

## 【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5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】	S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

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

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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】

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

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

### （７）【申込期間】

2024年 6月 6日から2024年12月 5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。

ただし、2024年11月5日受付分からは午後3時半までとします。なお、販売会社により受付時限が異なる場合があります。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 >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

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

###### <信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

###### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

###### 属性区分表

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

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

(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、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

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

#### < 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

## [ 投資対象地域による区分 ]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## [ 独立した区分 ]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

## [ 補足分類 ]

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

## &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 ]

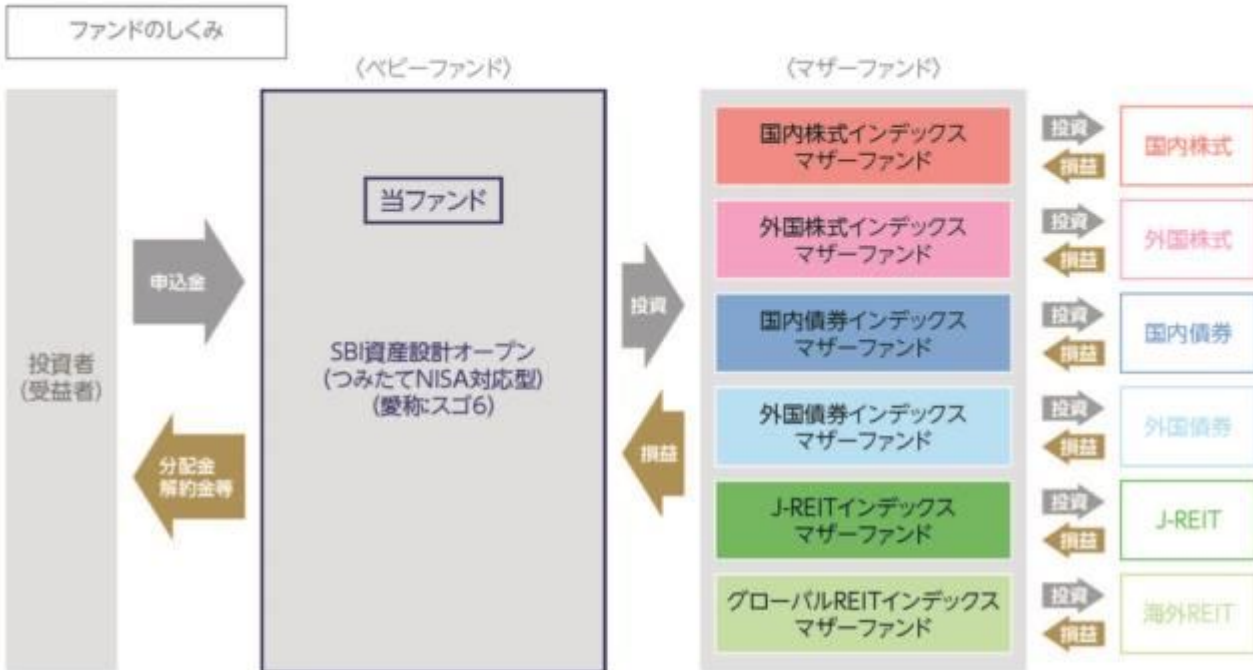
- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款に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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

## &lt;ファンドの特色&gt;

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。

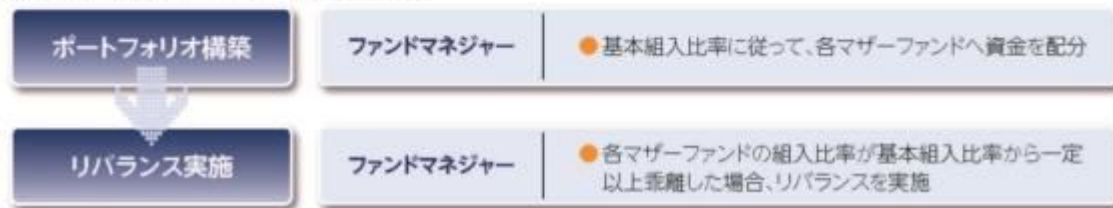


## ? ファミリーファンド方式とは

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

### ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

# 2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
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)
国内債券	NOMURA-BPI総合
外国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
J-REIT	東証REIT指数(配当込み)
海外REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)

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

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

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社J P X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J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」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J P Xが有します。J P X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、J P X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J P Xは責任を負いません。

「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。

「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。

「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。

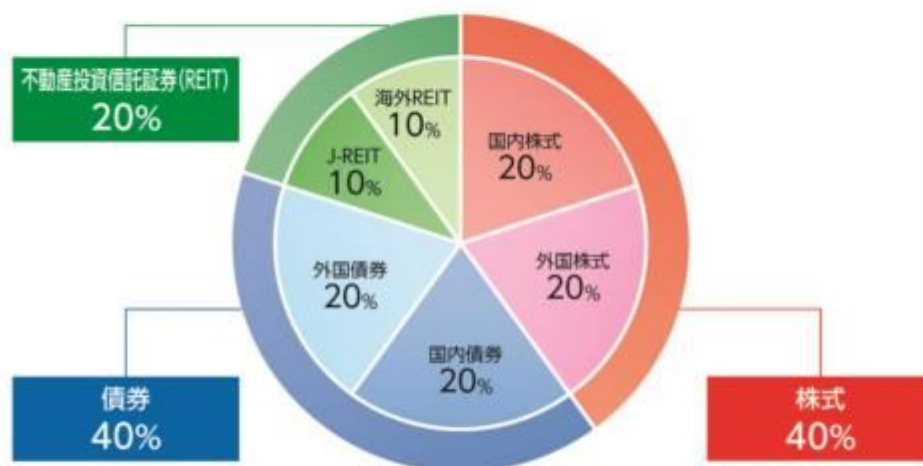
「東証REIT指数」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X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J P Xは責任を負いません。

「S&P先進国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's<sup>(R)</sup>及びS&P<sup>(R)</sup>は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>(R)</sup>はDow

Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。

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

#### 基本組入比率



- 組入比率には一定の変動許容幅を設けます。

### 4. ノーロードファンドです。

- 購入時手数料が無料のノーロードファンドです。  
(運用管理費用(信託報酬)は純資産総額に対して年率0.55%(税抜0.5%)です。)

#### 分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### 主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%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65%以下とします。

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

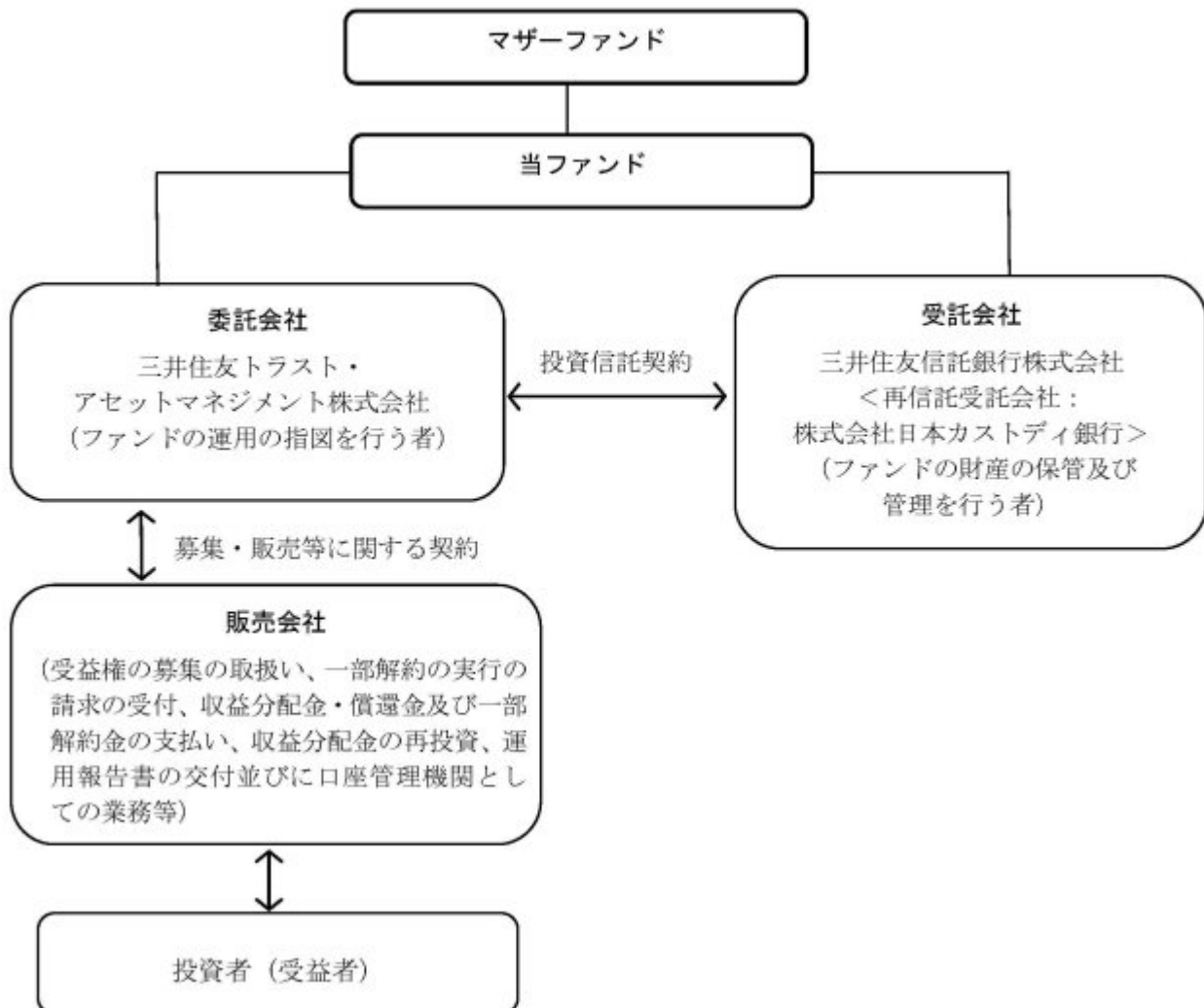
## (2) 【ファンドの沿革】

2017年12月19日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (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 3月29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】

#### 基本方針

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

#### 投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式及び不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。
- ロ．各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。また、各マザーファンドは、インデック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。

マザーファンド受益証券	インデックス	基本組入比率
国内債券インデックス マザーファンド受益証券	NOMURA-BPI総合	20%
国内株式インデックス マザーファンド受益証券	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）	20%
外国債券インデックス マザーファンド受益証券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）	20%
外国株式インデックス マザーファンド受益証券	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）	20%
J-REITインデックス マザーファンド受益証券	東証REIT指数（配当込み）	10%
グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）	10%

- ハ．各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ニ．実質組入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。
- ホ．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の70%以下とします。
- ヘ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### (2)【投資対象】

## 投資の対象とする資産の種類

当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。

イ.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。）

1. 有価証券
2. 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22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
3. 金銭債権
4. 約束手形

ロ.次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

### 有価証券の指図範囲

委託会社は、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親投資信託「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバルREITインデックス マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証券
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又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。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国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又は外国投資証券（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又は証書（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す。）
  20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又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号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

#### (参考)マザーファンドの概要

##### 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

###### 1. 基本方針

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

###### 2. 運用方法

###### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

###### (2)投資態度

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、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並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、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、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及び金利に係るオプション取引並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及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、スワップ取引及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、並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号及び第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。

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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（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、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並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、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、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。

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

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、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並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及び金利に係るオプション取引並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及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並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及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行

うことができます。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及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並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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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、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及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、及び通貨に係る選択権取引並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、及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並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。

新株引受権証券及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並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及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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしがた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。

## 「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、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、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

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

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

## 「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）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。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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。

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### (5) 【投資制限】

## <約款に定める投資制限>

### イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

### ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。

### ハ．外貨建資産への投資割合

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

## 二．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等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、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

## ホ．信用取引の指図範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売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、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができます。

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、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。

1. 投資信託財産に属する株券及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及び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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）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及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

## ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、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、わが国の金融商品取引所等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。）及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。）並び



に委託会社が適当と認める外国の金融商品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します。（以下同じ。）

（ロ）委託会社は、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、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。

（ハ）委託会社は、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、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品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。

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及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、又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。）を行うことを指図することができます。

（ロ）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、原則として信託期間を超えないものとしします。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。

（ハ）スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとしします。

（ニ）委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

#### チ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。

（ロ）金利先渡取引及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信託期間を超えないものとしします。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。

（ハ）金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとしします。

（ニ）委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

a.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します。

b.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します。

（ロ）上記（イ）a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとしします。

(八) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた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、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 上記(イ)の売付の指図は、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。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の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を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

#### ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

(ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、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。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の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を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、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。

(ロ) 上記(イ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### カ．資金の借入れ

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並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、又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。

(ロ) 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又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、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

(八) 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。

(二) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

タ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）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。

#### < 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】

#### (1) 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、投資者の皆様は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。

##### リートの価格変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 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。

#### 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。

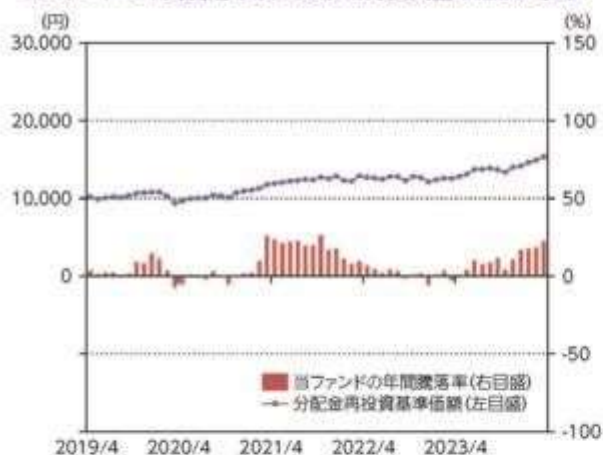
## (2) リスクの管理体制

### 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4月～2024年3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が算出、公表する指数で、日本の株式市場を正確に把握するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は権利は、株式会社JPXが算出又は株式会社JPXが算出の関連会社(以下「JPX」という)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利、ノウハウ及び同指数に係る権利又は権利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コフサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコフ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象徴する投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに際し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの権限、販売あるいは販売促進を行っていません。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 AmiLオンカインド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ハイブリッドインデックス	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

ありません。

## （２）【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。

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

## （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 0.55%（税抜 0.5%）

（ ）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 0.22% ( 税抜 0.2% )	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 0.275% ( 税抜 0.25% )	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 0.055% ( 税抜 0.05% )	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6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に相当する額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

## （４）【その他の手数料等】

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

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。

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。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示していません。

#### （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。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（原則として配当控除の適用が可能です。）のいずれかを選択することもできます。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定  
の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当  
所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入す  
るなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」及び「つみたて投資枠（特定累積  
投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会  
社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

ら控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2024年3月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

（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 <sup>①</sup>	その他費用の比率 <sup>②</sup>
0.58%	0.56%	0.02%

※対象期間は2022年9月6日～2023年9月5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3月29日現在の状況について記載してあります。

### 【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

#### （1）【投資状況】



資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	407,648,490	97.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,487,075	2.97
合計(純資産総額)		420,135,565	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	32,167,249	2.4170	77,748,241	2.8717	92,374,688	21.99
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	14,579,853	5.2849	77,054,322	6.3305	92,297,759	21.97
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	22,340,720	3.3163	74,089,026	3.5389	79,061,574	18.82
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	47,155,733	1.3386	63,127,376	1.3351	62,957,619	14.99
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	14,988,285	2.6214	39,290,658	2.9276	43,879,703	10.44
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	17,591,283	2.1677	38,134,289	2.1077	37,077,147	8.83

(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	97.03
合計	97.03

(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1期計算期間末	(2018年 9月 5日)	41,839,685	41,839,685	9,973	9,973
第2期計算期間末	(2019年 9月 5日)	87,957,030	87,957,030	10,188	10,188
第3期計算期間末	(2020年 9月 7日)	147,615,298	147,615,298	10,379	10,379
第4期計算期間末	(2021年 9月 6日)	222,181,297	222,181,297	12,585	12,585
第5期計算期間末	(2022年 9月 5日)	283,583,211	283,583,211	12,712	12,712

