286,000	
	第２５４号商工債（３年）	300,000,000	299,802,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	101,112,000	
	第２１回国際協力機構債券	100,000,000	112,367,000	
	第５３回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,962,000	
	第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,028,000	
	第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	196,804,000	
	第７３回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	490,105,000	
	第８６回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,124,000	
	第５４回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	598,860,000	
	第６３回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,810,000	
	第６６回西日本高速道路株式会社社債	800,000,000	799,536,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,684,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	192,560,000	
特殊債券合計		36,230,591,000	36,905,161,716	
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	99,734,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	298,389,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,599,000	
	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	99,048,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,674,000	

第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,888,000	
第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,579,000	
第１回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,132,000	
第３９回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,241,000	
第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,507,000	
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	199,766,000	
第１１回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,749,000	
第８回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,297,000	
第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,539,000	
第２５回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	97,698,000	
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	100,086,000	
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	199,790,000	
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	100,117,000	
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	101,015,000	
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	198,446,000	
第８回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,556,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,941,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,519,000	
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	99,036,000	
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	99,501,000	
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	199,458,000	
第１３回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,810,000	
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	99,813,000	
第２５回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,965,000	
第１３回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,736,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,360,000	
第１３回ＪＳＲ株式会社無担保社債	100,000,000	99,920,000	
第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,540,000	
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	198,632,000	
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	199,916,000	
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	99,368,000	
	100,000,000	90,280,000	

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			
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,454,000	
第７回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,742,000	
第４回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,999,000	
第６回株式会社電通無担保社債	200,000,000	198,528,000	
第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	290,184,000	
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	100,036,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,299,000	
第１５回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	98,998,000	
第１９回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	92,199,000	
第１０回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,687,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,498,000	
第４回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,237,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,077,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,807,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,021,000	
第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,424,000	
第１１回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	99,931,000	
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,821,000	
第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,078,000	
第１５回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,722,000	
第１４回株式会社ＬＩＸＩＬ無担保社債	100,000,000	99,699,000	
第８回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,585,000	
第１７回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	105,712,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,141,000	
第１回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,554,000	
第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	98,342,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,072,000	
第２０回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,925,000	
第２１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,681,000	
第２３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	97,713,000	
第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,546,000	
第１９回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,745,000	
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,903,000	
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,735,000	
第２２回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,722,000	
第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,636,000	

	第２７回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	195,984,000	
	第４回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,840,000	
	第８回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	94,814,000	
	第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,542,000	
	第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	89,950,000	
	第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,993,000	
	第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,682,000	
	第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	112,396,000	
	第７３回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,056,000	
	第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,514,000	
	第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,501,000	
	第６０回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,061,000	
	第３回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	99,926,000	
	第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	98,207,000	
	第２４回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	99,721,000	
	第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	114,207,000	
	第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	108,991,000	
	第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,779,000	
	第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,708,000	
	第１回みずほＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	302,070,000	
	第４回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,477,000	
	第９回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,376,000	
	第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,554,000	
	第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	197,272,000	
	第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,750,000	
	第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,784,000	
	第６７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,713,000	
	第７６回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,850,000	
	第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,920,000	
	第４１回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,922,000	
	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	99,312,000	
	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	99,014,000	
	第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,266,000	
	第３２回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,938,000	

第３５回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,658,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,027,000	
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,023,000	
第８０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,243,000	
第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,646,000	
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	200,008,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	198,666,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,498,000	
第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,142,000	
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	99,294,000	
第３回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,590,000	
第４回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,652,000	
第５回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,546,000	
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	199,000,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,074,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,906,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	91,321,000	
第１３５回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,916,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,140,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,147,000	
第１０９回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	96,967,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,534,000	
第１２４回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,826,000	
第１３２回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	98,975,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,049,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	91,922,000	
第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,744,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,015,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	91,817,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	81,563,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	92,605,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,072,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,509,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	223,422,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,119,000	

第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	93,781,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	87,261,000	
第１４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,827,000	
第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	83,432,000	
第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	90,228,000	
第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	78,320,000	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,829,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	82,899,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	91,772,000	
第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	498,625,000	
第７５回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	90,077,000	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,014,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,156,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,762,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	86,868,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	74,421,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	67,773,000	
第５４回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	80,196,000	
第５６回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	88,086,000	
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	163,582,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,464,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,813,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,367,000	
第１１回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	396,488,000	
第３１回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	178,520,000	
第３３回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	92,795,000	
第３６回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,348,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,602,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,125,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	96,372,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	88,257,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,312,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,692,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,894,000	
第５２４回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,525,000	
第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,594,000	
第５３８回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,019,000	

第５５０回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,961,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,461,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,982,000	
第４１６回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,002,000	
第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,661,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,279,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,330,000	
第３３０回北陸電力株式会社社債	200,000,000	194,750,000	
第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	127,525,860	
第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,006,000	
第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,249,000	
第５２１回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,470,000	
第５２７回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,804,000	
第５３５回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,286,000	
第３０９回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,945,000	
第３１４回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,494,000	
第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,932,000	
第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,238,000	
第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,495,000	
第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,952,000	
第４８９回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,954,000	
第４９４回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,272,000	
第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,223,000	
第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,733,000	
第３５０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	93,569,000	
第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	94,764,000	
第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,309,000	
第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,259,000	
第７７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,331,000	
第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,112,000	
第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,118,000	
第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	298,212,000	
第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,431,000	
第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,859,000	
第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,648,000	
第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	275,151,000	
第９回株式会社ＪＥＲＡ無担保社債	100,000,000	97,927,000	
第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	83,129,000	

	第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	195,272,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	194,540,000	
	第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	90,004,000	
	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	199,702,000	
社債券合計		28,826,000,000	28,317,177,860	
合計			622,782,997,719	

(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。

2【ファンドの現況】

【ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ】

【純資産額計算書】

（2022年10月31日現在）

Ⅰ　資産総額	125,709,934,348円
Ⅱ　負債総額	146,949,314円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	125,562,985,034円
Ⅳ　発行済口数	103,584,115,216口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2122円
（1万口当たり純資産額）	（12,122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10月31日現在）

Ⅰ　資産総額	627,709,942,735円
Ⅱ　負債総額	5,754,830,182円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	621,955,112,553円
Ⅳ　発行済口数	457,489,720,070口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3595円
（1万口当たり純資産額）	（13,595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10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12月28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10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	535	13,948,677
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	69	220,432
単位型公社債投資信託	51	184,667
合計	655	14,353,777

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				
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	株主資本合計
		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12月28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
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
株式会社東邦銀行	23,519	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
第一生命保険株式会社	60,000	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
株式会社千葉銀行	145,069	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社第四北越銀行	32,776	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000	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。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
アイザワ証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

３【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2022年3月末日現在）
④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

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

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2022年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年12月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　松崎雅則

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本債券インデックス・オープンSの2021年10月1日から2022年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本債券インデックス・オープンSの2022年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。