

## 【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】	2024年6月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【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S25
【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S25

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。

### （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】

2024年 6月29日から2024年12月27日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

2024年11月5日受付分からは、取得申込みの取扱いは、原則として、営業日の午後3時半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所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

## 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、外国株式およ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  中南米  アフリカ  中近東 (中東)				
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 ( )					
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。

## &lt; 商品分類表定義 &gt;

## [ 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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 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。

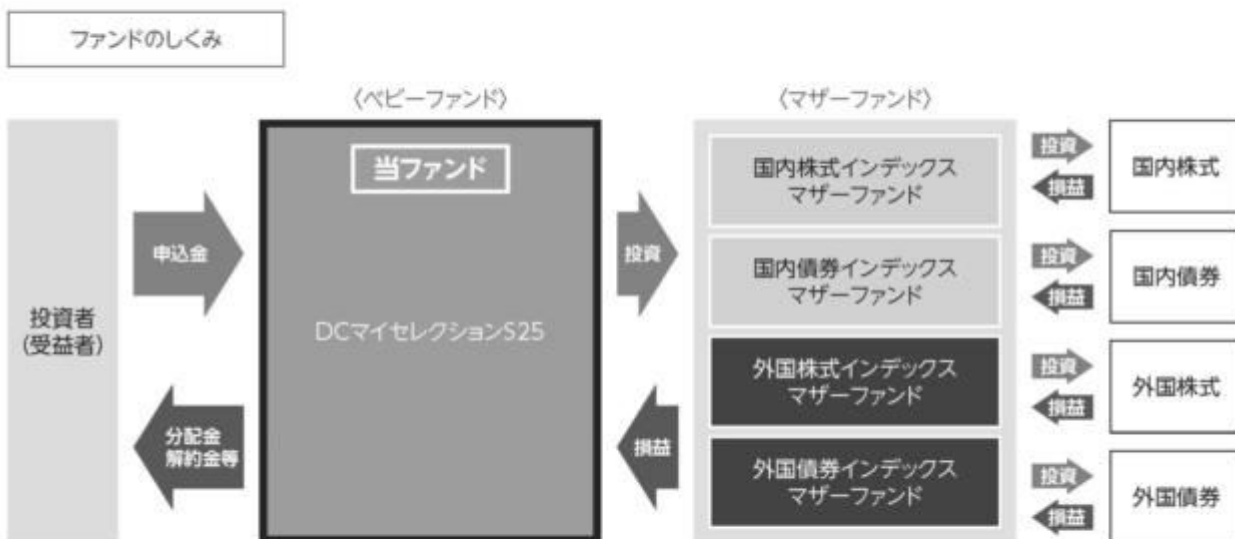
- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

<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） <sup>1</sup>
国内債券	NOMURA-BPI 総合 <sup>2</sup>
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） <sup>3</sup>
外国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース） <sup>4</sup>

\* 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。

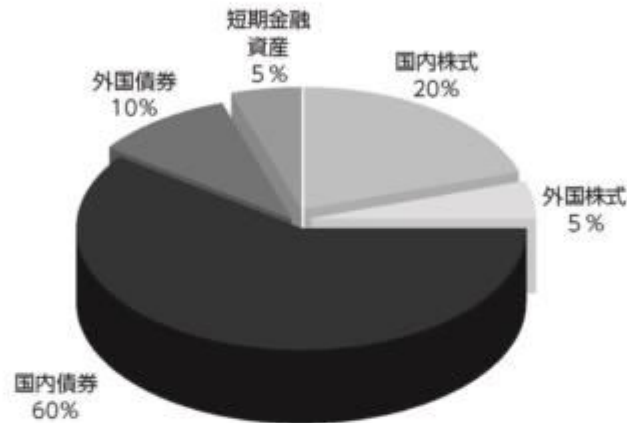
各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

- ※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」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20%、外国株式5%、国内債券60%、外国債券10%、短期金融資産5%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35%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25%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】

2006年10月30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S25」から「DCマイセレクションS25」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（2024年 4月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

#### ロ．委託会社の沿革

- 1986年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 1987年2月20日： 投資顧問業の登録
- 1987年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可
- 1990年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 1999年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 1999年3月25日： 証券投資信託委託業の認可
- 2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

#### ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### （イ）基本方針

本ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）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」ということがあります。）の受益証券（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）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20%、国内債券60%、外国株式5%、外国債券10%および短期金融資産5%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ごと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25条、第26条および第27条に定めるものに限りません。）

## 八．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)委託者は、信託金を主として、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記



載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(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、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、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、委託者は、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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス（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、委託者は、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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1.基本方針

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

### 2.運用方法

#### (1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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、異なる通貨、異なる受取金利または異なる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、委託者は、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及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲  
経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・ 分配対象額についての分配方針  
委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。
- ・ 留保益の運用方針  
留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、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35%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25%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者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、委託者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21条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。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24条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券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（第5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

委託者は、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。）ならびに委託者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。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。）委託者は、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者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、委託者は、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者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25条）

委託者は、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26条）

委託者は、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たっては、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27条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第28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。

委託者は、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り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借り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、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第29条）

委託者は、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30条）



委託者は、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につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第33条）

委託者は、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り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40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、委託者は、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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

前記 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。

#### 有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、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が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ある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。

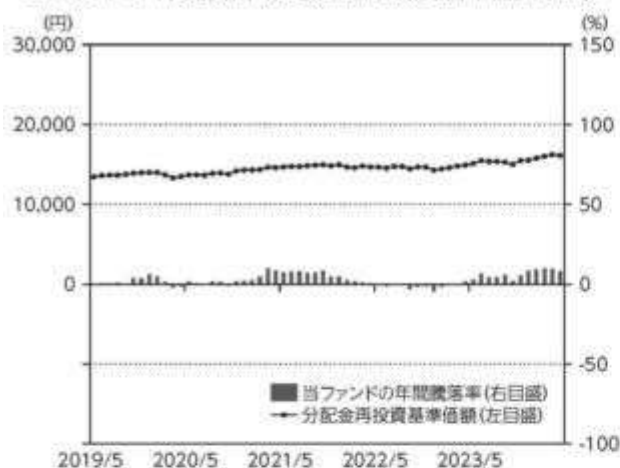
#### (ロ) リスクの管理体制

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】

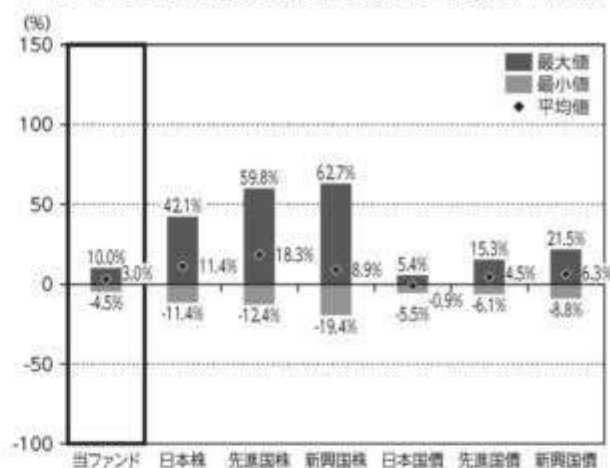
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*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



\*2019年5月～2024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協研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く範囲するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの同指数加重方式により算出されます。(配当込み)指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村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付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村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(以下「野村」)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・サービスに關し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan オバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・デベロップメント (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は英語を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金(解約)手数料】

## &lt; 解約手数料 &gt;

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

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、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．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 0.154%（税抜 0.14%）（ ）を乗じて得た額（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 0.077%（税抜 0.07%）	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 0.044%（税抜 0.04%）	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。

ロ．有価証券の貸付の指図を行った場合は、ファンドの品貸料及びマザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率（ ）を乗じて得た額

2024年 6月29日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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、2024年4月30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。

#### （参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.16%	0.15%	0.01%

※対象期間は2022年10月1日～2023年10月2日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

#### 5【運用状況】

以下は、2024年4月30日現在の状況について記載してあります。

#### 【DCマイセレクションS25】

##### （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	37,548,274,842	94.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,984,400,500	5.02
合計(純資産総額)		39,532,675,342	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	国内債券インデックス マザーファンド	17,610,207,176	1.3279	23,385,740,154	1.3199	23,243,712,451	58.80
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	2,876,311,253	2.3809	6,848,343,994	2.8461	8,186,269,457	20.71
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	1,119,636,772	3.3075	3,703,291,717	3.6058	4,037,186,272	10.21
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	324,412,574	5.1731	1,678,224,820	6.4150	2,081,106,662	5.26

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.98
合計	94.98

(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8期計算期間末 (2014年 9月30日)	10,531,539,682	10,531,539,682	11,889	11,889
第9期計算期間末 (2015年 9月30日)	12,342,153,362	12,342,153,362	12,347	12,347
第10期計算期間末 (2016年 9月30日)	13,732,263,936	13,732,263,936	12,466	12,466
第11期計算期間末 (2017年10月 2日)	15,964,176,750	15,964,176,750	13,340	13,340
第12期計算期間末 (2018年10月 1日)	18,260,187,515	18,260,187,515	13,695	13,695
第13期計算期間末 (2019年 9月30日)	20,075,767,653	20,075,767,653	13,750	13,750
第14期計算期間末 (2020年 9月30日)	22,774,313,770	22,774,313,770	13,916	13,916
第15期計算期間末 (2021年 9月30日)	28,405,096,689	28,405,096,689	14,917	14,917
第16期計算期間末 (2022年 9月30日)	30,431,894,864	30,431,894,864	14,446	14,446
第17期計算期間末 (2023年10月 2日)	36,291,412,150	36,291,412,150	15,266	15,266
2023年 4月末日	33,206,712,457		14,928	
5月末日	34,752,993,330		15,107	
6月末日	36,033,000,817		15,490	
7月末日	36,036,304,396		15,376	
8月末日	36,312,940,498		15,378	
9月末日	36,343,709,739		15,285	
10月末日	35,973,797,882		15,013	

11月末日	37,435,435,491		15,483
12月末日	37,711,492,935		15,529
2024年 1月末日	38,625,275,396		15,790
2月末日	39,346,861,554		16,042
3月末日	39,783,872,110		16,227
4月末日	39,532,675,342		16,128

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第8期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	0
第9期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第10期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第11期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第12期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0
第13期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0
第14期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	0
第15期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	0
第16期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	0
第17期計算期間	2022年10月 1日～2023年10月 2日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第8期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	6.7
第9期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	3.9
第10期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	1.0
第11期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	7.0
第12期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	2.7
第13期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0.4
第14期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	1.2
第15期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	7.2
第16期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	3.2
第17期計算期間	2022年10月 1日～2023年10月 2日	5.7
第18期中間計算期間	2023年10月 3日～2024年 4月 2日	5.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第8期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	2,276,287,347	519,665,212	8,858,133,018
第9期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	1,913,558,395	775,766,702	9,995,924,711
第10期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	1,404,333,164	384,672,714	11,015,585,161
第11期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	1,454,747,030	502,857,660	11,967,474,531
第12期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	2,043,425,700	677,319,878	13,333,580,353



第13期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	2,505,982,872	1,239,056,482	14,600,506,743
第14期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	2,947,819,675	1,183,246,066	16,365,080,352
第15期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	3,823,018,190	1,145,808,090	19,042,290,452
第16期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	3,527,164,510	1,502,824,793	21,066,630,169
第17期計算期間	2022年10月 1日～2023年10月 2日	4,464,682,516	1,759,091,262	23,772,221,423
第18期中間計算期間	2023年10月 3日～2024年 4月 2日	2,010,932,374	1,267,047,699	24,516,106,098

(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	649,649,606,820	98.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,072,947,356	1.97
合計(純資産総額)		662,722,554,176	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	13,158,130,000	1.99

(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	9,211,800	1,949.30	17,956,561,740	3,638.00	33,512,528,400	5.06
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,062,200	937.25	9,430,796,950	1,579.50	15,893,244,900	2.40
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,186,700	13,269.36	15,746,749,512	13,085.00	15,527,969,500	2.34
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	355,100	19,788.63	7,026,942,513	35,120.00	12,471,112,000	1.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,408,200	2,005.56	6,835,349,592	3,620.00	12,337,684,000	1.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	814,300	8,178.23	6,659,532,689	14,620.00	11,905,066,000	1.80
日本	株式	キーエンス	電気機器	167,800	68,425.93	11,481,871,054	70,300.00	11,796,340,000	1.78
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,174,700	5,692.47	6,686,944,509	8,980.00	10,548,806,000	1.59
日本	株式	三井物産	卸売業	1,329,400	4,709.00	6,260,144,600	7,639.00	10,155,286,600	1.53
日本	株式	信越化学工業	化学	1,506,900	4,422.30	6,663,963,870	6,195.00	9,335,245,500	1.41
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,241,200	4,457.15	5,532,214,580	6,902.00	8,566,762,400	1.29

日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	50,048,600	163.02	8,158,922,772	170.80	8,548,300,880	1.29
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,193,100	5,002.25	5,968,184,475	7,136.00	8,513,961,600	1.28
日本	株式	任天堂	その他製品	1,059,200	5,934.04	6,285,335,168	7,720.00	8,177,024,000	1.23
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,612,000	3,122.76	5,033,889,120	4,991.00	8,045,492,000	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	1,465,800	4,532.60	6,643,885,080	5,364.00	7,862,551,200	1.19
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	3,974,900	1,347.78	5,357,290,722	1,812.00	7,202,518,800	1.09
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,230,200	2,087.53	4,655,609,406	3,052.00	6,806,570,400	1.03
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	830,000	5,568.12	4,621,539,600	7,915.00	6,569,450,000	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,489,100	4,530.99	6,747,097,209	4,153.00	6,184,232,300	0.93
日本	株式	HOYA	精密機器	330,300	17,139.04	5,661,024,912	18,470.00	6,100,641,000	0.92
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,300,200	4,361.40	5,670,692,280	4,400.00	5,720,880,000	0.86
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,885,900	1,826.03	3,443,709,977	2,773.00	5,229,600,700	0.79
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,683,500	1,517.14	4,071,245,190	1,911.00	5,128,168,500	0.77
日本	株式	住友商事	卸売業	1,074,200	2,765.62	2,970,829,004	4,155.00	4,463,301,000	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,526,400	2,752.52	4,201,446,528	2,903.50	4,431,902,400	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	202,300	26,672.84	5,395,915,532	21,745.00	4,399,013,500	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,003,800	3,094.89	3,106,650,582	4,245.00	4,261,131,000	0.64
日本	株式	S M C	機械	50,700	74,502.90	3,777,297,030	83,520.00	4,234,464,000	0.64
日本	株式	三菱重工業	機械	2,963,100	618.68	1,833,210,708	1,417.50	4,200,194,250	0.63

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.34
		建設業	2.06
		食料品	3.10
		繊維製品	0.35
		パルプ・紙	0.16
		化学	5.48
		医薬品	4.27
		石油・石炭製品	0.51
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.70
		鉄鋼	0.89
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.50
		機械	5.46
		電気機器	17.01
輸送用機器	9.13		
精密機器	2.16		

その他製品	2.17
電気・ガス業	1.44
陸運業	2.37
海運業	0.75
空運業	0.38
倉庫・運輸関連業	0.13
情報・通信業	6.81
卸売業	7.77
小売業	4.00
銀行業	7.44
証券、商品先物取引業	0.90
保険業	2.73
その他金融業	1.14
不動産業	2.09
サービス業	4.25
小計	98.03
合計	98.03

(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	479	円	13,136,810,450	13,158,130,000	1.99

(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	562,800,519,960	84.78
地方債証券	日本	32,943,645,238	4.96
特殊債券	日本	36,710,480,782	5.53
	国際機関	298,965,000	0.05
	小計	37,009,445,782	5.58
社債券	日本	28,857,996,000	4.35
	フランス	1,494,670,000	0.23
	韓国	99,555,000	0.01
	小計	30,452,221,000	4.59

現金・預金・その他の資産（負債控除後）		630,456,135	0.09
合計(純資産総額)		663,836,288,115	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144回利付国債(5年)	6,580,000,000	100.26	6,597,521,300	100.00	6,580,329,000	0.100	2025/6/20	0.99
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	100.04	6,572,628,000	98.96	6,502,000,500	0.100	2028/3/20	0.98
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	6,160,000,000	100.39	6,184,604,300	97.67	6,016,656,800	0.500	2033/3/20	0.91
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	5,940,000,000	100.15	5,948,910,000	99.41	5,905,251,000	0.005	2026/6/20	0.89
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	5,860,000,000	100.78	5,905,957,400	100.34	5,880,275,600	0.400	2025/6/20	0.89
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	100.44	5,926,373,000	99.56	5,874,099,000	0.100	2026/9/20	0.88
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,920,000,000	99.95	5,917,621,400	99.02	5,862,043,200	0.005	2027/6/20	0.88
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	100.39	5,772,942,500	99.41	5,716,247,500	0.100	2027/3/20	0.86
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	5,680,000,000	100.05	5,683,361,000	99.33	5,642,228,000	0.005	2026/9/20	0.85
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	5,700,000,000	98.94	5,639,609,600	97.72	5,570,553,000	0.600	2033/12/20	0.84
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,760,000,000	98.38	5,667,065,000	96.22	5,542,675,200	0.200	2032/3/20	0.83
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	5,320,000,000	100.66	5,355,261,900	99.82	5,310,690,000	0.800	2033/9/20	0.80
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	5,550,000,000	98.02	5,440,214,200	95.65	5,309,074,500	0.200	2032/9/20	0.80
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,520,000,000	97.90	5,404,080,000	96.05	5,302,180,800	0.100	2031/9/20	0.80
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	5,430,000,000	98.63	5,355,718,700	97.19	5,277,525,600	0.100	2030/9/20	0.80
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	5,310,000,000	100.08	5,314,248,000	99.24	5,269,644,000	0.005	2026/12/20	0.79
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	100.17	5,169,092,800	99.10	5,113,611,600	0.100	2027/12/20	0.77
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	5,220,000,000	100.65	5,254,382,600	97.89	5,109,962,400	0.500	2032/12/20	0.77
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	5,280,000,000	98.28	5,189,362,200	95.92	5,065,051,200	0.200	2032/6/20	0.76
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,090,000,000	100.30	5,105,270,000	99.21	5,049,890,800	0.100	2027/9/20	0.76
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	5,220,000,000	98.15	5,123,743,000	96.38	5,031,036,000	0.100	2031/6/20	0.76
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	100.90	5,065,631,800	100.14	5,027,329,200	0.300	2025/12/20	0.76
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	5,040,000,000	100.12	5,046,399,600	99.54	5,016,816,000	0.005	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,020,000,000	100.37	5,038,574,000	99.93	5,016,486,000	0.100	2025/9/20	0.76

日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	5,130,000,000	98.40	5,048,320,800	96.96	4,974,150,600	0.100	2030/12/20	0.75
日本	国債証券	第371回利付国債（10年）	5,100,000,000	97.58	4,976,668,800	96.51	4,922,061,000	0.400	2033/6/20	0.74
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	5,077,000,000	97.85	4,968,275,600	95.75	4,861,379,810	0.100	2031/12/20	0.73
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	4,880,000,000	100.35	4,897,140,600	99.48	4,855,063,200	0.100	2026/12/20	0.73
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	4,800,000,000	100.39	4,818,720,000	99.82	4,791,360,000	0.100	2025/12/20	0.72
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	4,835,000,000	99.94	4,832,534,150	98.81	4,777,898,650	0.100	2028/6/20	0.72

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.78
地方債証券	4.96
特殊債券	5.58
社債券	4.59
合計	99.91

(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	513,785,064,551	69.50
	イギリス	28,295,575,192	3.83
	カナダ	24,103,359,917	3.26
	フランス	22,057,410,695	2.98
	スイス	20,863,775,082	2.82
	ドイツ	17,190,666,770	2.33
	オランダ	14,377,546,424	1.94
	オーストラリア	13,099,197,040	1.77
	アイルランド	13,026,935,988	1.76
	デンマーク	7,357,578,063	1.00
	スウェーデン	6,131,944,248	0.83
	スペイン	5,260,609,032	0.71
	イタリア	4,118,009,537	0.56
	香港	2,925,072,731	0.40
	シンガポール	2,165,135,877	0.29

	フィンランド	2,001,187,171	0.27
	ジャージー	1,832,510,251	0.25
	ベルギー	1,542,227,316	0.21
	イスラエル	1,399,232,119	0.19
	ノルウェー	1,222,252,003	0.17
	ケイマン	935,119,731	0.13
	バミューダ	924,360,510	0.13
	キュラソー	851,531,331	0.12
	ニュージーランド	511,869,433	0.07
	リベリア	414,526,888	0.06
	オーストリア	386,632,412	0.05
	ルクセンブルク	382,110,184	0.05
	ポルトガル	349,505,078	0.05
	パナマ	170,469,544	0.02
	マン島	80,004,435	0.01
	小計	707,761,419,553	95.74
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	オーストラリア	71,605,745	0.01
	香港	54,568,080	0.01
	小計	126,173,825	0.02
投資証券	アメリカ	11,113,484,736	1.50
	オーストラリア	910,486,727	0.12
	フランス	300,636,646	0.04
	シンガポール	237,712,302	0.03
	イギリス	204,096,337	0.03
	香港	113,106,461	0.02
	カナダ	55,014,122	0.01
	ベルギー	54,407,808	0.01
	小計	12,988,945,139	1.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		18,354,831,469	2.48
合計(純資産総額)		739,231,369,986	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	14,011,240,605	1.90
	買建	カナダ	576,122,446	0.08
	買建	ドイツ	2,474,155,389	0.33
	買建	イギリス	1,029,358,572	0.14
	買建	オーストラリア	630,856,512	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		682,323,000	0.09

(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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	545,058	52,271.23	28,490,854,806	63,113.02	34,400,259,180	4.65
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	1,133,924	27,506.13	31,189,871,160	27,222.15	30,867,849,217	4.18
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	190,578	61,374.57	11,696,643,374	137,690.73	26,240,824,514	3.55
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	717,541	18,925.27	13,579,662,902	28,392.62	20,372,871,818	2.76
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	456,849	19,562.29	8,937,013,538	26,068.93	11,909,566,886	1.61
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	171,346	41,388.65	7,091,779,794	67,878.07	11,630,637,153	1.57
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	397,755	19,672.12	7,824,684,886	26,343.50	10,478,262,820	1.42
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	34,367	124,568.65	4,281,050,804	210,029.47	7,218,083,070	0.98
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	62,224	67,738.43	4,214,956,504	115,666.67	7,197,243,496	0.97
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	222,518	21,500.00	4,784,138,557	30,325.63	6,747,998,981	0.91
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	221,215	30,615.90	6,772,697,861	30,446.44	6,735,210,331	0.91
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	101,297	50,535.82	5,119,127,629	62,910.62	6,372,657,479	0.86
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	307,151	16,479.20	5,061,604,909	18,771.51	5,765,689,911	0.78
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	71,401	75,818.78	5,413,537,211	76,728.80	5,478,513,549	0.74
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	122,188	35,322.89	4,316,034,139	42,651.69	5,211,525,431	0.70
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	253,029	12,899.15	3,263,861,089	19,952.24	5,048,495,335	0.68

アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	64,870	58,700.94	3,807,930,401	71,718.98	4,652,410,881	0.63
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	181,466	22,857.19	4,147,803,204	25,364.45	4,602,786,010	0.62
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,092	113,978.63	3,543,823,726	142,515.32	4,431,086,454	0.60
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	185,343	24,193.97	4,484,184,835	23,036.05	4,269,572,098	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	77,067	45,891.01	3,536,682,806	52,843.92	4,072,522,383	0.55
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	195,618	17,382.95	3,400,418,109	20,415.82	3,993,703,442	0.54
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	34,237	80,020.56	2,739,664,221	113,961.17	3,901,688,817	0.53
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	138,024	24,151.61	3,333,502,785	26,097.17	3,602,036,758	0.49
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	136,294	21,639.64	2,949,354,184	25,342.48	3,454,029,059	0.47
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	347,772	7,690.88	2,674,672,817	9,451.65	3,287,021,310	0.44
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	205,438	19,196.95	3,943,784,041	15,853.41	3,256,893,583	0.44
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	549,785	4,432.70	2,437,036,626	5,891.59	3,239,110,557	0.44
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	74,662	33,720.76	2,517,659,800	43,263.60	3,230,147,351	0.44
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	124,711	19,750.57	2,463,113,585	25,135.37	3,134,658,375	0.42

(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	4.82
		素材	3.82
		資本財	7.08
		商業・専門サービス	1.55
		運輸	1.63
		自動車・自動車部品	1.70
		耐久消費財・アパレル	1.43
		消費者サービス	1.98
		メディア・娯楽	6.34
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.80
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.23



	家庭用品・パーソナル用品	1.60
	ヘルスケア機器・サービス	4.14
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.66
	銀行	5.49
	金融サービス	6.54
	保険	2.98
	エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.03
	ソフトウェア・サービス	9.62
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.60
	電気通信サービス	1.07
	公益事業	2.54
	半導体・半導体製造装置	8.11
	不動産管理・開発	0.30
	小計	95.74
新株予約権証券		
投資信託受益証券		0.02
投資証券		1.76
合計		97.52

(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	347	アメリカドル	89,953,033.7	14,113,630,988	89,300,450	14,011,240,605	1.90
	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	5,010,457.5	575,050,207	5,019,800	576,122,446	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	44	スイスフラン	5,058,948	870,999,077	4,978,160	857,089,807	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	194	ユーロ	9,535,345.8	1,603,082,335	9,618,520	1,617,065,582	0.22
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	6,164,149	634,660,781	6,127,200	630,856,512	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	64	イギリスポンド	4,976,140	980,399,102	5,224,640	1,029,358,572	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	4,350,000.00	681,414,000	682,323,000	0.09
--------	--------	----	--------------	-------------	-------------	------

(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	156,642,694,702	45.90
	中国	31,006,620,475	9.09
	フランス	26,470,015,474	7.76
	イタリア	24,241,395,943	7.10
	ドイツ	20,744,645,784	6.08
	イギリス	16,944,349,788	4.96
	スペイン	16,223,049,281	4.75
	カナダ	6,787,766,107	1.99
	ベルギー	5,868,238,663	1.72
	オランダ	4,960,637,285	1.45
	オーストラリア	4,513,896,547	1.32
	オーストリア	4,011,951,078	1.18
	メキシコ	2,809,024,486	0.82
	ポーランド	1,853,889,900	0.54
	フィンランド	1,753,267,955	0.51
	アイルランド	1,715,085,755	0.50
	マレーシア	1,641,284,053	0.48
	シンガポール	1,367,149,718	0.40
	イスラエル	1,095,562,314	0.32
	デンマーク	893,009,170	0.26
ニュージーランド	829,191,895	0.24	
スウェーデン	636,780,932	0.19	
ノルウェー	523,569,839	0.15	
	小計	333,533,077,144	97.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,745,243,905	2.27
合計(純資産総額)		341,278,321,049	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	1,772,156,103	0.52
	買建	ドイツ	1,617,403,503	0.47

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		4,100,709,132	1.20

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/31/28	14,150,000	15,789.04	2,234,150,446	15,491.42	2,192,036,415	4.375	2028/8/31	0.64
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	14,000,000	15,897.19	2,225,607,727	15,133.49	2,118,689,344	4.125	2032/11/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	14,961.78	2,039,290,649	14,249.70	1,942,235,055	3.375	2033/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	14,408.12	1,858,648,383	13,671.13	1,763,576,827	2.750	2032/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,723.77	1,721,209,641	14,621.11	1,709,208,782	2.375	2027/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	11,150,000	15,265.61	1,702,115,681	15,300.81	1,706,040,806	3.000	2025/7/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	14,887.90	1,667,444,865	14,417.63	1,614,775,575	3.500	2033/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	14,481.97	1,559,708,551	14,679.95	1,581,031,288	1.625	2026/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,968.60	1,631,450,704	12,472.93	1,569,095,493	1.375	2031/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	15,162.96	1,546,622,484	15,300.81	1,560,683,070	3.125	2025/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	15,682.86	1,568,286,010	15,545.97	1,554,597,066	4.500	2026/7/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	13,468.57	1,578,517,334	12,884.49	1,510,062,605	1.875	2032/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	9,520,000	15,920.39	1,515,621,523	15,593.77	1,484,527,494	4.625	2026/10/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	14,924.84	1,501,439,540	14,635.52	1,472,333,482	2.875	2028/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	12,554.75	1,500,293,579	12,284.77	1,468,031,172	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	14,969.20	1,377,167,006	15,241.36	1,402,205,494	4.125	2030/8/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	14,581.89	1,472,771,268	13,850.10	1,398,860,343	2.875	2032/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	12,753.94	1,422,065,135	12,410.42	1,383,762,078	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	14,196.38	1,348,656,630	14,440.00	1,371,800,907	0.750	2026/4/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/25	9,000,000	15,027.19	1,352,447,600	15,167.20	1,365,048,390	2.875	2025/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	13,482.67	1,294,336,748	13,528.94	1,298,778,967	0.625	2027/12/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	13,660.41	1,297,739,203	13,555.60	1,287,782,792	1.250	2028/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	15,053.51	1,264,495,093	14,694.97	1,234,377,652	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	9,550,000	14,803.05	1,413,691,346	12,924.02	1,234,244,352	3.625	2053/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	13,695.28	1,232,576,030	13,656.73	1,229,106,187	1.250	2028/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	15,554.10	1,264,548,351	15,090.59	1,226,865,214	3.875	2029/11/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	8,170,000	15,453.56	1,262,556,130	14,803.76	1,209,467,196	3.875	2033/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/52	10,800,000	12,265.11	1,324,632,789	11,132.85	1,202,347,987	2.875	2052/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,220,000	14,680.97	1,206,776,283	14,585.87	1,198,959,139	2.875	2028/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	14,478.00	1,158,240,708	14,958.78	1,196,702,684	0.375	2025/4/30	0.35

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	97.73
合計	97.73

(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	46	アメリカドル	4,881,730.49	765,943,514	4,834,312.5	758,503,631	0.22
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	28	アメリカドル	3,062,500.35	480,506,305	3,022,687.64	474,259,691	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	30	アメリカドル	3,517,865.25	551,953,057	3,437,812.5	539,392,781	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	16	ユーロ	1,688,888.6	283,935,951	1,684,320	283,167,878	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	22	ユーロ	2,588,646.2	435,203,199	2,571,360	432,297,043	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	41	ユーロ	5,419,256.1	911,085,336	5,364,850	901,938,582	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。


種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	12,830,000.00	1,972,194,578	2,008,100,280	0.59
	カナダドル	買建	1,350,000.00	150,989,971	154,536,255	0.05
	ユーロ	買建	7,830,000.00	1,285,133,131	1,313,957,781	0.39
	イギリスポンド	買建	1,100,000.00	210,701,524	216,205,770	0.06
	マレーシアリングット	買建	189,000.00	6,212,127	6,210,426	0.00
	オフショア人民元	買建	18,600,000.00	394,019,433	401,698,620	0.12

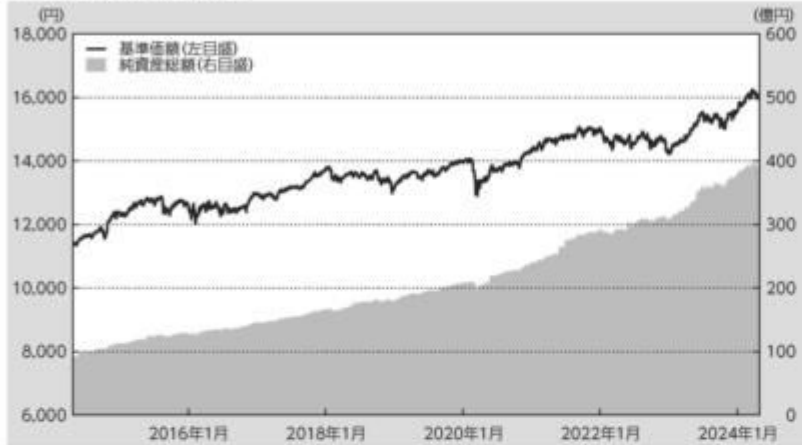
(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(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：2006年10月30日  
 作成基準日：2024年4月30日
**基準価額・純資産の推移**

基準価額 16,128円

純資産総額 395.33億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年9月	0円
2020年9月	0円
2021年9月	0円
2022年9月	0円
2023年10月	0円
設定来 分配金合計額	0円

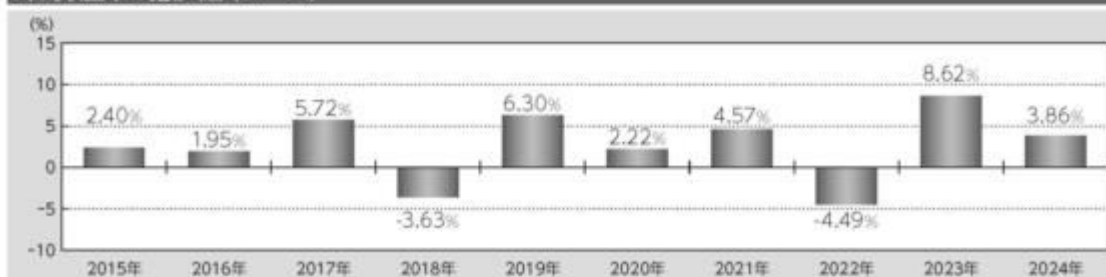
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

**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
国内債券 インデックス マザーファンド	58.8%	第144回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2025/06/20	0.6%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.6%
		第370回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.500%	2033/03/20	0.5%
国内株式 インデックス マザーファンド	20.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.0%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
外国債券 インデックス マザーファンド	10.2%	T 4.375% 08/31/28	アメリカ	国債	-	4.375%	2028/08/31	0.1%
		T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.1%
		T 3.375% 05/15/33	アメリカ	国債	-	3.375%	2033/05/15	0.1%
外国株式 インデックス マザーファンド	5.3%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.2%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェア	-	-	0.2%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.2%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。  
 ※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

**第2【管理及び運営】****1【申込（販売）手続等】****< 申込手続 >**

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。

2024年11月5日受付分からは、お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半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受付分とします。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

2024年11月5日受付分からは、一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半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。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 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

##### 1) 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。

##### 2) 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）の以下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。（2006年10月30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、以下の手続きを行います。

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。受託会社は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、販売会社を經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っ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17期計算期間(2022年10月1日から2023年10月2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S25】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 (2022年 9月30日現在)	第17期 (2023年10月 2日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,558,322,182	1,860,526,735
親投資信託受益証券	28,902,650,885	34,474,532,423
未収入金	-	6,930,000
流動資産合計	30,460,973,067	36,341,989,158
資産合計	30,460,973,067	36,341,989,158
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,316,907	21,634,467
未払受託者報酬	4,961,100	5,842,196
未払委託者報酬	18,190,646	21,421,325
未払利息	3,775	3,204
その他未払費用	1,605,775	1,675,816
流動負債合計	29,078,203	50,577,008
負債合計	29,078,203	50,577,008
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	21,066,630,169	23,772,221,423
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,365,264,695	12,519,190,727
(分配準備積立金)	4,047,347,662	4,616,093,346
元本等合計	30,431,894,864	36,291,412,150
純資産合計	30,431,894,864	36,291,412,150
負債純資産合計	30,460,973,067	36,341,989,158

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第16期		第17期	
	自	2021年10月 1日	自	2022年10月 1日
	至	2022年 9月30日	至	2023年10月 2日
<b>営業収益</b>				
受取利息		7,702		5,140
有価証券売買等損益		897,255,591		1,861,051,538
営業収益合計		897,247,889		1,861,056,678
<b>営業費用</b>				
支払利息		575,036		940,297
受託者報酬		9,681,522		10,976,295
委託者報酬		35,498,790		40,246,298
その他費用		1,605,775		1,675,816
営業費用合計		47,361,123		53,838,706
営業利益又は営業損失 ( )		944,609,012		1,807,217,972
経常利益又は経常損失 ( )		944,609,012		1,807,217,972
当期純利益又は当期純損失 ( )		944,609,012		1,807,217,972
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 ( )		24,921,266		81,619,888
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		9,362,806,237		9,365,264,695
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,659,205,958		2,215,502,208
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,659,205,958		2,215,502,208
剰余金減少額又は欠損金増加額		737,059,754		787,174,260
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		737,059,754		787,174,260
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		9,365,264,695		12,519,190,727

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第17期計算期間は2022年10月1日から2023年10月2日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2022年9月30日現在)	第17期 (2023年10月2日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	21,066,630,169口	23,772,221,423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) 1.4446円 (14,446円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5266円 (15,266円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 2021年10月1日 至 2022年9月30日			第17期 自 2022年10月1日 至 2023年10月2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	- 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	876,310,670円
収益調整金額	C	6,052,499,407円	収益調整金額	C	7,903,097,381円
分配準備積立金額	D	4,047,347,662円	分配準備積立金額	D	3,739,782,676円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,099,847,069円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,519,190,727円
当ファンドの期末残存口数	F	21,066,630,169口	当ファンドの期末残存口数	F	23,772,221,423口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,794円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,266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17期 自 2022年10月1日 至 2023年10月2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17期 (2023年10月2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。



	第17期 (2023年10月 2日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （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16期 自 2021年10月 1日 至 2022年 9月30日	第17期 自 2022年10月 1日 至 2023年10月 2日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	19,042,290,452円	21,066,630,169円
期中追加設定元本額	3,527,164,510円	4,464,682,516円
期中一部解約元本額	1,502,824,793円	1,759,091,262円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第16期 (2022年 9月30日現在)	第17期 (2023年10月 2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	851,838,949	1,767,454,396
合計	851,838,949	1,767,454,396

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	3,173,742,973	7,532,244,197	
	外国株式インデックス マザーファンド	411,558,324	2,120,430,796	
	国内債券インデックス マザーファンド	16,070,983,069	21,342,265,515	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,056,246,218	3,479,591,915	
合計		20,712,530,584	34,474,532,423	

(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

	2023年10月 2日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,029,621,794
株式	564,976,665,330
未収入金	17,617,500
未収配当金	5,304,023,172
前払金	111,682,200
差入委託証拠金	229,055,000
流動資産合計	573,668,664,996
資産合計	573,668,664,996
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	111,706,400
未払解約金	725,797,794
未払利息	5,218
流動負債合計	837,509,412
負債合計	837,509,412
純資産の部	
元本等	
元本	241,361,431,252
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	331,469,724,332
元本等合計	572,831,155,584
純資産合計	572,831,155,584
負債純資産合計	573,668,664,996

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年10月 2日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

2023年10月 2日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	241,361,431,252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) 2.3733円 (23,733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

2023年10月 2日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年10月 2日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年10月 2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	261,939,828,601円
期中追加設定元本額	20,431,207,047円
期中一部解約元本額	41,009,604,396円
期末元本額	241,361,431,252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）	315,522,569円

区分	2023年10月 2日現在
S B I 資産設計オープン(資産成長型)	3,487,867,825円
S B I 資産設計オープン(分配型)	12,849,032円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,112,271,822円
世界経済インデックスファンド	5,036,289,853円
日本株式インデックス・オープン	2,998,700,640円
D C マイセレクション 2 5	5,432,104,431円
D C マイセレクション 5 0	17,409,836,368円
D C マイセレクション 7 5	18,561,691,426円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,035,151,510円
D C マイセレクション S 2 5	3,173,742,973円
D C マイセレクション S 5 0	9,469,095,242円
D C マイセレクション S 7 5	8,092,843,178円
D C 日本株式インデックス・オープン S	9,130,260,432円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	92,145,033円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	617,031,715円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	484,344,221円
D C 世界経済インデックスファンド	3,751,995,151円
日本株式インデックス・オープン(S M A 専用)	913,056,728円
国内バランス 6 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	2,777,026円
マイセレクション 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	9,034,561円
マイセレクション 7 5 V A 1 (適格機関投資家専用)	14,638,693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)	156,832,421円
国内バランス 6 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	2,043,492円
バランス 3 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	17,358,838円
バランス 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	70,516,841円
バランス 2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	16,579,511円
バランス 5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	46,691,759円
バランス A ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	539,615,700円
バランス B ( 3 7 . 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	327,477,200円
バランス C ( 5 0 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	2,194,914,602円
世界バランス V A 1 (適格機関投資家専用)	29,343,477円
世界バランス V A 2 (適格機関投資家専用)	12,687,773円
バランス D ( 3 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	341,960,779円
バランス E ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	190,467,054円
バランス F ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	255,663,639円
国内バランス 2 5 V A 1 (適格機関投資家専用)	20,370,521円
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)	425,820,552円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	2,536,242,081円
日本株式ファンド・シリーズ 2	1,840,040,062円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,175,641,849円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,718,949,991円
分散投資コア戦略ファンド A	1,739,925,047円
分散投資コア戦略ファンド S	6,055,972,105円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	583,518,476円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	404,558,400円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,322,566,262円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	201,372,028円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,720,130円
S M T インデックスバランス・オープン	50,595,567円
国内株式 S M T B セレクション(S M A 専用)	18,832,498,160円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	278,370,714円
S M T 世界経済インデックス・オープン	50,926,494円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	209,439,241円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	36,489,914円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	11,703,688円
グローバル経済コア	216,621,636円
S B I 資産設計オープン(つみたて N I S A 対応型)	33,370,696円
M y S M T T O P I X インデックス(ノーロード)	1,112,093,245円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	27,362,412円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	986,410,100円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	232,177,734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	51,256,457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	49,168,913円

