

【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】	2023年6月30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】	上坪 直樹
【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マイセレクション75
【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マイセレクション75

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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。
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。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2023年 7月 1日から2023年12月28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、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、

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ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、国内株式、国内債券、外国株式及び外国債券に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長を目指します。

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

(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

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。

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。

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

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。

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。

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。

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。

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 から 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 から 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。

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。

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)プル・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

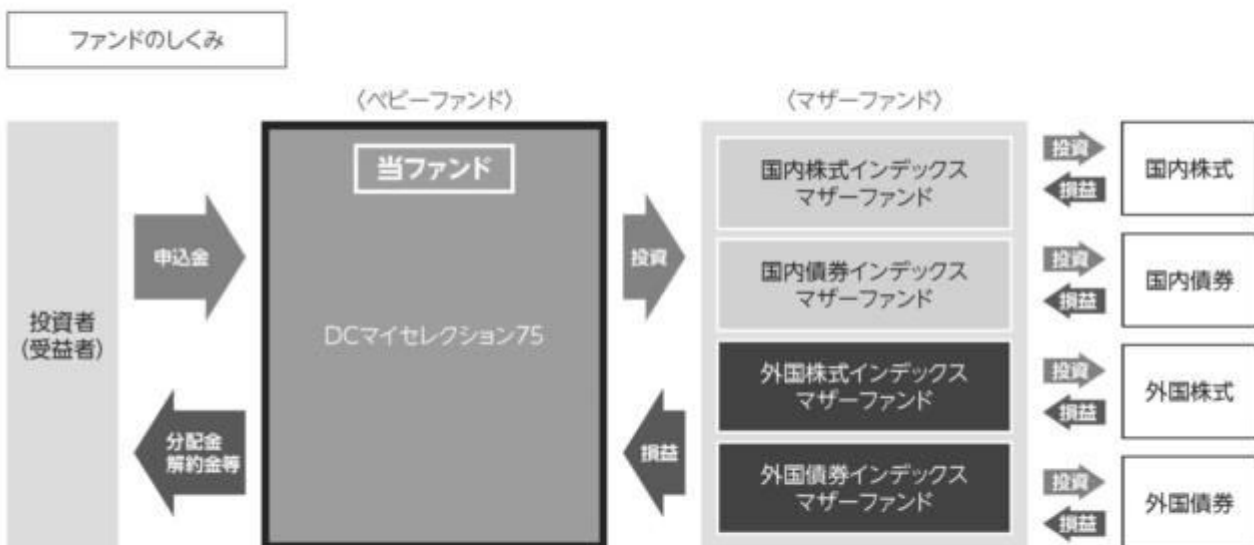
託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

- (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. 日本を含む世界の公社債や株式にバランスよく投資を行い、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX(東証株価指数)(配当込み) ¹
国内債券	NOMURA-BPI 総合 ²
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース) ³
外国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) ⁴

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

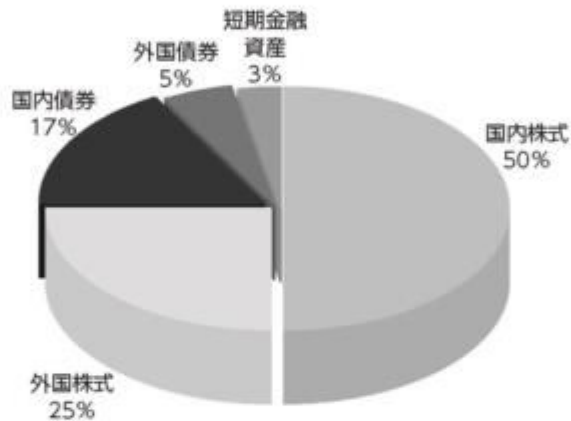
各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

- ※1 「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指数です。TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIX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、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIX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、配当込みTOPIX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。
- ※2 「NOMURA-BPI総合」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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。
- ※3 「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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCIコクサイ・インデックス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MSCIコクサイ・インデックス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。
- ※4 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

3. 期待リターンとリスクのバランスを勘案し、国内株式50%、外国株式25%、国内債券17%、外国債券5%、短期金融資産3%を基準ポートフォリオとして運用します。

- 資産ごとの投資比率は、原則として、基準ポートフォリオから±5%の範囲内にコントロールします。
- 基準ポートフォリオは、投資環境等の変化に応じて、年1回程度見直しを行うことがあります。

基準ポートフォリオ



ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基準ポートフォリオに基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以下とします。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2001年10月1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マイセレクション75」から「DCマイセレクション75」に変更 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2023年 4月28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

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」および「外国債券インデックス マザーファンド」（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。

投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券への投資を通して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
- 2)基準ポートフォリオは、国内株式50%、国内債券17%、外国株式25%、外国債券5%および短期金融資産3%の比率で基準配分します。
- 3)各資産につき、上記の基本アロケーションにおける各資産毎の比率に一定の変動幅を設けます。市況動向等に応じて、基本アロケーションは1年に1回程度、若干の見直しを行う場合があります。
- 4)実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上をはかるため、為替のエクスポージャーのコントロールを行う場合があります。
- 5)投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6)投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 7)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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

（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せん。）

ハ．金銭債権

二．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ) 委託会社は、信託金を主として次に掲げる第1号から第4号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに第5号から第26号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．国内株式インデックス マザーファンド
- 2．国内債券インデックス マザーファンド
- 3．外国株式インデックス マザーファンド
- 4．外国債券インデックス マザーファンド
- 5．株券または新株引受権証書
- 6．国債証券
- 7．地方債証券
- 8．特別の法律により法人の発行する債券
- 9．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。）
- 10．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。）
- 11．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。）
- 12．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。）
- 13．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。）
- 14．コマーシャル・ペーパー
- 15．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
- 16．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
- 17．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。）
- 18．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。）
- 19．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。）
- 20．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。）
- 21．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。）
- 22．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 23．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。）
- 24．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。）
- 25．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
- 26．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5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5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6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するもの、および第18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17号の証券および第18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。

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

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

(二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を前記(八)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

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。

このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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。

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総

額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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。

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

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。

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

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

「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

NOMURA-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。

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。

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。

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。

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

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純

資産総額の10%以下とします。

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。

外貨建資産への投資は、行いません。

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。

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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。

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

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。

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。

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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。

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。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利

先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

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

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。

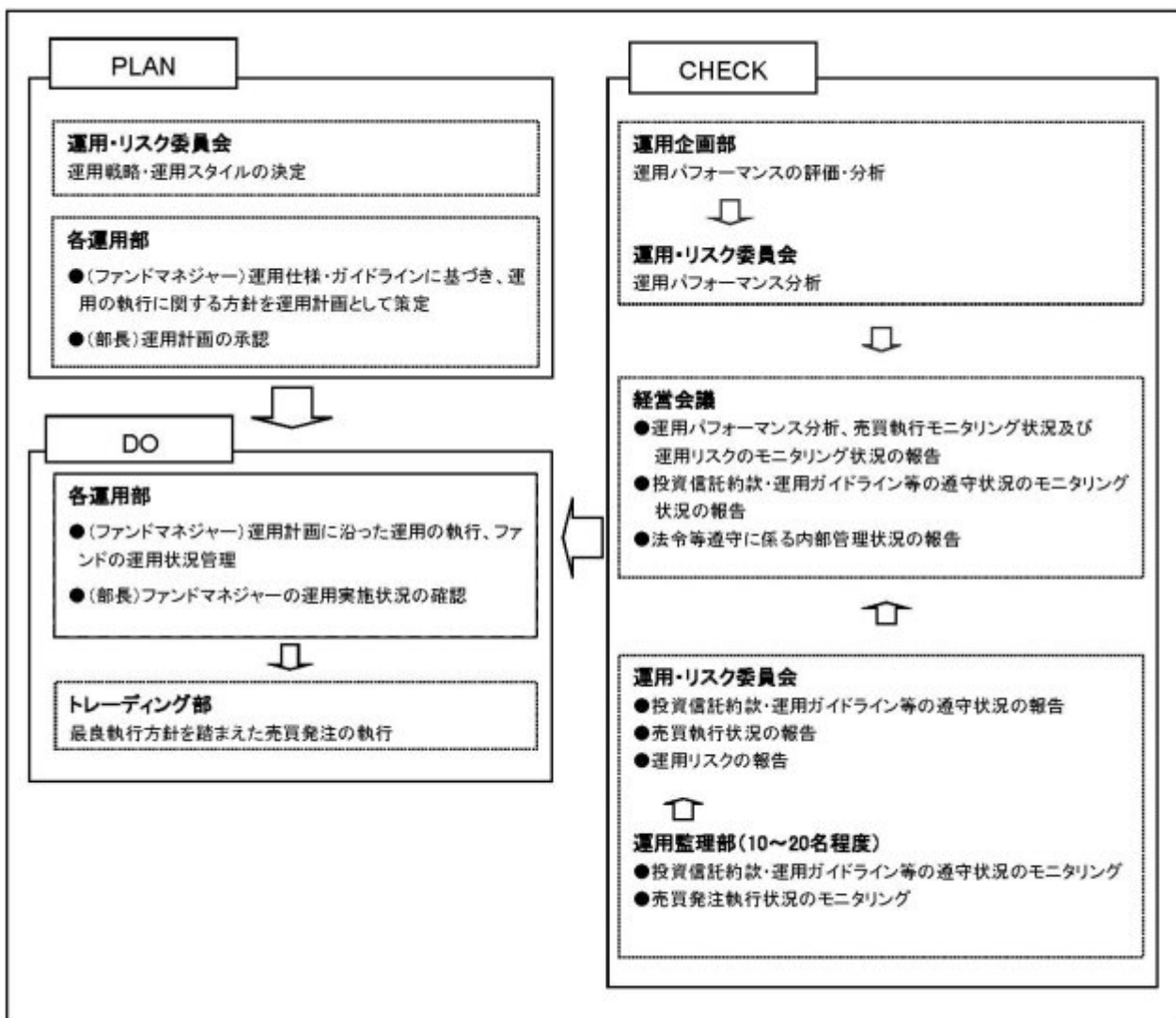
外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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。

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

(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。

- ・ 分配対象額の範囲は、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。
- ・ 分配については、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>

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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」）

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」）

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」）

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」）

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」）

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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、取引所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）

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

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。）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、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨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通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことを指図することができます。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）

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および為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（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）

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および為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として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。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。また、為替先渡取引の指図にあつ

ては、当該投資信託財産に係る為替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為替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、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。（投資信託約款第25条）

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。

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）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。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）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、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31条）

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39条）

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」）

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

産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

前記 から 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 から 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の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 、 および 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は帰属します。

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。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

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。

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。

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。

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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。

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小さかった場合も同様です。

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。

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。

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。

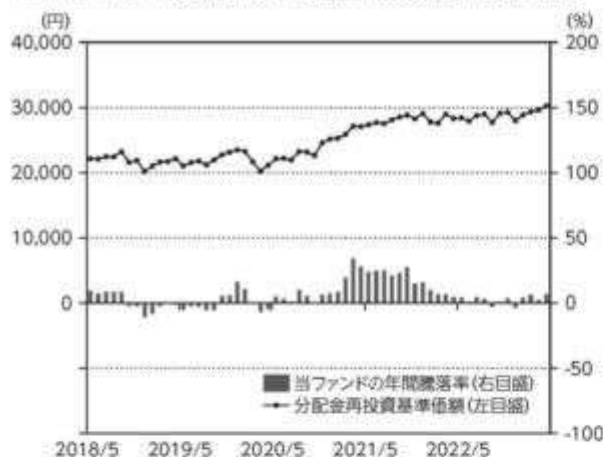
(ロ) リスクの管理体制

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】

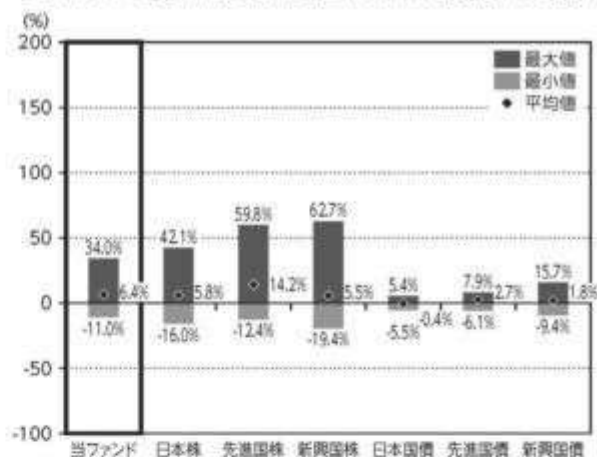
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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



*2018年5月～2023年4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く網羅するとともに、投資対象としての適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平均指数に係る権利又は商標は、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権利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 Emerging Markets インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets 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、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利率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フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社は、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・サービスに関して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、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は中断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権その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Global Bond Index Emerging Markets インデックス (円ベース)	本指数は、信頼性が低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あります。

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せん。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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0.352%（税抜 0.32%）（ ）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 0.187% (税抜 0.17%)	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 0.132% (税抜 0.12%)	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。

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。

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】

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があります。）。

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。

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があります。）。

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。

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、2023年 4月28日現在のもので、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、2023年4月28日現在の状況について記載してあります。

【DCマイセクション75】

（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	77,134,471,886	97.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,240,097,959	2.82
合計(純資産総額)		79,374,569,845	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】

【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	国内株式インデックス マザーファンド	19,393,679,713	1.8386	35,659,089,355	2.0865	40,464,912,721	50.98
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	4,456,181,414	4.1300	18,404,106,005	4.5249	20,163,775,280	25.40
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	9,344,706,349	1.3582	12,692,061,353	1.3684	12,787,296,167	16.11
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,199,086,685	3.1214	3,742,841,433	3.1011	3,718,487,718	4.68

(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。

□. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.18
合計	97.18

(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。

【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。

(3) 【運用実績】

【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12期計算期間末	(2013年 9月30日)	28,620,541,787	28,620,541,787	14,959	14,959
第13期計算期間末	(2014年 9月30日)	33,482,824,281	33,482,824,281	17,076	17,076
第14期計算期間末	(2015年 9月30日)	35,594,656,829	35,594,656,829	18,009	18,009
第15期計算期間末	(2016年 9月30日)	36,342,020,872	36,342,020,872	17,450	17,450
第16期計算期間末	(2017年10月 2日)	45,362,951,367	45,362,951,367	21,401	21,401
第17期計算期間末	(2018年10月 1日)	52,993,517,919	52,993,517,919	23,203	23,203
第18期計算期間末	(2019年 9月30日)	51,706,907,032	51,706,907,032	21,959	21,959
第19期計算期間末	(2020年 9月30日)	55,287,709,785	55,287,709,785	23,161	23,161
第20期計算期間末	(2021年 9月30日)	70,027,245,748	70,027,245,748	28,499	28,499
第21期計算期間末	(2022年 9月30日)	71,160,726,533	71,160,726,533	27,701	27,701
	2022年 4月末日	71,310,786,508		28,297	
	5月末日	71,833,770,867		28,396	
	6月末日	71,089,209,298		27,915	
	7月末日	73,269,560,400		28,746	
	8月末日	73,990,000,148		28,933	
	9月末日	71,160,726,533		27,701	
	10月末日	74,971,682,326		29,105	
	11月末日	75,492,402,630		29,231	

12月末日	72,641,797,005		27,963
2023年 1月末日	75,109,405,963		28,848
2月末日	76,132,153,366		29,303
3月末日	77,668,360,163		29,592
4月末日	79,374,569,845		30,215

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	0
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	0
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	0
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	0
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	45.8
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	14.2
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	5.5
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	3.1
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	22.6
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	8.4
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	5.4
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	5.5
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	23.0
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	2.8
第22期中間計算期間	2022年10月 1日～2023年 3月31日	6.8

(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12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	3,425,315,153	3,238,964,390	19,133,264,738
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	2,840,594,590	2,365,992,578	19,607,866,750
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	3,273,383,820	3,115,996,674	19,765,253,896
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	2,775,993,818	1,714,409,012	20,826,838,702
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	3,008,685,113	2,638,389,799	21,197,134,016
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	3,893,957,849	2,252,056,125	22,839,035,740
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	3,074,624,736	2,366,988,957	23,546,671,519
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	3,708,520,735	3,384,312,227	23,870,880,027
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	3,890,760,985	3,190,191,657	24,571,449,355
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	3,763,124,355	2,645,593,392	25,688,980,318
第22期中間計算期間	2022年10月 1日～2023年 3月31日	1,717,071,355	1,159,655,298	26,246,396,375

(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)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	530,575,131,960	98.44
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		8,418,567,842	1.56
合計（純資産総額）		538,993,699,802	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	8,499,540,000	1.58

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,896,100	2,113.03	20,910,817,789	1,857.00	18,377,057,700	3.41
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,274,900	11,933.04	15,213,445,322	12,830.00	16,356,967,000	3.03
日本	株式	キーエンス	電気機器	180,300	51,630.29	9,308,942,935	61,100.00	11,016,330,000	2.04
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,316,200	3,982.72	9,224,777,873	4,149.00	9,609,913,800	1.78
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,116,300	740.03	8,226,453,739	852.90	9,481,092,270	1.76
日本	株式	第一三共	医薬品	1,574,700	3,565.60	5,614,756,324	4,647.00	7,317,630,900	1.36
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,599,600	3,758.39	6,011,932,788	4,512.00	7,217,395,200	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,297,100	4,013.38	5,205,765,168	5,549.00	7,197,607,900	1.34
日本	株式	日立製作所	電気機器	885,100	6,777.70	5,998,943,876	7,485.00	6,624,973,500	1.23
日本	株式	任天堂	その他製品	1,137,800	5,827.74	6,630,804,984	5,721.00	6,509,353,800	1.21
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,396,800	4,525.89	6,321,769,694	4,248.00	5,933,606,400	1.10
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,179,400	4,486.54	5,291,426,154	5,018.00	5,918,229,200	1.10
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	381,400	19,527.00	7,447,599,492	15,495.00	5,909,793,000	1.10
日本	株式	信越化学工業	化学	1,500,600	3,635.32	5,455,170,482	3,863.00	5,796,817,800	1.08
日本	株式	三井物産	卸売業	1,353,400	3,203.27	4,335,311,701	4,229.00	5,723,528,600	1.06
日本	株式	HOYA	精密機器	384,900	13,940.04	5,365,523,128	14,210.00	5,469,429,000	1.01
日本	株式	ダイキン工業	機械	217,300	20,735.56	4,505,837,883	24,620.00	5,349,926,000	0.99
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,175,000	3,735.39	4,389,084,625	4,492.00	5,278,100,000	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,465,000	3,192.13	4,676,474,263	3,588.00	5,256,420,000	0.98
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,371,700	4,666.82	6,401,477,280	3,824.00	5,245,380,800	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,567,000	1,542.91	3,960,675,598	1,965.00	5,044,155,000	0.94
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,754,500	2,478.49	4,348,511,980	2,720.00	4,772,240,000	0.89
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	980,500	3,942.23	3,865,363,416	4,799.00	4,705,419,500	0.87
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	891,700	5,367.37	4,786,084,552	5,094.00	4,542,319,800	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,903,900	1,492.42	4,333,861,089	1,531.50	4,447,322,850	0.83
日本	株式	村田製作所	電気機器	546,600	8,201.66	4,483,027,514	7,880.00	4,307,208,000	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	884,500	4,266.90	3,774,079,181	4,589.00	4,058,970,500	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	657,200	5,418.62	3,561,120,650	6,145.00	4,038,494,000	0.75
日本	株式	S M C	機械	59,000	66,105.38	3,900,217,538	67,750.00	3,997,250,000	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,707,500	2,044.05	3,490,224,865	2,048.00	3,496,960,000	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.30

建設業	2.03	
食料品	3.60	
繊維製品	0.47	
パルプ・紙	0.17	
化学	6.09	
医薬品	5.50	
石油・石炭製品	0.45	
ゴム製品	0.76	
ガラス・土石製品	0.71	
鉄鋼	0.85	
非鉄金属	0.71	
金属製品	0.55	
機械	5.29	
電気機器	17.44	
輸送用機器	7.21	
精密機器	2.52	
その他製品	2.33	
電気・ガス業	1.24	
陸運業	3.06	
海運業	0.59	
空運業	0.48	
倉庫・運輸関連業	0.14	
情報・通信業	8.41	
卸売業	6.12	
小売業	4.55	
銀行業	5.89	
証券、商品先物取引業	0.70	
保険業	2.15	
その他金融業	1.11	
不動産業	1.88	
サービス業	5.04	
	小計	98.44
合計		98.44

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	413円		8,194,262,400	8,499,540,000	1.58

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

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

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	537,443,289,460	84.76
地方債証券	日本	32,010,698,301	5.05
特殊債券	日本	36,211,958,269	5.71
社債券	日本	26,388,931,000	4.16
	フランス	795,720,000	0.13
	スペイン	397,052,000	0.06
	小計	27,581,703,000	4.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		828,467,900	0.13
合計(純資産総額)		634,076,116,930	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)	8,820,000,000	100.33	8,849,784,000	100.25	8,842,667,400	0.100	2024/9/20	1.39
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	6,660,000,000	100.06	6,663,996,000	100.05	6,663,596,400	0.005	2026/12/20	1.05
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,420,000,000	100.29	6,439,104,500	100.02	6,421,540,800	0.100	2028/3/20	1.01
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,517,000,000	98.76	6,436,665,500	98.23	6,401,844,610	0.100	2031/12/20	1.01
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,170,000,000	100.12	6,177,404,000	100.10	6,176,725,300	0.005	2026/6/20	0.97
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	100.40	5,923,954,000	0.100	2026/9/20	0.93
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	5,870,000,000	100.29	5,887,455,100	100.23	5,884,029,300	0.100	2024/6/20	0.93

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	100.36	5,771,160,000	0.100	2027/3/20	0.91
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,650,000,000	99.01	5,594,596,600	98.48	5,564,628,500	0.100	2031/6/20	0.88
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	5,460,000,000	100.44	5,484,034,000	100.33	5,478,072,600	0.100	2025/6/20	0.86
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	5,370,000,000	99.71	5,354,427,000	98.96	5,314,313,100	0.200	2032/3/20	0.84
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	5,260,000,000	101.27	5,326,946,800	100.80	5,302,500,800	0.600	2024/6/20	0.84
日本	国債証券	第153回利付国債（5年）	5,160,000,000	99.87	5,153,293,900	99.91	5,155,717,200	0.005	2027/6/20	0.81
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	5,120,000,000	100.46	5,143,848,000	100.35	5,138,329,600	0.100	2025/9/20	0.81
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	5,120,000,000	100.39	5,140,009,200	100.13	5,127,065,600	0.100	2027/12/20	0.81
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,020,000,000	101.21	5,080,742,000	100.91	5,065,732,200	0.300	2025/12/20	0.80
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,110,000,000	99.01	5,059,411,000	98.36	5,026,349,300	0.100	2031/9/20	0.79
日本	国債証券	第154回利付国債（5年）	4,950,000,000	99.91	4,945,545,000	100.21	4,960,791,000	0.100	2027/9/20	0.78
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	4,955,000,000	100.26	4,967,953,700	99.97	4,953,711,700	0.100	2028/6/20	0.78
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	4,910,000,000	100.46	4,932,808,600	100.38	4,928,805,300	0.100	2025/12/20	0.78
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	4,900,000,000	99.82	4,891,180,000	98.80	4,841,347,000	0.200	2032/6/20	0.76
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	100.08	4,824,048,800	0.005	2026/9/20	0.76
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	4,730,000,000	100.32	4,745,176,800	101.44	4,798,348,500	0.500	2032/12/20	0.76
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	4,840,000,000	99.46	4,813,864,000	99.01	4,792,519,600	0.100	2030/9/20	0.76
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	100.40	4,779,230,400	0.100	2026/3/20	0.75
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	99.76	4,778,791,400	0.100	2029/3/20	0.75
日本	国債証券	第151回利付国債（5年）	4,760,000,000	99.87	4,753,812,000	100.00	4,760,000,000	0.005	2027/3/20	0.75
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,710,000,000	99.20	4,672,735,000	98.83	4,655,269,800	0.100	2030/12/20	0.73
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	4,660,000,000	99.84	4,652,815,900	99.66	4,644,389,000	0.100	2029/6/20	0.73
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	100.86	4,599,580,800	0.400	2025/3/20	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	84.76
地方債証券	5.05
特殊債券	5.71
社債券	4.35
合計	99.87

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	364,667,306,568	65.99
	イギリス	24,128,938,948	4.37
	フランス	19,569,354,204	3.54
	カナダ	19,423,022,350	3.51
	スイス	18,701,642,964	3.38
	ドイツ	14,343,579,784	2.60
	オーストラリア	11,261,215,536	2.04
	オランダ	10,132,424,326	1.83
	アイルランド	10,017,386,022	1.81
	スウェーデン	5,255,769,723	0.95
	デンマーク	5,164,492,769	0.93
	スペイン	4,409,306,045	0.80
	香港	3,349,962,035	0.61
	イタリア	3,108,734,192	0.56
	フィンランド	1,984,344,334	0.36
	シンガポール	1,840,381,600	0.33
	ジャージー	1,644,057,213	0.30
	ベルギー	1,400,627,927	0.25
	ノルウェー	1,084,230,102	0.20
	イスラエル	1,073,625,712	0.19
	ケイマン	1,047,309,369	0.19
	バミューダ	833,801,205	0.15
	キュラソー	719,021,715	0.13
	ニュージーランド	450,571,525	0.08
ルクセンブルク	338,861,300	0.06	
ポルトガル	319,882,933	0.06	
オーストリア	313,903,424	0.06	
リベリア	141,557,121	0.03	

	マン島	119,190,726	0.02
	パナマ	100,706,534	0.02
	小計	526,945,208,206	95.35
投資信託受益証券	オーストラリア	120,014,351	0.02
	香港	55,200,852	0.01
	小計	175,215,203	0.03
投資証券	アメリカ	9,666,566,186	1.75
	オーストラリア	647,695,854	0.12
	イギリス	254,270,625	0.05
	シンガポール	238,286,737	0.04
	フランス	214,929,453	0.04
	香港	148,519,140	0.03
	カナダ	55,584,006	0.01
	ベルギー	50,624,161	0.01
	小計	11,276,476,162	2.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,234,002,567	2.58
合計(純資産総額)		552,630,902,138	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	10,390,707,391	1.88
	買建	カナダ	465,173,515	0.08
	買建	ドイツ	2,146,077,382	0.39
	買建	イギリス	524,979,210	0.09
	買建	オーストラリア	470,281,545	0.09

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,009,521,000	0.18
	売建		33,512,500	0.01

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,262,821	20,115.47	25,402,245,644	22,588.83	28,525,653,057	5.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	562,164	36,632.63	20,593,545,869	40,886.84	22,985,113,963	4.16
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	727,070	15,487.06	11,260,177,737	14,730.15	10,709,854,959	1.94
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	196,006	25,150.71	4,929,691,299	36,518.23	7,157,792,934	1.30
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	474,294	15,059.11	7,142,448,810	14,431.04	6,844,558,864	1.24
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	433,996	15,148.64	6,574,450,121	14,535.66	6,308,421,813	1.14
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	179,617	26,125.84	4,692,645,255	31,998.05	5,747,394,250	1.04
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	327,418	13,073.65	4,280,548,696	15,670.40	5,130,773,614	0.93
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	74,171	68,060.38	5,048,106,491	65,786.74	4,879,468,374	0.88
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	213,069	33,835.64	7,209,327,903	21,486.28	4,578,061,195	0.83
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	207,999	24,197.67	5,033,091,569	21,863.19	4,547,521,657	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	103,354	42,712.15	4,414,472,403	43,757.22	4,522,484,739	0.82
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	232,844	17,599.91	4,098,033,631	18,382.51	4,280,258,672	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	128,824	28,548.22	3,677,697,078	30,717.11	3,957,101,146	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	187,873	19,922.32	3,742,867,697	20,987.32	3,942,950,977	0.71
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	218,301	17,470.72	3,813,875,910	17,064.09	3,725,109,221	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	67,952	47,968.91	3,259,583,502	50,120.35	3,405,778,506	0.62
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	63,340	43,336.06	2,744,906,148	52,357.64	3,316,333,266	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	146,184	23,848.31	3,486,241,934	22,393.00	3,273,498,824	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	80,884	41,370.55	3,346,216,234	39,424.83	3,188,838,023	0.58

アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	201,265	12,502.66	2,516,349,023	15,446.41	3,108,821,870	0.56
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	131,448	14,786.28	1,943,628,231	22,179.64	2,915,470,370	0.53
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	22,026	88,792.35	1,955,740,361	129,845.88	2,859,985,441	0.52
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	140,386	20,092.11	2,820,651,186	19,967.93	2,803,218,256	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	326,933	8,656.44	2,830,076,312	8,541.39	2,792,465,003	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	108,690	23,036.82	2,503,872,781	25,443.11	2,765,412,680	0.50
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	33,103	78,133.44	2,586,451,529	82,947.33	2,745,805,574	0.50
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,858	80,100.00	2,551,825,889	83,524.16	2,660,912,944	0.48
イギリス	株式	ASTRAZENECA	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	123,190	17,754.32	2,187,155,109	19,775.99	2,436,204,701	0.44
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	117,948	17,237.04	2,033,075,137	20,304.59	2,394,886,890	0.43

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.18
		素材	4.18
		資本財	6.50
		商業・専門サービス	1.52
		運輸	1.77
		自動車・自動車部品	1.66
		耐久消費財・アパレル	1.81
		消費者サービス	2.11
		メディア・娯楽	5.38
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.11
		生活必需品流通・小売り	1.82
		食品・飲料・タバコ	4.27
		家庭用品・パーソナル用品	1.86
		ヘルスケア機器・サービス	4.73
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.77		

	銀行	5.36
	金融サービス	6.46
	保険	3.16
	エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.04
	ソフトウェア・サービス	8.58
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.50
	電気通信サービス	1.41
	公益事業	3.07
	半導体・半導体製造装置	4.78
	不動産管理・開発	0.32
	小計	95.35
投資信託受益証券		0.03
投資証券		2.04
合計		97.42

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	373	アメリカドル	74,130,499.65	9,943,123,917	77,467,437.5	10,390,707,391	1.88
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	19	カナダドル	4,509,445.5	444,496,043	4,719,220	465,173,515	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	42	スイスフラン	4,490,704	673,964,856	4,756,500	713,855,520	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	224	ユーロ	9,264,223	1,371,475,573	9,674,560	1,432,221,862	0.26
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	29	オーストラリアドル	5,115,828	455,206,375	5,285,250	470,281,545	0.09
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	40	イギリスポンド	3,031,740	508,271,211	3,131,400	524,979,210	0.09

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	6,800,000.00	908,820,000	911,676,000	0.16
	オーストラリアドル	買建	1,100,000.00	97,133,300	97,845,000	0.02
	アメリカドル	売建	250,000.00	33,512,500	33,512,500	0.01

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	137,962,204,860	48.75
	フランス	23,242,762,126	8.21
	イタリア	21,183,903,964	7.49
	ドイツ	18,357,505,451	6.49
	スペイン	14,203,564,585	5.02
	中国	13,889,759,063	4.91
	イギリス	13,447,079,721	4.75
	カナダ	5,711,531,060	2.02
	ベルギー	5,255,677,300	1.86
	オーストラリア	4,372,008,236	1.54
	オランダ	4,327,290,415	1.53
	オーストリア	3,426,030,889	1.21
	メキシコ	2,477,392,185	0.88
	アイルランド	1,690,243,820	0.60
	マレーシア	1,541,279,017	0.54
	フィンランド	1,474,226,282	0.52
	ポーランド	1,360,670,908	0.48
	シンガポール	1,260,911,883	0.45
	イスラエル	896,157,425	0.32
	デンマーク	895,752,285	0.32
ニュージーランド	664,549,690	0.23	
スウェーデン	579,544,570	0.20	
ノルウェー	455,028,325	0.16	
	小計	278,675,074,060	98.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,330,876,005	1.53
合計(純資産総額)		283,005,950,065	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	アメリカ	861,723,428	0.30
	買建	ドイツ	745,852,167	0.26

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		1,821,530,529	0.64

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	13,800,000	12,432.39	1,715,670,883	12,594.59	1,738,054,453	2.750	2032/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,450,000	12,973.85	1,615,244,384	12,829.32	1,597,250,961	2.000	2025/8/15	0.56
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	79,870,000	1,919.98	1,533,494,836	1,918.11	1,531,996,019	1.990	2025/4/9	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	13,380,000	11,760.51	1,573,557,362	11,259.06	1,506,462,333	1.250	2031/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,137.75	1,535,803,966	12,754.66	1,491,020,072	2.375	2027/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	11,817.99	1,411,068,893	11,835.40	1,413,146,835	0.500	2027/4/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,076.59	1,415,376,602	11,762.57	1,378,573,461	1.875	2032/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	12,830.37	1,393,378,487	12,687.59	1,377,873,113	0.750	2024/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	10,900,000	12,280.67	1,338,593,524	12,394.18	1,350,966,530	0.250	2025/5/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	13,304.54	1,350,411,142	12,984.15	1,317,891,297	2.250	2024/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,342.36	1,355,412,991	10,929.49	1,306,075,156	0.625	2030/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	12,235.17	1,364,221,559	11,671.40	1,301,361,744	1.625	2031/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	12,744.93	1,287,238,348	12,740.77	1,286,818,589	2.875	2032/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,853.68	1,285,368,836	12,800.11	1,280,011,402	0.250	2024/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/29	9,800,000	12,719.90	1,246,551,158	12,875.43	1,261,792,353	2.875	2029/4/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	11,030,000	11,796.73	1,301,179,705	11,317.21	1,248,289,228	1.375	2031/11/15	0.44
中国	国債証券	CGB 2.69% 08/12/26	63,900,000	1,944.08	1,242,272,627	1,942.78	1,241,441,641	2.690	2026/8/12	0.44

アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,548.80	1,287,691,494	11,109.73	1,238,735,608	0.875	2030/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	12,097.14	1,149,229,019	12,257.70	1,164,481,559	0.750	2026/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,821.98	1,153,979,071	12,765.14	1,148,862,747	0.250	2024/6/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,829.84	1,155,969,386	12,750.20	1,148,793,849	0.375	2024/7/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	11,366.74	1,123,034,342	11,623.72	1,148,424,200	0.375	2027/9/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	13,119.06	1,174,156,470	12,724.27	1,138,822,508	2.250	2027/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	13,036.09	1,147,176,333	12,833.25	1,129,326,392	1.500	2024/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	12,221.92	1,161,082,932	11,851.11	1,125,856,310	1.250	2028/9/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	11,719.65	1,125,087,143	11,686.07	1,121,863,321	0.625	2027/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,676.02	1,148,785,731	13,071.38	1,097,996,563	3.125	2028/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 4% 11/15/52	7,800,000	13,688.07	1,067,669,684	14,041.73	1,095,255,282	4.000	2052/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/30/24	8,500,000	13,097.06	1,113,250,179	12,872.02	1,094,122,250	1.500	2024/9/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	13,198.70	1,116,610,561	12,898.74	1,091,234,057	2.000	2025/2/15	0.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.47
合計	98.47

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	23	アメリカドル	2,526,478.51	338,876,563	2,517,960.88	337,734,093	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	17	アメリカドル	1,958,969.51	262,756,580	1,950,484.46	261,618,480	0.09
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	15	アメリカドル	1,963,792	263,403,421	1,956,093.75	262,370,855	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	9	ユーロ	951,928.9	140,923,555	949,140	140,510,686	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	12	ユーロ	1,413,095.2	209,194,613	1,406,640	208,238,985	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	20	ユーロ	2,708,902	401,025,852	2,682,400	397,102,496	0.14

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	6,750,000.00	900,127,698	903,082,500	0.32
	カナダドル	買建	790,000.00	77,880,686	77,698,238	0.03
	ユーロ	買建	4,530,000.00	664,161,910	669,562,539	0.24
	イギリスポンド	買建	520,000.00	86,329,642	86,987,368	0.03
	オフショア人民元	買建	4,360,000.00	84,239,270	84,199,884	0.03