第6期計算期間末	(2023年 9月 5日)	368,251,589	368,251,589	13,954	13,954
	2023年 3月末日	310,875,000		12,548	
	4月末日	321,104,436		12,796	
	5月末日	332,077,478		13,104	
	6月末日	351,929,650		13,725	
	7月末日	356,928,946		13,742	
	8月末日	364,050,845		13,896	
	9月末日	362,406,995		13,681	
	10月末日	356,508,418		13,345	
	11月末日	378,044,125		14,011	
	12月末日	377,021,760		14,157	
	2024年 1月末日	391,087,610		14,595	
	2月末日	407,000,837		14,911	
	3月末日	420,135,565		15,354	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	0
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	0
第3期計算期間	2019年 9月 6日～2020年 9月 7日	0
第4期計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	0
第5期計算期間	2021年 9月 7日～2022年 9月 5日	0
第6期計算期間	2022年 9月 6日～2023年 9月 5日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	0.3
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	2.2
第3期計算期間	2019年 9月 6日～2020年 9月 7日	1.9
第4期計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	21.3
第5期計算期間	2021年 9月 7日～2022年 9月 5日	1.0
第6期計算期間	2022年 9月 6日～2023年 9月 5日	9.8
第7期中間計算期間	2023年 9月 6日～2024年 3月 5日	7.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年12月19日～2018年 9月 5日	44,509,649	2,557,562	41,952,087
第2期計算期間	2018年 9月 6日～2019年 9月 5日	54,949,184	10,565,823	86,335,448
第3期計算期間	2019年 9月 6日～2020年 9月 7日	68,964,944	13,069,234	142,231,158
第4期計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	56,921,923	22,602,543	176,550,538
第5期計算期間	2021年 9月 7日～2022年 9月 5日	57,198,326	10,669,877	223,078,987

第6期計算期間	2022年 9月 6日～2023年 9月 5日	54,268,074	13,437,475	263,909,586
第7期中間計算期間	2023年 9月 6日～2024年 3月 5日	35,416,229	24,045,466	275,280,349

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	567,540,936,640	84.69
地方債証券	日本	33,311,138,853	4.97
特殊債券	日本	37,216,286,674	5.55
	国際機関	299,343,000	0.04
	小計	37,515,629,674	5.60
社債券	日本	29,236,699,000	4.36
	フランス	1,495,907,000	0.22
	韓国	99,638,000	0.01
	小計	30,832,244,000	4.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		900,453,012	0.13
合計(純資産総額)		670,100,402,179	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	100.04	6,583,158,400	0.100	2025/6/20	0.98
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	99.31	6,524,864,100	0.100	2028/3/20	0.97
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	98.77	6,084,232,000	0.500	2033/3/20	0.91
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	6,030,000,000	99.96	6,027,768,800	99.32	5,989,478,400	0.005	2027/6/20	0.89
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	5,970,000,000	100.15	5,978,955,000	99.61	5,946,896,100	0.005	2026/6/20	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	99.79	5,887,610,000	0.100	2026/9/20	0.88
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	100.41	5,884,260,400	0.400	2025/6/20	0.88
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	5,800,000,000	98.94	5,739,098,400	98.86	5,734,112,000	0.600	2033/12/20	0.86
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	99.70	5,733,037,500	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	99.55	5,654,837,600	0.005	2026/9/20	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	97.21	5,599,699,200	0.200	2032/3/20	0.84

日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	5,630,000,000	98.42	5,541,226,200	97.71	5,501,410,800	0.100	2030/12/20	0.82
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,600,000,000	97.90	5,482,736,000	96.94	5,428,864,000	0.100	2031/9/20	0.81
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	101.02	5,374,370,400	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	96.73	5,368,848,000	0.200	2032/9/20	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	97.92	5,317,164,600	0.100	2030/9/20	0.79
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	99.49	5,283,396,900	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	99.44	5,131,465,200	0.100	2027/12/20	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	96.98	5,120,544,000	0.200	2032/6/20	0.76
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	5,160,000,000	100.68	5,195,152,400	99.00	5,108,761,200	0.500	2032/12/20	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	99.55	5,067,196,800	0.100	2027/9/20	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	100.26	5,033,353,200	0.300	2025/12/20	0.75
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	99.67	5,023,670,400	0.005	2026/3/20	0.75
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	100.01	5,020,702,800	0.100	2025/9/20	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	97.65	4,980,405,000	0.400	2033/6/20	0.74
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,120,000,000	98.19	5,027,328,000	97.21	4,977,254,400	0.100	2031/6/20	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	96.66	4,907,783,590	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	99.75	4,868,092,800	0.100	2026/12/20	0.73
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	99.22	4,797,673,800	0.100	2028/6/20	0.72
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	99.92	4,796,256,000	0.100	2025/12/20	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	84.69
地方債証券	4.97
特殊債券	5.60
社債券	4.60
合計	99.87

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 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	662,742,852,480	98.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,125,463,403	1.80
合計(純資産総額)		674,868,315,883	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	11,689,400,000	1.73

(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	9,297,500	1,949.30	18,123,616,750	3,792.00	35,256,120,000	5.22
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,155,900	937.25	9,518,617,275	1,557.00	15,812,736,300	2.34
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,197,800	13,269.36	15,894,039,408	12,985.00	15,553,433,000	2.30
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	358,400	19,788.63	7,092,244,992	39,570.00	14,181,888,000	2.10
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,440,000	2,005.56	6,899,126,400	3,487.00	11,995,280,000	1.78
日本	株式	キーエンス	電気機器	169,400	68,425.93	11,591,352,542	69,540.00	11,780,076,000	1.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	821,900	8,178.23	6,721,687,237	13,905.00	11,428,519,500	1.69
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,185,700	5,692.47	6,749,561,679	8,909.00	10,563,401,300	1.57
日本	株式	信越化学工業	化学	1,521,000	4,422.30	6,726,318,300	6,584.00	10,014,264,000	1.48
日本	株式	三井物産	卸売業	1,343,300	4,709.00	6,325,599,700	7,106.00	9,545,489,800	1.41
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	50,514,600	163.02	8,234,890,092	179.80	9,082,525,080	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	1,069,000	5,934.04	6,343,488,760	8,196.00	8,761,524,000	1.30
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,288,700	4,457.15	5,743,929,205	6,707.00	8,643,310,900	1.28
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,204,300	5,002.25	6,024,209,675	6,466.00	7,787,003,800	1.15
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,648,400	3,122.76	5,147,557,584	4,703.00	7,752,425,200	1.15
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,016,500	1,347.78	5,413,358,370	1,891.00	7,595,201,500	1.13
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	837,700	5,568.12	4,664,414,124	8,962.00	7,507,467,400	1.11
日本	株式	第一三共	医薬品	1,479,400	4,532.60	6,705,528,440	4,777.00	7,067,093,800	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,251,000	2,087.53	4,699,030,030	3,046.00	6,856,546,000	1.02
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,503,000	4,530.99	6,810,077,970	4,184.00	6,288,552,000	0.93

日本	株式	HOYA	精密機器	333,300	17,139.04	5,712,442,032	18,740.00	6,246,042,000	0.93
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,312,300	4,361.40	5,723,465,220	4,482.00	5,881,728,600	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,733,500	1,517.14	4,147,102,190	1,951.00	5,333,058,500	0.79
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,903,400	1,826.03	3,475,665,502	2,512.00	4,781,340,800	0.71
日本	株式	ディスコ	機械	82,300	20,724.82	1,705,652,686	57,190.00	4,706,737,000	0.70
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	921,200	5,369.65	4,946,521,580	4,849.00	4,466,898,800	0.66
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,540,600	2,752.52	4,240,532,312	2,824.00	4,350,654,400	0.64
日本	株式	S M C	機械	51,200	74,502.90	3,814,548,480	84,830.00	4,343,296,000	0.64
日本	株式	三菱重工業	機械	2,991,000	618.68	1,850,492,817	1,448.50	4,332,463,500	0.64
日本	株式	ダイキン工業	機械	204,200	26,672.84	5,446,593,928	20,600.00	4,206,520,000	0.62

(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	0.33
		建設業	2.05
		食料品	3.03
		繊維製品	0.35
		パルプ・紙	0.17
		化学	5.61
		医薬品	4.19
		石油・石炭製品	0.51
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.68
		鉄鋼	0.92
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.51
		機械	5.52
		電気機器	17.09
		輸送用機器	9.33
		精密機器	2.17
		その他製品	2.24
		電気・ガス業	1.36
		陸運業	2.45
		海運業	0.69
		空運業	0.40
倉庫・運輸関連業	0.13		
情報・通信業	7.12		
卸売業	7.28		
小売業	4.15		

	銀行業	7.27
	証券、商品先物取引業	0.91
	保険業	2.67
	その他金融業	1.17
	不動産業	2.10
	サービス業	4.35
	小計	98.20
合計		98.20

(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	422円		11,570,873,400	11,689,400,000	1.73

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

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

#### 外国債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	154,498,574,729	46.36
	中国	29,718,902,103	8.92
	フランス	26,029,119,170	7.81
	イタリア	23,745,876,092	7.13
	ドイツ	20,444,341,110	6.13
	イギリス	16,964,326,313	5.09
	スペイン	15,887,401,015	4.77
	カナダ	6,733,320,794	2.02
	ベルギー	5,771,693,815	1.73
	オランダ	4,890,319,366	1.47
	オーストラリア	4,464,220,653	1.34
	オーストリア	3,945,907,969	1.18
	メキシコ	2,870,507,316	0.86
	ポーランド	1,818,057,885	0.55
	フィンランド	1,722,661,280	0.52
	アイルランド	1,686,273,110	0.51
	マレーシア	1,609,572,076	0.48
	シンガポール	1,362,707,119	0.41

	イスラエル	1,097,287,651	0.33
	デンマーク	881,551,038	0.26
	ニュージーランド	819,569,650	0.25
	スウェーデン	631,824,081	0.19
	ノルウェー	518,563,905	0.16
	小計	328,112,578,240	98.45
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,155,675,118	1.55
合計（純資産総額）		333,268,253,358	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	948,484,317	0.28
	買建	ドイツ	865,932,698	0.26

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建		5,383,280,723	1.62
	売建		771,054,208	0.23

(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	15,236.58	2,155,976,539	15,205.17	2,151,531,809	4.375	2028/8/31	0.65
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	14,000,000	15,340.94	2,147,732,733	15,040.15	2,105,622,192	4.125	2032/11/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	14,438.26	1,967,934,972	14,186.70	1,933,647,622	3.375	2033/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	13,903.98	1,793,613,458	13,582.54	1,752,147,860	2.750	2032/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,208.58	1,660,983,759	14,250.57	1,665,892,701	2.375	2027/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	11,150,000	14,731.46	1,642,557,905	14,788.49	1,648,917,593	3.000	2025/7/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	14,366.96	1,609,100,237	14,342.54	1,606,365,460	3.500	2033/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,514.82	1,574,365,526	12,370.37	1,556,193,105	1.375	2031/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,975.24	1,505,133,664	14,233.13	1,532,908,252	1.625	2026/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	15,134.10	1,513,410,994	15,120.59	1,512,059,508	4.500	2026/7/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	14,632.40	1,492,505,483	14,798.25	1,509,422,256	3.125	2025/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,997.30	1,523,284,319	12,791.48	1,499,161,867	1.875	2032/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	12,115.46	1,447,797,647	12,128.76	1,449,387,902	0.625	2030/8/15	0.43



アメリカ	国債証券	T 4.625%	10/15/26	9,520,000	15,363.33	1,462,589,260	15,186.54	1,445,758,727	4.625	2026/10/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875%	05/15/28	10,060,000	14,402.61	1,448,903,509	14,331.31	1,441,729,926	2.875	2028/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875%	05/15/32	10,100,000	14,071.66	1,421,238,354	13,749.92	1,388,741,983	2.875	2032/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.125%	08/31/30	9,200,000	14,445.42	1,328,979,326	15,047.55	1,384,374,743	4.125	2030/8/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.875%	11/15/30	11,150,000	12,307.68	1,372,306,450	12,258.88	1,366,865,903	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75%	04/30/26	9,500,000	13,699.64	1,301,466,541	13,990.04	1,329,054,512	0.750	2026/4/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875%	11/30/25	9,000,000	14,501.38	1,305,124,865	14,688.54	1,321,968,994	2.875	2025/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.625%	02/15/53	9,550,000	14,285.08	1,364,225,664	13,299.23	1,270,077,359	3.625	2053/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.625%	12/31/27	9,600,000	13,010.90	1,249,047,336	13,217.02	1,268,834,729	0.625	2027/12/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25%	09/30/28	9,500,000	13,182.42	1,252,330,738	13,288.00	1,262,360,177	1.250	2028/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875%	05/15/52	10,800,000	11,835.95	1,278,283,306	11,461.02	1,237,790,936	2.875	2052/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.125%	11/15/28	8,400,000	14,526.78	1,220,249,854	14,424.16	1,211,630,136	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.875%	11/30/29	8,130,000	15,009.85	1,220,301,248	14,871.30	1,209,036,765	3.875	2029/11/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.875%	08/15/33	8,170,000	14,912.83	1,218,378,737	14,742.36	1,204,451,296	3.875	2033/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25%	06/30/28	9,000,000	13,216.08	1,189,447,653	13,371.09	1,203,398,993	1.250	2028/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.875%	08/15/28	8,220,000	14,167.28	1,164,550,650	14,299.96	1,175,457,097	2.875	2028/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.375%	12/31/28	8,680,000	13,265.31	1,151,429,037	13,286.22	1,153,244,546	1.375	2028/12/31	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	98.45
合計	98.45

(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	25	アメリカドル	2,676,952.91	405,317,440	2,675,390.75	405,080,913	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	15	アメリカドル	1,661,995.17	251,642,689	1,661,953.2	251,636,334	0.08
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	16	アメリカドル	1,919,607.3	290,647,741	1,927,000	291,767,070	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	9	ユーロ	951,333.9	155,295,746	951,300	155,290,212	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	12	ユーロ	1,417,645.2	231,416,402	1,419,000	231,637,560	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	22	ユーロ	2,928,956.2	478,122,810	2,934,360	479,004,926	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	16,736,000.00	2,530,167,056	2,529,781,093	0.76
	カナダドル	買建	1,987,000.00	221,593,551	221,836,775	0.07
	ユーロ	買建	3,890,000.00	636,610,998	633,571,691	0.19
	イギリスポンド	買建	610,000.00	116,349,003	116,296,500	0.03
	スウェーデンクローナ	買建	750,000.00	10,605,000	10,606,650	0.00
	ポーランドズロチ	買建	1,566,000.00	59,392,116	59,328,849	0.02
	ニュージーランドドル	買建	277,000.00	25,038,584	25,047,725	0.01
	シンガポールドル	買建	340,000.00	38,096,490	38,097,204	0.01
	イスラエルシェケル	買建	826,000.00	34,003,033	33,992,956	0.01
	オフショア人民元	買建	82,400,000.00	1,715,861,792	1,714,721,280	0.51
	メキシコペソ	売建	12,118,000.00	110,468,778	110,291,977	0.03
	ユーロ	売建	3,023,000.00	493,093,622	493,181,591	0.15
	イギリスポンド	売建	431,000.00	82,330,051	82,351,170	0.02
	ノルウェークローネ	売建	4,195,000.00	58,406,985	58,438,867	0.02
	デンマーククローネ	売建	110,000.00	2,405,260	2,405,601	0.00
	オーストラリアドル	売建	45,000.00	4,433,760	4,434,565	0.00
	マレーシアリングット	売建	625,000.00	19,954,812	19,950,437	0.01

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

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

## 外国株式インデックス 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	508,343,751,082	69.66
	イギリス	26,720,308,792	3.66
	カナダ	23,684,530,877	3.25
	フランス	21,684,348,542	2.97
	スイス	20,981,676,086	2.88
	ドイツ	17,086,928,201	2.34
	オランダ	14,511,179,571	1.99
	アイルランド	13,342,313,073	1.83
	オーストラリア	12,965,647,949	1.78
	デンマーク	7,192,370,987	0.99
	スウェーデン	6,058,383,988	0.83
	スペイン	5,081,170,725	0.70
	イタリア	3,963,393,293	0.54
	香港	2,672,923,387	0.37
	シンガポール	2,046,872,772	0.28
	フィンランド	1,886,487,809	0.26