区分	2023年10月 2日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	20,717,516円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	22,949,263円
10資産分散投資ファンド	92,934,250円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,064,139,141円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	496,739,492円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	301,198,334円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,664,551円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	578,120,202円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	45,970,189,419円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,444,159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）	206,748,935円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年10月 2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	37,200,537,728
合計	37,200,537,728

(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

（2023年10月 2日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,209,337,200	-	6,097,655,000	111,682,200
合計		6,209,337,200	-	6,097,655,000	111,682,200

## (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	9,200	3,900.00	35,880,000	
ニッスイ	241,600	723.20	174,725,120	
マルハニチロ	35,900	2,541.00	91,221,900	
雪国まいたけ	20,600	891.00	18,354,600	
カネコ種苗	7,400	1,440.00	10,656,000	
サカタのタネ	27,500	4,320.00	118,800,000	
ホクト	21,500	1,817.00	39,065,500	
ホクリヨウ	2,300	1,124.00	2,585,200	

住石ホールディングス	25,000	492.00	12,300,000
日鉄鉱業	9,700	4,960.00	48,112,000
三井松島ホールディングス	10,900	2,689.00	29,310,100
I N P E X	893,500	2,225.00	1,988,037,500
石油資源開発	28,000	5,450.00	152,600,000
K & O エナジーグループ	11,000	2,642.00	29,062,000
ショーボンドホールディングス	32,900	5,814.00	191,280,600
ミライト・ワン	79,900	1,962.50	156,803,750
タマホーム	15,200	3,580.00	54,416,000
サンヨーホームズ	2,000	729.00	1,458,000
日本アクア	6,700	1,006.00	6,740,200
ファーストコーポレーション	4,100	789.00	3,234,900
ベステラ	3,500	1,023.00	3,580,500
キャンディル	2,900	549.00	1,592,100
ダイセキ環境ソリューション	3,300	1,188.00	3,920,400
第一カッター興業	6,200	1,275.00	7,905,000
安藤・間	140,000	1,168.00	163,520,000
東急建設	68,800	779.00	53,595,200
コムシスホールディングス	77,100	3,098.00	238,855,800
ピーアールホールディングス	38,400	363.00	13,939,200
高松コンストラクショングループ	15,700	2,642.00	41,479,400
東建コーポレーション	6,900	7,930.00	54,717,000
ソネック	1,700	965.00	1,640,500
ヤマウラ	12,200	1,242.00	15,152,400
オリエンタル白石	86,800	325.00	28,210,000
大成建設	158,100	5,177.00	818,483,700
大林組	604,400	1,307.00	789,950,800
清水建設	479,200	1,030.00	493,576,000
飛鳥建設	18,700	1,365.00	25,525,500
長谷工コーポレーション	174,400	1,912.50	333,540,000
松井建設	15,800	760.00	12,008,000
銭高組	1,400	3,755.00	5,257,000
鹿島建設	374,700	2,433.50	911,832,450
不動テトラ	11,700	1,990.00	23,283,000
大末建設	4,100	1,446.00	5,928,600
鉄建建設	12,100	2,095.00	25,349,500
西松建設	28,700	3,674.00	105,443,800
三井住友建設	136,300	397.00	54,111,100
大豊建設	7,000	3,900.00	27,300,000
佐田建設	7,200	532.00	3,830,400
ナカノフドー建設	8,000	426.00	3,408,000
奥村組	27,400	4,480.00	122,752,000

東鉄工業	23,300	2,901.00	67,593,300
イチケン	2,500	2,084.00	5,210,000
富士ピー・エス	5,000	460.00	2,300,000
浅沼組	13,500	3,635.00	49,072,500
戸田建設	207,900	814.70	169,376,130
熊谷組	28,300	3,550.00	100,465,000
北野建設	2,100	3,000.00	6,300,000
植木組	3,200	1,481.00	4,739,200
矢作建設工業	23,000	1,234.00	28,382,000
ピーエス三菱	21,400	834.00	17,847,600
日本ハウスホールディングス	36,100	375.00	13,537,500
新日本建設	23,700	1,238.00	29,340,600
東亜道路工業	6,700	5,330.00	35,711,000
日本道路	17,000	1,908.00	32,436,000
東亜建設工業	14,500	3,775.00	54,737,500
日本国土開発	48,100	660.00	31,746,000
若築建設	7,500	3,000.00	22,500,000
東洋建設	54,700	1,219.00	66,679,300
五洋建設	239,600	881.00	211,087,600
世紀東急工業	21,700	1,533.00	33,266,100
福田組	6,400	4,840.00	30,976,000
住友林業	146,000	3,763.00	549,398,000
日本基礎技術	6,800	496.00	3,372,800
巴コーポレーション	12,600	579.00	7,295,400
大和ハウス工業	467,300	4,010.00	1,873,873,000
ライト工業	31,300	2,028.00	63,476,400
積水ハウス	512,400	2,914.00	1,493,133,600
日特建設	16,100	1,081.00	17,404,100
北陸電気工事	11,600	1,026.00	11,901,600
ユアテック	37,200	960.00	35,712,000
日本リーテック	14,900	1,282.00	19,101,800
四電工	7,100	2,879.00	20,440,900
中電工	26,200	2,408.00	63,089,600
関電工	92,600	1,385.00	128,251,000
きんでん	119,000	2,190.50	260,669,500
東京エネシス	16,800	970.00	16,296,000
トーエネック	5,600	4,200.00	23,520,000
住友電設	16,100	2,764.00	44,500,400
日本電設工業	27,800	2,127.00	59,130,600
エクシオグループ	77,800	3,048.00	237,134,400
新日本空調	9,400	2,373.00	22,306,200
九電工	41,100	4,714.00	193,745,400

三機工業	37,500	1,622.00	60,825,000
日揮ホールディングス	167,200	2,037.50	340,670,000
中外炉工業	5,500	2,317.00	12,743,500
ヤマト	9,400	955.00	8,977,000
太平電業	10,500	4,055.00	42,577,500
高砂熱学工業	40,700	2,881.00	117,256,700
三晃金属工業	1,400	4,105.00	5,747,000
朝日工業社	7,000	2,423.00	16,961,000
明星工業	29,100	1,003.00	29,187,300
大気社	19,500	4,530.00	88,335,000
ダイダシ	22,200	1,491.00	33,100,200
日比谷総合設備	13,800	2,296.00	31,684,800
フィル・カンパニー	2,600	695.00	1,807,000
テスホールディングス	36,400	519.00	18,891,600
インフロニア・ホールディングス	177,100	1,572.50	278,489,750
東洋エンジニアリング	22,400	674.00	15,097,600
レイズネクスト	24,400	1,438.00	35,087,200
ニッポン	45,700	2,168.00	99,077,600
日清製粉グループ本社	156,900	1,891.00	296,697,900
日東富士製粉	3,000	4,875.00	14,625,000
昭和産業	14,800	3,025.00	44,770,000
鳥越製粉	10,100	675.00	6,817,500
中部飼料	23,500	1,089.00	25,591,500
フィード・ワン	24,800	780.00	19,344,000
東洋精糖	2,100	1,898.00	3,985,800
日本甜菜製糖	9,900	1,924.00	19,047,600
D M三井製糖ホールディングス	16,800	2,999.00	50,383,200
塩水港精糖	13,500	259.00	3,496,500
ウェルネオシュガー	8,800	2,000.00	17,600,000
森永製菓	30,300	5,318.00	161,135,400
中村屋	4,200	3,060.00	12,852,000
江崎グリコ	48,500	4,046.00	196,231,000
名糖産業	6,700	1,597.00	10,699,900
井村屋グループ	9,300	2,238.00	20,813,400
不二家	11,600	2,512.00	29,139,200
山崎製パン	113,600	2,716.50	308,594,400
第一屋製パン	2,100	431.00	905,100
モロゾフ	5,500	3,680.00	20,240,000
亀田製菓	10,800	4,080.00	44,064,000
寿スピリッツ	90,000	2,415.00	217,350,000
カルビー	77,700	2,763.00	214,685,100
森永乳業	30,800	5,605.00	172,634,000



六甲バター	12,400	1,381.00	17,124,400
ヤクルト本社	242,400	3,617.00	876,760,800
明治ホールディングス	208,000	3,692.00	767,936,000
雪印メグミルク	41,000	2,301.00	94,341,000
プリマハム	22,800	2,421.00	55,198,800
日本ハム	66,300	4,449.00	294,968,700
林兼産業	3,400	561.00	1,907,400
丸大食品	17,100	1,660.00	28,386,000
S Foods	18,700	3,305.00	61,803,500
柿安本店	6,600	2,456.00	16,209,600
伊藤ハム米久ホールディングス	25,920	4,025.00	104,328,000
サッポロホールディングス	55,800	4,778.00	266,612,400
アサヒグループホールディングス	392,000	5,562.00	2,180,304,000
キリンホールディングス	706,700	2,098.50	1,483,009,950
宝ホールディングス	115,800	1,199.00	138,844,200
オエノンホールディングス	50,700	413.00	20,939,100
養命酒製造	5,600	1,845.00	10,332,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	132,900	1,964.50	261,082,050
ライフドリンク カンパニー	3,100	3,770.00	11,687,000
サントリー食品インターナショナル	119,500	4,493.00	536,913,500
ダイドーグループホールディングス	9,600	5,460.00	52,416,000
伊藤園	57,500	4,802.00	276,115,000
キーコーヒー	19,000	1,997.00	37,943,000
ユニカフェ	3,800	957.00	3,636,600
ジャパンフーズ	1,800	1,116.00	2,008,800
日清オイリオグループ	23,900	4,145.00	99,065,500
不二製油グループ本社	39,500	2,243.50	88,618,250
かどや製油	1,400	3,495.00	4,893,000
J - オイルミルズ	17,300	1,767.00	30,569,100
キッコーマン	112,400	7,855.00	882,902,000
味の素	409,700	5,719.00	2,343,074,300
ブルドックソース	9,000	2,066.00	18,594,000
キューピー	91,200	2,405.50	219,381,600
ハウス食品グループ本社	51,900	3,109.00	161,357,100
カゴメ	73,000	3,187.00	232,651,000
焼津水産化学工業	4,400	1,313.00	5,777,200
アリアケジャパン	14,800	4,902.00	72,549,600
ピエトロ	1,600	1,843.00	2,948,800
エバラ食品工業	4,600	2,937.00	13,510,200
やまみ	1,100	2,038.00	2,241,800
ニチレイ	77,700	3,251.00	252,602,700
東洋水産	85,700	5,753.00	493,032,100

イトアンドホールディングス	7,500	2,050.00	15,375,000
大冷	1,400	1,950.00	2,730,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	1,140.00	12,312,000
日清食品ホールディングス	59,700	12,320.00	735,504,000
永谷園ホールディングス	8,300	2,234.00	18,542,200
一正蒲鉾	4,900	755.00	3,699,500
フジッコ	17,400	1,914.00	33,303,600
ロック・フィールド	19,000	1,582.00	30,058,000
日本たばこ産業	1,031,000	3,449.00	3,555,919,000
ケンコーマヨネーズ	11,700	1,492.00	17,456,400
わらべや日洋ホールディングス	12,500	2,828.00	35,350,000
なとり	10,700	1,979.00	21,175,300
イフジ産業	1,900	1,588.00	3,017,200
ファーマフーズ	24,400	1,477.00	36,038,800
ユーグレナ	105,600	771.00	81,417,600
紀文食品	13,200	1,124.00	14,836,800
ピクルスホールディングス	9,900	1,218.00	12,058,200
ミヨシ油脂	4,400	1,193.00	5,249,200
理研ビタミン	14,700	2,217.00	32,589,900
片倉工業	16,200	1,738.00	28,155,600
ゲンゼ	12,400	4,520.00	56,048,000
東洋紡	75,100	1,047.50	78,667,250
ユニチカ	54,600	204.00	11,138,400
富士紡ホールディングス	6,900	3,550.00	24,495,000
倉敷紡績	13,100	2,445.00	32,029,500
シキボウ	6,400	1,099.00	7,033,600
日本毛織	45,900	1,331.00	61,092,900
トーア紡コーポレーション	4,500	458.00	2,061,000
帝国繊維	19,700	1,911.00	37,646,700
帝人	166,200	1,420.00	236,004,000
東レ	1,157,000	766.00	886,262,000
住江織物	2,400	2,233.00	5,359,200
日本フェルト	7,500	425.00	3,187,500
イチカワ	1,800	1,575.00	2,835,000
日東製網	1,200	1,515.00	1,818,000
アツギ	7,100	436.00	3,095,600
ダイニック	3,000	815.00	2,445,000
セーレン	33,500	2,303.00	77,150,500
ソトー	3,800	757.00	2,876,600
東海染工	1,300	1,055.00	1,371,500
小松マテーレ	25,200	738.00	18,597,600
ワコールホールディングス	31,500	3,380.00	106,470,000

ホギメディカル	23,200	3,185.00	73,892,000
T S Iホールディングス	58,300	805.00	46,931,500
マツオカコーポレーション	3,200	1,704.00	5,452,800
ワールド	22,300	1,652.00	36,839,600
三陽商会	4,400	1,993.00	8,769,200
ナイガイ	4,400	286.00	1,258,400
オンワードホールディングス	112,200	540.00	60,588,000
ルックホールディングス	3,700	2,017.00	7,462,900
ゴールドウイン	30,600	10,100.00	309,060,000
デサント	29,800	4,345.00	129,481,000
キング	5,300	660.00	3,498,000
ヤマトインターナショナル	9,600	320.00	3,072,000
特種東海製紙	7,700	3,445.00	26,526,500
王子ホールディングス	719,000	627.80	451,388,200
日本製紙	89,900	1,335.00	120,016,500
三菱製紙	13,800	603.00	8,321,400
北越コーポレーション	109,100	1,052.00	114,773,200
中越パルプ工業	4,600	1,374.00	6,320,400
大王製紙	76,200	1,219.00	92,887,800
阿波製紙	2,800	506.00	1,416,800
レンゴー	157,200	1,016.00	159,715,200
トモク	10,000	2,457.00	24,570,000
ザ・パック	12,800	3,160.00	40,448,000
北の達人コーポレーション	72,700	230.00	16,721,000
クラレ	251,500	1,735.00	436,352,500
旭化成	1,077,800	934.20	1,006,880,760
共和レザー	6,600	676.00	4,461,600
巴川製紙所	3,600	666.00	2,397,600
レゾナック・ホールディングス	166,800	2,564.00	427,675,200
住友化学	1,280,400	404.90	518,433,960
住友精化	7,200	4,545.00	32,724,000
日産化学	81,500	6,344.00	517,036,000
ラサ工業	6,700	2,051.00	13,741,700
クレハ	13,800	8,250.00	113,850,000
多木化学	6,700	3,660.00	24,522,000
テイカ	11,600	1,377.00	15,973,200
石原産業	31,200	1,471.00	45,895,200
片倉コープアグリ	2,400	1,134.00	2,721,600
日本曹達	18,500	5,470.00	101,195,000
東ソー	230,400	1,906.00	439,142,400
トクヤマ	55,700	2,337.00	130,170,900
セントラル硝子	27,700	2,960.00	81,992,000

東亜合成	86,500	1,332.50	115,261,250
大阪ソーダ	10,300	6,390.00	65,817,000
関東電化工業	33,400	871.00	29,091,400
デンカ	62,800	2,715.00	170,502,000
信越化学工業	1,434,700	4,362.00	6,258,161,400
日本カーバイド工業	4,400	1,741.00	7,660,400
堺化学工業	13,100	2,054.00	26,907,400
第一稀元素化学工業	15,700	950.00	14,915,000
エア・ウォーター	162,900	1,841.50	299,980,350
日本酸素ホールディングス	167,400	3,475.00	581,715,000
日本化学工業	5,700	1,939.00	11,052,300
東邦アセチレン	2,400	1,598.00	3,835,200
日本パーカライズン	85,400	1,094.00	93,427,600
高压ガス工業	25,100	748.00	18,774,800
チタン工業	1,400	1,415.00	1,981,000
四国化成ホールディングス	22,100	1,613.00	35,647,300
戸田工業	3,900	1,884.00	7,347,600
ステラ ケミファ	10,200	3,100.00	31,620,000
保土谷化学工業	4,900	3,155.00	15,459,500
日本触媒	26,300	5,406.00	142,177,800
大日精化工業	12,000	2,249.00	26,988,000
カネカ	39,400	3,851.00	151,729,400
三菱瓦斯化学	128,900	2,017.50	260,055,750
三井化学	142,300	3,918.00	557,531,400
J S R	161,100	4,012.00	646,333,200
東京応化工業	27,400	8,847.00	242,407,800
大阪有機化学工業	14,400	2,520.00	36,288,000
三菱ケミカルグループ	1,164,700	940.10	1,094,934,470
K Hネオケム	26,300	2,277.00	59,885,100
ダイセル	240,400	1,246.50	299,658,600
住友ベークライト	25,600	6,473.00	165,708,800
積水化学工業	349,900	2,148.00	751,585,200
日本ゼオン	103,500	1,554.50	160,890,750
アイカ工業	43,600	3,298.00	143,792,800
U B E	89,000	2,510.50	223,434,500
積水樹脂	24,000	2,373.00	56,952,000
タキロンシーアイ	37,700	564.00	21,262,800
旭有機材	11,500	3,670.00	42,205,000
ニチバン	10,700	1,804.00	19,302,800
リケンテクノス	37,200	714.00	26,560,800
大倉工業	8,000	2,622.00	20,976,000
積水化成成品工業	24,200	462.00	11,180,400

群栄化学工業	4,100	3,310.00	13,571,000
タイガースポリマー	5,200	682.00	3,546,400
ミライアル	3,500	1,406.00	4,921,000
ダイキアクシス	4,800	734.00	3,523,200
ダイキョーニシカワ	38,100	794.00	30,251,400
竹本容器	4,400	808.00	3,555,200
森六ホールディングス	8,700	2,241.00	19,496,700
恵和	12,400	1,411.00	17,496,400
日本化薬	131,800	1,252.50	165,079,500
カーリットホールディングス	15,500	955.00	14,802,500
日本精化	9,800	2,587.00	25,352,600
扶桑化学工業	16,000	3,865.00	61,840,000
トリケミカル研究所	23,000	2,963.00	68,149,000
A D E K A	60,200	2,587.00	155,737,400
日油	53,400	5,868.00	313,351,200
新日本理化	15,900	229.00	3,641,100
ハリマ化成グループ	8,100	816.00	6,609,600
花王	390,300	5,529.00	2,157,968,700
第一工業製薬	6,200	1,723.00	10,682,600
石原ケミカル	7,900	1,567.00	12,379,300
日華化学	4,600	890.00	4,094,000
ニイタカ	2,100	2,066.00	4,338,600
三洋化成工業	10,600	4,105.00	43,513,000
有機合成薬品工業	8,500	297.00	2,524,500
大日本塗料	21,100	974.00	20,551,400
日本ペイントホールディングス	916,500	1,003.00	919,249,500
関西ペイント	138,400	2,072.50	286,834,000
神東塗料	9,600	133.00	1,276,800
中国塗料	28,400	1,373.00	38,993,200
日本特殊塗料	7,300	1,323.00	9,657,900
藤倉化成	23,200	466.00	10,811,200
太陽ホールディングス	26,200	2,548.00	66,757,600
D I C	67,400	2,413.50	162,669,900
サカタインクス	38,400	1,268.00	48,691,200
東洋インキＳＣホールディングス	37,600	2,317.00	87,119,200
T & K T O K A	15,400	1,419.00	21,852,600
富士フイルムホールディングス	331,600	8,649.00	2,868,008,400
資生堂	360,800	5,223.00	1,884,458,400
ライオン	226,200	1,452.00	328,442,400
高砂香料工業	11,700	2,988.00	34,959,600
マンダム	37,300	1,375.00	51,287,500
ミルボン	23,500	4,108.00	96,538,000

ファンケル	75,600	2,284.00	172,670,400
コーセー	35,100	11,040.00	387,504,000
コタ	15,900	1,597.00	25,392,300
シーボン	1,500	1,537.00	2,305,500
ポーラ・オルビスホールディングス	88,600	1,769.50	156,777,700
ノエビアホールディングス	15,400	5,210.00	80,234,000
アジュバンホールディングス	2,800	930.00	2,604,000
新日本製薬	9,900	1,540.00	15,246,000
アクシージア	8,800	1,093.00	9,618,400
エステー	13,300	1,489.00	19,803,700
アグロ カネショウ	6,900	1,335.00	9,211,500
コニシ	28,900	2,279.00	65,863,100
長谷川香料	33,000	3,020.00	99,660,000
星光PMC	7,000	1,068.00	7,476,000
小林製薬	50,300	6,610.00	332,483,000
荒川化学工業	14,600	1,013.00	14,789,800
メック	14,200	3,685.00	52,327,000
日本高純度化学	4,300	2,561.00	11,012,300
タカラバイオ	46,600	1,350.00	62,910,000
JCU	19,300	3,030.00	58,479,000
新田ゼラチン	7,100	702.00	4,984,200
OATアグリオ	4,300	1,722.00	7,404,600
デクセリアルズ	47,200	3,667.00	173,082,400
アース製薬	15,700	4,910.00	77,087,000
北興化学工業	17,400	951.00	16,547,400
大成ラミック	5,400	2,985.00	16,119,000
クミアイ化学工業	68,700	1,106.00	75,982,200
日本農薬	31,700	652.00	20,668,400
アキレス	10,900	1,466.00	15,979,400
有沢製作所	28,100	1,072.00	30,123,200
日東電工	125,400	9,685.00	1,214,499,000
レック	24,600	947.00	23,296,200
三光合成	21,800	700.00	15,260,000
きもと	16,900	183.00	3,092,700
藤森工業	13,700	3,755.00	51,443,500
前澤化成工業	11,200	1,511.00	16,923,200
未来工業	6,200	3,470.00	21,514,000
ウェーブロックホールディングス	3,400	645.00	2,193,000
JSP	12,100	2,015.00	24,381,500
エフピコ	32,700	2,438.00	79,722,600
天馬	14,100	2,400.00	33,840,000
信越ポリマー	31,900	1,334.00	42,554,600

東リ	25,800	366.00	9,442,800
ニフコ	62,300	3,870.00	241,101,000
バルカー	14,500	4,150.00	60,175,000
ユニ・チャーム	360,000	5,221.00	1,879,560,000
ショーエイコーポレーション	3,300	605.00	1,996,500
協和キリン	208,800	2,565.50	535,676,400
武田薬品工業	1,529,400	4,576.00	6,998,534,400
アステラス製薬	1,632,500	2,074.00	3,385,805,000
住友ファーマ	128,200	516.90	66,266,580
塩野義製薬	217,900	6,591.00	1,436,178,900
わかもと製薬	10,800	221.00	2,386,800
日本新薬	40,700	6,244.00	254,130,800
中外製薬	541,000	4,534.00	2,452,894,000
科研製薬	29,600	3,470.00	102,712,000
エーザイ	210,200	8,291.00	1,742,768,200
ロート製薬	167,400	3,943.00	660,058,200
小野薬品工業	333,400	2,822.00	940,854,800
久光製薬	38,400	5,333.00	204,787,200
持田製薬	19,800	3,285.00	65,043,000
参天製薬	314,900	1,349.50	424,957,550
扶桑薬品工業	5,500	1,960.00	10,780,000
日本ケミファ	1,200	1,872.00	2,246,400
ツムラ	54,400	2,734.00	148,729,600
キッセイ薬品工業	25,400	3,365.00	85,471,000
生化学工業	32,900	801.00	26,352,900
栄研化学	28,100	1,365.00	38,356,500
鳥居薬品	9,300	3,805.00	35,386,500
JCRファーマ	58,500	1,422.00	83,187,000
東和薬品	26,600	2,753.00	73,229,800
富士製薬工業	12,800	1,144.00	14,643,200
ゼリア新薬工業	24,000	2,174.00	52,176,000
そーせいグループ	55,700	1,468.00	81,767,600
第一三共	1,505,500	4,054.00	6,103,297,000
杏林製薬	37,500	1,814.00	68,025,000
大幸薬品	34,200	351.00	12,004,200
ダイト	13,300	2,310.00	30,723,000
大塚ホールディングス	359,400	5,240.00	1,883,256,000
大正製薬ホールディングス	38,400	6,100.00	234,240,000
ペプチドリーム	83,800	1,527.00	127,962,600
あすか製薬ホールディングス	17,700	1,616.00	28,603,200
サワイグループホールディングス	39,500	4,399.00	173,760,500
日本コークス工業	155,900	119.00	18,552,100

ニチレキ	20,400	1,977.00	40,330,800
ユシロ化学工業	9,000	1,495.00	13,455,000
ビーピー・カストロール	4,400	916.00	4,030,400
富士石油	35,300	335.00	11,825,500
MORESCO	3,700	1,181.00	4,369,700
出光興産	191,900	3,350.00	642,865,000
E N E O Sホールディングス	2,931,400	575.30	1,686,434,420
コスモエネルギーホールディングス	68,300	5,232.00	357,345,600
横浜ゴム	87,400	3,079.00	269,104,600
TOYO TIRE	99,300	2,300.00	228,390,000
ブリヂストン	505,900	5,840.00	2,954,456,000
住友ゴム工業	169,500	1,637.50	277,556,250
藤倉コンポジット	8,200	1,176.00	9,643,200
オカモト	9,300	5,120.00	47,616,000
フコク	9,100	1,447.00	13,167,700
ニッタ	17,600	3,400.00	59,840,000
住友理工	33,500	1,106.00	37,051,000
三ツ星ベルト	25,200	4,610.00	116,172,000
バンドー化学	25,600	1,636.00	41,881,600
日東紡績	19,500	3,460.00	67,470,000
A G C	161,300	5,260.00	848,438,000
日本板硝子	88,100	812.00	71,537,200
石塚硝子	1,900	2,675.00	5,082,500
日本山村硝子	4,400	1,768.00	7,779,200
日本電気硝子	70,600	2,818.00	198,950,800
オハラ	8,400	1,293.00	10,861,200
住友大阪セメント	24,400	3,697.00	90,206,800
太平洋セメント	110,100	2,677.00	294,737,700
日本ヒューム	15,400	863.00	13,290,200
日本コンクリート工業	34,100	327.00	11,150,700
三谷セキサン	7,300	4,590.00	33,507,000
アジアパイルホールディングス	27,300	682.00	18,618,600
東海カーボン	159,600	1,180.00	188,328,000
日本カーボン	9,200	4,595.00	42,274,000
東洋炭素	12,200	5,430.00	66,246,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,600	6,280.00	54,008,000
T O T O	114,100	3,876.00	442,251,600
日本碍子	201,000	1,996.00	401,196,000
日本特殊陶業	131,600	3,415.00	449,414,000
M A R U W A	6,400	22,710.00	145,344,000
品川リフラクトリーズ	24,500	1,555.00	38,097,500
黒崎播磨	3,500	9,540.00	33,390,000



ヨータイ	9,500	1,452.00	13,794,000
東京窯業	11,200	331.00	3,707,200
ニッカトー	5,500	605.00	3,327,500
フジインコーポレーテッド	41,400	2,968.00	122,875,200
クニミネ工業	3,600	1,037.00	3,733,200
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,137.00	2,615,100
ニチアス	43,800	3,075.00	134,685,000
ニチハ	21,700	2,921.00	63,385,700
日本製鉄	796,100	3,500.00	2,786,350,000
神戸製鋼所	357,600	1,936.00	692,313,600
中山製鋼所	36,600	895.00	32,757,000
合同製鐵	8,800	4,610.00	40,568,000
JFEホールディングス	494,500	2,221.00	1,098,284,500
東京製鐵	50,000	1,677.00	83,850,000
共英製鋼	20,300	1,978.00	40,153,400
大和工業	29,300	7,144.00	209,319,200
東京鐵鋼	8,500	3,560.00	30,260,000
大阪製鐵	8,200	1,839.00	15,079,800
淀川製鋼所	20,200	3,520.00	71,104,000
中部鋼鈹	14,600	2,063.00	30,119,800
丸一鋼管	54,100	3,692.00	199,737,200
モリ工業	2,700	3,890.00	10,503,000
大同特殊鋼	22,400	6,114.00	136,953,600
日本高周波鋼業	4,000	609.00	2,436,000
日本冶金工業	13,000	4,620.00	60,060,000
山陽特殊製鋼	17,600	2,904.00	51,110,400
愛知製鋼	10,300	3,880.00	39,964,000
日本金属	2,600	886.00	2,303,600
大平洋金属	12,600	1,352.00	17,035,200
新日本電工	88,600	303.00	26,845,800
栗本鐵工所	8,500	2,720.00	23,120,000
虹技	1,500	1,458.00	2,187,000
三菱製鋼	11,200	1,510.00	16,912,000
日亜鋼業	12,200	304.00	3,708,800
日本精線	2,400	4,765.00	11,436,000
エンビプロ・ホールディングス	8,200	684.00	5,608,800
シンニッタン	12,900	247.00	3,186,300
新家工業	2,600	2,809.00	7,303,400
大紀アルミニウム工業所	25,400	1,277.00	32,435,800
日本輕金属ホールディングス	48,000	1,664.00	79,872,000
三井金属鈹業	51,700	3,815.00	197,235,500
東邦亜鉛	10,500	1,639.00	17,209,500

三菱マテリアル	118,600	2,419.50	286,952,700
住友金属鉱山	206,100	4,366.00	899,832,600
DOWAホールディングス	40,000	4,605.00	184,200,000
古河機械金属	26,100	1,701.00	44,396,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,100	3,020.00	78,822,000
東邦チタニウム	32,200	1,745.00	56,189,000
UACJ	24,900	3,160.00	78,684,000
CKサンエツ	4,300	3,610.00	15,523,000
古河電気工業	59,200	2,376.00	140,659,200
住友電気工業	613,900	1,801.00	1,105,633,900
フジクラ	190,700	1,210.00	230,747,000
SWCC	19,900	2,145.00	42,685,500
タツタ電線	36,300	700.00	25,410,000
カナレ電気	2,100	1,464.00	3,074,400
平河ヒューテック	10,300	1,414.00	14,564,200
リョービ	19,000	3,015.00	57,285,000
アーレスティ	13,200	838.00	11,061,600
AREホールディングス	71,900	1,887.00	135,675,300
稲葉製作所	9,200	1,543.00	14,195,600
宮地エンジニアリンググループ	9,800	3,010.00	29,498,000
トーカロ	47,300	1,368.00	64,706,400
アルファCo	4,300	1,572.00	6,759,600
SUMCO	315,900	1,981.50	625,955,850
川田テクノロジーズ	4,200	6,260.00	26,292,000
RS Technologies	11,900	2,897.00	34,474,300
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,656.00	4,249,600
信和	6,500	751.00	4,881,500
東洋製罐グループホールディングス	106,000	2,526.00	267,756,000
ホッカンホールディングス	9,500	1,513.00	14,373,500
コロナ	9,900	932.00	9,226,800
横河ブリッジホールディングス	22,300	2,788.00	62,172,400
駒井ハルテック	1,900	1,975.00	3,752,500
高田機工	1,000	3,255.00	3,255,000
三和ホールディングス	163,700	1,983.00	324,617,100
文化シャッター	51,200	1,103.00	56,473,600
三協立山	20,300	944.00	19,163,200
アルインコ	13,600	1,079.00	14,674,400
東洋シャッター	2,700	642.00	1,733,400
LIXIL	259,000	1,741.50	451,048,500
日本フィルコン	7,700	478.00	3,680,600
ノーリツ	29,500	1,584.00	46,728,000
長府製作所	17,700	2,073.00	36,692,100

リンナイ	96,700	2,800.00	270,760,000
ダイニチ工業	5,900	731.00	4,312,900
日東精工	25,800	604.00	15,583,200
三洋工業	1,400	2,082.00	2,914,800
岡部	31,800	750.00	23,850,000
ジーテクト	19,800	1,823.00	36,095,400
東プレ	31,300	1,704.00	53,335,200
高周波熱錬	27,400	1,020.00	27,948,000
東京製綱	10,500	1,367.00	14,353,500
サンコール	10,500	493.00	5,176,500
モリテック スチール	8,700	311.00	2,705,700
パイオラックス	24,500	2,295.00	56,227,500
エイチワン	18,300	871.00	15,939,300
日本発條	157,300	1,130.00	177,749,000
中央発條	13,200	796.00	10,507,200
アドバネクス	1,400	1,003.00	1,404,200
立川ブラインド工業	8,000	1,424.00	11,392,000
三益半導体工業	13,700	2,688.00	36,825,600
日本ドライケミカル	2,800	2,102.00	5,885,600
日本製鋼所	48,000	2,764.00	132,672,000
三浦工業	72,700	2,977.00	216,427,900
タクマ	53,600	1,549.00	83,026,400
ツガミ	38,800	1,153.00	44,736,400
オークマ	17,400	6,641.00	115,553,400
芝浦機械	17,400	4,175.00	72,645,000
アマダ	277,800	1,506.50	418,505,700
アイダエンジニアリング	35,900	995.00	35,720,500
TAKISAWA	3,100	2,594.00	8,041,400
FUJ I	75,700	2,334.50	176,721,650
牧野フライス製作所	19,300	6,510.00	125,643,000
オーエスジー	76,800	1,785.00	137,088,000
ダイジェット工業	1,300	936.00	1,216,800
旭ダイヤモンド工業	48,700	893.00	43,489,100
D M G 森精機	105,500	2,547.50	268,761,250
ソディック	42,500	761.00	32,342,500
ディスコ	83,800	28,140.00	2,358,132,000
日東工器	8,500	1,973.00	16,770,500
日進工具	14,600	1,031.00	15,052,600
パンチ工業	10,600	437.00	4,632,200
富士ダイス	5,500	635.00	3,492,500
豊和工業	6,400	778.00	4,979,200
リケン N P R	17,778	1,740.00	30,933,720

東洋機械金属	8,100	686.00	5,556,600
エンシュウ	2,600	758.00	1,970,800
島精機製作所	27,700	1,745.00	48,336,500
オプトラン	28,600	1,827.00	52,252,200
NCホールディングス	2,400	1,589.00	3,813,600
イワキポンプ	11,600	1,831.00	21,239,600
フリュー	18,300	1,532.00	28,035,600
ヤマシンフィルタ	41,700	342.00	14,261,400
日阪製作所	16,900	955.00	16,139,500
やまびこ	28,500	1,427.00	40,669,500
野村マイクロ・サイエンス	5,900	5,880.00	34,692,000
平田機工	8,300	7,540.00	62,582,000
P E G A S U S	19,300	610.00	11,773,000
マルマエ	7,600	1,758.00	13,360,800
タツモ	10,500	3,055.00	32,077,500
ナプテスコ	109,300	2,723.00	297,623,900
三井海洋開発	22,100	1,826.00	40,354,600
レオン自動機	18,300	1,309.00	23,954,700
S M C	56,400	68,220.00	3,847,608,000
ホソカワミクロン	11,200	4,095.00	45,864,000
ユニオンツール	7,700	3,870.00	29,799,000
瑞光	12,600	1,229.00	15,485,400
オイレス工業	24,300	2,004.00	48,697,200
日精エー・エス・ビー機械	6,900	4,450.00	30,705,000
サトーホールディングス	24,800	2,122.00	52,625,600
技研製作所	16,400	1,985.00	32,554,000
日本エアーテック	8,200	1,317.00	10,799,400
カワタ	3,400	1,114.00	3,787,600
日精樹脂工業	13,000	1,027.00	13,351,000
オカダアイヨン	3,600	2,054.00	7,394,400
ワイエイシイホールディングス	4,900	2,529.00	12,392,100
小松製作所	815,500	4,039.00	3,293,804,500
住友重機械工業	103,000	3,721.00	383,263,000
日立建機	69,300	4,608.00	319,334,400
日工	25,900	655.00	16,964,500
巴工業	6,800	3,110.00	21,148,000
井関農機	16,400	1,173.00	19,237,200
T O W A	17,800	4,280.00	76,184,000
丸山製作所	2,000	2,261.00	4,522,000
北川鉄工所	6,900	1,605.00	11,074,500
ローツェ	9,100	10,000.00	91,000,000
タカキタ	3,400	474.00	1,611,600

クボタ	913,300	2,182.00	1,992,820,600
荏原実業	9,200	2,689.00	24,738,800
三菱化工機	5,600	2,756.00	15,433,600
月島ホールディングス	23,600	1,315.00	31,034,000
帝国電機製作所	12,300	2,518.00	30,971,400
新東工業	35,300	1,077.00	38,018,100
澁谷工業	16,400	2,506.00	41,098,400
アイチ コーポレーション	24,300	1,007.00	24,470,100
小森コーポレーション	40,400	1,059.00	42,783,600
鶴見製作所	13,300	2,985.00	39,700,500
日本ギア工業	4,000	385.00	1,540,000
酒井重工業	1,900	5,360.00	10,184,000
荏原製作所	71,400	6,911.00	493,445,400
石井鐵工所	1,400	3,035.00	4,249,000
西島製作所	15,000	1,900.00	28,500,000
北越工業	17,500	2,061.00	36,067,500
ダイキン工業	207,800	23,650.00	4,914,470,000
オルガノ	23,900	4,170.00	99,663,000
トーヨーカネツ	6,600	3,335.00	22,011,000
栗田工業	97,400	5,184.00	504,921,600
椿本チエイン	24,700	3,895.00	96,206,500
大同工業	4,800	781.00	3,748,800
木村化工機	13,400	735.00	9,849,000
アネスト岩田	29,600	1,195.00	35,372,000
ダイフク	269,300	2,819.50	759,291,350
サムコ	4,700	4,325.00	20,327,500
加藤製作所	5,500	1,289.00	7,089,500
油研工業	1,800	2,284.00	4,111,200
タダノ	100,200	1,259.00	126,151,800
フジテック	61,000	3,428.00	209,108,000
C K D	48,200	2,068.00	99,677,600
平和	57,900	2,172.00	125,758,800
理想科学工業	13,900	2,313.00	32,150,700
S A N K Y O	34,200	6,950.00	237,690,000
日本金銭機械	19,200	994.00	19,084,800
マースグループホールディングス	10,300	2,735.00	28,170,500
フクシマガリレイ	12,800	4,800.00	61,440,000
オーイズミ	4,500	401.00	1,804,500
ダイコク電機	9,500	5,290.00	50,255,000
竹内製作所	31,600	4,855.00	153,418,000
アマノ	49,400	3,270.00	161,538,000
J U K I	27,100	620.00	16,802,000