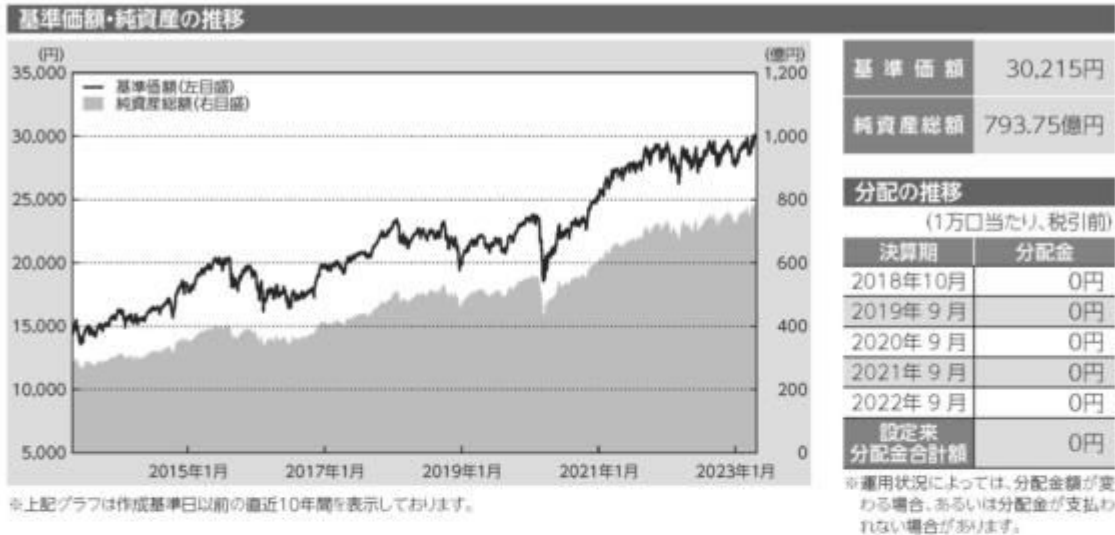
(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

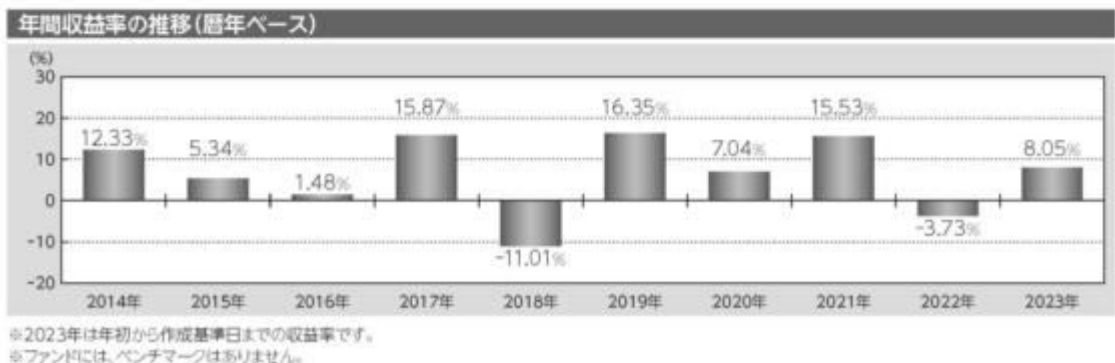

運用実績

 当初設定日：2001年10月1日
 作成基準日：2023年4月28日


主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式 インデックス マザーファンド	51.0%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.7%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.5%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	1.0%
外国株式 インデックス マザーファンド	25.4%	APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・ハードウェア	-	-	1.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.1%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	一般消費財・サービス流通・小売	-	-	0.5%
国内債券 インデックス マザーファンド	16.1%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.2%
		第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	0.2%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	4.7%	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.0%
		T 2% 08/15/25	アメリカ	国債	-	2.000%	2025/08/15	0.0%
		CGB 1.99% 04/09/25	中国	国債	-	1.990%	2025/04/09	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



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 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、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翌営業日の基準価額（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、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより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、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求

の受付を取り消すことができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

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。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

・株式

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

・公社債

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

- a. 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）
- b. 価格情報会社の提供する価額
- c. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2001年10月 1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。

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）

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5億口を下回るようになった場合
- ・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

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。

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。

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）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。

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。

上記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。

上記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。

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。

ファンドの繰上償還において、上記 から 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づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

(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。

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。

上記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。

上記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。

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 >

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。

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 >

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。

上記 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。

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。

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

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。

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てします。）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

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。

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てします。）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。

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。

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21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マイセレクション75】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 (2021年 9月30日現在)	第21期 (2022年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,177,315,184	2,210,802,244
親投資信託受益証券	67,900,320,352	69,118,802,786
未収入金	163,080,000	-
流動資産合計	70,240,715,536	71,329,605,030
資産合計	70,240,715,536	71,329,605,030
負債の部		
流動負債		
未払解約金	93,237,732	39,679,850
未払受託者報酬	11,099,306	11,935,883
未払委託者報酬	107,293,190	115,380,155
未払利息	5,290	5,356
その他未払費用	1,834,270	1,877,253
流動負債合計	213,469,788	168,878,497
負債合計	213,469,788	168,878,497
純資産の部		
元本等		
元本	24,571,449,355	25,688,980,318
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	45,455,796,393	45,471,746,215
(分配準備積立金)	23,469,451,095	21,120,787,562
元本等合計	70,027,245,748	71,160,726,533
純資産合計	70,027,245,748	71,160,726,533
負債純資産合計	70,240,715,536	71,329,605,030

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期		第21期	
	自	2020年10月1日 至 2021年9月30日	自	2021年10月1日 至 2022年9月30日
営業収益				
受取利息		9,108		11,459
有価証券売買等損益		13,066,012,932		1,786,317,566
営業収益合計		13,066,022,040		1,786,306,107
営業費用				
支払利息		679,416		843,997
受託者報酬		20,971,707		23,550,323
委託者報酬		202,726,372		227,652,960
その他費用		1,834,270		1,877,253
営業費用合計		226,211,765		253,924,533
営業利益又は営業損失（ ）		12,839,810,275		2,040,230,640
経常利益又は経常損失（ ）		12,839,810,275		2,040,230,640
当期純利益又は当期純損失（ ）		12,839,810,275		2,040,230,640
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（ ）		983,104,001		45,143,360
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		31,416,829,758		45,455,796,393
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,436,954,410		6,903,060,240
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,436,954,410		6,903,060,240
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,254,694,049		4,892,023,138
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,254,694,049		4,892,023,138
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		45,455,796,393		45,471,746,215

（ 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20期 (2021年 9月30日現在)	第21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	24,571,449,355口	25,688,980,318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 (1万口当たり純資産額) 2.8499円 (28,499円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7701円 (27,701円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第20期 自 2020年10月 1日 至 2021年 9月30日			第21期 自 2021年10月 1日 至 2022年 9月30日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	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	11,856,740,093円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	23,524,481,094円	収益調整金額	C	28,010,421,902円
分配準備積立金額	D	11,612,711,002円	分配準備積立金額	D	21,120,787,562円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	46,993,932,189円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	49,131,209,464円
当ファンドの期末残存口数	F	24,571,449,355口	当ファンドの期末残存口数	F	25,688,980,318口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	19,125円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	19,125円
1万口当たり分配金額	H	- 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	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21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、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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21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20期	第21期
	自 2020年10月 1日 至 2021年 9月30日	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	23,870,880,027円	24,571,449,355円
期中追加設定元本額	3,890,760,985円	3,763,124,355円
期中一部解約元本額	3,190,191,657円	2,645,593,392円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第20期	第21期
	(2021年 9月30日現在)	(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	12,326,129,628	1,984,234,677
合計	12,326,129,628	1,984,234,677

（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	国内株式インデックス マザーファンド	19,289,607,721	35,406,074,971	
	外国株式インデックス マザーファンド	4,385,065,140	18,090,147,728	
	国内債券インデックス マザーファンド	8,800,669,292	11,977,710,906	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,165,985,023	3,644,869,181	

合計	33,641,327,176	69,118,802,786	
----	----------------	----------------	--

(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。

国内株式インデックス 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	4,171,036,896
株式	472,582,867,680
派生商品評価勘定	1,672,250
未収入金	377,809,000
未収配当金	5,187,664,901
前払金	81,868,300
差入委託証拠金	236,785,000
流動資産合計	482,639,704,027
資産合計	482,639,704,027
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	83,571,900
未払解約金	1,774,427,746
未払利息	10,106
流動負債合計	1,858,009,752
負債合計	1,858,009,752
純資産の部	
元本等	
元本	261,939,828,601
剰余金	
剰余金又は欠損金()	218,841,865,674
元本等合計	480,781,694,275
純資産合計	480,781,694,275
負債純資産合計	482,639,704,027

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

(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	261,939,828,601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	<p>1口当たり純資産額 1.8355円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (18,355円)</p>

(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	<p>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。</p>

2022年 9月30日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>

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	<p>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。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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	249,768,323,924円
期中追加設定元本額	34,563,381,853円
期中一部解約元本額	22,391,877,176円
期末元本額	261,939,828,601円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	393,459,282円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,048,136,311円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,636,639円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,753,805,963円
世界経済インデックスファンド	4,218,744,097円
日本株式インデックス・オープン	3,260,655,237円
D C マイセレクション 2 5	6,247,488,292円
D C マイセレクション 5 0	19,109,060,935円
D C マイセレクション 7 5	19,289,607,721円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,236,125,252円
D C マイセレクション S 2 5	3,238,741,988円
D C マイセレクション S 5 0	9,521,473,020円
D C マイセレクション S 7 5	7,344,942,227円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,579,127,325円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	162,544,332円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	689,032,770円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	514,365,927円
D C 世界経済インデックスファンド	3,777,512,201円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,588,169,573円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,234,332円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	17,671,882円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	21,109,086円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	171,066,479円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	26,948,769円

区分	2022年 9月30日現在
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	101,866,544円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	24,370,437円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	66,216,476円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	832,256,984円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	425,508,995円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,740,745,587円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	43,855,538円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	17,474,015円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	462,992,567円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	262,157,365円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	338,158,139円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	34,347,126円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	585,254,482円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,897,837,857円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,926,951,857円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,283,750,971円
分散投資コア戦略ファンドA	1,440,100,504円
分散投資コア戦略ファンドS	6,193,390,222円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	517,536,877円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	443,179,359円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,880,527,274円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	222,293,744円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,836,028円
SMT インデックスバランス・オープン	58,193,129円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,258,205,889円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	546,528,890円
SMT 世界経済インデックス・オープン	51,405,671円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	195,696,875円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	34,706,559円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,440,154円
グローバル経済コア	221,515,214円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	29,361,443円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	331,076,220円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,044,603円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,309,165,117円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	241,126,994円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	19,649,919円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	16,952,214円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	6,723,002円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,379,599円
10資産分散投資ファンド	32,436円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,778,574,932円

区分	2022年 9月30日現在
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	889,895,902円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	320,959,866円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	54,212,426円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	273,843,062円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	45,734,154,592円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,368,519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）	203,076,456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)	
株式		22,159,707,299
合計		22,159,707,299

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,435,668,300	-		8,353,800,000	81,868,300
	合計	8,435,668,300	-		8,353,800,000	81,868,300

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	

極洋	8,900	3,620.00	32,218,000
日本水産	254,000	545.00	138,430,000
マルハニチロ	36,200	2,460.00	89,052,000
雪国まいたけ	20,000	998.00	19,960,000
カネコ種苗	7,700	1,464.00	11,272,800
サカタのタネ	29,600	4,810.00	142,376,000
ホクト	20,900	1,894.00	39,584,600
ホクリヨウ	3,700	602.00	2,227,400
住石ホールディングス	47,900	208.00	9,963,200
日鉄鉱業	10,400	2,748.00	28,579,200
三井松島ホールディングス	11,400	3,035.00	34,599,000
I N P E X	867,100	1,359.00	1,178,388,900
石油資源開発	32,200	3,465.00	111,573,000
K & O エナジーグループ	10,600	1,623.00	17,203,800
ショーボンドホールディングス	31,900	6,260.00	199,694,000
ミライト・ワン	88,100	1,467.00	129,242,700
タマホーム	16,600	2,350.00	39,010,000
サンヨーホームズ	3,200	690.00	2,208,000
日本アクア	10,900	729.00	7,946,100
ファーストコーポレーション	6,700	726.00	4,864,200
ベステラ	5,600	935.00	5,236,000
R o b o t H o m e	39,900	170.00	6,783,000
キャンディル	4,000	515.00	2,060,000
ダイセキ環境ソリューション	5,300	865.00	4,584,500
第一カッター興業	6,000	1,239.00	7,434,000
安藤・間	124,500	837.00	104,206,500
東急建設	73,400	631.00	46,315,400
コムシスホールディングス	88,200	2,462.00	217,148,400
ビーアールホールディングス	34,400	319.00	10,973,600
高松コンストラクショングループ	17,400	1,881.00	32,729,400
東建コーポレーション	7,600	8,010.00	60,876,000
ソネック	2,800	970.00	2,716,000
ヤマウラ	11,900	955.00	11,364,500
オリエンタル白石	91,900	246.00	22,607,400
大成建設	175,800	4,020.00	706,716,000
大林組	586,600	928.00	544,364,800
清水建設	542,400	709.00	384,561,600
飛島建設	16,900	1,042.00	17,609,800
長谷工コーポレーション	169,300	1,571.00	265,970,300
松井建設	21,000	563.00	11,823,000
銭高組	2,300	3,080.00	7,084,000
鹿島建設	429,800	1,373.00	590,115,400

不動テトラ	13,400	1,473.00	19,738,200
大末建設	6,600	1,421.00	9,378,600
鉄建建設	12,700	1,774.00	22,529,800
西松建設	38,200	3,795.00	144,969,000
三井住友建設	142,400	445.00	63,368,000
大豊建設	9,200	4,155.00	38,226,000
佐田建設	13,600	403.00	5,480,800
ナカノフドー建設	15,100	302.00	4,560,200
奥村組	31,400	2,846.00	89,364,400
東鉄工業	24,800	2,317.00	57,461,600
イチケン	4,600	1,781.00	8,192,600
富士ピー・エス	8,100	449.00	3,636,900
浅沼組	14,100	2,676.00	37,731,600
戸田建設	242,100	744.00	180,122,400
熊谷組	31,200	2,522.00	78,686,400
北野建設	3,800	2,334.00	8,869,200
植木組	5,200	1,238.00	6,437,600
矢作建設工業	25,100	736.00	18,473,600
ピーエス三菱	20,800	614.00	12,771,200
日本ハウスホールディングス	32,500	456.00	14,820,000
大東建託	64,600	13,570.00	876,622,000
新日本建設	26,900	707.00	19,018,300
東亜道路工業	3,300	5,840.00	19,272,000
日本道路	5,500	5,740.00	31,570,000
東亜建設工業	14,100	2,489.00	35,094,900
日本国土開発	49,200	627.00	30,848,400
若築建設	9,700	2,251.00	21,834,700
東洋建設	70,800	851.00	60,250,800
五洋建設	232,500	727.00	169,027,500
世紀東急工業	28,800	755.00	21,744,000
福田組	6,200	4,825.00	29,915,000
住友林業	125,800	2,205.00	277,389,000
日本基礎技術	15,400	458.00	7,053,200
巴コーポレーション	22,900	405.00	9,274,500
大和ハウス工業	499,900	2,943.50	1,471,455,650
ライト工業	34,700	1,904.00	66,068,800
積水ハウス	599,400	2,401.00	1,439,159,400
日特建設	13,000	894.00	11,622,000
北陸電気工事	11,200	706.00	7,907,200
ユアテック	36,100	705.00	25,450,500
日本リーテック	12,000	781.00	9,372,000
四電工	6,100	1,759.00	10,729,900

中電工	25,400	2,091.00	53,111,400
関電工	102,700	832.00	85,446,400
きんでん	128,300	1,528.00	196,042,400
東京エネシス	18,600	969.00	18,023,400
トーエネック	6,300	3,405.00	21,451,500
住友電設	15,600	2,593.00	40,450,800
日本電設工業	26,900	1,836.00	49,388,400
エクシオグループ	87,700	2,091.00	183,380,700
新日本空調	13,700	1,801.00	24,673,700
九電工	39,900	2,750.00	109,725,000
三機工業	41,000	1,585.00	64,985,000
日揮ホールディングス	178,400	1,809.00	322,725,600
中外炉工業	5,900	1,546.00	9,121,400
ヤマト	15,200	779.00	11,840,800
太平電業	11,400	3,340.00	38,076,000
高砂熱学工業	48,300	1,701.00	82,158,300
三晃金属工業	2,500	2,636.00	6,590,000
朝日工業社	7,700	1,768.00	13,613,600
明星工業	31,700	702.00	22,253,400
大気社	26,300	3,220.00	84,686,000
ダイダン	11,900	2,141.00	25,477,900
日比谷総合設備	17,200	1,862.00	32,026,400
フィル・カンパニー	2,900	1,179.00	3,419,100
テスホールディングス	17,600	945.00	16,632,000
インフロニア・ホールディングス	219,900	984.00	216,381,600
東洋エンジニアリング	26,500	560.00	14,840,000
レイズネクスト	27,100	1,176.00	31,869,600
ニッポン	49,300	1,554.00	76,612,200
日清製粉グループ本社	190,300	1,468.00	279,360,400
日東富士製粉	2,900	4,795.00	13,905,500
昭和産業	15,900	2,478.00	39,400,200
鳥越製粉	14,700	661.00	9,716,700
中部飼料	20,900	1,042.00	21,777,800
フィード・ワン	24,100	666.00	16,050,600
東洋精糖	3,400	844.00	2,869,600
日本甜菜製糖	10,500	1,617.00	16,978,500
D M三井製糖ホールディングス	16,300	1,893.00	30,855,900
塩水港精糖	24,100	199.00	4,795,900
日新製糖	9,600	1,728.00	16,588,800
森永製菓	40,700	3,975.00	161,782,500
中村屋	4,100	3,110.00	12,751,000
江崎グリコ	47,100	3,565.00	167,911,500

名糖産業	7,300	1,600.00	11,680,000
井村屋グループ	9,800	2,187.00	21,432,600
不二家	11,300	2,444.00	27,617,200
山崎製パン	110,200	1,663.00	183,262,600
第一屋製パン	3,500	410.00	1,435,000
モロゾフ	6,000	3,710.00	22,260,000
亀田製菓	10,500	4,590.00	48,195,000
寿スピリッツ	17,500	8,350.00	146,125,000
カルビー	92,100	3,100.00	285,510,000
森永乳業	34,300	4,255.00	145,946,500
六甲バター	12,100	1,391.00	16,831,100
ヤクルト本社	128,400	8,410.00	1,079,844,000
明治ホールディングス	111,300	6,430.00	715,659,000
雪印メグミルク	44,200	1,713.00	75,714,600
プリマハム	25,300	2,090.00	52,877,000
日本ハム	70,800	3,810.00	269,748,000
林兼産業	6,100	444.00	2,708,400
丸大食品	18,200	1,427.00	25,971,400
S Foods	18,200	3,035.00	55,237,000
柿安本店	7,000	2,259.00	15,813,000
伊藤ハム米久ホールディングス	128,000	666.00	85,248,000
サッポロホールディングス	54,200	3,180.00	172,356,000
アサヒグループホールディングス	380,500	4,484.00	1,706,162,000
キリンホールディングス	743,000	2,227.00	1,654,661,000
宝ホールディングス	112,400	1,057.00	118,806,800
オエノンホールディングス	49,200	274.00	13,480,800
養命酒製造	5,400	1,783.00	9,628,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,000	1,404.00	181,116,000
サントリー食品インターナショナル	115,900	5,130.00	594,567,000
ダイトーグループホールディングス	10,400	4,815.00	50,076,000
伊藤園	61,400	5,860.00	359,804,000
キーコーヒー	18,400	2,089.00	38,437,600
ユニカフェ	6,100	927.00	5,654,700
ジャパンフーズ	2,900	1,088.00	3,155,200
日清オイリオグループ	23,200	3,195.00	74,124,000
不二製油グループ本社	43,800	2,406.00	105,382,800
かどや製油	1,800	3,560.00	6,408,000
J - オイルミルズ	18,900	1,554.00	29,370,600
キッコーマン	121,200	8,200.00	993,840,000
味の素	403,000	3,962.00	1,596,686,000
ブルドックソース	7,200	1,820.00	13,104,000
キューピー	88,500	2,380.00	210,630,000

ハウス食品グループ本社	63,000	2,887.00	181,881,000
カゴメ	76,700	3,015.00	231,250,500
焼津水産化学工業	8,200	867.00	7,109,400
アリアケジャパン	18,500	5,020.00	92,870,000
ピエトロ	2,600	1,765.00	4,589,000
エバラ食品工業	4,400	3,020.00	13,288,000
やまみ	1,700	1,314.00	2,233,800
ニチレイ	75,400	2,385.00	179,829,000
東洋水産	90,100	5,960.00	536,996,000
イトアンドホールディングス	7,600	2,183.00	16,590,800
大冷	2,300	1,860.00	4,278,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,400	487.00	5,064,800
日清食品ホールディングス	65,200	10,070.00	656,564,000
永谷園ホールディングス	9,000	1,993.00	17,937,000
一正蒲鉾	7,800	770.00	6,006,000
フジッコ	18,800	1,911.00	35,926,800
ロック・フィールド	20,100	1,459.00	29,325,900
日本たばこ産業	1,083,900	2,374.00	2,573,178,600
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,555.00	16,016,500
わらべや日洋ホールディングス	12,100	2,216.00	26,813,600
なとり	11,300	1,991.00	22,498,300
イフジ産業	3,500	893.00	3,125,500
ファーマフーズ	25,500	1,232.00	31,416,000
ユーグレナ	106,000	856.00	90,736,000
紀文食品	15,700	912.00	14,318,400
ピクルスホールディングス	9,600	977.00	9,379,200
ミヨシ油脂	6,400	994.00	6,361,600
理研ビタミン	14,200	1,757.00	24,949,400
片倉工業	15,700	2,041.00	32,043,700
ゲンゼ	11,600	3,865.00	44,834,000
東洋紡	78,500	1,035.00	81,247,500
ユニチカ	56,100	298.00	16,717,800
富士紡ホールディングス	8,200	3,285.00	26,937,000
倉敷紡績	14,000	1,973.00	27,622,000
シキボウ	10,300	880.00	9,064,000
日本毛織	49,200	1,065.00	52,398,000
トーア紡コーポレーション	7,300	335.00	2,445,500
帝国繊維	19,200	1,548.00	29,721,600
帝人	173,700	1,402.00	243,527,400
東レ	1,225,000	711.80	871,955,000
住江織物	3,400	1,715.00	5,831,000
日本フェルト	12,400	407.00	5,046,800

イチカワ	2,700	1,345.00	3,631,500
日東製網	2,100	1,295.00	2,719,500
アツギ	14,700	370.00	5,439,000
ダイニック	6,400	589.00	3,769,600
セーレン	36,600	2,104.00	77,006,400
ソトー	7,500	692.00	5,190,000
東海染工	2,500	1,126.00	2,815,000
小松マテーレ	30,000	776.00	23,280,000
ワコールホールディングス	40,400	2,145.00	86,658,000
ホギメディカル	24,600	3,550.00	87,330,000
T S Iホールディングス	60,500	395.00	23,897,500
マツオカコーポレーション	5,900	941.00	5,551,900
ワールド	26,000	1,390.00	36,140,000
三陽商会	8,700	943.00	8,204,100
ナイガイ	7,600	253.00	1,922,800
オンワードホールディングス	109,400	292.00	31,944,800
ルックホールディングス	5,400	2,133.00	11,518,200
ゴールドウイン	32,700	7,660.00	250,482,000
デサント	33,700	3,325.00	112,052,500
キング	9,800	415.00	4,067,000
ヤマトインターナショナル	15,500	257.00	3,983,500
特種東海製紙	10,200	2,956.00	30,151,200
王子ホールディングス	761,200	538.00	409,525,600
日本製紙	80,000	941.00	75,280,000
三菱製紙	25,200	283.00	7,131,600
北越コーポレーション	117,600	755.00	88,788,000
中越パルプ工業	7,500	916.00	6,870,000
巴川製紙所	5,800	765.00	4,437,000
大王製紙	84,600	1,160.00	98,136,000
阿波製紙	4,500	298.00	1,341,000
レンゴー	152,600	840.00	128,184,000
トモク	9,700	1,423.00	13,803,100
ザ・パック	12,400	2,216.00	27,478,400
北の達人コーポレーション	70,600	257.00	18,144,200
クラレ	266,300	1,011.00	269,229,300
旭化成	1,220,400	955.50	1,166,092,200
共和レザー	10,700	509.00	5,446,300
昭和電工	161,900	2,054.00	332,542,600
住友化学	1,345,700	497.00	668,812,900
住友精化	7,900	2,996.00	23,668,400
日産化学	88,800	6,450.00	572,760,000
ラサ工業	7,000	2,233.00	15,631,000

クレハ	14,300	8,880.00	126,984,000
多木化学	6,500	4,850.00	31,525,000
テイカ	11,300	1,234.00	13,944,200
石原産業	35,400	1,019.00	36,072,600
片倉コープアグリ	4,400	1,163.00	5,117,200
日本曹達	21,600	4,405.00	95,148,000
東ソー	243,900	1,610.00	392,679,000
トクヤマ	58,600	1,741.00	102,022,600
セントラル硝子	29,600	3,325.00	98,420,000
東亜合成	86,100	1,079.00	92,901,900
大阪ソーダ	15,000	3,800.00	57,000,000
関東電化工業	36,000	922.00	33,192,000
デンカ	66,500	3,175.00	211,137,500
信越化学工業	312,700	14,330.00	4,480,991,000
日本カーバイド工業	7,000	1,240.00	8,680,000
堺化学工業	12,800	1,874.00	23,987,200
第一稀元素化学工業	16,800	1,222.00	20,529,600
エア・ウォーター	158,000	1,708.00	269,864,000
日本酸素ホールディングス	162,500	2,281.00	370,662,500
日本化学工業	5,600	1,871.00	10,477,600
東邦アセチレン	3,900	1,075.00	4,192,500
日本パーカライズニング	82,900	931.00	77,179,900
高压ガス工業	27,800	623.00	17,319,400
チタン工業	2,300	1,580.00	3,634,000
四国化成工業	22,800	1,226.00	27,952,800
戸田工業	4,200	2,624.00	11,020,800
ステラ ケミファ	9,900	2,508.00	24,829,200
保土谷化学工業	5,300	2,904.00	15,391,200
日本触媒	28,100	5,400.00	151,740,000
大日精化工業	14,000	1,695.00	23,730,000
カネカ	42,500	3,610.00	153,425,000
三菱瓦斯化学	152,900	1,896.00	289,898,400
三井化学	153,600	2,819.00	432,998,400
J S R	169,400	2,750.00	465,850,000
東京応化工業	29,300	6,040.00	176,972,000
大阪有機化学工業	12,600	2,036.00	25,653,600
三菱ケミカルグループ	1,224,500	661.60	810,129,200
K Hネオケム	27,900	2,636.00	73,544,400
ダイセル	265,200	851.00	225,685,200
住友ベークライト	27,900	3,965.00	110,623,500
積水化学工業	376,800	1,768.00	666,182,400
日本ゼオン	143,500	1,278.00	183,393,000

アイカ工業	46,500	3,130.00	145,545,000
UBE	93,000	1,932.00	179,676,000
積水樹脂	27,100	1,647.00	44,633,700
タキロンシーアイ	42,700	522.00	22,289,400
旭有機材	11,100	2,197.00	24,386,700
ニチバン	10,400	1,614.00	16,785,600
リケンテクノス	40,100	502.00	20,130,200
大倉工業	7,800	1,782.00	13,899,600
積水化成成品工業	23,500	398.00	9,353,000
群栄化学工業	3,900	2,328.00	9,079,200
タイガースポリマー	9,400	403.00	3,788,200
ミライアル	6,300	1,603.00	10,098,900
ダイキアクシス	6,800	636.00	4,324,800
ダイキョーニシカワ	41,600	532.00	22,131,200
竹本容器	6,300	752.00	4,737,600
森六ホールディングス	9,500	1,686.00	16,017,000
恵和	5,400	3,470.00	18,738,000
日本化薬	138,600	1,158.00	160,498,800
カーリットホールディングス	16,500	656.00	10,824,000
日本精化	12,700	1,896.00	24,079,200
扶桑化学工業	15,500	3,110.00	48,205,000
トリケミカル研究所	20,300	1,776.00	36,052,800
ADEKA	77,900	2,161.00	168,341,900
日油	57,000	5,220.00	297,540,000
新日本理化	28,000	251.00	7,028,000
ハリマ化成グループ	13,000	856.00	11,128,000
花王	415,900	5,898.00	2,452,978,200
第一工業製薬	6,700	1,911.00	12,803,700
石原ケミカル	9,200	1,241.00	11,417,200
日華化学	7,500	843.00	6,322,500
ニイタカ	3,700	2,250.00	8,325,000
三洋化成工業	11,800	4,380.00	51,684,000
有機合成薬品工業	13,700	287.00	3,931,900
大日本塗料	22,300	715.00	15,944,500
日本ペイントホールディングス	741,200	979.00	725,634,800
関西ペイント	170,500	2,047.00	349,013,500
神東塗料	15,500	133.00	2,061,500
中国塗料	42,600	889.00	37,871,400
日本特殊塗料	11,800	908.00	10,714,400
藤倉化成	24,600	410.00	10,086,000
太陽ホールディングス	29,100	2,403.00	69,927,300
DIC	65,500	2,407.00	157,658,500

サカティンクス	37,300	977.00	36,442,100
東洋インキSCホールディングス	32,800	1,900.00	62,320,000
T&K TOKA	15,900	881.00	14,007,900
富士フィルムホールディングス	354,000	6,609.00	2,339,586,000
資生堂	350,200	5,056.00	1,770,611,200
ライオン	201,200	1,636.00	329,163,200
高砂香料工業	11,300	2,647.00	29,911,100
マンダム	39,200	1,520.00	59,584,000
ミルボン	24,900	6,370.00	158,613,000
ファンケル	81,500	2,876.00	234,394,000
コーセー	34,100	14,900.00	508,090,000
コタ	14,000	1,535.00	21,490,000
シーボン	2,600	1,644.00	4,274,400
ポーラ・オルビスホールディングス	86,000	1,635.00	140,610,000
ノエビアホールディングス	15,000	5,680.00	85,200,000
アジュバンホールディングス	4,500	940.00	4,230,000
新日本製薬	9,600	1,502.00	14,419,200
エステー	12,900	1,501.00	19,362,900
アグロ カネショウ	6,700	1,307.00	8,756,900
コニシ	30,500	1,553.00	47,366,500
長谷川香料	34,700	3,000.00	104,100,000
星光PMC	9,500	525.00	4,987,500
小林製薬	51,300	8,480.00	435,024,000
荒川化学工業	14,200	981.00	13,930,200
メック	13,800	2,232.00	30,801,600
日本高純度化学	4,700	2,318.00	10,894,600
タカラバイオ	52,700	1,701.00	89,642,700
JCU	20,700	2,921.00	60,464,700
新田ゼラチン	11,500	899.00	10,338,500
OATアグリオ	7,600	1,786.00	13,573,600
デクセリアルズ	52,500	3,250.00	170,625,000
アース製薬	15,200	5,190.00	78,888,000
北興化学工業	16,900	904.00	15,277,600
大成ラミック	5,300	2,741.00	14,527,300
クミアイ化学工業	66,600	1,018.00	67,798,800
日本農薬	35,900	846.00	30,371,400
アキレス	12,900	1,301.00	16,782,900
有沢製作所	27,400	1,228.00	33,647,200
日東電工	121,700	7,830.00	952,911,000
レック	23,900	824.00	19,693,600
三光合成	23,000	467.00	10,741,000
きもと	30,800	228.00	7,022,400

藤森工業	15,700	3,215.00	50,475,500
前澤化成工業	11,800	1,293.00	15,257,400
未来工業	7,200	1,495.00	10,764,000
ウェーブロックホールディングス	7,600	587.00	4,461,200
J S P	11,800	1,395.00	16,461,000
エフピコ	37,000	3,555.00	131,535,000
天馬	15,800	1,911.00	30,193,800
信越ポリマー	36,200	1,197.00	43,331,400
東リ	46,000	200.00	9,200,000
ニフコ	67,200	3,005.00	201,936,000
バルカー	16,400	2,508.00	41,131,200
ユニ・チャーム	349,400	4,750.00	1,659,650,000
ショーエイコーポレーション	5,400	557.00	3,007,800
協和キリン	202,600	3,315.00	671,619,000
武田薬品工業	1,583,100	3,767.00	5,963,537,700
アステラス製薬	1,722,100	1,917.00	3,301,265,700
住友ファーマ	124,400	1,031.00	128,256,400
塩野義製薬	233,800	6,989.00	1,634,028,200
わかもと製薬	19,600	238.00	4,664,800
日本新薬	43,900	7,400.00	324,860,000
中外製薬	525,000	3,626.00	1,903,650,000
科研製薬	28,700	3,815.00	109,490,500
エーザイ	222,500	7,749.00	1,724,152,500
ロート製薬	96,000	4,635.00	444,960,000
小野薬品工業	388,300	3,381.00	1,312,842,300
久光製薬	42,600	3,395.00	144,627,000
持田製薬	22,600	3,375.00	76,275,000
参天製薬	350,800	975.00	342,030,000
扶桑薬品工業	6,500	1,967.00	12,785,500
日本ケミファ	2,100	1,771.00	3,719,100
ツムラ	57,600	3,085.00	177,696,000
日医工	57,200	436.00	24,939,200
キッセイ薬品工業	29,200	2,573.00	75,131,600
生化学工業	35,500	831.00	29,500,500
栄研化学	30,000	1,796.00	53,880,000
鳥居薬品	9,000	2,884.00	25,956,000
J C R ファーマ	56,800	2,165.00	122,972,000
東和薬品	29,000	2,123.00	61,567,000
富士製薬工業	10,800	1,034.00	11,167,200
ゼリア新薬工業	29,900	2,072.00	61,952,800
第一三共	1,461,100	4,042.00	5,905,766,200
キョーリン製薬ホールディングス	36,400	1,770.00	64,428,000

大幸薬品	30,400	561.00	17,054,400
ダイト	12,600	2,462.00	31,021,200
大塚ホールディングス	383,700	4,584.00	1,758,880,800
大正製薬ホールディングス	37,300	5,300.00	197,690,000
ペプチドリーム	81,300	1,615.00	131,299,500
あすか製薬ホールディングス	19,100	1,113.00	21,258,300
サワイグループホールディングス	38,600	4,060.00	156,716,000
日本コークス工業	170,200	91.00	15,488,200
ニチレキ	21,800	1,283.00	27,969,400
ユシロ化学工業	9,600	826.00	7,929,600
ビーピー・カストロール	7,200	1,076.00	7,747,200
富士石油	44,000	290.00	12,760,000
MORESCO	6,700	1,080.00	7,236,000
出光興産	204,900	3,135.00	642,361,500
Eneosホールディングス	3,030,100	465.10	1,409,299,510
コスモエネルギーホールディングス	79,500	3,710.00	294,945,000
横浜ゴム	95,400	2,216.00	211,406,400
TOYO TIRE	96,400	1,570.00	151,348,000
ブリヂストン	535,600	4,669.00	2,500,716,400
住友ゴム工業	164,500	1,151.00	189,339,500
藤倉コンポジット	16,100	884.00	14,232,400
オカモト	9,300	3,550.00	33,015,000
フコク	8,800	969.00	8,527,200
ニッタ	18,900	2,780.00	52,542,000
住友理工	39,000	563.00	21,957,000
三ツ星ベルト	24,500	3,010.00	73,745,000
バンドー化学	32,500	1,026.00	33,345,000
日東紡績	25,000	2,305.00	57,625,000
AGC	170,700	4,490.00	766,443,000
日本板硝子	91,100	511.00	46,552,100
石塚硝子	3,300	1,502.00	4,956,600
日本山村硝子	7,200	572.00	4,118,400
日本電気硝子	68,500	2,493.00	170,770,500
オハラ	8,100	1,250.00	10,125,000
住友大阪セメント	30,100	3,260.00	98,126,000
太平洋セメント	114,500	2,038.00	233,351,000
日本ヒューム	16,700	629.00	10,504,300
日本コンクリート工業	36,700	245.00	8,991,500
三谷セキサン	8,200	3,465.00	28,413,000
アジアパイルホールディングス	28,900	482.00	13,929,800
東海カーボン	140,800	979.00	137,843,200
日本カーボン	9,700	3,970.00	38,509,000