	ジャージー	1,744,686,586	0.24
	ベルギー	1,477,264,543	0.20
	イスラエル	1,454,570,974	0.20
	ノルウェー	1,165,841,810	0.16
	キュラソー	915,247,781	0.13
	バミューダ	909,248,358	0.12
	ケイマン	832,220,852	0.11
	ニュージーランド	505,459,045	0.07
	ルクセンブルク	397,537,725	0.05
	リベリア	387,884,453	0.05
	オーストリア	362,394,830	0.05
	ポルトガル	303,618,317	0.04
	パナマ	177,660,769	0.02
	マン島	75,675,242	0.01
	小計	698,931,598,419	95.77
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	69,073,238	0.01
	香港	55,620,873	0.01
	小計	124,694,111	0.02
投資証券	アメリカ	11,481,070,226	1.57
	オーストラリア	952,958,463	0.13
	フランス	281,767,135	0.04
	シンガポール	241,306,194	0.03
	イギリス	205,878,971	0.03
	香港	108,617,017	0.01
	カナダ	57,391,729	0.01
	ベルギー	55,779,833	0.01
	小計	13,384,769,568	1.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,351,958,806	2.38
合計(純資産総額)		729,793,020,904	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	12,578,843,765	1.72
	買建	カナダ	479,942,188	0.07
	買建	ドイツ	2,205,269,644	0.30
	買建	イギリス	1,023,401,791	0.14
	買建	オーストラリア	686,042,096	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		423,745,840	0.06
	売建		60,525,520	0.01

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	545,058	50,442.24	27,493,947,267	63,701.21	34,720,856,954	4.76
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	26,543.68	30,098,523,851	25,963.78	29,440,960,983	4.03
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	190,578	59,227.04	11,287,372,677	136,808.01	26,072,598,759	3.57
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	717,541	18,263.07	13,104,504,524	27,311.33	19,597,003,201	2.69
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	171,346	39,940.44	6,843,635,301	73,521.66	12,597,643,691	1.73
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	456,849	18,877.79	8,624,303,504	22,852.31	10,440,055,565	1.43
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	397,755	18,983.78	7,550,895,721	23,053.68	9,169,719,114	1.26
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	65,368.23	4,067,473,322	117,790.92	7,329,422,430	1.00
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	34,367	120,209.93	4,131,254,954	200,680.32	6,896,780,836	0.95
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	222,518	20,747.71	4,616,739,445	30,327.42	6,748,397,511	0.92
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	101,297	48,767.55	4,940,007,102	63,670.93	6,449,674,520	0.88
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	221,215	29,544.64	6,535,718,184	26,616.36	5,887,938,940	0.81
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	307,151	15,902.59	4,884,497,127	17,599.89	5,405,826,393	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	71,401	73,165.85	5,224,115,163	74,902.52	5,348,115,330	0.73
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	122,188	34,086.93	4,165,014,206	42,255.50	5,163,115,376	0.71
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	12,515.90	3,166,886,059	19,282.84	4,879,118,734	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	64,870	56,646.97	3,674,689,242	72,914.51	4,729,964,504	0.65

オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,092	110,670.19	3,440,957,560	145,642.72	4,528,323,699	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	77,067	44,285.26	3,412,932,719	58,080.87	4,476,118,871	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	181,466	22,057.40	4,002,669,745	24,566.27	4,457,943,205	0.61
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	23,347.42	4,327,281,235	23,951.54	4,439,251,742	0.61
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	16,774.71	3,281,435,984	19,978.54	3,908,163,896	0.54
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	34,237	77,220.61	2,643,802,165	110,927.50	3,797,825,102	0.52
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	136,294	20,882.46	2,846,154,985	27,571.76	3,757,865,594	0.51
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	124,711	19,059.49	2,376,928,157	27,327.99	3,408,101,073	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	74,662	32,540.86	2,429,565,777	45,601.66	3,404,711,423	0.47
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	205,438	18,723.07	3,846,432,109	16,078.34	3,303,102,013	0.45
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	138,024	23,306.54	3,216,862,056	23,883.41	3,296,484,251	0.45
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	347,772	7,421.77	2,581,084,839	9,110.33	3,168,321,058	0.43
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	549,785	4,277.60	2,351,763,643	5,741.46	3,156,572,545	0.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.58
		素材	3.76
		資本財	6.99
		商業・専門サービス	1.57
		運輸	1.70
		自動車・自動車部品	1.60
		耐久消費財・アパレル	1.47
		消費者サービス	1.99
		メディア・娯楽	6.22
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.85
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.18
		家庭用品・パーソナル用品	1.57

	ヘルスケア機器・サービス	4.20
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.78
	銀行	5.42
	金融サービス	6.65
	保険	3.04
	エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.04
	ソフトウェア・サービス	9.95
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.48
	電気通信サービス	1.08
	公益事業	2.45
	半導体・半導体製造装置	8.20
	不動産管理・開発	0.31
	小計	95.77
新株予約権証券		
投資信託受益証券		0.02
投資証券		1.83
合計		97.62

(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	313	アメリカドル	81,324,949.8	12,313,410,649	83,078,025	12,578,843,765	1.72
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	16	カナダドル	4,222,812	472,152,609	4,292,480	479,942,188	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	37	スイスフラン	4,269,999	717,018,232	4,304,950	722,887,204	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	180	ユーロ	8,825,281	1,440,638,870	9,081,000	1,482,382,440	0.20
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	35	オーストラリアドル	6,746,520	665,274,337	6,957,125	686,042,096	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	67	イギリスポンド	5,171,161.25	988,829,454	5,351,960	1,023,401,791	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	2,800,000.00	423,948,000	423,745,840	0.06

	アメリカドル	売建	400,000.00	60,512,000	60,525,520	0.01
--	--------	----	------------	------------	------------	------

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

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

## J - R E I T インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	117,365,336,300	95.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,925,618,489	4.03
合計(純資産総額)		122,290,954,789	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	4,907,928,000	4.01

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

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	13,331	607,230.62	8,094,991,398	598,000	7,971,938,000	6.52
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,738	562,646.21	6,604,341,307	538,000	6,315,044,000	5.16
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	36,954	165,980.91	6,133,658,608	150,300	5,554,186,200	4.54
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	19,907	274,347.22	5,461,430,186	269,000	5,354,983,000	4.38
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	32,886	160,938.6	5,292,626,942	158,700	5,219,008,200	4.27
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	54,775	97,856.14	5,360,070,273	94,700	5,187,192,500	4.24
日本	投資証券	GLP投資法人	38,385	136,124.28	5,225,130,727	125,600	4,821,156,000	3.94
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	17,225	270,649.96	4,661,945,608	258,800	4,457,830,000	3.65
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	25,563	149,563.07	3,823,280,824	153,200	3,916,251,600	3.20
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	55,329	57,273.68	3,168,895,869	68,000	3,762,372,000	3.08
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,212	324,567.12	3,639,046,561	334,000	3,744,808,000	3.06
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	22,769	170,423.05	3,880,362,431	164,400	3,743,223,600	3.06
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	38,254	67,103.44	2,566,975,353	79,700	3,048,843,800	2.49
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	20,815	133,957.21	2,788,319,407	135,600	2,822,514,000	2.31
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	34,339	78,124.62	2,682,721,471	80,500	2,764,289,500	2.26
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,815	347,037.23	2,712,095,970	332,000	2,594,580,000	2.12
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,946	607,281.36	2,396,332,273	645,000	2,545,170,000	2.08

日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,995	399,616.68	2,395,702,005	408,500	2,448,957,500	2.00
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,608	149,843.37	2,188,912,044	154,100	2,251,092,800	1.84
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,753	466,109.51	2,215,418,523	451,000	2,143,603,000	1.75
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,294	283,931.82	2,070,998,744	274,100	1,999,285,400	1.63
日本	投資証券	イオンリート投資法人	14,018	142,465.63	1,997,083,203	139,300	1,952,707,400	1.60
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,240	451,202.7	1,913,099,471	454,500	1,927,080,000	1.58
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,438	138,758.93	1,864,642,621	136,900	1,839,662,200	1.50
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,619	316,985.6	1,781,142,112	325,500	1,828,984,500	1.50
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,828	108,697.91	1,829,168,519	105,400	1,773,671,200	1.45
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	10,692	150,846.17	1,612,847,334	153,900	1,645,498,800	1.35
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	22,027	73,098.02	1,610,130,236	72,200	1,590,349,400	1.30
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,946	376,836.26	1,486,995,914	383,000	1,511,318,000	1.24
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	11,586	127,712.08	1,479,672,251	122,700	1,421,602,200	1.16

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	95.97
合計	95.97

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	通貨	帳簿価額(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,748	円	4,659,777,480	4,907,928,000	4.01

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

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

#### グローバルREITインデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	88,587,603,605	76.88
	オーストラリア	8,754,955,696	7.60
	イギリス	5,451,668,933	4.73
	シンガポール	3,685,867,763	3.20
	フランス	2,027,278,278	1.76
	カナダ	1,694,864,780	1.47
	ベルギー	1,200,149,393	1.04



香港	1,021,686,491	0.89
スペイン	471,196,592	0.41
ニュージーランド	339,163,797	0.29
ガーンジー	332,472,065	0.29
韓国	216,070,705	0.19
オランダ	206,976,512	0.18
イスラエル	131,488,912	0.11
アイルランド	45,397,044	0.04
ドイツ	41,433,577	0.04
イタリア	8,373,105	0.01
小計	114,216,647,248	99.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	1,006,191,079	0.87
合計(純資産総額)	115,222,838,327	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		70,288,862	0.06

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	513,056	15,679.38	8,044,404,002	19,716.61	10,115,725,163	8.78
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	52,151	114,785.04	5,986,154,993	124,963.21	6,516,956,641	5.66
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	306,360	12,818.37	3,927,036,018	14,147.75	4,334,304,813	3.76
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	180,443	17,254.68	3,113,486,873	23,694.15	4,275,443,671	3.71
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	87,516	37,375.55	3,270,959,377	43,917.98	3,843,526,340	3.34
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	460,323	7,611.38	3,503,693,598	8,191.28	3,770,635,044	3.27
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	167,464	19,342.62	3,239,193,772	21,809.09	3,652,238,520	3.17
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	953,707	2,219.71	2,116,954,014	3,334.00	3,179,663,048	2.76
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	116,631	17,922.40	2,090,307,632	22,257.26	2,595,887,657	2.25
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	571,213	4,265.21	2,436,348,940	4,510.50	2,576,458,464	2.24
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	78,564	25,199.16	1,979,747,302	28,095.63	2,207,305,830	1.92
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	161,311	8,925.61	1,439,800,607	12,144.59	1,959,056,941	1.70
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	190,924	8,139.80	1,554,083,481	9,555.48	1,824,371,437	1.58
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	317,636	4,727.02	1,501,471,788	5,391.71	1,712,601,229	1.49
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	87,175	14,393.91	1,254,789,912	19,518.26	1,701,504,586	1.48
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	222,165	6,377.38	1,416,832,671	6,592.39	1,464,598,635	1.27

アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	68,647	17,340.98	1,190,406,755	19,468.29	1,336,440,239	1.16
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	35,839	31,537.83	1,130,284,331	37,066.68	1,328,432,820	1.15
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,157	18,160.04	1,183,253,918	19,922.52	1,298,092,144	1.13
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	740,136	1,502.12	1,111,775,343	1,728.24	1,279,137,346	1.11
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	393,931	2,470.81	973,330,660	3,131.15	1,233,460,517	1.07
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	394,542	2,402.49	947,884,661	2,838.93	1,120,080,079	0.97
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	372,317	2,681.71	998,447,518	2,969.15	1,105,465,058	0.96
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	121,890	8,226.10	1,002,679,975	8,545.58	1,041,620,795	0.90
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	148,838	6,811.93	1,013,874,916	6,975.45	1,038,213,322	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	103,898	9,840.13	1,022,370,440	9,750.80	1,013,089,034	0.88
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	177,285	5,220.61	925,537,050	5,568.85	987,275,310	0.86
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,893,163	253.42	733,207,645	334.28	967,149,384	0.84
アメリカ	投資証券	UDR INC	168,680	4,843.60	817,019,444	5,664.24	955,445,370	0.83
香港	投資証券	LINK REIT	1,418,800	764.12	1,084,138,280	650.79	923,342,271	0.80

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.13
合計	99.13

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	230,000.00	34,824,300	34,807,694	0.03
	オーストラリアドル	買建	360,000.00	35,568,720	35,481,168	0.03

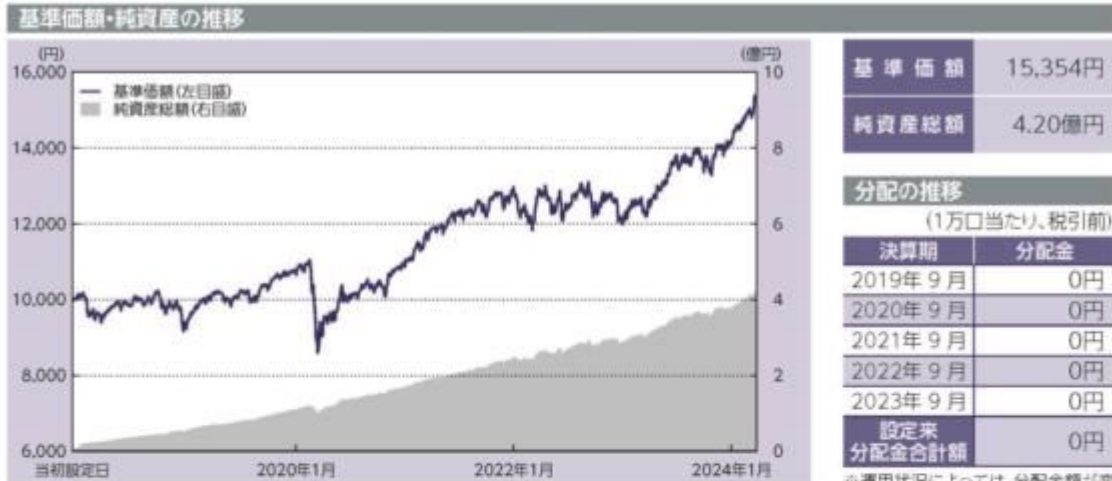
(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

 当初設定日：2017年12月19日  
 作成基準日：2024年3月29日


※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式 インデックス マザーファンド	22.0%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
外国株式 インデックス マザーファンド	22.0%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.0%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.9%
外国債券 インデックス マザーファンド	18.8%	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%
国内債券 インデックス マザーファンド	15.0%	第144回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2025/06/20	0.1%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.1%
グローバル REITインデックス マザーファンド	10.4%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.9%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
J-REIT インデックス マザーファンド	8.8%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.6%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.5%

※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)**


※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、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 >**

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込みの受付 >

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

ただし、2024年11月5日受付分からは午後3時半までとします。なお、販売会社により受付時限が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### < 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1円以上1円単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けられないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等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。

ただし、2024年11月5日受付分からは午後3時半までとします。なお、販売会社により受付時限が異なる場合があります。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 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

とします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等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 >

マザーファンド受益証券の評価方法

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資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

(ロ) 外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券

（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

(ハ) 公社債等

計算日（ ）における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における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計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

#### < 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。（2017年12月19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9月6日から翌年9月5日までとします。

ただし、第1計算期間は、2017年12月19日から2018年9月5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ち、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30億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）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

##### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

###### (1) 投資信託約款の変更等



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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用

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

上記の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅

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

上記に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

#### (2)償還金に対する請求権

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）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6期計算期間(2022年9月6日から2023年9月5日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 （2022年 9月 5日現在）	第6期 （2023年 9月 5日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	10,075,689	12,043,077
親投資信託受益証券	274,250,262	357,148,018
流動資産合計	284,325,951	369,191,095
資産合計	284,325,951	369,191,095
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	16	649
未払受託者報酬	73,539	92,968
未払委託者報酬	661,875	836,624
未払利息	19	31
その他未払費用	7,291	9,234
流動負債合計	742,740	939,506
負債合計	742,740	939,506
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	223,078,987	263,909,586
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	60,504,224	104,342,003
（分配準備積立金）	39,067,156	68,258,601
元本等合計	283,583,211	368,251,589
純資産合計	283,583,211	368,251,589
負債純資産合計	284,325,951	369,191,095

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2021年 9月 7日	自	2022年 9月 6日
	至	2022年 9月 5日	至	2023年 9月 5日
<b>営業収益</b>				
受取利息		40		29
有価証券売買等損益		4,447,284		34,050,138
営業収益合計		4,447,324		34,050,167
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,926		5,633
受託者報酬		137,824		172,640
委託者報酬		1,240,377		1,553,615
その他費用		13,653		17,137
営業費用合計		1,394,780		1,749,025
営業利益又は営業損失（ ）		3,052,544		32,301,142
経常利益又は経常損失（ ）		3,052,544		32,301,142
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,052,544		32,301,142
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（ ）		93,184		381,290
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		45,630,759		60,504,224
剰余金増加額又は欠損金減少額		14,653,301		15,536,988
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		14,653,301		15,536,988
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,739,196		3,619,061
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,739,196		3,619,061
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		60,504,224		104,342,003