ジャノメ	17,700	756.00	13,381,200
マックス	21,500	2,692.00	57,878,000
グローリー	41,800	2,956.50	123,581,700
新晃工業	17,600	2,240.00	39,424,000
大和冷機工業	26,700	1,372.00	36,632,400
セガサミーホールディングス	139,900	2,698.50	377,520,150
T P R	19,900	1,819.00	36,198,100
ツバキ・ナカシマ	34,900	777.00	27,117,300
ホシザキ	102,700	5,178.00	531,780,600
大豊工業	15,100	885.00	13,363,500
日本精工	290,100	850.40	246,701,040
N T N	343,100	284.70	97,680,570
ジェイテクト	154,900	1,395.00	216,085,500
不二越	12,900	4,045.00	52,180,500
日本トムソン	42,700	561.00	23,954,700
T H K	100,400	2,753.50	276,451,400
ユーシン精機	13,900	682.00	9,479,800
前澤給装工業	12,300	1,225.00	15,067,500
イーグル工業	19,300	1,689.00	32,597,700
前澤工業	6,700	1,024.00	6,860,800
日本ピラー工業	16,200	3,910.00	63,342,000
キッツ	58,300	1,038.00	60,515,400
マキタ	216,500	3,698.00	800,617,000
三井E & S	83,400	572.00	47,704,800
日立造船	142,700	821.00	117,156,700
三菱重工業	304,400	8,170.00	2,486,948,000
I H I	109,700	3,131.00	343,470,700
スター精密	32,900	1,900.00	62,510,000
日清紡ホールディングス	130,800	1,123.00	146,888,400
イビデン	99,900	8,045.00	803,695,500
コニカミノルタ	389,400	476.80	185,665,920
ブラザー工業	232,700	2,402.50	559,061,750
ミネベアミツミ	302,900	2,435.50	737,712,950
日立製作所	846,300	9,298.00	7,868,897,400
三菱電機	1,798,700	1,835.50	3,301,513,850
富士電機	105,800	6,721.00	711,081,800
東洋電機製造	3,800	985.00	3,743,000
安川電機	206,200	5,480.00	1,129,976,000
シンフォニアテクノロジー	19,200	1,622.00	31,142,400
明電舎	26,400	2,255.00	59,532,000
オリジン	2,600	1,254.00	3,260,400
山洋電気	7,600	6,870.00	52,212,000

デンヨー	13,300	2,140.00	28,462,000
P H C ホールディングス	24,600	1,502.00	36,949,200
ソシオネクスト	24,700	14,590.00	360,373,000
東芝テック	26,000	3,355.00	87,230,000
芝浦メカトロニクス	9,000	7,130.00	64,170,000
マブチモーター	43,300	4,503.00	194,979,900
ニデック	423,500	6,894.00	2,919,609,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,500	483.00	6,520,500
トレックス・セミコンダクター	8,400	2,136.00	17,942,400
東光高岳	10,700	2,093.00	22,395,100
ダブル・スコープ	49,800	1,018.00	50,696,400
ダイヘン	15,700	4,960.00	77,872,000
ヤーマン	30,400	1,006.00	30,582,400
J V C ケンウッド	159,100	701.00	111,529,100
ミマキエンジニアリング	17,000	767.00	13,039,000
I - P E X	12,300	1,541.00	18,954,300
大崎電気工業	41,300	665.00	27,464,500
オムロン	159,500	6,583.00	1,049,988,500
日東工業	23,500	3,605.00	84,717,500
I D E C	25,700	2,916.00	74,941,200
正興電機製作所	4,200	1,186.00	4,981,200
不二電機工業	2,600	1,111.00	2,888,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,300	2,664.50	152,675,850
サクサホールディングス	2,400	2,390.00	5,736,000
メルコホールディングス	4,500	3,125.00	14,062,500
テクノメディカ	4,400	2,166.00	9,530,400
日本電気	246,100	8,174.00	2,011,621,400
富士通	173,400	17,560.00	3,044,904,000
沖電気工業	78,700	1,003.00	78,936,100
岩崎通信機	5,100	790.00	4,029,000
電気興業	7,000	2,416.00	16,912,000
サンケン電気	16,200	9,050.00	146,610,000
ナカヨ	1,900	1,217.00	2,312,300
アイホン	10,600	3,005.00	31,853,000
ルネサスエレクトロニクス	1,135,900	2,280.00	2,589,852,000
セイコーエプソン	223,300	2,337.00	521,852,100
ワコム	132,900	581.00	77,214,900
アルバック	41,300	5,441.00	224,713,300
アクセル	4,500	1,820.00	8,190,000
E I Z O	12,700	5,090.00	64,643,000
日本信号	39,600	935.00	37,026,000
京三製作所	36,400	489.00	17,799,600

能美防災	23,700	1,756.00	41,617,200
ホーチキ	13,200	1,632.00	21,542,400
星和電機	5,900	503.00	2,967,700
エレコム	41,800	1,755.00	73,359,000
パナソニック ホールディングス	2,055,600	1,680.00	3,453,408,000
シャープ	209,500	949.00	198,815,500
アンリツ	122,600	1,063.00	130,323,800
富士通ゼネラル	49,300	2,772.00	136,659,600
ソニーグループ	1,218,900	12,205.00	14,876,674,500
T D K	275,600	5,591.00	1,540,879,600
帝国通信工業	8,000	1,848.00	14,784,000
タムラ製作所	74,700	551.00	41,159,700
アルプスアルパイン	155,700	1,270.00	197,739,000
池上通信機	3,700	815.00	3,015,500
日本電波工業	21,100	1,371.00	28,928,100
鈴木	9,600	1,180.00	11,328,000
メイコー	19,100	3,260.00	62,266,000
日本トリム	4,000	2,964.00	11,856,000
ローランド ディー . ジー .	9,600	3,400.00	32,640,000
フォスター電機	16,100	990.00	15,939,000
S M K	4,200	2,452.00	10,298,400
ヨコオ	14,100	1,577.00	22,235,700
ホシデン	40,800	1,952.00	79,641,600
ヒロセ電機	28,000	17,175.00	480,900,000
日本航空電子工業	35,700	2,998.00	107,028,600
T O A	19,800	1,150.00	22,770,000
マクセル	35,400	1,688.00	59,755,200
古野電気	22,900	1,370.00	31,373,000
スミダコーポレーション	23,500	1,461.00	34,333,500
アイコム	6,700	3,305.00	22,143,500
リオン	7,300	2,281.00	16,651,300
横河電機	190,400	2,860.50	544,639,200
新電元工業	6,700	3,025.00	20,267,500
アズビル	120,400	4,651.00	559,980,400
東亜ディーケーケー	5,800	864.00	5,011,200
日本光電工業	79,700	3,677.00	293,056,900
チノー	7,200	2,047.00	14,738,400
共和電業	10,700	377.00	4,033,900
日本電子材料	11,400	1,371.00	15,629,400
堀場製作所	32,900	8,095.00	266,325,500
アドバンテスト	543,200	4,301.00	2,336,303,200
小野測器	5,500	456.00	2,508,000



エスベック	13,900	2,361.00	32,817,900
キーエンス	172,400	55,520.00	9,571,648,000
日置電機	8,200	7,200.00	59,040,000
シスメックス	148,700	7,094.00	1,054,877,800
日本マイクロニクス	31,100	2,226.00	69,228,600
メガチップス	14,200	4,175.00	59,285,000
O B A R A G R O U P	9,500	3,820.00	36,290,000
澤藤電機	1,600	1,255.00	2,008,000
原田工業	5,500	833.00	4,581,500
コーセル	21,000	1,214.00	25,494,000
イリソ電子工業	15,900	4,070.00	64,713,000
オブテックスグループ	31,800	1,600.00	50,880,000
千代田インテグレ	6,900	2,768.00	19,099,200
レーザーテック	79,000	23,655.00	1,868,745,000
スタンレー電気	121,500	2,353.50	285,950,250
ウシオ電機	87,700	1,838.50	161,236,450
岡谷電機産業	10,000	307.00	3,070,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,400	409.00	4,662,600
エノモト	3,100	1,662.00	5,152,200
日本セラミック	15,200	2,683.00	40,781,600
遠藤照明	5,400	1,278.00	6,901,200
古河電池	13,000	968.00	12,584,000
双信電機	5,700	338.00	1,926,600
山一電機	14,300	1,737.00	24,839,100
図研	15,100	3,665.00	55,341,500
日本電子	43,200	4,639.00	200,404,800
カシオ計算機	128,400	1,255.50	161,206,200
ファナック	840,200	3,953.00	3,321,310,600
日本シイエムケイ	37,100	650.00	24,115,000
エンプラス	5,100	10,770.00	54,927,000
大真空	21,500	758.00	16,297,000
ローム	318,800	2,825.50	900,769,400
浜松ホトニクス	138,300	6,232.00	861,885,600
三井ハイテック	17,800	7,500.00	133,500,000
新光電気工業	61,000	5,719.00	348,859,000
京セラ	267,700	7,542.00	2,018,993,400
太陽誘電	84,000	4,049.00	340,116,000
村田製作所	1,567,800	2,732.00	4,283,229,600
双葉電子工業	33,500	530.00	17,755,000
北陸電気工業	4,500	1,442.00	6,489,000
ニチコン	35,500	1,376.00	48,848,000
日本ケミコン	17,300	1,578.00	27,299,400

K O A	26,300	1,794.00	47,182,200
市光工業	31,700	567.00	17,973,900
小糸製作所	207,400	2,290.50	475,049,700
ミツバ	32,300	760.00	24,548,000
S C R E E Nホールディングス	59,000	7,512.00	443,208,000
キャノン電子	19,200	1,907.00	36,614,400
キャノン	859,400	3,582.00	3,078,370,800
リコー	432,000	1,292.50	558,360,000
象印マホービン	48,400	1,803.00	87,265,200
M U T O Hホールディングス	1,700	2,025.00	3,442,500
東京エレクトロン	364,700	20,180.00	7,359,646,000
イノテック	11,700	1,602.00	18,743,400
トヨタ紡織	72,600	2,713.50	197,000,100
芦森工業	2,200	2,300.00	5,060,000
ユニプレス	31,000	1,159.00	35,929,000
豊田自動織機	126,000	11,710.00	1,475,460,000
モリタホールディングス	30,300	1,594.00	48,298,200
三櫻工業	26,400	986.00	26,030,400
デンソー	1,421,600	2,404.50	3,418,237,200
東海理化電機製作所	48,600	2,339.00	113,675,400
川崎重工業	129,800	3,603.00	467,669,400
名村造船所	29,500	849.00	25,045,500
日本車輛製造	6,600	2,062.00	13,609,200
三菱ロジスネクスト	27,500	1,310.00	36,025,000
近畿車輛	1,600	2,221.00	3,553,600
日産自動車	2,447,700	663.00	1,622,825,100
いすゞ自動車	501,000	1,868.00	935,868,000
トヨタ自動車	9,461,500	2,687.00	25,423,050,500
日野自動車	222,100	574.20	127,529,820
三菱自動車工業	672,200	658.30	442,509,260
エフテック	8,100	817.00	6,617,700
レシップホールディングス	4,500	540.00	2,430,000
G M B	2,300	2,001.00	4,602,300
ファルテック	2,000	578.00	1,156,000
武蔵精密工業	42,200	1,628.00	68,701,600
日産車体	30,400	845.00	25,688,000
新明和工業	54,100	1,261.00	68,220,100
極東開発工業	28,500	1,753.00	49,960,500
トピー工業	14,000	2,530.00	35,420,000
ティラド	4,400	2,210.00	9,724,000
曙ブレーキ工業	105,200	139.00	14,622,800
タチエス	27,300	1,722.00	47,010,600

NOK	67,000	2,003.50	134,234,500
フタバ産業	46,300	763.00	35,326,900
カヤバ	16,600	4,840.00	80,344,000
大同メタル工業	33,900	561.00	19,017,900
プレス工業	77,100	687.00	52,967,700
ミクニ	13,400	488.00	6,539,200
太平洋工業	39,600	1,416.00	56,073,600
アイシン	132,900	5,661.00	752,346,900
マツダ	570,000	1,707.50	973,275,000
今仙電機製作所	7,400	653.00	4,832,200
本田技研工業	4,202,100	1,688.50	7,095,245,850
スズキ	316,500	5,950.00	1,883,175,000
S U B A R U	545,200	2,923.50	1,593,892,200
安永	5,100	802.00	4,090,200
ヤマハ発動機	248,200	3,943.00	978,652,600
T B K	11,600	421.00	4,883,600
エクセディ	28,200	2,638.00	74,391,600
豊田合成	50,300	3,195.00	160,708,500
愛三工業	28,600	1,326.00	37,923,600
盟和産業	1,700	1,010.00	1,717,000
日本プラスト	9,300	488.00	4,538,400
ヨロズ	16,300	985.00	16,055,500
エフ・シー・シー	30,600	1,886.00	57,711,600
シマノ	70,000	20,050.00	1,403,500,000
テイ・エス テック	78,900	1,703.50	134,406,150
ジャムコ	6,300	1,531.00	9,645,300
テルモ	530,000	3,903.00	2,068,590,000
クリエートメディック	3,800	904.00	3,435,200
日機装	40,100	999.00	40,059,900
日本エム・ディ・エム	10,300	733.00	7,549,900
島津製作所	209,900	3,960.00	831,204,000
J M S	16,000	535.00	8,560,000
長野計器	12,500	2,510.00	31,375,000
ブイ・テクノロジー	8,400	2,068.00	17,371,200
東京計器	13,200	1,440.00	19,008,000
愛知時計電機	6,700	1,707.00	11,436,900
インターアクション	8,200	1,011.00	8,290,200
オーバル	10,200	434.00	4,426,800
東京精密	37,900	7,530.00	285,387,000
マニー	68,900	1,817.00	125,191,300
ニコン	249,100	1,567.00	390,339,700
トプコン	90,700	1,651.50	149,791,050

オリンパス	1,060,700	1,950.50	2,068,895,350
理研計器	10,700	6,040.00	64,628,000
タムロン	10,600	4,530.00	48,018,000
H O Y A	365,100	15,160.00	5,534,916,000
シード	5,800	819.00	4,750,200
ノーリツ銅機	16,300	3,370.00	54,931,000
A & Dホロンホールディングス	25,100	1,680.00	42,168,000
朝日インテック	192,500	2,603.50	501,173,750
シチズン時計	158,500	926.00	146,771,000
リズム	3,600	2,031.00	7,311,600
大研医器	8,700	519.00	4,515,300
メニコン	59,200	1,887.00	111,710,400
シンシア	1,400	562.00	786,800
松風	7,800	2,141.00	16,699,800
セイコーグループ	26,700	2,568.00	68,565,600
ニプロ	143,600	1,144.50	164,350,200
K Y O R I T S U	17,100	193.00	3,300,300
中本パックス	3,500	1,650.00	5,775,000
スノーピーク	24,600	1,139.00	28,019,400
パラマウントベッドホールディングス	39,800	2,344.00	93,291,200
トランザクション	11,400	1,781.00	20,303,400
粧美堂	3,100	480.00	1,488,000
ニホンフラッシュ	16,100	884.00	14,232,400
前田工織	14,600	2,921.00	42,646,600
永大産業	12,200	224.00	2,732,800
アートネイチャー	17,700	826.00	14,620,200
バンダイナムコホールディングス	472,100	3,081.00	1,454,540,100
アイフィスジャパン	3,200	641.00	2,051,200
S H O E I	38,900	2,282.00	88,769,800
フランスベッドホールディングス	19,800	1,207.00	23,898,600
パイロットコーポレーション	24,200	5,175.00	125,235,000
萩原工業	11,500	1,860.00	21,390,000
フジシールインターナショナル	34,900	1,773.00	61,877,700
タカラトミー	78,400	2,092.00	164,012,800
広済堂ホールディングス	7,700	2,939.00	22,630,300
エステールホールディングス	2,700	628.00	1,695,600
タカノ	4,300	867.00	3,728,100
プロネクサス	14,300	1,142.00	16,330,600
ホクシン	8,800	127.00	1,117,600
ウッドワン	3,800	1,059.00	4,024,200
大建工業	10,500	2,994.00	31,437,000
T O P P A Nホールディングス	211,800	3,494.00	740,029,200

大日本印刷	188,300	3,868.00	728,344,400
共同印刷	4,900	3,115.00	15,263,500
N I S S H A	29,500	1,652.00	48,734,000
光村印刷	1,000	1,332.00	1,332,000
T A K A R A & C O M P A N Y	11,000	2,423.00	26,653,000
アシックス	146,800	5,163.00	757,928,400
ツツミ	3,000	2,383.00	7,149,000
ローランド	12,700	4,130.00	52,451,000
小松ウオール工業	6,300	2,908.00	18,320,400
ヤマハ	108,600	4,087.00	443,848,200
河合楽器製作所	4,600	3,580.00	16,468,000
クリナップ	19,300	710.00	13,703,000
ピジョン	109,700	1,665.00	182,650,500
キングジム	15,200	875.00	13,300,000
リンテック	34,600	2,408.00	83,316,800
イトーキ	35,300	1,494.00	52,738,200
任天堂	1,087,900	6,130.00	6,668,827,000
三菱鉛筆	24,500	1,919.00	47,015,500
タカラスタANDARD	31,700	1,847.00	58,549,900
コクヨ	74,700	2,359.00	176,217,300
ナカバヤシ	18,600	517.00	9,616,200
グローブライド	13,900	2,026.00	28,161,400
オカムラ	51,900	2,194.00	113,868,600
美津濃	17,100	4,645.00	79,429,500
東京電力ホールディングス	1,553,300	650.00	1,009,645,000
中部電力	635,000	1,894.00	1,202,690,000
関西電力	665,400	2,061.50	1,371,722,100
中国電力	274,400	912.40	250,362,560
北陸電力	162,600	791.50	128,697,900
東北電力	421,300	949.60	400,066,480
四国電力	147,100	1,017.00	149,600,700
九州電力	397,200	956.20	379,802,640
北海道電力	166,500	646.60	107,658,900
沖縄電力	40,400	1,105.00	44,642,000
電源開発	129,700	2,403.00	311,669,100
エフオン	11,200	494.00	5,532,800
イーレックス	30,600	759.00	23,225,400
レノバ	45,900	1,116.00	51,224,400
東京瓦斯	364,300	3,375.00	1,229,512,500
大阪瓦斯	349,000	2,435.00	849,815,000
東邦瓦斯	67,800	2,573.50	174,483,300
北海道瓦斯	10,300	2,360.00	24,308,000

広島ガス	36,400	388.00	14,123,200
西部ガスホールディングス	16,200	1,930.00	31,266,000
静岡ガス	36,300	1,005.00	36,481,500
メタウォーター	20,600	1,848.00	38,068,800
SBSホールディングス	15,400	2,761.00	42,519,400
東武鉄道	189,300	3,784.00	716,311,200
相鉄ホールディングス	56,900	2,897.00	164,839,300
東急	483,200	1,701.00	821,923,200
京浜急行電鉄	195,500	1,262.50	246,818,750
小田急電鉄	261,200	2,217.50	579,211,000
京王電鉄	91,100	5,128.00	467,160,800
京成電鉄	111,100	5,127.00	569,609,700
富士急行	21,200	4,550.00	96,460,000
東日本旅客鉄道	292,200	8,300.00	2,425,260,000
西日本旅客鉄道	220,100	6,114.00	1,345,691,400
東海旅客鉄道	663,500	3,568.00	2,367,368,000
西武ホールディングス	208,400	1,424.50	296,865,800
鴻池運輸	29,400	1,948.00	57,271,200
西日本鉄道	46,000	2,487.50	114,425,000
ハマキョウレックス	13,500	4,025.00	54,337,500
サカイ引越センター	16,400	2,499.00	40,983,600
近鉄グループホールディングス	172,000	4,209.00	723,948,000
阪急阪神ホールディングス	229,400	5,050.00	1,158,470,000
南海電気鉄道	82,200	2,863.50	235,379,700
京阪ホールディングス	94,800	3,879.00	367,729,200
神戸電鉄	4,700	2,955.00	13,888,500
名古屋鉄道	190,100	2,151.00	408,905,100
山陽電気鉄道	13,000	2,139.00	27,807,000
アルプス物流	13,700	1,593.00	21,824,100
ヤマトホールディングス	220,300	2,413.00	531,583,900
山九	43,800	5,157.00	225,876,600
丸運	5,600	255.00	1,428,000
丸全昭和運輸	10,600	3,815.00	40,439,000
センコーグループホールディングス	91,100	1,061.00	96,657,100
トナミホールディングス	3,800	4,635.00	17,613,000
ニッコンホールディングス	55,100	3,145.00	173,289,500
日本石油輸送	1,200	2,693.00	3,231,600
福山通運	13,100	3,920.00	51,352,000
セイノーホールディングス	96,700	2,116.50	204,665,550
エスライングループ本社	3,200	880.00	2,816,000
神奈川中央交通	4,900	3,145.00	15,410,500
AZ-COM丸和ホールディングス	41,500	2,095.00	86,942,500

C & F ロジホールディングス	16,600	1,304.00	21,646,400
九州旅客鉄道	121,600	3,141.00	381,945,600
S Gホールディングス	330,100	1,902.00	627,850,200
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	58,400	7,768.00	453,651,200
日本郵船	460,500	3,910.00	1,800,555,000
商船三井	303,600	4,111.00	1,248,099,600
川崎汽船	129,500	5,213.00	675,083,500
N S ユナイテッド海運	9,600	4,005.00	38,448,000
飯野海運	64,400	1,065.00	68,586,000
共栄タンカー	3,500	836.00	2,926,000
乾汽船	22,800	1,280.00	29,184,000
日本航空	422,500	2,853.00	1,205,392,500
A N Aホールディングス	468,100	3,051.00	1,428,173,100
パスコ	2,200	1,683.00	3,702,600
トランコム	5,000	7,350.00	36,750,000
日新	13,100	2,685.00	35,173,500
三菱倉庫	37,000	3,953.00	146,261,000
三井倉庫ホールディングス	16,100	4,320.00	69,552,000
住友倉庫	46,400	2,392.00	110,988,800
澁澤倉庫	6,900	2,968.00	20,479,200
東陽倉庫	3,040	1,475.00	4,484,000
日本トランスシティ	34,600	655.00	22,663,000
ケイヒン	2,000	1,985.00	3,970,000
中央倉庫	8,300	1,089.00	9,038,700
川西倉庫	1,900	1,070.00	2,033,000
安田倉庫	11,700	1,053.00	12,320,100
ファイズホールディングス	2,100	1,138.00	2,389,800
東洋埠頭	3,300	1,400.00	4,620,000
上組	82,500	3,084.00	254,430,000
サンリツ	2,600	732.00	1,903,200
キムラユニティー	5,500	1,362.00	7,491,000
キューソー流通システム	5,900	979.00	5,776,100
東海運	6,700	287.00	1,922,900
エーアイティー	10,800	1,757.00	18,975,600
内外トランスライン	6,900	2,443.00	16,856,700
日本コンセプト	6,300	1,767.00	11,132,100
N E C ネットズエスアイ	57,700	1,952.00	112,630,400
クロスキャット	9,900	1,017.00	10,068,300
システナ	290,700	268.00	77,907,600
デジタルアーツ	10,900	4,605.00	50,194,500
日鉄ソリューションズ	29,500	4,255.00	125,522,500
キューブシステム	10,300	1,124.00	11,577,200

コア	7,700	1,699.00	13,082,300
手間いらず	2,900	2,470.00	7,163,000
ラクーンホールディングス	14,400	742.00	10,684,800
ソリトンシステムズ	8,900	1,146.00	10,199,400
ソフトクリエイトホールディングス	14,200	1,736.00	24,651,200
T I S	189,000	3,245.00	613,305,000
テクミラホールディングス	5,400	435.00	2,349,000
グリー	46,400	586.00	27,190,400
G M O ペパボ	2,300	1,320.00	3,036,000
コーエーテクモホールディングス	108,300	2,084.00	225,697,200
三菱総合研究所	8,500	4,785.00	40,672,500
電算	1,400	1,563.00	2,188,200
A G S	4,900	695.00	3,405,500
ファインデックス	13,800	749.00	10,336,200
ブレインパッド	13,000	882.00	11,466,000
K L a b	31,800	277.00	8,808,600
ポールトゥウィンホールディングス	29,600	506.00	14,977,600
ネクソン	385,400	2,683.50	1,034,220,900
アイスタイル	51,300	494.00	25,342,200
エムアップホールディングス	21,200	1,286.00	27,263,200
エイチーム	10,300	592.00	6,097,600
エニグモ	22,100	353.00	7,801,300
テクノスジャパン	9,500	754.00	7,163,000
コロプラ	67,100	580.00	38,918,000
ブロードリーフ	94,600	491.00	46,448,600
クロス・マーケティンググループ	7,000	725.00	5,075,000
デジタルハーツホールディングス	10,800	990.00	10,692,000
システム情報	13,800	927.00	12,792,600
メディアドゥ	6,800	1,153.00	7,840,400
じげん	50,500	516.00	26,058,000
ブイキューブ	20,800	386.00	8,028,800
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	506.00	1,416,800
サイバーリンクス	4,400	769.00	3,383,600
フィックスターズ	19,500	1,123.00	21,898,500
C A R T A H O L D I N G S	8,100	1,255.00	10,165,500
オブティム	14,300	847.00	12,112,100
セレス	7,000	937.00	6,559,000
S H I F T	11,500	26,530.00	305,095,000
ティーガイア	18,100	1,756.00	31,783,600
セック	1,600	3,545.00	5,672,000
テクマトリックス	31,600	1,605.00	50,718,000
プロシップ	7,600	1,246.00	9,469,600



ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,000	2,312.00	104,040,000
GMOペイメントゲートウェイ	34,500	7,954.00	274,413,000
ザッパラス	3,200	474.00	1,516,800
システムリサーチ	5,400	2,897.00	15,643,800
インターネットイニシアティブ	94,400	2,380.50	224,719,200
さくらインターネット	19,400	1,167.00	22,639,800
ヴィンクス	2,800	1,284.00	3,595,200
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	2,650.00	14,045,000
SRAホールディングス	8,800	3,430.00	30,184,000
システムインテグレータ	3,500	421.00	1,473,500
朝日ネット	18,600	619.00	11,513,400
eBASE	24,400	652.00	15,908,800
アバントグループ	21,900	1,299.00	28,448,100
アドソル日進	7,300	1,694.00	12,366,200
ODKソリューションズ	2,600	572.00	1,487,200
フリービット	9,100	1,180.00	10,738,000
コムチュア	22,900	2,268.00	51,937,200
サイバーコム	1,900	1,323.00	2,513,700
アステリア	13,600	696.00	9,465,600
アイル	8,100	3,785.00	30,658,500
マークライنز	9,400	2,837.00	26,667,800
メディカル・データ・ビジョン	20,700	788.00	16,311,600
gumi	25,500	481.00	12,265,500
ショーケース	2,800	374.00	1,047,200
モバイルファクトリー	2,500	799.00	1,997,500
テラスカイ	7,500	1,968.00	14,760,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,000	1,801.00	18,010,000
PCIホールディングス	4,400	1,054.00	4,637,600
アイビーシー	1,800	593.00	1,067,400
ネオジャパン	5,800	1,011.00	5,863,800
PR TIMES	4,400	1,727.00	7,598,800
ラクス	81,800	2,022.50	165,440,500
ランドコンピュータ	2,800	1,294.00	3,623,200
ダブルスタンダード	7,000	1,639.00	11,473,000
オープンドア	12,100	848.00	10,260,800
アカツキ	8,200	2,132.00	17,482,400
ベネフィットジャパン	700	1,241.00	868,700
Ubicomホールディングス	5,400	1,310.00	7,074,000
カナミックネットワーク	18,700	518.00	9,686,600
ノムラシステムコーポレーション	12,900	115.00	1,483,500
チェンジホールディングス	42,300	1,738.00	73,517,400
シンクロ・フード	7,300	560.00	4,088,000

オークネット	7,500	1,750.00	13,125,000
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	811.00	1,865,300
セグエグループ	3,700	1,015.00	3,755,500
エイトレッド	1,800	1,439.00	2,590,200
マクロミル	34,000	720.00	24,480,000
ビーグリー	2,400	1,132.00	2,716,800
オロ	6,300	2,114.00	13,318,200
ユーザーローカル	6,300	1,785.00	11,245,500
テモナ	2,800	284.00	795,200
ニーズウェル	6,300	651.00	4,101,300
マネーフォワード	38,400	4,717.00	181,132,800
サインポスト	4,400	482.00	2,120,800
Sun Asterisk	12,300	1,370.00	16,851,000
プラスアルファ・コンサルティング	10,000	2,831.00	28,310,000
電算システムホールディングス	7,700	2,854.00	21,975,800
Appier Group	59,000	1,537.00	90,683,000
ソルクシーズ	9,400	454.00	4,267,600
フェイス	3,300	501.00	1,653,300
プロトコーポレーション	21,600	1,145.00	24,732,000
ハイマックス	5,400	1,383.00	7,468,200
野村総合研究所	344,300	3,800.00	1,308,340,000
サイバネットシステム	13,900	766.00	10,647,400
CEホールディングス	6,000	571.00	3,426,000
日本システム技術	4,800	2,247.00	10,785,600
インテージホールディングス	19,600	2,239.00	43,884,400
東邦システムサイエンス	4,800	1,268.00	6,086,400
ソースネクスト	88,100	185.00	16,298,500
インフォコム	22,300	2,675.00	59,652,500
シンプレクス・ホールディングス	29,600	2,670.00	79,032,000
HEROZ	5,800	1,468.00	8,514,400
ラクスル	41,500	1,311.00	54,406,500
メルカリ	104,500	3,208.00	335,236,000
I P S	5,600	2,550.00	14,280,000
F I G	13,500	318.00	4,293,000
システムサポート	6,700	2,040.00	13,668,000
イーソル	12,500	718.00	8,975,000
東海ソフト	1,700	1,143.00	1,943,100
ウイングアーク1st	17,900	2,481.00	44,409,900
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,600	1,423.00	6,545,800
サーバーワークス	3,500	4,055.00	14,192,500
東名	900	2,491.00	2,241,900
ヴィッツ	1,200	1,120.00	1,344,000

トピラシステムズ	3,300	933.00	3,078,900
Sansan	56,600	1,211.00	68,542,600
Link-U	2,800	800.00	2,240,000
ギフトィ	15,100	1,362.00	20,566,200
メドレー	23,200	4,975.00	115,420,000
ベース	5,900	4,185.00	24,691,500
JMDC	28,500	5,481.00	156,208,500
フォーカスシステムズ	12,600	972.00	12,247,200
クレスコ	13,400	1,725.00	23,115,000
フジ・メディア・ホールディングス	166,000	1,594.00	264,604,000
オービック	57,800	22,465.00	1,298,477,000
ジャストシステム	24,800	2,905.50	72,056,400
TDCソフト	14,600	1,643.00	23,987,800
LINEヤフー	2,459,500	403.60	992,654,200
トレンドマイクロ	81,700	5,701.00	465,771,700
IDホールディングス	11,700	1,422.00	16,637,400
日本オラクル	33,100	11,000.00	364,100,000
アルファシステムズ	5,400	2,832.00	15,292,800
フューチャー	36,900	1,475.00	54,427,500
CAC Holdings	10,000	1,766.00	17,660,000
SBテクノロジー	7,300	2,201.00	16,067,300
トーセ	3,400	732.00	2,488,800
オービックビジネスコンサルタント	34,000	6,270.00	213,180,000
アイティフォー	22,800	1,107.00	25,239,600
東計電算	2,400	6,140.00	14,736,000
エクスネット	1,600	1,041.00	1,665,600
大塚商会	85,700	6,218.00	532,882,600
サイボウズ	23,800	1,938.00	46,124,400
電通国際情報サービス	21,000	5,560.00	116,760,000
ACCESS	20,500	774.00	15,867,000
デジタルガレージ	30,700	3,350.00	102,845,000
EMシステムズ	28,900	722.00	20,865,800
ウェザーニューズ	5,300	6,270.00	33,231,000
CIJ	28,800	554.00	15,955,200
ビジネスエンジニアリング	2,400	3,235.00	7,764,000
日本エンタープライズ	12,200	130.00	1,586,000
WOWOW	13,000	1,118.00	14,534,000
スカラ	16,000	764.00	12,224,000
インテリジェント ウェイブ	6,200	941.00	5,834,200
ANYCOLOR	6,000	3,330.00	19,980,000
IMAGICA GROUP	14,500	581.00	8,424,500
ネットワンシステムズ	64,400	2,840.00	182,896,000

システムソフト	60,600	75.00	4,545,000
アルゴグラフィックス	15,900	3,205.00	50,959,500
マーベラス	28,100	711.00	19,979,100
エイベックス	29,400	1,424.00	41,865,600
B I P R O G Y	63,600	3,700.00	235,320,000
都築電気	9,100	2,292.00	20,857,200
T B S ホールディングス	88,500	2,478.00	219,303,000
日本テレビホールディングス	153,000	1,516.00	231,948,000
朝日放送グループホールディングス	16,200	690.00	11,178,000
テレビ朝日ホールディングス	42,000	1,671.00	70,182,000
スカパーJ S A Tホールディングス	153,400	695.00	106,613,000
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,974.00	37,175,000
日本BS放送	4,200	916.00	3,847,200
ビジョン	26,000	1,575.00	40,950,000
スマートバリュー	2,900	391.00	1,133,900
U S E N - N E X T H O L D I N G S	19,400	3,225.00	62,565,000
ワイヤレスゲート	5,200	205.00	1,066,000
日本通信	159,700	214.00	34,175,800
クロップス	1,900	1,032.00	1,960,800
日本電信電話	55,359,900	175.00	9,687,982,500
K D D I	1,335,400	4,508.00	6,019,983,200
ソフトバンク	2,778,000	1,679.00	4,664,262,000
光通信	20,300	22,350.00	453,705,000
エムティーアイ	11,900	602.00	7,163,800
G M O インターネットグループ	63,900	2,271.00	145,116,900
ファイバーゲート	9,300	1,273.00	11,838,900
アйдママーケティングコミュニケーション	2,800	254.00	711,200
K A D O K A W A	91,400	3,035.00	277,399,000
学研ホールディングス	28,800	846.00	24,364,800
ゼンリン	29,600	911.00	26,965,600
昭文社ホールディングス	5,000	328.00	1,640,000
インプレスホールディングス	10,300	181.00	1,864,300
アイネット	10,500	1,702.00	17,871,000
松竹	9,900	10,105.00	100,039,500
東宝	108,200	5,087.00	550,413,400
東映	4,800	18,350.00	88,080,000
N T T データグループ	542,200	2,010.00	1,089,822,000
ピー・シー・エー	10,000	1,211.00	12,110,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,139.00	15,828,600
D T S	36,800	3,170.00	116,656,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	86,900	5,121.00	445,014,900
シーイーシー	24,300	1,590.00	38,637,000

カブコン	171,700	5,303.00	910,525,100
アイ・エス・ピー	8,900	1,415.00	12,593,500
ジャステック	10,600	1,492.00	15,815,200
S C S K	141,100	2,583.50	364,531,850
N S W	6,700	2,811.00	18,833,700
アイネス	12,100	1,628.00	19,698,800
T K C	27,600	3,575.00	98,670,000
富士ソフト	34,800	4,795.00	166,866,000
N S D	61,700	2,860.00	176,462,000
コナミグループ	74,000	7,918.00	585,932,000
福井コンピュータホールディングス	12,000	2,576.00	30,912,000
J B C Cホールディングス	12,600	2,794.00	35,204,400
ミロク情報サービス	15,700	1,620.00	25,434,000
ソフトバンクグループ	852,500	6,250.00	5,328,125,000
高千穂交易	4,300	3,160.00	13,588,000
オルパヘルスケアホールディングス	1,800	1,807.00	3,252,600
伊藤忠食品	4,100	6,590.00	27,019,000
エレマテック	16,400	1,825.00	29,930,000
あらた	13,900	5,600.00	77,840,000
トーメンデバイス	2,600	4,920.00	12,792,000
東京エレクトロン デバイス	20,100	3,625.00	72,862,500
円谷フィールズホールディングス	31,300	1,981.00	62,005,300
双日	181,700	3,227.00	586,345,900
アルフレッサ ホールディングス	183,000	2,427.00	444,141,000
横浜冷凍	49,700	1,176.00	58,447,200
ラサ商事	5,600	1,652.00	9,251,200
アルコニックス	24,000	1,363.00	32,712,000
神戸物産	141,000	3,436.00	484,476,000
ハイパー	2,800	357.00	999,600
あい ホールディングス	29,200	2,399.00	70,050,800
ディーブイエックス	3,400	1,040.00	3,536,000
ダイワボウホールディングス	74,500	2,852.00	212,474,000
マクニカホールディングス	43,100	7,120.00	306,872,000
ラクト・ジャパン	7,100	2,034.00	14,441,400
グリムス	7,600	2,263.00	17,198,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,800	990.00	22,572,000
八洲電機	14,800	1,302.00	19,269,600
メディアスホールディングス	11,700	764.00	8,938,800
レスターホールディングス	17,500	2,492.00	43,610,000
ジオリーブグループ	2,800	1,210.00	3,388,000
大光	5,200	718.00	3,733,600
O C H Iホールディングス	2,800	1,390.00	3,892,000

TO K A Iホールディングス	90,000	925.00	83,250,000
黒谷	3,400	601.00	2,043,400
C o m i n i x	2,400	846.00	2,030,400
三洋貿易	20,600	1,340.00	27,604,000
ビューティガレージ	2,900	4,800.00	13,920,000
ウイン・パートナーズ	13,300	1,081.00	14,377,300
ミタチ産業	3,100	1,126.00	3,490,600
シップヘルスケアホールディングス	65,500	2,204.00	144,362,000
明治電機工業	6,800	1,443.00	9,812,400
デリカフーズホールディングス	4,800	622.00	2,985,600
スターティアホールディングス	2,400	1,665.00	3,996,000
コメダホールディングス	44,700	2,849.00	127,350,300
ピーバンドットコム	1,800	451.00	811,800
アセンテック	6,200	528.00	3,273,600
富士興産	2,700	1,788.00	4,827,600
協栄産業	1,100	2,318.00	2,549,800
フルサト・マルカホールディングス	17,100	2,665.00	45,571,500
ヤマエグループホールディングス	10,300	3,490.00	35,947,000
小野建	17,900	1,716.00	30,716,400
南陽	2,300	2,230.00	5,129,000
佐島電機	7,700	1,888.00	14,537,600
エコートレーディング	2,400	1,596.00	3,830,400
伯東	10,400	5,130.00	53,352,000
コンドーテック	14,000	1,166.00	16,324,000
中山福	6,600	360.00	2,376,000
ナガイレーベン	23,000	2,133.00	49,059,000
三菱食品	16,800	3,895.00	65,436,000
松田産業	13,900	2,385.00	33,151,500
第一興商	70,600	2,408.00	170,004,800
メディバルホールディングス	174,400	2,505.50	436,959,200
S P K	8,100	1,930.00	15,633,000
萩原電気ホールディングス	7,400	3,940.00	29,156,000
アズワン	26,000	5,288.00	137,488,000
スズデン	6,400	2,214.00	14,169,600
尾家産業	2,900	1,920.00	5,568,000
シモジマ	12,500	1,147.00	14,337,500
ドウシシャ	19,300	2,161.00	41,707,300
小津産業	2,700	1,593.00	4,301,100
高速	9,500	2,028.00	19,266,000
たけびし	7,000	1,836.00	12,852,000
リックス	2,500	3,035.00	7,587,500
丸文	16,300	1,163.00	18,956,900

ハビネット	15,500	2,445.00	37,897,500
橋本総業ホールディングス	7,200	1,132.00	8,150,400
日本ライフライン	53,500	1,157.00	61,899,500
タカショー	15,900	632.00	10,048,800
I D O M	55,200	722.00	39,854,400
進和	11,200	2,365.00	26,488,000
エスケイジャパン	3,000	702.00	2,106,000
ダイトロン	7,200	3,010.00	21,672,000
シークス	26,000	1,485.00	38,610,000
田中商事	3,500	705.00	2,467,500
オーハシテクニカ	8,800	1,649.00	14,511,200
白銅	6,600	2,252.00	14,863,200
ダイコー通産	1,300	1,206.00	1,567,800
伊藤忠商事	1,123,400	5,378.00	6,041,645,200
丸紅	1,411,600	2,331.00	3,290,439,600
高島	7,600	925.00	7,030,000
長瀬産業	83,600	2,346.00	196,125,600
蝶理	9,800	2,968.00	29,086,400
豊田通商	159,700	8,709.00	1,390,827,300
三共生興	25,300	816.00	20,644,800
兼松	70,800	2,092.00	148,113,600
ツカモトコーポレーション	1,700	1,291.00	2,194,700
三井物産	1,275,600	5,391.00	6,876,759,600
日本紙パルプ商事	9,700	4,825.00	46,802,500
カメイ	19,400	1,440.00	27,936,000
東都水産	600	6,410.00	3,846,000
O U Gホールディングス	1,800	2,402.00	4,323,600
スターゼン	13,900	2,563.00	35,625,700
山善	49,200	1,181.00	58,105,200
椿本興業	2,900	4,830.00	14,007,000
住友商事	1,103,200	2,965.00	3,270,988,000
内田洋行	7,400	6,750.00	49,950,000
三菱商事	1,111,500	7,126.00	7,920,549,000
第一実業	19,200	1,839.00	35,308,800
キャノンマーケティングジャパン	42,200	3,895.00	164,369,000
西華産業	7,200	2,194.00	15,796,800
佐藤商事	12,700	1,503.00	19,088,100
菱洋エレクトロ	15,600	3,310.00	51,636,000
東京産業	16,700	844.00	14,094,800
ユアサ商事	15,700	4,155.00	65,233,500
神鋼商事	4,600	5,750.00	26,450,000
トルク	6,600	308.00	2,032,800