東洋炭素	10,500	3,285.00	34,492,500
ノリタケカンパニーリミテド	10,200	4,015.00	40,953,000
TOTO	121,800	4,820.00	587,076,000
日本碍子	198,400	1,800.00	357,120,000
日本特殊陶業	140,500	2,562.00	359,961,000
MARUWA	7,000	15,460.00	108,220,000
品川リフラクトリーズ	4,800	3,750.00	18,000,000
黒崎播磨	3,400	4,630.00	15,742,000
ヨータイ	12,900	1,397.00	18,021,300
東京窯業	20,400	257.00	5,242,800
ニッカトー	8,700	429.00	3,732,300
フジインコーポレーテッド	16,200	6,050.00	98,010,000
クニミネ工業	6,500	799.00	5,193,500
エーアンドエーマテリアル	3,600	853.00	3,070,800
ニチアス	42,500	2,245.00	95,412,500
ニチハ	25,700	2,746.00	70,572,200
日本製鉄	832,000	2,006.50	1,669,408,000
神戸製鋼所	347,100	580.00	201,318,000
中山製鋼所	27,700	562.00	15,567,400
合同製鐵	9,700	1,682.00	16,315,400
JFEホールディングス	461,100	1,341.00	618,335,100
東京製鐵	58,200	1,261.00	73,390,200
共英製鋼	19,700	1,387.00	27,323,900
大和工業	32,500	4,380.00	142,350,000
東京鐵鋼	8,300	1,304.00	10,823,200
大阪製鐵	10,600	1,136.00	12,041,600
淀川製鋼所	21,800	2,374.00	51,753,200
丸一鋼管	57,800	2,959.00	171,030,200
モリ工業	4,900	2,616.00	12,818,400
大同特殊鋼	27,200	3,520.00	95,744,000
日本高周波鋼業	7,600	305.00	2,318,000
日本冶金工業	13,600	2,612.00	35,523,200
山陽特殊製鋼	17,100	1,870.00	31,977,000
愛知製鋼	11,200	2,062.00	23,094,400
日立金属	214,600	2,175.00	466,755,000
日本金属	5,000	970.00	4,850,000
大平洋金属	12,300	2,187.00	26,900,100
新日本電工	110,500	334.00	36,907,000
栗本鐵工所	8,200	1,605.00	13,161,000
虹技	2,600	900.00	2,340,000
三菱製鋼	12,800	907.00	11,609,600
日亜鋼業	22,900	230.00	5,267,000

日本精線	3,100	4,370.00	13,547,000	
エンビプロ・ホールディングス	13,300	786.00	10,453,800	
シンニッタン	24,400	213.00	5,197,200	
新家工業	4,200	1,667.00	7,001,400	
大紀アルミニウム工業所	24,600	1,179.00	29,003,400	
日本軽金属ホールディングス	50,500	1,448.00	73,124,000	
三井金属鉱業	53,800	3,040.00	163,552,000	
東邦亜鉛	10,200	2,173.00	22,164,600	
三菱マテリアル	115,200	1,989.00	229,132,800	
住友金属鉱山	218,300	4,160.00	908,128,000	
D O W Aホールディングス	46,500	5,190.00	241,335,000	
古河機械金属	30,400	1,213.00	36,875,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,000	2,959.00	68,057,000	
東邦チタニウム	35,700	2,362.00	84,323,400	
U A C J	27,200	2,003.00	54,481,600	
C Kサンエツ	3,800	3,890.00	14,782,000	
古河電気工業	57,500	2,293.00	131,847,500	
住友電気工業	695,100	1,464.00	1,017,626,400	
フジクラ	222,100	862.00	191,450,200	
昭和電線ホールディングス	17,400	1,750.00	30,450,000	
東京特殊電線	2,600	2,121.00	5,514,600	
タツタ電線	35,300	436.00	15,390,800	
カナレ電気	3,000	1,410.00	4,230,000	
平河ヒューテック	11,100	1,033.00	11,466,300	
リョービ	18,500	1,243.00	22,995,500	
アーレスティ	21,500	361.00	7,761,500	
アサヒホールディングス	79,800	2,030.00	161,994,000	
稲葉製作所	10,100	1,350.00	13,635,000	
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,240.00	18,144,000	
トーカロ	51,400	1,171.00	60,189,400	
アルファC o	7,000	903.00	6,321,000	
S U M C O	328,500	1,688.00	554,508,000	
川田テクノロジーズ	3,700	3,690.00	13,653,000	
R S Technologies	5,700	6,360.00	36,252,000	
ジェイテックコーポレーション	2,600	1,415.00	3,679,000	
信和	12,300	790.00	9,717,000	
東洋製罐グループホールディングス	101,500	1,744.00	177,016,000	
ホッカンホールディングス	9,300	1,264.00	11,755,200	
コロナ	9,600	830.00	7,968,000	
横河ブリッジホールディングス	28,500	1,903.00	54,235,500	
駒井ハルテック	3,100	1,612.00	4,997,200	
高田機工	1,700	2,386.00	4,056,200	

三和ホールディングス	187,800	1,244.00	233,623,200
文化シャッター	58,700	1,024.00	60,108,800
三協立山	23,700	591.00	14,006,700
アルインコ	13,200	900.00	11,880,000
東洋シャッター	4,400	530.00	2,332,000
LIXIL	287,300	2,119.00	608,788,700
日本フィルコン	12,500	458.00	5,725,000
ノーリツ	25,400	1,540.00	39,116,000
長府製作所	18,000	2,041.00	36,738,000
リンナイ	34,400	10,390.00	357,416,000
ダイニチ工業	9,500	625.00	5,937,500
日東精工	25,000	514.00	12,850,000
三洋工業	2,400	1,628.00	3,907,200
岡部	27,700	647.00	17,921,900
ジーテクト	22,000	1,265.00	27,830,000
東プレ	30,400	1,109.00	33,713,600
高周波熱錬	30,700	642.00	19,709,400
東京製網	12,200	854.00	10,418,800
サンコール	17,000	654.00	11,118,000
モリテック スチール	15,500	351.00	5,440,500
パイオラックス	26,200	1,771.00	46,400,200
エイチワン	17,800	569.00	10,128,200
日本発條	167,900	851.00	142,882,900
中央発條	9,600	666.00	6,393,600
アドバネクス	2,600	1,115.00	2,899,000
立川ブラインド工業	7,800	1,041.00	8,119,800
三益半導体工業	15,500	1,922.00	29,791,000
日本ドライケミカル	4,600	1,452.00	6,679,200
日本製鋼所	51,200	2,846.00	145,715,200
三浦工業	78,400	2,946.00	230,966,400
タクマ	57,300	1,240.00	71,052,000
ツガミ	40,900	1,170.00	47,853,000
オークマ	19,000	4,950.00	94,050,000
芝浦機械	22,600	2,880.00	65,088,000
アマダ	314,600	981.00	308,622,600
アイダエンジニアリング	43,700	819.00	35,790,300
滝澤鉄工所	5,900	1,059.00	6,248,100
F U J I	79,600	1,892.00	150,603,200
牧野フライス製作所	20,300	4,435.00	90,030,500
オーエスジー	80,800	1,786.00	144,308,800
ダイジェット工業	2,400	801.00	1,922,400
旭ダイヤモンド工業	49,100	718.00	35,253,800

DMG森精機	102,500	1,650.00	169,125,000
ソディック	47,100	758.00	35,701,800
ディスコ	29,400	32,000.00	940,800,000
日東工器	9,600	1,563.00	15,004,800
日進工具	15,800	1,137.00	17,964,600
パンチ工業	17,300	415.00	7,179,500
富士ダイス	10,200	569.00	5,803,800
豊和工業	10,500	810.00	8,505,000
ニデックオーケー	7,500	1,110.00	8,325,000
東洋機械金属	13,100	561.00	7,349,100
津田駒工業	3,400	468.00	1,591,200
エンシュウ	4,700	757.00	3,557,900
島精機製作所	29,200	2,009.00	58,662,800
オプトラン	25,000	2,092.00	52,300,000
NCホールディングス	5,600	1,982.00	11,099,200
イワキポンプ	12,700	1,265.00	16,065,500
フリー	17,800	1,009.00	17,960,200
ヤマシンフィルタ	31,600	365.00	11,534,000
日阪製作所	20,600	815.00	16,789,000
やまびこ	27,700	1,105.00	30,608,500
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,355.00	21,472,000
平田機工	8,800	4,120.00	36,256,000
ペガサスミシン製造	20,300	862.00	17,498,600
マルマエ	8,200	1,752.00	14,366,400
タツモ	9,300	1,300.00	12,090,000
ナプテスコ	106,100	2,955.00	313,525,500
三井海洋開発	21,200	1,479.00	31,354,800
レオン自動機	21,400	1,144.00	24,481,600
S M C	59,000	58,220.00	3,434,980,000
ホソカワミクロン	13,000	2,457.00	31,941,000
ユニオンツール	7,500	3,320.00	24,900,000
オイレス工業	25,800	1,475.00	38,055,000
日精エー・エス・ビー機械	7,700	3,580.00	27,566,000
サトーホールディングス	26,300	1,798.00	47,287,400
技研製作所	17,700	3,125.00	55,312,500
日本エアテック	8,600	1,064.00	9,150,400
カワタ	6,000	847.00	5,082,000
日精樹脂工業	12,800	889.00	11,379,200
オカダアイヨン	6,400	1,448.00	9,267,200
ワイエイシイホールディングス	8,000	1,204.00	9,632,000
小松製作所	913,000	2,611.00	2,383,843,000
住友重機械工業	107,700	2,673.00	287,882,100

日立建機	80,800	2,676.00	216,220,800
日工	25,400	605.00	15,367,000
巴工業	7,300	2,457.00	17,936,100
井関農機	16,000	1,170.00	18,720,000
TOWA	17,300	1,602.00	27,714,600
丸山製作所	3,300	1,451.00	4,788,300
北川鉄工所	8,000	1,254.00	10,032,000
ローツェ	9,900	6,970.00	69,003,000
タカキタ	6,300	500.00	3,150,000
クボタ	900,800	2,004.00	1,805,203,200
荏原実業	8,500	2,167.00	18,419,500
三菱化工機	6,100	2,071.00	12,633,100
月島機械	31,700	879.00	27,864,300
帝国電機製作所	12,800	1,836.00	23,500,800
新東工業	37,900	684.00	25,923,600
澁谷工業	15,900	2,420.00	38,478,000
アイチ コーポレーション	29,000	785.00	22,765,000
小森コーポレーション	46,600	705.00	32,853,000
鶴見製作所	14,300	2,291.00	32,761,300
住友精密工業	3,000	2,505.00	7,515,000
日本ギア工業	7,500	355.00	2,662,500
酒井重工業	3,400	2,916.00	9,914,400
荏原製作所	69,100	4,735.00	327,188,500
石井鐵工所	2,500	2,799.00	6,997,500
西島製作所	16,600	1,334.00	22,144,400
北越工業	17,100	962.00	16,450,200
ダイキン工業	220,000	22,295.00	4,904,900,000
オルガノ	23,200	2,051.00	47,583,200
トーヨーカネツ	7,100	2,456.00	17,437,600
栗田工業	101,800	5,160.00	525,288,000
椿本チエイン	26,400	3,055.00	80,652,000
大同工業	8,500	699.00	5,941,500
木村化工機	15,800	675.00	10,665,000
アネスト岩田	31,500	855.00	26,932,500
ダイフク	95,000	6,810.00	646,950,000
サムコ	5,600	2,830.00	15,848,000
加藤製作所	9,900	744.00	7,365,600
油研工業	3,200	1,754.00	5,612,800
タダノ	97,500	842.00	82,095,000
フジテック	61,900	2,919.00	180,686,100
C K D	51,000	1,718.00	87,618,000
キトー	15,800	2,718.00	42,944,400

平和	56,200	2,238.00	125,775,600
理想科学工業	16,900	2,338.00	39,512,200
SANKYO	41,500	4,385.00	181,977,500
日本金銭機械	20,600	651.00	13,410,600
マースグループホールディングス	12,900	1,617.00	20,859,300
フクシマガリレイ	12,500	3,580.00	44,750,000
オーイズミ	7,300	400.00	2,920,000
ダイコク電機	9,300	1,301.00	12,099,300
竹内製作所	30,700	2,661.00	81,692,700
アマノ	52,800	2,430.00	128,304,000
JUKI	26,300	690.00	18,147,000
ジャノメ	17,300	646.00	11,175,800
マックス	23,800	1,989.00	47,338,200
グローリー	47,800	2,123.00	101,479,400
新晃工業	18,800	1,484.00	27,899,200
大和冷機工業	26,000	1,146.00	29,796,000
セガサミーホールディングス	181,100	1,969.00	356,585,900
日本ピストンリング	7,400	1,215.00	8,991,000
リケン	7,400	2,284.00	16,901,600
TPR	22,000	1,189.00	26,158,000
ツバキ・ナカシマ	41,700	1,128.00	47,037,600
ホシザキ	108,700	4,035.00	438,604,500
大豊工業	16,600	674.00	11,188,400
日本精工	344,900	707.00	243,844,300
NTN	366,300	254.00	93,040,200
ジェイテクト	171,900	916.00	157,460,400
不二越	12,500	3,525.00	44,062,500
日本トムソン	46,200	533.00	24,624,600
THK	97,500	2,496.00	243,360,000
ユーシン精機	15,800	705.00	11,139,000
前澤給装工業	13,100	895.00	11,724,500
イーグル工業	21,900	1,084.00	23,739,600
前澤工業	12,200	624.00	7,612,800
日本ピラー工業	17,300	2,287.00	39,565,100
キッツ	62,300	802.00	49,964,600
マキタ	227,700	2,799.00	637,332,300
三井E&Sホールディングス	76,200	403.00	30,708,600
日立造船	159,900	857.00	137,034,300
三菱重工業	295,400	4,806.00	1,419,692,400
IHI	125,800	3,100.00	389,980,000
スター精密	32,700	1,629.00	53,268,300
日清紡ホールディングス	137,500	1,050.00	144,375,000

イビデン	97,000	3,960.00	384,120,000
コニカミノルタ	409,600	446.00	182,681,600
ブラザー工業	229,800	2,491.00	572,431,800
ミネベアミツミ	320,700	2,139.00	685,977,300
日立製作所	968,700	6,114.00	5,922,631,800
東芝	352,100	5,148.00	1,812,610,800
三菱電機	1,879,800	1,304.50	2,452,199,100
富士電機	112,000	5,290.00	592,480,000
東洋電機製造	6,700	863.00	5,782,100
安川電機	200,100	4,165.00	833,416,500
シンフォニアテクノロジー	20,500	1,342.00	27,511,000
明電舎	28,500	1,971.00	56,173,500
オリジン	4,600	1,246.00	5,731,600
山洋電気	7,400	4,935.00	36,519,000
デンヨー	14,300	1,377.00	19,691,100
PHCホールディングス	31,400	1,430.00	44,902,000
東芝テック	21,600	3,740.00	80,784,000
芝浦メカトロニクス	3,600	9,350.00	33,660,000
マブチモーター	42,100	3,930.00	165,453,000
日本電産	447,500	8,130.00	3,638,175,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,000	472.00	3,776,000
トレックス・セミコンダクター	8,800	2,516.00	22,140,800
東光高岳	11,400	1,768.00	20,155,200
ダブル・スコープ	55,200	1,322.00	72,974,400
ダイヘン	18,600	3,715.00	69,099,000
ヤーマン	33,200	1,167.00	38,744,400
JVCケンウッド	166,400	197.00	32,780,800
ミマキエンジニアリング	18,700	666.00	12,454,200
I-PEX	9,700	1,239.00	12,018,300
日新電機	47,200	1,328.00	62,681,600
大崎電気工業	33,900	500.00	16,950,000
オムロン	167,700	6,616.00	1,109,503,200
日東工業	25,300	2,374.00	60,062,200
IDEC	24,900	2,944.00	73,305,600
正興電機製作所	7,500	1,021.00	7,657,500
不二電機工業	4,200	1,080.00	4,536,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,700	2,258.00	137,060,600
サクサホールディングス	4,700	1,242.00	5,837,400
メルコホールディングス	5,800	3,110.00	18,038,000
テクノメディカ	4,800	1,597.00	7,665,600
日本電気	238,900	4,625.00	1,104,912,500
富士通	181,200	15,785.00	2,860,242,000

沖電気工業	76,400	718.00	54,855,200
岩崎通信機	8,200	765.00	6,273,000
電気興業	9,700	2,164.00	20,990,800
サンケン電気	17,300	4,425.00	76,552,500
ナカヨ	3,300	1,036.00	3,418,800
アイホン	9,100	1,894.00	17,235,400
ルネサスエレクトロニクス	1,099,900	1,202.00	1,322,079,800
セイコーエプソン	224,900	1,970.00	443,053,000
ワコム	155,000	711.00	110,205,000
アルバック	40,100	5,130.00	205,713,000
アクセル	8,100	1,157.00	9,371,700
E I Z O	13,700	3,630.00	49,731,000
日本信号	42,700	946.00	40,394,200
京三製作所	39,300	415.00	16,309,500
能美防災	23,100	1,620.00	37,422,000
ホーチキ	13,000	1,287.00	16,731,000
星和電機	8,500	430.00	3,655,000
エレコム	46,400	1,444.00	67,001,600
パナソニック ホールディングス	2,148,200	1,014.50	2,179,348,900
シャープ	191,300	863.00	165,091,900
アンリツ	127,400	1,579.00	201,164,600
富士通ゼネラル	54,700	3,005.00	164,373,500
ソニーグループ	1,261,800	9,286.00	11,717,074,800
T D K	291,800	4,455.00	1,299,969,000
帝国通信工業	9,200	1,423.00	13,091,600
タムラ製作所	72,500	683.00	49,517,500
アルプスアルパイン	165,000	1,046.00	172,590,000
池上通信機	5,900	550.00	3,245,000
日本電波工業	20,500	1,427.00	29,253,500
鈴木	10,400	848.00	8,819,200
メイコー	22,000	2,496.00	54,912,000
日本トリム	4,000	2,329.00	9,316,000
ローランド ディー . ジー .	9,600	2,974.00	28,550,400
フォスター電機	18,800	742.00	13,949,600
S M K	4,500	2,330.00	10,485,000
ヨコオ	13,700	1,895.00	25,961,500
ホシデン	44,800	1,479.00	66,259,200
ヒロセ電機	27,900	18,980.00	529,542,000
日本航空電子工業	40,400	2,120.00	85,648,000
T O A	21,600	764.00	16,502,400
マクセル	37,000	1,371.00	50,727,000
古野電気	24,300	1,098.00	26,681,400

ユニデンホールディングス	1,800	4,090.00	7,362,000	
スミダコーポレーション	15,900	1,011.00	16,074,900	
アイコム	6,500	2,616.00	17,004,000	
リオン	7,200	1,984.00	14,284,800	
横河電機	184,800	2,275.00	420,420,000	
新電元工業	7,100	3,490.00	24,779,000	
アズビル	116,800	3,770.00	440,336,000	
東亜ディーケーケー	10,500	850.00	8,925,000	
日本光電工業	77,400	3,080.00	238,392,000	
チノー	6,400	1,626.00	10,406,400	
共和電業	17,500	335.00	5,862,500	
日本電子材料	9,500	1,307.00	12,416,500	
堀場製作所	37,200	5,610.00	208,692,000	
アドバンテスト	149,700	6,700.00	1,002,990,000	
小野測器	8,000	399.00	3,192,000	
エスベック	15,100	1,711.00	25,836,100	
キーエンス	182,500	47,900.00	8,741,750,000	
日置電機	8,800	6,280.00	55,264,000	
シスメックス	144,300	7,768.00	1,120,922,400	
日本マイクロニクス	27,900	1,183.00	33,005,700	
メガチップス	18,000	2,523.00	45,414,000	
O B A R A G R O U P	8,000	3,210.00	25,680,000	
澤藤電機	2,800	1,107.00	3,099,600	
原田工業	10,100	785.00	7,928,500	
コーセル	22,900	820.00	18,778,000	
イリソ電子工業	17,000	3,965.00	67,405,000	
オブテックスグループ	30,900	2,123.00	65,600,700	
千代田インテグレ	7,000	2,142.00	14,994,000	
レーザーテック	82,600	14,695.00	1,213,807,000	
スタンレー電気	130,000	2,264.00	294,320,000	
岩崎電気	6,500	2,531.00	16,451,500	
ウシオ電機	95,600	1,502.00	143,591,200	
岡谷電機産業	16,200	242.00	3,920,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	18,300	405.00	7,411,500	
エノモト	5,900	1,338.00	7,894,200	
日本セラミック	17,200	2,441.00	41,985,200	
遠藤照明	9,900	721.00	7,137,900	
古河電池	14,800	1,123.00	16,620,400	
双信電機	10,700	410.00	4,387,000	
山一電機	13,400	1,788.00	23,959,200	
図研	13,200	3,495.00	46,134,000	
日本電子	38,800	4,755.00	184,494,000	

カシオ計算機	124,600	1,269.00	158,117,400
ファナック	176,800	20,260.00	3,581,968,000
日本シイエムケイ	36,500	435.00	15,877,500
エンプラス	5,100	4,070.00	20,757,000
大真空	25,400	867.00	22,021,800
ローム	83,800	9,460.00	792,748,000
浜松ホトニクス	134,300	6,200.00	832,660,000
三井ハイテック	17,300	6,810.00	117,813,000
新光電気工業	59,300	3,115.00	184,719,500
京セラ	283,400	7,300.00	2,068,820,000
太陽誘電	89,700	3,725.00	334,132,500
村田製作所	549,500	6,632.00	3,644,284,000
双葉電子工業	35,200	611.00	21,507,200
北陸電気工業	8,000	1,018.00	8,144,000
ニチコン	54,000	1,388.00	74,952,000
日本ケミコン	19,300	1,864.00	35,975,200
K O A	28,000	2,205.00	61,740,000
市光工業	25,300	382.00	9,664,600
小糸製作所	201,400	1,971.00	396,959,400
ミツバ	31,400	386.00	12,120,400
S C R E E Nホールディングス	31,800	7,880.00	250,584,000
キャノン電子	18,800	1,585.00	29,798,000
キャノン	917,500	3,172.00	2,910,310,000
リコー	479,200	1,056.00	506,035,200
象印マホービン	50,200	1,559.00	78,261,800
M U T O Hホールディングス	2,800	1,910.00	5,348,000
東京エレクトロン	127,800	35,700.00	4,562,460,000
トヨタ紡織	70,400	1,772.00	124,748,800
芦森工業	3,800	1,034.00	3,929,200
ユニプレス	33,000	887.00	29,271,000
豊田自動織機	142,600	6,880.00	981,088,000
モリタホールディングス	32,300	1,282.00	41,408,600
三櫻工業	27,800	665.00	18,487,000
デンソー	394,200	6,586.00	2,596,201,200
東海理化電機製作所	53,000	1,376.00	72,928,000
川崎重工業	136,500	2,187.00	298,525,500
名村造船所	52,000	608.00	31,616,000
日本車輛製造	6,400	2,032.00	13,004,800
三菱ロジスネクスト	26,700	738.00	19,704,600
近畿車輛	3,000	980.00	2,940,000
日産自動車	2,375,500	460.20	1,093,205,100
いすゞ自動車	583,400	1,597.00	931,689,800

トヨタ自動車	9,182,300	1,876.00	17,225,994,800
日野自動車	251,500	596.00	149,894,000
三菱自動車工業	745,600	518.00	386,220,800
エフテック	12,900	492.00	6,346,800
レシップホールディングス	8,000	457.00	3,656,000
G M B	3,600	679.00	2,444,400
ファルテック	3,500	591.00	2,068,500
武蔵精密工業	44,900	1,556.00	69,864,400
日産車体	29,500	811.00	23,924,500
新明和工業	52,500	971.00	50,977,500
極東開発工業	32,100	1,323.00	42,468,300
トピー工業	15,100	1,448.00	21,864,800
ティラド	5,500	2,490.00	13,695,000
曙ブレーキ工業	110,600	159.00	17,585,400
タチエス	33,100	1,071.00	35,450,100
N O K	75,800	1,127.00	85,426,600
フタバ産業	44,800	324.00	14,515,200
K Y B	17,700	3,095.00	54,781,500
大同メタル工業	38,600	481.00	18,566,600
プレス工業	90,200	394.00	35,538,800
ミクニ	23,400	298.00	6,973,200
太平洋工業	38,300	1,018.00	38,989,400
河西工業	24,700	188.00	4,643,600
アイシン	147,400	3,710.00	546,854,000
マツダ	592,600	956.00	566,525,600
今仙電機製作所	13,200	562.00	7,418,400
本田技研工業	1,472,600	3,137.00	4,619,546,200
スズキ	399,300	4,481.00	1,789,263,300
S U B A R U	529,100	2,167.00	1,146,559,700
安永	8,100	654.00	5,297,400
ヤマハ発動機	262,800	2,707.00	711,399,600
T B K	20,200	292.00	5,898,400
エクセディ	30,400	1,642.00	49,916,800
豊田合成	56,900	2,185.00	124,326,500
愛三工業	31,600	683.00	21,582,800
盟和産業	2,800	978.00	2,738,400
日本プラスト	14,600	435.00	6,351,000
ヨロズ	15,700	800.00	12,560,000
エフ・シー・シー	32,900	1,321.00	43,460,900
シマノ	68,400	22,740.00	1,555,416,000
テイ・エス テック	85,000	1,419.00	120,615,000
ジャムコ	11,800	1,330.00	15,694,000

テルモ	570,000	4,074.00	2,322,180,000
クリエートメディック	6,100	888.00	5,416,800
日機装	41,800	909.00	37,996,200
日本エム・ディ・エム	11,600	1,251.00	14,511,600
島津製作所	240,700	3,795.00	913,456,500
JMS	15,500	533.00	8,261,500
長野計器	13,400	1,017.00	13,627,800
ブイ・テクノロジー	8,800	2,558.00	22,510,400
東京計器	12,800	1,210.00	15,488,000
愛知時計電機	7,300	1,390.00	10,147,000
インターアクション	10,100	1,521.00	15,362,100
オーバル	18,100	431.00	7,801,100
東京精密	31,400	4,260.00	133,764,000
マニー	73,600	1,758.00	129,388,800
ニコン	283,900	1,367.00	388,091,300
トプコン	94,700	1,613.00	152,751,100
オリンパス	965,000	2,778.50	2,681,252,500
理研計器	13,300	3,900.00	51,870,000
タムロン	12,500	2,901.00	36,262,500
HOYA	383,900	13,880.00	5,328,532,000
シード	9,400	534.00	5,019,600
ノーリツ鋼機	15,900	2,442.00	38,827,800
A & Dホロンホールディングス	22,700	816.00	18,523,200
朝日インテック	220,800	2,317.00	511,593,600
シチズン時計	183,900	604.00	111,075,600
リズム	6,300	1,504.00	9,475,200
大研医器	16,000	466.00	7,456,000
メニコン	62,200	2,973.00	184,920,600
シンシア	1,800	439.00	790,200
松風	6,700	2,345.00	15,711,500
セイコーホールディングス	28,500	3,015.00	85,927,500
ニプロ	139,400	1,088.00	151,667,200
中本パックス	5,600	1,544.00	8,646,400
スノーピーク	28,600	2,195.00	62,777,000
パラマウントベッドホールディングス	38,600	2,581.00	99,626,600
トランザクション	12,900	1,065.00	13,738,500
粧美堂	5,000	404.00	2,020,000
ニホンフラッシュ	15,700	933.00	14,648,100
前田工織	18,200	3,160.00	57,512,000
永大産業	21,900	230.00	5,037,000
アートネイチャー	17,200	722.00	12,418,400
バンダイナムコホールディングス	166,600	9,433.00	1,571,537,800

アイフィスジャパン	5,100	591.00	3,014,100
共立印刷	27,700	127.00	3,517,900
S H O E I	17,600	5,230.00	92,048,000
フランスベッドホールディングス	25,900	903.00	23,387,700
パイロットコーポレーション	26,100	5,490.00	143,289,000
萩原工業	11,200	1,046.00	11,715,200
フジシールインターナショナル	41,400	1,530.00	63,342,000
タカラトミー	83,200	1,239.00	103,084,800
広済堂ホールディングス	12,500	1,407.00	17,587,500
エステールホールディングス	4,300	614.00	2,640,200
タカノ	6,900	671.00	4,629,900
プロネクサス	15,600	955.00	14,898,000
ホクシン	14,200	145.00	2,059,000
ウッドワン	6,200	1,041.00	6,454,200
大建工業	10,200	1,824.00	18,604,800
凸版印刷	262,400	2,154.00	565,209,600
大日本印刷	218,200	2,900.00	632,780,000
共同印刷	5,200	2,454.00	12,760,800
N I S S H A	31,800	1,709.00	54,346,200
光村印刷	1,600	1,219.00	1,950,400
T A K A R A & C O M P A N Y	11,500	2,134.00	24,541,000
アシックス	154,400	2,300.00	355,120,000
ツツミ	5,000	2,016.00	10,080,000
ローランド	12,300	4,440.00	54,612,000
小松ウオール工業	6,100	1,841.00	11,230,100
ヤマハ	117,100	5,140.00	601,894,000
河合楽器製作所	5,100	2,531.00	12,908,100
クリナップ	18,700	563.00	10,528,100
ビジョン	106,500	2,114.00	225,141,000
兼松サステック	1,300	1,585.00	2,060,500
キングジム	14,800	912.00	13,497,600
リンテック	38,300	2,221.00	85,064,300
イトーキ	34,300	401.00	13,754,300
任天堂	1,137,000	5,854.00	6,655,998,000
三菱鉛筆	24,100	1,411.00	34,005,100
タカラスタンダード	32,400	1,295.00	41,958,000
コクヨ	80,500	1,836.00	147,798,000
ナカバヤシ	16,200	499.00	8,083,800
グローブライド	15,000	2,158.00	32,370,000
オカムラ	56,600	1,380.00	78,108,000
美津濃	16,600	2,573.00	42,711,800
東京電力ホールディングス	1,507,400	462.00	696,418,800

中部電力	568,800	1,304.00	741,715,200
関西電力	704,400	1,212.00	853,732,800
中国電力	290,500	734.00	213,227,000
北陸電力	171,000	486.00	83,106,000
東北電力	440,300	681.00	299,844,300
四国電力	167,400	723.00	121,030,200
九州電力	385,500	772.00	297,606,000
北海道電力	175,000	453.00	79,275,000
沖縄電力	42,700	1,058.00	45,176,600
電源開発	148,800	2,048.00	304,742,400
エフオン	12,200	639.00	7,795,800
イーレックス	25,900	2,788.00	72,209,200
レノバ	39,500	3,405.00	134,497,500
東京瓦斯	353,500	2,451.00	866,428,500
大阪瓦斯	338,700	2,186.00	740,398,200
東邦瓦斯	79,000	2,883.00	227,757,000
北海道瓦斯	10,000	1,587.00	15,870,000
広島ガス	35,200	329.00	11,580,800
西部ガスホールディングス	19,200	1,727.00	33,158,400
静岡ガス	38,100	990.00	37,719,000
メタウォーター	20,900	1,897.00	39,647,300
SBSホールディングス	14,900	2,789.00	41,556,100
東武鉄道	183,700	3,410.00	626,417,000
相鉄ホールディングス	59,800	2,397.00	143,340,600
東急	468,900	1,647.00	772,278,300
京浜急行電鉄	224,200	1,466.00	328,677,200
小田急電鉄	253,500	1,864.00	472,524,000
京王電鉄	88,400	5,270.00	465,868,000
京成電鉄	122,400	3,940.00	482,256,000
富士急行	20,600	4,280.00	88,168,000
東日本旅客鉄道	307,200	7,421.00	2,279,731,200
西日本旅客鉄道	213,600	5,540.00	1,183,344,000
東海旅客鉄道	141,700	16,935.00	2,399,689,500
西武ホールディングス	242,700	1,446.00	350,944,200
鴻池運輸	28,500	1,425.00	40,612,500
西日本鉄道	48,400	2,884.00	139,585,600
ハマキョウレックス	13,100	3,140.00	41,134,000
サカイ引越センター	9,300	4,685.00	43,570,500
近鉄グループホールディングス	178,800	4,820.00	861,816,000
阪急阪神ホールディングス	222,600	4,350.00	968,310,000
南海電気鉄道	79,800	2,956.00	235,888,800
京阪ホールディングス	74,300	3,755.00	278,996,500

神戸電鉄	4,500	3,280.00	14,760,000
名古屋鉄道	184,500	2,224.00	410,328,000
山陽電気鉄道	13,600	2,199.00	29,906,400
アルプス物流	13,300	1,035.00	13,765,500
ヤマトホールディングス	261,300	2,177.00	568,850,100
山九	46,300	4,200.00	194,460,000
丸運	9,100	213.00	1,938,300
丸全昭和運輸	12,900	3,065.00	39,538,500
センコーグループホールディングス	88,400	959.00	84,775,600
トナミホールディングス	3,700	3,515.00	13,005,500
ニッコンホールディングス	57,600	2,258.00	130,060,800
日本石油輸送	2,100	2,293.00	4,815,300
福山通運	24,400	3,265.00	79,666,000
セイノーホールディングス	103,900	1,160.00	120,524,000
エスライン	5,200	758.00	3,941,600
神奈川中央交通	4,700	3,385.00	15,909,500
日立物流	36,800	8,660.00	318,688,000
丸和運輸機関	32,200	1,451.00	46,722,200
C & F ロジホールディングス	16,100	1,105.00	17,790,500
九州旅客鉄道	127,900	3,125.00	399,687,500
S Gホールディングス	320,400	1,980.00	634,392,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	62,300	7,360.00	458,528,000
日本郵船	479,100	2,467.00	1,181,939,700
商船三井	294,700	2,602.00	766,809,400
川崎汽船	177,000	2,032.00	359,664,000
NSユナイテッド海運	9,400	3,775.00	35,485,000
飯野海運	77,500	651.00	50,452,500
共栄タンカー	5,400	836.00	4,514,400
乾汽船	12,400	1,637.00	20,298,800
日本航空	410,000	2,582.00	1,058,620,000
ANAホールディングス	454,300	2,718.00	1,234,787,400
パスコ	3,600	1,280.00	4,608,000
トランコム	5,300	7,620.00	40,386,000
日新	13,900	1,735.00	24,116,500
三菱倉庫	46,100	3,410.00	157,201,000
三井倉庫ホールディングス	18,700	3,075.00	57,502,500
住友倉庫	56,000	1,970.00	110,320,000
澁澤倉庫	9,500	2,020.00	19,190,000
東陽倉庫	27,100	263.00	7,127,300
日本トランスシティ	33,600	478.00	16,060,800
ケイヒン	3,300	1,402.00	4,626,600
中央倉庫	9,800	913.00	8,947,400

川西倉庫	3,500	995.00	3,482,500
安田倉庫	12,800	906.00	11,596,800
ファイズホールディングス	4,100	898.00	3,681,800
東洋埠頭	5,300	1,157.00	6,132,100
上組	90,600	2,674.00	242,264,400
サンリツ	4,900	668.00	3,273,200
キムラユニティー	9,900	760.00	7,524,000
キューソー流通システム	11,100	1,279.00	14,196,900
東海運	10,900	266.00	2,899,400
エーアイティー	12,000	1,450.00	17,400,000
内外トランスライン	6,000	2,039.00	12,234,000
日本コンセプト	5,200	1,556.00	8,091,200
NEC ネットズエスアイ	65,500	1,573.00	103,031,500
クロスキャット	10,800	1,321.00	14,266,800
システナ	282,500	403.00	113,847,500
デジタルアーツ	10,600	6,290.00	66,674,000
日鉄ソリューションズ	34,400	3,495.00	120,228,000
キューブシステム	10,200	949.00	9,679,800
WOW WORLD	3,000	880.00	2,640,000
コア	8,500	1,370.00	11,645,000
手間いらず	2,900	5,240.00	15,196,000
ラクーンホールディングス	17,000	1,023.00	17,391,000
ソリトンシステムズ	8,900	1,020.00	9,078,000
ソフトクリエイティブホールディングス	8,700	3,080.00	26,796,000
T I S	172,800	3,835.00	662,688,000
J N Sホールディングス	9,700	367.00	3,559,900
グリー	90,200	881.00	79,466,200
G M Oペパボ	2,500	1,759.00	4,397,500
コーエーテクモホールディングス	126,200	2,375.00	299,725,000
三菱総合研究所	8,300	4,455.00	36,976,500
電算	2,300	1,745.00	4,013,500
A G S	8,200	646.00	5,297,200
ファインデックス	13,700	571.00	7,822,700
ブレインパッド	17,000	874.00	14,858,000
K L a b	31,500	502.00	15,813,000
ポルトゥウィンホールディングス	28,900	926.00	26,761,400
ネクソン	433,300	2,552.00	1,105,781,600
アイスタイル	51,400	490.00	25,186,000
エムアップホールディングス	23,000	1,528.00	35,144,000
エイチーム	12,700	794.00	10,083,800
エニグモ	21,800	498.00	10,856,400
テクノスジャパン	15,800	438.00	6,920,400