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2022年 9月 5日現在)	第6期 (2023年 9月 5日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	223,078,987口	263,909,586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) 1.2712円 (12,712円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3954円 (13,954円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 5日			第6期 自 2022年 9月 6日 至 2023年 9月 5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	3,666,526円	費用控除後の配当等収益額	A	6,690,081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	24,560,109円
収益調整金額	C	21,437,068円	収益調整金額	C	36,083,402円
分配準備積立金額	D	35,400,630円	分配準備積立金額	D	37,008,411円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	60,504,224円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	104,342,003円
当ファンドの期末残存口数	F	223,078,987口	当ファンドの期末残存口数	F	263,909,586口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,712円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,953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6期 自 2022年 9月 6日 至 2023年 9月 5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視部が、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6期 (2023年 9月 5日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第5期	第6期
	自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 5日	自 2022年 9月 6日 至 2023年 9月 5日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	176,550,538円	223,078,987円
期中追加設定元本額	57,198,326円	54,268,074円
期中一部解約元本額	10,669,877円	13,437,475円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第5期	第6期
	(2022年 9月 5日現在)	(2023年 9月 5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	4,261,555	33,823,296
合計	4,261,555	33,823,296

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	14,952,793	32,848,295	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	14,099,265	36,899,186	
	国内株式インデックス マザーファンド	33,682,989	81,401,679	
	外国株式インデックス マザーファンド	15,282,715	80,747,752	
	国内債券インデックス マザーファンド	41,745,392	55,934,650	
	外国債券インデックス マザーファンド	20,956,723	69,316,456	
合計		140,719,877	357,148,018	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

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



なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年 9月 5日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	871,120,353
国債証券	544,266,686,240
地方債証券	33,168,296,473
特殊債券	36,502,930,724
社債券	29,830,448,000
未収入金	298,578,200
未収利息	1,587,801,797
前払費用	81,748,159
流動資産合計	646,607,609,946
資産合計	646,607,609,946
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	900,000,000
未払解約金	277,748,481
未払利息	2,252
流動負債合計	1,177,750,733
負債合計	1,177,750,733
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	481,685,965,946
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	163,743,893,267
元本等合計	645,429,859,213
純資産合計	645,429,859,213
負債純資産合計	646,607,609,946

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 9月 5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 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	481,685,965,946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 99,595,000円

		2023年 9月 5日現在
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 (1万口当たり純資産額)	1,3399円 (13,399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 9月 5日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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 9月 5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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	456,966,880,624円
期中追加設定元本額	52,364,435,213円
期中一部解約元本額	27,645,349,891円
期末元本額	481,685,965,946円
期末元本額の内訳	
エマーシング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	5,438,637,993円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,732,250円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,642,402,297円
世界経済インデックスファンド	5,959,015,664円
D C マイセクション 2 5	28,184,439,515円
D C マイセクション 5 0	33,875,927,685円
D C マイセクション 7 5	10,753,086,178円

区分	2023年 9月 5日現在
DC日本債券インデックス・オープン	414,103,292円
DC日本債券インデックス・オープンS	90,777,321,132円
DC日本債券インデックス・オープンP	64,240,885,097円
DCマイセレクションS25	15,887,681,772円
DCマイセレクションS50	18,379,176,407円
DCマイセレクションS75	4,633,190,352円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	480,540,133円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,759,780,394円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,094,764,253円
DC世界経済インデックスファンド	4,463,807,572円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,105,261円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	17,793,161円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	7,961,710円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,103,784円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	64,511,916円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	105,883,657円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	28,811,305円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	24,315,793円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,275,873,338円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	730,633,763円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,131,806,077円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	64,861,964円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	51,013,836円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	916,512,274円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,018,645,912円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,351,018,350円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	101,275,448円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,489,158,858円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,840,879,750円
分散投資コア戦略ファンドA	19,359,832,385円
分散投資コア戦略ファンドS	26,054,049,871円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	277,736,435円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,783,064,425円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	97,953,459円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,799,185円
SMT インデックスバランス・オープン	73,615,854円
SMT 世界経済インデックス・オープン	45,294,207円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	99,163,770円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	159,482,734円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	15,493,354円
グローバル経済コア	234,362,885円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	41,745,392円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,440,435円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	125,617,092円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	69,801,851円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	20,096,744円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	12,768,916円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	488,653,236円
10資産分散投資ファンド	315,433,469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）	90,590,942,336円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	39,980,017円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,566,172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）	465,186,339円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	12,597,551,960
地方債証券	321,213,289

特殊債券	398,247,048
社債券	191,865,000
合計	13,508,877,297

(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441回利付国債(2年)	440,000,000	440,422,400	
	第442回利付国債(2年)	2,400,000,000	2,402,352,000	
	第443回利付国債(2年)	3,300,000,000	3,303,036,000	
	第444回利付国債(2年)	2,925,000,000	2,927,486,250	
	第445回利付国債(2年)	1,160,000,000	1,160,893,200	
	第446回利付国債(2年)	3,060,000,000	3,062,019,600	
	第447回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,000,540,000	
	第448回利付国債(2年)	50,000,000	50,020,500	
	第449回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,220,317,200	
	第450回利付国債(2年)	50,000,000	50,004,500	
	第451回利付国債(2年)	1,180,000,000	1,180,106,200	
	第452回利付国債(2年)	3,080,000,000	3,079,384,000	
	第142回利付国債(5年)	3,910,000,000	3,918,054,600	
	第143回利付国債(5年)	4,480,000,000	4,489,273,600	
	第144回利付国債(5年)	5,050,000,000	5,059,898,000	
	第145回利付国債(5年)	5,120,000,000	5,129,369,600	
	第146回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,808,208,000	
	第147回利付国債(5年)	4,540,000,000	4,536,549,600	
	第148回利付国債(5年)	6,210,000,000	6,202,175,400	
	第149回利付国債(5年)	5,070,000,000	5,061,533,100	
	第150回利付国債(5年)	6,410,000,000	6,395,257,000	
	第151回利付国債(5年)	4,510,000,000	4,495,658,200	
	第152回利付国債(5年)	210,000,000	210,035,700	
	第153回利付国債(5年)	5,810,000,000	5,784,784,600	
	第154回利付国債(5年)	5,180,000,000	5,171,660,200	
	第155回利付国債(5年)	2,730,000,000	2,746,270,800	
	第156回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,656,205,000	
	第157回利付国債(5年)	1,460,000,000	1,460,642,400	
	第158回利付国債(5年)	3,730,000,000	3,714,893,500	

第159回利付国債（5年）	950,000,000	944,822,500	
第160回利付国債（5年）	3,110,000,000	3,106,299,100	
第1回利付国債（40年）	740,000,000	879,149,600	
第2回利付国債（40年）	1,130,000,000	1,291,533,500	
第3回利付国債（40年）	650,000,000	741,279,500	
第4回利付国債（40年）	950,000,000	1,082,743,500	
第5回利付国債（40年）	1,150,000,000	1,259,859,500	
第6回利付国債（40年）	1,260,000,000	1,353,454,200	
第7回利付国債（40年）	1,340,000,000	1,374,531,800	
第8回利付国債（40年）	1,490,000,000	1,415,663,900	
第9回利付国債（40年）	2,260,000,000	1,568,937,200	
第10回利付国債（40年）	2,040,000,000	1,659,519,600	
第11回利付国債（40年）	1,525,000,000	1,191,345,250	
第12回利付国債（40年）	1,290,000,000	894,563,400	
第13回利付国債（40年）	2,330,000,000	1,595,584,000	
第14回利付国債（40年）	2,170,000,000	1,587,289,900	
第15回利付国債（40年）	2,970,000,000	2,385,949,500	
第16回利付国債（40年）	1,330,000,000	1,168,298,600	
第336回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,289,228,800	
第337回利付国債（10年）	2,800,000,000	2,812,964,000	
第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	4,590,415,200	
第339回利付国債（10年）	3,970,000,000	3,999,060,400	
第340回利付国債（10年）	4,430,000,000	4,465,174,200	
第341回利付国債（10年）	5,020,000,000	5,051,525,600	
第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	4,767,806,400	
第343回利付国債（10年）	2,670,000,000	2,673,711,300	
第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	5,907,139,000	
第345回利付国債（10年）	4,280,000,000	4,283,466,800	
第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,750,977,500	
第347回利付国債（10年）	3,550,000,000	3,547,302,000	
第348回利付国債（10年）	4,260,000,000	4,253,141,400	
第349回利付国債（10年）	5,120,000,000	5,106,892,800	
第350回利付国債（10年）	6,670,000,000	6,642,986,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	4,835,000,000	4,808,649,250	
第352回利付国債（10年）	4,230,000,000	4,201,532,100	
第353回利付国債（10年）	4,385,000,000	4,349,525,350	
第354回利付国債（10年）	4,720,000,000	4,674,971,200	
第355回利付国債（10年）	4,660,000,000	4,608,274,000	
第356回利付国債（10年）	4,630,000,000	4,570,967,500	
第357回利付国債（10年）	3,390,000,000	3,339,895,800	
第358回利付国債（10年）	3,900,000,000	3,835,260,000	
第359回利付国債（10年）	4,145,000,000	4,066,866,750	

第360回利付国債(10年)	4,970,000,000	4,862,896,500	
第361回利付国債(10年)	4,690,000,000	4,575,751,600	
第362回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,631,813,200	
第363回利付国債(10年)	5,430,000,000	5,269,163,400	
第364回利付国債(10年)	5,050,000,000	4,888,198,000	
第365回利付国債(10年)	6,367,000,000	6,147,147,490	
第366回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,012,733,600	
第367回利付国債(10年)	4,900,000,000	4,748,296,000	
第368回利付国債(10年)	5,230,000,000	5,054,951,900	
第369回利付国債(10年)	4,740,000,000	4,696,202,400	
第370回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,803,138,000	
第371回利付国債(10年)	3,630,000,000	3,544,840,200	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	126,347,100	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	180,883,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	135,277,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	129,305,000	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	56,491,500	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	402,731,000	
第7回利付国債(30年)	380,000,000	436,126,000	
第8回利付国債(30年)	850,000,000	941,494,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	257,229,600	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	166,987,200	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	285,906,400	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	216,368,200	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	452,068,000	
第14回利付国債(30年)	750,000,000	878,535,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	402,182,600	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	236,886,000	
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,328,168,100	
第18回利付国債(30年)	315,000,000	367,220,700	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	618,621,300	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	571,483,200	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	584,235,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	644,209,200	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	513,303,900	
第24回利付国債(30年)	780,000,000	931,608,600	
第25回利付国債(30年)	600,000,000	702,192,000	
第26回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,834,921,000	
第27回利付国債(30年)	1,850,000,000	2,216,152,000	
第28回利付国債(30年)	2,020,000,000	2,421,394,200	
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,980,803,700	
第30回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,423,659,500	

第3 1 回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,410,649,400
第3 2 回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,884,231,300
第3 3 回利付国債(30年)	2,120,000,000	2,381,798,800
第3 4 回利付国債(30年)	1,865,000,000	2,150,736,650
第3 5 回利付国債(30年)	2,480,000,000	2,776,236,000
第3 6 回利付国債(30年)	2,420,000,000	2,709,407,800
第3 7 回利付国債(30年)	2,295,000,000	2,524,408,200
第3 8 回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,631,419,100
第3 9 回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,611,340,500
第4 0 回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,357,990,200
第4 1 回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,345,069,700
第4 2 回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,481,158,000
第4 3 回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,417,264,400
第4 4 回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,426,248,000
第4 5 回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,467,216,000
第4 6 回利付国債(30年)	1,830,000,000	1,863,360,900
第4 7 回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,790,740,300
第4 8 回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,793,952,000
第4 9 回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,722,682,100
第5 0 回利付国債(30年)	1,940,000,000	1,705,531,600
第5 1 回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,341,015,200
第5 2 回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,329,281,300
第5 3 回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,223,701,500
第5 4 回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,496,262,400
第5 5 回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,379,150,100
第5 6 回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,366,478,800
第5 7 回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,319,364,900
第5 8 回利付国債(30年)	2,260,000,000	1,943,170,600
第5 9 回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,146,073,500
第6 0 回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,189,809,600
第6 1 回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,128,460,000
第6 2 回利付国債(30年)	1,165,000,000	914,443,450
第6 3 回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,102,174,000
第6 4 回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,149,849,600
第6 5 回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,059,665,050
第6 6 回利付国債(30年)	1,465,000,000	1,099,643,650
第6 7 回利付国債(30年)	1,665,000,000	1,315,799,550
第6 8 回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,267,842,800
第6 9 回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,235,582,100
第7 0 回利付国債(30年)	1,990,000,000	1,603,223,600
第7 1 回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,213,571,900
第7 2 回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,340,175,000
第7 3 回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,497,065,900

第74回利付国債(30年)	2,020,000,000	1,751,663,200	
第75回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,317,532,200	
第76回利付国債(30年)	1,960,000,000	1,876,680,400	
第77回利付国債(30年)	2,170,000,000	2,178,680,000	
第78回利付国債(30年)	1,040,000,000	995,280,000	
第79回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,045,603,000	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	369,554,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	205,566,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	134,260,100	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	278,019,000	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	299,056,700	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	175,800,400	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	279,695,700	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	228,291,800	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	405,814,500	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	625,554,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	303,757,600	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	491,220,500	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	305,161,200	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	539,243,400	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,930,302,300	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	446,292,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	370,937,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	670,887,000	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	480,568,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	938,440,800	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	437,588,900	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	653,194,100	
第95回利付国債(20年)	830,000,000	898,367,100	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,708,979,700	
第97回利付国債(20年)	900,000,000	974,637,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	474,724,800	
第99回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,635,088,400	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	523,488,000	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	786,206,850	
第102回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,302,755,400	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	439,716,000	
第104回利付国債(20年)	160,000,000	174,369,600	
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,290,223,800	
第106回利付国債(20年)	680,000,000	746,905,200	
第107回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,206,513,000	
第108回利付国債(20年)	840,000,000	912,567,600	



第109回利付国債(20年)	920,000,000	1,002,036,400
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,210,088,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,076,040,400
第112回利付国債(20年)	990,000,000	1,092,593,700
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,235,635,000
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,585,624,300
第115回利付国債(20年)	700,000,000	781,109,000
第116回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,857,357,400
第117回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,646,500,000
第118回利付国債(20年)	660,000,000	731,458,200
第119回利付国債(20年)	530,000,000	580,360,600
第120回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,373,403,400
第121回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,621,498,200
第122回利付国債(20年)	900,000,000	986,589,000
第123回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,036,197,800
第124回利付国債(20年)	760,000,000	844,907,200
第125回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,444,275,200
第126回利付国債(20年)	730,000,000	812,745,500
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,128,181,200
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,074,585,400
第129回利付国債(20年)	740,000,000	814,229,400
第130回利付国債(20年)	1,685,000,000	1,856,415,050
第131回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,444,080,000
第132回利付国債(20年)	660,000,000	722,733,000
第133回利付国債(20年)	1,610,000,000	1,775,846,100
第134回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,634,793,200
第135回利付国債(20年)	630,000,000	690,744,600
第136回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,142,190,000
第137回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,316,760,000
第138回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,436,493,100
第139回利付国債(20年)	830,000,000	903,795,300
第140回利付国債(20年)	2,490,000,000	2,735,364,600
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,757,920,000
第142回利付国債(20年)	1,175,000,000	1,301,900,000
第143回利付国債(20年)	1,820,000,000	1,984,127,600
第144回利付国債(20年)	1,310,000,000	1,415,677,700
第145回利付国債(20年)	2,335,000,000	2,567,659,400
第146回利付国債(20年)	2,760,000,000	3,035,944,800
第147回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,573,698,000
第148回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,462,559,600
第149回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,087,913,400
第150回利付国債(20年)	2,830,000,000	3,023,685,200
第151回利付国債(20年)	2,445,000,000	2,558,154,600