阪和興業	32,700	4,690.00	153,363,000
正栄食品工業	12,100	4,825.00	58,382,500
カナデン	12,200	1,305.00	15,921,000
R Y O D E N	14,700	2,348.00	34,515,600
岩谷産業	41,500	7,472.00	310,088,000
ナイス	3,300	1,454.00	4,798,200
ニチモウ	1,600	3,970.00	6,352,000
極東貿易	10,900	1,866.00	20,339,400
アステナホールディングス	34,300	490.00	16,807,000
三愛オブリ	48,200	1,591.00	76,686,200
稲畑産業	36,000	3,140.00	113,040,000
G S I クレオス	10,600	2,213.00	23,457,800
明和産業	24,300	656.00	15,940,800
クワザワホールディングス	3,900	580.00	2,262,000
ワキタ	33,500	1,402.00	46,967,000
東邦ホールディングス	45,400	3,200.00	145,280,000
サンゲツ	45,800	2,904.00	133,003,200
ミツウロコグループホールディングス	23,300	1,269.00	29,567,700
シナネンホールディングス	5,900	3,995.00	23,570,500
伊藤忠エネクス	45,200	1,499.00	67,754,800
サンリオ	51,700	7,008.00	362,313,600
サンワテクノス	9,300	2,200.00	20,460,000
リョーサン	19,300	4,445.00	85,788,500
新光商事	24,500	1,189.00	29,130,500
トーヨー	7,800	3,355.00	26,169,000
三信電気	7,400	2,170.00	16,058,000
東陽テクニカ	18,500	1,278.00	23,643,000
モスフードサービス	26,800	3,210.00	86,028,000
加賀電子	14,800	6,500.00	96,200,000
ソーダニッカ	8,900	1,030.00	9,167,000
立花エレテック	13,300	2,783.00	37,013,900
フォーバル	7,200	1,113.00	8,013,600
P A L T A C	28,700	4,597.00	131,933,900
三谷産業	32,000	318.00	10,176,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	4,600	4,760.00	21,896,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,028.00	2,028,000
コーア商事ホールディングス	10,300	713.00	7,343,900
K P Pグループホールディングス	42,500	684.00	29,070,000
ヤマタネ	8,100	2,052.00	16,621,200
丸紅建材リース	1,100	2,696.00	2,965,600
泉州電業	9,100	3,460.00	31,486,000
トラスコ中山	38,300	2,424.00	92,839,200



オートボックスセブン	63,500	1,561.00	99,123,500
モリト	13,100	1,378.00	18,051,800
加藤産業	22,600	3,890.00	87,914,000
北恵	3,100	979.00	3,034,900
イエローハット	32,200	1,850.00	59,570,000
J Kホールディングス	14,000	967.00	13,538,000
日伝	10,800	2,521.00	27,226,800
北沢産業	6,600	334.00	2,204,400
杉本商事	8,100	2,193.00	17,763,300
因幡電機産業	47,300	3,255.00	153,961,500
東テク	6,100	5,230.00	31,903,000
ミスミグループ本社	275,200	2,305.50	634,473,600
アルテック	6,600	264.00	1,742,400
タキヒヨー	3,000	1,181.00	3,543,000
蔵王産業	2,000	2,512.00	5,024,000
スズケン	53,400	4,524.00	241,581,600
ジェコス	10,900	975.00	10,627,500
グローセル	14,700	469.00	6,894,300
ローソン	45,300	6,775.00	306,907,500
サンエー	14,000	4,875.00	68,250,000
カワチ薬品	14,500	2,491.00	36,119,500
エービーシー・マート	79,800	2,695.00	215,061,000
ハードオフコーポレーション	5,200	1,468.00	7,633,600
アスクル	38,000	1,936.00	73,568,000
ゲオホールディングス	18,000	2,295.00	41,310,000
アダストリア	22,200	3,205.00	71,151,000
くら寿司	21,500	3,315.00	71,272,500
キャンドゥ	6,700	2,674.00	17,915,800
I Kホールディングス	5,100	381.00	1,943,100
パルグループホールディングス	36,000	1,969.00	70,884,000
エディオン	72,500	1,475.00	106,937,500
サーラコーポレーション	38,900	754.00	29,330,600
ワッツ	6,700	605.00	4,053,500
ハローズ	8,400	4,090.00	34,356,000
あみやき亭	4,600	3,850.00	17,710,000
大黒天物産	5,700	6,190.00	35,283,000
ハニーズホールディングス	14,700	1,595.00	23,446,500
ファーマライズホールディングス	3,400	654.00	2,223,600
アルペン	15,300	1,920.00	29,376,000
ハブ	4,500	833.00	3,748,500
クオールホールディングス	25,300	1,755.00	44,401,500
ジーンズホールディングス	11,000	3,165.00	34,815,000

ビックカメラ	97,500	1,101.00	107,347,500
D C Mホールディングス	106,400	1,190.00	126,616,000
MonotaRO	258,800	1,532.50	396,611,000
東京一番フーズ	3,700	523.00	1,935,100
きちりホールディングス	2,900	913.00	2,647,700
J.フロント リテイリング	227,000	1,509.00	342,543,000
ドトール・日レスホールディングス	32,500	2,302.00	74,815,000
マツキヨココカラ&カンパニー	331,800	2,623.50	870,477,300
ブロンコピリー	10,900	2,978.00	32,460,200
Z O Z O	120,700	2,710.00	327,097,000
トレジャー・ファクトリー	7,900	1,373.00	10,846,700
物語コーポレーション	30,600	4,075.00	124,695,000
三越伊勢丹ホールディングス	307,300	1,726.50	530,553,450
H a m e e	6,800	880.00	5,984,000
マーケットエンタープライズ	1,600	1,369.00	2,190,400
ウエルシアホールディングス	94,800	2,522.50	239,133,000
クリエイティブSDホールディングス	30,300	3,345.00	101,353,500
丸善C H Iホールディングス	15,800	341.00	5,387,800
ミサワ	3,000	608.00	1,824,000
ティーライフ	2,000	1,408.00	2,816,000
チムニー	3,700	1,380.00	5,106,000
シュッピン	14,000	1,099.00	15,386,000
オイシックス・ラ・大地	24,800	1,525.00	37,820,000
ネクステージ	41,800	2,213.00	92,503,400
ジョイフル本田	53,300	1,739.00	92,688,700
鳥貴族ホールディングス	6,900	2,955.00	20,389,500
ホットランド	14,300	1,919.00	27,441,700
すかいらーくホールディングス	249,500	2,017.00	503,241,500
S F Pホールディングス	10,000	2,207.00	22,070,000
綿半ホールディングス	14,500	1,315.00	19,067,500
ヨシックスホールディングス	2,600	2,739.00	7,121,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	59,800	1,057.00	63,208,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,900	692.00	6,158,800
B E E N O S	8,000	1,628.00	13,024,000
あさひ	15,600	1,254.00	19,562,400
日本調剤	12,700	1,466.00	18,618,200
コスモス薬品	18,100	15,085.00	273,038,500
トーエル	6,000	755.00	4,530,000
セブン&アイ・ホールディングス	628,300	5,775.00	3,628,432,500
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	137,100	1,117.00	153,140,700
ツルハホールディングス	38,300	10,090.00	386,447,000

サンマルクホールディングス	14,900	1,890.00	28,161,000
フェリシモ	3,200	985.00	3,152,000
トリドールホールディングス	45,500	3,615.00	164,482,500
TOKYO BASE	20,200	328.00	6,625,600
ウイルプラスホールディングス	2,400	1,207.00	2,896,800
JMホールディングス	14,000	1,947.00	27,258,000
サツドラホールディングス	6,100	762.00	4,648,200
アレンザホールディングス	14,100	1,003.00	14,142,300
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,653.00	8,595,600
パロックジャパンリミテッド	12,400	821.00	10,180,400
クスリのアオキホールディングス	16,300	8,499.00	138,533,700
力の源ホールディングス	7,000	2,250.00	15,750,000
FOOD & LIFE COMPANIES	97,400	2,496.00	243,110,400
メディカルシステムネットワーク	17,000	408.00	6,936,000
はるやまホールディングス	6,100	521.00	3,178,100
ノジマ	59,900	1,312.00	78,588,800
カップ・クリエイト	28,700	1,480.00	42,476,000
ライトオン	9,200	508.00	4,673,600
良品計画	199,300	1,894.00	377,474,200
パリミキホールディングス	16,500	375.00	6,187,500
アドヴァングループ	17,800	1,060.00	18,868,000
アルビス	6,200	2,406.00	14,917,200
コナカ	13,200	405.00	5,346,000
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,609.00	2,896,200
G-7ホールディングス	23,100	1,204.00	27,812,400
イオン北海道	27,100	863.00	23,387,300
コジマ	30,900	636.00	19,652,400
ヒマラヤ	4,300	912.00	3,921,600
コーナン商事	24,700	3,835.00	94,724,500
エコス	7,000	2,046.00	14,322,000
ワタミ	22,000	1,197.00	26,334,000
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	368,100	3,052.00	1,123,441,200
西松屋チェーン	40,700	1,581.00	64,346,700
ゼンショーホールディングス	99,900	6,422.00	641,557,800
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,008.00	11,995,200
ハークスレイ	4,900	722.00	3,537,800
サイゼリヤ	27,100	4,820.00	130,622,000
VTホールディングス	70,200	510.00	35,802,000
魚力	5,900	2,125.00	12,537,500
フジ・コーポレーション	9,300	2,048.00	19,046,400
ユナイテッドアローズ	19,700	1,947.00	38,355,900

ハイデイ日高	27,200	2,668.00	72,569,600
YU-WA Creation Holdings	9,900	173.00	1,712,700
コロワイド	84,000	2,364.00	198,576,000
壱番屋	14,500	5,300.00	76,850,000
PLANT	3,400	797.00	2,709,800
スギホールディングス	36,800	5,860.00	215,648,000
薬王堂ホールディングス	10,400	2,659.00	27,653,600
スクロール	27,500	990.00	27,225,000
ヨンドシーホールディングス	15,900	1,888.00	30,019,200
木曽路	27,800	2,404.00	66,831,200
SRSホールディングス	30,500	995.00	30,347,500
千趣会	34,800	403.00	14,024,400
リテールパートナーズ	27,300	1,725.00	47,092,500
ケーヨー	29,600	971.00	28,741,600
上新電機	16,500	2,329.00	38,428,500
日本瓦斯	96,800	2,214.00	214,315,200
ロイヤルホールディングス	32,100	2,585.00	82,978,500
いなげや	17,800	1,450.00	25,810,000
チヨダ	17,900	910.00	16,289,000
ライフコーポレーション	16,000	3,615.00	57,840,000
リンガーハット	23,500	2,278.00	53,533,000
MrMaxHD	26,300	610.00	16,043,000
AOKIホールディングス	34,000	1,006.00	34,204,000
オークワ	29,300	858.00	25,139,400
コメリ	28,200	3,145.00	88,689,000
青山商事	39,300	1,600.00	62,880,000
しまむら	21,400	14,915.00	319,181,000
はせがわ	7,200	341.00	2,455,200
高島屋	137,500	2,158.00	296,725,000
松屋	31,100	994.00	30,913,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	88,800	1,793.00	159,218,400
近鉄百貨店	8,000	2,804.00	22,432,000
丸井グループ	134,500	2,423.00	325,893,500
アクシアル リテイリング	12,600	3,685.00	46,431,000
イオン	618,100	2,919.50	1,804,542,950
イズミ	27,700	3,925.00	108,722,500
平和堂	30,500	2,631.00	80,245,500
フジ	28,100	1,775.00	49,877,500
ヤオコー	20,600	7,588.00	156,312,800
ゼビオホールディングス	25,200	991.00	24,973,200
ケーズホールディングス	129,200	1,368.00	176,745,600
Olympicグループ	5,400	520.00	2,808,000

日産東京販売ホールディングス	16,500	480.00	7,920,000
シルバーライフ	3,900	1,105.00	4,309,500
Genky DrugStores	8,100	5,440.00	44,064,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,170.00	2,808,000
ブックオフグループホールディングス	8,300	1,250.00	10,375,000
ギフトホールディングス	7,900	2,255.00	17,814,500
アインホールディングス	25,200	4,339.00	109,342,800
元気寿司	5,200	5,130.00	26,676,000
ヤマダホールディングス	748,600	458.50	343,233,100
アークランズ	54,900	1,562.00	85,753,800
ニトリホールディングス	73,800	16,000.00	1,180,800,000
グルメ杵屋	15,200	1,059.00	16,096,800
愛眼	9,000	176.00	1,584,000
ケーユーホールディングス	11,100	1,176.00	13,053,600
吉野家ホールディングス	71,500	2,785.50	199,163,250
松屋フーズホールディングス	8,700	4,075.00	35,452,500
サガミホールディングス	29,700	1,289.00	38,283,300
関西フードマーケット	16,800	1,428.00	23,990,400
王将フードサービス	12,100	6,780.00	82,038,000
ミニストップ	13,400	1,451.00	19,443,400
アークス	33,600	2,702.00	90,787,200
パローホールディングス	35,000	2,201.00	77,035,000
ベルク	9,100	6,740.00	61,334,000
大庄	7,000	1,100.00	7,700,000
ファーストリテイリング	82,000	32,470.00	2,662,540,000
サンドラッグ	69,300	4,025.00	278,932,500
サックスパーホールディングス	17,900	900.00	16,110,000
ヤマザワ	2,600	1,258.00	3,270,800
やまや	2,700	2,887.00	7,794,900
ベルーナ	44,500	671.00	29,859,500
いよぎんホールディングス	201,900	1,108.50	223,806,150
しずおかフィナンシャルグループ	377,000	1,242.50	468,422,500
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	142,900	1,138.50	162,691,650
楽天銀行	59,000	2,280.00	134,520,000
京都フィナンシャルグループ	53,800	8,636.00	464,616,800
島根銀行	3,900	550.00	2,145,000
じもとホールディングス	10,000	443.00	4,430,000
めぶきフィナンシャルグループ	842,100	420.00	353,682,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,700	4,635.00	100,579,500
九州フィナンシャルグループ	298,600	780.40	233,027,440
ゆうちょ銀行	466,200	1,311.50	611,421,300
富山第一銀行	53,900	963.00	51,905,700

コンコルディア・フィナンシャルグループ	910,600	695.30	633,140,180
西日本フィナンシャルホールディングス	105,300	1,781.00	187,539,300
三十三フィナンシャルグループ	15,200	1,866.00	28,363,200
第四北越フィナンシャルグループ	26,600	3,900.00	103,740,000
ひろぎんホールディングス	221,400	936.40	207,318,960
おきなわフィナンシャルグループ	15,600	2,446.00	38,157,600
十六フィナンシャルグループ	22,000	3,845.00	84,590,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,900	5,330.00	95,407,000
プロクレアホールディングス	20,800	1,965.00	40,872,000
あいちフィナンシャルグループ	23,700	2,529.00	59,937,300
あおぞら銀行	106,700	3,029.00	323,194,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,628,200	1,288.00	13,689,121,600
りそなホールディングス	2,131,100	840.10	1,790,337,110
三井住友トラスト・ホールディングス	304,700	5,639.00	1,718,203,300
三井住友フィナンシャルグループ	1,206,100	7,400.00	8,925,140,000
千葉銀行	472,900	1,100.50	520,426,450
群馬銀行	329,300	713.10	234,823,830
武蔵野銀行	21,800	2,829.00	61,672,200
千葉興業銀行	26,500	923.00	24,459,500
筑波銀行	74,500	278.00	20,711,000
七十七銀行	54,300	3,230.00	175,389,000
秋田銀行	11,400	2,018.00	23,005,200
山形銀行	18,800	1,149.00	21,601,200
岩手銀行	11,600	2,651.00	30,751,600
東邦銀行	134,200	287.00	38,515,400
東北銀行	5,500	1,155.00	6,352,500
ふくおかフィナンシャルグループ	135,500	3,667.00	496,878,500
スルガ銀行	149,600	645.00	96,492,000
八十二銀行	358,400	834.10	298,941,440
山梨中央銀行	17,400	1,694.00	29,475,600
大垣共立銀行	32,300	2,106.00	68,023,800
福井銀行	15,200	1,567.00	23,818,400
清水銀行	6,800	1,618.00	11,002,400
富山銀行	1,700	1,817.00	3,088,900
滋賀銀行	28,200	3,655.00	103,071,000
南都銀行	25,500	2,701.00	68,875,500
百五銀行	159,700	540.00	86,238,000
紀陽銀行	60,700	1,520.00	92,264,000
ほくほくフィナンシャルグループ	107,900	1,650.50	178,088,950
山陰合同銀行	106,200	977.00	103,757,400
鳥取銀行	3,600	1,411.00	5,079,600
百十四銀行	15,500	2,634.00	40,827,000

四国銀行	27,000	1,020.00	27,540,000
阿波銀行	23,800	2,329.00	55,430,200
大分銀行	10,200	2,751.00	28,060,200
宮崎銀行	11,100	2,809.00	31,179,900
佐賀銀行	9,900	2,050.00	20,295,000
琉球銀行	38,900	1,145.00	44,540,500
セブン銀行	607,900	313.90	190,819,810
みずほフィナンシャルグループ	2,454,300	2,567.00	6,300,188,100
高知銀行	3,900	1,040.00	4,056,000
山口フィナンシャルグループ	166,400	1,328.00	220,979,200
名古屋銀行	11,200	5,250.00	58,800,000
北洋銀行	257,100	362.00	93,070,200
大光銀行	3,400	1,343.00	4,566,200
愛媛銀行	22,900	997.00	22,831,300
トマト銀行	3,700	1,231.00	4,554,700
京葉銀行	77,700	702.00	54,545,400
栃木銀行	77,700	335.00	26,029,500
北日本銀行	5,900	2,340.00	13,806,000
東和銀行	31,100	634.00	19,717,400
福島銀行	11,900	249.00	2,963,100
大東銀行	4,400	748.00	3,291,200
トモニホールディングス	137,200	468.00	64,209,600
フィデアホールディングス	17,500	1,608.00	28,140,000
池田泉州ホールディングス	217,300	327.00	71,057,100
F P G	57,500	1,326.00	76,245,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,000	1,742.00	24,388,000
マーキュリアホールディングス	6,000	814.00	4,884,000
S B Iホールディングス	246,100	3,147.00	774,476,700
ジャフコ グループ	56,800	1,625.50	92,328,400
大和証券グループ本社	1,213,700	856.40	1,039,412,680
野村ホールディングス	3,058,000	599.80	1,834,188,400
岡三証券グループ	149,200	697.00	103,992,400
丸三証券	56,700	833.00	47,231,100
東洋証券	56,800	320.00	18,176,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,000	482.00	89,170,000
光世証券	2,800	595.00	1,666,000
水戸証券	45,900	446.00	20,471,400
いちよし証券	31,500	699.00	22,018,500
松井証券	100,400	817.00	82,026,800
マネックスグループ	183,100	562.00	102,902,200
極東証券	21,300	924.00	19,681,200
岩井コスモホールディングス	19,400	1,731.00	33,581,400

アイザワ証券グループ	24,700	988.00	24,403,600
マネーパートナーズグループ	12,300	300.00	3,690,000
スパークス・グループ	19,000	1,468.00	27,892,000
かんぽ生命保険	197,500	2,564.00	506,390,000
S O M P Oホールディングス	291,300	6,347.00	1,848,881,100
アニコム ホールディングス	57,600	597.00	34,387,200
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	345,400	5,459.00	1,885,538,600
第一生命ホールディングス	829,100	3,125.00	2,590,937,500
東京海上ホールディングス	1,677,400	3,392.00	5,689,740,800
T & Dホールディングス	455,400	2,481.50	1,130,075,100
アドバンスクリエイト	9,800	1,025.00	10,045,000
全国保証	44,400	4,893.00	217,249,200
あんしん保証	6,600	285.00	1,881,000
イントラスト	4,700	950.00	4,465,000
日本モーゲージサービス	6,800	560.00	3,808,000
C a s a	4,700	860.00	4,042,000
アルヒ	21,300	900.00	19,170,000
プレミアグループ	28,800	1,576.00	45,388,800
ネットプロテクションズホールディングス	57,000	340.00	19,380,000
クレディセゾン	107,700	2,371.50	255,410,550
芙蓉総合リース	15,600	11,830.00	184,548,000
みずほリース	25,300	4,835.00	122,325,500
東京センチュリー	31,800	5,961.00	189,559,800
日本証券金融	62,600	1,452.00	90,895,200
アイフル	281,900	389.00	109,659,100
リコーリース	16,200	4,390.00	71,118,000
イオンフィナンシャルサービス	97,700	1,293.50	126,374,950
アコム	303,700	350.70	106,507,590
ジャックス	18,100	5,180.00	93,758,000
オリエントコーポレーション	44,600	1,159.00	51,691,400
オリックス	1,114,100	2,760.50	3,075,473,050
三菱H C キャピタル	662,000	1,001.50	662,993,000
九州リースサービス	5,600	998.00	5,588,800
日本取引所グループ	477,000	2,789.00	1,330,353,000
イー・ギャランティ	27,700	1,942.00	53,793,400
アサックス	5,600	678.00	3,796,800
N E C キャピタルソリューション	8,400	3,245.00	27,258,000
R o b o t H o m e	47,000	198.00	9,306,000
大東建託	62,200	15,765.00	980,583,000
いちご	197,800	324.00	64,087,200
日本駐車場開発	183,200	210.00	38,472,000
スター・マイカ・ホールディングス	20,900	659.00	13,773,100



S R Eホールディングス	8,600	2,866.00	24,647,600
A Dワークスグループ	28,500	279.00	7,951,500
ヒューリック	396,400	1,332.00	528,004,800
野村不動産ホールディングス	106,400	3,722.00	396,020,800
三重交通グループホールディングス	37,600	562.00	21,131,200
サムティ	27,300	2,367.00	64,619,100
ディア・ライフ	29,800	794.00	23,661,200
地主	13,400	1,922.00	25,754,800
プレサンスコーポレーション	27,200	1,819.00	49,476,800
ハウスコム	2,600	931.00	2,420,600
J P M C	10,500	1,141.00	11,980,500
サンセイランディック	4,100	1,058.00	4,337,800
フージャースホールディングス	26,200	1,093.00	28,636,600
オープンハウスグループ	62,300	5,081.00	316,546,300
東急不動産ホールディングス	511,000	917.30	468,740,300
飯田グループホールディングス	144,800	2,460.00	356,208,000
イーランド	2,200	1,517.00	3,337,400
ムゲンエステート	8,200	1,072.00	8,790,400
A n d D oホールディングス	10,100	1,020.00	10,302,000
シーアールイー	9,900	1,601.00	15,849,900
ケイアイスター不動産	8,300	4,610.00	38,263,000
グッドコムアセット	16,500	1,054.00	17,391,000
ジェイ・エス・ビー	4,300	5,220.00	22,446,000
ロードスターキャピタル	11,500	1,880.00	21,620,000
テンポイノベーション	4,000	1,156.00	4,624,000
フェイスネットワーク	3,600	1,457.00	5,245,200
パーク24	110,600	1,877.50	207,651,500
パラカ	6,300	1,943.00	12,240,900
三井不動産	724,400	3,278.00	2,374,583,200
三菱地所	1,024,400	1,939.50	1,986,823,800
平和不動産	27,700	3,950.00	109,415,000
東京建物	148,600	2,047.00	304,184,200
京阪神ビルディング	29,100	1,373.00	39,954,300
住友不動産	307,000	3,841.00	1,179,187,000
テーオーシー	31,900	633.00	20,192,700
東京楽天地	3,000	4,165.00	12,495,000
レオパレス21	191,000	329.00	62,839,000
スターツコーポレーション	24,600	2,923.00	71,905,800
フジ住宅	24,800	725.00	17,980,000
空港施設	21,800	555.00	12,099,000
明和地所	6,100	1,172.00	7,149,200
ゴールドクレスト	16,500	2,226.00	36,729,000

エスリード	8,200	3,050.00	25,010,000
日神グループホールディングス	28,600	539.00	15,415,400
日本エスコン	31,800	921.00	29,287,800
MIRARTHホールディングス	85,800	472.00	40,497,600
A V A N T I A	7,200	865.00	6,228,000
イオンモール	88,400	1,757.00	155,318,800
毎日コムネット	5,200	764.00	3,972,800
ファースト住建	5,200	1,238.00	6,437,600
カチタス	46,000	2,113.00	97,198,000
トーセイ	28,600	1,924.00	55,026,400
穴吹興産	2,600	2,007.00	5,218,200
サンフロンティア不動産	28,800	1,515.00	43,632,000
F Jネクストホールディングス	18,600	1,041.00	19,362,600
インテリックス	2,800	537.00	1,503,600
ランドビジネス	4,100	312.00	1,279,200
サンネクスタグループ	4,100	971.00	3,981,100
グランディハウス	10,700	641.00	6,858,700
日本空港ビルデング	60,100	6,213.00	373,401,300
明豊ファシリティワークス	6,400	727.00	4,652,800
L I F U L L	61,900	227.00	14,051,300
M I X I	40,500	2,312.00	93,636,000
ジェイエシーリクルートメント	16,100	2,492.00	40,121,200
日本M&Aセンターホールディングス	304,400	698.60	212,653,840
メンバーズ	5,500	1,174.00	6,457,000
中広	2,400	432.00	1,036,800
UTグループ	26,200	2,204.00	57,744,800
アイティメディア	7,000	1,156.00	8,092,000
E・Jホールディングス	10,500	1,694.00	17,787,000
オープンアップグループ	53,300	1,786.00	95,193,800
コシダカホールディングス	53,300	1,145.00	61,028,500
アルトナー	3,100	1,752.00	5,431,200
パソナグループ	21,700	1,591.00	34,524,700
C D S	3,100	1,735.00	5,378,500
リンクアンドモチベーション	51,000	421.00	21,471,000
エス・エム・エス	67,600	2,525.00	170,690,000
サニーサイドアップグループ	3,900	824.00	3,213,600
パーソルホールディングス	1,955,000	239.00	467,245,000
リニカル	7,100	663.00	4,707,300
クックパッド	50,400	136.00	6,854,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	720.00	4,536,000
学情	9,200	1,981.00	18,225,200
スタジオアリス	9,000	2,051.00	18,459,000

シミックホールディングス	8,700	1,692.00	14,720,400
エプロ	3,700	755.00	2,793,500
N J S	4,000	2,963.00	11,852,000
総合警備保障	329,100	896.90	295,169,790
カカクコム	130,200	1,478.00	192,435,600
アイロムグループ	6,500	1,853.00	12,044,500
セントケア・ホールディング	11,700	856.00	10,015,200
サイネックス	2,500	677.00	1,692,500
ルネサンス	12,700	873.00	11,087,100
ディップ	31,100	3,595.00	111,804,500
デジタルホールディングス	12,900	983.00	12,680,700
新日本科学	19,000	1,833.00	34,827,000
キャリアデザインセンター	2,600	1,967.00	5,114,200
ベネフィット・ワン	82,300	1,059.00	87,155,700
エムスリー	350,100	2,669.00	934,416,900
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	432.00	3,283,200
アウトソーシング	114,000	1,141.50	130,131,000
ウェルネット	9,500	577.00	5,481,500
ワールドホールディングス	8,100	2,405.00	19,480,500
ディー・エヌ・エー	71,000	1,473.00	104,583,000
博報堂D Yホールディングス	226,200	1,220.50	276,077,100
ぐるなび	33,500	311.00	10,418,500
タカミヤ	24,600	482.00	11,857,200
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	702.00	6,177,600
ファンコミュニケーションズ	32,300	398.00	12,855,400
ライク	6,800	1,517.00	10,315,600
A o b a - B B T	5,200	392.00	2,038,400
エスプール	51,600	481.00	24,819,600
W D Bホールディングス	9,200	2,049.00	18,850,800
ティア	7,600	454.00	3,450,400
C D G	1,500	1,298.00	1,947,000
アドウェイズ	24,900	554.00	13,794,600
バリューコマース	15,800	1,242.00	19,623,600
インフォマート	184,600	403.00	74,393,800
J Pホールディングス	51,900	332.00	17,230,800
エコナックホールディングス	12,100	153.00	1,851,300
C Lホールディングス	5,100	808.00	4,120,800
プレステージ・インターナショナル	75,100	611.00	45,886,100
アミューズ	9,800	1,549.00	15,180,200
ドリームインキュベータ	5,500	2,711.00	14,910,500
クイック	13,700	2,085.00	28,564,500
T A C	7,300	204.00	1,489,200

電通グループ	174,200	4,399.00	766,305,800
イオンファンタジー	7,700	3,190.00	24,563,000
シーティーエス	20,000	688.00	13,760,000
ネクシィーズグループ	4,000	814.00	3,256,000
H．U．グループホールディングス	52,000	2,508.00	130,416,000
アルプス技研	16,900	2,507.00	42,368,300
日本空調サービス	19,400	781.00	15,151,400
オリエンタルランド	937,500	4,941.00	4,632,187,500
ダスキン	39,500	3,180.00	125,610,000
明光ネットワークジャパン	22,000	641.00	14,102,000
ファルコホールディングス	8,200	1,943.00	15,932,600
ラウンドワン	148,700	552.00	82,082,400
リゾートトラスト	70,100	2,248.00	157,584,800
ビー・エム・エル	21,900	2,799.00	61,298,100
リソー教育	81,800	243.00	19,877,400
早稲田アカデミー	10,000	1,411.00	14,110,000
ユー・エス・エス	182,300	2,498.50	455,476,550
東京個別指導学院	21,700	485.00	10,524,500
サイバーエージェント	391,800	795.70	311,755,260
楽天グループ	1,516,700	579.50	878,927,650
クリーク・アンド・リバー社	10,500	2,090.00	21,945,000
S B I グローバルアセットマネジメント	29,500	555.00	16,372,500
テー・オー・ダブリュー	35,700	312.00	11,138,400
山田コンサルティンググループ	9,200	1,566.00	14,407,200
セントラルスポーツ	6,800	2,381.00	16,190,800
フルキャストホールディングス	17,100	1,850.00	31,635,000
エン・ジャパン	32,200	2,291.00	73,770,200
リソルホールディングス	1,100	4,845.00	5,329,500
テクノプロ・ホールディングス	104,900	3,176.00	333,162,400
アトラグループ	3,400	198.00	673,200
アイ・アールジャパンホールディングス	9,300	1,699.00	15,800,700
K e e P e r 技研	11,000	5,640.00	62,040,000
ファーストロジック	3,400	530.00	1,802,000
三機サービス	2,100	1,022.00	2,146,200
G u n o s y	14,600	591.00	8,628,600
デザインワン・ジャパン	4,800	166.00	796,800
イー・ガーディアン	6,800	2,292.00	15,585,600
リブセンス	6,400	326.00	2,086,400
ジャパンマテリアル	54,300	2,334.00	126,736,200
ベクトル	28,100	1,212.00	34,057,200
ウチヤマホールディングス	5,900	360.00	2,124,000
チャーム・ケア・コーポレーション	15,000	1,142.00	17,130,000

キャリアリンク	6,600	2,425.00	16,005,000
I B J	14,100	624.00	8,798,400
アサンテ	8,900	1,569.00	13,964,100
バリューHR	15,700	1,260.00	19,782,000
M & Aキャピタルパートナーズ	14,400	2,640.00	38,016,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,012.00	6,679,200
E R Iホールディングス	3,200	1,734.00	5,548,800
アビスト	1,900	3,240.00	6,156,000
シグマクシス・ホールディングス	27,100	1,572.00	42,601,200
ウィルグループ	15,100	1,075.00	16,232,500
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	14,700	145.00	2,131,500
メドピア	15,900	1,025.00	16,297,500
レアジョブ	2,600	1,019.00	2,649,400
リクルートホールディングス	1,311,400	4,590.00	6,019,326,000
エラン	23,800	799.00	19,016,200
土木管理総合試験所	6,400	337.00	2,156,800
日本郵政	2,131,700	1,231.00	2,624,122,700
ベルシステム24ホールディングス	23,900	1,572.00	37,570,800
鎌倉新書	20,600	604.00	12,442,400
S M N	3,600	419.00	1,508,400
グローバルキッズCOMPANY	2,700	626.00	1,690,200
エアトリ	13,100	2,060.00	26,986,000
アトラエ	10,700	1,052.00	11,256,400
ストライク	7,600	3,310.00	25,156,000
ソラスト	49,300	610.00	30,073,000
セラク	5,700	1,295.00	7,381,500
インソース	38,800	1,005.00	38,994,000
ベイカレント・コンサルティング	140,300	4,822.00	676,526,600
Orchestra Holdings	4,100	1,025.00	4,202,500
アイモバイル	8,100	1,337.00	10,829,700
キャリアインデックス	5,100	302.00	1,540,200
MS - Japan	4,100	1,124.00	4,608,400
船場	2,800	908.00	2,542,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	63,300	2,163.00	136,917,900
フルテック	1,900	1,214.00	2,306,600
GameWith	4,500	320.00	1,440,000
MS & Consulting	1,900	699.00	1,328,100
ウェルビー	13,500	635.00	8,572,500
エル・ティー・エス	2,100	3,865.00	8,116,500
ミダックホールディングス	10,900	1,913.00	20,851,700
キュービーネットホールディングス	8,600	1,580.00	13,588,000
R P Aホールディングス	24,900	323.00	8,042,700

スプリックス	3,800	804.00	3,055,200
マネジメントソリューションズ	7,700	2,734.00	21,051,800
プロレド・パートナーズ	5,000	461.00	2,305,000
テノ・ホールディングス	2,000	593.00	1,186,000
フロンティア・マネジメント	5,200	1,341.00	6,973,200
ピアラ	2,900	433.00	1,255,700
コプロ・ホールディングス	4,200	1,223.00	5,136,600
ギークス	2,000	720.00	1,440,000
アンビスホールディングス	19,100	2,641.00	50,443,100
カーブスホールディングス	48,800	691.00	33,720,800
フォーラムエンジニアリング	10,600	1,312.00	13,907,200
Fast Fitness Japan	6,300	1,390.00	8,757,000
ダイレクトマーケティングミックス	18,900	446.00	8,429,400
ポピンズ	2,900	1,217.00	3,529,300
LITALICO	13,900	1,984.00	27,577,600
コンフィデンス・インターワークス	800	1,628.00	1,302,400
アドバンテッジリスクマネジメント	6,000	447.00	2,682,000
リログループ	98,800	1,573.50	155,461,800
東祥	12,600	1,119.00	14,099,400
ID&Eホールディングス	10,800	3,560.00	38,448,000
ビーウィズ	4,600	2,410.00	11,086,000
TREホールディングス	37,500	1,205.00	45,187,500
人・夢・技術グループ	6,900	1,630.00	11,247,000
NISSOホールディングス	13,700	770.00	10,549,000
大栄環境	45,200	2,033.00	91,891,600
日本管財ホールディングス	18,700	2,544.00	47,572,800
M&A総研ホールディングス	8,500	3,375.00	28,687,500
エイチ・アイ・エス	51,600	1,809.00	93,344,400
ラックランド	8,100	2,926.00	23,700,600
共立メンテナンス	30,400	6,239.00	189,665,600
イチネンホールディングス	19,000	1,424.00	27,056,000
建設技術研究所	9,200	4,485.00	41,262,000
スペース	12,300	922.00	11,340,600
燦ホールディングス	15,400	1,032.00	15,892,800
スバル興業	700	11,750.00	8,225,000
東京テアトル	4,300	1,116.00	4,798,800
タナベコンサルティンググループ	4,800	1,129.00	5,419,200
ナガワ	4,800	6,920.00	33,216,000
東京都競馬	14,900	3,970.00	59,153,000
カナモト	27,600	2,638.00	72,808,800
ニシオホールディングス	16,600	3,530.00	58,598,000
トランス・コスモス	22,100	3,180.00	70,278,000

乃村工藝社	77,600	927.00	71,935,200
藤田観光	7,100	4,575.00	32,482,500
KNT-CTホールディングス	10,600	1,322.00	14,013,200
トーカイ	15,800	1,900.00	30,020,000
セコム	180,400	10,085.00	1,819,334,000
セントラル警備保障	9,600	3,100.00	29,760,000
丹青社	34,700	901.00	31,264,700
メイテックグループホールディングス	69,200	2,689.00	186,078,800
応用地質	16,700	2,429.00	40,564,300
船井総研ホールディングス	37,000	2,587.00	95,719,000
進学会ホールディングス	4,900	290.00	1,421,000
オオバ	7,700	958.00	7,376,600
いであ	3,400	1,703.00	5,790,200
学究社	7,200	2,038.00	14,673,600
ベネッセホールディングス	66,300	1,831.50	121,428,450
イオンディライト	19,700	3,280.00	64,616,000
ナック	7,800	966.00	7,534,800
ダイセキ	36,200	4,040.00	146,248,000
ステップ	6,600	1,724.00	11,378,400
合 計	262,294,938		564,976,665,330

## (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

項目	2023年10月 2日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,677,479,859
国債証券	542,246,480,350
地方債証券	32,839,291,325
特殊債証券	36,691,960,150
社債証券	29,020,234,000
未収入金	3,480,438,600
未収利息	673,930,862
前払費用	22,107,207
流動資産合計	646,651,922,353
資産合計	646,651,922,353
負債の部	
流動負債	
未払金	4,753,393,700

	2023年10月 2日現在
項目	金額（円）
未払解約金	167,070,692
未払利息	2,889
流動負債合計	4,920,467,281
負債合計	4,920,467,281
純資産の部	
元本等	
元本	483,216,028,480
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	158,515,426,592
元本等合計	641,731,455,072
純資産合計	641,731,455,072
負債純資産合計	646,651,922,353

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年10月 2日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2023年10月 2日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	483,216,028,480口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 99,163,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3280円 (1万口当たり純資産額) (13,280円)

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

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年10月 2日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月 2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	2023年10月 2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	53,539,537,882円
期中一部解約元本額	28,563,115,832円
期末元本額	483,216,028,480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）	5,443,643,341円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,230,577円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,480,913,508円
世界経済インデックスファンド	6,089,108,234円
D C マイセレクション 2 5	28,359,670,354円
D C マイセレクション 5 0	34,142,429,046円
D C マイセレクション 7 5	10,797,265,485円
D C 日本債券インデックス・オープン	412,713,516円
D C 日本債券インデックス・オープン S	90,509,007,567円
D C 日本債券インデックス・オープン P	64,249,273,229円
D C マイセレクション S 2 5	16,070,983,069円
D C マイセレクション S 5 0	18,724,035,865円
D C マイセレクション S 7 5	4,715,898,708円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	479,363,588円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,773,288,860円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	1,102,817,666円
D C 世界経済インデックスファンド	4,490,948,597円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,679,208円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	17,793,161円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,028,875円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,103,784円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	63,528,811円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	103,013,462円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	28,758,681円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	23,621,870円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,224,320,714円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	729,256,795円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,118,378,428円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	63,629,066円

区分	2023年10月 2日現在
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	50,442,493円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	913,195,848円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,014,958,179円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,351,177,499円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	97,308,383円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,778,919,746円
日本債券ファンド・シリーズ1	18,117,038,153円
分散投資コア戦略ファンドA	18,574,211,322円
分散投資コア戦略ファンドS	25,852,152,181円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	281,289,731円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,791,792,848円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	95,418,079円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,031,423円
SMT インデックスバランス・オープン	73,406,247円
SMT 世界経済インデックス・オープン	45,974,796円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	101,199,452円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	163,427,091円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	15,696,918円
グローバル経済コア	237,874,896円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	42,075,424円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,511,687円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	127,418,410円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	71,414,031円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	20,660,270円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,534,134円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	534,480,062円
10資産分散投資ファンド	315,338,647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）	91,676,473,902円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	39,801,253円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,645,171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）	485,228,899円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年10月 2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	17,969,915,700
地方債証券	549,746,437
特殊債券	630,108,504
社債券	378,629,000
合計	19,528,399,641