コロプラ	65,400	680.00	44,472,000
ブロードリーフ	98,400	504.00	49,593,600
クロス・マーケティンググループ	7,800	852.00	6,645,600
デジタルハーツホールディングス	9,100	1,892.00	17,217,200
システム情報	15,000	907.00	13,605,000
メディアドゥ	6,900	1,814.00	12,516,600
じげん	56,600	342.00	19,357,200
ブイキューブ	20,300	918.00	18,635,400
エンカレッジ・テクノロジー	4,800	503.00	2,414,400
サイバーリンクス	6,100	1,133.00	6,911,300
フィックスターズ	19,100	1,052.00	20,093,200
CARTA HOLDINGS	8,200	1,669.00	13,685,800
オブティム	14,100	805.00	11,350,500
セレス	6,900	909.00	6,272,100
SHIFT	12,300	18,890.00	232,347,000
ティーガイア	17,700	1,639.00	29,010,300
セック	3,000	2,145.00	6,435,000
テクマトリックス	33,500	1,674.00	56,079,000
プロシップ	6,700	1,441.00	9,654,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	51,400	2,225.00	114,365,000
GMOペイメントゲートウェイ	38,300	9,950.00	381,085,000
ザッパラス	7,500	330.00	2,475,000
システムリサーチ	5,900	1,806.00	10,655,400
インターネットイニシアティブ	105,400	2,221.00	234,093,400
さくらインターネット	21,600	529.00	11,426,400
ヴィンクス	5,700	1,452.00	8,276,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,200	4,420.00	22,984,000
SRAホールディングス	9,600	2,975.00	28,560,000
システムインテグレータ	6,800	424.00	2,883,200
朝日ネット	18,400	586.00	10,782,400
eBASE	24,000	514.00	12,336,000
アバント	21,300	1,450.00	30,885,000
アドソル日進	7,200	1,467.00	10,562,400
ODKソリューションズ	4,500	586.00	2,637,000
フリービット	10,500	916.00	9,618,000
コムチュア	22,300	2,285.00	50,955,500
サイバーコム	3,200	1,324.00	4,236,800
アステリア	14,500	794.00	11,513,000
アイル	9,500	1,750.00	16,625,000
マークライنز	9,200	2,342.00	21,546,400
メディカル・データ・ビジョン	25,300	1,056.00	26,716,800
gumi	27,600	950.00	26,220,000

ショーケース	4,900	365.00	1,788,500
モバイルファクトリー	4,200	907.00	3,809,400
テラスカイ	7,300	1,884.00	13,753,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,900	1,481.00	13,180,900
P C Iホールディングス	8,000	925.00	7,400,000
アイビーシー	3,300	465.00	1,534,500
ネオジャパン	5,800	956.00	5,544,800
P R T I M E S	4,300	2,150.00	9,245,000
ラクス	90,800	1,368.00	124,214,400
ランドコンピュータ	4,800	812.00	3,897,600
ダブルスタンダード	6,000	2,351.00	14,106,000
オープンドア	11,800	2,006.00	23,670,800
マイネット	6,500	468.00	3,042,000
アカツキ	8,900	2,082.00	18,529,800
ベネフィットジャパン	1,600	1,515.00	2,424,000
U b i c o mホールディングス	5,300	2,183.00	11,569,900
カナミックネットワーク	24,500	508.00	12,446,000
ノムラシステムコーポレーション	19,200	122.00	2,342,400
チェンジ	41,200	1,959.00	80,710,800
シンクロ・フード	10,600	501.00	5,310,600
オークネット	8,800	2,231.00	19,632,800
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	623.00	2,429,700
セグエグループ	5,500	667.00	3,668,500
エイトレッド	2,900	1,682.00	4,877,800
マクロミル	38,200	1,083.00	41,370,600
ビーグリー	3,300	1,298.00	4,283,400
オロ	5,200	1,456.00	7,571,200
ユーザーローカル	6,200	1,620.00	10,044,000
テモナ	4,300	296.00	1,272,800
ニーズウェル	6,100	615.00	3,751,500
マネーフォワード	40,400	3,080.00	124,432,000
サインポスト	6,400	788.00	5,043,200
電算システムホールディングス	8,200	2,153.00	17,654,600
ソルクシーズ	15,700	355.00	5,573,500
フェイス	5,600	533.00	2,984,800
プロトコーポレーション	21,200	1,030.00	21,836,000
ハイマックス	5,400	1,335.00	7,209,000
野村総合研究所	343,800	3,550.00	1,220,490,000
サイバネットシステム	14,300	904.00	12,927,200
C Eホールディングス	10,000	463.00	4,630,000
日本システム技術	7,200	1,205.00	8,676,000
インテージホールディングス	22,900	1,517.00	34,739,300

東邦システムサイエンス	5,400	977.00	5,275,800
ソースネクスト	86,100	265.00	22,816,500
インフォコム	21,700	1,905.00	41,338,500
シンプレクス・ホールディングス	31,500	1,858.00	58,527,000
HEROZ	5,800	1,069.00	6,200,200
ラクスル	23,700	2,484.00	58,870,800
メルカリ	75,500	1,934.00	146,017,000
I P S	5,500	2,971.00	16,340,500
F I G	22,100	366.00	8,088,600
システムサポート	7,300	1,390.00	10,147,000
イーソル	11,200	545.00	6,104,000
アルテリア・ネットワークス	18,900	1,191.00	22,509,900
東海ソフト	3,300	917.00	3,026,100
ウイングアーク1st	15,200	1,839.00	27,952,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,600	1,653.00	7,603,800
サーバーワークス	3,500	2,275.00	7,962,500
東名	1,600	1,136.00	1,817,600
ヴィッツ	2,100	995.00	2,089,500
トピラシステムズ	4,900	908.00	4,449,200
S a n s a n	62,700	1,267.00	79,440,900
L i n k - U	3,900	690.00	2,691,000
ギフトィ	18,100	1,998.00	36,163,800
ベース	5,800	3,460.00	20,068,000
J M D C	26,700	4,765.00	127,225,500
フォーカスシステムズ	12,500	956.00	11,950,000
クレスコ	14,500	1,640.00	23,780,000
フジ・メディア・ホールディングス	176,000	1,062.00	186,912,000
オービック	62,300	19,390.00	1,207,997,000
ジャストシステム	28,200	3,345.00	94,329,000
T D C ソフト	15,900	1,238.00	19,684,200
Zホールディングス	2,851,000	380.20	1,083,950,200
トレンドマイクロ	96,900	7,820.00	757,758,000
I Dホールディングス	12,700	865.00	10,985,500
日本オラクル	32,100	7,700.00	247,170,000
アルファシステムズ	5,300	4,090.00	21,677,000
フューチャー	41,900	1,583.00	66,327,700
C A C H o l d i n g s	10,400	1,422.00	14,788,800
S Bテクノロジー	8,600	2,191.00	18,842,600
トーセ	5,200	786.00	4,087,200
オービックビジネスコンサルタント	18,900	4,480.00	84,672,000
伊藤忠テクノソリューションズ	90,100	3,390.00	305,439,000
アイティフォー	24,200	762.00	18,440,400

東計電算	2,400	6,080.00	14,592,000
エクスネット	3,300	1,000.00	3,300,000
大塚商会	95,100	4,525.00	430,327,500
サイボウズ	23,300	1,500.00	34,950,000
電通国際情報サービス	20,400	4,430.00	90,372,000
A C C E S S	22,600	743.00	16,791,800
デジタルガレージ	32,800	3,470.00	113,816,000
E Mシステムズ	28,200	858.00	24,195,600
ウェザーニューズ	6,000	7,460.00	44,760,000
C I J	15,600	777.00	12,121,200
ビジネスエンジニアリング	4,600	2,095.00	9,637,000
日本エンタープライズ	20,800	146.00	3,036,800
WOWOW	8,300	1,330.00	11,039,000
スカラ	16,900	669.00	11,306,100
インテリジェント ウェイブ	10,200	736.00	7,507,200
I M A G I C A G R O U P	14,200	947.00	13,447,400
ネットワンシステムズ	73,000	2,818.00	205,714,000
システムソフト	60,700	98.00	5,948,600
アルゴグラフィックス	15,400	3,615.00	55,671,000
マーベラス	31,500	666.00	20,979,000
エイベックス	34,200	1,541.00	52,702,200
B I P R O G Y	61,800	3,140.00	194,052,000
兼松エレクトロニクス	10,800	3,985.00	43,038,000
都築電気	9,000	1,243.00	11,187,000
T B S ホールディングス	96,700	1,583.00	153,076,100
日本テレビホールディングス	165,200	1,157.00	191,136,400
朝日放送グループホールディングス	16,100	628.00	10,110,800
テレビ朝日ホールディングス	47,700	1,401.00	66,827,700
スカパーJ S A Tホールディングス	167,800	517.00	86,752,600
テレビ東京ホールディングス	12,200	1,899.00	23,167,800
日本BS放送	6,900	947.00	6,534,300
ビジョン	22,200	1,370.00	30,414,000
スマートバリュー	5,000	425.00	2,125,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	15,100	1,974.00	29,807,400
ワイヤレスゲート	8,900	280.00	2,492,000
コネクシオ	14,200	1,188.00	16,869,600
クロップス	3,900	886.00	3,455,400
日本電信電話	2,215,400	3,906.00	8,653,352,400
K D D I	1,441,000	4,243.00	6,114,163,000
ソフトバンク	2,993,800	1,446.50	4,330,531,700
光通信	22,800	17,040.00	388,512,000
エムティーアイ	15,800	499.00	7,884,200

GMOインターネットグループ	62,400	2,548.00	158,995,200
ファイバーゲート	9,300	880.00	8,184,000
アйдママーケティングコミュニケーション	5,000	276.00	1,380,000
KADOKAWA	106,500	2,662.00	283,503,000
学研ホールディングス	28,200	965.00	27,213,000
ゼンリン	32,500	891.00	28,957,500
昭文社ホールディングス	8,700	296.00	2,575,200
インプレスホールディングス	17,500	203.00	3,552,500
アイネット	9,300	1,257.00	11,690,100
松竹	11,300	11,900.00	134,470,000
東宝	116,700	5,250.00	612,675,000
東映	5,600	17,330.00	97,048,000
エヌ・ティ・ティ・データ	526,400	1,866.00	982,262,400
ピー・シー・エー	11,800	1,022.00	12,059,600
ビジネスブレイン太田昭和	6,700	1,397.00	9,359,900
D T S	36,900	3,435.00	126,751,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	92,000	6,230.00	573,160,000
シーイーシー	21,300	1,471.00	31,332,300
カブコン	183,400	3,640.00	667,576,000
アイ・エス・ピー	8,700	1,225.00	10,657,500
ジャステック	10,500	1,253.00	13,156,500
S C S K	136,900	2,190.00	299,811,000
N S W	7,600	2,122.00	16,127,200
アイネス	17,200	1,460.00	25,112,000
T K C	30,200	3,430.00	103,586,000
富士ソフト	19,000	8,180.00	155,420,000
N S D	62,000	2,461.00	152,582,000
コナミグループ	71,800	6,680.00	479,624,000
福井コンピュータホールディングス	9,100	3,385.00	30,803,500
J B C Cホールディングス	13,500	1,767.00	23,854,500
ミロク情報サービス	17,600	1,442.00	25,379,200
ソフトバンクグループ	1,185,200	4,900.00	5,807,480,000
高千穂交易	7,000	2,008.00	14,056,000
オルバヘルスケアホールディングス	3,300	1,405.00	4,636,500
伊藤忠食品	4,000	4,850.00	19,400,000
エレマテック	15,900	1,253.00	19,922,700
あらた	14,700	4,105.00	60,343,500
トーマンデバイス	3,000	5,280.00	15,840,000
東京エレクトロン デバイス	5,900	5,300.00	31,270,000
フィールズ	17,400	1,599.00	27,822,600
双日	203,500	2,124.00	432,234,000
アルフレッサ ホールディングス	205,800	1,690.00	347,802,000

横浜冷凍	48,200	881.00	42,464,200
ラサ商事	9,000	1,000.00	9,000,000
アルコニックス	25,200	1,316.00	33,163,200
神戸物産	136,900	3,495.00	478,465,500
ハイパー	3,800	449.00	1,706,200
あい ホールディングス	28,300	2,064.00	58,411,200
ディーブイエックス	6,800	857.00	5,827,600
ダイワボウホールディングス	84,400	1,863.00	157,237,200
マクニカホールディングス	47,300	2,714.00	128,372,200
ラクト・ジャパン	6,800	2,142.00	14,565,600
グリムス	8,800	1,552.00	13,657,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,700	649.00	20,573,300
八洲電機	14,300	953.00	13,627,900
メディアスホールディングス	11,400	698.00	7,957,200
レスターホールディングス	18,800	1,931.00	36,302,800
ジューテックホールディングス	3,900	1,030.00	4,017,000
大光	8,500	668.00	5,678,000
OCHIホールディングス	4,500	1,215.00	5,467,500
TOKAIホールディングス	96,100	871.00	83,703,100
黒谷	5,500	557.00	3,063,500
Cominix	3,500	718.00	2,513,000
三洋貿易	18,200	1,034.00	18,818,800
ビューティガレージ	3,200	2,612.00	8,358,400
ウイン・パートナーズ	14,400	947.00	13,636,800
ミタチ産業	5,000	855.00	4,275,000
シップヘルスケアホールディングス	57,200	2,719.00	155,526,800
明治電機工業	6,000	1,020.00	6,120,000
デリカフーズホールディングス	7,800	505.00	3,939,000
スターティアホールディングス	4,500	924.00	4,158,000
コメダホールディングス	43,300	2,329.00	100,845,700
ピーバンドットコム	2,900	495.00	1,435,500
アセンテック	6,800	531.00	3,610,800
富士興産	5,000	1,144.00	5,720,000
協栄産業	2,000	1,442.00	2,884,000
フルサト・マルカホールディングス	17,600	3,100.00	54,560,000
ヤマエグループホールディングス	11,100	1,586.00	17,604,600
小野建	17,800	1,414.00	25,169,200
南陽	3,700	1,854.00	6,859,800
佐島電機	12,400	1,230.00	15,252,000
エコートレーディング	4,200	513.00	2,154,600
伯東	11,600	3,190.00	37,004,000
コンドーテック	14,900	1,000.00	14,900,000

中山福	10,600	308.00	3,264,800
ナガイレーベン	23,900	1,945.00	46,485,500
三菱食品	19,100	3,270.00	62,457,000
松田産業	14,500	2,176.00	31,552,000
第一興商	37,700	4,070.00	153,439,000
メディカルホールディングス	183,500	1,843.00	338,190,500
S P K	7,900	1,380.00	10,902,000
萩原電気ホールディングス	6,800	2,102.00	14,293,600
アズワン	28,500	5,990.00	170,715,000
スズデン	6,200	2,050.00	12,710,000
尾家産業	4,700	835.00	3,924,500
シモジマ	12,200	1,010.00	12,322,000
ドウシシャ	18,700	1,442.00	26,965,400
小津産業	4,400	1,758.00	7,735,200
高速	10,500	1,538.00	16,149,000
たけびし	6,800	1,454.00	9,887,200
リックス	4,100	1,967.00	8,064,700
丸文	15,800	775.00	12,245,000
ハピネット	15,100	1,848.00	27,904,800
橋本総業ホールディングス	7,000	966.00	6,762,000
日本ライフライン	57,100	967.00	55,215,700
タカショー	15,500	674.00	10,447,000
I D O M	60,200	869.00	52,313,800
進和	11,700	2,188.00	25,599,600
エスケイジャパン	4,900	568.00	2,783,200
ダイトロン	7,000	2,001.00	14,007,000
シークス	25,300	1,086.00	27,475,800
田中商事	6,200	555.00	3,441,000
オーハシテクニカ	9,800	1,331.00	13,043,800
白銅	6,400	2,306.00	14,758,400
ダイコー通産	2,400	1,097.00	2,632,800
伊藤忠商事	1,189,300	3,501.00	4,163,739,300
丸紅	1,718,500	1,268.00	2,179,058,000
高島	2,800	2,449.00	6,857,200
長瀬産業	90,800	1,971.00	178,966,800
蝶理	11,100	1,919.00	21,300,900
豊田通商	177,100	4,480.00	793,408,000
三共生興	25,500	445.00	11,347,500
兼松	68,700	1,427.00	98,034,900
ツカモトコーポレーション	3,300	1,085.00	3,580,500
三井物産	1,394,200	3,089.00	4,306,683,800
日本紙パルプ商事	9,400	4,360.00	40,984,000

カメイ	21,200	1,067.00	22,620,400
東都水産	1,000	4,485.00	4,485,000
OUGホールディングス	2,900	2,705.00	7,844,500
スターゼン	13,500	2,028.00	27,378,000
山善	71,600	910.00	65,156,000
椿本興業	3,300	3,645.00	12,028,500
住友商事	1,173,800	1,802.50	2,115,774,500
内田洋行	7,800	4,385.00	34,203,000
三菱商事	1,300,700	3,968.00	5,161,177,600
第一実業	7,600	3,845.00	29,222,000
キャノンマーケティングジャパン	41,000	3,200.00	131,200,000
西華産業	8,500	1,584.00	13,464,000
佐藤商事	13,700	1,132.00	15,508,400
菱洋エレクトロ	11,800	2,116.00	24,968,800
東京産業	16,200	755.00	12,231,000
ユアサ商事	15,900	3,505.00	55,729,500
神鋼商事	4,400	3,690.00	16,236,000
トルク	10,700	212.00	2,268,400
阪和興業	34,400	3,435.00	118,164,000
正栄食品工業	11,800	4,150.00	48,970,000
カナデン	16,100	1,022.00	16,454,200
菱電商事	15,700	1,561.00	24,507,700
岩谷産業	44,000	5,450.00	239,800,000
ナイス	6,100	1,542.00	9,406,200
ニチモウ	2,400	2,678.00	6,427,200
極東貿易	11,400	1,233.00	14,056,200
アステナホールディングス	30,700	427.00	13,108,900
三愛オブリ	44,400	1,117.00	49,594,800
稲畑産業	39,700	2,334.00	92,659,800
G S Iクレオス	9,500	1,421.00	13,499,500
明和産業	18,300	749.00	13,706,700
クワザワホールディングス	7,200	400.00	2,880,000
ワキタ	35,800	1,161.00	41,563,800
東邦ホールディングス	53,900	1,938.00	104,458,200
サンゲツ	48,200	1,601.00	77,168,200
ミツウロコグループホールディングス	22,800	967.00	22,047,600
シナネンホールディングス	6,500	3,885.00	25,252,500
伊藤忠エネクス	43,900	1,022.00	44,865,800
サンリオ	55,700	3,720.00	207,204,000
サンワテクノス	10,100	1,274.00	12,867,400
リョーサン	20,300	2,239.00	45,451,700
新光商事	26,200	881.00	23,082,200

トーホー	7,600	1,600.00	12,160,000
三信電気	8,200	1,677.00	13,751,400
東陽テクニカ	19,600	1,208.00	23,676,800
モスフードサービス	26,000	3,110.00	80,860,000
加賀電子	16,200	4,040.00	65,448,000
ソーダニッカ	15,900	590.00	9,381,000
立花エレテック	12,900	1,566.00	20,201,400
フォーバル	7,000	932.00	6,524,000
PALTA C	27,800	4,455.00	123,849,000
三谷産業	31,000	302.00	9,362,000
西本Wismettacホールディングス	4,500	3,860.00	17,370,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,800	1,508.00	2,714,400
コア商事ホールディングス	12,500	631.00	7,887,500
国際紙パルプ商事	36,700	718.00	26,350,600
ヤマタネ	8,500	1,588.00	13,498,000
丸紅建材リース	1,700	1,713.00	2,912,100
日鉄物産	12,100	5,030.00	60,863,000
泉州電業	4,400	5,200.00	22,880,000
トラスコ中山	37,200	1,992.00	74,102,400
オートバックスセブン	61,600	1,402.00	86,363,200
モリト	13,100	705.00	9,235,500
加藤産業	21,500	3,340.00	71,810,000
北恵	4,400	695.00	3,058,000
イノテック	12,000	1,258.00	15,096,000
イエローハット	31,200	1,794.00	55,972,800
J Kホールディングス	14,000	988.00	13,832,000
日伝	13,500	1,733.00	23,395,500
北沢産業	10,600	200.00	2,120,000
杉本商事	9,300	1,818.00	16,907,400
因幡電機産業	49,400	2,727.00	134,713,800
東テク	5,900	3,305.00	19,499,500
ミスミグループ本社	249,100	3,120.00	777,192,000
アルテック	11,000	327.00	3,597,000
タキヒヨー	5,400	764.00	4,125,600
蔵王産業	3,800	1,772.00	6,733,600
スズケン	71,100	3,305.00	234,985,500
ジェコス	13,700	786.00	10,768,200
グローセル	21,600	404.00	8,726,400
ローソン	44,000	4,740.00	208,560,000
サンエー	13,600	4,365.00	59,364,000
カワチ薬品	15,500	2,131.00	33,030,500
エービーシー・マート	31,000	6,230.00	193,130,000

ハードオフコーポレーション	9,000	1,254.00	11,286,000
アスクル	42,900	1,494.00	64,092,600
ゲオホールディングス	24,100	1,772.00	42,705,200
アダストリア	21,500	2,142.00	46,053,000
くら寿司	20,800	3,060.00	63,648,000
キャンドゥ	6,400	2,197.00	14,060,800
アイケイ	7,100	404.00	2,868,400
パルグループホールディングス	17,500	2,349.00	41,107,500
エディオン	91,300	1,178.00	107,551,400
サーラコーポレーション	37,600	760.00	28,576,000
ワッツ	10,100	680.00	6,868,000
ハローズ	9,200	2,898.00	26,661,600
フジオフードグループ本社	14,700	1,358.00	19,962,600
あみやき亭	4,800	2,912.00	13,977,600
大黒天物産	6,400	5,260.00	33,664,000
ハニーズホールディングス	16,000	1,216.00	19,456,000
ファーマライズホールディングス	4,800	637.00	3,057,600
アルペン	14,800	2,066.00	30,576,800
ハブ	7,000	618.00	4,326,000
クオールホールディングス	24,600	1,210.00	29,766,000
ジinzホールディングス	10,600	4,280.00	45,368,000
ビックカメラ	117,900	1,237.00	145,842,300
D C Mホールディングス	118,100	1,177.00	139,003,700
Monotaro	251,000	2,222.00	557,722,000
東京一番フーズ	5,100	579.00	2,952,900
きちりホールディングス	5,300	311.00	1,648,300
アーランドサービスホールディングス	14,700	2,137.00	31,413,900
J.フロント リテイリング	220,200	1,176.00	258,955,200
ドトール・日レスホールディングス	31,600	1,738.00	54,920,800
マツキヨココカラ&カンパニー	116,300	6,230.00	724,549,000
ブロンコビリー	9,600	2,447.00	23,491,200
Z O Z O	136,500	2,894.00	395,031,000
トレジャー・ファクトリー	6,000	1,788.00	10,728,000
物語コーポレーション	9,900	6,940.00	68,706,000
三越伊勢丹ホールディングス	298,000	1,227.00	365,646,000
Hamee	7,500	860.00	6,450,000
マーケットエンタープライズ	2,400	897.00	2,152,800
ウエルシアホールディングス	105,000	3,055.00	320,775,000
クリエイティブSDホールディングス	29,400	3,135.00	92,169,000
丸善CHIホールディングス	24,200	326.00	7,889,200
ミサワ	4,600	575.00	2,645,000
ティーライフ	2,900	1,199.00	3,477,100

チムニー	6,000	1,171.00	7,026,000
シュッピン	16,600	1,268.00	21,048,800
オイシックス・ラ・大地	28,700	1,645.00	47,211,500
ネクステージ	40,400	3,140.00	126,856,000
ジョイフル本田	57,100	1,784.00	101,866,400
鳥貴族ホールディングス	6,700	2,400.00	16,080,000
ホットランド	13,800	1,356.00	18,712,800
すかいらーくホールディングス	242,100	1,543.00	373,560,300
SFPホールディングス	9,700	1,695.00	16,441,500
綿半ホールディングス	13,900	1,379.00	19,168,100
ヨシックスホールディングス	4,000	2,023.00	8,092,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	58,000	1,054.00	61,132,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,200	1,515.00	12,423,000
B E E N O S	10,200	2,332.00	23,786,400
あさひ	16,700	1,306.00	21,810,200
日本調剤	12,300	1,265.00	15,559,500
コスモス薬品	20,000	14,350.00	287,000,000
トーエル	9,100	744.00	6,770,400
セブン&アイ・ホールディングス	665,200	5,806.00	3,862,151,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	133,100	976.00	129,905,600
ツルハホールディングス	43,300	8,490.00	367,617,000
サンマルクホールディングス	15,900	1,604.00	25,503,600
フェリシモ	4,700	1,015.00	4,770,500
トリドールホールディングス	49,500	2,992.00	148,104,000
T O K Y O B A S E	19,200	314.00	6,028,800
ウイルプラスホールディングス	4,000	1,117.00	4,468,000
J Mホールディングス	15,200	1,683.00	25,581,600
サツドラホールディングス	9,400	672.00	6,316,800
アレンザホールディングス	13,600	982.00	13,355,200
串カツ田中ホールディングス	4,900	1,706.00	8,359,400
パロックジャパンリミテッド	14,200	786.00	11,161,200
クスリのアオキホールディングス	17,800	6,810.00	121,218,000
力の源ホールディングス	10,500	765.00	8,032,500
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	101,800	2,224.00	226,403,200
メディカルシステムネットワーク	18,100	395.00	7,149,500
はるやまホールディングス	10,100	400.00	4,040,000
ノジマ	64,400	1,348.00	86,811,200
カッパ・クリエイト	27,800	1,362.00	37,863,600
ライトオン	14,800	672.00	9,945,600
良品計画	228,500	1,209.00	276,256,500

パリミキホールディングス	26,000	235.00	6,110,000	
アドヴァングループ	17,200	815.00	14,018,000	
アルビス	5,900	2,331.00	13,752,900	
コナカ	21,400	331.00	7,083,400	
ハウス オブ ローゼ	2,600	1,600.00	4,160,000	
G - 7ホールディングス	22,300	1,431.00	31,911,300	
イオン北海道	26,400	1,130.00	29,832,000	
コジマ	34,700	630.00	21,861,000	
ヒマラヤ	6,500	913.00	5,934,500	
コーナン商事	28,300	3,380.00	95,654,000	
エコス	6,700	1,807.00	12,106,900	
ワタミ	24,000	903.00	21,672,000	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	396,800	2,560.00	1,015,808,000	
西松屋チェーン	39,400	1,344.00	52,953,600	
ゼンショーホールディングス	96,900	3,585.00	347,386,500	
幸楽苑ホールディングス	11,500	1,078.00	12,397,000	
ハークスレイ	9,000	468.00	4,212,000	
サイゼリヤ	29,500	2,670.00	78,765,000	
V Tホールディングス	75,400	476.00	35,890,400	
魚力	5,600	2,005.00	11,228,000	
フジ・コーポレーション	10,300	1,229.00	12,658,700	
ユナイテッドアローズ	21,000	1,821.00	38,241,000	
ハイデイ日高	28,800	2,156.00	62,092,800	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	13,300	205.00	2,726,500	
コロワイド	81,500	1,859.00	151,508,500	
ピーシーデボコーポレーション	24,300	268.00	6,512,400	
壱番屋	14,100	4,440.00	62,604,000	
P L A N T	5,100	635.00	3,238,500	
スギホールディングス	39,700	5,810.00	230,657,000	
薬王堂ホールディングス	10,000	2,331.00	23,310,000	
スクロール	31,000	701.00	21,731,000	
ヨンドシーホールディングス	16,900	1,718.00	29,034,200	
木曽路	26,900	2,072.00	55,736,800	
S R Sホールディングス	29,400	842.00	24,754,800	
千趣会	33,400	392.00	13,092,800	
リテールパートナーズ	26,600	1,112.00	29,579,200	
ケーヨー	36,900	910.00	33,579,000	
上新電機	19,400	1,896.00	36,782,400	
日本瓦斯	95,000	2,055.00	195,225,000	
ロイヤルホールディングス	33,700	2,186.00	73,668,200	
いなげや	19,800	1,146.00	22,690,800	

チヨダ	17,300	785.00	13,580,500
ライフコーポレーション	15,500	2,686.00	41,633,000
リンガーハット	22,800	2,196.00	50,068,800
MrMaxHD	25,300	623.00	15,761,900
AOKIホールディングス	38,800	707.00	27,431,600
オークワ	28,500	905.00	25,792,500
コメリ	30,800	2,764.00	85,131,200
青山商事	38,200	912.00	34,838,400
しまむら	23,100	12,230.00	282,513,000
はせがわ	11,500	365.00	4,197,500
高島屋	133,500	1,711.00	228,418,500
松屋	33,500	1,037.00	34,739,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	86,300	1,107.00	95,534,100
近鉄百貨店	5,800	2,398.00	13,908,400
丸井グループ	143,600	2,398.00	344,352,800
アクシアル リテイリング	13,300	3,255.00	43,291,500
イオン	654,400	2,703.50	1,769,170,400
イズミ	31,400	3,105.00	97,497,000
平和堂	29,700	1,998.00	59,340,600
フジ	43,600	1,884.00	82,142,400
ヤオコー	22,600	6,560.00	148,256,000
ゼビオホールディングス	27,300	964.00	26,317,200
ケーズホールディングス	169,100	1,195.00	202,074,500
Olympicグループ	9,400	563.00	5,292,200
日産東京販売ホールディングス	30,400	267.00	8,116,800
シルバーライフ	4,300	1,319.00	5,671,700
Genky DrugStores	8,800	3,595.00	31,636,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,800	831.00	3,988,800
ブックオフグループホールディングス	11,900	1,117.00	13,292,300
ギフトホールディングス	3,800	3,265.00	12,407,000
アインホールディングス	24,400	6,250.00	152,500,000
元気寿司	5,700	3,040.00	17,328,000
ヤマダホールディングス	702,500	476.00	334,390,000
アーケランズ	31,300	1,449.00	45,353,700
ニトリホールディングス	78,800	12,190.00	960,572,000
グルメ杵屋	16,100	996.00	16,035,600
愛眼	14,500	175.00	2,537,500
ケーユーホールディングス	10,600	1,094.00	11,596,400
吉野家ホールディングス	69,400	2,347.00	162,881,800
松屋フーズホールディングス	9,600	3,815.00	36,624,000
サガミホールディングス	28,700	1,156.00	33,177,200
関西フードマーケット	16,300	1,117.00	18,207,100

王将フードサービス	13,200	6,400.00	84,480,000
プレナス	22,400	1,926.00	43,142,400
ミニストップ	14,900	1,420.00	21,158,000
アークス	35,300	2,060.00	72,718,000
パローホールディングス	40,700	1,779.00	72,405,300
ベルク	8,900	5,390.00	47,971,000
大庄	10,900	1,129.00	12,306,100
ファーストリテイリング	26,500	76,710.00	2,032,815,000
サンドラッグ	74,700	3,515.00	262,570,500
サックスパー ホールディングス	19,200	710.00	13,632,000
ヤマザワ	4,400	1,233.00	5,425,200
やまや	4,200	2,475.00	10,395,000
ベルーナ	43,100	698.00	30,083,800
島根銀行	6,300	435.00	2,740,500
じもとホールディングス	13,100	466.00	6,104,600
めぶきフィナンシャルグループ	817,200	282.00	230,450,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23,000	2,122.00	48,806,000
九州フィナンシャルグループ	347,700	382.00	132,821,400
ゆうちょ銀行	469,000	1,009.00	473,221,000
富山第一銀行	44,200	405.00	17,901,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	983,400	447.00	439,579,800
西日本フィナンシャルホールディングス	104,300	750.00	78,225,000
三十三フィナンシャルグループ	16,000	1,411.00	22,576,000
第四北越フィナンシャルグループ	28,000	2,682.00	75,096,000
ひろぎんホールディングス	253,900	608.00	154,371,200
おきなわフィナンシャルグループ	16,800	2,097.00	35,229,600
十六フィナンシャルグループ	23,100	2,439.00	56,340,900
北國フィナンシャルホールディングス	16,400	4,720.00	77,408,000
プロクレアホールディングス	20,200	2,124.00	42,904,800
新生銀行	129,600	2,075.00	268,920,000
あおぞら銀行	111,000	2,582.00	286,602,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,628,200	651.50	7,575,772,300
りそなホールディングス	2,102,000	528.00	1,109,856,000
三井住友トラスト・ホールディングス	328,600	4,099.00	1,346,931,400
三井住友フィナンシャルグループ	1,289,100	4,024.00	5,187,338,400
千葉銀行	561,000	779.00	437,019,000
群馬銀行	319,600	392.00	125,283,200
武蔵野銀行	25,400	1,704.00	43,281,600
千葉興業銀行	42,800	282.00	12,069,600
筑波銀行	77,400	185.00	14,319,000
七十七銀行	52,700	1,782.00	93,911,400
秋田銀行	11,900	1,612.00	19,182,800

山形銀行	18,300	999.00	18,281,700
岩手銀行	12,100	1,792.00	21,683,200
東邦銀行	142,100	203.00	28,846,300
東北銀行	8,900	949.00	8,446,100
ふくおかフィナンシャルグループ	143,400	2,566.00	367,964,400
静岡銀行	409,400	875.00	358,225,000
スルガ銀行	174,200	372.00	64,802,400
八十二銀行	368,500	479.00	176,511,500
山梨中央銀行	20,000	1,158.00	23,160,000
大垣共立銀行	34,000	1,713.00	58,242,000
福井銀行	15,900	1,367.00	21,735,300
清水銀行	7,100	1,450.00	10,295,000
富山銀行	3,100	1,736.00	5,381,600
滋賀銀行	32,400	2,614.00	84,693,600
南都銀行	26,800	2,100.00	56,280,000
百五銀行	166,900	317.00	52,907,300
京都銀行	61,700	5,290.00	326,393,000
紀陽銀行	58,900	1,388.00	81,753,200
ほくほくフィナンシャルグループ	112,700	854.00	96,245,800
山陰合同銀行	110,400	700.00	77,280,000
中国銀行	139,800	899.00	125,680,200
鳥取銀行	6,300	1,089.00	6,860,700
伊予銀行	222,700	699.00	155,667,300
百十四銀行	18,300	1,667.00	30,506,100
四国銀行	26,200	853.00	22,348,600
阿波銀行	26,400	1,889.00	49,869,600
大分銀行	10,700	1,815.00	19,420,500
宮崎銀行	10,800	2,148.00	23,198,400
佐賀銀行	10,400	1,521.00	15,818,400
琉球銀行	43,100	765.00	32,971,500
セブン銀行	590,000	259.00	152,810,000
みずほフィナンシャルグループ	2,381,900	1,562.50	3,721,718,750
高知銀行	6,200	637.00	3,949,400
山口フィナンシャルグループ	198,400	768.00	152,371,200
長野銀行	6,100	1,366.00	8,332,600
名古屋銀行	12,100	3,000.00	36,300,000
北洋銀行	249,600	227.00	56,659,200
愛知銀行	6,200	5,500.00	34,100,000
中京銀行	6,100	1,710.00	10,431,000
大光銀行	5,900	1,297.00	7,652,300
愛媛銀行	25,900	861.00	22,299,900
トマト銀行	6,000	1,011.00	6,066,000