第152回利付国債(20年)	2,840,000,000	2,967,771,600	
第153回利付国債(20年)	2,510,000,000	2,647,999,800	
第154回利付国債(20年)	2,835,000,000	2,954,637,000	
第155回利付国債(20年)	2,650,000,000	2,695,712,500	
第156回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,587,135,400	
第157回利付国債(20年)	3,070,000,000	2,813,869,900	
第158回利付国債(20年)	2,750,000,000	2,610,960,000	
第159回利付国債(20年)	2,980,000,000	2,856,926,000	
第160回利付国債(20年)	2,080,000,000	2,014,001,600	
第161回利付国債(20年)	2,380,000,000	2,267,402,200	
第162回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,167,995,700	
第163回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,347,171,200	
第164回利付国債(20年)	1,860,000,000	1,728,814,200	
第165回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,176,194,000	
第166回利付国債(20年)	1,880,000,000	1,786,413,600	
第167回利付国債(20年)	2,290,000,000	2,103,296,300	
第168回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,062,649,000	
第169回利付国債(20年)	2,000,000,000	1,764,600,000	
第170回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,125,631,200	
第171回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,713,804,400	
第172回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,018,598,000	
第173回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,071,407,500	
第174回利付国債(20年)	2,640,000,000	2,316,652,800	
第175回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,143,887,800	
第176回利付国債(20年)	2,660,000,000	2,356,121,600	
第177回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,018,315,900	
第178回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,003,230,800	
第179回利付国債(20年)	2,495,000,000	2,183,948,350	
第180回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,166,394,500	
第181回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,179,388,800	
第182回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,317,896,000	
第183回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,473,794,000	
第184回利付国債(20年)	2,180,000,000	2,092,516,600	
第185回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,751,712,600	
国債証券合計	548,412,000,000	544,266,686,240	
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	99,673,000	
第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	78,642,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,950,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	115,862,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	113,234,000	
第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	108,687,000	

第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	105,772,000	
第16回東京都公募公債（20年）	200,000,000	216,908,000	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	108,869,000	
第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,667,000	
第19回東京都公募公債（30年）	100,000,000	79,141,000	
第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	217,682,000	
第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	216,816,000	
第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,360,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	100,501,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	99,964,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	99,775,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	297,453,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	195,170,000	
第830回東京都公募公債	300,000,000	289,458,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,135,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,763,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,068,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	197,918,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	196,578,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	100,015,000	
第31回1号宮城県公募公債（10年）	200,000,000	201,606,000	
第39回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	98,211,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	238,728,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,483,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	219,232,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	110,225,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	108,559,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	105,263,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	201,008,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	100,685,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,102,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,929,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,775,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	195,108,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	219,512,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	218,478,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	108,646,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,545,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	151,828,990	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,787,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,750,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,650,560	

第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,940,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	197,898,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,917,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	97,062,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	154,387,200	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	175,205,940	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	192,300,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	110,333,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	108,958,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,798,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	91,448,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	93,804,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	135,978,710	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	108,340,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	100,747,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,749,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,767,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,668,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	443,208,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,553,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	91,872,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	293,574,000	
第1回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	104,178,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	100,144,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	84,068,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,580,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	106,131,000	
平成27年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,756,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,812,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,887,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,804,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	301,831,500	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	110,515,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,548,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,158,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,705,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	199,754,000	

平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	279,366,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,359,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	82,888,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	194,994,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,425,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	156,554,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,881,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	109,810,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	220,102,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,147,935	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,783,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	378,990,300	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	97,196,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	99,378,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	108,175,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	109,414,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	88,046,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	221,162,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	184,780,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	219,232,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	183,500,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,732,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,695,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,134,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,792,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	97,025,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	96,781,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	143,788,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,333,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,662,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,360,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	110,382,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	104,139,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	111,502,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,496,000	

平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,462,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,720,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	82,888,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	92,539,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	292,815,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,528,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	91,238,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債（グリーン ボンド・10年）	100,000,000	99,106,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	98,832,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	218,828,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	110,222,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	108,580,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,521,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,776,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,696,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,898,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	292,272,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	97,285,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	127,944,700	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,734,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	290,712,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	290,454,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	99,055,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	217,776,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	98,831,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,716,000	
第139回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,566,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,098,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,032,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,548,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,444,582	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,746,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,777,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,847,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,777,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,414,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,282,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	398,580,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,535,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,915,000	

第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,103,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,544,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,332,386	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,758,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,011,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,387,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,154,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	193,262,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,057,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,121,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,794,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	97,222,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	98,497,220	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,733,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,753,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,708,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	220,718,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	77,952,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	276,015,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	94,499,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	193,150,000	
第1回名古屋市公募公債（12年）	100,000,000	101,657,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	117,410,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	117,597,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	108,766,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	104,719,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,016,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	292,731,000	
第1回京都市公募公債（20年）	100,000,000	102,688,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	199,830,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	127,886,400	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	219,060,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	110,957,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,671,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	78,293,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	78,186,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	103,687,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	329,589,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,796,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,899,000	

	平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,957,000	
	平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,431,000	
	平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,592,000	
	第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	210,044,000	
	令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	292,752,000	
	令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	96,573,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	104,361,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,477,000	
	平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,091,000	
	令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	196,734,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	108,881,000	
	第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	200,208,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,869,000	
	第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,986,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,495,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,748,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,766,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	110,030,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	106,651,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	201,128,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,515,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,879,250	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	169,437,300	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	537,042,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	299,232,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	194,848,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	288,471,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	96,615,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	98,264,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,761,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	200,742,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	98,614,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	108,346,000	
	地方債証券合計	32,980,430,000	33,168,296,473	
特殊債券	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,723,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,938,000	



第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,816,000	
第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	63,897,000	
第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	500,000,000	499,360,000	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,184,000	
第21回道路債券	100,000,000	117,345,000	
第28回道路債券	200,000,000	237,148,000	
第33回道路債券	200,000,000	239,312,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,998,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,883,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,545,000	
第42回道路債券	200,000,000	206,438,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,803,000	
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	116,566,000	
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	219,870,000	
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	221,302,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,572,000	
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	113,644,000	
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	110,818,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,943,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,484,000	
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	109,112,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,879,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,918,000	
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	107,371,000	
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	108,079,000	
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	108,251,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	558,732,000	
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	109,284,000	

第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	84,339,000	
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	212,528,000	
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	105,649,000	
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	210,506,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,586,000	
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	260,442,630	
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	301,137,000	
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	402,124,000	
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	102,593,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,288,000	
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	100,528,000	
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	112,799,680	
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	200,958,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,049,000	
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	78,446,000	
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	106,430,760	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,120,000	
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	204,549,000	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,354,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,436,000	
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	99,820,000	
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	199,548,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	296,466,000	
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	99,671,000	
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	119,522,400	
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	198,412,000	
	300,000,000	278,178,000	

第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	212,579,040	
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	97,698,000	
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	97,309,000	
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	116,266,800	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	343,566,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	103,988,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	354,342,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	235,754,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	116,202,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	219,544,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	215,756,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	154,370,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,624,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	217,996,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,134,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	535,930,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,557,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,531,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,551,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	419,000,000	422,071,270	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,981,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,414,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,058,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,597,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,048,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,736,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,472,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,558,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,723,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	250,445,290	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,754,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,746,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,698,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,589,700	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,957,000	

第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	155,118,600	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,341,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,526,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,175,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,632,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	712,173,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,779,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,142,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,032,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,382,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,096,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,166,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,641,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,446,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,571,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,623,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,527,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	103,150,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,929,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,179,000	
第19回水資源債券(サステナビリティボンド)	200,000,000	199,744,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	110,003,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	110,938,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,667,360	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,745,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,700,100	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	185,786,370	
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,938,400	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,871,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	202,400,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	128,210,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	70,871,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	149,640,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,725,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	97,390,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	104,109,000	103,353,168	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,985,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	71,402,000	71,096,399	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,985,000	

第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	123,840,000	122,670,950	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	141,411,000	139,636,291	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	50,324,000	49,812,204	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,324,000	10,400,500	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	177,867,000	176,125,682	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	122,068,000	120,777,741	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,431,000	10,525,296	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,297,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,932,000	14,482,731	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,718,000	14,236,403	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,499,000	16,206,684	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,733,000	18,549,072	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,899,000	19,817,869	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,367,000	20,275,118	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,076,000	41,899,858	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,175,000	18,936,169	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,534,000	19,267,946	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,143,000	18,877,972	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,175,000	17,854,958	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,216,000	10,310,293	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,394,000	37,684,895	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,089,000	19,771,431	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,605,000	26,438,954	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,295,000	25,085,559	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,487,000	25,303,151	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,784,000	54,362,769	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,324,000	66,634,399	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,945,000	34,560,762	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,801,000	35,713,134	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,479,000	36,440,480	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,773,000	31,587,561	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,722,000	30,287,906	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,081,000	36,069,933	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	165,469,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,878,000	93,623,682	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,396,000	126,646,323	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,278,000	36,774,283	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,674,000	38,187,119	

第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,435,000	38,818,581	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,981,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,347,000	122,409,999	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,394,000	41,587,723	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,858,000	87,513,596	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,190,000	49,092,603	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,855,000	52,523,599	
第 9 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	313,899,000	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,946,000	51,882,106	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,937,000	162,209,054	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,420,000	109,384,985	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,230,000	53,187,948	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,474,000	57,356,753	
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,661,000	61,443,050	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,338,000	67,126,811	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,804,000	66,412,372	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,202,000	67,033,209	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,852,000	67,945,040	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,007,000	67,942,493	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,162,000	69,808,075	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,347,000	70,042,748	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,051,000	69,544,345	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,057,000	69,550,136	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,896,000	70,359,219	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,342,000	142,782,141	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,858,000	70,283,198	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,930,000	143,870,847	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,607,000	71,898,019	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,762,000	143,103,093	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,078,000	72,325,640	
第 1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,472,000	145,478,252	

第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	152,316,000	146,241,637	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,057,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,021,000	74,341,439	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,302,000	73,816,080	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,771,000	73,588,842	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,776,000	151,342,107	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,536,000	75,696,001	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,643,000	74,969,585	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,588,000	151,758,612	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,480,000	76,866,602	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	245,649,000	230,384,371	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,420,000	155,064,708	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,222,000	79,996,582	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,074,000	80,531,048	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,550,000	165,832,973	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,412,000	83,846,404	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,890,000	167,633,346	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,094,000	169,347,704	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,981,000	84,376,233	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,966,000	170,373,842	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,968,000	170,114,453	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,549,000	85,937,339	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,068,000	86,853,268	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	274,656,000	259,011,594	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,236,000	87,057,870	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,440,000	89,312,755	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,048,000	90,940,025	

第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,851,000	91,804,170	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,394,000	183,790,140	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,292,000	95,129,198	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,262,000	195,174,132	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,594,000	98,601,887	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,228,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,125,000	99,184,475	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,901,000	99,777,122	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	201,018,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	79,181,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	289,446,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,202,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,381,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,868,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,528,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,610,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,984,000	
い第876号商工債	300,000,000	298,890,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,740,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,567,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,428,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	396,984,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	100,409,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,665,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	108,028,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,467,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	195,608,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	486,470,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,251,000	
第102回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,760,000	
第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,735,000	
第85回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,406,000	
第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,222,000	
第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,930,000	
第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,018,000	
第27回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,586,000	
第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	598,926,000	



	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,924,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,266,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,720,000	
	第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,683,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,116,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,545,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	187,070,000	
	特殊債券合計	36,407,835,000	36,502,930,724	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,896,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	299,247,000	
	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,678,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,933,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,264,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,997,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	398,224,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,564,000	
	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	99,592,000	
	第52回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,197,000	
	第8回ビー・エヌ・ビー・パリパ円貨社債（2023）	400,000,000	399,492,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,334,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,333,000	
	第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,951,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,591,000	
	第8回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,233,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,939,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,541,000	
	第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,975,000	
	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	99,873,000	
	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	99,932,000	
	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	100,624,000	
	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	299,814,000	
	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	198,680,000	

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	299,760,000	
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	97,861,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,939,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,825,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,813,000	
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	98,716,000	
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	98,007,000	
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	99,970,000	
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	100,318,000	
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	199,400,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,715,000	
第35回王子ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	99,154,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,420,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,634,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,475,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,810,000	
第13回JSR株式会社無担保社債	100,000,000	95,980,000	
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	98,799,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホール ディングス無担保社債	200,000,000	198,022,000	
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	199,558,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホール ディングス無担保社債	100,000,000	99,124,000	
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	82,490,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,844,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,888,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	195,730,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	285,834,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,895,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	200,068,000	
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	99,759,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,751,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	400,000,000	399,140,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,799,000	
第4回ENEOSホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	97,164,000	

第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,448,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,695,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,525,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	96,860,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,619,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,772,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,529,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,332,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	99,512,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,745,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	98,805,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,564,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,992,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	97,018,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,350,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,776,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,906,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,068,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,562,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	95,068,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,842,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,246,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,286,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,841,000	
第25回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,503,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	192,692,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,323,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	85,932,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,583,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	109,517,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	196,104,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,540,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,380,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	96,850,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,984,000	
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	96,684,000	
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	99,334,000	
	100,000,000	110,462,000	

第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）			
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,805,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,404,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,056,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,400,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	194,722,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,409,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,286,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,536,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,732,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,928,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,746,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,873,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,462,000	
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	99,677,000	
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	99,306,000	
第82回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,670,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,393,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,058,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,490,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,603,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,739,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,321,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,518,000	
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	199,544,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,278,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,718,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,242,000	
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	98,799,000	
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	99,990,000	
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	98,858,000	

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	300,051,000	
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	198,762,000	
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	200,068,000	
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	198,496,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,614,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,472,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	85,974,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,265,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,690,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,809,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,428,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,254,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,040,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,439,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,210,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	77,670,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,753,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,115,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,497,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	218,926,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,283,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	87,243,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,471,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,274,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	77,409,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	85,433,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	71,969,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,715,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,751,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	76,371,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	85,365,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,230,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	85,230,000	
	100,000,000	113,102,000	

第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債			
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,535,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,458,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	80,071,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	67,782,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	60,484,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	72,780,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	81,420,000	
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	156,178,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,680,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,826,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,343,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	175,632,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,602,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,518,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,501,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	92,946,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	84,286,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,850,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,760,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,490,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,273,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,681,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,261,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,567,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,084,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,784,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,368,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	196,166,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,132,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	295,776,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,871,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,644,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	196,002,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,348,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,690,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	195,106,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,730,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,100,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,420,000	

第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,421,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,594,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,931,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,155,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	195,192,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,427,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,359,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	196,664,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,975,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	89,684,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,254,000	
第31回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	99,892,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	91,156,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,676,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,879,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,691,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,904,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,532,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,228,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,493,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,556,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,051,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,759,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	271,839,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,433,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	96,218,000	
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	99,870,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	76,937,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	193,078,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,178,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	84,956,000	
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	198,644,000	
社債券合計	30,600,000,000	29,830,448,000	
合計		643,768,361,437	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 9月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,573,468,575
株式	583,567,482,127
派生商品評価勘定	8,987,000
未収入金	99,924,650
未収配当金	395,797,491
差入委託証拠金	4,873,300
流動資産合計	586,650,533,143
資産合計	586,650,533,143
負債の部	
流動負債	
前受金	8,987,000
未払解約金	217,960,445
未払利息	6,655
流動負債合計	226,954,100
負債合計	226,954,100
純資産の部	
元本等	
元本	242,651,408,927
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	343,772,170,116
元本等合計	586,423,579,043
純資産合計	586,423,579,043
負債純資産合計	586,650,533,143

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 9月 5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 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		242,651,408,927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)	2.4167円 (24,167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 9月 5日現在
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2023年 9月 5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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	264,418,414,974円
期中追加設定元本額	20,335,062,528円
期中一部解約元本額	42,102,068,575円
期末元本額	242,651,408,927円
期末元本額の内訳	

区分	2023年 9月 5日現在
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	331,433,522円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,484,693,642円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,007,694円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,106,977,809円
世界経済インデックスファンド	4,946,749,137円
日本株式インデックス・オープン	3,019,960,525円
DCマイセクション25	5,509,634,763円
DCマイセクション50	17,686,266,504円
DCマイセクション75	18,593,484,701円
DC日本株式インデックス・オープン	6,008,884,735円
DCマイセクションS25	3,213,208,440円
DCマイセクションS50	9,501,402,104円
DCマイセクションS75	8,110,887,659円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,065,790,437円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	92,361,826円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	614,176,048円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	480,963,553円
DC世界経済インデックスファンド	3,733,300,728円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	917,203,114円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,668,401円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,059,381円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,125,814円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	158,813,091円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,072,124円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	17,690,051円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	74,059,921円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	17,095,594円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	49,473,246円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	581,564,827円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	330,154,687円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,218,912,659円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	30,795,734円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	13,212,312円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	346,736,718円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	195,734,254円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	258,709,950円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	21,290,283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）	445,636,205円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,619,327,787円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,799,063,935円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,241,824,743円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,805,562,216円
分散投資コア戦略ファンドA	1,573,611,795円
分散投資コア戦略ファンドS	5,972,815,479円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	577,382,172円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	402,926,451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）	205,744,359円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,678,948円
SMT インデックスバランス・オープン	50,715,651円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	19,206,484,026円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	285,794,619円
SMT 世界経済インデックス・オープン	50,300,996円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	205,935,828円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	35,758,058円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,674,739円
グローバル経済コア	213,984,898円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,682,989円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	876,351,621円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	27,302,397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
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	50,559,567円