(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442回利付国債（2年）	2,400,000,000	2,401,416,000	

第443回利付国債(2年)	2,700,000,000	2,701,404,000	
第444回利付国債(2年)	2,425,000,000	2,426,042,750	
第445回利付国債(2年)	1,160,000,000	1,160,382,800	
第446回利付国債(2年)	2,880,000,000	2,880,604,800	
第447回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,000,070,000	
第448回利付国債(2年)	50,000,000	50,000,000	
第449回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,219,792,600	
第450回利付国債(2年)	50,000,000	49,982,500	
第451回利付国債(2年)	1,180,000,000	1,179,775,800	
第452回利付国債(2年)	3,340,000,000	3,337,762,200	
第453回利付国債(2年)	670,000,000	669,330,000	
第142回利付国債(5年)	3,910,000,000	3,916,138,700	
第143回利付国債(5年)	4,480,000,000	4,486,854,400	
第144回利付国債(5年)	5,050,000,000	5,057,322,500	
第145回利付国債(5年)	5,120,000,000	5,126,502,400	
第146回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,804,752,000	
第147回利付国債(5年)	5,440,000,000	5,430,643,200	
第148回利付国債(5年)	6,210,000,000	6,194,847,600	
第149回利付国債(5年)	5,670,000,000	5,651,572,500	
第150回利付国債(5年)	5,910,000,000	5,884,468,800	
第151回利付国債(5年)	4,510,000,000	4,485,149,900	
第152回利付国債(5年)	210,000,000	209,529,600	
第153回利付国債(5年)	5,810,000,000	5,769,271,900	
第154回利付国債(5年)	5,180,000,000	5,154,514,400	
第155回利付国債(5年)	2,730,000,000	2,735,105,100	
第156回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,641,605,000	
第157回利付国債(5年)	1,460,000,000	1,454,203,800	
第158回利付国債(5年)	3,730,000,000	3,698,779,900	
第159回利付国債(5年)	950,000,000	940,072,500	
第160回利付国債(5年)	3,250,000,000	3,231,117,500	
第161回利付国債(5年)	1,510,000,000	1,507,886,000	
第1回利付国債(40年)	740,000,000	861,485,800	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,267,554,900	
第3回利付国債(40年)	650,000,000	727,909,000	
第4回利付国債(40年)	950,000,000	1,062,793,500	
第5回利付国債(40年)	1,150,000,000	1,236,319,000	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,326,389,400	
第7回利付国債(40年)	1,340,000,000	1,346,753,600	
第8回利付国債(40年)	1,490,000,000	1,386,996,300	
第9回利付国債(40年)	2,260,000,000	1,534,675,600	
第10回利付国債(40年)	2,040,000,000	1,627,695,600	
第11回利付国債(40年)	1,525,000,000	1,168,348,250	

第12回利付国債(40年)	1,320,000,000	898,946,400	
第13回利付国債(40年)	2,330,000,000	1,568,276,400	
第14回利付国債(40年)	2,170,000,000	1,559,166,700	
第15回利付国債(40年)	2,970,000,000	2,344,725,900	
第16回利付国債(40年)	1,220,000,000	1,052,542,800	
第336回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,288,230,400	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,811,200,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,586,949,600	
第339回利付国債(10年)	3,970,000,000	3,996,162,300	
第340回利付国債(10年)	4,430,000,000	4,461,718,800	
第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	5,047,158,200	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,762,903,600	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,670,347,100	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,897,345,000	
第345回利付国債(10年)	4,280,000,000	4,274,521,600	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,737,120,000	
第347回利付国債(10年)	3,550,000,000	3,537,539,500	
第348回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,239,040,800	
第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,126,614,800	
第350回利付国債(10年)	6,670,000,000	6,614,172,100	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,835,000,000	4,784,474,250	
第352回利付国債(10年)	4,230,000,000	4,180,424,400	
第353回利付国債(10年)	4,385,000,000	4,327,731,900	
第354回利付国債(10年)	4,720,000,000	4,650,521,600	
第355回利付国債(10年)	4,660,000,000	4,583,203,200	
第356回利付国債(10年)	4,630,000,000	4,543,789,400	
第357回利付国債(10年)	3,390,000,000	3,319,250,700	
第358回利付国債(10年)	3,900,000,000	3,808,311,000	
第359回利付国債(10年)	4,145,000,000	4,035,986,500	
第360回利付国債(10年)	4,970,000,000	4,824,826,300	
第361回利付国債(10年)	4,810,000,000	4,653,338,300	
第362回利付国債(10年)	4,850,000,000	4,676,806,500	
第363回利付国債(10年)	5,430,000,000	5,218,284,300	
第364回利付国債(10年)	5,050,000,000	4,837,799,000	
第365回利付国債(10年)	6,267,000,000	5,986,551,750	
第366回利付国債(10年)	5,160,000,000	4,957,882,800	
第367回利付国債(10年)	5,010,000,000	4,800,331,500	
第368回利付国債(10年)	5,230,000,000	4,998,834,000	
第369回利付国債(10年)	4,740,000,000	4,643,872,800	
第370回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,752,642,600	
第371回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,629,822,400	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	125,415,400	

第2回利付国債(30年)	160,000,000	179,470,400
第3回利付国債(30年)	120,000,000	134,113,200
第4回利付国債(30年)	110,000,000	128,046,600
第5回利付国債(30年)	50,000,000	55,916,000
第6回利付国債(30年)	350,000,000	398,380,500
第7回利付国債(30年)	380,000,000	431,220,200
第8回利付国債(30年)	850,000,000	930,690,500
第9回利付国債(30年)	240,000,000	254,320,800
第10回利付国債(30年)	160,000,000	165,238,400
第11回利付国債(30年)	260,000,000	282,872,200
第12回利付国債(30年)	190,000,000	213,978,000
第13回利付国債(30年)	400,000,000	446,796,000
第14回利付国債(30年)	750,000,000	867,922,500
第15回利付国債(30年)	340,000,000	397,419,200
第16回利付国債(30年)	200,000,000	234,036,000
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,311,997,800
第18回利付国債(30年)	315,000,000	362,508,300
第19回利付国債(30年)	530,000,000	610,554,700
第20回利付国債(30年)	480,000,000	564,168,000
第21回利付国債(30年)	500,000,000	576,710,000
第22回利付国債(30年)	540,000,000	635,731,200
第23回利付国債(30年)	430,000,000	506,458,300
第24回利付国債(30年)	780,000,000	919,019,400
第25回利付国債(30年)	600,000,000	692,652,000
第26回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,808,509,000
第27回利付国債(30年)	1,850,000,000	2,183,333,000
第28回利付国債(30年)	1,700,000,000	2,006,935,000
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,947,704,300
第30回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,384,039,700
第31回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,386,237,200
第32回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,849,600,200
第33回利付国債(30年)	2,120,000,000	2,335,985,600
第34回利付国債(30年)	1,865,000,000	2,109,855,850
第35回利付国債(30年)	2,480,000,000	2,724,875,200
第36回利付国債(30年)	2,420,000,000	2,654,401,200
第37回利付国債(30年)	2,315,000,000	2,495,917,250
第38回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,597,474,300
第39回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,578,662,400
第40回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,329,300,000
第41回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,357,998,400
第42回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,450,638,000
第43回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,284,255,600
第44回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,396,399,500

第45回利付国債（30年）	1,440,000,000	1,436,529,600	
第46回利付国債（30年）	1,830,000,000	1,822,588,500	
第47回利付国債（30年）	1,730,000,000	1,752,576,500	
第48回利付国債（30年）	1,810,000,000	1,765,510,200	
第49回利付国債（30年）	1,730,000,000	1,685,712,000	
第50回利付国債（30年）	1,940,000,000	1,668,400,000	
第51回利付国債（30年）	1,720,000,000	1,311,448,400	
第52回利付国債（30年）	1,630,000,000	1,300,479,200	
第53回利付国債（30年）	1,490,000,000	1,213,143,100	
第54回利付国債（30年）	1,720,000,000	1,462,825,600	
第55回利付国債（30年）	1,590,000,000	1,349,289,900	
第56回利付国債（30年）	1,580,000,000	1,336,727,400	
第57回利付国債（30年）	1,560,000,000	1,315,782,000	
第58回利付国債（30年）	2,220,000,000	1,866,753,600	
第59回利付国債（30年）	1,370,000,000	1,120,865,500	
第60回利付国債（30年）	1,360,000,000	1,164,200,800	
第61回利付国債（30年）	1,360,000,000	1,105,340,000	
第62回利付国債（30年）	1,195,000,000	918,154,350	
第63回利付国債（30年）	1,450,000,000	1,078,945,000	
第64回利付国債（30年）	1,520,000,000	1,125,529,600	
第65回利付国債（30年）	1,465,000,000	1,081,404,400	
第66回利付国債（30年）	1,465,000,000	1,077,111,950	
第67回利付国債（30年）	1,665,000,000	1,289,459,250	
第68回利付国債（30年）	1,610,000,000	1,242,356,500	
第69回利付国債（30年）	1,580,000,000	1,249,969,600	
第70回利付国債（30年）	1,990,000,000	1,570,408,500	
第71回利付国債（30年）	1,510,000,000	1,188,596,500	
第72回利付国債（30年）	1,670,000,000	1,311,217,200	
第73回利付国債（30年）	1,870,000,000	1,465,893,000	
第74回利付国債（30年）	2,020,000,000	1,715,868,800	
第75回利付国債（30年）	1,410,000,000	1,291,207,500	
第76回利付国債（30年）	1,960,000,000	1,838,734,800	
第77回利付国債（30年）	2,170,000,000	2,133,869,500	
第78回利付国債（30年）	1,040,000,000	973,970,400	
第79回利付国債（30年）	1,360,000,000	1,210,223,200	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	368,870,400	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	205,172,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	133,996,200	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	277,511,400	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	298,491,200	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	175,484,200	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	279,174,600	

第80回利付国債(20年)	220,000,000	227,851,800
第81回利付国債(20年)	390,000,000	405,042,300
第82回利付国債(20年)	600,000,000	624,318,000
第83回利付国債(20年)	290,000,000	303,110,900
第84回利付国債(20年)	470,000,000	490,210,000
第85回利付国債(20年)	290,000,000	304,418,800
第86回利付国債(20年)	510,000,000	537,866,400
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,925,489,400
第88回利付国債(20年)	420,000,000	445,053,000
第89回利付国債(20年)	350,000,000	369,929,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	668,902,500
第91回利付国債(20年)	450,000,000	479,115,000
第92回利付国債(20年)	880,000,000	935,325,600
第93回利付国債(20年)	410,000,000	436,035,000
第94回利付国債(20年)	610,000,000	650,833,400
第95回利付国債(20年)	830,000,000	894,557,400
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,701,936,000
第97回利付国債(20年)	900,000,000	970,218,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	472,599,600
第99回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,626,481,400
第100回利付国債(20年)	480,000,000	520,598,400
第101回利付国債(20年)	715,000,000	781,773,850
第102回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,294,530,800
第103回利付国債(20年)	400,000,000	436,968,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	173,300,800
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,282,317,800
第106回利付国債(20年)	680,000,000	742,288,000
第107回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,199,176,000
第108回利付国債(20年)	840,000,000	907,124,400
第109回利付国債(20年)	920,000,000	995,863,200
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,202,487,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,068,998,200
第112回利付国債(20年)	990,000,000	1,085,505,300
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,220,040,600
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,567,030,900
第115回利付国債(20年)	700,000,000	775,453,000
第116回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,842,367,600
第117回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,633,298,400
第118回利付国債(20年)	660,000,000	725,234,400
第119回利付国債(20年)	530,000,000	575,489,900
第120回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,362,049,600
第121回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,607,415,600
第122回利付国債(20年)	900,000,000	978,075,000

第123回利付国債（20年）	1,820,000,000	2,017,815,800	
第124回利付国債（20年）	760,000,000	837,041,200	
第125回利付国債（20年）	1,280,000,000	1,430,323,200	
第126回利付国債（20年）	730,000,000	804,985,600	
第127回利付国債（20年）	1,020,000,000	1,117,471,200	
第128回利付国債（20年）	970,000,000	1,063,731,100	
第129回利付国債（20年）	740,000,000	806,045,000	
第130回利付国債（20年）	1,685,000,000	1,836,599,450	
第131回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,428,187,200	
第132回利付国債（20年）	660,000,000	714,865,800	
第133回利付国債（20年）	1,610,000,000	1,756,413,400	
第134回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,616,485,600	
第135回利付国債（20年）	630,000,000	682,768,800	
第136回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,129,537,500	
第137回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,301,736,000	
第138回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,420,280,400	
第139回利付国債（20年）	830,000,000	893,171,300	
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,703,442,800	
第141回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,738,480,000	
第142回利付国債（20年）	1,175,000,000	1,286,871,750	
第143回利付国債（20年）	1,640,000,000	1,769,379,600	
第144回利付国債（20年）	1,310,000,000	1,401,110,500	
第145回利付国債（20年）	2,335,000,000	2,540,409,950	
第146回利付国債（20年）	2,780,000,000	3,024,834,600	
第147回利付国債（20年）	2,380,000,000	2,565,830,400	
第148回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,434,036,800	
第149回利付国債（20年）	2,860,000,000	3,051,505,600	
第150回利付国債（20年）	2,830,000,000	2,987,602,700	
第151回利付国債（20年）	2,525,000,000	2,608,779,500	
第152回利付国債（20年）	2,850,000,000	2,940,345,000	
第153回利付国債（20年）	2,510,000,000	2,613,587,700	
第154回利付国債（20年）	2,755,000,000	2,833,545,050	
第155回利付国債（20年）	2,650,000,000	2,660,123,000	
第156回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,552,173,000	
第157回利付国債（20年）	3,070,000,000	2,775,771,200	
第158回利付国債（20年）	2,750,000,000	2,574,467,500	
第159回利付国債（20年）	2,980,000,000	2,816,219,200	
第160回利付国債（20年）	2,080,000,000	1,984,777,600	
第161回利付国債（20年）	2,380,000,000	2,232,868,400	
第162回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,149,976,200	
第163回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,208,034,200	
第164回利付国債（20年）	1,860,000,000	1,701,658,200	



	第165回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,140,262,500
	第166回利付国債(20年)	1,880,000,000	1,756,277,200
	第167回利付国債(20年)	2,290,000,000	2,067,801,300
	第168回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,043,957,800
	第169回利付国債(20年)	2,250,000,000	1,950,075,000
	第170回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,086,257,800
	第171回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,680,641,200
	第172回利付国債(20年)	2,280,000,000	1,978,948,800
	第173回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,073,528,000
	第174回利付国債(20年)	2,640,000,000	2,270,294,400
	第175回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,100,387,300
	第176回利付国債(20年)	2,660,000,000	2,307,895,800
	第177回利付国債(20年)	2,330,000,000	1,978,239,900
	第178回利付国債(20年)	2,280,000,000	1,962,897,600
	第179回利付国債(20年)	2,545,000,000	2,182,464,750
	第180回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,121,368,500
	第181回利付国債(20年)	2,370,000,000	2,170,137,900
	第182回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,269,968,000
	第183回利付国債(20年)	2,240,000,000	2,223,155,200
	第184回利付国債(20年)	2,180,000,000	2,048,633,200
	第185回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,192,580,000
	国債証券合計	552,082,000,000	542,246,480,350
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	99,477,000
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	77,045,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,763,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	113,959,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	111,120,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	106,573,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	103,614,000
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	215,576,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,195,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,967,000
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	77,589,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	215,150,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	214,296,000
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,250,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,418,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	99,712,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	99,468,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	295,977,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	193,996,000

第 8 3 0 回東京都公募公債	300,000,000	286,131,000	
平成 2 7 年度第 1 5 回北海道公募公債	100,000,000	100,035,000	
平成 2 8 年度第 1 回北海道公募公債	100,000,000	99,667,000	
平成 2 8 年度第 1 4 回北海道公募公債	100,000,000	99,818,000	
平成 3 0 年度第 1 4 回北海道公募公債	200,000,000	196,882,000	
令和 4 年度第 1 0 回北海道公募公債	200,000,000	194,362,000	
令和 5 年度第 6 回北海道公募公債	100,000,000	99,063,000	
第 3 1 回 1 号宮城県公募公債（ 1 0 年）	200,000,000	201,448,000	
第 3 9 回 1 号宮城県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	97,253,000	
第 4 回神奈川県公募公債（ 3 0 年）	200,000,000	235,170,000	
第 1 1 回神奈川県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	108,749,000	
第 1 5 回神奈川県公募公債（ 2 0 年）	200,000,000	217,326,000	
第 1 7 回神奈川県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	109,125,000	
第 2 0 回神奈川県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	107,254,000	
第 2 7 回神奈川県公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	104,085,000	
第 2 1 0 回神奈川県公募公債	200,000,000	200,900,000	
第 2 1 5 回神奈川県公募公債	100,000,000	100,622,000	
第 2 1 8 回神奈川県公募公債	100,000,000	100,032,000	
第 2 2 6 回神奈川県公募公債	100,000,000	99,660,000	
第 2 2 7 回神奈川県公募公債	100,000,000	99,468,000	
第 2 4 3 回神奈川県公募公債	200,000,000	193,936,000	
第 6 回大阪府公募公債（ 2 0 年）	200,000,000	217,626,000	
第 7 回大阪府公募公債（ 2 0 年）	200,000,000	216,098,000	
第 1 0 回大阪府公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	107,400,000	
第 3 9 5 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	151,000,000	151,732,350	
第 3 9 9 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	100,712,000	
第 4 0 0 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	300,000,000	302,208,000	
第 4 0 2 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	100,660,000	
第 4 0 7 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	156,000,000	155,500,800	
第 4 1 0 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	200,000,000	198,688,000	
第 4 3 9 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	200,000,000	196,864,000	
第 4 4 0 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	98,390,000	
第 4 5 8 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	96,315,000	
第 4 6 5 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	160,000,000	153,043,200	
第 4 6 8 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	182,000,000	173,589,780	
第 4 6 9 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	200,000,000	190,490,000	
平成 2 1 年度第 3 回京都府公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	109,540,000	
平成 2 3 年度第 5 回京都府公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	107,767,000	
平成 2 7 年度第 4 回京都府公募公債	100,000,000	100,722,000	
平成 2 8 年度第 5 回京都府公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	90,221,000	
	100,000,000	92,447,000	

平成29年度第5回京都府公募公債(20年)			
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	134,858,925	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	107,825,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	100,667,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,164,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,160,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,048,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	440,080,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,489,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	90,397,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	291,687,000	
第1回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,976,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	97,974,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	82,325,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	107,330,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,961,000	
平成27年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,690,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,504,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,578,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,453,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	299,323,600	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	109,800,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,450,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,070,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,591,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,130,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	275,112,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,901,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	81,161,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	193,742,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	96,671,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	153,574,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,911,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	109,163,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	218,666,000	

平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,036,481	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,496,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	375,644,100	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	96,077,000	
第2回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	98,371,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	107,719,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	108,774,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	86,144,000	
第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	219,730,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	182,340,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	217,326,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	181,072,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,641,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,539,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,882,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,503,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	96,274,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	95,984,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	142,321,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	107,838,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	107,991,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	103,183,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,307,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	103,853,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	109,348,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,443,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	102,229,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,630,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	81,161,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	91,014,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	290,628,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	95,632,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	90,022,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債（グリーン bond・10年）	100,000,000	98,102,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	97,830,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	217,548,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	109,483,000	

第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	107,330,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,459,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,701,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,541,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,629,200	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	290,301,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	96,503,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	126,444,500	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,645,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	288,096,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	287,148,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	98,044,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	215,910,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	97,827,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,357,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,984,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,906,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,414,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,341,754	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,673,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,686,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,753,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,681,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,184,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,022,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	397,984,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,361,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,691,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,868,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,966,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	192,697,025	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,399,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,640,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	95,442,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	189,992,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	191,054,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,047,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,121,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,847,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	96,099,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	97,395,310	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,644,000	

平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,366,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,160,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	218,866,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	76,469,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	272,352,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	93,184,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	191,370,000	
第1回名古屋市長市公募公債（12年）	100,000,000	101,545,000	
第1回名古屋市長市公募公債（30年）	100,000,000	115,975,000	
第5回名古屋市長市公募公債（30年）	100,000,000	115,657,000	
第9回名古屋市長市公募公債（20年）	100,000,000	108,093,000	
第11回名古屋市長市公募公債（30年）	100,000,000	102,551,000	
第499回名古屋市長市公募公債（10年）	100,000,000	99,761,000	
第512回名古屋市長市公募公債（10年）	300,000,000	290,547,000	
第1回京都市公募公債（20年）	100,000,000	102,503,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	199,380,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	127,524,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	217,720,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	110,158,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	107,407,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	76,769,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	76,698,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	103,499,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	327,312,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,712,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,675,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,663,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	98,952,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,058,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	207,578,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	290,577,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	95,681,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	104,029,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,424,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,021,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	194,742,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	107,948,000	
第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	196,366,000	

	第 8 9 回川崎市公募公債	100,000,000	99,668,000	
	第 9 3 回川崎市公募公債	100,000,000	96,243,000	
	平成 2 6 年度第 2 回北九州市公募公債	100,000,000	100,441,000	
	平成 2 7 年度第 2 回北九州市公募公債	100,000,000	100,647,000	
	平成 2 8 年度第 1 回北九州市公募公債	100,000,000	99,659,000	
	平成 2 1 年度第 3 回福岡市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	109,242,000	
	平成 2 5 年度第 6 回福岡市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	105,497,000	
	平成 2 6 年度第 2 回広島市公募公債	100,000,000	100,461,000	
	平成 2 8 年度第 4 回広島市公募公債	105,000,000	104,666,100	
	平成 2 9 年度第 6 回広島市公募公債	170,000,000	168,684,200	
	令和元年度第 6 回広島市公募公債	550,000,000	533,406,500	
	令和 2 年度第 3 回広島市公募公債（ 5 年 ）	300,000,000	299,106,000	
	令和元年度第 5 回千葉市公募公債	200,000,000	193,534,000	
	令和 3 年度第 8 回千葉市公募公債	300,000,000	285,225,000	
	令和 4 年度第 1 回千葉市公募公債	100,000,000	95,517,000	
	令和 5 年度第 2 回福井県公募公債	100,000,000	97,308,000	
	平成 2 7 年度第 1 回山梨県公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	100,682,000	
	平成 2 6 年度第 1 回岡山県公募公債（ 1 0 年 ）	200,000,000	200,636,000	
	平成 3 0 年度第 3 回岡山県公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	98,079,000	
	第 1 1 3 回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	107,776,000	
	地方債証券合計	32,880,430,000	32,839,291,325	
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	99,542,000	
	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	99,909,000	
	第 7 8 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,566,000	
	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	62,680,000	
	第 1 4 8 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	500,000,000	499,270,000	
	第 2 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,766,000	
	第 2 1 回道路債券	100,000,000	116,124,000	
	第 2 8 回道路債券	200,000,000	234,912,000	
	第 3 3 回道路債券	200,000,000	237,114,000	
	第 3 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,427,000	
	第 3 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,226,000	
	第 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,896,000	
	第 4 2 回道路債券	200,000,000	206,040,000	

第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,085,000	
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	114,336,000	
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	218,420,000	
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	219,866,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,289,000	
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	111,544,000	
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	109,946,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,761,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,431,000	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,066,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,809,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,222,000	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,277,000	
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,975,000	
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	107,180,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	550,332,000	
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	108,378,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	82,702,000	
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	210,620,000	
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,686,000	
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	208,456,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	259,000,000	260,279,460	
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	300,975,000	
第238回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	401,876,000	
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	101,478,000	
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	603,216,000	
	200,000,000	204,022,000	



第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,465,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	112,726,880	
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	200,764,000	
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	99,951,000	
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	76,763,000	
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	106,246,720	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,885,000	
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	204,126,700	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,820,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,868,000	
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	99,587,000	
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	199,046,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	291,003,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,359,000	
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	99,381,000	
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	119,016,000	
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	197,528,000	
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	273,375,000	
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	211,489,780	
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	97,182,000	
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	96,768,000	
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	115,551,600	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	340,392,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	103,368,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	350,856,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	233,194,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	114,931,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	217,716,000	

第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	214,082,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	151,362,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,320,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	215,666,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	106,856,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	530,170,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,475,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,481,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	419,000,000	421,765,400	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,859,500	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,264,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,526,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,511,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,964,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,646,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,284,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,436,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,542,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	249,860,460	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,629,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,475,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,407,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,132,100	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,818,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	154,316,760	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,836,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,008,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,660,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,114,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	711,410,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,669,000	
F143回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,747,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,894,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	195,042,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,425,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,710,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,664,000	

F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,508,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,118,000	
F 2 2 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,948,000	
F 4 4 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,268,000	
第 2 9 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,335,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	102,953,000	
第 2 7 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,678,000	
第 2 8 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,040,000	
第 1 9 回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,708,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,313,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,828,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,553,960	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,455,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,059,600	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	184,858,850	
第 8 9 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,834,000	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	200,664,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	125,866,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	69,563,000	
第 1 7 1 回都市再生債券	200,000,000	146,928,000	
第 1 9 1 回都市再生債券	100,000,000	98,169,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,537,000	
第 6 2 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	96,637,000	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	101,739,000	100,829,453	
第 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,570,000	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	69,658,000	69,239,355	
第 4 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,612,000	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	121,080,000	119,732,379	
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	137,721,000	135,653,807	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	48,923,000	48,310,484	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,202,000	10,269,231	
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	174,021,000	171,756,986	
第 9 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	119,616,000	118,001,184	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,319,000	10,402,067	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,703,000	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,796,000	14,324,110	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,599,000	14,094,275	

第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,302,000	15,968,249	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,552,000	18,299,890	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,619,000	19,466,164	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,151,000	19,981,387	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,666,000	41,329,195	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,002,000	18,721,179	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,359,000	19,056,642	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,997,000	18,698,703	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,019,000	17,674,401	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,049,000	10,131,803	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,984,000	37,203,137	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,921,000	19,560,529	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,431,000	26,152,986	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,068,000	24,760,195	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,260,000	24,976,397	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,328,000	53,663,933	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,862,000	65,790,175	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,679,000	34,088,536	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,603,000	35,303,364	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,198,000	35,941,029	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,414,000	31,059,385	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,453,000	29,853,266	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,698,000	35,473,153	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	163,785,000	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,023,000	92,255,451	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	123,044,000	124,577,128	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,053,000	36,320,513	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,422,000	37,694,432	
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,181,000	38,311,960	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,790,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,426,000	120,678,894	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,096,000	41,012,164	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,138,000	86,182,096	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,928,000	48,482,265	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,432,000	51,721,546	
第 9 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	312,816,000	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,615,000	51,179,369	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,968,000	160,053,701	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,704,000	107,856,108	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,864,000	52,424,171	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,086,000	56,527,698	

第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,215,000	60,501,180	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,896,000	66,153,250	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,416,000	65,487,795	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,805,000	66,089,266	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,375,000	66,914,962	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,579,000	66,949,609	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,848,000	68,902,232	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,928,000	69,028,582	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,666,000	68,563,578	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,591,000	68,489,677	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,415,000	69,270,740	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,682,000	140,887,151	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,354,000	69,171,871	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,230,000	141,913,919	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,106,000	70,781,604	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,020,000	141,103,025	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,561,000	71,172,948	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,506,000	143,223,014	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,302,000	143,929,053	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,938,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,524,000	73,176,840	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,928,000	72,783,062	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,213,000	72,363,481	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,864,000	149,050,452	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,021,000	74,489,145	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,160,000	73,801,016	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,760,000	149,526,518	

第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,910,000	75,579,649	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	244,464,000	227,048,384	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,486,000	152,695,643	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,844,000	78,860,312	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,776,000	79,470,717	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,758,000	163,426,349	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,917,000	82,538,237	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,266,000	165,355,134	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,250,000	166,840,217	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,519,000	83,092,785	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,268,000	168,022,938	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,686,000	167,168,765	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,110,000	84,645,729	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,559,000	85,477,651	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	273,381,000	255,173,825	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,882,000	85,829,732	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,107,000	88,089,463	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,498,000	89,457,476	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,537,000	90,538,504	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,658,000	181,139,808	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,920,000	93,768,161	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,438,000	192,328,347	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,247,000	97,212,459	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	88,010,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,642,000	97,643,742	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,511,000	98,318,858	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,856,000	

	第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,825,000	
	第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	77,525,000	
	第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	284,661,000	
	第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,538,000	
	第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,206,000	
	い第843号商工債	200,000,000	199,456,000	
	い第847号商工債	100,000,000	99,556,000	
	い第850号商工債	200,000,000	198,818,000	
	い第876号商工債	300,000,000	297,558,000	
	い第878号商工債	100,000,000	99,086,000	
	第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,710,000	
	第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,481,000	
	第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,322,000	
	第385回信金中金債（5年）	400,000,000	396,240,000	
	第394回信金中金債（5年）	100,000,000	98,921,000	
	第16号商工債（10年）	100,000,000	100,329,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,592,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	106,991,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	96,863,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	194,358,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	482,885,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,065,000	
	第102回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,575,000	
	第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,222,000	
	第85回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,324,000	
	第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,304,000	
	第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,456,000	
	第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,495,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,436,000	
	第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	598,764,000	
	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,590,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,404,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,728,000	
	第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,172,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,587,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,413,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	185,024,000	
	特殊債券合計	36,824,868,000	36,691,960,150	
社債券	第8回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,648,000	

第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	98,737,000	
第32回ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	200,000,000	198,812,000	
第33回ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	98,411,000	
第19回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	400,000,000	397,384,000	
第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー 円貨社債	400,000,000	398,460,000	
第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空 円貨社債(2023)	100,000,000	99,374,000	
第52回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,153,000	
第8回ピー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債 (2023)	400,000,000	396,992,000	
第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	96,263,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,926,000	
第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,505,000	
第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,379,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,720,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	94,523,000	
第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,946,000	
第2回DM三井製糖ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	99,835,000	
第19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	99,862,000	
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	100,559,000	
第16回キリンホールディングス株式会社無 担保社債	300,000,000	299,748,000	
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	198,532,000	
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	299,697,000	
第12回サントリーホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	96,683,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,913,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,329,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,731,000	
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	98,248,000	
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	97,220,000	
第27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	99,899,000	
第28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	99,863,000	
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	199,334,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,693,000	



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	98,636,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,212,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,572,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,303,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,745,000	
第13回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	94,465,000	
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	98,461,000	
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	197,758,000	
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	199,528,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	81,011,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,391,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,867,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	194,288,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	282,666,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	199,808,000	
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	99,694,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,183,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	400,000,000	399,076,000	
第4回E N E O Sホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	96,001,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,210,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,629,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	97,949,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	95,637,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,536,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,679,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,203,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,978,000	
第14回株式会社L I X I L 無担保社債	100,000,000	99,189,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,614,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	97,583,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,556,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,390,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,377,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,277,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,750,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,082,000	

第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,532,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	94,169,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,858,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,718,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,805,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,989,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,166,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,461,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	191,022,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,271,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	84,341,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,233,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	107,715,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	194,368,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,019,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,385,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	95,342,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,335,000	
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	96,030,000	
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	99,013,000	
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	109,721,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,380,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,426,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,332,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	192,996,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	98,569,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,373,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,456,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,684,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,703,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,826,000	

第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,378,000	
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	99,648,000	
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	99,213,000	
第82回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,435,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,239,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,907,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,991,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,308,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,047,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,884,000	
第36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	199,236,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	198,024,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,956,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,234,000	
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	98,493,000	
第39回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,548,000	
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	98,759,000	
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	299,910,000	
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	198,124,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,808,000	
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	198,224,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,480,000	
第84回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	197,662,000	
第86回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	196,354,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,944,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	84,492,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,247,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	94,714,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	95,423,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	81,629,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	85,417,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,371,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	85,856,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	76,151,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	86,161,000	

第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,577,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,232,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	217,512,000	
第109回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,921,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,231,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	85,316,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	79,049,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,582,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	75,671,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	83,776,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	70,732,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,604,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,117,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	74,925,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	83,475,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,100,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	83,520,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,028,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,457,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,239,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	78,588,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	66,593,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	58,891,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	71,598,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	79,864,000	
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	153,126,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,150,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,802,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,717,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	170,294,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,699,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	89,528,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	91,352,000	

第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	82,387,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,583,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,142,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,168,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,750,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,392,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	94,904,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,304,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,030,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,477,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,046,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,122,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,031,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	290,115,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,360,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	194,802,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	178,436,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,028,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,172,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	193,036,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	94,437,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,625,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,326,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	94,005,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,200,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,440,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,650,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,434,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,395,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	93,848,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	192,832,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,740,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	87,717,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	97,397,000	
第31回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	99,861,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	89,351,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,376,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,386,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,494,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,440,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	96,558,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,010,000	

第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,664,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,745,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,812,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	95,760,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	267,768,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	95,831,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	94,268,000	
第4回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	98,959,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	75,302,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,626,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	189,308,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	83,301,000	
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	197,666,000	
社債券合計	30,000,000,000	29,020,234,000	
合計		640,797,965,825	

(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

項目	2023年10月 2日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	12,699,032,983
コール・ローン	388,296,008
株式	561,335,259,536
投資信託受益証券	160,706,637
投資証券	10,944,685,348
派生商品評価勘定	9,665,086
未収入金	3,965,579
未収配当金	598,966,078
前払金	588,369,918
差入委託証拠金	4,387,449,742
流動資産合計	591,116,396,915
資産合計	591,116,396,915
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	597,637,559

	2023年10月 2日現在
項目	金額（円）
未払金	77,770,649
未払解約金	114,520,048
未払利息	668
流動負債合計	789,928,924
負債合計	789,928,924
純資産の部	
元本等	
元本	114,577,143,137
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	475,749,324,854
元本等合計	590,326,467,991
純資産合計	590,326,467,991
負債純資産合計	591,116,396,915

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年10月 2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) 新株予約権証券 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(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、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>(4) 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>

2023年10月 2日現在	
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> <p>(2)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>(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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2023年10月 2日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	114,577,143,137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 5.1522円 (1万口当たり純資産額) (51,522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

2023年10月 2日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年10月 2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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)



該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年10月 2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	14,265,005,735円
期中一部解約元本額	28,023,790,675円
期末元本額	114,577,143,137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）	1,584,656,685円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,900,976円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,464,761,212円
世界経済インデックスファンド	12,702,263,957円
外国株式インデックス・オープン	883,071,570円
D C マイセクション 2 5	646,954,560円
D C マイセクション 5 0	3,503,942,939円
D C マイセクション 7 5	4,362,419,530円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,617,043,369円
D C マイセクション S 2 5	411,558,324円
D C マイセクション S 5 0	1,887,136,607円
D C マイセクション S 7 5	1,898,461,450円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	20,858,531円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	139,676,076円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	109,644,875円
D C 世界経済インデックスファンド	9,457,847,420円
外国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	997,244,962円
マイセクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,777,533円
マイセクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	3,357,647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）	21,919,341円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	7,895,440円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	33,182,785円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	7,792,631円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	21,945,351円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	168,226,228円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	133,637,092円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,012,778,531円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	69,073,884円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	17,896,351円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	116,595,969円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	38,298,181円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	787,426,934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）	885,215,160円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,143,447,697円
コア投資戦略ファンド（安定型）	113,740,322円
コア投資戦略ファンド（成長型）	283,481,970円
分散投資コア戦略ファンド A	1,549,153,616円
分散投資コア戦略ファンド S	7,326,808,258円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,464,100,919円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,008,195,448円
コア投資戦略ファンド（切替型）	133,649,708円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	499,445,552円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,529,049円
S M T インデックスバランス・オープン	128,080,046円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	76,157,099円
外国株式 S M T B セレクション（S M A 専用）	4,640,470,844円
S M T 世界経済インデックス・オープン	249,039,869円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,010,427,786円

区分	2023年10月 2日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	176,581,684円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,332,838円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,110,283,759円
グローバル経済コア	534,036,193円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,382,160円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,195,644円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	116,500,119円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	27,810,950円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	139,254,936円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	132,817,174円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	56,621,782円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	62,421,180円
10資産分散投資ファンド	53,170,717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）	54,890,130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）	23,173,862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）	439,220,327円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,457,569,679円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	102,751,018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）	73,087,436円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	85,042,301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）	78,606,339円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	194,200,383円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	186,765,260円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	185,818,200円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	189,041,134円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	187,171,165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）	91,791,755円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	120,414,728円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年10月 2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,538,309,409
投資信託受益証券	28,785,739
投資証券	582,916,801
合計	5,926,606,869

(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

（2023年10月 2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	18,631,985,912	-	18,043,615,994	588,369,918
合計		18,631,985,912	-	18,043,615,994	588,369,918

## (注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

## 4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

(2023年10月 2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	472,206,200	-	472,603,645	397,445
	アメリカドル	390,516,200	-	390,853,345	337,145
	スイスフラン	81,690,000	-	81,750,300	60,300
	合計	472,206,200	-	472,603,645	397,445

## (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	23,392	41.10	961,411.20	
	BAKER HUGHES CO	77,332	35.32	2,731,366.24	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	165.96	3,003,710.04	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	86.23	731,402.86	
	CHEVRON CORP	135,745	168.62	22,889,321.90	
	CONOCOPHILLIPS	90,080	119.80	10,791,584.00	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	27.05	1,475,469.30	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	47.70	2,397,211.20	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	154.88	2,054,792.96	
	EOG RESOURCES INC	43,691	126.76	5,538,271.16	
	EQT CORPORATION	27,026	40.58	1,096,715.08	
	EXXON MOBIL	301,729	117.58	35,477,295.82	
	HALLIBURTON CO	70,302	40.50	2,847,231.00	
	HESS CORP	21,602	153.00	3,305,106.00	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	56.93	764,512.97	
	KINDER MORGAN INC	144,061	16.58	2,388,531.38	
	MARATHON OIL CORP	50,360	26.75	1,347,130.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	31,527	151.34	4,771,296.18	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	64.88	3,205,461.28	
	ONEOK INC	43,535	63.43	2,761,425.05	

OVINTIV INC	20,398	47.57	970,332.86
PHILLIPS 66	34,260	120.15	4,116,339.00
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	229.55	3,988,201.70
SCHLUMBERGER	105,564	58.30	6,154,381.20
TARGA RESOURCES CORP	17,298	85.72	1,482,784.56
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,823.56	971,957.48
VALERO ENERGY CORP	26,571	141.71	3,765,376.41
WILLIAMS COS	90,577	33.69	3,051,539.13
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,508	283.40	4,678,367.20
ALBEMARLE CORP	8,403	170.04	1,428,846.12
AMCOR PLC	110,292	9.16	1,010,274.72
AVERY DENNISON CORP	6,638	182.67	1,212,563.46
BALL CORP	21,539	49.78	1,072,211.42
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	125.52	1,077,212.64
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,149	85.74	1,127,395.26
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	15.63	672,090.00
CORTEVA INC	51,304	51.16	2,624,712.64
CROWN HOLDINGS INC	9,940	88.48	879,491.20
DOW INC	51,372	51.56	2,648,740.32
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	74.59	2,544,936.21
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	76.72	677,591.04
ECOLAB INC	18,665	169.40	3,161,851.00
FMC CORP	8,264	66.97	553,440.08
FREEMONT-MCMORAN INC	105,762	37.29	3,943,864.98
INT'L PAPER CO	25,191	35.47	893,524.77
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	68.17	1,316,158.19
LINDE PLC	36,447	372.35	13,571,040.45
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	94.70	1,869,851.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,371	410.48	1,794,208.08
MOSAIC CO/THE	27,732	35.60	987,259.20
NEWMONT CORPORATION	61,808	36.95	2,283,805.60
NUCOR CORP	18,727	156.35	2,927,966.45
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,783	153.55	1,195,079.65
PPG INDUSTRIES INC	17,495	129.80	2,270,851.00
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	262.23	1,081,960.98
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	94.81	991,333.36
SEALED AIR CORP	11,690	32.86	384,133.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,250	255.05	4,654,662.50
STEEL DYNAMICS INC	11,618	107.22	1,245,681.96
VULCAN MATERIALS CO	10,153	202.02	2,051,109.06
WESTLAKE CORP	2,222	124.67	277,016.74
WESTROCK CO	21,356	35.80	764,544.80