京葉銀行	82,900	472.00	39,128,800
栃木銀行	89,100	274.00	24,413,400
北日本銀行	5,800	1,760.00	10,208,000
東和銀行	32,600	513.00	16,723,800
福島銀行	21,000	207.00	4,347,000
大東銀行	8,700	608.00	5,289,600
トモニホールディングス	143,300	310.00	44,423,000
フィデアホールディングス	18,200	1,261.00	22,950,200
池田泉州ホールディングス	210,900	209.00	44,078,100
F P G	67,000	1,132.00	75,844,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,600	1,322.00	17,979,200
マーキュリアホールディングス	11,100	609.00	6,759,900
S B Iホールディングス	245,500	2,596.00	637,318,000
ジャフコ グループ	68,800	2,129.00	146,475,200
大和証券グループ本社	1,276,200	566.40	722,839,680
野村ホールディングス	3,033,600	478.40	1,451,274,240
岡三証券グループ	144,000	326.00	46,944,000
丸三証券	59,500	433.00	25,763,500
東洋証券	61,000	261.00	15,921,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	196,200	353.00	69,258,600
光世証券	4,700	402.00	1,889,400
水戸証券	49,600	237.00	11,755,200
いちよし証券	33,200	594.00	19,720,800
松井証券	97,600	780.00	76,128,000
マネックスグループ	167,800	452.00	75,845,600
極東証券	22,900	665.00	15,228,500
岩井コスモホールディングス	19,000	1,210.00	22,990,000
アイザワ証券グループ	27,100	643.00	17,425,300
マネーパートナーズグループ	22,000	263.00	5,786,000
スパークス・グループ	18,520	1,334.00	24,705,680
かんぼ生命保険	200,000	2,026.00	405,200,000
S O M P Oホールディングス	282,700	5,762.00	1,628,917,400
アニコム ホールディングス	61,000	567.00	34,587,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	408,400	3,836.00	1,566,622,400
第一生命ホールディングス	967,400	2,292.00	2,217,280,800
東京海上ホールディングス	1,658,400	2,565.00	4,253,796,000
T & Dホールディングス	442,000	1,367.00	604,214,000
アドバンスクリエイト	9,500	963.00	9,148,500
全国保証	47,500	4,815.00	228,712,500
あんしん保証	10,300	253.00	2,605,900
イントラスト	9,400	593.00	5,574,200
日本モーゲージサービス	11,700	840.00	9,828,000

C a s a	7,800	801.00	6,247,800
アルヒ	29,800	1,375.00	40,975,000
プレミアムグループ	30,500	1,777.00	54,198,500
ネットプロテクションズホールディングス	61,800	379.00	23,422,200
クレディセゾン	116,300	1,692.00	196,779,600
芙蓉総合リース	17,100	7,890.00	134,919,000
みずほリース	24,700	3,115.00	76,940,500
東京センチュリー	30,900	4,610.00	142,449,000
日本証券金融	78,800	820.00	64,616,000
アイフル	335,000	377.00	126,295,000
リコーリース	17,800	3,530.00	62,834,000
イオンフィナンシャルサービス	108,500	1,432.00	155,372,000
アコム	393,800	311.00	122,471,800
ジャックス	19,900	3,590.00	71,441,000
オリエントコーポレーション	54,280	1,146.00	62,204,880
オリックス	1,180,600	2,028.50	2,394,847,100
三菱HCキャピタル	643,100	622.00	400,008,200
九州リースサービス	9,600	589.00	5,654,400
日本取引所グループ	463,100	1,952.50	904,202,750
イー・ギャランティ	29,800	2,495.00	74,351,000
アサックス	11,400	578.00	6,589,200
NECキャピタルソリューション	8,400	2,065.00	17,346,000
いちご	228,000	298.00	67,944,000
日本駐車場開発	206,200	201.00	41,446,200
スター・マイカ・ホールディングス	9,700	1,569.00	15,219,300
SREホールディングス	5,700	3,175.00	18,097,500
ADワークスグループ	44,300	152.00	6,733,600
ヒューリック	386,100	1,063.00	410,424,300
三栄建築設計	9,200	1,616.00	14,867,200
野村不動産ホールディングス	103,500	3,275.00	338,962,500
三重交通グループホールディングス	44,400	499.00	22,155,600
サムティ	27,100	2,249.00	60,947,900
ディア・ライフ	28,000	554.00	15,512,000
地主	13,600	1,987.00	27,023,200
プレサンスコーポレーション	23,000	1,463.00	33,649,000
ハウスコム	5,600	904.00	5,062,400
JPMC	10,400	1,008.00	10,483,200
サンセイランディック	7,800	821.00	6,403,800
フージャースホールディングス	25,400	775.00	19,685,000
オープンハウスグループ	60,700	4,895.00	297,126,500
東急不動産ホールディングス	542,800	751.00	407,642,800
飯田グループホールディングス	163,300	1,963.00	320,557,900

イーランド	4,100	1,521.00	6,236,100
ムゲンエステート	16,500	456.00	7,524,000
And Doホールディングス	9,800	860.00	8,428,000
シーアールイー	8,700	1,460.00	12,702,000
ケイアイスター不動産	9,400	4,370.00	41,078,000
グッドコムアセット	9,000	1,517.00	13,653,000
ジェイ・エス・ビー	4,600	3,750.00	17,250,000
ロードスターキャピタル	8,300	1,574.00	13,064,200
テンポイノベーション	7,700	898.00	6,914,600
フェイスネットワーク	4,000	1,308.00	5,232,000
パーク24	129,400	1,869.00	241,848,600
パラカ	6,900	1,816.00	12,530,400
三井不動産	775,900	2,754.50	2,137,216,550
三菱地所	1,132,300	1,896.50	2,147,406,950
平和不動産	32,100	3,970.00	127,437,000
東京建物	158,000	2,058.00	325,164,000
京阪神ビルディング	27,600	1,223.00	33,754,800
住友不動産	357,900	3,288.00	1,176,775,200
テーオーシー	32,700	706.00	23,086,200
東京楽天地	3,400	3,940.00	13,396,000
スターツコーポレーション	27,800	2,631.00	73,141,800
フジ住宅	26,300	621.00	16,332,300
空港施設	23,700	520.00	12,324,000
明和地所	12,600	603.00	7,597,800
ゴールドクレスト	16,800	1,667.00	28,005,600
エスリード	8,900	1,686.00	15,005,400
日神グループホールディングス	37,000	429.00	15,873,000
日本エスコン	37,000	818.00	30,266,000
タカラレーベン	83,200	385.00	32,032,000
A V A N T I A	11,800	793.00	9,357,400
イオンモール	100,900	1,610.00	162,449,000
毎日コムネット	10,000	622.00	6,220,000
ファースト住建	9,200	1,099.00	10,110,800
カチタス	49,800	3,215.00	160,107,000
トーセイ	28,800	1,387.00	39,945,600
穴吹興産	5,300	2,001.00	10,605,300
サンフロンティア不動産	29,200	1,120.00	32,704,000
F Jネクストホールディングス	21,400	1,008.00	21,571,200
インテリックス	4,500	551.00	2,479,500
ランドビジネス	6,700	222.00	1,487,400
サンネクスタグループ	8,200	913.00	7,486,600
グランディハウス	17,100	543.00	9,285,300

日本空港ビルデング	64,400	6,050.00	389,620,000
明豊ファシリティワークス	9,400	656.00	6,166,400
日本工営	12,300	3,570.00	43,911,000
LIFULL	61,100	161.00	9,837,100
ミクシィ	44,200	2,293.00	101,350,600
ジェイエイシーリクルートメント	15,700	2,216.00	34,791,200
日本M&Aセンターホールディングス	315,900	1,663.00	525,341,700
メンバーズ	5,200	2,578.00	13,405,600
中広	4,000	396.00	1,584,000
UTグループ	27,900	2,382.00	66,457,800
アイティメディア	9,400	1,615.00	15,181,000
E・Jホールディングス	11,300	1,298.00	14,667,400
夢真ビーネックスグループ	63,000	1,607.00	101,241,000
コシダカホールディングス	51,900	905.00	46,969,500
アルトナー	5,000	982.00	4,910,000
パソナグループ	21,000	2,000.00	42,000,000
CDS	5,000	1,651.00	8,255,000
リンクアンドモチベーション	49,500	769.00	38,065,500
エス・エム・エス	65,500	2,929.00	191,849,500
サニーサイドアップグループ	7,300	594.00	4,336,200
パーソルホールディングス	192,600	2,675.00	515,205,000
リニカル	11,400	742.00	8,458,800
クックパッド	48,900	200.00	9,780,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	10,000	619.00	6,190,000
学情	8,000	1,424.00	11,392,000
スタジオアリス	8,800	2,146.00	18,884,800
シミックホールディングス	9,700	1,528.00	14,821,600
エプコ	4,700	635.00	2,984,500
NJS	4,000	1,969.00	7,876,000
総合警備保障	70,300	3,640.00	255,892,000
カカクコム	141,400	2,462.00	348,126,800
アイロムグループ	7,100	2,363.00	16,777,300
セントケア・ホールディング	13,000	814.00	10,582,000
サイネックス	3,900	591.00	2,304,900
ルネサンス	13,800	931.00	12,847,800
ディップ	33,900	3,675.00	124,582,500
デジタルホールディングス	13,700	1,168.00	16,001,600
新日本科学	23,600	2,696.00	63,625,600
キャリアデザインセンター	4,200	1,397.00	5,867,400
ベネフィット・ワン	69,900	2,033.00	142,106,700
エムスリー	339,700	4,051.00	1,376,124,700
ツカダ・グローバルホールディング	12,200	354.00	4,318,800

アウトソーシング	102,700	1,097.00	112,661,900
ウェルネット	17,600	591.00	10,401,600
ワールドホールディングス	7,800	2,631.00	20,521,800
ディー・エヌ・エー	73,500	1,829.00	134,431,500
博報堂D Yホールディングス	244,000	1,018.00	248,392,000
ぐるなび	28,900	433.00	12,513,700
タカミヤ	24,200	386.00	9,341,200
ジャパンベストレスキューシステム	10,800	743.00	8,024,400
ファンコミュニケーションズ	34,600	409.00	14,151,400
ライク	6,600	2,157.00	14,236,200
ビジネス・ブレークスルー	8,100	392.00	3,175,200
エスプール	49,800	1,043.00	51,941,400
WDBホールディングス	8,900	2,398.00	21,342,200
ティア	12,100	422.00	5,106,200
C D G	2,300	1,229.00	2,826,700
アドウェイズ	24,200	741.00	17,932,200
バリューコマース	13,100	2,214.00	29,003,400
インフォマート	179,300	441.00	79,071,300
J Pホールディングス	50,800	271.00	13,766,800
エコナックホールディングス	37,400	88.00	3,291,200
C Lホールディングス	5,200	860.00	4,472,000
プレステージ・インターナショナル	72,700	634.00	46,091,800
アミューズ	10,700	1,695.00	18,136,500
ドリームインキュベータ	6,100	1,802.00	10,992,200
クイック	12,200	1,818.00	22,179,600
T A C	12,300	202.00	2,484,600
電通グループ	180,400	4,110.00	741,444,000
イオンファンタジー	7,500	3,465.00	25,987,500
シーティーエス	22,200	729.00	16,183,800
ネクシィーズグループ	6,400	652.00	4,172,800
H . U . グループホールディングス	50,400	2,640.00	133,056,000
アルプス技研	15,200	1,848.00	28,089,600
ダイオーズ	4,000	1,497.00	5,988,000
日本空調サービス	20,600	737.00	15,182,200
オリエンタルランド	204,700	19,705.00	4,033,613,500
ダスキン	41,600	2,840.00	118,144,000
明光ネットワークジャパン	23,200	604.00	14,012,800
ファルコホールディングス	8,700	1,746.00	15,190,200
ラウンドワン	161,700	628.00	101,547,600
リゾートトラスト	81,600	2,322.00	189,475,200
ビー・エム・エル	24,600	3,260.00	80,196,000
りらいあコミュニケーションズ	28,800	965.00	27,792,000

リソー教育	89,100	320.00	28,512,000
早稲田アカデミー	11,100	1,036.00	11,499,600
ユー・エス・エス	215,600	2,237.00	482,297,200
東京個別指導学院	17,700	550.00	9,735,000
サイバーエージェント	411,600	1,218.00	501,328,800
楽天グループ	794,900	621.00	493,632,900
クリーク・アンド・リバー社	10,200	2,475.00	25,245,000
モーニングスター	34,500	464.00	16,008,000
テー・オー・ダブリュー	38,000	304.00	11,552,000
山田コンサルティンググループ	10,300	1,199.00	12,349,700
セントラルスポーツ	7,300	2,444.00	17,841,200
フルキャストホールディングス	16,600	2,560.00	42,496,000
エン・ジャパン	34,400	2,231.00	76,746,400
リソルホールディングス	2,200	4,520.00	9,944,000
テクノプロ・ホールディングス	115,400	3,085.00	356,009,000
アトラグループ	4,300	183.00	786,900
インターワークス	6,500	365.00	2,372,500
アイ・アールジャパンホールディングス	9,100	2,050.00	18,655,000
Keeper 技研	12,500	3,720.00	46,500,000
ファーストロジック	3,400	836.00	2,842,400
三機サービス	3,800	874.00	3,321,200
Gunosy	11,100	766.00	8,502,600
デザインワン・ジャパン	7,800	168.00	1,310,400
イー・ガーディアン	6,600	2,864.00	18,902,400
リブセンス	10,200	248.00	2,529,600
ジャパンマテリアル	59,400	1,848.00	109,771,200
ベクトル	27,300	1,098.00	29,975,400
ウチヤマホールディングス	10,700	287.00	3,070,900
チャーム・ケア・コーポレーション	14,700	1,045.00	15,361,500
キャリアリンク	7,300	2,219.00	16,198,700
I B J	10,900	884.00	9,635,600
アサンテ	8,700	1,513.00	13,163,100
バリューHR	15,200	1,472.00	22,374,400
M&Aキャピタルパートナーズ	16,000	3,710.00	59,360,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,800	1,055.00	8,229,000
E R Iホールディングス	5,700	1,086.00	6,190,200
アビスト	3,100	2,765.00	8,571,500
シグマクシス・ホールディングス	23,500	1,132.00	26,602,000
ウィルグループ	14,600	1,368.00	19,972,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	22,300	158.00	3,523,400
メドピア	13,800	1,293.00	17,843,400
レアジョブ	4,100	710.00	2,911,000

リクルートホールディングス	1,378,800	4,161.00	5,737,186,800
エラン	23,100	1,073.00	24,786,300
土木管理総合試験所	9,200	303.00	2,787,600
日本郵政	2,103,200	957.70	2,014,234,640
ベルシステム24ホールディングス	27,900	1,380.00	38,502,000
鎌倉新書	22,300	847.00	18,888,100
S MN	5,100	511.00	2,606,100
グローバルキッズCOMPANY	3,500	615.00	2,152,500
エアトリ	11,200	2,849.00	31,908,800
アトラエ	13,700	1,624.00	22,248,800
ストライク	8,600	3,860.00	33,196,000
ソラスト	47,800	863.00	41,251,400
セラク	6,500	984.00	6,396,000
インソース	21,500	2,625.00	56,437,500
ペイカレント・コンサルティング	13,600	37,650.00	512,040,000
Orchestra Holdings	3,800	2,427.00	9,222,600
アイモバイル	9,200	1,171.00	10,773,200
キャリアインデックス	7,500	364.00	2,730,000
MS - Japan	8,300	840.00	6,972,000
船場	3,700	725.00	2,682,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	61,300	1,895.00	116,163,500
フルテック	3,000	1,145.00	3,435,000
GameWith	6,700	363.00	2,432,100
MS&Consulting	3,400	605.00	2,057,000
ウェルビー	13,100	785.00	10,283,500
エル・ティー・エス	2,300	3,115.00	7,164,500
ミダックホールディングス	8,800	3,350.00	29,480,000
日総工産	15,700	556.00	8,729,200
キュービーネットホールディングス	9,200	1,360.00	12,512,000
RPAホールディングス	28,400	290.00	8,236,000
スプリックス	7,000	950.00	6,650,000
マネジメントソリューションズ	9,600	2,940.00	28,224,000
プロレド・パートナーズ	4,900	496.00	2,430,400
テノ・ホールディングス	3,000	556.00	1,668,000
フロンティア・マネジメント	6,000	1,164.00	6,984,000
ピアラ	3,600	691.00	2,487,600
コプロ・ホールディングス	4,200	878.00	3,687,600
ギークス	3,700	815.00	3,015,500
カーブスホールディングス	53,300	819.00	43,652,700
フォーラムエンジニアリング	12,100	912.00	11,035,200
Fast Fitness Japan	3,800	1,345.00	5,111,000
ダイレクトマーケティングミックス	19,800	1,629.00	32,254,200

ポピンズ	2,800	1,689.00	4,729,200
LITALICO	15,700	2,769.00	43,473,300
アドバンテッジリスクマネジメント	10,600	424.00	4,494,400
リログループ	105,400	2,202.00	232,090,800
東祥	14,700	1,214.00	17,845,800
ビーウィズ	5,400	1,361.00	7,349,400
TREホールディングス	36,400	1,700.00	61,880,000
人・夢・技術グループ	7,800	2,535.00	19,773,000
エイチ・アイ・エス	45,100	2,087.00	94,123,700
ラックランド	5,500	2,768.00	15,224,000
共立メンテナンス	34,400	5,980.00	205,712,000
イチネンホールディングス	20,000	1,216.00	24,320,000
建設技術研究所	9,000	2,836.00	25,524,000
スペース	12,900	852.00	10,990,800
燦ホールディングス	8,600	1,687.00	14,508,200
スバル興業	1,200	8,920.00	10,704,000
東京テアトル	7,000	1,163.00	8,141,000
タナベ経営	8,000	618.00	4,944,000
ナガワ	5,400	7,420.00	40,068,000
東京都競馬	14,500	4,130.00	59,885,000
カナモト	31,700	2,064.00	65,428,800
西尾レントオール	16,100	2,854.00	45,949,400
トランス・コスモス	24,500	3,735.00	91,507,500
乃村工藝社	82,900	905.00	75,024,500
藤田観光	7,600	2,891.00	21,971,600
KNT-CTホールディングス	12,000	1,789.00	21,468,000
日本管財	20,700	2,534.00	52,453,800
トーカイ	15,400	1,793.00	27,612,200
セコム	189,700	8,276.00	1,569,957,200
セントラル警備保障	9,400	2,381.00	22,381,400
丹青社	36,800	760.00	27,968,000
メイテック	68,700	2,294.00	157,597,800
応用地質	16,900	1,868.00	31,569,200
船井総研ホールディングス	36,300	2,455.00	89,116,500
進学会ホールディングス	7,500	300.00	2,250,000
オオバ	12,600	691.00	8,706,600
いであ	4,400	1,639.00	7,211,600
学究社	6,400	1,616.00	10,342,400
ベネッセホールディングス	64,300	2,155.00	138,566,500
イオンディライト	22,300	2,836.00	63,242,800
ナック	9,500	918.00	8,721,000
ダイセキ	35,200	4,460.00	156,992,000

ステップ	7,300	1,778.00	12,979,400	
合計	206,248,400		472,582,867,680	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

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
特殊債証券	36,905,161,716
社債証券	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	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（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	<p>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。</p> <p>有価証券 99,972,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3610円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,610円)</p>

（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	<p>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。</p>

	2022年 9月30日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>

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	<p>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。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

(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
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,163,501,932円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,022,136円
S M T 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
D C マイセレクション 2 5	26,150,499,367円
D C マイセレクション 5 0	30,020,680,653円
D C マイセレクション 7 5	8,800,669,292円
D C 日本債券インデックス・オープン	432,974,004円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,444,255,221円
D C 日本債券インデックス・オープン P	67,120,766,554円
D C マイセレクション S 2 5	13,387,190,440円
D C マイセレクション S 5 0	14,908,836,492円
D C マイセレクション S 7 5	3,417,338,205円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	692,522,238円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,352,296,284円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	892,924,329円
D C 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 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,404,466円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	29,000,496円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,937,325円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	979,351円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	81,354,182円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	115,659,680円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	33,135,779円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	26,289,986円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,704,999,017円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	745,232,914円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,095,355,287円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	74,777,744円
世界バランス V A 2（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 1 1 回川崎市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	111,442,000	
	第 8 9 回川崎市公募公債	100,000,000	100,125,000	
	第 9 3 回川崎市公募公債	100,000,000	97,874,000	
	平成 2 6 年度第 2 回北九州市公募公債	100,000,000	100,848,000	
	平成 2 7 年度第 2 回北九州市公募公債	100,000,000	101,276,000	
	平成 2 8 年度第 1 回北九州市公募公債	100,000,000	99,947,000	
	平成 2 1 年度第 3 回福岡市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	112,513,000	
	平成 2 5 年度第 6 回福岡市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	110,470,000	
	平成 2 6 年度第 5 回福岡市公募公債	200,000,000	201,992,000	
	平成 3 0 年度第 1 0 回福岡市公募公債（ 5 年）	100,000,000	100,006,000	
	平成 2 5 年度第 3 回広島市公募公債	150,000,000	151,344,000	
	平成 2 6 年度第 2 回広島市公募公債	100,000,000	100,883,000	
	平成 2 8 年度第 4 回広島市公募公債	105,000,000	105,132,300	
	平成 2 9 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 2 5 年度第 4 回福井県公募公債	100,000,000	101,034,000	
	平成 2 6 年度第 1 回岡山県公募公債（ 1 0 年）	200,000,000	201,258,000	
	平成 3 0 年度第 3 回岡山県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	99,172,000	
	第 1 1 3 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 3 7 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 5 2 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 7 8 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 1 2 9 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 2 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,433,000	
	第 2 1 回道路債券	100,000,000	122,964,000	
	第 2 7 回道路債券	400,000,000	413,824,000	
	第 2 8 回道路債券	200,000,000	248,574,000	
	第 3 3 回道路債券	200,000,000	251,260,000	
	第 3 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,435,000	
	第 3 6 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	

F 2 0 2 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,944,000	
F 2 0 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,257,000	
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,489,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,401,000	
F 4 4 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,960,000	
第 2 9 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 1 9 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 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	114,179,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,868,960	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,047,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,273,400	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	186,923,330	
第 5 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,848,200	
第 8 7 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,816,000	
第 8 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,924,000	
第 8 9 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,843,000	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	205,640,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	137,186,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	75,697,000	
第 1 7 1 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 6 2 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（BFCEM）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（BFCEM）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回ピー・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J S R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J.A.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 5 5 0 回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,961,000	
第 3 9 8 回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,461,000	
第 4 0 0 回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,982,000	
第 4 1 6 回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,002,000	
第 4 2 5 回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,661,000	
第 3 0 7 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,279,000	
第 3 2 2 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,330,000	
第 3 3 0 回北陸電力株式会社社債	200,000,000	194,750,000	
第 4 7 1 回東北電力株式会社社債	126,000,000	127,525,860	
第 4 9 6 回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,006,000	
第 5 0 8 回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,249,000	
第 5 2 1 回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,470,000	
第 5 2 7 回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,804,000	
第 5 3 5 回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,286,000	
第 3 0 9 回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,945,000	
第 3 1 4 回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,494,000	
第 4 4 9 回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,932,000	
第 4 6 5 回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,238,000	
第 4 6 8 回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,495,000	
第 4 8 4 回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,952,000	
第 4 8 9 回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,954,000	
第 4 9 4 回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,272,000	
第 3 2 6 回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,223,000	
第 3 4 0 回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,733,000	
第 3 5 0 回北海道電力株式会社社債	100,000,000	93,569,000	
第 4 4 回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	94,764,000	
第 5 0 回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,309,000	
第 5 7 回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,259,000	
第 7 7 回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,331,000	
第 3 1 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 3 9 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 4 1 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 4 2 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 4 4 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 4 5 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 4 8 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 J E R A 無担保社債	100,000,000	97,927,000	
第 6 4 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。

外国株式インデックス 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	
預金	15,534,493,418
コール・ローン	740,855,890
株式	502,363,912,613
投資信託受益証券	250,133,434
投資証券	11,727,638,811
派生商品評価勘定	1,128,585
未収入金	5,542,707
未収配当金	725,570,644
前払金	1,413,882,049
差入委託証拠金	2,153,911,940
流動資産合計	534,917,070,091
資産合計	534,917,070,091
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,437,195,000
未払解約金	4,038,355,356
未払利息	1,795
流動負債合計	5,475,552,151
負債合計	5,475,552,151
純資産の部	
元本等	
元本	128,335,928,077
剰余金	
剰余金又は欠損金()	401,105,589,863
元本等合計	529,441,517,940
純資産合計	529,441,517,940

	2022年 9月30日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	534,917,070,091

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	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2022年 9月30日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(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	128,335,928,077口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 4.1254円 (1万口当たり純資産額) (41,254円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2022年 9月30日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>

2022年 9月30日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>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。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>

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	<p>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。</p>
2.時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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	132,221,776,468円
期中追加設定元本額	17,674,411,219円
期中一部解約元本額	21,560,259,610円
期末元本額	128,335,928,077円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,868,056,097円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,478,216円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	32,904,969,778円
世界経済インデックスファンド	11,421,811,861円
外国株式インデックス・オープン	895,495,683円
D C マイセレクション 2 5	800,445,543円
D C マイセレクション 5 0	3,659,535,933円
D C マイセレクション 7 5	4,385,065,140円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,109,543,291円
D C マイセレクション S 2 5	408,442,032円
D C マイセレクション S 5 0	1,869,368,191円
D C マイセレクション S 7 5	1,617,713,118円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	35,826,168円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	151,221,153円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	112,896,349円
D C 世界経済インデックスファンド	10,040,369,203円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,376,172,531円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,323,750円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	4,636,187円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	26,248,637円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	11,930,148円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	43,891,764円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	10,773,665円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	29,355,694円

区分	2022年 9月30日現在
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	239,771,275円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	163,281,098円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,195,039,892円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	96,779,096円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	23,117,701円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	151,616,091円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	49,824,090円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	988,111,586円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,066,656,621円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,135,430,126円
コア投資戦略ファンド（安定型）	535,041,760円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,317,321,801円
分散投資コア戦略ファンドA	1,480,175,803円
分散投資コア戦略ファンドS	8,236,433,833円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,382,648,820円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,138,160,342円
コア投資戦略ファンド（切替型）	598,401,219円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	582,760,223円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	28,854,559円
SMT インデックスバランス・オープン	157,496,767円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	358,342,252円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	16,523,905,098円
SMT 世界経済インデックス・オープン	209,219,204円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	806,307,809円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	146,813,199円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,178,951円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	278,124,114円
グローバル経済コア	640,299,702円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,047,036円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,497,192円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	472,763,498円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	85,239,158円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	51,978,422円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	45,133,777円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	17,779,252円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	22,062,249円
10資産分散投資ファンド	18,092円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	256,118,091円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	175,741,559円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	853,287,746円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,314,457,047円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	216,416,050円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	84,904,553円

区分	2022年 9月30日現在
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	72,364,747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）	68,691,929円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	236,402,277円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	226,303,448円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	225,149,556円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	228,989,512円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	225,426,645円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	109,473,077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)
株式	69,493,741,143
投資信託受益証券	59,175,861
投資証券	2,944,311,291
合計	72,497,228,295

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	16,556,328,334	-	15,142,446,285	1,413,882,049
	合計	16,556,328,334	-	15,142,446,285	1,413,882,049

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2022年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	272,545,650	-	272,779,595	233,945
	アメリカドル	170,081,250	-	170,088,065	6,815
	カナダドル	52,658,000	-	52,884,500	226,500
	ユーロ	49,806,400	-	49,807,030	630
	売建	3,395,607,370	-	3,418,025,681	22,418,311
	アメリカドル	2,611,649,000	-	2,620,326,140	8,677,140
	カナダドル	148,022,000	-	148,076,600	54,600
	ユーロ	370,629,000	-	377,119,910	6,490,910
	イギリスポンド	184,137,820	-	190,786,176	6,648,356
	スイスフラン	81,169,550	-	81,716,855	547,305
合計		3,668,153,020	-	3,690,805,276	22,184,366

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	27,671	34.95	967,101.45	
	BAKER HUGHES CO	75,948	21.12	1,604,021.76	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	164.31	2,997,507.33	
	CHEVRON CORP	153,061	144.77	22,158,640.97	
	CONOCOPHILLIPS	105,873	103.66	10,974,795.18	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	25.97	1,662,080.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	60.97	3,064,108.32	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	120.91	1,604,112.97	
	EOG RESOURCES INC	47,936	112.97	5,415,329.92	
	EQT CORPORATION	27,026	39.53	1,068,337.78	
	EXXON MOBIL	343,717	88.68	30,480,823.56	
	HALLIBURTON CO	71,583	24.64	1,763,805.12	
	HESS CORP	22,781	109.14	2,486,318.34	

KINDER MORGAN INC	168,208	16.72	2,812,437.76
MARATHON OIL CORP	57,281	22.80	1,306,006.80
MARATHON PETROLEUM CORP	45,012	98.70	4,442,684.40
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	77,357	62.11	4,804,643.27
ONEOK INC	35,533	51.98	1,847,005.34
PHILLIPS 66	38,237	80.63	3,083,049.31
PIONEER NATURAL RESOURCES	18,998	216.50	4,113,067.00
SCHLUMBERGER	112,526	35.97	4,047,560.22
TARGA RESOURCES CORP	17,298	60.80	1,051,718.40
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,777.70	947,514.10
VALERO ENERGY CORP	32,597	107.24	3,495,702.28
WILLIAMS COS	98,553	28.96	2,854,094.88
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,324	231.76	4,246,770.24
ALBEMARLE CORP	9,440	265.44	2,505,753.60
ALCOA CORP	15,500	35.43	549,165.00
AMCOR PLC	126,534	10.75	1,360,240.50
AVERY DENNISON CORP	6,638	163.60	1,085,976.80
BALL CORP	25,605	47.65	1,220,078.25
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	89.21	765,600.22
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	97.06	1,604,110.62
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	13.77	592,110.00
CORTEVA INC	58,500	57.21	3,346,785.00
CROWN HOLDINGS INC	9,940	80.29	798,082.60
DOW INC	60,585	44.16	2,675,433.60
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	50.65	2,075,637.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	70.81	784,220.75
ECOLAB INC	21,208	145.92	3,094,671.36
FMC CORP	10,507	106.31	1,116,999.17
FREEMONT-MCMORAN INC	119,600	28.17	3,369,132.00
INT'L PAPER CO	30,800	32.09	988,372.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,024	91.58	1,925,377.92
LINDE PLC	41,106	269.61	11,082,588.66
LYONDELLBASELL INDU-CL A	21,835	74.81	1,633,476.35
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,192	322.41	1,673,952.72
MOSAIC CO/THE	27,732	48.39	1,341,951.48
NEWMONT CORPORATION	65,704	41.76	2,743,799.04
NUCOR CORP	22,299	105.29	2,347,861.71
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	114.22	878,009.14
PPG INDUSTRIES INC	19,278	111.61	2,151,617.58
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	84.02	878,513.12
SEALED AIR CORP	11,690	44.43	519,386.70
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	207.84	4,098,396.96

STEEL DYNAMICS INC	15,552	70.71	1,099,681.92
VULCAN MATERIALS CO	10,247	157.78	1,616,771.66
WESTLAKE CORP	4,100	85.27	349,607.00
WESTROCK CO	21,356	31.38	670,151.28
3 M COMPANY	46,618	112.30	5,235,201.40
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	43.04	473,655.20
ALLEGION PLC	7,601	89.27	678,541.27
AMETEK INC	19,255	113.28	2,181,206.40
BOEING CO	46,285	125.33	5,800,899.05
CARLISLE COS INC	4,378	280.41	1,227,634.98
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	35.62	2,427,787.96
CATERPILLAR	43,701	165.90	7,249,995.90
CUMMINS INC	11,214	204.59	2,294,272.26
DEERE&CO	23,765	341.00	8,103,865.00
DOVER CORP	12,041	117.90	1,419,633.90
EATON CORP	32,650	134.15	4,379,997.50
EMERSON ELECTRIC CO	48,687	74.20	3,612,575.40
FASTENAL CO	47,949	46.57	2,232,984.93
FORTIVE CORP	28,348	59.21	1,678,485.08
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	54.53	562,204.30
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	174.16	907,547.76
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	214.43	4,067,737.10
GENERAL ELECTRIC CO	89,763	62.73	5,630,832.99
GRAINGER (WW) INC	3,667	486.90	1,785,462.30
HEICO CORP	3,640	143.74	523,213.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	114.45	738,088.05
HONEYWELL INTL INC	55,841	170.07	9,496,878.87
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	30.94	977,518.36
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	223.33	786,568.26
IDEX CORP	5,916	200.25	1,184,679.00
ILLINOIS TOOL WORKS	25,708	183.88	4,727,187.04
INGERSOLL-RAND INC	31,562	43.69	1,378,943.78
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	51.50	654,050.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	49.47	2,804,404.83
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	209.35	3,283,445.40
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	222.51	562,060.26
LOCKHEED MARTIN CORP	19,579	389.79	7,631,698.41
MASCO CORP	19,462	47.28	920,163.36
NORDSON CORP	4,121	213.76	880,904.96
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,122	470.48	5,703,158.56
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	64.50	2,183,841.00
OWENS CORNING	8,642	78.21	675,890.82

PACCAR INC	28,106	84.87	2,385,356.22
PARKER HANNIFIN CORP	10,579	245.56	2,597,779.24
PENTAIR PLC	14,533	40.93	594,835.69
PLUG POWER INC	41,884	21.04	881,239.36
QUANTA SERVICES INC	11,465	127.93	1,466,717.45
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	121,485	82.34	10,003,074.90
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	215.78	1,963,166.44
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	37.71	521,453.88
SMITH (A.O.) CORP	9,016	48.73	439,349.68
SNAP-ON INC	4,000	202.76	811,040.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	77.21	972,691.58
TEXTRON	16,934	59.05	999,952.70
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	145.96	2,720,402.48
TRANSDIGM GROUP INC	4,347	530.40	2,305,648.80
UNITED RENTALS INC	6,022	270.15	1,626,843.30
WABTEC CORP	15,024	81.72	1,227,761.28
XYLEM INC	15,077	88.09	1,328,132.93
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	92.18	1,047,533.52
CINTAS CORP	7,423	389.55	2,891,629.65
CLARIVATE PLC	27,357	9.19	251,410.83
COPART INC	16,617	109.78	1,824,214.26
COSTAR GROUP INC	32,116	70.69	2,270,280.04
EQUIFAX INC	9,509	167.10	1,588,953.90
JACOBS SOLUTIONS INC	10,661	108.80	1,159,916.80
LEIDOS HOLDINGS	11,220	88.10	988,482.00
REPUBLIC SERVICES INC	18,296	137.45	2,514,785.20
ROBERT HALF INTL INC	9,566	76.00	727,016.00
ROLLINS INC	17,468	35.14	613,825.52
TRANSUNION	15,741	59.66	939,108.06
VERISK ANALYTICS INC	13,315	173.55	2,310,818.25
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	137.03	2,915,313.25
WASTE MANAGEMENT INC	33,891	161.91	5,487,291.81
AMERCO	734	508.74	373,415.16
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	98.73	1,014,648.21
CSX CORP	179,261	27.19	4,874,106.59
DELTA AIR LINES INC	14,609	28.44	415,479.96
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	90.47	1,291,187.84
FEDEX CORP	20,314	152.31	3,094,025.34
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	2.56	212,508.16
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	165.28	1,165,554.56
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,697	49.78	681,836.66
LYFT INC-A	21,288	13.48	286,962.24

NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	214.55	4,095,115.85
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	254.18	2,034,202.54
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	31.64	428,184.12
UBER TECHNOLOGIES INC	120,334	26.42	3,179,224.28
UNION PACIFIC CORP	51,838	199.20	10,326,129.60
UNITED PARCEL SERVICE B	59,627	165.32	9,857,535.64
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	23.04	165,312.00
APTIV PLC	22,415	80.45	1,803,286.75
BORGWARNER INC	19,781	31.67	626,464.27
FORD MOTOR COMPANY	321,972	11.47	3,693,018.84
GENERAL MOTORS CO	114,534	33.26	3,809,400.84
LEAR CORP	5,287	122.15	645,807.05
LUCID GROUP INC	31,234	14.19	443,210.46
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	26,935	32.31	870,269.85
TESLA INC	216,377	268.21	58,034,475.17
DR HORTON INC	27,764	68.36	1,897,947.04
GARMIN LTD	12,854	81.77	1,051,071.58
HASBRO INC	10,572	67.89	717,733.08
LENNAR CORP-CL A	20,844	74.97	1,562,674.68
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	300.22	2,793,547.10
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	91.99	382,954.37
NEWELL BRANDS INC	31,461	13.97	439,510.17
NIKE B	103,874	95.33	9,902,308.42
NVR INC	247	3,987.16	984,828.52
PULTE GROUP INC	21,609	38.14	824,167.26
VF CORP	25,718	30.75	790,828.50
WHIRLPOOL CORP	5,220	137.62	718,376.40
AIRBNB INC-CLASS A	31,141	106.66	3,321,499.06
ARAMARK	20,955	31.36	657,148.80
BOOKING HOLDINGS INC	3,339	1,678.92	5,605,913.88
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	32.42	569,295.20
CARNIVAL CORPORATION	84,361	9.16	772,746.76
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,303	1,543.35	3,554,335.05
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	129.32	1,385,275.84
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	316.35	900,964.80
EXPEDIA GROUP INC	11,638	94.21	1,096,415.98
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	121.86	2,666,053.08
LAS VEGAS SANDS CORP	29,096	38.53	1,121,068.88
MARRIOTT INTL A	22,091	140.51	3,104,006.41
MCDONALD'S CORP	60,458	234.40	14,171,355.20
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	29.99	865,931.26
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	43.64	731,711.88