区分	2023年 9月 5日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	48,104,727円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	20,176,016円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	21,701,613円
10資産分散投資ファンド	93,091,386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）	42,469,473,759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）	520,745,460円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	297,476,278円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,743,552円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	614,567,203円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	46,304,730,783円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,370,148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）	205,398,439円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 9月 5日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	52,946,309,036	
合計	52,946,309,036	

(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 9月 5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	2,579,313,000	-	2,588,300,000	8,987,000
合計		2,579,313,000	-	2,588,300,000	8,987,000

## (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	3,890.00	35,788,000	
ニッスイ	241,900	770.20	186,311,380	
マルハニチロ	35,900	2,602.50	93,429,750	
雪国まいたけ	20,600	919.00	18,931,400	
カネコ種苗	7,400	1,426.00	10,552,400	
サカタのタネ	27,500	4,210.00	115,775,000	
ホクト	21,500	1,848.00	39,732,000	

ホクリヨウ	2,300	997.00	2,293,100
住石ホールディングス	25,100	388.00	9,738,800
日鉄鉱業	9,700	5,430.00	52,671,000
三井松島ホールディングス	11,000	2,870.00	31,570,000
I N P E X	894,800	2,161.50	1,934,110,200
石油資源開発	28,000	5,030.00	140,840,000
K & O エナジーグループ	11,000	2,473.00	27,203,000
ショーボンドホールディングス	33,000	5,971.00	197,043,000
ミライト・ワン	80,000	1,956.50	156,520,000
タマホーム	15,200	3,640.00	55,328,000
サンヨーホームズ	2,000	726.00	1,452,000
日本アクア	6,700	1,049.00	7,028,300
ファーストコーポレーション	4,100	777.00	3,185,700
ベステラ	3,500	1,115.00	3,902,500
Robot Home	47,000	211.00	9,917,000
キャンディル	2,900	638.00	1,850,200
ダイセキ環境ソリューション	3,300	1,335.00	4,405,500
第一カッター興業	6,200	1,320.00	8,184,000
安藤・間	140,200	1,221.00	171,184,200
東急建設	68,900	795.00	54,775,500
コムシスホールディングス	77,200	3,091.00	238,625,200
ビーアールホールディングス	38,400	394.00	15,129,600
高松コンストラクショングループ	15,700	2,654.00	41,667,800
東建コーポレーション	7,000	7,800.00	54,600,000
ソネック	1,700	1,008.00	1,713,600
ヤマウラ	12,300	1,262.00	15,522,600
オリエンタル白石	87,000	329.00	28,623,000
大成建設	158,300	5,044.00	798,465,200
大林組	605,200	1,345.50	814,296,600
清水建設	479,900	1,000.00	479,900,000
飛島建設	18,700	1,370.00	25,619,000
長谷工コーポレーション	174,700	1,864.00	325,640,800
松井建設	15,800	784.00	12,387,200
銭高組	1,400	4,055.00	5,677,000
鹿島建設	375,200	2,479.00	930,120,800
不動テトラ	11,700	1,880.00	21,996,000
大末建設	4,100	1,497.00	6,137,700
鉄建建設	12,100	2,073.00	25,083,300
西松建設	28,700	3,769.00	108,170,300
三井住友建設	136,500	405.00	55,282,500
大豊建設	7,000	4,130.00	28,910,000
佐田建設	7,200	483.00	3,477,600

ナカノフドー建設	8,000	402.00	3,216,000	
奥村組	27,400	4,660.00	127,684,000	
東鉄工業	23,300	2,853.00	66,474,900	
イチケン	2,500	2,088.00	5,220,000	
富士ピー・エス	5,000	475.00	2,375,000	
浅沼組	13,600	3,685.00	50,116,000	
戸田建設	208,200	818.50	170,411,700	
熊谷組	28,300	3,395.00	96,078,500	
北野建設	2,100	3,090.00	6,489,000	
植木組	3,200	1,534.00	4,908,800	
矢作建設工業	23,000	1,307.00	30,061,000	
ピーエス三菱	21,400	809.00	17,312,600	
日本ハウスホールディングス	36,100	376.00	13,573,600	
新日本建設	23,800	1,253.00	29,821,400	
東亜道路工業	6,700	5,140.00	34,438,000	
日本道路	3,400	9,800.00	33,320,000	
東亜建設工業	14,500	3,675.00	53,287,500	
日本国土開発	48,100	626.00	30,110,600	
若築建設	7,500	3,105.00	23,287,500	
東洋建設	56,200	1,126.00	63,281,200	
五洋建設	239,900	881.60	211,495,840	
世紀東急工業	21,700	1,733.00	37,606,100	
福田組	6,400	4,930.00	31,552,000	
住友林業	146,200	4,151.00	606,876,200	
日本基礎技術	6,800	500.00	3,400,000	
巴コーポレーション	12,600	546.00	6,879,600	
大和ハウス工業	468,000	4,124.00	1,930,032,000	
ライト工業	31,300	2,039.00	63,820,700	
積水ハウス	513,100	3,057.00	1,568,546,700	
日特建設	16,100	1,118.00	17,999,800	
北陸電気工事	11,600	1,007.00	11,681,200	
ユアテック	37,300	995.00	37,113,500	
日本リーテック	14,900	1,339.00	19,951,100	
四電工	7,100	2,842.00	20,178,200	
中電工	26,300	2,442.00	64,224,600	
関電工	92,700	1,345.00	124,681,500	
きんでん	119,100	2,082.00	247,966,200	
東京エネシス	16,800	1,031.00	17,320,800	
トーエネック	5,600	4,245.00	23,772,000	
住友電設	16,100	2,900.00	46,690,000	
日本電設工業	27,800	2,164.00	60,159,200	
エクシオグループ	77,900	3,116.00	242,736,400	

新日本空調	9,400	2,508.00	23,575,200
九電工	41,200	4,604.00	189,684,800
三機工業	37,500	1,633.00	61,237,500
日揮ホールディングス	167,400	1,989.50	333,042,300
中外炉工業	5,500	2,125.00	11,687,500
ヤマト	9,400	940.00	8,836,000
太平電業	10,500	4,045.00	42,472,500
高砂熱学工業	40,800	2,906.00	118,564,800
三晃金属工業	1,400	4,280.00	5,992,000
朝日工業社	7,000	2,420.00	16,940,000
明星工業	29,100	996.00	28,983,600
大気社	19,500	4,665.00	90,967,500
ダイダン	11,100	3,035.00	33,688,500
日比谷総合設備	14,400	2,312.00	33,292,800
フィル・カンパニー	3,000	761.00	2,283,000
テスホールディングス	37,400	529.00	19,784,600
インフロニア・ホールディングス	177,300	1,519.50	269,407,350
東洋エンジニアリング	22,400	648.00	14,515,200
レイズネクスト	24,500	1,450.00	35,525,000
ニッポン	45,800	2,099.00	96,134,200
日清製粉グループ本社	157,100	1,938.50	304,538,350
日東富士製粉	3,000	5,020.00	15,060,000
昭和産業	14,800	3,060.00	45,288,000
鳥越製粉	10,100	672.00	6,787,200
中部飼料	23,500	1,153.00	27,095,500
フィード・ワン	24,800	826.00	20,484,800
東洋精糖	2,100	2,217.00	4,655,700
日本甜菜製糖	9,900	1,928.00	19,087,200
D M三井製糖ホールディングス	16,800	3,055.00	51,324,000
塩水港精糖	13,600	257.00	3,495,200
ウェルネオシュガー	8,800	2,188.00	19,254,400
森永製菓	30,900	5,363.00	165,716,700
中村屋	4,200	3,140.00	13,188,000
江崎グリコ	48,600	3,870.00	188,082,000
名糖産業	6,700	1,658.00	11,108,600
井村屋グループ	9,300	2,350.00	21,855,000
不二家	11,600	2,473.00	28,686,800
山崎製パン	113,700	2,833.50	322,168,950
第一屋製パン	2,100	405.00	850,500
モロゾフ	5,500	3,735.00	20,542,500
亀田製菓	10,800	4,450.00	48,060,000
寿スピリッツ	18,100	11,950.00	216,295,000

カルビー	77,800	2,880.00	224,064,000
森永乳業	30,900	5,963.00	184,256,700
六甲バター	12,500	1,445.00	18,062,500
ヤクルト本社	121,400	7,606.00	923,368,400
明治ホールディングス	208,300	3,680.00	766,544,000
雪印メグミルク	41,100	2,387.00	98,105,700
プリマハム	22,800	2,525.00	57,570,000
日本ハム	66,400	4,559.00	302,717,600
林兼産業	3,400	556.00	1,890,400
丸大食品	17,100	1,743.00	29,805,300
S Foods	18,700	3,400.00	63,580,000
柿安本店	6,600	2,566.00	16,935,600
伊藤ハム米久ホールディングス	129,800	817.00	106,046,600
サッポロホールディングス	55,900	4,558.00	254,792,200
アサヒグループホールディングス	392,600	5,894.00	2,313,984,400
キリンホールディングス	707,700	2,067.50	1,463,169,750
宝ホールディングス	116,000	1,255.00	145,580,000
オエノンホールディングス	50,800	431.00	21,894,800
養命酒製造	5,600	1,928.00	10,796,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	133,100	1,952.00	259,811,200
ライフドリンク カンパニー	3,100	4,180.00	12,958,000
サントリー食品インターナショナル	119,600	4,809.00	575,156,400
ダイドーグループホールディングス	9,600	5,790.00	55,584,000
伊藤園	57,600	4,822.00	277,747,200
キーコーヒー	19,000	2,091.00	39,729,000
ユニカフェ	3,800	953.00	3,621,400
ジャパンフーズ	1,800	1,106.00	1,990,800
日清オイリオグループ	23,900	4,195.00	100,260,500
不二製油グループ本社	39,600	2,382.50	94,347,000
かどや製油	1,400	3,505.00	4,907,000
J - オイルミルズ	17,300	1,811.00	31,330,300
キッコーマン	112,600	8,393.00	945,051,800
味の素	410,200	6,114.00	2,507,962,800
ブルドックソース	9,000	2,160.00	19,440,000
キューピー	91,300	2,458.50	224,461,050
ハウス食品グループ本社	52,000	3,183.00	165,516,000
カゴメ	73,100	3,373.00	246,566,300
焼津水産化学工業	4,400	1,142.00	5,024,800
アリアケジャパン	14,800	5,252.00	77,729,600
ピエトロ	1,600	1,865.00	2,984,000
エバラ食品工業	4,600	3,005.00	13,823,000
やまみ	1,100	1,817.00	1,998,700

ニチレイ	77,800	3,521.00	273,933,800
東洋水産	85,900	6,029.00	517,891,100
イトアンドホールディングス	7,500	2,133.00	15,997,500
大冷	1,400	2,014.00	2,819,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	1,342.00	14,493,600
日清食品ホールディングス	59,700	12,595.00	751,921,500
永谷園ホールディングス	8,300	2,362.00	19,604,600
一正蒲鉾	4,900	763.00	3,738,700
フジッコ	17,500	1,962.00	34,335,000
ロック・フィールド	19,000	1,545.00	29,355,000
日本たばこ産業	1,032,400	3,212.00	3,316,068,800
ケンコーマヨネーズ	11,700	1,475.00	17,257,500
わらべや日洋ホールディングス	12,500	2,845.00	35,562,500
なとり	10,700	2,002.00	21,421,400
イフジ産業	1,900	1,883.00	3,577,700
ファーマフーズ	24,400	1,610.00	39,284,000
ユーグレナ	109,200	833.00	90,963,600
紀文食品	13,300	1,151.00	15,308,300
ピクルスホールディングス	10,000	1,250.00	12,500,000
ミヨシ油脂	4,400	1,157.00	5,090,800
理研ビタミン	14,700	2,339.00	34,383,300
片倉工業	16,200	1,711.00	27,718,200
ゲンゼ	12,400	4,590.00	56,916,000
東洋紡	75,200	1,097.50	82,532,000
ユニチカ	54,700	219.00	11,979,300
富士紡ホールディングス	7,000	3,615.00	25,305,000
倉敷紡績	13,100	2,413.00	31,610,300
シキボウ	6,400	1,055.00	6,752,000
日本毛織	46,000	1,314.00	60,444,000
トーア紡コーポレーション	4,500	451.00	2,029,500
帝国繊維	19,800	2,011.00	39,817,800
帝人	166,400	1,505.00	250,432,000
東レ	1,158,700	807.70	935,881,990
住江織物	2,500	2,245.00	5,612,500
日本フェルト	7,600	431.00	3,275,600
イチカワ	1,800	1,480.00	2,664,000
日東製網	1,200	1,455.00	1,746,000
アツギ	7,200	444.00	3,196,800
ダイニック	3,000	794.00	2,382,000
セーレン	33,600	2,448.00	82,252,800
ソトー	3,900	798.00	3,112,200
東海染工	1,300	1,090.00	1,417,000



小松マテーレ	25,300	757.00	19,152,100
ワコールホールディングス	31,600	3,260.00	103,016,000
ホギメディカル	23,300	3,255.00	75,841,500
T S Iホールディングス	58,500	747.00	43,699,500
マツオカコーポレーション	3,300	1,466.00	4,837,800
ワールド	22,300	1,686.00	37,597,800
三陽商会	4,400	1,985.00	8,734,000
ナイガイ	4,600	286.00	1,315,600
オンワードホールディングス	112,500	524.00	58,950,000
ルックホールディングス	3,700	2,050.00	7,585,000
ゴールドウイン	30,600	10,770.00	329,562,000
デサント	29,800	3,655.00	108,919,000
キング	5,400	654.00	3,531,600
ヤマトインターナショナル	9,800	287.00	2,812,600
特種東海製紙	7,700	3,355.00	25,833,500
王子ホールディングス	720,000	613.50	441,720,000
日本製紙	90,000	1,269.00	114,210,000
三菱製紙	13,900	498.00	6,922,200
北越コーポレーション	109,200	950.00	103,740,000
中越パルプ工業	4,700	1,372.00	6,448,400
巴川製紙所	3,600	681.00	2,451,600
大王製紙	76,300	1,263.50	96,405,050
阿波製紙	2,800	530.00	1,484,000
レンゴー	157,400	1,001.00	157,557,400
トーモク	10,000	2,338.00	23,380,000
ザ・パック	12,800	3,230.00	41,344,000
北の達人コーポレーション	72,800	251.00	18,272,800
クラレ	251,900	1,702.50	428,859,750
旭化成	1,079,300	964.50	1,040,984,850
共和レザー	6,600	664.00	4,382,400
レゾナック・ホールディングス	167,000	2,518.00	420,506,000
住友化学	1,282,200	415.40	532,625,880
住友精化	7,200	4,620.00	33,264,000
日産化学	81,700	6,332.00	517,324,400
ラサ工業	6,700	2,087.00	13,982,900
クレハ	14,700	8,790.00	129,213,000
多木化学	6,700	3,825.00	25,627,500
テイカ	11,600	1,390.00	16,124,000
石原産業	31,300	1,488.00	46,574,400
片倉コープアグリ	2,400	1,191.00	2,858,400
日本曹達	18,500	5,510.00	101,935,000
東ソー	230,700	1,944.50	448,596,150