3 M COMPANY	40,676	93.62	3,808,087.12
AECOM	10,456	83.04	868,266.24
AERCAP HOLDINGS NV	11,968	62.67	750,034.56
ALLEGION PLC	5,598	104.20	583,311.60
AMETEK INC	17,753	147.76	2,623,183.28
AXON ENTERPRISE INC	5,367	198.99	1,067,979.33
BOEING CO	42,311	191.68	8,110,172.48
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	124.49	1,370,634.90
CARLISLE COS INC	3,456	259.26	896,002.56
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	55.20	3,425,877.60
CATERPILLAR	38,381	273.00	10,478,013.00
CUMMINS INC	10,414	228.46	2,379,182.44
DEERE&CO	20,925	377.38	7,896,676.50
DOVER CORP	10,657	139.51	1,486,758.07
EATON CORP	29,584	213.28	6,309,675.52
EMERSON ELECTRIC CO	42,473	96.57	4,101,617.61
FASTENAL CO	44,011	54.64	2,404,761.04
FERGUSON PLC	16,260	164.47	2,674,282.20
FORTIVE CORP	25,894	74.16	1,920,299.04
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	62.16	640,869.60
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	108.96	567,790.56
GENERAL DYNAMICS CORP	17,004	220.97	3,757,373.88
GENERAL ELECTRIC CO	81,042	110.55	8,959,193.10
GRACO INC	13,378	72.88	974,988.64
GRAINGER (WW) INC	3,363	691.84	2,326,657.92
HEICO CORP	3,640	161.93	589,425.20
HEICO CORP-CLASS A	4,690	129.22	606,041.80
HONEYWELL INTL INC	49,482	184.74	9,141,304.68
HOWMET AEROSPACE INC	32,364	46.25	1,496,835.00
HUBBELL INC	3,709	313.41	1,162,437.69
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	204.58	507,767.56
IDEX CORP	5,916	208.02	1,230,646.32
ILLINOIS TOOL WORKS	22,658	230.31	5,218,363.98
INGERSOLL-RAND INC	31,562	63.72	2,011,130.64
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	46.42	589,534.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	53.21	2,674,653.86
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	174.12	2,556,429.84
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	374.44	945,835.44
LOCKHEED MARTIN CORP	16,942	408.96	6,928,600.32
MASCO CORP	15,277	53.45	816,555.65
NORDSON CORP	4,121	223.17	919,683.57
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,740	440.19	4,727,640.60

OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	80.31	2,466,882.27
OWENS CORNING	6,460	136.41	881,208.60
PACCAR INC	38,842	85.02	3,302,346.84
PARKER HANNIFIN CORP	9,535	389.52	3,714,073.20
PENTAIR PLC	10,813	64.75	700,141.75
QUANTA SERVICES INC	11,573	187.07	2,164,961.11
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	285.87	2,420,175.42
RTX CORP	108,761	71.97	7,827,529.17
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	37.82	522,974.96
SMITH (A.O.) CORP	9,016	66.13	596,228.08
SNAP-ON INC	4,000	255.06	1,020,240.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	83.58	1,052,940.84
TEXTRON	17,063	78.14	1,333,302.82
TORO CO	8,812	83.10	732,277.20
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	202.91	3,455,151.48
TRANSDIGM GROUP INC	4,084	843.13	3,443,342.92
UNITED RENTALS INC	5,364	444.57	2,384,673.48
WABTEC CORP	13,304	106.27	1,413,816.08
WATSCO INC	2,656	377.72	1,003,224.32
XYLEM INC	16,864	91.03	1,535,129.92
AUTOMATIC DATA PROCESS	30,799	240.58	7,409,623.42
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	109.27	1,009,654.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,290	179.05	1,484,324.50
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	67.85	723,823.80
CINTAS CORP	6,804	481.01	3,272,792.04
CLARIVATE PLC	27,357	6.71	183,565.47
COPART INC	63,766	43.09	2,747,676.94
EQUIFAX INC	9,160	183.18	1,677,928.80
JACOBS SOLUTIONS INC	8,667	136.50	1,183,045.50
LEIDOS HOLDINGS	8,529	92.16	786,032.64
PAYCHEX INC	24,118	115.33	2,781,528.94
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	259.27	1,098,008.45
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	181.70	621,959.10
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	142.51	2,345,002.05
ROBERT HALF INC	7,185	73.28	526,516.80
ROLLINS INC	17,468	37.33	652,080.44
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	52.54	809,221.08
TRANSUNION	15,741	71.79	1,130,046.39
VERISK ANALYTICS INC	10,738	236.24	2,536,745.12
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	134.30	2,655,782.50
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	152.44	4,609,175.84
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	86.13	720,649.71

CSX CORP	152,261	30.75	4,682,025.75
DELTA AIR LINES INC	9,648	37.00	356,976.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	114.63	1,407,656.40
FEDEX CORP	17,749	264.92	4,702,065.08
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.54	400,058.94
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	188.52	1,083,612.96
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	50.15	683,193.45
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	196.93	3,332,055.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	409.14	3,009,633.84
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	27.07	366,338.31
U-HAUL HOLDING CO	6,606	52.39	346,088.34
UBER TECHNOLOGIES INC	134,723	45.99	6,195,910.77
UNION PACIFIC CORP	45,361	203.63	9,236,860.43
UNITED PARCEL SERVICE B	53,764	155.87	8,380,194.68
APTIV PLC	21,896	98.59	2,158,726.64
BORGWARNER INC	19,781	40.37	798,558.97
FORD MOTOR COMPANY	290,797	12.42	3,611,698.74
GENERAL MOTORS CO	103,664	32.97	3,417,802.08
LEAR CORP	3,648	134.20	489,561.60
LUCID GROUP INC	61,234	5.59	342,298.06
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	24.28	1,246,438.08
TESLA INC	213,419	250.22	53,401,702.18
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	514.09	1,081,131.27
DR HORTON INC	22,973	107.47	2,468,908.31
GARMIN LTD	10,561	105.20	1,111,017.20
HASBRO INC	10,572	66.14	699,232.08
LENNAR CORP-CL A	18,864	112.23	2,117,106.72
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	385.61	3,323,572.59
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	85.81	357,227.03
NIKE B	91,582	95.62	8,757,070.84
NVR INC	247	5,963.30	1,472,935.10
PULTE GROUP INC	16,747	74.05	1,240,115.35
VF CORP	25,718	17.67	454,437.06
WHIRLPOOL CORP	3,785	133.70	506,054.50
AIRBNB INC-CLASS A	30,729	137.21	4,216,326.09
ARAMARK	16,686	34.70	579,004.20
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	3,083.95	8,631,976.05
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	46.35	813,906.00
CARNIVAL CORPORATION	71,810	13.72	985,233.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,047	1,831.83	3,749,756.01
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	143.22	1,318,626.54
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	378.79	1,078,793.92

DOORDASH INC - A	19,212	79.47	1,526,777.64
DRAFTKINGS INC	32,654	29.44	961,333.76
EXPEDIA GROUP INC	11,638	103.07	1,199,528.66
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,175	150.18	2,879,701.50
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	106.08	401,724.96
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	45.84	1,171,670.40
MARRIOTT INTL A	19,516	196.56	3,836,064.96
MCDONALD'S CORP	54,264	263.44	14,295,308.16
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	36.76	836,437.04
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	92.14	1,577,068.24
STARBUCKS CORP	85,428	91.27	7,797,013.56
VAIL RESORTS INC	3,014	221.89	668,776.46
WYNN RESORTS LTD	6,702	92.41	619,331.82
YUM BRANDS INC	22,162	124.94	2,768,920.28
ACTIVISION BLIZZARD INC	58,681	93.63	5,494,302.03
ALPHABET INC-CL A	444,829	130.86	58,210,322.94
ALPHABET INC-CL C	395,244	131.85	52,112,921.40
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	439.82	3,163,185.44
COMCAST CORP-CL A	312,679	44.34	13,864,186.86
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	120.40	2,375,853.20
FOX CORP - CLASS A	21,544	31.20	672,172.80
FOX CORP- CLASS B	10,345	28.88	298,763.60
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	28.66	817,125.26
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	91.32	835,851.96
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	62.30	958,111.70
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	25.46	345,848.64
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	83.04	964,343.52
MATCH GROUP INC	22,730	39.17	890,447.75
META PLATFORMS INC-CLASS A	165,576	300.21	49,707,570.96
NETFLIX INC	33,103	377.60	12,499,692.80
NEWS CORP-CLASS A	33,479	20.06	671,588.74
OMNICOM GROUP	14,048	74.48	1,046,295.04
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	12.90	419,353.20
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	27.03	1,237,082.01
ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	28.96	825,446.88
ROKU INC	9,122	70.59	643,921.98
SEA LTD-ADR	28,338	43.95	1,245,455.10
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.52	273,315.36
SNAP INC - A	63,578	8.91	566,479.98
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	140.39	1,806,398.13
THE WALT DISNEY CO	135,788	81.05	11,005,617.40
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	78.15	2,624,511.45



WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	10.86	1,926,705.18
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	16.40	359,734.00
AMAZON.COM	690,901	127.12	87,827,335.12
AUTOZONE INC	1,368	2,539.99	3,474,706.32
BATH & BODY WORKS INC	13,528	33.80	457,246.40
BEST BUY COMPANY INC	15,285	69.47	1,061,848.95
BURLINGTON STORES INC	5,108	135.30	691,112.40
CARMAX INC	10,695	70.73	756,457.35
CHEWY INC - CLASS A	6,878	18.26	125,592.28
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	108.58	537,471.00
EBAY	41,952	44.09	1,849,663.68
ETSY INC	10,294	64.58	664,786.52
GENUINE PARTS CO	9,903	144.38	1,429,795.14
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	39.74	278,180.00
HOME DEPOT	75,273	302.16	22,744,489.68
LKQ CORP	19,286	49.51	954,849.86
LOWES COMPANIES	44,328	207.84	9,213,131.52
MERCADOLIBRE INC	3,353	1,267.88	4,251,201.64
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	908.86	4,159,852.22
POOL CORP	2,664	356.10	948,650.40
ROSS STORES INC	25,425	112.95	2,871,753.75
TJX COMPANIES INC	85,671	88.88	7,614,438.48
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	203.05	1,593,130.30
ULTA BEAUTY INC	3,920	399.45	1,565,844.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	22.75	568,750.00
COSTCO WHOLESALE CORP	32,965	564.96	18,623,906.40
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	105.80	1,723,164.60
DOLLAR TREE INC	16,318	106.45	1,737,051.10
KROGER CO	50,664	44.75	2,267,214.00
SYSCO CORP	40,090	66.05	2,647,944.50
TARGET (DAYTON HUDSON)	34,220	110.57	3,783,705.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	22.24	1,146,850.08
WALMART INC	110,203	159.93	17,624,765.79
ALTRIA GROUP INC	132,765	42.05	5,582,768.25
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	75.42	3,063,409.56
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	57.69	1,384,906.14
BUNGE LIMITED	11,604	108.25	1,256,133.00
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	41.08	651,898.52
COCA-COLA CO	305,497	55.98	17,101,722.06
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	62.48	961,817.12
CONAGRA BRANDS INC	33,324	27.42	913,744.08
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,979	251.33	3,010,682.07

DARLING INGREDIENTS INC	13,242	52.20	691,232.40
GENERAL MILLS INC	43,531	63.99	2,785,548.69
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	200.08	2,189,275.36
HORMEL FOODS CORP	23,338	38.03	887,544.14
JM SMUCKER CO	7,850	122.91	964,843.50
KELLOGG CO	18,819	59.51	1,119,918.69
KEURIG DR PEPPER INC	65,371	31.57	2,063,762.47
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	33.64	2,319,948.96
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	92.46	1,098,054.96
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	75.64	1,368,478.88
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	63.59	932,801.71
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	101,324	69.40	7,031,885.60
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	52.95	3,089,526.60
PEPSICO INC	102,377	169.44	17,346,758.88
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,372	92.58	10,681,139.76
TYSON FOODS INC	23,306	50.49	1,176,719.94
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	91.63	1,772,673.98
CLOROX COMPANY	9,570	131.06	1,254,244.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	71.11	4,178,494.71
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	144.55	2,453,447.15
KENVUE INC	111,921	20.08	2,247,373.68
KIMBERLY-CLARK CORP	24,643	120.85	2,978,106.55
PROCTER & GAMBLE CO	177,374	145.86	25,871,771.64
ABBOTT LABORATORIES	129,183	96.85	12,511,373.55
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	305.32	1,603,845.96
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	37.74	1,569,078.24
BECTON DICKINSON & CO	21,103	258.53	5,455,758.59
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,838	52.80	5,641,046.40
CARDINAL HEALTH	19,151	86.82	1,662,689.82
CENCORA INC	12,469	179.97	2,244,045.93
CENTENE CORP	40,934	68.88	2,819,533.92
COOPER COS INC/THE	3,504	318.01	1,114,307.04
CVS HEALTH CORP	95,131	69.82	6,642,046.42
DAVITA INC	4,627	94.53	437,390.31
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	34.16	607,159.84
DEXCOM INC	28,772	93.30	2,684,427.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	69.28	3,121,202.56
ELEVANCE HEALTH INC	17,637	435.42	7,679,502.54
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	68.04	2,035,824.84
HCA HEALTHCARE INC	15,457	245.98	3,802,112.86
HENRY SCHEIN INC	8,755	74.25	650,058.75
HOLOGIC INC	18,875	69.40	1,309,925.00

HUMANA INC	9,297	486.52	4,523,176.44
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	437.27	2,697,081.36
INSULET CORP	5,246	159.49	836,684.54
INTUITIVE SURGICAL INC	26,035	292.29	7,609,770.15
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	201.05	1,316,475.40
MCKESSON CORP	10,179	434.85	4,426,338.15
MEDTRONIC PLC	98,891	78.36	7,749,098.76
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	327.89	1,490,260.05
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	121.86	1,057,622.94
RESMED INC	10,920	147.87	1,614,740.40
STERIS PLC	6,933	219.42	1,521,238.86
STRYKER CORP	25,363	273.27	6,930,947.01
TELEFLEX INC	3,934	196.41	772,676.94
THE CIGNA GROUP	22,079	286.07	6,316,139.53
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,912	504.19	35,248,931.28
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	125.73	587,410.56
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	203.45	2,289,829.75
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	112.22	1,711,803.88
ABBVIE INC	133,056	149.06	19,833,327.36
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	111.82	2,436,669.62
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	177.10	1,707,775.30
AMGEN	39,709	268.76	10,672,190.84
AVANTOR INC	49,647	21.08	1,046,558.76
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	358.45	664,207.85
BIO-TECHNE CORP	12,980	68.07	883,548.60
BIOGEN INC	10,740	257.01	2,760,287.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	88.48	1,307,999.84
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	156,340	58.04	9,073,973.60
CATALENT INC	13,739	45.53	625,536.67
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	195.98	823,899.92
DANAHER CORP	53,074	248.10	13,167,659.40
ELI LILLY & CO	60,535	537.13	32,515,164.55
EXACT SCIENCES CORP	12,208	68.22	832,829.76
GILEAD SCIENCES INC	92,825	74.94	6,956,305.50
HORIZON THERAPEUTICS PLC	15,618	115.69	1,806,846.42
ILLUMINA INC	11,423	137.28	1,568,149.44
INCYTE CORP	15,212	57.77	878,797.24
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	196.75	2,722,233.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	129.44	643,446.24
JOHNSON & JOHNSON	179,427	155.75	27,945,755.25
MERCK & CO	191,177	102.95	19,681,672.15
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,108.07	1,802,829.89

MODERNA INC	24,153	103.29	2,494,763.37
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	112.50	758,475.00
PFIZER	419,551	33.17	13,916,506.67
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,992	822.96	6,577,096.32
REPLIGEN CORP	4,353	159.01	692,170.53
REVVITY INC	8,524	110.70	943,606.80
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	27.14	816,452.62
SEAGEN INC	11,325	212.15	2,402,598.75
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	10.20	939,838.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,670	506.17	14,511,893.90
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	225.87	817,197.66
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,147	347.74	6,658,177.78
VIATRIS INC	89,720	9.86	884,639.20
WATERS CORP	4,749	274.21	1,302,223.29
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	375.21	2,163,836.07
ZOETIS INC	34,383	173.98	5,981,954.34
BANK OF AMERICA CORP	535,131	27.38	14,651,886.78
CITIGROUP	144,682	41.13	5,950,770.66
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	26.80	1,059,189.60
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	25.33	1,378,458.60
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,380.10	1,057,156.60
FIRST HORIZON CORP	44,308	11.02	488,274.16
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.40	1,186,764.80
JPMORGAN CHASE & CO	217,897	145.02	31,599,422.94
KEY CORP	71,223	10.76	766,359.48
M & T BANK CORP	11,807	126.45	1,492,995.15
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	122.77	3,641,112.66
REGIONS FINL CORP	70,810	17.20	1,217,932.00
TRUIST FINANCIAL CORP	96,574	28.61	2,762,982.14
US BANCORP	113,859	33.06	3,764,178.54
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	40.31	575,344.63
WELLS FARGO & CO	273,135	40.86	11,160,296.10
ALLY FINANCIAL INC	21,529	26.68	574,393.72
AMERICAN EXPRESS	47,011	149.19	7,013,571.09
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	329.68	2,576,778.88
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	28,767	89.76	2,582,125.92
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	102.87	1,314,678.60
BANK NEW YORK CO	61,254	42.65	2,612,483.10
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	97,275	350.30	34,075,432.50
BLACKROCK INC	11,143	646.49	7,203,838.07
BLACKSTONE INC	52,505	107.14	5,625,385.70
BLOCK INC	39,463	44.26	1,746,632.38

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	97.05	2,920,913.85
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	30.16	472,577.04
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,144	156.21	1,115,964.24
CME GROUP INC	26,740	200.22	5,353,882.80
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,595	75.08	945,632.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	86.63	1,644,843.81
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	28.39	794,437.37
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	437.26	1,376,494.48
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	42,810	55.27	2,366,108.70
FISERV INC	46,319	112.96	5,232,194.24
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	255.34	1,293,041.76
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	24.58	640,800.60
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	57.81	249,507.96
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	115.39	2,394,227.11
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,812	323.57	8,028,418.84
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41,604	110.02	4,577,272.08
INVESCO LTD	26,420	14.52	383,618.40
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	151.14	787,892.82
KKR & CO INC	44,805	61.60	2,759,988.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,307	237.65	1,261,208.55
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	213.64	685,143.48
MASTERCARD INC-CLASS A	63,267	395.91	25,048,037.97
MOODY'S CORP	12,261	316.17	3,876,560.37
MORGAN STANLEY	93,231	81.67	7,614,175.77
MSCI INC	5,952	513.08	3,053,852.16
NASDAQ INC	24,183	48.59	1,175,051.97
NORTHERN TRUST CORP	15,902	69.48	1,104,870.96
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	58.46	4,635,059.56
PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	104.87	1,657,575.22
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	100.43	1,555,258.98
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,913	9.81	313,066.53
S&P GLOBAL INC	24,377	365.41	8,907,599.57
SCHWAB (CHARLES) CORP	111,693	54.90	6,131,945.70
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	60.23	575,196.50
STATE STREET CORP	26,059	66.96	1,744,910.64
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	30.57	892,521.72
TOAST INC-CLASS A	20,341	18.73	380,986.93
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	80.20	726,692.20
VISA INC-CLASS A SHARES	120,784	230.01	27,781,527.84
AFLAC	43,196	76.75	3,315,293.00
ALLSTATE CORP	18,556	111.41	2,067,323.96
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	111.67	705,642.73

AMERICAN INT'L GROUP	54,534	60.60	3,304,760.40
AON PLC	15,249	324.22	4,944,030.78
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,510	79.71	2,113,112.10
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,913	227.93	3,627,050.09
ASSURANT INC	4,726	143.58	678,559.08
BROWN & BROWN INC	20,155	69.84	1,407,625.20
CHUBB LTD	30,784	208.18	6,408,613.12
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	102.29	1,136,441.90
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	293.79	636,349.14
EVEREST GROUP LTD	3,288	371.67	1,222,050.96
FNF GROUP	20,461	41.30	845,039.30
GLOBE LIFE INC	5,948	108.73	646,726.04
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	70.91	1,753,675.21
LOEWS CORP	12,757	63.31	807,645.67
MARKEL GROUP INC	1,007	1,472.49	1,482,797.43
MARSH & MCLENNAN COS	36,799	190.30	7,002,849.70
METLIFE INC	48,925	62.91	3,077,871.75
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	72.07	1,335,889.52
PROGRESSIVE CORP	43,513	139.30	6,061,360.90
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	94.89	2,516,577.69
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	163.31	2,800,276.57
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,429	208.96	1,552,363.84
WR BERKLEY CORP	17,572	63.49	1,115,646.28
WEYERHAEUSER CO	52,615	30.66	1,613,175.90
ACCENTURE PLC-CL A	46,943	307.11	14,416,664.73
ADOBE INC	34,096	509.90	17,385,550.40
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	106.54	1,223,505.36
ANSYS INC	6,794	297.55	2,021,554.70
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	204.26	488,998.44
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	201.51	2,304,468.36
AUTODESK INC	15,965	206.91	3,303,318.15
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	50.16	743,020.08
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	108.57	808,086.51
CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,308	234.30	4,758,164.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,186	133.28	824,470.08
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	63.04	1,278,640.32
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,307	67.74	2,459,436.18
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	29.61	364,203.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,571	167.38	2,773,653.98
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	163.77	507,687.00
DATADOG INC - CLASS A	17,716	91.09	1,613,750.44
DOCUSIGN INC	14,969	42.00	628,698.00

DROPBOX INC-CLASS A	23,068	27.23	628,141.64
DYNATRACE INC	22,028	46.73	1,029,368.44
EPAM SYSTEMS INC	4,768	255.69	1,219,129.92
FAIR ISAAC CORP	1,816	868.53	1,577,250.48
FORTINET INC	48,642	58.68	2,854,312.56
GARTNER INC	5,655	343.61	1,943,114.55
GEN DIGITAL INC	43,555	17.68	770,052.40
GODADDY INC - CLASS A	11,388	74.48	848,178.24
HUBSPOT INC	3,646	492.50	1,795,655.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,426	140.30	9,459,867.80
INTUIT INC	20,854	510.94	10,655,142.76
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	197.66	927,816.04
MICROSOFT CORP	528,983	315.75	167,026,382.25
MONDAY.COM LTD	1,631	159.22	259,687.82
MONGODB INC	5,325	345.86	1,841,704.50
OKTA INC	11,505	81.51	937,772.55
ORACLE CORP	123,187	105.92	13,047,967.04
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	130,741	16.00	2,091,856.00
PALO ALTO NETWORKS INC	22,493	234.44	5,273,258.92
PTC INC	8,226	141.68	1,165,459.68
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,898	484.28	3,824,843.44
SALESFORCE INC	72,631	202.78	14,728,114.18
SERVICENOW INC	15,145	558.96	8,465,449.20
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,326	152.77	2,952,433.02
SPLUNK INC	11,101	146.25	1,623,521.25
SYNOPSYS INC	11,321	458.97	5,195,999.37
TWILIO INC - A	12,842	58.53	751,642.26
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	386.14	1,289,321.46
UIPATH INC - CLASS A	28,419	17.11	486,249.09
UNITY SOFTWARE INC	16,437	31.39	515,957.43
VERISIGN INC	6,723	202.53	1,361,609.19
VMWARE INC-CLASS A	17,149	166.48	2,854,965.52
WIX.COM LTD	5,010	91.80	459,918.00
WORKDAY INC-CLASS A	15,164	214.85	3,257,985.40
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	69.94	1,157,297.18
ZSCALER INC	7,204	155.59	1,120,870.36
AMPHENOL CORPORATION	44,247	83.99	3,716,305.53
APPLE INC	1,177,684	171.21	201,631,277.64
ARISTA NETWORKS INC	19,289	183.93	3,547,825.77
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	125.24	543,291.12
CDW CORP/DE	9,584	201.76	1,933,667.84
CISCO SYSTEMS	304,444	53.76	16,366,909.44

COGNEX CORP	14,352	42.44	609,098.88
CORNING	58,221	30.47	1,773,993.87
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	68.90	1,248,743.60
F5 INC	4,851	161.14	781,690.14
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	17.37	1,692,393.84
HP INC	68,329	25.70	1,756,055.30
JABIL INC	11,304	126.89	1,434,364.56
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	27.79	703,670.59
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	132.31	1,830,905.78
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,202	272.24	3,321,872.48
NETAPP INC	15,191	75.88	1,152,693.08
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,756	65.95	841,258.20
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,534	274.22	969,093.48
TE CONNECTIVITY LTD	22,795	123.53	2,815,866.35
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	408.58	1,356,485.60
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	53.86	954,291.48
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	45.63	1,176,797.70
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	236.53	984,437.86
AT&T INC	529,966	15.02	7,960,089.32
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	18.56	350,208.64
T-MOBILE US INC	40,399	140.05	5,657,879.95
VERIZON COMMUNICATIONS	312,179	32.41	10,117,721.39
AES CORP	54,375	15.20	826,500.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	48.45	1,006,694.10
AMEREN CORPORATION	20,898	74.83	1,563,797.34
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,118	75.22	2,792,015.96
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	123.83	1,791,572.44
ATMOS ENERGY CORP	11,302	105.93	1,197,220.86
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	26.85	1,274,462.10
CMS ENERGY CORP	23,697	53.11	1,258,547.67
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	85.53	2,367,042.75
CONSTELLATION ENERGY	25,114	109.08	2,739,435.12
DOMINION ENERGY INC	60,549	44.67	2,704,723.83
DTE ENERGY COMPANY	15,851	99.28	1,573,687.28
DUKE ENERGY CORP	57,283	88.26	5,055,797.58
EDISON INTL	30,900	63.29	1,955,661.00
ENERGY CORP	16,181	92.50	1,496,742.50
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	34.33	700,297.67
EVERGY INC	18,475	50.70	936,682.50
EVERSOURCE ENERGY	27,450	58.15	1,596,217.50
EXELON CORP	73,907	37.79	2,792,945.53
FIRSTENERGY CORP	39,425	34.18	1,347,546.50



NEXTERA ENERGY INC	150,399	57.29	8,616,358.71	
NISOURCE INC	32,351	24.68	798,422.68	
NRG ENERGY INC	19,068	38.52	734,499.36	
PG&E CORP	148,742	16.13	2,399,208.46	
PPL CORPORATION	58,459	23.56	1,377,294.04	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,683	56.91	2,030,719.53	
SEMPRA	45,886	68.03	3,121,624.58	
SOUTHERN CO	81,133	64.72	5,250,927.76	
VISTRA CORP	22,676	33.18	752,389.68	
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	80.55	1,888,655.85	
XCEL ENERGY INC	39,963	57.22	2,286,682.86	
ADVANCED MICRO DEVICES	119,628	102.82	12,300,150.96	
ANALOG DEVICES	37,601	175.09	6,583,559.09	
APPLIED MATERIALS	62,818	138.45	8,697,152.10	
BROADCOM INC	30,991	830.58	25,740,504.78	
ENPHASE ENERGY INC	9,617	120.15	1,155,482.55	
ENTEGRIS INC	10,321	93.91	969,245.11	
FIRST SOLAR INC	7,921	161.59	1,279,954.39	
INTEL CORP	310,036	35.55	11,021,779.80	
KLA CORP	10,294	458.66	4,721,446.04	
LAM RESEARCH CORP	10,237	626.77	6,416,244.49	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	85.93	943,339.54	
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	54.13	3,447,756.22	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	78.05	3,178,039.90	
MICRON TECHNOLOGY	81,347	68.03	5,534,036.41	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	462.00	1,631,322.00	
NVIDIA CORP	184,802	434.99	80,387,021.98	
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	199.92	3,860,455.20	
ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	92.95	2,975,422.45	
QORVO INC	6,249	95.47	596,592.03	
QUALCOMM	82,879	111.06	9,204,541.74	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	98.59	1,108,348.78	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	4,156	129.51	538,243.56	
TERADYNE INC	12,318	100.46	1,237,466.28	
TEXAS INSTRUMENTS	67,444	159.01	10,724,270.44	
WOLFSPEED INC	10,256	38.10	390,753.60	
CBRE GROUP INC-A	22,995	73.86	1,698,410.70	
COSTAR GROUP INC	29,397	76.89	2,260,335.33	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.57	352,359.00	
ZILLOW GROUP INC-C	11,809	46.16	545,103.44	
アメリカドル 小計	25,632,158		2,786,485,655.31 (417,387,686,308)	

カナダドル	ARC RESOURCES LTD	37,400	21.68	810,832.00
	CAMECO CORP	31,793	53.89	1,713,324.77
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,307	87.84	7,229,846.88
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	28.28	3,147,366.04
	ENBRIDGE	159,113	45.05	7,168,040.65
	IMPERIAL OIL	16,488	83.66	1,379,386.08
	KEYERA CORP	18,607	31.89	593,377.23
	PARKLAND CORP	14,896	39.73	591,818.08
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	40.84	1,557,270.04
	SUNCOR ENERGY	98,973	46.71	4,623,028.83
	TC ENERGY CORP	75,669	46.71	3,534,498.99
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	68.35	1,709,365.15
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	61.72	2,228,092.00
	BARRICK GOLD CORP	133,727	19.73	2,638,433.71
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	14,689	57.01	837,419.89
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	32.09	1,391,422.40
	FRANCO-NEVADA CORP	13,695	181.33	2,483,314.35
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	11.64	603,499.08
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.19	671,311.69
	LUNDIN MINING CORP	31,977	10.13	323,927.01
	NUTRIEN LTD	37,152	83.88	3,116,309.76
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	19.66	440,698.56
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	58.46	2,068,665.56
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	98.61	345,628.05
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	55.12	1,758,658.72
	CAE INC	25,999	31.71	824,428.29
	STANTEC INC	9,001	88.13	793,258.13
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	110.62	576,662.06
	WSP GLOBAL INC	9,951	191.70	1,907,606.70
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	43.13	602,569.23
	RB GLOBAL INC	14,445	85.04	1,228,402.80
	THOMSON REUTERS CORP	11,033	166.16	1,833,243.28
	AIR CANADA	13,805	19.38	267,540.90
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	147.09	6,212,640.33
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	69,248	100.96	6,991,278.08	
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	174.44	1,018,206.28	
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	72.79	1,474,288.66	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	102.81	315,626.70	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	38.07	373,847.40	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	90.45	2,086,952.85	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	146.05	659,123.65	
DOLLARAMA INC	22,000	93.58	2,058,760.00	

ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	56,821	68.98	3,919,512.58
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	36.95	256,063.50
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	115.40	1,490,160.20
METRO INC	18,840	70.54	1,328,973.60
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	150.63	787,192.38
SAPUTO INC	20,898	28.40	593,503.20
BANK MONTREAL	52,757	114.58	6,044,897.06
BANK NOVA SCOTIA	88,533	60.88	5,389,889.04
CANADIAN IMPERIAL BANK	67,344	52.43	3,530,845.92
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	90.23	2,175,535.53
ROYAL BANK OF CANADA	103,016	118.70	12,227,999.20
TORONTO-DOMINION BANK	135,406	81.83	11,080,272.98
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	45.26	1,312,585.26
BROOKFIELD CORP	104,769	42.47	4,449,539.43
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	19.49	634,964.71
IGM FINANCIAL INC	7,685	34.45	264,748.25
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	20.37	87,611.37
ONEX CORP	6,603	79.83	527,117.49
TMX GROUP LTD	23,425	29.19	683,775.75
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,108.77	1,944,782.58
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.86	924,401.68
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	85.20	594,440.40
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	198.02	2,624,755.10
MANULIFE FINANCIAL CORP	130,818	24.82	3,246,902.76
POWER CORP OF CANADA	43,577	34.58	1,506,892.66
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	66.27	2,890,299.78
CGI INC - CL A	16,084	133.88	2,153,325.92
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,490	2,804.07	4,178,064.30
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	99.69	696,234.96
OPEN TEXT CORP	20,463	47.67	975,471.21
SHOPIFY INC - CLASS A	88,987	74.14	6,597,496.18
BCE INC	6,203	51.85	321,625.55
QUEBECOR INC -CL B	15,200	29.11	442,472.00
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	52.15	1,453,994.15
TELUS CORP	32,908	22.18	729,899.44
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	8.04	416,616.72
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	26.05	635,489.75
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	32.51	367,200.45
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	28.70	296,298.80
EMERA INC	17,459	47.42	827,905.78
FORTIS INC	35,547	51.59	1,833,869.73
HYDRO ONE LTD	20,587	34.58	711,898.46

	NORTHLAND POWER INC	17,854	22.12	394,930.48
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	197.56	531,436.40
	カナダドル 小計	3,050,470		176,271,863.55 (19,451,600,142)
ユーロ	ENI	174,687	15.25	2,665,024.87
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	14.04	556,854.48
	NESTE OIL OYJ	32,766	32.13	1,052,771.58
	OMV AG	12,549	45.32	568,720.68
	REPSOL SA	89,536	15.57	1,394,075.52
	TENARIS SA	40,648	14.98	609,110.28
	TOTALENERGIES SE	167,847	62.31	10,458,546.57
	AIR LIQUIDE	38,920	159.84	6,220,972.80
	AKZO NOBEL	12,357	68.48	846,207.36
	ARCELORMITTAL	42,704	23.77	1,015,287.60
	ARKEMA	4,369	93.56	408,763.64
	BASF SE	64,204	42.95	2,757,561.80
	COVESTRO AG	14,454	51.06	738,021.24
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	80.13	1,098,341.91
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.32	277,841.02
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	73.52	791,442.80
	OCI NV	7,248	26.39	191,274.72
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	31.56	615,546.24
	SOLVAY SA	5,356	104.85	561,576.60
	STORA ENSO OYJ R	42,169	11.89	501,389.41
	SYMRISE AG	10,018	90.32	904,825.76
	UMICORE	17,605	22.45	395,232.25
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	32.47	1,374,260.28
	VOESTALPINE AG	7,152	25.84	184,807.68
	WACKER CHEMIE AG	1,770	135.65	240,100.50
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,403	34.07	558,850.21
	AIRBUS SE	44,063	126.98	5,595,119.74
	ALSTOM	24,388	22.60	551,168.80
	BOUYGUES ORD	16,606	33.14	550,322.84
	BRENTAG SE	12,514	73.48	919,528.72
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	11.54	935,040.04
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	34,575	32.82	1,134,751.50
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	178.40	379,992.00
	EIFFAGE	5,924	90.04	533,396.96
	FERROVIAL SE	37,026	28.97	1,072,643.22
	GEA GROUP AG	13,382	34.96	467,834.72
	IMCD NV	4,641	120.00	556,920.00
	KINGSPAN GROUP PLC	12,398	70.96	879,762.08

KNORR-BREMSE AG	5,022	60.18	302,223.96
KONE OYJ-B	26,369	39.92	1,052,650.48
LEGRAND SA	19,340	87.30	1,688,382.00
METSO CORPORATION	51,970	9.95	517,309.38
MTU AERO ENGINES AG	3,962	171.75	680,473.50
PRYSMIAN SPA	21,155	38.15	807,063.25
RATIONAL AG	483	600.00	289,800.00
RHEINMETALL AG	3,820	243.90	931,698.00
SAFRAN SA	24,910	148.64	3,702,622.40
SAINT-GOBAIN	36,177	56.88	2,057,747.76
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,328	156.98	6,330,689.44
SIEMENS	56,492	135.66	7,663,704.72
SIEMENS ENERGY AG	36,841	12.38	456,091.58
THALES SA	8,524	133.10	1,134,544.40
VINCI S.A.	39,327	105.02	4,130,121.54
WARTSILA OYJ	41,917	10.75	450,817.33
BUREAU VERITAS SA	25,073	23.51	589,466.23
RANDSTAD NV	10,680	52.38	559,418.40
TELEPERFORMANCE	4,734	119.40	565,239.60
WOLTERS KLUWER	18,738	114.65	2,148,311.70
ADP	2,382	111.90	266,545.80
AENA SME SA	5,508	142.60	785,440.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	7.50	340,344.55
DHL GROUP	74,810	38.53	2,882,803.35
GETLINK	21,115	15.11	319,047.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,011	96.38	2,121,420.18
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	88.30	440,705.30
CONTINENTAL AG	8,168	66.76	545,295.68
DR ING HC F PORSCHE AG	7,331	89.00	652,459.00
FERRARI NV	9,370	279.70	2,620,789.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	59,903	65.89	3,947,008.67
MICHELIN	47,236	29.07	1,373,150.52
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	46.65	547,904.25
RENAULT SA	11,597	38.87	450,833.37
STELLANTIS NV	162,367	18.21	2,956,703.07
VALEO SA	16,596	16.33	271,012.68
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	108.94	1,669,832.32
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	124.70	310,004.20
ADIDAS AG	12,783	166.62	2,129,903.46
HERMES INTERNATIONAL	2,355	1,729.80	4,073,679.00
KERING	5,534	431.90	2,390,134.60
LVMH	20,525	716.40	14,704,110.00

MONCLER SPA	14,605	55.08	804,443.40
PUMA SE	9,220	58.80	542,136.00
SEB SA	2,282	88.65	202,299.30
ACCOR	14,436	31.94	461,085.84
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	32,105	57.28	1,838,974.40
DELIVERY HERO SE	13,414	27.17	364,458.38
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,042	154.90	2,020,205.80
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	30.80	249,726.40
SODEXO	6,173	97.52	601,990.96
BOLLORE SE	83,646	5.09	425,758.14
PUBLICIS GROUPE	17,217	71.76	1,235,491.92
SCOUT24 SE	3,716	65.66	243,992.56
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	24.73	1,627,876.98
VIVENDI SE	61,243	8.29	508,071.92
D'IETEREN GROUP	2,217	159.90	354,498.30
INDITEX	81,082	35.29	2,861,383.78
PROSUS	114,372	27.92	3,193,266.24
ZALANDO SE	17,664	21.13	373,240.32
CARREFOUR	39,746	16.28	647,263.61
HELLOFRESH SE	13,805	28.28	390,405.40
JERONIMO MARTINS	27,312	21.26	580,653.12
KESKO OYJ-B SHS	20,083	16.97	340,808.51
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	28.52	2,022,068.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,422	52.51	3,330,289.22
DANONE (GROUPE)	47,639	52.26	2,489,614.14
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	11.16	378,080.39
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	71.40	679,156.80
HEINEKEN NV	23,160	83.46	1,932,933.60
JDE PEET'S BV	7,000	26.42	184,940.00
KERRY GROUP PLC-A	10,592	79.18	838,674.56
LOTUS BAKERIES	50	7,690.00	384,500.00
PERNOD-RICARD	15,339	157.85	2,421,261.15
REMY COINTREAU	1,032	115.65	119,350.80
BEIERSDORF AG	7,430	122.15	907,574.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	59.72	524,341.60
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	67.46	770,055.90
LOREAL	17,902	393.20	7,039,066.40
AMPLIFON SPA	11,650	28.12	327,598.00
BIOMERIEUX	3,044	91.82	279,500.08
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	82.82	284,072.60
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	86.42	178,889.40
ESSILORLUXOTTICA	21,384	165.16	3,531,781.44

FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	40.84	693,667.40
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	29.46	992,477.94
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	18.96	1,362,232.95
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	48.00	1,035,216.00
ARGENX SE	4,177	460.60	1,923,926.20
BAYER	72,310	45.45	3,286,489.50
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	53.50	546,770.00
GRIFOLS SA	27,685	12.29	340,387.07
IPSEN	3,532	124.20	438,674.40
MERCK KGAA	9,080	158.15	1,436,002.00
ORION OYJ-CLASS B	3,129	37.22	116,461.38
QIAGEN N.V.	17,038	38.27	652,044.26
RECORDATI SPA	5,163	44.71	230,837.73
SANOFI	84,347	101.48	8,559,533.56
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	321.80	586,963.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	226.00	355,724.00
UCB (GROUPE)	9,389	77.54	728,023.06
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	13.44	372,086.40
AIB GROUP PLC	88,299	4.26	376,153.74
BANCO BILBAO VIZCAYA	441,393	7.71	3,403,140.03
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.61	4,425,537.67
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.29	821,031.62
BNP PARIBAS	77,654	60.43	4,692,631.22
CAIXABANK	336,789	3.78	1,275,083.15
COMMERZBANK AG	81,889	10.79	883,582.31
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	11.69	1,162,804.47
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	32.82	832,840.32
FINECOBANK SPA	41,585	11.51	478,851.27
ING GROEP NV-CVA	269,040	12.55	3,376,452.00
INTESA SANPAOLO	1,145,097	2.44	2,794,036.68
KBC GROEP NV	18,057	59.14	1,067,890.98
MEDIOBANCA	53,422	12.53	669,377.66
SOCIETE GENERALE	53,019	23.04	1,221,822.85
UNICREDIT SPA	139,080	22.73	3,161,288.40
ADYEN NV	1,609	705.70	1,135,471.30
AMUNDI SA	4,626	53.35	246,797.10
DEUTSCHE BANK NAMEN	134,445	10.45	1,404,950.25
DEUTSCHE BOERSE	14,123	163.70	2,311,935.10
EDENRED	20,131	59.28	1,193,365.68
EURAZEO SA	3,357	56.45	189,502.65
EURONEXT NV	6,480	66.00	427,680.00
EXOR NV	7,825	83.94	656,830.50