STARBUCKS CORP	93,796	86.57	8,119,919.72
VAIL RESORTS INC	3,014	213.55	643,639.70
WYNN RESORTS LTD	9,302	64.35	598,583.70
YUM BRANDS INC	22,637	107.21	2,426,912.77
ACTIVISION BLIZZARD INC	64,558	74.87	4,833,457.46
ALPHABET INC-CL A	492,726	97.42	48,001,366.92
ALPHABET INC-CL C	460,933	98.09	45,212,917.97
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	7.10	271,859.00
CABLE ONE INC	445	897.41	399,347.45
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	312.59	3,066,195.31
COMCAST CORP-CL A	367,926	30.43	11,195,988.18
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	14.14	284,666.48
ELECTRONIC ARTS INC	23,158	117.47	2,720,370.26
FOX CORP - CLASS A	27,658	30.51	843,845.58
FOX CORP- CLASS B	10,345	28.37	293,487.65
IAC INC	6,721	56.47	379,534.87
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	25.65	867,842.10
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	76.22	858,846.96
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	57.35	881,985.65
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	37.43	508,449.12
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	37.78	241,187.52
LIVE NATION ENTERTAINMENT	14,491	75.26	1,090,592.66
MATCH GROUP INC	22,730	48.25	1,096,722.50
META PLATFORMS INC-CLASS A	187,450	136.41	25,570,054.50
NETFLIX INC	36,196	239.71	8,676,543.16
NEWS CORP-CLASS A	33,479	15.05	503,858.95
OMNICOM GROUP	16,538	63.46	1,049,501.48
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	18.95	920,704.70
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	23.19	1,061,336.73
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	35.38	992,727.42
ROKU INC	9,122	56.78	517,947.16
SEA LTD-ADR	28,338	53.63	1,519,766.94
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	5.78	349,505.04
SNAP INC - A	83,375	10.19	849,591.25
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	108.58	1,397,098.86
THE WALT DISNEY CO	149,471	97.45	14,565,948.95
TWITTER INC	54,209	42.74	2,316,892.66
WARNER BROS DISCOVERY INC	192,233	11.66	2,241,436.78
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	41.65	913,592.75
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	159.66	850,029.84
AMAZON.COM	749,309	114.80	86,020,673.20
AUTOZONE INC	1,639	2,159.02	3,538,633.78

BATH & BODY WORKS INC	19,806	33.63	666,075.78
BEST BUY COMPANY INC	18,175	65.08	1,182,829.00
BURLINGTON STORES INC	5,108	109.78	560,756.24
CARMAX INC	13,591	65.16	885,589.56
CHEWY INC - CLASS A	6,878	31.08	213,768.24
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	239.47	4,474,736.42
DOLLAR TREE INC	17,931	136.84	2,453,678.04
DOORDASH INC - A	15,171	49.84	756,122.64
EBAY	46,820	37.69	1,764,645.80
ETSY INC	10,294	101.52	1,045,046.88
GENUINE PARTS CO	11,319	149.70	1,694,454.30
HOME DEPOT	84,000	278.33	23,379,720.00
LKQ CORP	22,779	47.21	1,075,396.59
LOWES COMPANIES	52,525	190.46	10,003,911.50
MERCADOLIBRE INC	3,725	829.68	3,090,558.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	711.76	3,848,486.32
POOL CORP	3,304	315.78	1,043,337.12
ROSS STORES INC	28,076	84.03	2,359,226.28
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,926	151.79	5,756,787.54
TJX COMPANIES INC	97,454	61.34	5,977,828.36
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	187.49	1,672,785.78
ULTA BEAUTY INC	4,315	404.76	1,746,539.40
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	34.56	207,360.00
COSTCO WHOLESALE CORP	36,343	478.98	17,407,570.14
KROGER CO	56,126	44.68	2,507,709.68
SYSCO CORP	42,228	71.48	3,018,457.44
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	31.55	1,885,648.85
WALMART INC	124,048	132.25	16,405,348.00
ALTRIA GROUP INC	148,393	41.17	6,109,339.81
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	46,575	80.61	3,754,410.75
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	67.40	1,618,004.40
BUNGE LIMITED	11,604	82.24	954,312.96
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	47.01	746,001.69
COCA-COLA CO	337,769	56.57	19,107,592.33
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	43.01	662,095.94
CONAGRA BRANDS INC	40,304	33.26	1,340,511.04
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	233.67	3,023,689.80
GENERAL MILLS INC	49,534	77.71	3,849,287.14
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	223.80	2,689,852.20
HORMEL FOODS CORP	23,338	45.90	1,071,214.20
JM SMUCKER CO	9,145	139.00	1,271,155.00
KELLOGG CO	21,630	71.52	1,546,977.60

KEURIG DR PEPPER INC	62,155	36.12	2,245,038.60
KRAFT HEINZ CO/THE	58,511	33.56	1,963,629.16
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	73.51	1,528,272.90
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	48.17	706,605.73
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	113,286	56.67	6,419,917.62
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	88.01	2,839,818.67
PEPSICO INC	113,421	166.61	18,897,072.81
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	126,117	86.09	10,857,412.53
TYSON FOODS INC	23,306	66.85	1,558,006.10
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	72.92	1,410,710.32
CLOROX COMPANY	9,570	133.14	1,274,149.80
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,702	71.77	4,715,432.54
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,016	219.35	4,171,159.60
KIMBERLY-CLARK CORP	26,841	114.98	3,086,178.18
PROCTER & GAMBLE CO	196,677	128.70	25,312,329.90
ABBOTT LABORATORIES	143,383	98.29	14,093,115.07
ABIOMED INC	3,781	248.96	941,317.76
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	211.01	1,254,032.43
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	136.07	1,754,758.72
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	55.30	2,212,718.90
BECTON DICKINSON & CO	23,274	226.12	5,262,716.88
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,818	39.34	4,595,620.12
CARDINAL HEALTH	21,902	67.79	1,484,736.58
CENTENE CORP	48,335	77.68	3,754,662.80
CIGNA CORP	26,188	280.56	7,347,305.28
CVS HEALTH CORP	106,862	96.98	10,363,476.76
DAVITA INC	4,627	83.96	388,482.92
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	29.15	518,112.10
DEXCOM INC	32,658	82.10	2,681,221.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51,357	83.83	4,305,257.31
ELEVANCE HEALTH INC	19,661	456.79	8,980,948.19
HCA HEALTHCARE INC	19,440	187.68	3,648,499.20
HENRY SCHEIN INC	11,747	66.55	781,762.85
HOLOGIC INC	19,018	65.00	1,236,170.00
HUMANA INC	10,365	491.06	5,089,836.90
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	331.81	2,240,049.31
INSULET CORP	5,311	231.18	1,227,796.98
INTUITIVE SURGICAL INC	29,197	189.06	5,519,984.82
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	208.00	1,579,760.00
MASIMO CORP	4,147	142.42	590,615.74
MCKESSON CORP	12,089	342.00	4,134,438.00
MEDTRONIC PLC	109,343	82.27	8,995,648.61

MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	331.10	1,504,849.50
NOVOCURE LTD	7,933	77.05	611,237.65
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	124.62	1,246,823.10
RESMED INC	12,169	218.46	2,658,439.74
STERIS PLC	8,018	167.11	1,339,887.98
STRYKER CORP	28,067	205.48	5,767,207.16
TELADOC HEALTH INC	11,375	26.23	298,366.25
TELEFLEX INC	3,934	203.97	802,417.98
THE COOPER COS INC	4,134	269.40	1,113,699.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	76,869	508.83	39,113,253.27
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	90.49	552,169.98
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	164.81	1,854,936.55
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	107.12	1,744,020.72
ABBVIE INC	144,953	142.72	20,687,692.16
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	122.74	2,919,370.90
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	209.39	2,019,147.77
AMGEN	43,905	228.41	10,028,341.05
AVANTOR INC	48,633	20.20	982,386.60
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	418.24	774,998.72
BIO-TECHNE CORP	3,245	285.63	926,869.35
BIOGEN INC	11,860	264.28	3,134,360.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	85.06	1,257,441.98
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	173,351	71.71	12,431,000.21
CATALENT INC	13,739	74.28	1,020,532.92
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	190.01	798,802.04
DANAHER CORP	56,691	262.15	14,861,545.65
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	12.66	456,532.26
EXACT SCIENCES CORP	14,756	33.17	489,456.52
GILEAD SCIENCES INC	103,360	63.07	6,518,915.20
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	62.69	1,123,780.94
ILLUMINA INC	12,506	193.81	2,423,787.86
INCYTE CORP	15,212	66.61	1,013,271.32
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	181.61	2,747,032.86
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	132.42	658,259.82
JOHNSON & JOHNSON	215,641	164.53	35,479,413.73
LILLY (ELI) & CO	66,242	330.01	21,860,522.42
MERCK & CO	207,468	86.64	17,975,027.52
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,096.88	1,983,159.04
MODERNA INC	27,309	118.07	3,224,373.63
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	102.76	870,788.24
PERKINELMER INC	10,545	121.36	1,279,741.20
PFIZER	460,155	44.16	20,320,444.80

REGENERON PHARMACEUTICALS	8,915	691.82	6,167,575.30
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	40.33	1,053,742.24
SEAGEN INC	10,981	135.70	1,490,121.70
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	7.82	720,542.62
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,118	516.61	16,592,479.98
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,811	292.80	6,093,460.80
VIATRIS INC	90,748	8.60	780,432.80
WATERS CORP	4,749	274.56	1,303,885.44
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	251.27	1,449,074.09
ZOETIS INC	38,534	150.95	5,816,707.30
BANK OF AMERICA CORP	591,261	30.66	18,128,062.26
CITIGROUP	158,792	42.39	6,731,192.88
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	33.85	1,337,819.70
FIFTH THIRD BANCORP	57,420	32.05	1,840,311.00
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	790.76	751,222.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,984	132.68	1,988,077.12
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.17	1,502,855.04
JPMORGAN CHASE & CO	240,076	106.16	25,486,468.16
KEY CORP	71,472	16.03	1,145,696.16
M & T BANK CORP	14,929	174.84	2,610,186.36
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,513	150.73	5,202,144.49
REGIONS FINL CORP	79,314	19.87	1,575,969.18
SIGNATURE BANK	4,686	152.88	716,395.68
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	337.93	1,535,891.85
TRUIST FINANCIAL CORP	109,883	43.97	4,831,555.51
US BANCORP	116,467	40.73	4,743,700.91
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	45.18	644,854.14
WELLS FARGO & CO	310,526	40.50	12,576,303.00
ALLY FINANCIAL INC	27,761	28.53	792,021.33
AMERICAN EXPRESS	52,626	137.79	7,251,336.54
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	253.93	2,209,698.86
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	47.63	1,517,206.02
BANK NEW YORK CO	61,254	38.88	2,381,555.52
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,127	269.58	28,340,136.66
BLACKROCK INC	12,394	563.92	6,989,224.48
BLACKSTONE INC	57,841	84.46	4,885,250.86
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	93.68	3,115,422.08
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	26.24	411,154.56
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	117.73	1,044,853.75
CME GROUP INC	29,373	178.67	5,248,073.91
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	61.94	593,137.44
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	91.42	2,139,502.26

EQUITABLE HOLDINGS INC	34,355	26.72	917,965.60
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	396.86	1,249,315.28
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	22.20	578,754.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	36.40	157,102.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,241	296.11	8,362,442.51
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	90.75	4,056,797.25
INVESCO LTD	26,420	14.13	373,314.60
KKR & CO INC	44,282	43.30	1,917,410.60
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	216.47	1,382,377.42
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	224.60	720,292.20
MOODY'S CORP	13,365	246.56	3,295,274.40
MORGAN STANLEY	107,356	79.86	8,573,450.16
MSCI INC	6,518	423.22	2,758,547.96
NASDAQ INC	28,971	57.11	1,654,533.81
NORTHERN TRUST CORP	15,902	86.27	1,371,865.54
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	107.39	1,923,032.73
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	98.28	1,521,964.08
S&P GLOBAL INC	28,338	310.43	8,796,965.34
SCHWAB (CHARLES) CORP	118,155	72.64	8,582,779.20
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	50.56	482,848.00
STATE STREET CORP	30,359	61.72	1,873,757.48
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	28.84	1,198,763.44
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	57.68	522,638.48
AFLAC	50,591	56.58	2,862,438.78
ALLEGHANY CORP	1,080	840.62	907,869.60
ALLSTATE CORP	22,174	126.13	2,796,806.62
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	123.26	778,879.94
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	47.66	3,140,698.68
AON PLC	17,038	270.95	4,616,446.10
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	45.83	1,362,342.58
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,431	171.14	2,983,141.34
ASSURANT INC	4,726	147.75	698,266.50
BROWN & BROWN INC	19,873	60.89	1,210,066.97
CHUBB LTD	34,810	183.78	6,397,381.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	91.85	1,174,853.35
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	219.95	476,411.70
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	267.50	879,540.00
FNF GROUP	20,461	36.26	741,915.86
GLOBE LIFE INC	8,106	100.24	812,545.44
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	62.65	1,736,720.65
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	44.51	600,172.84
LOEWS CORP	16,741	50.77	849,940.57

MARKEL CORP	1,156	1,101.49	1,273,322.44
MARSH & MCLENNAN COS	41,045	150.65	6,183,429.25
METLIFE INC	57,127	61.07	3,488,745.89
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	71.42	1,479,750.98
PROGRESSIVE CORP	48,534	118.39	5,745,940.26
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,146	86.30	2,687,899.80
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	154.68	3,058,332.96
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,385	202.28	1,898,397.80
WR BERKLEY CORP	17,572	65.18	1,145,342.96
CBRE GROUP INC-A	27,714	67.79	1,878,732.06
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.45	439,215.00
WEYERHAEUSER CO	64,295	27.75	1,784,186.25
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	29.21	392,202.67
ACCENTURE PLC-CL A	51,987	258.27	13,426,682.49
ADOBE INC	38,782	278.25	10,791,091.50
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	19.06	244,272.96
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	80.50	1,100,676.50
ANSYS INC	6,794	227.53	1,545,838.82
APPLOVIN CORP-CLASS A	10,000	19.68	196,800.00
AUTODESK INC	17,467	189.46	3,309,297.82
AUTOMATIC DATA PROCESS	34,246	227.75	7,799,526.50
AVALARA INC	6,847	91.73	628,075.31
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	31.28	437,794.88
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	135.22	1,006,442.46
BLACK KNIGHT INC	11,543	65.65	757,797.95
BLOCK INC	41,288	55.90	2,307,999.20
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	146.90	1,431,099.80
CADENCE DESIGN SYSTEMS	22,740	164.69	3,745,050.60
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	56.60	603,808.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	112.88	917,037.12
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	103.90	1,085,131.60
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	54.85	1,112,522.55
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,220	58.45	2,526,209.00
COUPA SOFTWARE INC	6,059	60.63	367,357.17
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,831	165.70	2,788,896.70
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	149.16	462,396.00
DATADOG INC - CLASS A	20,137	87.45	1,760,980.65
DOCUSIGN INC	14,969	55.20	826,288.80
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	20.53	473,586.04
DYNATRACE INC	14,790	34.60	511,734.00
EPAM SYSTEMS INC	4,779	362.14	1,730,667.06
FAIR ISAAC CORP	2,125	424.84	902,785.00

FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	49,912	76.57	3,821,761.84
FISERV INC	49,921	94.85	4,735,006.85
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	181.09	1,086,902.18
FORTINET INC	56,318	49.63	2,795,062.34
GARTNER INC	6,340	278.67	1,766,767.80
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	109.54	2,471,989.18
GODADDY INC - CLASS A	13,798	72.09	994,697.82
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	62.66	395,885.88
HUBSPOT INC	3,646	274.35	1,000,280.10
INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,262	121.63	8,910,857.06
INTUIT INC	21,909	396.81	8,693,710.29
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	183.04	1,151,504.64
MASTERCARD INC-CLASS A	70,879	286.77	20,325,970.83
MICROSOFT CORP	581,193	237.50	138,033,337.50
MONGODB INC	5,325	194.82	1,037,416.50
NORTONLIFELOCK INC	43,549	20.37	887,093.13
OKTA INC	11,505	56.80	653,484.00
ORACLE CORP	130,499	61.40	8,012,638.60
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	8.08	1,011,971.52
PALO ALTO NETWORKS INC	24,237	165.58	4,013,162.46
PAYCHEX INC	26,693	113.39	3,026,719.27
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	334.43	1,416,311.05
PAYPAL HOLDINGS INC	90,208	88.70	8,001,449.60
PTC INC	9,804	105.67	1,035,988.68
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	40.49	258,852.57
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,672	366.75	3,180,456.00
SALESFORCE INC	81,603	146.81	11,980,136.43
SERVICENOW INC	16,309	385.50	6,287,119.50
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	170.34	3,011,611.20
SPLUNK INC	13,355	77.80	1,039,019.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	48.50	937,747.50
SYNOPSYS INC	12,539	309.22	3,877,309.58
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	60.80	2,229,596.80
TWILIO INC - A	12,842	70.59	906,516.78
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	347.70	1,160,970.30
UNITY SOFTWARE INC	16,329	31.77	518,772.33
VERISIGN INC	7,790	176.17	1,372,364.30
VISA INC-CLASS A SHARES	134,653	180.06	24,245,619.18
VMWARE INC-CLASS A	16,717	107.48	1,796,743.16
WESTERN UNION CO	29,297	13.56	397,267.32
WIX.COM LTD	5,010	80.41	402,854.10
WORKDAY INC-CLASS A	16,567	156.26	2,588,759.42

ZENDESK INC	8,890	76.34	678,662.60
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19,002	74.47	1,415,078.94
ZSCALER INC	7,204	165.89	1,195,071.56
AMPHENOL CORPORATION	47,707	67.92	3,240,259.44
APPLE INC	1,323,830	142.48	188,619,298.40
ARISTA NETWORKS INC	20,350	114.75	2,335,162.50
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	93.03	567,483.00
CDW CORP/DE	10,882	158.97	1,729,911.54
CISCO SYSTEMS	337,789	40.57	13,704,099.73
COGNEX CORP	14,352	42.17	605,223.84
CORNING	64,989	29.62	1,924,974.18
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	34.19	768,625.39
F5 INC	4,851	146.81	712,175.31
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,530	12.12	1,327,503.60
HP INC	83,910	25.04	2,101,106.40
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	26.11	661,131.31
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	158.82	2,380,552.98
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,836	225.30	3,117,250.80
NETAPP INC	18,303	62.94	1,151,990.82
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	54.38	901,783.54
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	112.54	2,933,692.72
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	344.18	1,341,957.82
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	55.26	1,170,185.76
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	32.18	829,922.20
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	265.52	1,105,094.24
AT&T INC	581,626	15.53	9,032,651.78
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	15.80	245,152.80
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	16.74	460,132.38
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	7.38	544,415.22
T-MOBILE US INC	50,968	134.64	6,862,331.52
VERIZON COMMUNICATIONS	344,746	38.64	13,320,985.44
AES CORP	54,375	22.75	1,237,031.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	54.54	1,133,232.12
AMEREN CORPORATION	20,898	82.49	1,723,876.02
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,467	89.07	3,782,535.69
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,165	133.20	2,019,978.00
ATMOS ENERGY CORP	10,802	104.66	1,130,537.32
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	28.84	1,388,992.08
CMS ENERGY CORP	23,697	59.73	1,415,421.81
CONSOLIDATED EDISON INC	29,197	87.66	2,559,409.02
CONSTELLATION ENERGY	25,732	83.04	2,136,785.28
DOMINION ENERGY INC	66,909	71.06	4,754,553.54

DTE ENERGY COMPANY	15,851	118.22	1,873,905.22
DUKE ENERGY CORP	62,802	95.10	5,972,470.20
EDISON INTL	30,339	57.46	1,743,278.94
ENERGY CORP	16,181	102.63	1,660,656.03
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	42.33	863,489.67
EVERGY INC	18,475	60.49	1,117,552.75
EVERSOURCE ENERGY	28,450	79.58	2,264,051.00
EXELON CORP	81,218	37.75	3,065,979.50
FIRSTENERGY CORP	45,165	37.18	1,679,234.70
NEXTERA ENERGY INC	159,643	79.97	12,766,650.71
NISOURCE INC	32,351	25.97	840,155.47
NRG ENERGY INC	19,068	39.18	747,084.24
PG&E CORP	118,132	12.38	1,462,474.16
PPL CORPORATION	58,459	25.95	1,517,011.05
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	56.92	2,246,518.56
SEMPRA ENERGY	25,885	151.48	3,921,059.80
SOUTHERN CO	86,558	69.38	6,005,394.04
UGI CORP	18,019	32.93	593,365.67
VISTRA CORP	31,797	21.38	679,819.86
WEC ENERGY GROUP INC	26,033	91.81	2,390,089.73
XCEL ENERGY INC	43,741	65.36	2,858,911.76
ADVANCED MICRO DEVICES	132,978	64.14	8,529,208.92
ANALOG DEVICES	42,691	141.99	6,061,695.09
APPLIED MATERIALS	72,040	84.42	6,081,616.80
BROADCOM INC	32,989	450.13	14,849,338.57
ENPHASE ENERGY INC	11,020	277.84	3,061,796.80
ENTEGRIS INC	12,483	87.85	1,096,631.55
INTEL CORP	336,001	26.38	8,863,706.38
KLA CORP	12,119	310.71	3,765,494.49
LAM RESEARCH CORP	11,398	370.55	4,223,528.90
MARVELL TECHNOLOGY INC	70,444	42.87	3,019,934.28
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	61.99	2,745,475.11
MICRON TECHNOLOGY	91,511	50.01	4,576,465.11
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	365.40	1,290,227.40
NVIDIA CORP	205,210	122.20	25,076,662.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	21,751	151.01	3,284,618.51
ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	62.94	2,169,415.92
QORVO INC	8,556	81.79	699,795.24
QUALCOMM	91,671	114.84	10,527,497.64
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	89.26	1,193,584.72
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	4,864	235.56	1,145,763.84
TERADYNE INC	12,318	77.17	950,580.06

	TEXAS INSTRUMENTS	75,121	158.45	11,902,922.45	
	アメリカドル 小計	27,890,400		2,584,468,786.47 (374,256,924,968)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	16.59	910,127.40	
	CAMECO CORP	31,793	36.88	1,172,525.84	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,374	64.10	6,177,573.40	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	21.34	2,374,992.62	
	ENBRIDGE	165,402	51.68	8,547,975.36	
	IMPERIAL OIL	20,285	60.54	1,228,053.90	
	KEYERA CORP	18,607	28.41	528,624.87	
	PARKLAND CORP	14,075	29.25	411,693.75	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	42.29	1,931,215.14	
	SUNCOR ENERGY	116,208	38.81	4,510,032.48	
	TC ENERGY CORP	81,350	56.47	4,593,834.50	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	72.87	1,822,405.83	
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	56.75	2,063,089.50	
	BARRICK GOLD CORP	139,009	20.68	2,874,706.12	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	64.54	847,991.06	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	22.96	987,280.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	161.81	2,485,887.03	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	8.52	441,736.44	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	4.93	534,663.43	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	6.97	433,833.71	
	NUTRIEN LTD	44,786	114.47	5,126,653.42	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	21.41	394,179.51	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,179	41.96	1,685,910.84	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	98.25	599,325.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	43.46	1,487,983.48	
	CAE INC	25,999	21.61	561,838.39	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	96.21	729,752.85	
	WSP GLOBAL INC	9,951	151.39	1,506,481.89	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	35.23	475,781.15	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	87.66	898,076.70	
	THOMSON REUTERS CORP	13,293	142.08	1,888,669.44	
	AIR CANADA	13,805	16.75	231,233.75	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	48,612	150.61	7,321,453.32	
	CP RAILWAY LIMITED	75,991	93.96	7,140,114.36	
	TFI INTERNATIONAL INC	5,837	128.99	752,914.63	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	66.41	1,546,157.62	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	86.95	266,936.50	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	39.39	672,741.81	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	74.50	1,718,938.50	

QUEBECOR INC -CL B	15,200	25.58	388,816.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	33.71	1,194,075.62
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	147.21	664,358.73
DOLLARAMA INC	22,000	79.01	1,738,220.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	56.54	3,814,584.18
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	34.77	530,346.81
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	111.27	1,436,829.51
METRO INC	18,840	69.76	1,314,278.40
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	146.80	767,176.80
SAPUTO INC	20,898	33.06	690,887.88
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	9.51	197,808.00
BANK MONTREAL	55,487	121.25	6,727,798.75
BANK NOVA SCOTIA	99,336	66.09	6,565,116.24
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,829	60.47	4,343,499.63
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	86.09	2,349,310.01
ROYAL BANK OF CANADA	115,288	124.43	14,345,285.84
TORONTO-DOMINION BANK	148,462	84.96	12,613,331.52
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	116,005	55.75	6,467,278.75
IGM FINANCIAL INC	7,685	33.96	260,982.60
ONEX CORP	6,603	62.76	414,404.28
TMX GROUP LTD	4,685	125.06	585,906.10
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	632.23	1,348,546.59
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	29.84	709,833.92
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	69.67	703,597.33
INTACT FINANCIAL CORP	15,012	200.11	3,004,051.32
MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	21.55	3,335,465.90
POWER CORP OF CANADA	43,577	31.23	1,360,909.71
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	55.02	2,514,524.04
FIRSTSERVICE CORP	2,690	161.71	434,999.90
BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.59	259,646.00
CGI INC - CL A	18,300	103.12	1,887,096.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	1,931.50	3,098,126.00
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	24.70	204,911.20
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	37.61	161,760.61
OPEN TEXT CORP	20,463	36.98	756,721.74
SHOPIFY INC - CLASS A	92,560	36.68	3,395,100.80
BCE INC	6,203	58.70	364,116.10
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,196	53.09	1,603,105.64
TELUS CORP	32,908	27.71	911,880.68
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	15.16	785,560.88
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	26.48	645,979.60
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	44.20	499,239.00

	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	36.38	375,587.12
	EMERA INC	23,223	55.99	1,300,255.77
	FORTIS INC	40,183	53.02	2,130,502.66
	HYDRO ONE LTD	28,888	33.59	970,347.92
	NORTHLAND POWER INC	17,854	40.48	722,729.92
	カナダドル 小計	3,336,560		180,778,277.54 (19,126,341,763)
ユーロ	ENI	212,616	10.80	2,296,678.03
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	9.63	381,945.06
	NESTE OIL OYJ	36,735	43.85	1,610,829.75
	OMV AG	12,549	37.01	464,438.49
	REPSOL SA	111,112	11.73	1,303,899.32
	TENARIS SA	40,648	13.24	538,179.52
	TOTALENERGIES SE	203,322	47.30	9,618,147.21
	AIR LIQUIDE	43,239	115.70	5,002,752.30
	AKZO NOBEL	15,301	56.80	869,096.80
	ARCELORMITTAL	48,641	20.14	979,629.74
	ARKEMA	4,369	71.90	314,131.10
	BASF SE	73,837	38.85	2,868,567.45
	COVESTRO AG	14,454	28.85	416,997.90
	CRH PLC	65,449	32.21	2,108,439.53
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.02	273,029.92
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	39.60	516,423.60
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	114.35	1,567,395.45
	OCI NV	12,000	37.00	444,000.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	28.37	553,328.48
	SOLVAY SA	5,356	78.00	417,768.00
	STORA ENSO OYJ R	42,169	12.79	539,341.51
	SYMRISE AG	11,830	97.56	1,154,134.80
	UMICORE	17,605	29.47	518,819.35
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	31.58	1,336,591.92
	VOESTALPINE AG	7,152	17.32	123,872.64
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,552	22.61	509,900.72
	AIRBUS SE	49,560	88.09	4,365,740.40
	ALSTOM	24,388	16.20	395,207.54
	BOUYGUES ORD	16,606	26.53	440,557.18
	BRENTAG SE	12,514	61.04	763,854.56
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	11.38	922,481.01
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	22.69	757,740.66
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	117.00	249,210.00
	EIFFAGE	5,924	80.90	479,251.60
	FERROVIAL SA	43,631	23.16	1,010,493.96

GEA GROUP AG	13,382	32.21	431,034.22
IMCD NV	4,641	118.00	547,638.00
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	44.10	546,751.80
KION GROUP AG	5,887	19.31	113,677.97
KNORR-BREMSE AG	5,022	42.88	215,343.36
KONE OYJ-B	26,311	38.65	1,016,920.15
LEGRAND SA	21,768	64.96	1,414,049.28
MTU AERO ENGINES AG	3,962	153.20	606,978.40
PRYSMIAN SPA	21,155	28.31	598,898.05
RATIONAL AG	483	484.20	233,868.60
RHEINMETALL AG	3,660	162.10	593,286.00
SAFRAN SA	28,774	93.01	2,676,269.74
SAINT-GOBAIN	40,093	35.59	1,427,110.33
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,670	114.16	5,099,527.20
SIEMENS	63,788	98.26	6,267,808.88
SIEMENS ENERGY AG	36,841	11.32	417,040.12
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	17.92	402,147.37
THALES SA	8,524	113.55	967,900.20
VINCI S.A.	44,993	82.61	3,716,871.73
WARTSILA OYJ	41,917	6.88	288,556.62
BUREAU VERITAS SA	25,073	22.50	564,142.50
RANDSTAD NV	10,558	42.92	453,149.36
TELEPERFORMANCE	4,734	249.60	1,181,606.40
WOLTERS KLUWER	20,839	98.76	2,058,059.64
ADP	2,382	121.25	288,817.50
AENA SME SA	5,508	107.00	589,356.00
ATLANTIA SPA	43,726	22.62	989,082.12
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	5.81	263,760.23
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	30.46	2,398,022.01
GETLINK	35,220	15.80	556,476.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	69.13	1,804,776.91
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	65.40	326,411.40
CONTINENTAL AG	8,168	44.77	365,681.36
FERRARI NV	10,170	190.05	1,932,808.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	64,434	52.43	3,378,274.62
MICHELIN	55,356	22.45	1,242,742.20
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	60.48	710,337.60
RENAULT SA	17,362	27.37	475,197.94
STELLANTIS NV	175,794	12.21	2,147,147.91
VALEO SA	16,596	15.24	253,006.02
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,874	128.46	2,039,174.04
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	174.70	434,304.20

ADIDAS AG	13,972	124.02	1,732,807.44
ESSILORLUXOTTICA	22,910	141.00	3,230,310.00
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,207.50	3,065,842.50
KERING	6,271	455.05	2,853,618.55
LVMH	22,668	608.00	13,782,144.00
MONCLER SPA	19,057	42.19	804,014.83
PUMA SE	9,220	50.88	469,113.60
SEB SA	2,282	64.10	146,276.20
ACCOR	14,436	21.44	309,507.84
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	112.20	1,463,985.60
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	30.13	244,294.04
SODEXO	6,027	76.60	461,668.20
BOLLORE SE	83,646	4.62	387,113.68
PUBLICIS GROUPE	17,077	47.21	806,205.17
SCOUT24 SE	7,492	50.24	376,398.08
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	28.36	200,533.56
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	18.69	1,144,876.64
VIVENDI SE	61,243	7.76	475,735.62
D' IETEREN GROUP	2,217	138.60	307,276.20
DELIVERY HERO SE	13,414	36.04	483,440.56
INDITEX	87,326	21.00	1,833,846.00
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	15.40	239,902.23
PROSUS	66,706	52.74	3,518,074.44
ZALANDO SE	17,664	19.41	342,946.56
CARREFOUR	52,544	14.01	736,404.16
HELLOFRESH SE	13,805	21.18	292,389.90
JERONIMO MARTINS	24,901	19.35	481,834.35
KESKO OYJ-B SHS	20,083	18.72	375,953.76
KONINKLIJKE AHOLD NV	86,170	26.01	2,241,281.70
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,659	46.35	3,368,107.94
DANONE (GROUPE)	51,543	48.18	2,483,341.74
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	8.93	438,355.76
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	69.80	645,719.80
HEINEKEN NV	20,157	89.36	1,801,229.52
JDE PEET'S BV	7,000	29.60	207,200.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	90.08	1,175,544.00
PERNOD-RICARD	16,694	184.35	3,077,538.90
REMY COINTREAU	1,382	167.50	231,485.00
BEIERSDORF AG	7,430	100.20	744,486.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	57.45	504,411.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	60.36	871,538.04
LOREAL	19,843	323.35	6,416,234.05

AMPLIFON SPA	11,650	26.06	303,599.00
BIOMERIEUX	3,044	79.66	242,485.04
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	103.15	353,804.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	111.60	231,012.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	28.41	482,543.85
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	21.22	714,880.58
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	15.64	1,122,391.71
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	42.01	906,029.67
ARGENX SE	4,713	366.00	1,724,958.00
BAYER	78,757	47.72	3,758,284.04
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	58.98	602,775.60
GRIFOLS SA	27,685	8.83	244,569.29
IPSEN	3,532	93.55	330,418.60
MERCK KGAA	10,555	163.60	1,726,798.00
ORION OYJ-CLASS B	9,854	42.16	415,444.64
QIAGEN N.V.	17,038	42.20	719,003.60
RECORDATI SPA	9,859	36.74	362,219.66
SANOFI	93,369	77.84	7,267,842.96
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	347.60	634,022.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,539	308.20	782,519.80
UCB (GROUPE)	9,389	71.12	667,745.68
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	8.96	357,851.84
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.55	2,434,977.46
BANCO SANTANDER SA	1,393,640	2.38	3,318,953.66
BNP PARIBAS	92,730	42.53	3,944,270.55
CAIXABANK	330,447	3.30	1,090,805.54
COMMERZBANK AG	81,889	7.17	587,307.90
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	8.19	814,917.88
ERSTE GROUP BANK AG	31,905	22.22	708,929.10
FINECOBANK SPA	53,120	12.28	652,313.60
ING GROEP NV-CVA	324,888	8.61	2,798,910.12
INTESA SANPAOLO	1,322,943	1.65	2,189,470.66
KBC GROEP NV	18,608	49.04	912,536.32
MEDIOBANCA	53,990	7.61	410,971.88
SOCIETE GENERALE	63,329	20.12	1,274,496.12
UNICREDIT SPA	168,352	10.19	1,715,506.88
AMUNDI SA	4,626	41.14	190,313.64
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	7.59	1,219,695.12
DEUTSCHE BOERSE	14,999	167.90	2,518,332.10
EURAZEO SA	3,357	52.65	176,746.05
EURONEXT NV	6,480	64.36	417,052.80
EXOR NV	7,825	64.00	500,800.00