トクヤマ	55,800	2,408.50	134,394,300
セントラル硝子	27,700	3,015.00	83,515,500
東亜合成	86,700	1,402.00	121,553,400
大阪ソーダ	10,300	7,090.00	73,027,000
関東電化工業	33,400	854.00	28,523,600
デンカ	62,900	2,809.00	176,686,100
信越化学工業	1,436,700	4,777.00	6,863,115,900
日本カーバイド工業	4,400	1,704.00	7,497,600
堺化学工業	13,200	2,052.00	27,086,400
第一稀元素化学工業	15,700	981.00	15,401,700
エア・ウォーター	163,100	1,863.50	303,936,850
日本酸素ホールディングス	167,700	3,580.00	600,366,000
日本化学工業	5,800	1,929.00	11,188,200
東邦アセチレン	2,400	1,584.00	3,801,600
日本パーカライズング	85,600	1,223.00	104,688,800
高压ガス工業	25,100	794.00	19,929,400
チタン工業	1,400	1,430.00	2,002,000
四国化成ホールディングス	22,200	1,469.00	32,611,800
戸田工業	3,900	2,011.00	7,842,900
ステラ ケミファ	10,200	3,245.00	33,099,000
保土谷化学工業	4,900	3,400.00	16,660,000
日本触媒	26,300	5,650.00	148,595,000
大日精化工業	12,000	2,361.00	28,332,000
カネカ	39,500	4,201.00	165,939,500
三菱瓦斯化学	129,100	2,075.50	267,947,050
三井化学	142,500	4,039.00	575,557,500
J S R	161,400	4,063.00	655,768,200
東京応化工業	27,500	10,075.00	277,062,500
大阪有機化学工業	14,500	2,697.00	39,106,500
三菱ケミカルグループ	1,166,300	903.50	1,053,752,050
K Hネオケム	28,600	2,321.00	66,380,600
ダイセル	240,700	1,289.00	310,262,300
住友ベークライト	25,600	7,039.00	180,198,400
積水化学工業	350,400	2,224.50	779,464,800
日本ゼオン	103,700	1,635.00	169,549,500
アイカ工業	43,600	3,486.00	151,989,600
U B E	89,100	2,531.50	225,556,650
積水樹脂	24,000	2,400.00	57,600,000
タキロンシーアイ	37,800	598.00	22,604,400
旭有機材	11,500	4,060.00	46,690,000
ニチバン	10,700	1,935.00	20,704,500
リケンテクノス	37,200	745.00	27,714,000

大倉工業	8,000	2,669.00	21,352,000
積水化成製品工業	24,300	467.00	11,348,100
群栄化学工業	4,100	3,510.00	14,391,000
タイガースポリマー	5,300	819.00	4,340,700
ミライアル	3,500	1,483.00	5,190,500
ダイキアクシス	4,800	739.00	3,547,200
ダイキョーニシカワ	38,100	840.00	32,004,000
竹本容器	4,400	817.00	3,594,800
森六ホールディングス	8,800	2,239.00	19,703,200
恵和	12,400	1,264.00	15,673,600
日本化薬	132,000	1,337.50	176,550,000
カーリットホールディングス	15,500	923.00	14,306,500
日本精化	9,800	2,552.00	25,009,600
扶桑化学工業	16,000	4,380.00	70,080,000
トリケミカル研究所	23,100	2,840.00	65,604,000
A D E K A	60,300	2,870.00	173,061,000
日油	53,500	6,682.00	357,487,000
新日本理化	15,900	234.00	3,720,600
ハリマ化成グループ	8,100	845.00	6,844,500
花王	390,800	5,675.00	2,217,790,000
第一工業製薬	6,200	1,716.00	10,639,200
石原ケミカル	7,900	1,666.00	13,161,400
日華化学	4,600	874.00	4,020,400
ニイタカ	2,100	2,011.00	4,223,100
三洋化成工業	10,600	4,175.00	44,255,000
有機合成薬品工業	8,500	298.00	2,533,000
大日本塗料	21,100	1,006.00	21,226,600
日本ペイントホールディングス	917,800	1,171.50	1,075,202,700
関西ペイント	138,600	2,368.50	328,274,100
神東塗料	9,600	139.00	1,334,400
中国塗料	28,400	1,463.00	41,549,200
日本特殊塗料	7,300	1,396.00	10,190,800
藤倉化成	23,200	475.00	11,020,000
太陽ホールディングス	26,300	2,659.00	69,931,700
D I C	67,500	2,534.50	171,078,750
サカタインクス	38,500	1,388.00	53,438,000
東洋インキ S C ホールディングス	37,600	2,299.00	86,442,400
T & K T O K A	15,500	1,409.00	21,839,500
富士フイルムホールディングス	332,100	8,800.00	2,922,480,000
資生堂	361,300	5,971.00	2,157,322,300
ライオン	226,500	1,579.50	357,756,750
高砂香料工業	11,700	3,005.00	35,158,500

マンダム	37,400	1,445.00	54,043,000
ミルボン	23,500	4,594.00	107,959,000
ファンケル	75,700	2,526.50	191,256,050
コーセー	35,200	11,880.00	418,176,000
コタ	15,900	1,654.00	26,298,600
シーボン	1,500	1,552.00	2,328,000
ポーラ・オルビスホールディングス	88,700	1,873.50	166,179,450
ノエビアホールディングス	15,400	5,720.00	88,088,000
アジュバンホールディングス	2,800	947.00	2,651,600
新日本製薬	9,900	1,651.00	16,344,900
アクシージア	8,800	1,161.00	10,216,800
エステー	13,400	1,551.00	20,783,400
アグロ カネショウ	6,900	1,466.00	10,115,400
コニシ	28,900	2,603.00	75,226,700
長谷川香料	33,100	3,530.00	116,843,000
星光PMC	7,000	767.00	5,369,000
小林製薬	50,400	7,227.00	364,240,800
荒川化学工業	14,700	1,050.00	15,435,000
メック	14,200	3,965.00	56,303,000
日本高純度化学	4,300	2,644.00	11,369,200
タカラバイオ	46,600	1,439.00	67,057,400
JCU	19,300	3,435.00	66,295,500
新田ゼラチン	7,100	730.00	5,183,000
OATアグリオ	4,300	1,826.00	7,851,800
デクセリアルズ	47,300	3,820.00	180,686,000
アース製薬	15,700	4,970.00	78,029,000
北興化学工業	17,400	926.00	16,112,400
大成ラミック	5,500	3,260.00	17,930,000
クミアイ化学工業	68,800	1,164.00	80,083,200
日本農薬	31,700	690.00	21,873,000
アキレス	10,900	1,521.00	16,578,900
有沢製作所	28,100	1,055.00	29,645,500
日東電工	125,600	10,300.00	1,293,680,000
レック	24,600	984.00	24,206,400
三光合成	21,800	739.00	16,110,200
きもと	17,000	187.00	3,179,000
藤森工業	13,700	3,905.00	53,498,500
前澤化成工業	11,200	1,530.00	17,136,000
未来工業	6,200	3,275.00	20,305,000
ウェーブロックホールディングス	3,400	668.00	2,271,200
JSP	12,200	2,022.00	24,668,400
エフピコ	32,700	2,789.50	91,216,650

天馬	14,100	2,632.00	37,111,200
信越ポリマー	32,000	1,403.00	44,896,000
東リ	25,900	356.00	9,220,400
ニフコ	62,400	4,398.00	274,435,200
バルカー	14,500	4,360.00	63,220,000
ユニ・チャーム	360,500	5,740.00	2,069,270,000
ショーエイコーポレーション	3,300	604.00	1,993,200
協和キリン	209,100	2,650.00	554,115,000
武田薬品工業	1,531,500	4,550.00	6,968,325,000
アステラス製薬	1,634,800	2,215.50	3,621,899,400
住友ファーマ	128,400	527.80	67,769,520
塩野義製薬	218,200	6,464.00	1,410,444,800
わかもと製薬	10,800	232.00	2,505,600
日本新薬	40,800	6,330.00	258,264,000
中外製薬	541,700	4,473.00	2,423,024,100
科研製薬	29,600	3,560.00	105,376,000
エーザイ	210,500	9,107.00	1,917,023,500
ロート製薬	167,600	3,805.00	637,718,000
小野薬品工業	333,900	2,769.50	924,736,050
久光製薬	38,500	5,093.00	196,080,500
持田製薬	19,900	3,415.00	67,958,500
参天製薬	315,300	1,372.50	432,749,250
扶桑薬品工業	5,500	2,114.00	11,627,000
日本ケミファ	1,200	1,886.00	2,263,200
ツムラ	54,500	2,801.00	152,654,500
キッセイ薬品工業	26,600	3,425.00	91,105,000
生化学工業	33,000	820.00	27,060,000
栄研化学	28,100	1,408.00	39,564,800
鳥居薬品	9,300	3,795.00	35,293,500
JCRファーマ	58,600	1,264.00	74,070,400
東和薬品	26,600	2,731.00	72,644,600
富士製薬工業	12,800	1,190.00	15,232,000
ゼリア新薬工業	24,000	2,468.00	59,232,000
そーせいグループ	59,100	1,680.00	99,288,000
第一三共	1,507,600	4,238.00	6,389,208,800
杏林製薬	37,500	1,791.00	67,162,500
大幸薬品	34,200	351.00	12,004,200
ダイト	13,310	2,381.00	31,691,110
大塚ホールディングス	360,000	5,535.00	1,992,600,000
大正製薬ホールディングス	38,500	6,157.00	237,044,500
ペプチドリーム	83,900	1,829.00	153,453,100
あすか製薬ホールディングス	17,700	1,717.00	30,390,900

サワイグループホールディングス	39,600	4,477.00	177,289,200
日本コークス工業	156,100	117.00	18,263,700
ニチレキ	20,400	2,071.00	42,248,400
ユシロ化学工業	9,000	1,491.00	13,419,000
ビーピー・カストロール	4,400	891.00	3,920,400
富士石油	35,300	319.00	11,260,700
MORESCO	3,800	1,200.00	4,560,000
出光興産	192,200	3,182.00	611,580,400
Eneosホールディングス	2,935,500	566.30	1,662,373,650
コスモエネルギーホールディングス	68,400	5,452.00	372,916,800
横浜ゴム	87,500	3,004.00	262,850,000
TOYO TIRE	99,400	2,187.50	217,437,500
ブリヂストン	506,600	5,709.00	2,892,179,400
住友ゴム工業	169,700	1,547.50	262,610,750
藤倉コンポジット	8,200	1,129.00	9,257,800
オカモト	9,300	4,825.00	44,872,500
フコク	9,100	1,496.00	13,613,600
ニッタ	17,600	3,455.00	60,808,000
住友理工	33,600	1,073.00	36,052,800
三ツ星ベルト	25,200	4,985.00	125,622,000
バンドー化学	27,300	1,570.00	42,861,000
日東紡績	19,500	3,840.00	74,880,000
AGC	161,500	5,198.00	839,477,000
日本板硝子	88,200	806.00	71,089,200
石塚硝子	1,900	2,421.00	4,599,900
日本山村硝子	4,500	1,786.00	8,037,000
日本電気硝子	70,700	2,633.50	186,188,450
オハラ	8,400	1,448.00	12,163,200
住友大阪セメント	24,400	4,005.00	97,722,000
太平洋セメント	110,300	2,791.00	307,847,300
日本ヒューム	15,400	902.00	13,890,800
日本コンクリート工業	34,200	340.00	11,628,000
三谷セキサン	7,300	5,150.00	37,595,000
アジアパイルホールディングス	27,400	682.00	18,686,800
東海カーボン	159,900	1,181.50	188,921,850
日本カーボン	9,900	4,495.00	44,500,500
東洋炭素	12,200	5,920.00	72,224,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,700	6,250.00	54,375,000
TOTO	114,300	4,069.00	465,086,700
日本碍子	201,300	1,959.00	394,346,700
日本特殊陶業	131,800	3,490.00	459,982,000
MARUWA	6,400	27,710.00	177,344,000

品川リフラクトリーズ	4,900	7,560.00	37,044,000
黒崎播磨	3,600	9,830.00	35,388,000
ヨータイ	9,500	1,526.00	14,497,000
東京窯業	11,200	350.00	3,920,000
ニッカトー	5,500	638.00	3,509,000
フジインコーポレーテッド	41,400	3,375.00	139,725,000
クニミネ工業	3,600	1,052.00	3,787,200
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,185.00	2,725,500
ニチアス	43,800	3,060.00	134,028,000
ニチハ	21,700	3,205.00	69,548,500
日本製鉄	797,200	3,631.00	2,894,633,200
神戸製鋼所	358,100	2,035.00	728,733,500
中山製鋼所	36,700	995.00	36,516,500
合同製鐵	8,900	4,755.00	42,319,500
J F E ホールディングス	475,800	2,289.00	1,089,106,200
東京製鐵	50,100	1,732.00	86,773,200
共英製鋼	20,300	2,087.00	42,366,100
大和工業	29,400	7,269.00	213,708,600
東京鐵鋼	8,500	3,895.00	33,107,500
大阪製鐵	8,200	1,816.00	14,891,200
淀川製鋼所	20,200	3,555.00	71,811,000
中部鋼板	14,600	2,276.00	33,229,600
丸一鋼管	54,200	3,829.00	207,531,800
モリ工業	2,700	3,720.00	10,044,000
大同特殊鋼	22,400	6,375.00	142,800,000
日本高周波鋼業	4,100	522.00	2,140,200
日本冶金工業	13,000	4,865.00	63,245,000
山陽特殊製鋼	17,600	2,926.00	51,497,600
愛知製鋼	10,300	4,280.00	44,084,000
日本金属	2,600	923.00	2,399,800
大平洋金属	12,700	1,645.00	20,891,500
新日本電工	105,800	287.00	30,364,600
栗本鐵工所	8,500	2,980.00	25,330,000
虹技	1,500	1,604.00	2,406,000
三菱製鋼	11,200	1,597.00	17,886,400
日亜鋼業	12,200	319.00	3,891,800
日本精線	2,400	4,885.00	11,724,000
エンビプロ・ホールディングス	8,200	621.00	5,092,200
シンニッタン	13,000	251.00	3,263,000
新家工業	2,600	2,832.00	7,363,200
大紀アルミニウム工業所	25,400	1,511.00	38,379,400
日本軽金属ホールディングス	48,100	1,623.00	78,066,300

三井金属鉱業	51,800	3,840.00	198,912,000
東邦亜鉛	10,600	1,737.00	18,412,200
三菱マテリアル	118,800	2,525.00	299,970,000
住友金属鉱山	206,400	4,659.00	961,617,600
DOWAホールディングス	40,000	4,841.00	193,640,000
古河機械金属	26,100	1,789.00	46,692,900
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,100	3,230.00	84,303,000
東邦チタニウム	32,200	2,022.00	65,108,400
UACJ	25,000	3,230.00	80,750,000
CKサンエツ	4,300	3,855.00	16,576,500
古河電気工業	59,300	2,561.00	151,867,300
住友電気工業	614,800	1,818.50	1,118,013,800
フジクラ	191,000	1,221.50	233,306,500
SWCC	19,900	2,018.00	40,158,200
タツタ電線	36,300	705.00	25,591,500
カナレ電気	2,100	1,437.00	3,017,700
平河ヒューテック	10,300	1,523.00	15,686,900
リョービ	19,000	2,840.00	53,960,000
アーレスティ	13,200	825.00	10,890,000
AREホールディングス	72,000	1,929.00	138,888,000
稲葉製作所	9,300	1,584.00	14,731,200
宮地エンジニアリンググループ	4,900	6,070.00	29,743,000
トーカロ	47,400	1,467.00	69,535,800
アルファCo	4,300	1,546.00	6,647,800
SUMCO	316,300	1,978.00	625,641,400
川田テクノロジーズ	4,200	6,140.00	25,788,000
RS Technologies	11,900	2,723.00	32,403,700
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,714.00	4,342,400
信和	6,600	792.00	5,227,200
東洋製罐グループホールディングス	106,200	2,607.00	276,863,400
ホッカンホールディングス	9,600	1,570.00	15,072,000
コロナ	9,900	929.00	9,197,100
横河ブリッジホールディングス	22,300	2,827.00	63,042,100
駒井ハルテック	1,900	1,882.00	3,575,800
高田機工	1,000	3,075.00	3,075,000
三和ホールディングス	164,000	2,284.50	374,658,000
文化シャッター	51,200	1,114.00	57,036,800
三協立山	20,400	943.00	19,237,200
アルインコ	13,600	1,098.00	14,932,800
東洋シャッター	2,700	648.00	1,749,600
LIXIL	259,400	1,855.00	481,187,000
日本フィルコン	7,700	482.00	3,711,400