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	70.56	600,818.40
NEXI SPA	48,458	5.78	280,474.90
SOFINA	1,238	191.80	237,448.40
WENDEL	2,023	75.05	151,826.15
WORLDLINE SA	20,332	26.65	541,847.80
AEGON	148,741	4.58	681,531.26
AGEAS	11,086	39.03	432,686.58
ALLIANZ SE-REG	29,979	225.70	6,766,260.30
ASR NEDERLAND NV	11,959	35.52	424,783.68
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	19.36	1,379,485.14
AXA SA	136,364	28.18	3,842,737.52
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	207.90	926,194.50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	369.10	3,843,807.40
NN GROUP NV	16,208	30.44	493,371.52
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.96	458,876.88
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	40.98	1,357,749.36
TALANX AG	5,053	60.00	303,180.00
BECHTLE AG	7,659	44.24	338,834.16
CAPGEMINI SA	12,235	165.80	2,028,563.00
DASSAULT SYSTEMES SA	47,353	35.29	1,671,324.13
NEMETSCHEK SE	5,455	57.88	315,735.40
SAP SE	77,618	122.82	9,533,042.76
NOKIA OYJ	396,129	3.56	1,413,388.27
CELLNEX TELECOM SA	41,890	32.97	1,381,113.30
DEUTSCHE TELEKOM	240,920	19.86	4,786,598.56
ELISA A	10,227	43.89	448,863.03
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.26	342,174.37
KPN (KON.)	216,358	3.11	674,820.60
ORANGE	153,281	10.86	1,664,631.66
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.29	252,440.64
TELEFONICA	373,259	3.86	1,443,765.81
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	1.69	167,321.92
ACCIONA SA	2,181	120.70	263,246.70
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	24.40	132,662.80
E.ON SE	166,881	11.20	1,869,067.20
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	15.51	337,482.28
ELIA GROUP SA/NV	987	92.65	91,445.55
ENAGAS	21,663	15.68	339,675.84
ENDESA	25,972	19.27	500,610.30
ENEL	596,378	5.82	3,470,919.96
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	223,128	3.93	878,231.80
ENGIE	146,393	14.53	2,127,090.29



	FORTUM OYJ	32,550	10.99	357,887.25
	IBERDROLA SA	444,395	10.59	4,708,365.02
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	25.76	257,857.60
	REDEIA CORP SA	30,678	14.89	456,948.81
	RWE STAMM	44,929	35.15	1,579,254.35
	SNAM SPA	147,559	4.44	656,489.99
	TERNA SPA	95,819	7.12	682,997.83
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	27.43	1,365,492.83
	VERBUND AG	6,430	77.05	495,431.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,400	397.50	1,351,500.00
	ASML HOLDING NV	29,993	559.10	16,769,086.30
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	93.00	591,201.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	31.35	3,043,629.85
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	40.98	2,060,971.71
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	65.34	344,668.50
	VONOVIA SE	52,580	22.81	1,199,349.80
	ユーロ 小計	13,592,223		337,897,007.86 (53,478,959,434)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	5.31	6,989,296.95
	SHELL PLC-NEW	499,932	26.06	13,028,227.92
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	22.65	2,114,323.18
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	14.29	426,642.24
	CRH PLC	55,581	45.42	2,524,489.02
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	49.15	536,914.60
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	15.86	279,199.44
	GLENCORE PLC	793,369	4.69	3,728,040.93
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	16.28	274,285.44
	MONDI PLC	41,710	13.72	572,469.75
	RIO TINTO PLC REG	83,678	51.74	4,329,499.72
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	50.02	1,666,516.34
	BAE SYSTEMS PLC	219,532	9.97	2,190,490.29
	BUNZL PLC	22,799	29.26	667,098.74
	DCC PLC	6,622	46.09	305,207.98
	MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	4.69	474,436.27
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	2.20	1,404,722.98
	SMITHS GROUP PLC	26,476	16.19	428,778.82
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	95.26	525,263.64
	EXPERIAN PLC	67,859	26.91	1,826,085.69
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	41.12	571,156.80
	RELX PLC	141,442	27.75	3,925,015.50
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	6.10	1,109,551.06
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.41	322,894.02

BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	41.07	285,518.64
BURBERRY GROUP PLC	29,776	19.08	568,274.96
PERSIMMON PLC	25,686	10.77	276,766.65
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.17	309,793.99
COMPASS GROUP PLC	129,701	20.00	2,594,020.00
ENTAIN PLC	49,630	9.32	462,948.64
INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	60.74	690,188.62
PEARSON	55,305	8.68	480,268.62
WHITBREAD PLC	17,434	34.64	603,913.76
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.17	447,525.31
INFORMA PLC	110,598	7.50	829,927.39
WPP PLC	85,821	7.33	629,067.93
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.49	309,617.02
KINGFISHER PLC	153,717	2.23	343,250.06
NEXT PLC	7,832	72.96	571,422.72
OCADO GROUP PLC	54,753	6.00	328,737.01
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.52	374,990.88
TESCO PLC	525,585	2.64	1,388,595.57
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	20.68	532,303.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,888	25.77	4,068,773.76
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	22.49	403,920.40
DIAGEO	167,595	30.34	5,084,832.30
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	16.67	1,141,528.26
HALEON PLC	452,525	3.40	1,542,431.46
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	52,885	57.94	3,064,156.90
UNILEVER PLC	187,760	40.62	7,626,811.20
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.23	701,726.85
ASTRAZENECA	115,201	111.02	12,789,615.02
GSK PLC	304,379	14.92	4,541,334.68
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,620	20.88	138,225.60
BARCLAYS	1,129,529	1.58	1,795,273.39
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,029	6.44	9,576,952.02
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.44	2,142,394.80
NATWEST GROUP PLC	426,244	2.35	1,004,657.10
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	7.58	1,441,405.22
3I GROUP PLC	74,757	20.73	1,549,712.61
ABRDN PLC	153,430	1.55	238,967.22
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.73	255,766.82
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,849	82.34	2,457,766.66
M&G PLC	131,539	1.97	259,526.44
SCHRODERS PLC	39,932	4.07	162,603.10
ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	8.32	340,652.74

	WISE PLC - A	49,048	6.85	336,273.08
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.77	386,381.35
	AVIVA PLC	193,334	3.89	753,615.93
	LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.22	909,766.90
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	4.82	245,926.82
	PRUDENTIAL	212,226	8.88	1,886,264.68
	SAGE GROUP PLC	76,660	9.89	758,167.40
	HALMA PLC	31,069	19.38	602,272.56
	BT GROUP PLC	464,863	1.16	542,495.12
	VODAFONE GROUP PLC	1,564,850	0.76	1,202,117.77
	CENTRICA PLC	453,631	1.54	700,633.07
	NATIONAL GRID PLC	260,089	9.80	2,548,872.20
	SEVERN TRENT PLC	17,468	23.65	413,118.20
	SSE PLC	81,692	16.10	1,315,241.20
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	9.48	479,599.56
	イギリスポンド 小計	20,563,714		137,657,518.68 (25,141,769,211)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	14.50	252,271.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	623.00	357,602.00
	GIVAUDAN-REG	678	2,994.00	2,029,932.00
	HOLCIM LTD	38,804	58.78	2,280,899.12
	SIG GROUP AG	26,203	22.64	593,235.92
	SIKA AG-BR	10,856	233.10	2,530,533.60
	ABB LTD	116,833	32.80	3,832,122.40
	GEBERIT AG-REG	2,530	459.00	1,161,270.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	176.80	362,086.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	183.00	565,836.00
	VAT GROUP AG	1,956	329.00	643,524.00
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	37.76	560,962.56
	SGS SA	10,147	77.02	781,521.94
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	261.00	986,841.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	38,748	112.00	4,339,776.00
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	235.40	584,498.20
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	44.85	176,619.30
	DUFREY AG-REG	7,820	34.91	272,996.20
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,458.00	408,240.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	100,400.00	803,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,190.00	835,580.00
	NESTLE SA - REGISTERED	199,766	103.74	20,723,724.84
	ALCON INC	38,399	70.94	2,724,025.06
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	217.70	846,199.90
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	117.20	1,000,888.00

	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	68.00	125,800.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	425.60	2,356,121.60
	NOVARTIS	152,294	93.87	14,295,837.78
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	269.40	596,721.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	52,222	250.45	13,078,999.90
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	96.05	238,876.35
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	58.86	899,910.54
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,574	1,034.50	1,628,303.00
	UBS GROUP AG	249,657	22.69	5,664,717.33
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,379	132.90	316,169.10
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	128.40	379,422.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	571.60	1,211,220.40
	SWISS RE LTD	22,063	94.32	2,080,982.16
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,184	420.10	4,698,398.40
	TEMENOS AG - REG	5,150	64.42	331,763.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,702	63.28	677,222.56
	SWISSCOM	1,856	544.20	1,010,035.20
	BKW AG	1,744	161.50	281,656.00
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	83.95	476,752.05
	スイスフラン 小計	1,102,662		100,003,293.81 (16,351,538,570)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	314.45	6,997,141.40
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	425.80	2,292,081.40
	SCA SV CELLULOSA B	35,790	149.95	5,366,710.50
	ALFA LAVAL AB	18,955	375.80	7,123,289.00
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	238.20	18,097,721.40
	ATLAS COPCO A	207,097	147.25	30,495,033.25
	ATLAS COPCO B	108,178	128.20	13,868,419.60
	BEIJER REF AB	26,868	115.50	3,103,254.00
	EPIROC AB-A	53,479	208.00	11,123,632.00
	EPIROC AB-B	28,804	175.20	5,046,460.80
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	83.74	3,241,742.88
	INDUTRADE AB	22,644	202.70	4,589,938.80
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	192.75	2,698,885.50
	LIFCO AB-B SHS	17,970	191.95	3,449,341.50
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	71.80	8,820,486.40
	SAAB AB-B	6,388	556.80	3,556,838.40
	SANDVIK AB	75,334	201.60	15,187,334.40
	SKANSKA B	25,507	180.00	4,591,260.00
	SKF AB-B	21,050	182.15	3,834,257.50
	VOLVO AB-A SHS	13,514	227.40	3,073,083.60
	VOLVO B	114,238	225.60	25,772,092.80

	SECURITAS B	28,375	86.66	2,458,977.50	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	44.44	2,214,845.16	
	EVOLUTION AB	13,186	1,106.40	14,588,990.40	
	HENNES & MAURITZ B	41,351	155.46	6,428,426.46	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	235.90	11,670,916.60	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	192.70	3,429,289.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	223.40	3,202,439.00	
	NORDEA BANK ABP	236,636	120.12	28,424,716.32	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	110,001	130.65	14,371,630.65	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	97.56	11,779,004.16	
	SWEDBANK AB-A	58,652	201.30	11,806,647.60	
	EQT AB	31,471	216.90	6,826,059.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	288.80	3,413,038.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	288.60	3,223,084.80	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	209.80	26,967,272.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	457.00	3,326,960.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	53.33	11,449,364.37	
	HEXAGON AB-B SHS	148,878	93.38	13,902,227.64	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	83.68	3,913,044.16	
	TELIA CO AB	123,760	22.57	2,793,263.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	49.30	2,795,310.00	
	SAGAX AB-B	17,402	208.50	3,628,317.00	
	スウェーデンクローナ 小計	2,593,837		374,942,830.05	(5,136,716,771)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	18,105	296.00	5,359,080.00	
	EQUINOR ASA	66,436	351.15	23,329,001.40	
	NORSK HYDRO	100,517	67.20	6,754,742.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	405.30	5,065,439.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	441.20	3,814,174.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	105.90	2,024,490.30	
	MOWI ASA	31,968	189.55	6,059,534.40	
	ORKLA	77,073	79.98	6,164,298.54	
	SALMAR ASA	5,423	543.40	2,946,858.20	
	DNB BANK ASA	71,795	215.60	15,479,002.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	157.50	2,925,405.00	
	TELENOR ASA	51,193	121.50	6,219,949.50	
	ノルウェークローネ 小計	481,344		86,141,975.14	(1,204,264,812)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	432.40	3,668,049.20	
	NOVOZYMES A/S	17,111	284.70	4,871,501.70	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,712.50	1,292,937.50	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	72,778	151.56	11,030,233.68	

	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,530.00	2,744,070.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	12,735.00	3,896,910.00	
	DSV A/S	14,203	1,319.00	18,733,757.00	
	PANDORA A/S	7,957	731.60	5,821,341.20	
	CARLSBERG AS-B	6,810	891.40	6,070,434.00	
	COLOPLAST-B	9,208	747.60	6,883,900.80	
	DEMANT A/S	8,512	292.60	2,490,611.20	
	GENMAB A/S	4,628	2,508.00	11,607,024.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	246,100	643.90	158,463,790.00	
	DANSKE BANK A/S	58,346	164.35	9,589,165.10	
	TRYG A/S	29,772	129.35	3,851,008.20	
	ORSTED A/S	12,910	385.10	4,971,641.00	
	デンマーククローネ 小計	498,098		255,986,374.58 (5,432,030,868)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	33.80	697,260.20	
	SANTOS	218,974	7.90	1,729,894.60	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	36.49	5,150,016.15	
	BHP GROUP LTD	377,956	44.25	16,724,553.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.44	675,928.80	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	122,505	20.92	2,562,804.60	
	IGO LTD	56,345	12.66	713,327.70	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,852	40.79	1,543,983.08	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	67.63	974,480.67	
	NEWCREST MINING LIMITED	60,966	24.52	1,494,886.32	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	10.46	770,713.72	
	ORICA LTD	38,288	15.59	596,909.92	
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.30	900,785.50	
	RIO TINTO LTD	28,272	113.55	3,210,285.60	
	SOUTH32 LTD	346,773	3.39	1,175,560.47	
	REECE LTD	16,814	18.63	313,244.82	
	BRAMBLES LTD	108,007	14.32	1,546,660.24	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	25.96	1,152,000.96	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.49	417,372.59	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.18	440,300.00	
	TRANSURBAN GROUP	224,973	12.69	2,854,907.37	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	40.85	1,887,678.50	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	21.38	380,414.34	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.72	859,101.36	
	REA GROUP LTD	3,586	154.32	553,391.52	
	SEEK LTD	28,001	22.07	617,982.07	
	WESFARMERS LTD	84,329	52.86	4,457,630.94	
	COLES GROUP LTD	108,486	15.56	1,688,042.16	

	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.27	579,178.27	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	37.32	3,436,089.72	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	12.33	788,626.80	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	255.32	1,221,195.56	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	51.87	627,990.09	
	SONIC HEALTHCARE LTD	27,240	29.80	811,752.00	
	CSL LIMITED	35,855	250.80	8,992,434.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	221,609	25.66	5,686,486.94	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	125,501	99.97	12,546,334.97	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	233,298	29.07	6,781,972.86	
	WESTPAC BANKING	255,840	21.15	5,411,016.00	
	ASX LTD	14,549	57.12	831,038.88	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,105	167.73	4,546,321.65	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	32.59	450,133.08	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.68	946,640.16	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.44	798,709.52	
	QBE INSURANCE GROUP	104,083	15.71	1,635,143.93	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.97	1,325,250.08	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	65.05	897,755.05	
	XERO LTD	11,340	112.43	1,274,956.20	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.85	1,187,597.95	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	8.78	961,243.18	
	オーストラリアドル 小計	5,129,732		117,827,984.09	(11,351,547,987)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.91	652,266.51	
	EBOS GROUP LTD	14,283	34.20	488,478.60	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	21.58	862,768.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	97,207	4.81	467,565.67	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.10	394,139.30	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.14	568,196.16	
	ニュージーランドドル 小計	409,088		3,433,414.64	(308,217,632)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,496	41.90	7,353,282.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	76.00	8,132,000.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	10.14	932,880.00	
	MTR CORP	125,000	31.00	3,875,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	13.16	1,579,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	47.15	8,204,100.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	24.00	4,752,000.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	15.46	2,255,614.00	
	WH GROUP LTD	658,301	4.11	2,705,617.11	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	21.45	6,038,175.00	

	HANG SENG BANK	59,400	97.45	5,788,530.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	292.60	25,836,580.00
	AIA GROUP LTD	865,600	63.85	55,268,560.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	37.05	1,389,375.00
	CLP HOLDINGS	102,000	57.95	5,910,900.00
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.46	4,939,427.22
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	37.90	4,244,800.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	41.25	5,032,335.00
	ESR GROUP LTD	157,000	11.00	1,727,000.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	10.72	1,854,560.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	20.65	2,585,958.20
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	15.24	2,078,355.00
	SINO LAND CO	315,400	8.83	2,784,982.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	83.80	8,799,000.00
	SWIRE PACIFIC A	44,500	52.85	2,351,825.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	16.34	1,571,908.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	30.25	3,720,750.00
	香港ドル 小計	5,644,353		181,712,713.93 (3,476,164,217)
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	31.93	255,440.00
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.80	767,040.00
	SEATRUM LTD	2,152,791	0.13	288,473.99
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.91	576,334.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.46	699,824.72
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.84	247,416.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.73	666,178.00
	DBS GROUP	141,600	33.64	4,763,424.00
	OCBC BANK	257,100	12.81	3,293,451.00
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	28.50	2,679,000.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.75	643,500.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	555,643	2.42	1,344,656.06
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.09	428,069.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	127,200	3.10	394,320.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.61	282,908.00
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.42	304,950.00
	シンガポールドル 小計	4,416,666		17,634,984.77 (1,931,559,881)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	21.45	1,274,709.15
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	762.70	1,636,754.20
	BANK HAPUALIM BM	98,310	34.63	3,404,475.30
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	32.29	3,633,012.48
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	21.35	2,124,325.00



	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	139.50	1,744,168.50	
	NICE LTD	4,991	657.20	3,280,085.20	
	AZRIELI GROUP	1,537	201.20	309,244.40	
	イスラエルシェケル 小計	390,926		17,406,774.23 (683,203,703)	
	合 計	83,505,271		561,335,259,536 (561,335,259,536)	

## (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
新株予約権証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,490.00	-	
		カナダドル 小計	1,490.00	- ( - )	
		新株予約権証券合計		- ( - )	
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	691,307.00	
		LENLEASE GROUP	64,786	465,163.48	
		オーストラリアドル 小計	148,076	1,156,470.48 (111,414,366)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,576,700.00	
		香港ドル 小計	315,000	2,576,700.00 (49,292,271)	
		投資信託受益証券合計	463,076	160,706,637 (160,706,637)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,251,550.30	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	841,374.06	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,641	5,696,712.45	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	703,531.62	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,083	1,731,654.42	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	669,685.32	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	732,900.42	
		CROWN CASTLE INC	32,235	2,966,587.05	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,366	2,585,713.32	
		EQUINIX INC	6,951	5,048,233.26	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	897,673.90	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,519,708.35	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,103,928.45	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	1,907,954.94	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	824,227.25	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	464,208.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	831,065.40	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	912,342.11			

	INVITATION HOMES INC	45,008	1,426,303.52	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,386,730.70	
	KIMCO REALTY CORP	47,897	842,508.23	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,182,936.75	
	PROLOGIS INC	68,641	7,702,206.61	
	PUBLIC STORAGE	11,847	3,121,921.44	
	REALTY INCOME CORP	49,099	2,452,004.06	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	743,653.84	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,567	1,514,686.39	
	SIMON PROPERTY GROUP	23,439	2,532,115.17	
	SUN COMMUNITIES INC	8,423	996,777.82	
	UDR INC	23,815	849,481.05	
	VENTAS INC	31,565	1,329,833.45	
	VICI PROPERTIES INC	74,643	2,172,111.30	
	WELLTOWER INC	36,855	3,019,161.60	
	WP CAREY INC	16,024	866,577.92	
	アメリカドル 小計	900,424	62,828,060.47	(9,411,015,177)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	220,305.96	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	279,904.30	
	カナダドル 小計	20,377	500,210.26	(55,198,202)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	208,900.20	
	GECINA SA	3,139	303,698.25	
	KLEPIERRE	17,225	400,136.75	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	488,771.25	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	302,704.16	
	ユーロ 小計	48,695	1,704,210.61	(269,725,413)
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	331,992.52	
	SEGR0 PLC	78,133	562,088.80	
	イギリスポンド 小計	134,422	894,081.32	(163,295,012)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	686,857.00	
	GOODMAN GROUP	135,303	2,902,249.35	
	GPT GROUP	167,884	654,747.60	
	MIRVAC GROUP	266,683	568,034.79	
	SCENTRE GROUP	381,283	937,956.18	
	STOCKLAND	207,412	813,055.04	
	VICINITY CENTERS	305,149	517,227.55	
	オーストラリアドル 小計	1,557,804	7,080,127.51	(682,099,484)
香港ドル	LINK REIT	166,900	6,408,960.00	

	香港ドル 小計	166,900	6,408,960.00 (122,603,404)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	781,379.50	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	626,278.65	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	475,757.52	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	220,000	314,600.00	
	シンガポールドル 小計	1,125,856	2,198,015.67 (240,748,656)	
	投資証券合計	3,954,478	10,944,685,348 (10,944,685,348)	
	合計		11,105,391,985 (11,105,391,985)	

## 有価証券明細表注記

1. 券面総額欄の数値は、証券数又は口数を表示しております。
2. 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。
3. 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。
4. 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。
5. 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	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 606銘柄	97.8%				72.9%
	投資証券 34銘柄				2.2%	1.6%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%				3.4%
	新株予約権 証券 1銘柄					
	投資証券 2銘柄				0.3%	0.0%
ユーロ	株式 222銘柄	99.5%				9.3%
	投資証券 5銘柄				0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 81銘柄	99.4%				4.4%
	投資証券 2銘柄				0.6%	0.0%
スイスフラン	株式 44銘柄	100.0%				2.9%
スウェーデン クローナ	株式 43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 16銘柄	100.0%				0.9%
オーストラ リアドル	株式 50銘柄	93.5%				2.0%
	投資信託受 益証券 2銘柄			0.9%		0.0%
	投資証券 7銘柄				5.6%	0.1%
ニュージー ランドドル	株式 6銘柄	100.0%				0.1%

香港ドル	株式	27銘柄	95.3%			0.6%
	投資信託受 益証券	1銘柄			1.4%	0.0%
	投資証券	1銘柄			3.4%	0.0%
シンガポ ールドル	株式	16銘柄	88.9%			0.3%
	投資証券	4銘柄			11.1%	0.0%
イスラエル シェケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年10月 2日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	559,018,149
コール・ローン	4,662,116,684
国債証券	286,009,456,836
派生商品評価勘定	8,804,096
未収入金	4,132,023,353
未収利息	2,130,936,170
前払費用	129,161,496
差入委託証拠金	196,681,830
流動資産合計	297,828,198,614
資産合計	297,828,198,614
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	902,376
前受金	2,907,594
未払金	7,425,098,634
未払解約金	92,904,894
未払利息	8,030
流動負債合計	7,521,821,528
負債合計	7,521,821,528
純資産の部	
元本等	
元本	88,123,684,086
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	202,182,693,000
元本等合計	290,306,377,086
純資産合計	290,306,377,086
負債純資産合計	297,828,198,614

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2023年10月 2日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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。 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 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。 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10月 2日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	88,123,684,086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 3.2943円 (1万口当たり純資産額) (32,943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

2023年10月 2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>
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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引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	<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

2023年10月 2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>

2023年10月 2日現在	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## ( 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	2023年10月 2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	15,653,343,912円
期中一部解約元本額	29,762,759,247円
期末元本額	88,123,684,086円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,170,433,826円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	530,211,438円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	341,382,731円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,477,669,324円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,027,484円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,871,455,839円
世界経済インデックスファンド	18,457,660,285円
D C マイセクション 2 5	1,988,391,404円
D C マイセクション 5 0	1,778,927,114円
D C マイセクション 7 5	1,359,709,507円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,253,075,006円
D C マイセクション S 2 5	1,056,246,218円
D C マイセクション S 5 0	956,427,083円
D C マイセクション S 7 5	525,955,604円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	16,309,889円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	99,304,618円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	53,593,476円
D C 世界経済インデックスファンド	13,681,894,069円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	446,895,431円
マイセクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	918,807円
マイセクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,075,526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）	15,984,343円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	29,577,182円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	51,554,161円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	58,397,209円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	54,812,935円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	894,753,557円
バランス B（3 7. 5）V A 1（適格機関投資家専用）	388,833,651円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,581,245,859円

区分	2023年10月 2日現在
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	53,833,925円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	32,587,935円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	370,526,485円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	137,447,949円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	184,361,507円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	660,635,961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）	1,945,723,372円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	631,367,705円
外国債券ファンド・シリーズ1	751,676,662円
分散投資コア戦略ファンドA	337,384,624円
分散投資コア戦略ファンドS	909,837,305円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	683,224,751円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,366,734,333円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	233,835,263円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,132,646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）	1,327,820,206円
SMT インデックスバランス・オープン	179,516,751円
SMT 世界経済インデックス・オープン	359,058,691円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	473,096,709円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	763,153,663円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,430,214円
グローバル経済コア	789,959,349円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,114,016円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,306,482円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	51,989,634円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	70,320,079円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	33,942,046円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	40,950,281円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	321,633,107円
10資産分散投資ファンド	26,150,088円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	12,234,289,418円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	188,120,620円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	458,763,251円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	122,508,589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）	95,526,893円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年10月 2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	7,681,479,910
合計	7,681,479,910

(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

(2023年10月 2日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	1,320,978,498	-	1,323,886,092	2,907,594
	合計	1,320,978,498	-	1,323,886,092	2,907,594

(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10月 2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	4,767,015,712	-	4,772,096,680	5,080,968
	アメリカドル	2,020,045,198	-	2,021,583,108	1,537,910
	カナダドル	85,061,552	-	84,836,269	225,283
	ユーロ	1,329,928,735	-	1,333,169,729	3,240,994
	イギリスポンド	209,884,128	-	210,365,159	481,031
	スウェーデンクローナ	6,356,800	-	6,355,315	1,485
	ノルウェークローネ	7,391,188	-	7,393,356	2,168
	ポーランドズロチ	34,221,000	-	34,198,600	22,400
	オーストラリアドル	31,691,912	-	31,688,227	3,685
	ニュージーランドドル	15,342,975	-	15,345,591	2,616
	マレーシアリングット	29,680,472	-	29,697,620	17,148
	イスラエルシェケル	15,689,000	-	15,695,720	6,720
	オフショア人民元	981,722,752	-	981,767,986	45,234
	売建	261,085,623	-	261,172,465	86,842
	メキシコペソ	211,486,200	-	211,567,380	81,180
	シンガポールドル	49,599,423	-	49,605,085	5,662
	合計		5,028,101,335	-	5,033,269,145

(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 0.25% 05/31/25	3,900,000.00	3,596,683.58	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,492,882.82	



T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,761,859.38	
T 0.25% 08/31/25	5,250,000.00	4,791,035.13	
T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,730,351.57	
T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,264,750.00	
T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,202,812.48	
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,417,500.00	
T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,673,066.42	
T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,341,267.16	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,718,632.82	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,616,718.76	
T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,052,109.37	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,728,983.61	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,535,290.62	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,007,949.21	
T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	5,963,578.14	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,967,189.03	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,345,849.60	
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,517,382.85	
T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,044,324.19	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,121,250.00	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,173,958.95	
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,835,371.43	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,120,410.15	
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,118,749.95	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,208,398.48	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,426,718.72	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,559,277.32	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,592,968.76	
T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,629,915.22	
T 0.75% 11/15/24	2,750,000.00	2,612,500.00	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,199,375.04	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,354,765.64	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,676,964.78	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,447,781.21	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,219,056.27	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,024,199.24	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,884,375.04	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	982,248.04	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	2,958,109.38	
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,276,356.84	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,320,293.77	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,888,750.00	

T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,619,881.82
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,153,554.68
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,708,359.42
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,216,345.72
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,075,185.53
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,281,953.16
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,388,034.37
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,798,750.00
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,783,203.12
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,003,687.49
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	9,862,523.49
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,553,593.72
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,162,511.73
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,403,281.28
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,364,539.81
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,837,597.67
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,177,659.94
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,420,843.72
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,428,027.32
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,188,312.52
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,089,996.08
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,840,171.90
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,729,589.81
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,548,218.73
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,615,896.49
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,340,650.79
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,186,718.72
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,997,296.87
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	2,916,407.80
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,552,343.75
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,522,042.21
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,099,511.69
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,700,769.55
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,641,250.00
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,788,890.01
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,840,394.52
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,905,976.58
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,597,812.48
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,029,570.71
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,356,015.61
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,840,076.80
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,122,584.95
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,640,216.81

T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,039,892.55	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,434,941.42	
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	6,882,596.50	
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,040,375.00	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,425,361.33	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,091,435.53	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,807,239.27	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,158,000.00	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	6,958,810.56	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,200,875.00	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	3,803,486.33	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,363,296.87	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,443,390.61	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,782,655.04	
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,342,326.56	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,170,792.92	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,625,521.46	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,820,117.20	
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	1,908,988.87	
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,645,041.00	
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,596,066.42	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	971,698.24	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,452,660.34	
T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	3,022,178.12	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,978,125.00	
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,231,437.48	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,532,637.50	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,058,750.00	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,164,734.37	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,281,718.75	
T 2.75% 08/15/32	13,800,000.00	11,952,093.75	
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	6,380,736.33	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	2,828,276.35	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,606,480.48	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,396,833.96	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,127,732.42	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,858,593.76	
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,014,214.85	
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,324,362.50	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	8,867,089.86	
T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	2,038,383.79	
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,338,649.99	

T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	7,659,984.34
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,679,883.58
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,247,145.28
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,620,334.38
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,666,601.57
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	1,796,289.05
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,093,510.17
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,605,419.91
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,260,384.75
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,531,535.11
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	2,962,274.22
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,025,761.74
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	823,327.14
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	2,942,699.21
T 3.125% 05/15/48	5,580,000.00	4,180,313.69
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,841,804.66
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,406,450.00
T 3.125% 08/31/27	8,850,000.00	8,353,915.99
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,590,289.06
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,822,828.10
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,307,922.83
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,788,359.36
T 3.375% 05/15/33	7,800,000.00	7,074,843.75
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,402,885.34
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,864,033.20
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,158,326.15
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,749,843.76
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,277,750.00
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	665,779.29
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	1,996,359.38
T 3.625% 02/15/53	8,350,000.00	6,907,667.92
T 3.625% 05/15/53	1,300,000.00	1,076,664.05
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,669,335.94
T 3.75% 04/15/26	2,800,000.00	2,723,765.63
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,547,187.50
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,347,910.14
T 3.875% 02/15/43	1,900,000.00	1,653,890.62
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,287,922.85
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,396,325.77
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	7,793,367.18
T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,175,375.00
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	731,835.94
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	731,132.81

T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,875,876.94	
T 3% 05/15/45	700,000.00	520,091.79	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,356,027.13	
T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,650,414.02	
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,376,499.02	
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	3,790,515.61	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,037,742.19	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,801,953.10	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,090,539.05	
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,034,488.28	
T 4.125% 11/15/32	14,000,000.00	13,504,531.31	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	848,953.12	
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,792,996.11	
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	688,474.60	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	969,804.69	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,803,144.53	
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	613,018.55	
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	5,925,937.50	
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	914,212.50	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,087,913.67	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	538,312.50	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,646,908.20	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,351,995.70	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	741,972.66	
T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,363,144.51	
T 4% 02/28/30	6,200,000.00	5,980,093.75	
T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,325,099.59	
T 4% 11/15/52	7,800,000.00	6,915,187.50	
T 5.0% 05/15/37	400,000.00	415,718.75	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,335,089.84	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,046,662.10	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,738,382.80	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,527,880.86	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,145,730.47	
アメリカドル 小計	1,080,840,000.00	926,895,407.92 (138,839,663,152)	
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,054,433.48	
CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,774,265.16	
CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,487,003.68	
CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	671,079.25	
CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,367,953.92	
CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,691,036.61	

	CAN 1.25% 06/01/30	3,980,000.00	3,323,363.44
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,386,888.25
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	841,652.84
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,299,343.37
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	2,978,647.92
	CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	1,826,344.05
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	720,152.33
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,384,974.84
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,227,334.56
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	218,032.27
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,029,194.13
	CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	287,521.71
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,506,330.38
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	863,141.75
	CAN 2.75% 12/01/55	460,000.00	368,092.84
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	482,458.61
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	372,703.78
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,292,282.11
	CAN 2% 12/01/51	3,650,000.00	2,502,012.09
	CAN 3.25% 09/01/28	2,070,000.00	1,978,994.84
	CAN 3.25% 12/01/33	320,000.00	299,602.88
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,122,325.68
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	984,832.15
	CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	1,995,671.42
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,288,817.13
	CAN 3% 10/01/25	510,000.00	492,501.89
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,111,540.05
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	741,797.96
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,612,422.89
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,838,415.65
	CAN 5% 06/01/37	630,000.00	693,207.11
	カナダドル 小計	58,960,000.00	52,116,373.02 (5,751,041,762)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,590,612.50
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,208,285.26
	MBONO 5.5% 03/04/27	24,260,000.00	20,898,049.20
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	40,686,701.23
	MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,191,549.20
	MBONO 7.5% 05/26/33	18,500,000.00	15,725,370.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	28,790,687.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	40,630,000.00	35,809,250.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	23,059,660.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,549,315.50

	MBONO 8.5% 05/31/29	26,700,000.00	24,985,326.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	18,902,760.10
	MBONO 8% 07/31/53	16,550,000.00	13,515,226.50
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	20,254,410.00
	メキシコペソ 小計	343,560,000.00	305,167,202.99 (2,626,452,049)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,260,000.00	1,025,623.62
	BGB 0.35% 06/22/32	1,570,000.00	1,214,142.23
	BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	296,960.41
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,375,887.70
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	151,485.40
	BGB 0.8% 06/22/25	1,900,000.00	1,818,974.02
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,387,899.89
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,440,201.60
	BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,441,426.93
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	688,227.54
	BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,282,570.85
	BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	722,106.09
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	592,215.75
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	609,028.80
	BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	701,673.84
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	701,053.92
	BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	516,625.85
	BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,377,755.28
	BGB 1% 06/22/31	1,560,000.00	1,317,920.76
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	578,751.36
	BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	466,846.62
	BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	352,530.00
	BGB 3.3% 06/22/54	810,000.00	714,041.64
	BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	413,408.80
	BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	912,327.21
	BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,076,716.37
	BGB 3% 06/22/34	950,000.00	905,780.99
	BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	1,951,222.75
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,173,645.96
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,131,624.00
	BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,242,035.48
	BGB 5% 03/28/35	1,730,000.00	1,957,015.26
	BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,369,658.74
	BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,609,836.90
	BKO 2.8% 06/12/25	800,000.00	793,480.80
	BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,357,252.80

BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,420,923.84
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	553,412.80
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,701,121.28
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,766,377.55
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,098,548.10
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,362,548.72
BTPS 0.85% 01/15/27	1,270,000.00	1,149,854.50
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,269,353.92
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	633,705.60
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,731,534.32
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,783,901.88
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,325,113.62
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,628,077.76
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,032,810.21
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	2,892,723.40
BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	715,852.50
BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,313,808.80
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,795,511.25
BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,541,016.70
BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	811,870.68
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,212,600.00
BTPS 1.45% 11/15/24	1,970,000.00	1,917,106.28
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	684,105.62
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,315,916.01
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,017,367.56
BTPS 1.65% 03/01/32	1,910,000.00	1,533,447.32
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,112,619.60
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	871,805.76
BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	417,285.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,606,715.00
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,552,485.36
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,371,274.87
BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	301,451.90
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	580,155.60
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,142,785.04
BTPS 2.25% 09/01/36	2,050,000.00	1,544,736.50
BTPS 2.45% 09/01/33	2,200,000.00	1,820,372.40
BTPS 2.45% 09/01/50	1,010,000.00	632,329.69
BTPS 2.5% 11/15/25	2,200,000.00	2,138,901.60
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,903,124.50
BTPS 2.5% 12/01/32	3,050,000.00	2,581,147.90
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,666,860.80
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	762,676.99



BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	512,540.77	
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,420,258.22	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,332,400.20	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	935,269.18	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,077,631.56	
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,095,595.07	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,122,211.80	
BTPS 3.25% 03/01/38	1,860,000.00	1,536,802.68	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,727,481.35	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	977,435.20	
BTPS 3.4% 04/01/28	1,200,000.00	1,166,032.68	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,420,546.40	
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	902,060.25	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,255,746.12	
BTPS 3.7% 06/15/30	300,000.00	288,322.38	
BTPS 3.8% 04/15/26	1,350,000.00	1,345,545.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,214,655.12	
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,787,726.36	
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,077,084.25	
BTPS 4.35% 11/01/33	470,000.00	456,853.94	
BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	392,631.60	
BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	782,461.55	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,107,160.64	
BTPS 4.5% 10/01/53	650,000.00	585,552.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,702,719.50	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,440,978.00	
BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,616,915.60	
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	819,272.67	
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,210,708.52	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,685,199.20	
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,858,694.99	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,473,706.52	
BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,172,858.77	
BTPS 5% 08/01/34	3,770,000.00	3,841,818.50	
BTPS 5% 09/01/40	2,450,000.00	2,447,589.20	
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,950,281.90	
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,257,145.26	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,531,518.80	
DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,780,435.00	
DBR 0.25% 02/15/29	3,030,000.00	2,661,703.50	
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,336,975.92	
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,963,351.16	

DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,828,262.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,235,842.88
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	321,077.05
DBR 0% 02/15/30	1,470,000.00	1,240,559.46
DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	927,535.64
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,917,850.82
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,706,924.10
DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,549,042.74
DBR 0% 08/15/26	3,050,000.00	2,808,482.70
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,521,987.45
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,956,957.80
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,234,101.64
DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,694,253.05
DBR 0% 08/15/50	4,380,000.00	2,009,982.00
DBR 0% 08/15/52	3,100,000.00	1,338,477.70
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,162,112.70
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,734,217.34
DBR 1.25% 08/15/48	3,230,000.00	2,264,307.52
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,898,241.40
DBR 1.8% 08/15/53	2,380,000.00	1,815,674.63
DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,464,945.17
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,334,522.06
DBR 2.1% 11/15/29	3,850,000.00	3,711,426.95
DBR 2.3% 02/15/33	4,630,000.00	4,444,330.50
DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,563,295.38
DBR 2.5% 08/15/46	3,040,000.00	2,789,828.52
DBR 2.6% 08/15/33	770,000.00	755,533.24
DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,887,882.90
DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,716,499.82
DBR 4.25% 07/04/39	1,900,000.00	2,193,352.40
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,556,694.71
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,497,851.00
DBR 4.75% 07/04/40	1,770,000.00	2,171,269.62
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,657,181.60
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,627,681.82
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,501,210.00
DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,118,098.61
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,275,325.08
FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,425,351.21
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,195,647.00
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,416,844.80
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,628,523.31
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	310,641.55

FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	793,465.00	
FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,244,903.70	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,140,000.00	5,514,978.70	
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,389,455.76	
FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,455,413.84	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,440,000.00	4,833,249.60	
FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,135,823.57	
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,724,027.50	
FRTR 0% 02/25/27	3,040,000.00	2,734,464.80	
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,556,104.30	
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,479,202.75	
FRTR 0% 11/25/29	4,450,000.00	3,676,871.44	
FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,190,367.00	
FRTR 0% 11/25/31	5,500,000.00	4,237,299.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	4,330,000.00	3,489,975.67	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,409,679.00	
FRTR 1.25% 05/25/38	1,100,000.00	801,379.70	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,580,728.57	
FRTR 1.5% 05/25/50	2,870,000.00	1,771,880.60	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	860,603.72	
FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,268,632.68	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,076,408.96	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,309,695.56	
FRTR 1% 11/25/25	4,280,000.00	4,081,245.36	
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,350,185.95	
FRTR 2.5% 05/25/43	820,000.00	673,984.24	
FRTR 2.5% 09/24/26	3,140,000.00	3,076,229.74	
FRTR 2.75% 02/25/29	500,000.00	489,680.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,281,049.00	
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,043,312.70	
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,599,432.40	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	2,838,016.78	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,761,272.86	
FRTR 3% 05/25/33	3,690,000.00	3,576,632.13	
FRTR 3% 05/25/54	1,650,000.00	1,388,936.26	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,778,760.88	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,723,566.06	
FRTR 4% 04/25/55	1,940,000.00	1,983,722.16	
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,823,431.46	
FRTR 4% 10/25/38	2,750,000.00	2,860,770.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,612,237.44	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,260,016.06	

FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,000,004.60
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	603,684.74
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	636,098.05
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	365,364.18
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	493,484.55
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	217,458.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	698,278.35
IRISH 0% 10/18/31	790,000.00	613,966.90
IRISH 1.1% 05/15/29	1,060,000.00	950,862.40
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	360,271.20
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	414,500.52
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	506,508.00
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	464,664.68
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	947,160.20
IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	756,110.58
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	738,477.04
IRISH 3% 10/18/43	470,000.00	431,821.90
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,194,069.66
NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,812,274.08
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	812,976.18
NETHER 0.5% 01/15/40	1,380,000.00	901,689.93
NETHER 0.5% 07/15/26	1,670,000.00	1,556,591.63
NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	818,625.66
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	828,849.60
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,531,672.80
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,108,003.05
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,668,098.00
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,375,501.89
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	604,392.00
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	719,556.12
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,103,395.50
NETHER 0% 07/15/31	1,570,000.00	1,242,375.05
NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	387,488.40
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,473,991.10
NETHER 2.5% 07/15/33	740,000.00	699,059.50
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,689,583.68
NETHER 2% 01/15/54	720,000.00	548,487.36
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,805,221.50
NETHER 4% 01/15/37	1,760,000.00	1,898,076.57
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,679,283.63
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,849,343.75
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,189,399.85
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,309,922.60

OBL 0% 10/09/26	3,650,000.00	3,346,750.70	
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,757,588.00	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,324,455.23	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,350,965.70	
OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,342,095.20	
OBL 2.4% 10/19/28	670,000.00	658,601.96	
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	472,797.36	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,223,661.45	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,220,000.00	1,112,699.78	
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	104,994.33	
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	793,095.60	
RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	377,181.48	
RAGB 0.75% 10/20/26	1,410,000.00	1,312,767.81	
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	81,489.00	
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,011,610.83	
RAGB 0% 02/20/30	1,280,000.00	1,043,104.00	
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,312,620.00	
RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	977,499.08	
RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	622,164.40	
RAGB 0% 10/20/40	580,000.00	315,714.88	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,142,209.60	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	716,464.17	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	137,012.31	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	971,633.52	
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	324,993.22	
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	411,282.95	
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	662,247.97	
RAGB 2.9% 02/20/33	790,000.00	757,095.71	
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	216,734.98	
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	650,704.95	
RAGB 3.15% 10/20/53	270,000.00	245,054.74	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	432,843.60	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,570,000.00	1,655,247.86	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,109,144.13	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,306,809.88	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	288,992.00	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	184,706.10	
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	288,566.58	
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	173,499.51	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	580,130.28	
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	278,246.46	
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	487,409.40	

RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	641,177.98
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	453,342.12
RFGB 0.75% 04/15/31	570,000.00	475,094.43
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	419,939.52
RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	418,877.38
RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	512,178.56
RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	295,409.66
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	329,032.20
RFGB 1.375% 04/15/47	510,000.00	335,985.52
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	489,561.60
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	452,071.36
RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	360,758.99
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	540,045.55
RFGB 2.875% 04/15/29	210,000.00	206,352.09
RFGB 3% 09/15/33	460,000.00	444,311.24
RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	586,009.84
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,687,825.76
SPGB 0.5% 04/30/30	2,750,000.00	2,260,500.00
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,002,880.67
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,026,211.54
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,715,718.40
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,210,559.48
SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,357,175.70
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	958,447.66
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,174,018.76
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,455,650.82
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,597,012.04
SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,096,544.70
SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,886,241.55
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,328,208.07
SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,698,383.41
SPGB 1.3% 10/31/26	2,650,000.00	2,485,893.45
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	1,982,899.71
SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,863,887.05
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,412,720.07
SPGB 1.45% 10/31/27	3,160,000.00	2,921,423.16
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	272,323.06
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,402,653.60
SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,407,003.15
SPGB 1.85% 07/30/35	2,180,000.00	1,743,871.38
SPGB 1.9% 10/31/52	1,780,000.00	1,040,349.48
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,215,438.20
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,820,020.00

	SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	513,833.04
	SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	881,626.00
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,529,691.82
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,440,000.00	1,264,368.96
	SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,792,143.54
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,271,225.70
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,335,528.00
	SPGB 2.8% 05/31/26	1,000,000.00	982,263.00
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,543,301.71
	SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,604,359.70
	SPGB 3.45% 07/30/43	730,000.00	640,255.26
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,101,309.00
	SPGB 3.55% 10/31/33	1,490,000.00	1,445,708.26
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,030,000.00	985,773.23
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	1,970,170.80
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,895,101.68
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	1,972,670.27
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,853,823.02
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,378,037.12
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,573,837.12
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,284,069.36
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,190,787.34
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,018,699.50
	ユーロ 小計	659,850,000.00	586,884,217.52 (92,886,165,106)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,141,653.24
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,262,375.10
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,788,804.25
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	1,984,289.10
	UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,282,706.60
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,642,772.00
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,783,867.84
	UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	473,280.00
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,310,653.40
	UKT 0.625% 07/31/35	1,700,000.00	1,093,919.40
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	395,403.52
	UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	747,906.46
	UKT 0.875% 07/31/33	1,630,000.00	1,172,482.47
	UKT 0.875% 10/22/29	1,810,000.00	1,487,667.96
	UKT 1.125% 01/31/39	2,050,000.00	1,250,000.62
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	354,060.00
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	847,960.50

UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,099,809.65	
UKT 1.25% 10/22/41	1,960,000.00	1,129,156.00	
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,478,800.00	
UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	898,994.00	
UKT 1.5% 07/31/53	1,140,000.00	543,711.60	
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	943,143.15	
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	654,831.20	
UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	511,171.28	
UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	595,162.08	
UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	776,443.20	
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,329,441.12	
UKT 1% 01/31/32	3,940,000.00	3,024,596.16	
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	852,468.60	
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,263,632.28	
UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,513,675.00	
UKT 3.25% 01/31/33	3,040,000.00	2,771,958.33	
UKT 3.5% 01/22/45	1,970,000.00	1,610,742.92	
UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,188,963.00	
UKT 3.5% 10/22/25	1,360,000.00	1,324,164.00	
UKT 3.75% 01/29/38	1,410,000.00	1,268,703.90	
UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,093,382.40	
UKT 3.75% 10/22/53	1,620,000.00	1,333,746.00	
UKT 4.125% 01/29/27	2,800,000.00	2,760,430.40	
UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,832,358.78	
UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,492,725.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,199,388.00	
UKT 4.25% 12/07/27	2,180,000.00	2,169,091.71	
UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,359,810.00	
UKT 4.25% 12/07/46	1,590,000.00	1,450,286.70	
UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,461,217.32	
UKT 4.25% 12/07/55	1,780,000.00	1,611,975.12	
UKT 4.5% 06/07/28	660,000.00	660,318.05	
UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,390,647.74	
UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,729,620.00	
UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,501,712.20	
UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,408,241.80	
UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,084,796.50	
UKT 4% 10/22/63	1,000,000.00	864,034.39	
UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,183,599.94	
UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,454,144.40	
イギリスポンド 小計	96,770,000.00	76,840,896.38	(14,034,221,314)
SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,622,532.70	



スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,806,494.53
	SGB 0.75% 11/12/29	5,540,000.00	4,870,319.30
	SGB 1.75% 11/11/33	2,940,000.00	2,644,676.05
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,462,888.25
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,229,587.50
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,609,706.82
	SGB 3.5% 03/30/39	4,300,000.00	4,565,482.00
スウェーデンクローナ 小計		44,900,000.00	41,811,687.15 (572,820,113)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	2,998,280.00
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,392,440.00
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,849,917.00
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,918,650.85
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,045,022.83
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,750,030.00
	NGB 2.125% 05/18/32	3,620,000.00	3,134,047.58
	NGB 2% 04/26/28	3,070,000.00	2,809,742.58
	NGB 3% 08/15/33	3,460,000.00	3,198,660.66
ノルウェークローネ 小計		37,860,000.00	34,096,791.50 (476,673,145)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,370,903.06
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,208,981.11
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,278,371.90
	DGB 0% 11/15/24	3,950,000.00	3,803,202.33
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,156,920.80
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,370,601.64
	DGB 2.25% 11/15/33	1,310,000.00	1,215,577.82
	DGB 4.5% 11/15/39	10,290,000.00	11,994,937.74
デンマーククローネ 小計		46,770,000.00	42,399,496.40 (899,717,313)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,958,710.36
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,343,053.60
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,136,623.95
	POLGB 1.75% 04/25/32	3,110,000.00	2,271,606.20
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,824,734.95
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,582,210.50
	POLGB 2.5% 07/25/27	5,530,000.00	5,038,615.26
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,898,263.50
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,209,320.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,913,803.01
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,351,550.90
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	610,925.40

	POLGB 6% 10/25/33	2,380,000.00	2,399,955.81
	POLGB 7.5% 07/25/28	1,510,000.00	1,652,351.77
ポーランドズロチ 小計		46,520,000.00	42,191,725.21 (1,443,509,713)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,677,778.74
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,936,801.31
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,090,014.40
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,887,465.46
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	1,952,463.26
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,710,000.00	905,529.91
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,452,946.16
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,138,273.22
	ACGB 1% 12/21/30	2,020,000.00	1,606,415.88
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,364,569.53
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,101,788.35
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,010,264.08
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,006,368.22
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,832,101.19
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,554,171.61
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,344,728.97
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,041,170.07
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,603,181.74
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	938,511.21
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,321,496.36
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,059,011.54
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,490,000.00	1,396,801.25
	ACGB 3% 03/21/47	1,450,000.00	1,076,110.58
ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,619,412.90	
ACGB 4.25% 04/21/26	1,500,000.00	1,506,072.90	
ACGB 4.5% 04/21/33	3,010,000.00	3,018,677.22	
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,370,648.15	
オーストラリアドル 小計		49,770,000.00	43,812,774.21 (4,220,922,667)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	517,475.32
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	589,729.24
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	764,752.79
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	266,041.77
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	813,246.45
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	468,078.82
	NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	317,164.18
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	410,194.06
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,160,000.00	1,004,513.27
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	579,887.82

	NZGB 4.25% 05/15/34	380,000.00	346,232.29
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	816,507.30
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	468,762.43
ニュージーランドドル 小計		8,830,000.00	7,362,585.74 (660,939,321)
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	739,945.60
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	756,702.00
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	493,080.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	595,210.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	248,777.60
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	606,224.12
	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	576,550.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	880,103.31
	SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	418,269.45
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	698,544.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	360,000.00	339,480.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	596,160.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	589,815.45
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	633,100.00
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	412,440.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	609,840.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	828,248.70
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	741,554.00
	SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	486,080.00
	シンガポールドドル 小計		12,010,000.00
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,505,956.86
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,498,571.36
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	686,992.77
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,923,767.42
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,215,741.74
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,730,447.91
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,853,007.52
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,379,810.29
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,155,222.14
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,137,257.76
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,985,749.16
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,489,749.37
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	605,276.46
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,703,082.12
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,287,280.89
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,871,926.45
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,532,179.35

	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,771,283.15	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,520,000.00	2,567,110.88	
	MGS 4.457% 03/31/53	490,000.00	491,763.31	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,100,000.00	1,138,900.06	
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	361,434.88	
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	917,476.68	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,450,000.00	1,524,098.19	
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,024,639.88	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	2,946,128.90	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	1,989,086.00	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,788,489.86	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,104,586.21	
	マレーシアリングット 小計	47,880,000.00	48,187,017.57 (1,535,773,255)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,956,412.49	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,032,414.44	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,271,718.61	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,550,000.00	1,227,490.72	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,258,211.75	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,176,779.59	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,720,000.00	2,228,037.67	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,474,320.77	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	500,000.00	360,113.00	
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,481,300.80	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,396,169.77	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,136,587.85	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,410,505.03	
	イスラエルシェケル 小計	24,620,000.00	22,410,062.49 (879,579,265)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000.00	53,556,299.36	
	CGB 2.18% 08/25/25	19,000,000.00	18,946,841.04	
	CGB 2.22% 09/25/25	21,100,000.00	21,078,900.00	
	CGB 2.26% 02/24/25	32,000,000.00	31,956,629.76	
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,191,478.66	
	CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,339,412.64	
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,078,293.02	
	CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,910,907.40	
	CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	42,358,938.04	
	CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,262,501.84	
	CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,544,135.40	
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	19,996,394.00	
	CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	26,403,853.23	

CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,042,296.37	
CGB 2.6% 09/01/32	32,800,000.00	32,417,324.36	
CGB 2.6% 09/15/30	10,500,000.00	10,426,846.50	
CGB 2.62% 04/15/28	15,050,000.00	15,087,789.04	
CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	19,933,280.20	
CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,557,006.20	
CGB 2.67% 05/25/33	13,000,000.00	12,972,359.66	
CGB 2.68% 05/21/30	33,530,000.00	33,459,335.18	
CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,158,969.06	
CGB 2.69% 08/15/32	20,220,000.00	20,125,558.44	
CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,502,939.15	
CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	25,614,612.96	
CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	10,708,507.57	
CGB 2.79% 12/15/29	13,000,000.00	13,066,277.90	
CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,271,859.42	
CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,123,318.00	
CGB 2.8% 11/15/32	4,000,000.00	4,017,849.20	
CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	29,894,769.32	
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,443,538.25	
CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,494,961.38	
CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,666,697.75	
CGB 2% 06/15/25	3,600,000.00	3,586,379.04	
CGB 3.01% 05/13/28	14,000,000.00	14,282,000.60	
CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,182,031.14	
CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,121,530.76	
CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,521,511.88	
CGB 3.19% 04/15/53	2,600,000.00	2,702,306.36	
CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,144,969.90	
CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,609,997.72	
CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,444,736.80	
CGB 3.39% 03/16/50	16,830,000.00	17,754,507.24	
CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	8,083,316.30	
CGB 3.72% 04/12/51	13,540,000.00	15,159,641.26	
CGB 3.81% 09/14/50	18,550,000.00	21,028,491.47	
CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,661,835.06	
CGB 4.08% 10/22/48	14,010,000.00	16,516,387.59	
オフショア人民元 小計	960,450,000.00	973,410,323.42 (19,949,752,555)	
合計		286,009,456,836 (286,009,456,836)	

## 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 206銘柄	100.0%	48.5%
カナダドル	国債証券 37銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 357銘柄	100.0%	32.5%
イギリスポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
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%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 49銘柄	100.0%	7.0%

(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18期中間計算期間(2023年10月3日から2024年4月2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S25】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2023年10月2日現在)	第18期中間計算期間 (2024年4月2日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,860,526,735	1,999,030,946
親投資信託受益証券	34,474,532,423	37,562,773,335
未収入金	6,930,000	46,650,000
未収利息	-	5,332
流動資産合計	36,341,989,158	39,608,459,613
資産合計	36,341,989,158	39,608,459,613
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	21,634,467	27,055,710
未払受託者報酬	5,842,196	6,228,479
未払委託者報酬	21,421,325	22,837,703
未払利息	3,204	-
その他未払費用	1,675,816	846,212
流動負債合計	50,577,008	56,968,104
負債合計	50,577,008	56,968,104
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	23,772,221,423	24,516,106,098
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	12,519,190,727	15,035,385,411
(分配準備積立金)	4,616,093,346	4,380,636,154
元本等合計	36,291,412,150	39,551,491,509
純資産合計	36,291,412,150	39,551,491,509
負債純資産合計	36,341,989,158	39,608,459,613



## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自 2022年10月 1日 至 2023年 3月31日	第18期中間計算期間 自 2023年10月 3日 至 2024年 4月 2日
<b>営業収益</b>		
受取利息	2,861	51,721
有価証券売買等損益	781,033,828	2,133,270,912
営業収益合計	781,036,689	2,133,322,633
<b>営業費用</b>		
支払利息	392,434	157,815
受託者報酬	5,134,099	6,228,479
委託者報酬	18,824,973	22,837,703
その他費用	825,905	846,276
営業費用合計	25,177,411	30,070,273
営業利益又は営業損失（ ）	755,859,278	2,103,252,360
経常利益又は経常損失（ ）	755,859,278	2,103,252,360
中間純利益又は中間純損失（ ）	755,859,278	2,103,252,360
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（ ）	8,181,319	55,751,981
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,365,264,695	12,519,190,727
剰余金増加額又は欠損金減少額	834,160,800	1,136,977,197
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	834,160,800	1,136,977,197
剰余金減少額又は欠損金増加額	336,865,648	668,282,892
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	336,865,648	668,282,892
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,610,237,806	15,035,385,411

## （３）【中間注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第18期中間計算期間は2023年10月3日から2024年4月2日までとなっております。

## （中間貸借対照表に関する注記）

	第17期 (2023年10月2日現在)	第18期中間計算期間 (2024年4月2日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	23,772,221,423口	24,516,106,098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) 1.5266円 (15,266円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6133円 (16,133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18期中間計算期間 (2024年4月2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17期 自 2022年10月1日 至 2023年10月2日	第18期中間計算期間 自 2023年10月3日 至 2024年4月2日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	21,066,630,169円	23,772,221,423円
期中追加設定元本額	4,464,682,516円	2,010,932,374円
期中一部解約元本額	1,759,091,262円	1,267,047,699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

	2024年 4月 2日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,358,786,422
株式	649,770,765,050
派生商品評価勘定	38,740,900
未収入金	203,395,400
未収配当金	6,390,508,645
未収利息	14,295
前払金	112,713,900
差入委託証拠金	546,095,867
流動資産合計	662,421,020,479
資産合計	662,421,020,479
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	151,688,000
未払解約金	331,990,241
流動負債合計	483,678,241
負債合計	483,678,241
純資産の部	
元本等	
元本	235,098,341,553
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	426,839,000,685
元本等合計	661,937,342,238
純資産合計	661,937,342,238
負債純資産合計	662,421,020,479

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 4月 2日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2024年 4月 2日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	235,098,341,553口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.8156円 (1万口当たり純資産額) (28,156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

	2024年 4月 2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	2024年 4月 2日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月 3日
期首元本額	241,361,431,252円
期中追加設定元本額	12,398,310,339円
期中一部解約元本額	18,661,400,038円
期末元本額	235,098,341,553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）	262,774,403円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,275,736,309円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,687,224円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,684,585,693円
世界経済インデックスファンド	5,767,893,644円
日本株式インデックス・オープン	2,846,697,234円
DCマイセクション25	4,770,688,018円
DCマイセクション50	15,642,637,022円
DCマイセクション75	17,902,397,721円
DC日本株式インデックス・オープン	6,003,376,740円
DCマイセクションS25	2,881,416,090円
DCマイセクションS50	9,058,193,108円
DCマイセクションS75	8,359,055,955円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,445,311,460円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	57,576,451円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	553,681,606円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	449,162,107円
DC世界経済インデックスファンド	3,927,850,742円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	721,251,982円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,610,093円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	8,161,792円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,243,691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）	136,164,499円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,841,719円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	12,959,781円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	62,015,718円

区分	2024年 4月 2日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,686,156円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	39,888,720円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	433,107,673円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	290,459,360円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,969,044,008円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	26,054,951円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,703,073円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	297,281,246円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	165,461,392円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	220,955,852円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	16,037,940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）	369,325,210円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,407,483,902円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,896,472,104円
コア投資戦略ファンド（安定型）	979,876,095円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,406,395,078円
分散投資コア戦略ファンドA	1,674,382,755円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	643,594,311円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	414,127,613円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,049,581,218円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	184,709,772円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,466,762円
SMT インデックスバランス・オープン	48,006,346円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	16,059,973,657円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	239,439,855円
SMT 世界経済インデックス・オープン	50,903,088円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	229,025,062円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	37,949,367円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,710,311円
グローバル経済コア	256,654,332円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	32,162,970円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,860,399,335円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	29,656,021円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	889,892,261円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	222,020,097円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	60,806,215円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	58,473,205円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	25,971,010円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	31,296,742円
10資産分散投資ファンド	114,497,364円
グローバル10資産バランスファンド	28,633,489円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	34,725円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	37,911円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	39,822円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	39,822円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	34,844円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,400円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	19,911円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	41,374,251,056円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	437,922,948円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	288,512,471円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	26,636,591円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	153,450,380円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	47,950,881,862円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,837,043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）	198,620,736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	11,628,553,900	-	11,515,840,000	112,713,900
合計		11,628,553,900	-	11,515,840,000	112,713,900

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2024年 4月 2日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,548,712,513
国債証券	565,951,339,750
地方債証券	33,256,589,931
特殊債券	37,456,007,385
社債券	30,790,468,000
未収利息	718,793,572
前払費用	32,913,076
流動資産合計	669,754,824,227
資産合計	669,754,824,227
負債の部	
流動負債	
未払金	110,660
未払解約金	1,187,783,476
流動負債合計	1,187,894,136
負債合計	1,187,894,136
純資産の部	
元本等	
元本	502,035,451,894
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	166,531,478,197
元本等合計	668,566,930,091
純資産合計	668,566,930,091
負債純資産合計	669,754,824,227

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 4月 2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 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。 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> <p>先物取引</p>

2024年 4月 2日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 4月 2日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	502,035,451,894口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 99,275,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3317円 (1万口当たり純資産額) (13,317円)

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

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2024年 4月 2日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2024年 4月 2日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月 3日
期首元本額	483,216,028,480円
期中追加設定元本額	34,967,087,871円
期中一部解約元本額	16,147,664,457円
期末元本額	502,035,451,894円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	5,119,985,827円
SBI資産設計オープン(分配型)	18,345,295円
SMT 国内債券インデックス・オープン	17,079,959,056円
世界経済インデックスファンド	7,234,728,587円
DCマイセレクション25	29,836,393,015円
DCマイセレクション50	38,717,247,032円
DCマイセレクション75	13,105,606,950円
DC日本債券インデックス・オープン	404,124,292円
DC日本債券インデックス・オープンS	88,152,170,884円
DC日本債券インデックス・オープンP	62,844,323,927円
DCマイセレクションS25	17,595,662,078円
DCマイセレクションS50	21,214,035,698円

区分	2024年 4月 2日現在
DCマイセレクションS75	5,813,268,124円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	354,661,844円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	3,055,291,367円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,252,384,538円
DC世界経済インデックスファンド	4,761,638,929円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	1,777,958円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	19,208,241円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	8,968,360円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,321,333円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	53,918,262円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	106,003,813円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	28,020,431円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	23,821,904円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,053,964,712円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	746,725,233円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,290,026,398円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	66,682,184円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	45,520,836円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	920,138,195円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,019,219,378円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,345,731,054円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	94,673,158円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,000,089,106円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,622,741,001円
分散投資コア戦略ファンドA	18,706,917,963円
分散投資コア戦略ファンドS	26,451,134,249円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	318,271,549円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,997,090,565円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	88,556,704円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	45,094,142円
SMT インデックスバランス・オープン	69,273,251円
SMT 世界経済インデックス・オープン	59,653,702円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	143,449,480円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	219,805,702円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	19,094,977円
グローバル経済コア	378,204,846円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	47,147,911円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	40,762,967円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	154,511,814円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	86,798,024円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	26,531,563円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	18,946,895円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	957,280,789円
10資産分散投資ファンド	455,468,398円
グローバル10資産バランスファンド	402,593,582円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	149,986円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	135,136円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	126,226円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	126,226円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	149,429円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	207,418円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	219,038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）	100,766,755,256円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	68,584,151円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	18,522,817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）	483,280,898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

	2024年 4月 2日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	10,004,717,149
コール・ローン	491,006,275
株式	698,888,549,557
投資信託受益証券	124,767,861
投資証券	13,210,103,123
派生商品評価勘定	346,202,535
未収入金	7,434,587
未収配当金	756,443,649
未収利息	1,309
差入委託証拠金	6,342,936,434
流動資産合計	730,172,162,479
資産合計	730,172,162,479
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,181,126
前受金	344,941,939
未払解約金	410,958,491
流動負債合計	757,081,556
負債合計	757,081,556
純資産の部	
元本等	
元本	115,253,867,255
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	614,161,213,668
元本等合計	729,415,080,923
純資産合計	729,415,080,923
負債純資産合計	730,172,162,479

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 4月 2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) 新株予約権証券 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（金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、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>(4) 投資証券</p>

2024年 4月 2日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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>(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取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取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> <p>(2)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>(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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 4月 2日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,253,867,255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 6.3288円 (1万口当たり純資産額) (63,288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

2024年 4月 2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	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。

	2024年 4月 2日現在
--	---------------

## （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	2024年 4月 2日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月 3日
期首元本額	114,577,143,137円
期中追加設定元本額	5,735,154,902円
期中一部解約元本額	5,058,430,784円
期末元本額	115,253,867,255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）	1,490,511,625円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,740,788円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,199,720,701円
世界経済インデックスファンド	13,545,972,627円
外国株式インデックス・オープン	891,618,025円
D Cマイセクション2 5	546,827,776円
D Cマイセクション5 0	3,057,939,902円
D Cマイセクション7 5	4,097,958,122円
D C外国株式インデックス・オープン	13,108,695,126円
D CマイセクションS 2 5	325,002,936円
D CマイセクションS 5 0	1,786,953,649円
D CマイセクションS 7 5	1,923,687,524円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	13,025,381円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	125,283,672円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	101,642,051円
D C世界経済インデックスファンド	9,290,732,931円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	891,290,008円
マイセクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,675,832円
マイセクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,805,608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）	19,986,212円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,855,052円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	28,620,264円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	6,168,293円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	17,980,323円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	135,467,307円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	116,287,258円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	902,199,551円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	59,814,335円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	13,377,341円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	101,453,182円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	31,998,730円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	726,534,023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）	773,822,053円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,160,084,599円
コア投資戦略ファンド（安定型）	120,638,147円
コア投資戦略ファンド（成長型）	290,213,250円
分散投資コア戦略ファンドA	1,491,590,936円
分散投資コア戦略ファンドS	6,952,080,946円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,509,065,174円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,006,451,571円
コア投資戦略ファンド（切替型）	126,172,035円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	429,453,320円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	21,980,862円
S M T インデックスバランス・オープン	111,195,900円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	72,983,607円
外国株式S M T Bセクション（SMA専用）	5,042,244,083円

区分	2024年 4月 2日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	246,972,746円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,111,517,818円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	184,184,982円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,327,033円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,981,978,480円
グローバル経済コア	641,577,282円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,577,912円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,710,822円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	124,430,320円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	30,839,009円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	165,250,934円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	157,931,594円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	70,966,873円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	85,036,775円
10資産分散投資ファンド	63,674,021円
グローバル10資産バランスファンド	12,970,509円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	50,271円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	23,675円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	25,847円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	27,150円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	27,150円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	23,756円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	15,277円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	13,575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）	51,434,246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）	196,653,914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）	607,178,298円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,398,915,543円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	129,088,720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）	69,905,701円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	76,800,071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）	78,209,206円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	179,358,397円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	167,795,325円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	166,942,593円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	174,601,806円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	172,871,024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）	91,215,580円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	107,940,382円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年 4月 2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	16,657,437,532	-	17,002,379,471	344,941,939
合計		16,657,437,532	-	17,002,379,471	344,941,939

## （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

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	37,839,225	-	37,928,325	89,100
	アメリカドル 売建	37,839,225	-	37,928,325	89,100
	オーストラリアドル	88,626,600	-	88,636,230	9,630
		88,626,600	-	88,636,230	9,630
合計		126,465,825	-	126,564,555	79,470

(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

2024年 4月 2日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	967,156,514
コール・ローン	5,232,863,188
国債証券	327,266,526,661
派生商品評価勘定	15,613,908
未収入金	4,103,683,763
未収利息	2,461,646,084
前払金	6,787,928
前払費用	254,286,455
差入委託証拠金	230,814,969
流動資産合計	340,539,379,470
資産合計	340,539,379,470
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,539,407
未払金	7,216,660,336
未払解約金	527,742,761
流動負債合計	7,756,942,504
負債合計	7,756,942,504
純資産の部	
元本等	
元本	94,249,668,593
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	238,532,768,373
元本等合計	332,782,436,966
純資産合計	332,782,436,966
負債純資産合計	340,539,379,470

### 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年 4月 2日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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。 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 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。 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)

2024年 4月 2日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	94,249,668,593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 3.5309円 (1万口当たり純資産額) (35,309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

2024年 4月 2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	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	2024年 4月 2日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月 3日
期首元本額	88,123,684,086円
期中追加設定元本額	9,619,548,287円
期中一部解約元本額	3,493,563,780円
期末元本額	94,249,668,593円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,108,556,115円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	490,974,943円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	309,732,561円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,362,995,461円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,163,633円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,801,677,539円
世界経済インデックスファンド	21,512,141,422円
DCマイセクション25	1,903,899,347円
DCマイセクション50	1,822,125,521円
DCマイセクション75	1,455,835,095円
DC外国債券インデックス・オープン	2,252,411,075円
DCマイセクションS25	1,121,763,976円
DCマイセクションS50	986,454,718円
DCマイセクションS75	563,183,803円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	11,326,390円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,312,314円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	56,097,312円
DC世界経済インデックスファンド	14,405,839,887円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	708,838,566円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	911,209円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	997,055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）	12,714,074円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	23,433,198円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	47,888,494円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	52,821,859円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	51,321,780円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	769,282,904円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	359,867,002円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,509,966,608円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	52,380,051円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	27,305,183円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	340,883,845円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	128,336,498円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	167,905,457円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	634,778,991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）	1,484,031,682円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	624,198,319円
外国債券ファンド・シリーズ1	764,286,461円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円
分散投資コア戦略ファンドS	1,606,006,912円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	762,403,498円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,484,020,301円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	218,994,383円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,204,242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）	1,254,395,980円
SMT インデックスバランス・オープン	170,262,672円
SMT 世界経済インデックス・オープン	414,340,499円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	597,611,677円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	915,688,346円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,021,284円
グローバル経済コア	1,070,134,556円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	22,337,248円

区分	2024年 4月 2日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,812,567円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	62,455,097円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	84,644,575円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	43,115,788円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	56,621,444円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	640,221,267円
10資産分散投資ファンド	35,997,338円
グローバル10資産バランスファンド	21,665,668円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	22,068円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	13,001,214,413円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	283,864,795円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	378,552,071円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	128,692,258円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2024年 4月 2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	1,813,217,347	-	1,806,429,419	6,787,928
合計		1,813,217,347	-	1,806,429,419	6,787,928

## （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

（2024年 4月 2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	5,387,731,795	-	5,396,705,904	8,974,109
	アメリカドル	2,530,167,056	-	2,537,328,793	7,161,737
	カナダドル	221,593,551	-	221,957,320	363,769
	ユーロ	636,610,998	-	632,883,550	3,727,448
	イギリスポンド	116,349,003	-	115,890,850	458,153
	スウェーデンクローナ	10,619,172	-	10,550,273	68,899
	ポーランドズロチ	59,392,116	-	59,417,641	25,525
	ニュージーランドドル	25,038,584	-	25,000,995	37,589
	シンガポールドル	38,096,490	-	38,137,018	40,528



イスラエルシェケ ル	34,003,033	-	33,967,928	35,105
オフショア人民元 売建	1,715,861,792	-	1,721,571,536	5,709,744
メキシコペソ	771,093,268	-	770,204,948	888,320
ユーロ	110,468,778	-	110,662,787	194,009
ユーロ	493,093,622	-	492,631,103	462,519
イギリスポンド	82,330,051	-	82,050,461	279,590
ノルウェークロー ネ	58,406,985	-	58,050,410	356,575
デンマーククロー ネ	2,405,260	-	2,403,247	2,013
オーストラリアド ル	4,433,760	-	4,432,378	1,382
マレーシアリン ギット	19,954,812	-	19,974,562	19,750
合計	6,158,825,063	-	6,166,910,852	9,862,429

## (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S25】

## 【純資産額計算書】

(2024年 4月30日現在)

資産総額	39,562,553,297円
負債総額	29,877,955円
純資産総額( - )	39,532,675,342円
発行済口数	24,512,253,738口
1口当たり純資産額( / )	1.6128円
(1万口当たり純資産額)	(16,128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

(2024年 4月30日現在)

資産総額	664,407,568,076円
負債総額	1,685,013,900円
純資産総額( - )	662,722,554,176円
発行済口数	232,854,691,232口
1口当たり純資産額( / )	2.8461円
(1万口当たり純資産額)	(28,461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

(2024年 4月30日現在)

資産総額	668,863,681,995円
負債総額	5,027,393,880円
純資産総額( - )	663,836,288,115円
発行済口数	502,937,357,044口
1口当たり純資産額( / )	1.3199円
(1万口当たり純資産額)	(13,199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

(2024年 4月30日現在)

資産総額	739,755,953,631円
負債総額	524,583,645円
純資産総額( - )	739,231,369,986円
発行済口数	115,235,602,435口

1口当たり純資産額（ / ）	6.4150円
（1万口当たり純資産額）	（64,150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

（2024年 4月30日現在）

資産総額	341,401,655,264円
負債総額	123,334,215円
純資産総額（ - ）	341,278,321,049円
発行済口数	94,646,408,753口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6058円
（1万口当たり純資産額）	（36,058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ます。）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（2024年 4月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (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、各取締役に對して会日の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2024年 6月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年 4月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	533	15,018,346
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	62	213,458
単体型公社債投資信託	51	170,655
合計	646	15,402,460

## 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37期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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38期事業年度の中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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 ( 2022年3月31日 )	当事業年度 ( 2023年3月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 289	1 255
器具備品	1 687	1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179

	( 単位：百万円 )	
	前事業年度 ( 2022年3月31日 )	当事業年度 ( 2023年3月31日 )
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49

未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
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	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	509	510
評価・換算差額等合計	431	460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918



その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	-	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	-
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	-	565
その他	8	11

営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	-
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	-
特別損失合計	120	-
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

## （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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				株主資本合計
	利益準備金	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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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				株主資本合計
	利益準備金	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
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	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
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

## 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. 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）

#### 「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。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-21項に定める経過措置に従って、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。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

### （表示方法の変更）

#### （貸借対照表関係）

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額の重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

### （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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
建 物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	"	681	"
計	681	"	866	"

### （株主資本等変動計算書関係）

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

##### (2) 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
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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31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	当事業年度末
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

2023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
2023年6月22日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26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しております。

##### 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払い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。

## (4) 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。

## 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 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（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
資産計	-	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。

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	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)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
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	(10)	(48)	-	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(88)	-	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(\*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（貸借対照表計上額は960百万円）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貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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(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

当事業年度(2023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	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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(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

当事業年度(2023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	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

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 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	3,429	738	16

### （デリバティブ取引関係）

#### 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

前事業年度（2022年3月31日）

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）
為替予約取引				
売建				
米ドル	5,498	-	54	54
英ポンド	277	-	1	1
カナダドル	111	-	1	1
スイスフラン	139	-	2	2
香港ドル	190	-	1	1
ユーロ	676	-	18	18
買建				
ユーロ	21	-	0	0
合計	6,915	-	80	80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建 米ドル	152	-	3	3
合計		7,458	-	48	48

（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

前事業年度（2022年3月31日）

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。

当事業年度（2023年3月31日）

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	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
合計		12,378	-	10	10

（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

前事業年度（2022年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 関係会社株式	4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
合計			8,057	-	71

当事業年度（2023年3月31日）

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		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
	合計		5,082	-	88

## (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。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	-	6
退職給付の支払額	81	57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	820	911

## (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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	-	6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	274	142

## (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	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	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100百万円、当事業年度109百万円であります。

(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		当事業年度	
	(2022年3月31日)		(2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	"	187	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	"	277	"
税務上の収益認識差額	74	"	-	"
税務上の費用認識差額	439	"	412	"
繰延ヘッジ損益	224	"	225	"
その他	76	"	75	"
繰延税金資産 合計	1,357	"	1,236	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	415	"	21	"
その他	34	"	32	"
繰延税金負債 合計	450	"	54	"
繰延税金資産の純額	907	"	1,181	"

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。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(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 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あります。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	9,887百万円

## [ 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 ]

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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

- (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（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）

当事業年度（2023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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49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いません。

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601

##### 固定資産

有形固定資産	1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502

##### 投資その他の資産

投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213

固定資産合計 19,443

資産合計 77,045

## 負債の部

## 流動負債

未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	2	1,624

流動負債合計		11,124
--------	--	--------

## 固定負債

退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35

固定負債合計		1,121
--------	--	-------

負債合計		12,246
------	--	--------

(単位:百万円)

第38期中間会計期間末

(2023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		43,700
---------	--	--------

利益剰余金合計		46,300
---------	--	--------

株主資本合計		65,540
--------	--	--------

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		164
--------------	--	-----

繰延ヘッジ損益		906
---------	--	-----

評価・換算差額等合計		741
------------	--	-----

純資産合計		64,798
-------	--	--------

負債・純資産合計		77,045
----------	--	--------

## 中間損益計算書

(単位:百万円)

第38期中間会計期間

(自 2023年4月1日

至 2023年9月30日)

## 営業収益

委託者報酬		21,671
-------	--	--------

運用受託報酬		5,502
--------	--	-------

その他営業収益		178
---------	--	-----

営業収益合計		27,352
--------	--	--------

営業費用		16,664
------	--	--------

一般管理費	1	6,965
-------	---	-------

営業利益		3,722
営業外収益	2	1,680
営業外費用	3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

## 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
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	-	-	1,055	1,055	1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	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	49	510	460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純 額）	114	395	280	280
当中間期変動額合計	114	395	280	1,335
当中間期末残高	164	906	741	64,798

## 注記事項

（重要な会計方針）

第38期中間会計期間  
（自 2023年4月1日  
至 2023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。



## （表示方法の変更）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」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38期中間会計期間末 （2023年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	957百万円
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38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	91百万円
無形固定資産	972百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	1,589百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,269百万円
為替差損	784百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26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38期中間会計期間末（2023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)	1,206	13,995	-	15,201
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,137	-	4,137
資産計	1,206	18,133	-	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	-	339
通貨関連取引	-	(134)	-	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	-	205

(\*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1,041百万円）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16,243百万円です。

(\*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271百万円）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、短期差入証拠金、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。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価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38期中間会計期間末（2023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)

区 分	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	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	343
小計	1,426	1,769	343
合計	4,137	3,900	237

(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271百万円）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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	-	76	76
	英ポンド	267	-	1	1
	カナダドル	126	-	1	1
	スイスフラン	176	-	0	0
	香港ドル	214	-	2	2
	ユーロ	719	-	3	3
合計		7,449	-	84	84

(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	9,373	-	226	226
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	-	113	113
合計		13,239	-	339	339

(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		1,935	-	24
	英ポンド		3,612	-	23
	スイスフラン		22	-	0
	香港ドル		90	-	1
	ユーロ		51	-	0
合計			5,713	-	49

(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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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	5,057百万円

## 〔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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）  
該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	21,599,648円64銭
1株当たり中間純利益	770,782円86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38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
中間純利益	2,312百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,312百万円
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

2024年6月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2023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） （2023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。

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（2023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やSNS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。）、名称や利用上の注意事項等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**

2023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2023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

2023年12月11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 山田信之

## 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S25の2022年10月1日から2023年10月2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S25の2023年10月2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**

2023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 田中洋一

**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2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023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（2023年4月1日から2023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。

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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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

2024年6月11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 山田信之

## 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S25の2023年10月3日から2024年4月2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S25の2024年4月2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（2023年10月3日から2024年4月2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。