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	70.60	601,159.00
SOFINA	1,238	176.70	218,754.60
WENDEL	2,023	71.65	144,947.95
AEGON	148,741	4.06	604,334.68
AGEAS	11,086	36.94	409,516.84
ALLIANZ SE-REG	34,133	159.62	5,448,309.46
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	13.84	1,185,644.26
AXA SA	154,335	22.34	3,448,615.57
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	153.00	662,949.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,889	245.50	2,918,749.50
NN GROUP NV	22,611	39.21	886,577.31
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.65	352,536.03
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	43.40	1,677,627.00
AROUNDTOWN SA	64,068	2.18	140,052.64
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	58.78	310,064.50
VONOVIA SE	59,080	21.03	1,242,452.40
ADYEN NV	1,746	1,240.60	2,166,087.60
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	45.79	1,629,391.36
BECHTLE AG	7,659	35.45	271,511.55
CAPGEMINI SA	13,877	159.65	2,215,463.05
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	34.23	1,806,478.24
EDENRED	22,564	46.90	1,058,251.60
NEMETSCHKE SE	5,455	47.36	258,348.80
NEXI SPA	48,458	8.06	390,668.39
SAP SE	85,927	81.87	7,034,843.49
WORLDLINE SA	20,332	39.23	797,624.36
NOKIA OYJ	427,600	4.36	1,866,046.40
CELLNEX TELECOM SA	46,824	31.10	1,456,226.40
DEUTSCHE TELEKOM	271,698	17.63	4,792,209.32
ELISA A	10,227	47.86	489,464.22
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	8.84	268,575.75
KPN (KON.)	282,927	2.78	786,819.98
ORANGE	153,815	9.29	1,430,171.87
PROXIMUS	13,141	10.58	139,031.78
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.18	155,675.99
TELEFONICA	431,420	3.34	1,443,099.90
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.05	202,760.61
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	19.04	181,175.08
ACCIONA SA	2,181	178.70	389,744.70
E.ON SE	195,549	7.92	1,549,139.17
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	20.92	449,068.72
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.91	470,695.11

	ELIA GROUP SA/NV	3,125	121.70	380,312.50
	ENAGAS	21,663	16.02	347,149.57
	ENDESA	25,972	15.70	407,760.40
	ENEL	650,125	4.24	2,761,731.00
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.46	1,008,890.15
	ENGIE	158,924	11.87	1,887,063.57
	FORTUM OYJ	32,550	13.14	427,707.00
	IBERDROLA SA	477,647	9.62	4,597,830.02
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	23.77	237,937.70
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	15.90	487,780.20
	RWE STAMM	55,432	38.09	2,111,404.88
	SNAM SPA	147,559	4.19	619,010.00
	TERNA SPA	102,810	6.27	644,618.70
	UNIPER SE	7,335	3.92	28,767.87
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	19.17	978,187.59
	VERBUND AG	6,430	86.75	557,802.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,995	233.45	932,632.75
	ASML HOLDING NV	33,358	431.90	14,407,320.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	110,035	22.29	2,453,230.32
	STMICROELECTRONICS	55,076	31.79	1,750,866.04
	ユーロ 小計	14,956,835		305,727,250.12 (43,511,102,237)
イギリスポンド	BP PLC	1,596,790	4.32	6,898,931.19
	SHELL PLC-NEW	608,239	22.41	13,633,677.18
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	27.60	2,819,505.60
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	11.01	394,953.84
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	63.16	689,959.84
	GLENCORE PLC	817,868	4.86	3,980,972.49
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	18.21	306,886.32
	MONDI PLC	36,710	13.55	497,604.05
	RIO TINTO PLC REG	94,110	48.94	4,605,743.40
	ASHTREAD GROUP PLC	37,687	39.94	1,505,218.78
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	8.25	2,145,858.00
	BUNZL PLC	24,880	27.47	683,453.60
	DCC PLC	6,622	46.23	306,135.06
	FERGUSON PLC	17,761	95.44	1,695,109.84
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	0.99	316,771.09
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.68	434,071.48
	SMITHS GROUP PLC	26,476	14.77	391,182.90
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	102.60	565,736.40
	EXPERIAN PLC	74,115	26.39	1,955,894.85
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	36.88	512,263.20

RELX PLC	154,242	21.98	3,390,239.16
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	4.73	665,734.72
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	3.23	236,735.26
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	31.65	243,325.20
BURBERRY GROUP PLC	29,776	17.34	516,315.84
PERSIMMON PLC	25,686	11.75	301,810.50
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	0.85	224,699.68
COMPASS GROUP PLC	142,427	18.09	2,576,504.43
ENTAIN PLC	49,630	10.97	544,441.10
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	43.70	647,240.70
WHITBREAD PLC	17,434	22.85	398,366.90
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	4.95	358,759.36
INFORMA PLC	110,598	5.06	560,289.46
PEARSON	55,305	8.38	463,787.73
MPP PLC	95,821	7.31	701,218.07
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	0.99	206,618.17
KINGFISHER PLC	153,717	2.15	331,260.13
NEXT PLC	11,468	46.74	536,014.32
OCADO GROUP PLC	54,753	4.69	256,955.82
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.72	255,581.20
TESCO PLC	601,050	2.00	1,203,903.15
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	12.37	318,403.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	178,799	32.69	5,845,833.30
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	18.56	333,337.60
DIAGEO	189,615	37.82	7,171,239.30
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	18.77	1,428,021.60
HALEON PLC	405,046	2.80	1,134,331.32
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,052	61.24	3,677,584.48
UNILEVER PLC	209,465	40.80	8,547,219.32
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.23	702,069.82
ASTRAZENECA	126,291	99.33	12,544,485.03
GSK PLC	334,172	13.15	4,397,035.17
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	13.49	222,046.73
BARCLAYS	1,339,545	1.44	1,937,785.79
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,655,458	4.67	7,730,988.86
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,667,831	0.40	2,307,657.39
NATWEST GROUP PLC	412,008	2.21	910,949.68
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.56	1,182,899.32
3I GROUP PLC	74,757	10.79	807,001.81
ABRDN PLC	153,430	1.34	205,826.34
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.33	275,812.70
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	75.98	1,998,046.06

	M&G PLC	229,107	1.59	366,456.64
	SCHRODERS PLC	69,376	3.87	269,109.50
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	9.94	407,211.43
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	19.31	313,965.32
	AVIVA PLC	225,378	3.78	851,928.84
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.12	979,112.87
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.12	261,125.12
	PRUDENTIAL	230,270	8.62	1,985,848.48
	AVEVA GROUP PLC	10,917	31.45	343,339.65
	SAGE GROUP PLC	76,660	6.92	531,100.48
	HALMA PLC	31,069	20.11	624,797.59
	BT GROUP PLC	557,358	1.21	677,189.97
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.01	2,245,313.32
	NATIONAL GRID PLC	302,035	9.37	2,831,276.09
	SEVERN TRENT PLC	22,468	23.38	525,301.84
	SSE PLC	90,604	15.13	1,371,291.54
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	8.83	517,495.72
	イギリスポンド 小計	23,132,687		137,740,169.83 (22,275,340,264)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	14.85	258,360.30
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	609.00	349,566.00
	GIVAUDAN-REG	748	2,920.00	2,184,160.00
	HOLCIM LTD	44,847	40.01	1,794,328.47
	SIG GROUP AG	26,203	19.56	512,530.68
	SIKA AG-BR	11,714	193.05	2,261,387.70
	ABB LTD	137,175	25.35	3,477,386.25
	GEBERIT AG-REG	2,964	411.50	1,219,686.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	147.60	302,284.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	152.85	472,612.20
	VAT GROUP AG	1,956	199.80	390,808.80
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	26.64	278,388.00
	SGS SA	506	2,077.00	1,050,962.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	202.50	926,842.50
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,318	92.92	4,025,108.56
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	222.90	553,460.70
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	41.52	163,505.76
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,829.00	512,120.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	95,900.00	767,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,310.00	763,420.00
	NESTLE SA - REGISTERED	230,976	106.56	24,612,802.56
	ALCON INC	42,458	55.44	2,353,871.52
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,686	211.80	992,494.80

	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	86.02	734,610.80	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	58.70	108,595.00	
	LONZA GROUP AG-REG	6,283	468.30	2,942,328.90	
	NOVARTIS	177,027	74.92	13,262,862.84	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	386.60	856,319.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,316	320.25	18,355,449.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	3.82	816,677.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	42.35	800,287.95	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	775.20	1,420,941.60	
	UBS GROUP AG	281,888	14.36	4,047,911.68	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	125.50	398,337.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	429.00	1,037,751.00	
	SWISS RE LTD	24,445	72.28	1,766,884.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,554	395.50	4,965,107.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	76.90	436,715.10	
	TEMENOS AG - REG	5,150	64.32	331,248.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	44.91	659,548.26	
	SWISSCOM	2,187	466.90	1,021,110.30	
	スイスフラン 小計	1,431,967		104,185,972.63 (15,479,951,813)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	341.00	7,587,932.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	414.30	4,143,000.00	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	138.40	6,073,960.80	
	ALFA LAVAL AB	27,268	270.60	7,378,720.80	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	206.00	16,100,548.00	
	ATLAS COPCO A	227,097	102.22	23,213,855.34	
	ATLAS COPCO B	127,608	91.59	11,687,616.72	
	EPIROC AB-A	53,479	155.65	8,324,006.35	
	EPIROC AB-B	28,804	137.60	3,963,430.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	61.06	2,363,754.72	
	INDUTRADE AB	22,644	176.05	3,986,476.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	179.50	2,513,359.00	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	150.15	2,698,195.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	98.02	12,041,560.96	
	SANDVIK AB	87,644	147.30	12,909,961.20	
	SKANSKA B	25,507	134.40	3,428,140.80	
	SKF AB-B	37,718	147.55	5,565,290.90	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	161.80	2,186,565.20	
	VOLVO B	121,238	155.28	18,825,836.64	
	SECURITAS AB-B RTS	118,132	4.32	510,566.50	
SECURITAS B	29,533	76.14	2,248,642.62		
VOLVO CAR AB-B	49,839	47.76	2,380,559.83		

	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	114.72	2,439,979.68	
	EVOLUTION AB	14,096	877.00	12,362,192.00	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	60.14	3,196,260.58	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	99.67	5,504,674.43	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	110.00	13,999,700.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	219.00	10,834,806.00	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	186.30	3,315,394.80	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	213.70	3,063,389.50	
	NORDEA BANK ABP	279,221	94.85	26,484,111.85	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	104.30	13,688,853.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	89.74	9,937,448.64	
	SWEDBANK AB-A	72,526	145.15	10,527,148.90	
	EQT AB	23,207	210.70	4,889,714.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	222.40	2,628,323.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	218.90	2,444,675.20	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	167.45	6,517,991.25	
	INVESTOR AB-B SHS	156,321	158.98	24,851,912.58	
	KINNEVIK AB - B	18,792	143.70	2,700,410.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	397.70	2,895,256.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	43.11	2,444,337.00	
	SAGAX AB-B	12,402	170.95	2,120,121.90	
	ERICSSON (LM) B	255,508	64.96	16,597,799.68	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	100.75	15,499,178.50	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	94.82	4,433,972.84	
	TELIA CO AB	230,643	32.38	7,468,220.34	
	スウェーデンクローナ 小計	3,287,562		370,977,854.15 (4,822,712,103)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	27,755	309.30	8,584,621.50	
	EQUINOR ASA	81,436	348.95	28,417,092.20	
	NORSK HYDRO	96,800	58.08	5,622,144.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	376.90	4,710,496.20	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	325.00	2,809,625.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	63.55	1,214,885.35	
	MOWI ASA	31,968	133.55	4,269,326.40	
	ORKLA	69,804	78.38	5,471,237.52	
	SALMAR ASA	5,423	375.80	2,037,963.40	
	DNB BANK ASA	71,795	169.30	12,154,893.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	183.80	3,413,901.20	
	TELENOR ASA	51,193	101.50	5,196,089.50	
	ノルウェークローネ 小計	495,008		83,902,275.77 (1,137,714,859)	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	370.10	3,139,558.30	

デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	17,111	374.70	6,411,491.70
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,150.00	868,250.00
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	138.88	11,340,107.52
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,950.00	2,836,050.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	13,250.00	5,750,500.00
	DSV A/S	15,307	876.60	13,418,116.20
	PANDORA A/S	8,163	357.30	2,916,639.90
	CARLSBERG AS-B	8,481	900.00	7,632,900.00
	COLOPLAST-B	9,208	756.00	6,961,248.00
	DEMANT A/S	8,512	181.65	1,546,204.80
	GN STORE NORD A/S	9,226	134.40	1,239,974.40
	GENMAB A/S	5,250	2,428.00	12,747,000.00
	NOVO NORDISK A/S-B	135,410	764.70	103,548,027.00
	DANSKE BANK A/S	56,132	93.88	5,269,672.16
	TRYG A/S	29,772	158.00	4,703,976.00
ORSTED A/S	15,439	600.30	9,268,031.70	
デンマーククローネ 小計		409,556		199,597,747.68 (3,820,300,890)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	28.54	588,751.66
	SANTOS	265,406	7.02	1,863,150.12
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	26.98	345,694.74
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	158,086	31.69	5,009,745.34
	BHP GROUP LTD	414,748	38.17	15,830,931.16
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	15.26	530,590.20
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	1.98	242,475.69
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	16.78	2,325,573.76
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	30.98	1,144,649.04
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	65.63	945,662.67
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	16.48	1,218,514.72
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	7.49	761,193.72
	ORICA LTD	38,288	13.48	516,122.24
	RIO TINTO LTD	28,818	90.91	2,619,844.38
	SOUTH32 LTD	407,531	3.66	1,491,563.46
	REECE LTD	16,814	14.48	243,466.72
	BRAMBLES LTD	108,007	11.67	1,260,441.69
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.53	422,156.23
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.24	445,400.00
	TRANSURBAN GROUP	249,674	13.00	3,245,762.00
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	33.64	1,554,504.40
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	54.15	191,745.15	
IDP EDUCATION LTD	17,793	27.13	482,724.09	
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.23	769,914.99	

	REA GROUP LTD	3,586	118.23	423,972.78
	SEEK LTD	28,001	19.87	556,379.87
	WESFARMERS LTD	91,917	44.02	4,046,186.34
	COLES GROUP LTD	108,486	16.66	1,807,376.76
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.09	779,198.09
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	34.30	3,426,604.30
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	12.73	814,210.80
	COCHLEAR LIMITED	4,783	208.36	996,585.88
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	57.60	935,884.80
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	30.76	1,145,840.76
	CSL LIMITED	39,814	286.74	11,416,266.36
	AUST AND NZ BANKING GROUP	247,511	23.37	5,784,332.07
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	139,969	93.12	13,033,913.28
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	267,570	29.27	7,831,773.90
	WESTPAC BANKING	283,793	21.12	5,993,708.16
	ASX LTD	14,549	73.14	1,064,113.86
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,434	159.51	4,695,017.34
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	236,496	4.58	1,083,151.68
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.52	817,284.16
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	11.60	1,294,455.60
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	10.11	959,075.04
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.64	1,093,424.64
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	55.08	760,159.08
	XERO LTD	11,340	77.00	873,180.00
	TELSTRA CORP	308,467	3.88	1,196,851.96
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	5.32	805,804.44
	オーストラリアドル 小計	5,488,661		117,685,330.12 (11,082,427,537)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.49	882,853.79
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	19.20	767,616.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.10	883,767.39
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.70	368,294.10
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.85	536,138.40
	ニュージーランドドル 小計	506,126		3,438,669.68 (285,168,876)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	43.15	9,233,927.40
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	75.75	8,105,250.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	11.34	1,950,480.00
	MTR CORP	125,000	35.60	4,450,000.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	14.52	1,742,400.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	45.35	7,890,900.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	19.82	3,924,360.00

	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	15.10	2,600,220.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	20.80	3,034,720.00	
	WH GROUP LTD	658,301	4.91	3,232,257.91	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	26.00	7,319,000.00	
	HANG SENG BANK	59,400	117.30	6,967,620.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	269.60	25,827,680.00	
	AIA GROUP LTD	982,200	64.65	63,499,230.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	47.20	7,764,211.20	
	ESR GROUP LTD	157,000	20.00	3,140,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	12.80	2,214,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	21.95	2,748,754.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	22.00	3,000,250.00	
	SINO LAND CO	315,400	9.79	3,087,766.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	122,500	86.85	10,639,125.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	58.10	2,353,050.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	16.74	1,610,388.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	35.00	4,165,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	39.60	2,673,000.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	59.05	8,119,375.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.88	6,224,040.16	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	38.85	4,351,200.00	
	香港ドル 小計	6,176,653		211,868,605.27 (3,908,975,767)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.93	781,704.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.51	517,374.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.12	554,659.84	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.77	476,625.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.86	689,396.00	
	DBS GROUP	150,000	32.93	4,939,500.00	
	OCBC BANK	282,100	11.71	3,303,391.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	26.13	2,453,607.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.35	617,100.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.39	757,665.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.61	325,708.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.44	305,900.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	16.40	421,480.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.67	1,818,117.81	
	シンガポールドル 小計	2,774,575		17,962,227.65 (1,815,442,348)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	28.80	1,711,497.60	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	677.00	1,452,842.00	
	BANK HAPAOALIM BM	98,310	30.25	2,973,877.50	

BANK LEUMI LE-ISRAEL	134,557	30.62	4,120,135.34
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.06	1,796,970.00
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	125.50	1,569,126.50
AZRIELI GROUP	4,323	244.20	1,055,676.60
NICE LTD	4,991	679.60	3,391,883.60
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	176,957	5.84	1,033,605.83
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	155.80	1,558,000.00
イスラエルシェケル 小計	602,714		20,663,614.97 (841,509,188)
合 計	90,489,304		502,363,912,613 (502,363,912,613)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	38,290	111,041.00	
		アメリカドル 小計	38,290	111,041.00 (16,079,847)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	109,658	1,077,938.14	
		LENLEASE GROUP	64,786	591,496.18	
	オーストラリアドル 小計	174,444	1,669,434.32 (157,210,629)		
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,203,930.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,961,000.00	
香港ドル 小計	535,500	4,164,930.00 (76,842,958)			
投資信託受益証券合計			748,234	250,133,434 (250,133,434)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,110	1,676,508.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	816,649.80	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,131	7,935,637.32	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	654,909.02	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,056,758.00	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	840,822.12	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	916,086.78	
		CROWN CASTLE INC	35,305	5,092,746.25	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,270,698.21	
		DUKE REALTY CORP	30,517	1,463,900.49	
		EQUINIX INC	7,423	4,167,197.97	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	877,666.10	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,592	1,959,582.24	

	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,242,225.30
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,834,844.44
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	21,791	949,433.87
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	625,632.00
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,022,083.70
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	896,445.67
	INVITATION HOMES INC	51,127	1,732,182.76
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,021,912.06
	KIMCO REALTY CORP	47,897	865,977.76
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	572,411.84
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,412,535.90
	PROLOGIS INC	60,352	6,107,018.88
	PUBLIC STORAGE	12,922	3,714,945.78
	REALTY INCOME CORP	49,865	2,889,676.75
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	665,209.87
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,422,723.41
	SIMON PROPERTY GROUP	27,091	2,414,620.83
	SUN COMMUNITIES INC	10,227	1,371,338.43
	UDR INC	24,265	996,806.20
	VENTAS INC	31,565	1,251,552.25
	VICI PROPERTIES INC	80,143	2,355,402.77
	VORNADO REALTY TRUST	11,390	261,286.60
	WELLTOWER INC	37,724	2,389,060.92
	WP CAREY INC	16,024	1,101,970.48
	アメリカドル 小計	1,016,860	70,846,461.17 (10,259,276,042)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	198,558.81
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	280,988.60
	カナダドル 小計	20,377	479,547.41 (50,736,115)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	235,397.28
	GECINA SA	3,139	241,703.00
	KLEPIERRE	17,225	298,595.37
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	421,231.95
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	306,578.36
	ユーロ 小計	48,695	1,503,505.96 (213,978,968)
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	270,007.60
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	232,741.09
	SEGRO PLC	93,383	669,556.11
	イギリスポンド 小計	219,086	1,172,304.80 (189,585,132)
	DEXUS	94,090	731,079.30

オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	133,807	2,171,687.61	
	GPT GROUP	167,884	641,316.88	
	MIRVAC GROUP	266,683	514,698.19	
	SCENTRE GROUP	382,183	982,210.31	
	STOCKLAND	207,412	672,014.88	
	VICINITY CENTERS	365,149	633,533.51	
オーストラリアドル 小計		1,617,208	6,346,540.68	(597,653,735)
香港ドル	LINK REIT	170,500	9,249,625.00	
香港ドル 小計		170,500	9,249,625.00	(170,655,581)
シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	460,429	865,606.52	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	284,138	752,965.70	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	438,942.95	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	374,000.00	
シンガポールドル 小計		1,247,756	2,431,515.17	(245,753,238)
投資証券合計		4,340,482	11,727,638,811	(11,727,638,811)
合計			11,977,772,245	(11,977,772,245)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

- 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
- 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 602銘柄	97.3%			72.8%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 37銘柄			2.7%	2.0%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%			3.7%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 223銘柄	99.5%			8.5%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79銘柄	99.2%			4.3%
	投資証券 3銘柄			0.8%	0.0%

スイスフラン	株式	41銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式	47銘柄	100.0%			0.9%
ノルウェークローネ	株式	12銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式	50銘柄	93.6%			2.2%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.3%		0.0%
	投資証券	7銘柄			5.0%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	28銘柄	94.0%			0.8%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券	1銘柄			4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	88.1%			0.4%
	投資証券	4銘柄			11.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	100.0%			0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2022年 9月30日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	217,782,100
コール・ローン	5,055,153,906
国債証券	311,625,274,650
派生商品評価勘定	50,145,603
未収入金	359,551,990
未収利息	2,012,875,813
前払金	142,088,352
前払費用	105,590,792
差入委託証拠金	482,043,347
流動資産合計	320,050,506,553
資産合計	320,050,506,553
負債の部	

	2022年 9月30日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	175,902,395
未払金	246,044,948
未払解約金	44,822,901
未払利息	12,248
流動負債合計	466,782,492
負債合計	466,782,492
純資産の部	
元本等	
元本	102,233,099,421
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	217,350,624,640
元本等合計	319,583,724,061
純資産合計	319,583,724,061
負債純資産合計	320,050,506,553

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	<p>国債証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

	2022年 9月30日現在
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（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	102,233,099,421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	<p>1口当たり純資産額 3.1260円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (31,260円)</p>

（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。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>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。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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	97,195,843,485円
期中追加設定元本額	18,713,028,069円
期中一部解約元本額	13,675,772,133円
期末元本額	102,233,099,421円

区分	2022年 9月30日現在
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,277,961,023円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	555,682,343円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,209,598,556円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,463,527円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,361,882,106円
世界経済インデックスファンド	15,035,973,221円
D C マイセレクション 2 5	1,954,182,180円
D C マイセレクション 5 0	1,692,398,921円
D C マイセレクション 7 5	1,165,985,023円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,313,486,221円
D C マイセレクション S 2 5	976,643,321円
D C マイセレクション S 5 0	775,537,884円
D C マイセレクション S 7 5	440,817,631円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	25,412,630円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	92,962,226円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	48,355,188円
D C 世界経済インデックスファンド	13,323,641,543円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	577,453,905円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,592,694円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,321,326円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	22,422,452円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	39,910,203円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	62,103,284円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	72,255,695円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	65,476,574円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,168,627,558円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	419,805,424円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,678,145,935円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	67,729,649円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	37,766,271円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	417,830,684円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	159,757,629円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	204,806,905円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	724,743,474円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1（適格機関投資家専用）	2,743,838,304円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	677,802,405円
外国債券ファンド・シリーズ 1	700,619,543円
コア投資戦略ファンド（安定型）	496,976,231円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,348,562,464円
分散投資コア戦略ファンド A	259,544,875円

区分	2022年 9月30日現在
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	591,561,264円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,247,909,497円
コア投資戦略ファンド（切替型）	617,085,545円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	252,385,406円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	107,887,864円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,325,033,059円
S M T インデックスバランス・オープン	197,776,750円
外国債券S M T Bセクション（S M A専用）	15,945,125,125円
S M T 世界経済インデックス・オープン	276,916,360円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	347,381,991円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	550,810,196円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,597,866円
グローバル経済コア	855,775,731円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	17,581,173円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	1,806,214円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	199,453,093円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,400,351円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	19,190,340円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	21,908,445円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	9,719,061円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,216,651円
M y S M T グローバル債券インデックス（ノーロード）	32,218,684円
10資産分散投資ファンド	7,886円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	258,863,962円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	11,070,064,495円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	331,527,995円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	289,422,913円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	364,222,126円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	938,499,105円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	97,294,886円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	75,574,871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	24,598,831,198
合計	24,598,831,198

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	4,835,296,580	-	4,693,208,228	142,088,352
	合計	4,835,296,580	-	4,693,208,228	142,088,352

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2022年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	5,117,723,670	-	5,134,055,230	16,331,560
	アメリカドル	2,785,702,696	-	2,818,649,647	32,946,951
	カナダドル	211,151,265	-	206,028,225	5,123,040
	ユーロ	1,678,758,872	-	1,673,098,728	5,660,144
	イギリスポンド	271,501,660	-	266,554,860	4,946,800
	オフショア人民元	170,609,177	-	169,723,770	885,407
	合計	5,117,723,670	-	5,134,055,230	16,331,560

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,484,570.30	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,451,593.95	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,756,490.62	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,667,968.72	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,094,609.37	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,263,671.94	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,374,023.40	
		T 0.25% 05/31/25	10,900,000.00	9,813,832.00	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,410,429.71	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,414,210.92	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,652,781.27	
		T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,535,234.36	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,674,121.07	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,192,328.11	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,522,187.50	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,055,937.52	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,594,628.88	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,250,937.52	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,417,486.90	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,629,453.12	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,654,492.20	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,127,558.60	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,691,562.48	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,663,671.89	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,542,500.00	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	3,977,226.58	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,593,044.51	
		T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,183,980.49	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	2,977,187.50	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	5,906,212.49	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,935,151.58	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,295,898.47	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,449,414.10	
		T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	9,481,875.00	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,012,812.48	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,389,152.40	

T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,725,392.17	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,107,128.90	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,409,375.00	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,174,531.25	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	9,784,414.09	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,661,562.50	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,539,218.76	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,396,536.77	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,098,951.61	
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,227,696.49	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,097,187.52	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,290,546.86	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,908,675.83	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,341,000.00	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,224,597.73	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	7,902,343.75	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,883,125.04	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,077,567.18	
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	4,559,648.47	
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	8,667,731.61	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,451,933.61	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,900,937.52	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	4,910,902.38	
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	6,888,437.52	
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,163,320.36	
T 1.25% 08/15/31	19,380,000.00	15,711,426.65	
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,377,675.74	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,242,578.16	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,347,928.12	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,750,156.24	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	5,816,250.00	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,437,158.20	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,889,218.76	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,023,350.00	
T 1.375% 11/15/31	21,030,000.00	17,139,450.00	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,913,593.78	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,205,003.89	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,391,796.86	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,507,587.50	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,798,339.82	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,065,039.10	
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,309,125.00	

T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,482,519.55
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,453,898.47
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,078,823.43
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,389,519.58
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,837,695.31
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,431,103.52
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,541,765.63
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,339,992.22
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,334,302.33
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,254,453.14
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,299,546.87
T 1.75% 08/15/41	12,330,000.00	8,510,589.90
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,613,750.00
T 1.875% 02/15/32	8,020,000.00	6,815,746.87
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,643,562.50
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,426,125.00
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,651,093.76
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,781,490.22
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,743,593.78
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,229,546.87
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,910,898.42
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,463,125.04
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	4,950,785.16
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,170,339.81
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,012,221.11
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,353,343.76
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,621,593.74
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,803,125.00
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,616,768.75
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,896,953.12
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,293,433.63
T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,691,757.82
T 2.25% 03/31/24	5,900,000.00	5,727,263.69
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,039,746.07
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,782,480.46
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,924,740.62
T 2.25% 08/15/27	11,530,000.00	10,628,768.38
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,057,063.30
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,076,015.62
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,056,121.07
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,746,775.41
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,150,265.63
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,018,576.19

T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,391,455.09
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,175,984.40
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,252,617.21
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,611,612.49
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,449,046.87
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,448,265.63
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,864,393.75
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,267,823.43
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	6,172,988.31
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,832,812.50
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	3,126,890.62
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,389,756.25
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,809,179.70
T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,319,238.28
T 2.5% 02/15/46	6,450,000.00	4,958,941.43
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,679,972.67
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,113,214.85
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,464,843.37
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,326,993.75
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,979,824.25
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,430,888.68
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,547,187.50
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,937,949.23
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,150,859.37
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,292,984.37
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,293,320.34
T 2.75% 08/15/42	5,800,000.00	4,757,359.40
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,277,968.75
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,480,722.66
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,625,617.22
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,281,892.19
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,207,968.76
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,471,214.85
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,869,062.52
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	6,842,266.42
T 2.875% 05/15/32	6,000,000.00	5,563,125.00
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,456,496.11
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	4,702,298.43
T 2.875% 05/15/52	4,800,000.00	4,073,625.02
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,690,030.45
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,266,767.21
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,687,096.88

T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,899,117.19
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,690,717.76
T 2.875% 10/31/23	7,900,000.00	7,789,523.47
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,067,187.50
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	3,957,344.52
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,209,082.05
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,038,982.85
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,481,640.65
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,013,653.53
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,190,141.78
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,292,783.21
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,480,637.12
T 2% 08/15/51	17,350,000.00	12,004,031.25
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,407,989.11
T 2% 11/15/41	8,200,000.00	5,923,859.41
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	923,015.62
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,736,718.76
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,191,992.99
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	3,576,895.33
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,002,640.60
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,535,625.00
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,713,467.98
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,884,695.33
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	737,214.84
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,253,750.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,882,656.26
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	1,933,125.00
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,877,421.89
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,435,160.16
T 3% 02/15/47	800,000.00	677,250.00
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	3,792,582.05
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,320,312.50
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,391,554.69
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,111,328.12
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,720,224.23
T 3% 08/15/48	7,250,000.00	6,208,945.31
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,059,398.44
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,829,101.55
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,365,343.76
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	943,523.44
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,443,449.23
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,068,593.75
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,012,218.75

	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,058,621.10
	T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,144,768.76
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,183,586.72
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	595,246.09
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,835,734.37
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,509,482.81
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	831,210.93
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,253,054.69
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,386,074.22
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,162,214.85
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,795,425.77
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,587,013.67
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,212,832.03
	アメリカドル 小計	1,290,980,000.00	1,138,480,678.64 (164,863,387,073)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,040,805.20
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,277,984.00
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,267,538.40
	CAN 0.5% 12/01/30	4,940,000.00	3,987,568.00
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,248,169.00
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	660,135.00
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,358,884.80
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,722,945.20
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,144,078.60
	CAN 1.5% 04/01/25	2,710,000.00	2,568,077.30
	CAN 1.5% 05/01/24	1,590,000.00	1,533,777.60
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,269,206.40
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,461,681.20
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,150,836.00
	CAN 1.5% 12/01/31	4,320,000.00	3,746,865.60
	CAN 1.75% 12/01/53	2,520,000.00	1,850,788.80
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	730,206.90
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,393,814.70
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,250,596.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,236,160.00
	CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	717,842.80
	CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	480,312.90
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,302,934.50
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	824,854.80
	CAN 2.75% 09/01/27	760,000.00	741,060.80
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,541,034.00
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	702,665.60

	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,227,417.60	
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,167,540.30	
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,719,487.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,105,839.00	
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,127,211.20	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,164,397.50	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,175,254.20	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,120,000.00	1,377,532.80	
	CAN 5% 06/01/37	880,000.00	1,054,345.60	
	カナダドル 小計	66,930,000.00	61,329,849.30 (6,488,698,055)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,762,382.00	
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,380,918.40	
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,593,875.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	52,610,000.00	46,227,354.80	
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,622,332.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	35,662,571.40	
	MBONO 7.75% 05/29/31	47,430,000.00	42,074,678.70	
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	23,709,679.20	
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,632,063.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,340,000.00	35,172,039.60	
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	24,047,272.20	
	MBONO 8% 07/31/53	3,700,000.00	3,101,007.00	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,052,938.30	
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	23,913,084.00	
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,221,446.70	
	メキシコペソ 小計	392,870,000.00	357,173,642.30 (2,567,078,401)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,139,387.90	
	BGB 0.2% 10/22/23	630,000.00	620,027.10	
	BGB 0.35% 06/22/32	1,550,000.00	1,225,461.00	
	BGB 0.4% 06/22/40	1,010,000.00	636,946.40	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,381,589.00	
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	273,356.80	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,596,973.60	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,577,277.00	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,460,000.00	1,336,688.40	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,430,000.00	2,192,637.60	
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	692,562.00	
	BGB 0% 10/22/31	1,830,000.00	1,435,598.40	
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,291,380.00	
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	695,593.50	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	639,456.00	

BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	919,336.00
BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	956,774.00
BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	888,300.00
BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,188,640.40
BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,810,525.50
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	715,052.80
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	644,466.90
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,167,199.40
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,309,440.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,032,605.90
BGB 4.25% 03/28/41	2,030,000.00	2,311,236.20
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,230,231.00
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,192,060.80
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,231,638.80
BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	2,739,916.30
BKO 0.2% 06/14/24	500,000.00	487,580.00
BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,807,949.50
BKO 0% 09/15/23	2,470,000.00	2,434,036.80
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,844,768.80
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,377,247.20
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	543,634.00
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,652,149.80
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,731,777.90
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	1,871,606.40
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,284,553.60
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	658,690.40
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,000,722.50
BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	2,896,360.90
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	642,875.40
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	1,849,719.00
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,740,336.60
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,074,503.20
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,580,111.80
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	965,380.00
BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,572,412.10
BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,410,271.40
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,874,480.00
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,249,218.20
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,419,900.00
BTPS 0% 11/29/23	1,750,000.00	1,698,795.00
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,711,848.00
BTPS 1.1% 04/01/27	1,000,000.00	890,320.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,773,213.00

BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,588,084.00	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,186,821.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,193,418.00	
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,324,064.00	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	730,850.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,300,513.70	
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,644,776.50	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,655,745.00	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,077,796.20	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	968,318.40	
BTPS 1.75% 05/30/24	1,910,000.00	1,870,711.30	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	980,320.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,492,797.80	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,409,477.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,592,270.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,531,129.80	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,036,032.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	435,620.20	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	641,294.40	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,130,112.80	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,197,236.00	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,159,599.20	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,240,483.50	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,910,174.60	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,250,000.00	1,216,587.50	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,916,370.00	
BTPS 2.5% 12/01/32	250,000.00	207,900.00	
BTPS 2.65% 12/01/27	960,000.00	900,576.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	1,648,240.10	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	795,712.10	
BTPS 2.8% 06/15/29	1,820,000.00	1,675,109.80	
BTPS 2.8% 12/01/28	2,720,000.00	2,545,593.60	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,580,000.00	1,296,895.60	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,056,848.60	
BTPS 2% 12/01/25	1,490,000.00	1,428,254.40	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,171,940.20	
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	816,700.80	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,970,000.00	1,625,053.00	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,610,044.80	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	1,800,918.80	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	3,802,273.20	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,180,831.00	

BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	1,678,110.60
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,029,839.70
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,814,460.00
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,152,987.20
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,735,068.50
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,164,953.00
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,373,742.50
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,160,260.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	3,826,038.80
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,505,788.40
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,813,171.00
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,089,156.40
BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,357,600.00
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,055,112.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,302,707.80
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,600,172.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	855,368.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,624,429.70
DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,754,967.60
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,374,627.00
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,991,419.20
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,871,420.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,402,859.20
DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,736,356.30
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,128,127.30
DBR 0% 02/15/31	3,280,000.00	2,759,923.20
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,001,053.60
DBR 0% 05/15/35	2,780,000.00	2,092,033.40
DBR 0% 05/15/36	2,730,000.00	2,010,262.80
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,052,286.00
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,046,295.00
DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,262,432.30
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	570,853.40
DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,632,562.50
DBR 0% 08/15/50	5,330,000.00	2,950,421.50
DBR 0% 08/15/52	1,790,000.00	948,503.10
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,676,284.00
DBR 0% 11/15/28	1,720,000.00	1,521,924.80
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	2,952,998.80
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,286,610.80
DBR 1.7% 08/15/32	1,550,000.00	1,485,024.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,653,811.50
DBR 1% 05/15/38	800,000.00	664,152.00

DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,976,400.00	
DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,560,757.20	
DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,541,238.40	
DBR 2.5% 08/15/46	3,610,000.00	3,846,888.20	
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,593,289.30	
DBR 4.0% 01/04/37	3,190,000.00	3,855,465.90	
DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	2,738,455.00	
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	2,920,413.00	
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	3,777,595.90	
DBR 4.75% 07/04/40	2,480,000.00	3,373,494.40	
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,570,788.80	
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,781,543.20	
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,413,528.60	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,600,550.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,257,316.00	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,318,423.20	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,369,754.00	
FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,303,920.10	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,950,000.00	5,249,744.50	
FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,095,488.00	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	386,545.50	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,199,167.20	
FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	1,970,690.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	5,747,864.90	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,980,000.00	2,225,854.80	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,660,000.00	1,458,611.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,299,515.00	
FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,731,611.50	
FRTR 0% 02/25/25	2,500,000.00	2,381,375.00	
FRTR 0% 02/25/26	4,460,000.00	4,151,724.80	
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,127,438.40	
FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,146,385.80	
FRTR 0% 03/25/25	5,490,000.00	5,222,417.40	
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,534,390.40	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,418,926.00	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	4,922,600.00	
FRTR 0% 11/25/31	5,790,000.00	4,563,041.10	
FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	3,678,073.70	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,141,551.60	
FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	5,688,493.20	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,566,885.90	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,280,905.80	

FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	2,785,280.80
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,139,200.00
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,386,159.00
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,104,017.60
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,123,452.00
FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000.00	7,217,766.80
FRTR 2.75% 10/25/27	6,580,000.00	6,707,388.80
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	2,899,904.80
FRTR 2% 11/25/32	1,220,000.00	1,135,380.80
FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	3,508,222.00
FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	5,855,360.00
FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,794,640.00
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	5,397,874.40
FRTR 4.75% 04/25/35	3,540,000.00	4,169,199.60
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	2,893,618.20
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,470,834.80
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	3,756,067.20
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,101,737.40
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,462,454.20
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,117,208.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	845,593.20
IRISH 0.2% 10/18/30	960,000.00	798,076.80
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	371,290.60
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	453,101.90
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	324,420.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	709,277.80
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	670,471.50
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,101,300.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	579,576.80
IRISH 1.35% 03/18/31	790,000.00	720,638.00
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	569,152.00
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	699,345.20
IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,577,516.00
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,204,494.50
IRISH 2% 02/18/45	1,280,000.00	1,064,358.40
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	991,369.10
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,253,832.40
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,207,020.20
NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,370,343.10
NETHER 0.5% 01/15/40	1,780,000.00	1,261,023.20
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,194,256.00
NETHER 0.5% 07/15/32	900,000.00	745,938.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,460,955.60

NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,565,768.00	
NETHER 0% 01/15/24	1,630,000.00	1,594,254.10	
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,114,851.50	
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,682,256.80	
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,203,017.20	
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	645,513.60	
NETHER 0% 01/15/52	1,610,000.00	800,894.50	
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,128,343.50	
NETHER 0% 07/15/31	1,770,000.00	1,441,877.40	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,970,000.00	1,970,591.00	
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,442,958.40	
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	1,998,855.50	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,649,375.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,532,724.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,010,484.90	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,252,078.00	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,881,195.00	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,588,637.50	
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,006,830.00	
OBL 0% 10/09/26	3,900,000.00	3,611,049.00	
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,317,475.00	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,484,103.50	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,328,011.80	
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	414,948.00	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,810,000.00	1,585,161.80	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,003,519.40	
RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	200,780.80	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,103,701.50	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	460,044.00	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	1,957,446.40	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	139,758.30	
RAGB 0.9% 02/20/32	880,000.00	741,496.80	
RAGB 0% 02/20/30	1,690,000.00	1,389,467.30	
RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,308,146.00	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	882,867.60	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,394,827.20	
RAGB 0% 10/20/28	450,000.00	385,083.00	
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	393,343.60	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,039,376.60	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	780,688.50	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	167,219.10	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	985,634.10	

RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,331,729.00
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	371,992.80
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	616,183.20
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,024,833.60
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	867,084.40
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	503,664.00
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,065,063.00
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,494,094.60
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,385,202.00
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	306,284.00
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	219,263.60
RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	430,347.60
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	316,280.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	585,292.40
RFGB 0.5% 04/15/43	440,000.00	279,263.60
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	794,727.60
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	577,973.50
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	660,652.80
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	681,520.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	664,787.40
RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	560,224.50
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	404,901.00
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	274,008.00
RFGB 0% 09/15/30	520,000.00	422,645.60
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	464,536.80
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	335,279.00
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	372,679.30
RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	434,884.80
RFGB 2.625% 07/04/42	680,000.00	650,086.80
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	558,123.50
RFGB 2% 04/15/24	660,000.00	661,947.00
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	874,695.50
SPGB 0.1% 04/30/31	2,700,000.00	2,088,342.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,211,201.10
SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	2,826,284.00
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,028,449.60
SPGB 0.6% 10/31/29	2,050,000.00	1,742,090.00
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,739,320.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,230,208.80
SPGB 0.8% 07/30/29	740,000.00	639,796.60
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,002,961.60
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,162,169.60
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,507,377.60

SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,389,102.00	
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,663,100.30	
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,037,394.90	
SPGB 0% 05/31/25	990,000.00	928,689.30	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	1,913,834.80	
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,653,439.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,050,377.50	
SPGB 1.4% 04/30/28	3,070,000.00	2,846,319.80	
SPGB 1.4% 07/30/28	3,030,000.00	2,792,084.40	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,456,346.60	
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	2,855,107.20	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	325,492.20	
SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,900,020.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	2,997,631.50	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,293,087.50	
SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	601,983.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	3,600,000.00	3,533,616.00	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,531,376.40	
SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	571,371.10	
SPGB 1% 10/31/50	2,330,000.00	1,259,132.00	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,792,325.10	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,150,000.00	1,958,843.50	
SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,844,251.20	
SPGB 2.7% 10/31/48	2,160,000.00	1,829,757.60	
SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,085,593.50	
SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	1,954,062.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,665,243.40	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,584,587.60	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,733,766.20	
SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,759,402.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,022,015.60	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	2,595,084.80	
SPGB 4.8% 01/31/24	1,840,000.00	1,905,117.60	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,398,993.10	
SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	3,925,028.50	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,161,445.40	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,473,784.60	
SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,316,943.80	
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,239,231.00	
ユーロ 小計	776,660,000.00	722,062,818.40	(102,763,980,314)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,317,824.80

UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,118,731.00
UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	1,807,683.60
UKT 0.25% 01/31/25	1,800,000.00	1,625,328.00
UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,322,484.80
UKT 0.375% 10/22/26	2,970,000.00	2,515,411.80
UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,591,881.50
UKT 0.5% 01/31/29	1,930,000.00	1,518,388.90
UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	482,949.40
UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,536,970.00
UKT 0.625% 07/31/35	2,810,000.00	1,799,046.30
UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	468,392.50
UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	609,546.60
UKT 0.875% 07/31/33	1,260,000.00	889,030.80
UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,349,477.00
UKT 1.125% 01/31/39	1,370,000.00	859,675.00
UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	235,872.00
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	820,667.00
UKT 1.25% 07/31/51	1,710,000.00	916,440.30
UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	1,716,316.00
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,434,784.00
UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,430,532.00
UKT 1.5% 07/31/53	420,000.00	238,253.40
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	916,198.20
UKT 1.625% 10/22/54	1,740,000.00	1,021,293.00
UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	841,498.40
UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	827,047.00
UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,355,525.60
UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,576,011.60
UKT 1% 01/31/32	1,720,000.00	1,287,660.80
UKT 1% 04/22/24	800,000.00	759,872.00
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,453,500.00
UKT 2.5% 07/22/65	2,000,000.00	1,533,940.00
UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,639,908.40
UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,663,570.20
UKT 3.25% 01/22/44	2,230,000.00	1,947,213.70
UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,084,312.20
UKT 3.5% 07/22/68	2,130,000.00	2,100,904.20
UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	1,536,080.00
UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	1,628,880.80
UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,118,564.00
UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,605,501.00
UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,356,368.50
UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	1,750,315.00

	UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	1,952,985.60
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,553,971.20
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,025,956.10
	UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,599,830.00
	UKT 4.5% 12/07/42	2,050,000.00	2,129,929.50
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,518,808.80
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	1,732,071.00
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	1,624,315.00
	UKT 5% 03/07/25	2,300,000.00	2,323,851.00
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,353,612.50
	イギリスポンド 小計	96,360,000.00	80,425,182.00 (13,006,360,433)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,403,097.00
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,870,782.90
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	6,774,516.00
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,384,500.00
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,074,228.40
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,549,451.60
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,281,121.00
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,372,000.00
	スウェーデンクローナ 小計	62,720,000.00	60,709,696.90 (789,226,059)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,641,867.60
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,624,964.00
	NGB 1.5% 02/19/26	6,470,000.00	6,120,555.30
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,973,027.50
	NGB 1.75% 03/13/25	6,570,000.00	6,352,335.90
	NGB 1.75% 09/06/29	6,010,000.00	5,443,737.80
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	3,020,001.60
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,700,326.40
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,753,404.00
	ノルウェークローネ 小計	50,240,000.00	46,630,220.10 (632,305,784)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,210,000.00	3,215,662.20
	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,020,312.50
	DGB 0.5% 11/15/29	8,280,000.00	7,191,511.20
	DGB 0% 11/15/24	3,840,000.00	3,672,729.60
	DGB 0% 11/15/31	8,390,000.00	6,612,746.30
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,512,023.50
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,427,129.60
	DGB 4.5% 11/15/39	13,320,000.00	16,677,838.80
	デンマーククローネ 小計	61,950,000.00	58,329,953.70

			(1,116,435,313)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,290,000.00	1,721,026.60	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,030,058.40	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,894,449.60	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,666,665.50	
	POLGB 1.75% 04/25/32	1,810,000.00	1,140,915.40	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,566,121.30	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,309,381.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,426,153.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,260,000.00	3,436,073.40	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,581,542.50	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,684,530.80	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,404,122.70	
	POLGB 3.75% 05/25/27	1,390,000.00	1,190,521.10	
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,332,687.20	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	551,094.00	
	ポーランドズロチ 小計		54,640,000.00	44,935,342.50
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,204,683.30	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,892,856.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,810,000.00	2,484,321.00	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,162,325.80	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,625,657.10	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,189,190.50	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,400,000.00	1,964,712.00	
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,806,053.00	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,881,486.40	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,368,482.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,620,000.00	3,293,620.80	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,368,325.20	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,333,225.90	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,045,752.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,844,365.90	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,566,890.60	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,314,627.60	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,541,542.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,130,436.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,000,283.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,559,428.20	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,382,992.80	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,681,171.20	
ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,174,367.90		
ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,421,041.70		

	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,424,052.00	
オーストラリアドル 小計		56,700,000.00	50,661,890.50 (4,770,830,228)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	684,060.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	483,545.50	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	558,909.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	594,110.70	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	235,152.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,026,950.40	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	774,967.50	
	SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	913,078.40	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	373,863.50	
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	582,970.90	
	SIGB 2.625% 08/01/32	350,000.00	325,451.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	684,554.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	571,410.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	625,995.50	
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,070,000.00	1,024,022.10	
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	667,488.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	823,824.80	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	738,083.40	
	SIGB 3% 08/01/72	280,000.00	265,109.60	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,577,423.10	
シンガポールドル 小計		14,590,000.00	13,530,970.20 (1,367,575,158)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,800,000.00	1,568,124.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,916,716.80	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,473,865.70	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,520,848.20	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,830,000.00	1,581,412.80	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,629,072.60	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,566,176.10	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,373,918.20	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,457,160.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,120,101.20	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,955,756.90	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,106,516.80	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	597,888.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,128,642.40	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,290,675.20	
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,007,954.00	
MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,293,004.80		

	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,447,819.40	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,760,000.00	2,633,178.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,536,925.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,864,433.00	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,774,053.30	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,019,655.00	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,428,481.20	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,298,582.00	
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,317,761.60	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,663,620.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,023,624.30	
	マレーシアリングット 小計	53,040,000.00	51,595,966.50 (1,610,583,573)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,010,000.00	955,126.39	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,032,287.20	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,265,798.56	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	950,000.00	791,126.83	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,970,000.00	1,516,873.01	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,196,921.96	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,190,873.18	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,392,358.32	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,894,746.60	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,603,982.15	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	3,030,000.00	3,061,325.95	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,135,504.41	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,683,681.14	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	2,660,000.00	2,963,235.21	
	イスラエルシェケル 小計	29,490,000.00	28,683,840.91 (1,168,126,473)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,300,666.40	
	CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,526,550.00	
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,734,144.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,699,564.80	
	CGB 2.48% 04/15/27	27,000,000.00	26,967,330.00	
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,644,861.20	
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,343,771.20	
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,396,366.80	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,000,000.00	10,018,200.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,215,248.80	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,791,314.50	
	CGB 2.85% 06/04/27	21,430,000.00	21,722,305.20	
	CGB 2.89% 11/18/31	18,510,000.00	18,630,685.20	
	CGB 2.91% 10/14/28	10,720,000.00	10,868,472.00	

	CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,161,716.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,061,332.80	
	CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,834,077.20	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,111,601.50	
	CGB 3.28% 12/03/27	19,110,000.00	19,817,452.20	
	CGB 3.39% 03/16/50	10,420,000.00	10,769,695.20	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	7,962,411.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,620,587.20	
	CGB 3.81% 09/14/50	13,260,000.00	14,759,440.80	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,406,937.80	
	CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,786,341.60	
	オフショア人民元 小計	441,700,000.00	450,151,073.40 (9,162,239,902)	
	合計		311,625,274,650 (311,625,274,650)	

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 219銘柄	100.0%	52.9%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 352銘柄	100.0%	33.0%
イギリスポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	4.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 25銘柄	100.0%	2.9%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期中間計算期間(2022年10月1日から2023年3月31日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DCマイセレクション75】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 (2022年 9月30日現在)	第22期中間計算期間 (2023年 3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,210,802,244	2,290,782,441
親投資信託受益証券	69,118,802,786	75,409,374,765
未収入金	-	135,510,000
流動資産合計	71,329,605,030	77,835,667,206
資産合計	71,329,605,030	77,835,667,206
負債の部		
流動負債		
未払解約金	39,679,850	35,638,298
未払受託者報酬	11,935,883	12,255,067
未払委託者報酬	115,380,155	118,465,617
未払利息	5,356	3,473
その他未払費用	1,877,253	944,588
流動負債合計	168,878,497	167,307,043
負債合計	168,878,497	167,307,043
純資産の部		
元本等		
元本	25,688,980,318	26,246,396,375
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	45,471,746,215	51,421,963,788
(分配準備積立金)	21,120,787,562	20,195,294,093
元本等合計	71,160,726,533	77,668,360,163
純資産合計	71,160,726,533	77,668,360,163
負債純資産合計	71,329,605,030	77,835,667,206

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期中間計算期間 自 2021年10月 1日 至 2022年 3月31日	第22期中間計算期間 自 2022年10月 1日 至 2023年 3月31日
営業収益		
受取利息	7,254	3,819
有価証券売買等損益	1,248,076,146	5,038,931,979
営業収益合計	1,248,083,400	5,038,935,798
営業費用		
支払利息	467,301	528,573
受託者報酬	11,614,440	12,255,067
委託者報酬	112,272,805	118,465,617
その他費用	933,916	944,588
営業費用合計	125,288,462	132,193,845
営業利益又は営業損失（ ）	1,122,794,938	4,906,741,953
経常利益又は経常損失（ ）	1,122,794,938	4,906,741,953
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,122,794,938	4,906,741,953
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	38,401,449	132,847,797
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	45,455,796,393	45,471,746,215
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,649,494,096	3,232,466,493
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,649,494,096	3,232,466,493
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,573,835,410	2,056,143,076
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,573,835,410	2,056,143,076
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	47,692,651,466	51,421,963,788

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第21期 (2022年 9月30日現在)	第22期中間計算期間 (2023年 3月31日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,688,980,318口	26,246,396,375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 (1万口当たり純資産額) 2.7701円 (27,701円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.9592円 (29,592円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第22期中間計算期間 (2023年 3月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第21期 自 2021年10月 1日 至 2022年 9月30日	第22期中間計算期間 自 2022年10月 1日 至 2023年 3月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	24,571,449,355円	25,688,980,318円
期中追加設定元本額	3,763,124,355円	1,717,071,355円
期中一部解約元本額	2,645,593,392円	1,159,655,298円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,943,130,238
株式	517,841,790,170
派生商品評価勘定	144,930,200
未収入金	321,436,541
未収配当金	6,301,256,854
差入委託証拠金	457,064,500
流動資産合計	528,009,608,503
資産合計	528,009,608,503
負債の部	
流動負債	

項目	2023年 3月31日現在
	金額（円）
派生商品評価勘定	15,074,500
前受金	129,882,100
未払金	9,859,971
未払解約金	394,910,548
未払利息	4,463
流動負債合計	549,731,582
負債合計	549,731,582
純資産の部	
元本等	
元本	259,604,331,418
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	267,855,545,503
元本等合計	527,459,876,921
純資産合計	527,459,876,921
負債純資産合計	528,009,608,503

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 3月31日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2023年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		259,604,331,418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 (1万口当たり純資産額)	2.0318円 (20,318円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2022年10月 1日

区分	2023年 3月31日現在
期首元本額	261,939,828,601円
期中追加設定元本額	9,571,579,443円
期中一部解約元本額	11,907,076,626円
期末元本額	259,604,331,418円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	371,352,457円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,074,841,680円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,083,643円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,825,942,373円
世界経済インデックスファンド	4,456,747,070円
日本株式インデックス・オープン	3,195,792,808円
DCマイセクション25	6,172,885,028円
DCマイセクション50	19,007,207,309円
DCマイセクション75	19,379,574,318円
DC日本株式インデックス・オープン	6,116,069,608円
DCマイセクションS25	3,304,168,286円
DCマイセクションS50	9,668,094,156円
DCマイセクションS75	7,660,260,276円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,757,141,672円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	129,513,256円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	659,967,933円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	504,541,342円
DC世界経済インデックスファンド	3,608,931,120円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,256,710,654円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	4,502,610円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,566,216円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,125,814円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	161,378,519円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,231,363円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	23,216,477円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	87,070,833円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	18,630,114円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	52,757,887円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	712,601,317円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	389,551,390円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,539,718,255円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	35,995,284円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	15,812,849円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	407,388,305円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	233,787,892円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	307,366,535円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	27,263,993円

区分	2023年 3月31日現在
F O F s用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	517,673,390円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,919,749,930円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,995,973,471円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,664,529,461円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,756,334,500円
分散投資コア戦略ファンドA	1,707,390,824円
分散投資コア戦略ファンドS	6,232,800,431円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	524,581,230円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	388,518,907円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,596,753,816円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,346,243円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,698,837円
S M T インデックスバランス・オープン	51,846,705円
国内株式S M T Bセレクション(S M A専用)	28,947,593,714円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	448,468,120円
S M T 世界経済インデックス・オープン	46,272,465円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	184,512,414円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	31,929,549円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	11,031,409円
グローバル経済コア	209,627,416円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	31,852,735円
M y S M T T O P I Xインデックス(ノーロード)	543,329,513円
D Cターゲット・イヤーフンド2055	26,466,440円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	260,308,230円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	23,905,591円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	22,235,342円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	10,770,110円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	14,582,765円
10資産分散投資ファンド	94,996,840円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	44,031,003,631円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	735,449,040円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	304,650,026円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	21,482,269円
S M T A M 9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	612,422,852円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P(適格機関投資家専用)	44,729,238,588円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	16,632,720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)	216,283,758円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,286,567,900	-	9,416,450,000	129,882,100
	合計	9,286,567,900	-	9,416,450,000	129,882,100

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2023年 3月31日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,383,903,337
国債証券	533,593,815,020
地方債証券	32,204,051,236
特殊債券	35,943,447,416
社債券	27,860,234,000
未収入金	4,347,340,840
未収利息	612,201,719
前払費用	20,482,649
流動資産合計	635,965,476,217
資産合計	635,965,476,217
負債の部	
流動負債	
未払金	5,130,571,000
未払解約金	323,982,684
未払利息	2,098
流動負債合計	5,454,555,782
負債合計	5,454,555,782
純資産の部	
元本等	
元本	461,944,153,214
剰余金	
剰余金又は欠損金()	168,566,767,221
元本等合計	630,510,920,435
純資産合計	630,510,920,435
負債純資産合計	635,965,476,217

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2023年 3月31日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	461,944,153,214口
2. 担保資産	<p>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。</p> <p>有価証券 100,024,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3649円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,649円)</p>

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2023年 3月31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	<p>(1)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(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。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

	2023年 3月31日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

（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	2023年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年10月 1日
期首元本額	458,239,606,430円
期中追加設定元本額	20,807,074,958円
期中一部解約元本額	17,102,528,174円
期末元本額	461,944,153,214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
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,253,824,208円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,977,682円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,465,569,371円
世界経済インデックスファンド	5,307,935,601円
D C マイセレクション 2 5	26,659,911,800円
D C マイセレクション 5 0	31,055,637,481円
D C マイセレクション 7 5	9,330,217,028円
D C 日本債券インデックス・オープン	429,945,954円
D C 日本債券インデックス・オープン S	91,381,297,321円
D C 日本債券インデックス・オープン P	65,518,135,723円
D C マイセレクション S 2 5	14,183,035,656円
D C マイセレクション S 5 0	15,873,104,307円
D C マイセレクション S 7 5	3,690,912,202円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	583,844,117円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,473,718,355円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	959,823,873円

区分	2023年 3月31日現在
D C 世界経済インデックスファンド	4,299,503,015円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,249,097円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	17,522,078円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	7,961,710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）	70,525,223円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	104,361,222円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	26,675,650円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	22,044,184円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,435,799,292円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	701,807,068円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,978,711,270円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	64,421,584円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	51,919,780円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	910,795,525円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,021,738,527円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,331,342,705円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	117,255,227円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,581,087,459円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,031,993,527円
分散投資コア戦略ファンドA	18,918,443,724円
分散投資コア戦略ファンドS	25,039,704,682円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	249,940,049円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,712,592,716円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	98,801,691円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,776,603円
S M T インデックスバランス・オープン	75,306,595円
S M T 世界経済インデックス・オープン	41,335,677円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	87,885,537円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	140,632,348円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	13,914,665円
グローバル経済コア	228,960,825円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	37,486,940円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	24,494,013円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	44,829,317円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	26,603,504円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	9,598,226円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,881,049円
M y S M T 国内債券インデックス（ノーロード）	217,512,784円
10資産分散投資ファンド	288,289,453円
F O F s 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）	85,205,485,723円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	39,506,049円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,869,181円

区分	2023年 3月31日現在
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	412,490,450円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2023年 3月31日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	13,007,045,245
コール・ローン	829,298,331
株式	513,975,458,012
投資信託受益証券	173,368,232
投資証券	11,019,638,834
派生商品評価勘定	643,965,565
未収入金	4,933,629
未収配当金	949,698,352
差入委託証拠金	3,797,136,183
流動資産合計	544,400,542,383
資産合計	544,400,542,383
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,569
前受金	637,877,753
未払金	1,158,412
未払解約金	33,939,433
未払利息	1,257
流動負債合計	673,025,424
負債合計	673,025,424
純資産の部	
元本等	
元本	123,453,098,532
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	420,274,418,427
元本等合計	543,727,516,959
純資産合計	543,727,516,959
負債純資産合計	544,400,542,383

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 3月31日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2023年 3月31日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 3月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	123,453,098,532口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 4.4043円 (1万口当たり純資産額) (44,043円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額 によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引におけ る名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引 のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年10月 1日
期首元本額	128,335,928,077円
期中追加設定元本額	8,129,980,630円
期中一部解約元本額	13,012,810,175円
期末元本額	123,453,098,532円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,860,353,014円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,403,183円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,184,317,400円
世界経済インデックスファンド	11,355,730,085円
外国株式インデックス・オープン	920,210,347円
D C マイセレクション 2 5	789,710,854円
D C マイセレクション 5 0	3,703,798,317円
D C マイセレクション 7 5	4,452,627,683円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,452,610,645円
D C マイセレクション S 2 5	418,163,473円
D C マイセレクション S 5 0	1,926,833,890円
D C マイセレクション S 7 5	1,756,107,322円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	29,083,957円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	148,258,185円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	113,359,541円
D C 世界経済インデックスファンド	9,199,242,798円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,125,762,347円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,931,092円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	3,528,471円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	25,216,387円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	10,275,281円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	39,587,311円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	8,468,131円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	23,972,787円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	214,101,651円

区分	2023年 3月31日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	152,942,253円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,144,252,241円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	81,604,334円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	21,527,075円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	141,420,729円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	45,756,245円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	908,672,288円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	998,021,301円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,126,706,028円
コア投資戦略ファンド（安定型）	473,398,906円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,181,204,042円
分散投資コア戦略ファンドA	1,749,171,318円
分散投資コア戦略ファンドS	8,510,158,962円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,337,110,719円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	990,420,679円
コア投資戦略ファンド（切替型）	509,037,880円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	528,567,040円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,756,710円
S M T インデックスバランス・オープン	132,206,095円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	307,732,719円
外国株式S M T B セレクション（S M A 専用）	11,119,351,179円
S M T 世界経済インデックス・オープン	227,225,777円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	905,950,479円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	156,788,221円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	4,900,493円
M y S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	655,376,798円
グローバル経済コア	533,226,932円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A 対応型）	15,171,312円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	5,948,062円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	456,682,822円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	98,504,462円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	62,539,618円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	59,701,471円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	28,943,190円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	38,950,124円
10資産分散投資ファンド	54,569,371円
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	224,504,967円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	25,531,679円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	483,834,790円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,496,088,016円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	104,989,408円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	82,116,060円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	81,739,674円

区分	2023年 3月31日現在
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	74,284,100円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	223,103,117円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	213,286,445円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	212,187,298円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	217,861,630円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	215,611,827円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	103,512,005円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	136,295,489円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 3月31日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	17,934,547,411	-	18,572,425,164	637,877,753
合計		17,934,547,411	-	18,572,425,164	637,877,753

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2023年 3月31日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	935,048,460	-	941,087,703	6,039,243
	アメリカドル	727,740,500	-	732,752,421	5,011,921
	カナダドル	90,779,160	-	91,801,602	1,022,442
	ユーロ	116,528,800	-	116,533,680	4,880
合計		935,048,460	-	941,087,703	6,039,243

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	394,597,323
コール・ローン	2,319,146,048
国債証券	295,740,500,098
派生商品評価勘定	61,507,665
未収入金	2,780
未収利息	2,025,604,752
前払費用	160,274,122
差入委託証拠金	389,365,207
流動資産合計	301,090,997,995
資産合計	301,090,997,995
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,357,668
前受金	16,837,358
未払金	2,414,511
未払解約金	45,774,662
未払利息	3,516
流動負債合計	72,387,715
負債合計	72,387,715
純資産の部	
元本等	
元本	97,780,069,141
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	203,238,541,139
元本等合計	301,018,610,280
純資産合計	301,018,610,280
負債純資産合計	301,090,997,995

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 3月31日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までには個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p>

2023年 3月31日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,780,069,141口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0785円 (1万口当たり純資産額) (30,785円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2023年 3月31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。

	2023年 3月31日現在
2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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	2023年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年10月 1日
期首元本額	102,233,099,421円
期中追加設定元本額	9,146,021,962円
期中一部解約元本額	13,599,052,242円
期末元本額	97,780,069,141円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,230,382,860円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	537,863,050円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,259,975,254円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,437,835円

区分	2023年 3月31日現在
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,757,930,669円
世界経済インデックスファンド	16,210,990,599円
DCマイセレクション25	1,935,934,620円
DCマイセレクション50	1,713,427,801円
DCマイセレクション75	1,198,127,121円
DC外国債券インデックス・オープン	2,286,273,044円
DCマイセレクションS25	1,047,475,342円
DCマイセレクションS50	839,268,621円
DCマイセレクションS75	475,570,220円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	21,432,350円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	96,978,408円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	51,318,170円
DC世界経済インデックスファンド	13,130,491,889円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	479,187,102円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	954,742円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,033,203円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	22,492,259円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	34,537,110円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	56,141,127円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	58,937,670円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	55,634,656円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,043,277,615円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	393,018,426円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,607,179,666円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	59,281,367円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	36,486,582円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	389,564,529円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	146,559,848円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	190,814,734円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	694,594,558円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	2,581,633,499円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	665,212,114円
外国債券ファンド・シリーズ1	721,559,581円
コア投資戦略ファンド（安定型）	191,540,029円
コア投資戦略ファンド（成長型）	956,949,109円
分散投資コア戦略ファンドA	276,386,697円
分散投資コア戦略ファンドS	604,847,674円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	610,727,241円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,184,292,326円
コア投資戦略ファンド（切替型）	364,678,466円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	241,428,580円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,591,303円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,355,921,157円

区分	2023年 3月31日現在
S M T インデックスバランス・オープン	184,007,602円
外国債券 S M T B セレクション (S M A 専用)	10,989,117,224円
S M T 世界経済インデックス・オープン	324,404,056円
S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	413,833,366円
S M T 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	662,251,689円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	6,610,649円
グローバル経済コア	762,544,831円
S B I 資産設計オープン (つみたて N I S A 対応型)	19,566,364円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	2,058,228円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	102,830,030円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	22,653,358円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 3 0	23,689,202円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 4 0	28,936,978円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 5 0	15,812,249円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 6 0	23,920,652円
M y S M T グローバル債券インデックス (ノーロード)	170,062,452円
1 0 資産分散投資ファンド	26,111,519円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用)	151,110,015円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンド P (適格機関投資家専用)	11,800,955,717円
外国債券インデックス・ファンド (適格機関投資家専用)	328,546,047円
外国債券インデックス・ファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	284,771,823円
F O F s 用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	186,550,570円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用)	774,832,430円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	116,677,708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)	55,043,035円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2023年 3月31日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	2,229,819,810	-	2,246,657,168	16,837,358
合計		2,229,819,810	-	2,246,657,168	16,837,358

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2023年 3月31日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	2,266,428,437	-	2,303,741,076	37,312,639
	アメリカドル	1,168,915,947	-	1,182,016,200	13,100,253
	カナダドル	98,465,794	-	100,541,400	2,075,606
	ユーロ	760,208,103	-	778,612,250	18,404,147
	イギリスポンド	95,130,577	-	97,506,350	2,375,773
	オフショア人民元	143,708,016	-	145,064,876	1,356,860
合計		2,266,428,437	-	2,303,741,076	37,312,639

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DCマイセレクション75】

【純資産額計算書】

(2023年 4月28日現在)

資産総額	79,449,770,142円
負債総額	75,200,297円
純資産総額（ - ）	79,374,569,845円
発行済口数	26,269,801,704口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0215円
（1万口当たり純資産額）	（30,215円）

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年 4月28日現在)

資産総額	542,429,742,572円
負債総額	3,436,042,770円
純資産総額（ - ）	538,993,699,802円
発行済口数	258,320,115,847口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0865円
（1万口当たり純資産額）	（20,865円）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年 4月28日現在)

資産総額	641,283,277,796円
負債総額	7,207,160,866円
純資産総額（ - ）	634,076,116,930円
発行済口数	463,355,204,702口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3684円
（1万口当たり純資産額）	（13,684円）

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年 4月28日現在)

資産総額	553,574,877,705円
負債総額	943,975,567円
純資産総額（ - ）	552,630,902,138円
発行済口数	122,130,291,615口
1口当たり純資産額（ / ）	4.5249円
（1万口当たり純資産額）	（45,249円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年 4月28日現在)

資産総額	283,049,131,847円
負債総額	43,181,782円
純資産総額（ - ）	283,005,950,065円
発行済口数	91,260,317,593口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1011円
（1万口当たり純資産額）	（31,011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。

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。

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。

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。

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。

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て）に支払います。

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（2023年 4月28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年間に於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

会社の意思決定機構

会社が取締役（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發します。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。

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

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2023年 6月30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。

2023年4月28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	530	14,101,215
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	207,465
単位型公社債投資信託	53	173,268
合計	651	14,481,947

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。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

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、財務諸表及び中間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、第36期事業年度（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。

また、第37期事業年度の中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間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	当事業年度
	（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					

当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

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

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債

務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

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

(会計方針の変更)

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

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

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-21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いません。

（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、

（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・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、自ら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。

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。

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あります。

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	投資有価証券 関係会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
人民元	1	-	0			
	合計		7,431	-	73	

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	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	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	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		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せん。

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

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。

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(株)	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

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。

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。

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		21,051
金銭の信託		13,989
未収委託者報酬		9,325
未収運用受託報酬		5,831
短期差入証拠金		4,507
その他		3,041
流動資産合計		57,747

固定資産

有形固定資産	1	895
無形固定資産		6,915
投資その他の資産		
投資有価証券		4,202
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,228
その他		31
投資その他の資産合計		11,098

固定資産合計		18,909
--------	--	--------

資産合計		76,657
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,649
未払法人税等		1,537
賞与引当金		321
その他	2	2,111
流動負債合計		11,619

固定負債

退職給付引当金		871
---------	--	-----

資産除去債務	153
その他	20
固定負債合計	1,045
負債合計	12,665

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	42,655
利益剰余金合計	45,255
株主資本合計	64,494
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	278
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	502
純資産合計	63,992
負債・純資産合計	76,657

中間損益計算書

(単位：百万円)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		20,422
運用受託報酬		5,485
その他営業収益		178
営業収益合計		26,086
営業費用		15,618
一般管理費	1	6,047
営業利益		4,421
営業外収益	2	2,365
営業外費用	3	1,945
経常利益		4,840
税引前中間純利益		4,840
法人税、住民税及び事業税		1,402
法人税等調整額		90

法人税等合計	1,492
中間純利益	3,347

中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30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
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	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	41,948	44,548	63,788
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
中間純利益			3,347	3,347	3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	706	706	706
当中間期末残高	500	2,100	42,655	45,255	64,494

	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	941	509	431	64,219
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,641
中間純利益				3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	663	270	933	933
当中間期変動額合計	663	270	933	227
当中間期末残高	278	780	502	63,992

注記事項

（重要な会計方針）

第37期中間会計期間

（自 2022年4月1日

至 2022年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

（1）有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

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

時価法によっております。

（3）金銭の信託

時価法によっております。

2．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。

3．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中間会計期間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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間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、退職給付に係る当中間会計期間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。

4．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。

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、中間会計期間末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. ヘッジ会計の方法

(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。

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

第37期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「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。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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いたしました。これによる中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

第37期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

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の適用

当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、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については、「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。以下、「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（表示方法の変更）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
従来「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。	

（中間貸借対照表関係）

第37期中間会計期間末 （2022年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	777百万円
2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	95百万円
無形固定資産	608百万円
2 営業外収益の主要項目	
デリバティブ利益	2,027百万円
投資有価証券売却益	317百万円
3 営業外費用の主要項目	
為替差損	1,011百万円
金銭の信託運用損	904百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

(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)

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

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

中間貸借対照表計上額、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 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、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順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額（百万円）(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	952	12,129	-	13,081
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,978	-	3,978
資産計	952	16,107	-	17,060
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	804	(0)	-	804
ヘッジ会計が適用されているもの	-	22	-	22
デリバティブ取引計	804	21	-	826

(*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)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。

(*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は上記に含めておりません。

(*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）時価をもって中間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、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。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。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、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中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

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中間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）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	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	2,657	1,966	690
小計	2,657	1,966	690

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,321	1,615	293
小計	1,321	1,615	293
合計	3,978	3,581	397

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30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	6,412	-	5	5
	英ポンド	250	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	164	-	1	1
	香港ドル	219	-	0	0
	ユーロ	721	-	0	0
	買建				
	米ドル	259	-	0	0
	香港ドル	2	-	0	0
合計	8,141	-	0	0	

（注）上記取引の評価損益は中間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	13,818	-	804	804
合計		13,818	-	804	804

（注）上記取引の評価損益は中間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	デリバティブ取引 の種類等	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	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		3,036	-	2
	英ポンド		3,333	-	19
	スイスフラン		70	-	0
	香港ドル		87	-	0
	ユーロ		82	-	0
	買建				
	米ドル		93	-	0
	英ポンド		77	-	2
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		3	-	0
	ユーロ		60	-	1
合計			6,898	-	22

（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）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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4．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中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後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]

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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]

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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中間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中間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中間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

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,950百万円

〔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〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1株当たり純資産額	21,330,712円74銭
1株当たり中間純利益	1,115,947円92銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
中間純利益	3,347百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	3,347百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の実行条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の実行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

2023年 6月30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

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

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。
岡三証券株式会社	5,000	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。
株式会社紀陽銀行	80,096	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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。
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。
株式会社滋賀銀行	33,076	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

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2022年3月末日現在）

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。

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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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まれます。）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. X B R L 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マイセレクション75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マイセレクション75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、継続企業的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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年12月1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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、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9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的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。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年6月13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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCマイセレクション75の2022年10月1日から2023年3月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCマイセレクション75の2023年3月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年10月1日から2023年3月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。