ノーリツ	29,500	1,605.00	47,347,500
長府製作所	17,800	2,151.00	38,287,800
リンナイ	96,800	2,846.00	275,492,800
ダイニチ工業	5,900	743.00	4,383,700
日東精工	25,800	573.00	14,783,400
三洋工業	1,400	2,117.00	2,963,800
岡部	31,800	752.00	23,913,600
ジーテクト	19,800	1,873.00	37,085,400
東プレ	31,400	1,779.00	55,860,600
高周波熱錬	27,500	1,021.00	28,077,500
東京製綱	10,500	1,385.00	14,542,500
サンコール	10,500	508.00	5,334,000
モリテック スチール	8,700	342.00	2,975,400
パイオラックス	24,600	2,402.00	59,089,200
エイチワン	18,300	800.00	14,640,000
日本発條	157,500	1,148.50	180,888,750
中央発條	13,200	785.00	10,362,000
アドバネクス	1,400	1,063.00	1,488,200
立川ブラインド工業	8,000	1,420.00	11,360,000
三益半導体工業	13,700	2,902.00	39,757,400
日本ドライケミカル	2,800	2,082.00	5,829,600
日本製鋼所	48,000	3,036.00	145,728,000
三浦工業	72,800	3,356.00	244,316,800
タクマ	53,600	1,630.00	87,368,000
ツガミ	38,800	1,205.00	46,754,000
オークマ	17,400	6,981.00	121,469,400
芝浦機械	17,400	4,350.00	75,690,000
アマダ	278,100	1,550.50	431,194,050
アイダエンジニアリング	36,000	1,022.00	36,792,000
TAKISAWA	3,100	2,551.00	7,908,100
FUJI	75,800	2,469.00	187,150,200
牧野フライス製作所	19,300	7,060.00	136,258,000
オーエスジー	76,900	1,865.00	143,418,500
ダイジェット工業	1,300	929.00	1,207,700
旭ダイヤモンド工業	48,800	914.00	44,603,200
D M G 森精機	105,700	2,703.50	285,759,950
ソディック	45,800	738.00	33,800,400
ディスコ	83,900	28,110.00	2,358,429,000
日東工器	8,500	2,019.00	17,161,500
日進工具	14,600	1,160.00	16,936,000
パンチ工業	10,600	463.00	4,907,800
富士ダイス	5,500	680.00	3,740,000

豊和工業	6,500	815.00	5,297,500
東洋機械金属	8,100	713.00	5,775,300
エンシュウ	2,600	825.00	2,145,000
島精機製作所	27,800	1,950.00	54,210,000
オプトラン	28,700	2,007.00	57,600,900
NCホールディングス	2,400	1,863.00	4,471,200
イワキポンプ	11,600	1,872.00	21,715,200
フリー	18,300	1,657.00	30,323,100
ヤマシンフィルタ	41,800	348.00	14,546,400
日阪製作所	17,000	986.00	16,762,000
やまびこ	28,500	1,569.00	44,716,500
野村マイクロ・サイエンス	5,900	6,200.00	36,580,000
平田機工	8,300	8,090.00	67,147,000
PEGASUS	19,300	620.00	11,966,000
マルマエ	7,600	1,810.00	13,756,000
タツモ	10,600	2,965.00	31,429,000
ナプテスコ	109,400	2,815.50	308,015,700
三井海洋開発	22,100	1,794.00	39,647,400
レオン自動機	18,400	1,419.00	26,109,600
SMC	56,500	72,810.00	4,113,765,000
ホソカワミクロン	11,200	4,240.00	47,488,000
ユニオンツール	7,700	3,805.00	29,298,500
瑞光	12,600	1,363.00	17,173,800
オイレス工業	24,400	2,119.00	51,703,600
日精エー・エス・ビー機械	6,900	4,480.00	30,912,000
サトーホールディングス	24,800	2,091.00	51,856,800
技研製作所	16,400	2,114.00	34,669,600
日本エアーテック	8,800	1,266.00	11,140,800
カワタ	3,400	1,123.00	3,818,200
日精樹脂工業	13,000	1,083.00	14,079,000
オカダアイヨン	3,600	2,217.00	7,981,200
ワイエイシイホールディングス	4,900	2,707.00	13,264,300
小松製作所	816,600	4,300.00	3,511,380,000
住友重機械工業	103,100	3,777.00	389,408,700
日立建機	69,400	4,720.00	327,568,000
日工	26,000	681.00	17,706,000
巴工業	7,500	3,015.00	22,612,500
井関農機	16,400	1,231.00	20,188,400
TOWA	17,800	3,965.00	70,577,000
丸山製作所	2,000	2,255.00	4,510,000
北川鉄工所	6,900	1,500.00	10,350,000
ローツェ	9,100	11,690.00	106,379,000

タカキタ	3,400	497.00	1,689,800
クボタ	914,700	2,385.00	2,181,559,500
荏原実業	9,200	3,015.00	27,738,000
三菱化工機	5,700	2,805.00	15,988,500
月島ホールディングス	23,600	1,420.00	33,512,000
帝国電機製作所	12,300	2,681.00	32,976,300
新東工業	35,300	1,155.00	40,771,500
澁谷工業	16,400	2,668.00	43,755,200
アイチ コーポレーション	24,400	960.00	23,424,000
小森コーポレーション	40,500	1,134.00	45,927,000
鶴見製作所	13,300	3,090.00	41,097,000
日本ギア工業	4,000	433.00	1,732,000
酒井重工業	1,900	5,220.00	9,918,000
荏原製作所	71,500	7,455.00	533,032,500
石井鐵工所	1,400	3,000.00	4,200,000
西島製作所	15,100	1,972.00	29,777,200
北越工業	17,600	2,158.00	37,980,800
ダイキン工業	208,100	25,730.00	5,354,413,000
オルガノ	24,000	4,095.00	98,280,000
トーヨーカネツ	6,700	3,495.00	23,416,500
栗田工業	97,500	5,706.00	556,335,000
椿本チエイン	24,700	3,940.00	97,318,000
大同工業	4,800	748.00	3,590,400
木村化工機	13,400	750.00	10,050,000
アネスト岩田	29,700	1,266.00	37,600,200
ダイフク	269,600	2,750.50	741,534,800
サムコ	4,700	5,140.00	24,158,000
加藤製作所	5,500	1,295.00	7,122,500
油研工業	1,800	2,238.00	4,028,400
タダノ	100,400	1,229.00	123,391,600
フジテック	61,100	3,791.00	231,630,100
C K D	48,200	2,147.00	103,485,400
平和	58,000	2,253.00	130,674,000
理想科学工業	14,000	2,344.00	32,816,000
S A N K Y O	34,300	6,450.00	221,235,000
日本金銭機械	19,200	1,025.00	19,680,000
マースグループホールディングス	10,300	2,949.00	30,374,700
フクシマガリレイ	12,800	5,310.00	67,968,000
オーイズミ	4,500	430.00	1,935,000
ダイコク電機	9,600	5,760.00	55,296,000
竹内製作所	31,600	4,740.00	149,784,000
アマノ	49,500	3,251.00	160,924,500

JUKI	27,100	636.00	17,235,600
ジャノメ	17,700	655.00	11,593,500
マックス	21,500	2,793.00	60,049,500
グローリー	41,900	3,090.00	129,471,000
新晃工業	17,600	2,104.00	37,030,400
大和冷機工業	26,700	1,473.00	39,329,100
セガサミーホールディングス	140,100	2,849.50	399,214,950
日本ピストンリング	3,900	1,702.00	6,637,800
リケン	6,900	3,340.00	23,046,000
T P R	20,000	1,890.00	37,800,000
ツバキ・ナカシマ	42,800	830.00	35,524,000
ホシザキ	102,800	5,826.00	598,912,800
大豊工業	15,100	892.00	13,469,200
日本精工	320,200	863.10	276,364,620
N T N	343,600	297.80	102,324,080
ジェイテクト	155,100	1,385.50	214,891,050
不二越	12,900	4,070.00	52,503,000
日本トムソン	42,800	575.00	24,610,000
T H K	100,600	2,703.00	271,921,800
ユーシン精機	13,900	707.00	9,827,300
前澤給装工業	12,300	1,247.00	15,338,100
イーグル工業	19,300	1,757.00	33,910,100
前澤工業	6,700	1,023.00	6,854,100
日本ピラー工業	16,200	4,290.00	69,498,000
キッツ	63,900	1,072.00	68,500,800
マキタ	216,800	3,916.00	848,988,800
三井E & S	83,400	540.00	45,036,000
日立造船	142,900	877.00	125,323,300
三菱重工業	304,800	8,595.00	2,619,756,000
I H I	109,800	3,749.00	411,640,200
スター精密	32,900	1,906.00	62,707,400
日清紡ホールディングス	131,000	1,117.00	146,327,000
イビデン	100,000	8,911.00	891,100,000
コニカミノルタ	390,000	461.70	180,063,000
ブラザー工業	233,000	2,463.50	573,995,500
ミネベアミツミ	303,300	2,478.00	751,577,400
日立製作所	847,500	10,045.00	8,513,137,500
東芝	335,400	4,599.00	1,542,504,600
三菱電機	1,801,200	1,922.50	3,462,807,000
富士電機	106,000	6,926.00	734,156,000
東洋電機製造	3,800	1,037.00	3,940,600
安川電機	206,500	5,845.00	1,206,992,500

シンフォニアテクノロジー	19,200	1,632.00	31,334,400
明電舎	26,400	2,265.00	59,796,000
オリジン	2,600	1,274.00	3,312,400
山洋電気	7,600	7,290.00	55,404,000
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	1,525.00	37,515,000
ソシオネクスト	24,700	16,370.00	404,339,000
東芝テック	26,000	3,530.00	91,780,000
芝浦メカトロニクス	3,000	24,110.00	72,330,000
マブチモーター	43,400	4,555.00	197,687,000
ニデック	424,100	7,654.00	3,246,061,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,500	511.00	6,898,500
トレックス・セミコンダクター	8,400	2,425.00	20,370,000
東光高岳	10,700	2,295.00	24,556,500
ダブル・スコープ	56,700	1,173.00	66,509,100
ダイヘン	15,700	5,450.00	85,565,000
ヤーマン	30,500	1,050.00	32,025,000
J V C ケンウッド	159,300	665.00	105,934,500
ミマキエンジニアリング	17,000	767.00	13,039,000
I - P E X	12,300	1,668.00	20,516,400
大崎電気工業	41,300	650.00	26,845,000
オムロン	159,700	7,124.00	1,137,702,800
日東工業	23,500	3,955.00	92,942,500
I D E C	25,700	3,170.00	81,469,000
正興電機製作所	4,200	1,142.00	4,796,400
不二電機工業	2,600	1,152.00	2,995,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,300	2,806.00	160,783,800
サクサホールディングス	2,400	2,572.00	6,172,800
メルコホールディングス	4,500	3,210.00	14,445,000
テクノメディカ	4,400	2,168.00	9,539,200
日本電気	246,500	7,925.00	1,953,512,500
富士通	173,600	18,650.00	3,237,640,000
沖電気工業	78,800	1,060.00	83,528,000
岩崎通信機	5,100	833.00	4,248,300
電気興業	7,000	2,481.00	17,367,000
サンケン電気	16,200	11,310.00	183,222,000
ナカヨ	1,900	1,269.00	2,411,100
アイホン	10,600	3,015.00	31,959,000
ルネサスエレクトロニクス	1,137,500	2,432.50	2,766,968,750
セイコーエプソン	223,600	2,299.00	514,056,400
ワコム	133,100	613.00	81,590,300
アルバック	41,400	5,809.00	240,492,600

アクセル	4,600	1,853.00	8,523,800
E I Z O	12,800	5,240.00	67,072,000
日本信号	39,700	972.00	38,588,400
京三製作所	36,500	461.00	16,826,500
能美防災	23,800	1,817.00	43,244,600
ホーチキ	13,200	1,694.00	22,360,800
星和電機	5,900	497.00	2,932,300
エレコム	41,900	1,786.00	74,833,400
パナソニック ホールディングス	2,058,400	1,728.50	3,557,944,400
シャープ	209,800	950.00	199,310,000
アンリツ	122,700	1,102.50	135,276,750
富士通ゼネラル	49,400	2,841.00	140,345,400
ソニーグループ	1,220,600	12,480.00	15,233,088,000
T D K	276,000	5,404.00	1,491,504,000
帝国通信工業	8,100	1,904.00	15,422,400
タムラ製作所	74,800	591.00	44,206,800
アルプスアルパイン	155,900	1,237.00	192,848,300
池上通信機	3,700	739.00	2,734,300
日本電波工業	21,100	1,528.00	32,240,800
鈴木	9,700	1,138.00	11,038,600
メイコー	19,100	3,550.00	67,805,000
日本トリム	4,000	3,145.00	12,580,000
ローランド ディー . ジー .	9,600	3,555.00	34,128,000
フォスター電機	16,100	903.00	14,538,300
S M K	4,200	2,574.00	10,810,800
ヨコオ	14,100	1,703.00	24,012,300
ホシデン	40,900	1,867.00	76,360,300
ヒロセ電機	28,100	17,735.00	498,353,500
日本航空電子工業	35,700	3,155.00	112,633,500
T O A	19,800	1,076.00	21,304,800
マクセル	35,500	1,637.00	58,113,500
古野電気	22,900	1,338.00	30,640,200
スミダコーポレーション	23,500	1,701.00	39,973,500
アイコム	6,700	3,425.00	22,947,500
リオン	7,300	2,300.00	16,790,000
横河電機	190,700	2,968.50	566,092,950
新電元工業	6,700	3,210.00	21,507,000
アズビル	120,500	4,911.00	591,775,500
東亜ディーケーケー	5,800	888.00	5,150,400
日本光電工業	79,800	3,892.00	310,581,600
チノー	7,200	2,110.00	15,192,000
共和電業	10,800	367.00	3,963,600

日本電子材料	11,400	1,557.00	17,749,800
堀場製作所	32,900	7,736.00	254,514,400
アドバンテクト	136,000	17,950.00	2,441,200,000
小野測器	5,500	458.00	2,519,000
エスベック	14,000	2,434.00	34,076,000
キーエンス	172,600	60,500.00	10,442,300,000
日置電機	9,000	7,810.00	70,290,000
シスメックス	148,900	7,852.00	1,169,162,800
日本マイクロニクス	31,200	2,270.00	70,824,000
メガチップス	14,300	4,250.00	60,775,000
O B A R A G R O U P	9,500	4,100.00	38,950,000
澤藤電機	1,600	1,313.00	2,100,800
原田工業	5,500	830.00	4,565,000
コーセル	21,000	1,335.00	28,035,000
イリソ電子工業	15,900	4,485.00	71,311,500
オブテックスグループ	31,900	1,792.00	57,164,800
千代田インテグレ	6,900	2,904.00	20,037,600
レーザーテック	79,100	22,425.00	1,773,817,500
スタンレー電気	122,200	2,560.00	312,832,000
ウシオ電機	87,900	1,919.50	168,724,050
岡谷電機産業	10,200	323.00	3,294,600
ヘリオス テクノ ホールディング	11,400	451.00	5,141,400
エノモト	3,100	1,743.00	5,403,300
日本セラミック	17,600	2,598.00	45,724,800
遠藤照明	5,400	1,298.00	7,009,200
古河電池	13,100	995.00	13,034,500
双信電機	5,700	345.00	1,966,500
山一電機	14,300	1,820.00	26,026,000
図研	15,100	4,410.00	66,591,000
日本電子	43,300	4,716.00	204,202,800
カシオ計算機	128,500	1,291.50	165,957,750
ファナック	841,400	4,196.00	3,530,514,400
日本シイエムケイ	37,300	630.00	23,499,000
エンプラス	5,100	10,710.00	54,621,000
大真空	21,500	805.00	17,307,500
ローム	79,800	12,000.00	957,600,000
浜松ホトニクス	138,500	6,675.00	924,487,500
三井ハイテック	17,900	9,920.00	177,568,000
新光電気工業	61,100	5,950.00	363,545,000
京セラ	268,100	7,559.00	2,026,567,900
太陽誘電	84,100	4,330.00	364,153,000
村田製作所	523,300	8,458.00	4,426,071,400

双葉電子工業	33,500	580.00	19,430,000
北陸電気工業	4,600	1,440.00	6,624,000
ニチコン	35,500	1,405.00	49,877,500
日本ケミコン	17,300	1,445.00	24,998,500
K O A	26,300	1,898.00	49,917,400
市光工業	31,800	550.00	17,490,000
小糸製作所	207,700	2,457.50	510,422,750
ミツバ	32,400	792.00	25,660,800
S C R E E Nホールディングス	29,500	14,755.00	435,272,500
キャノン電子	19,300	1,858.00	35,859,400
キャノン	860,600	3,600.00	3,098,160,000
リコー	432,600	1,215.50	525,825,300
象印マホービン	51,400	1,880.00	96,632,000
M U T O Hホールディングス	1,800	1,963.00	3,533,400
東京エレクトロン	365,200	21,695.00	7,923,014,000
イノテック	11,700	1,603.00	18,755,100
トヨタ紡織	72,700	2,795.50	203,232,850
芦森工業	2,200	2,180.00	4,796,000
ユニプレス	31,100	1,239.00	38,532,900
豊田自動織機	126,200	10,555.00	1,332,041,000
モリタホールディングス	30,400	1,663.00	50,555,200
三櫻工業	26,500	985.00	26,102,500
デンソー	355,900	10,200.00	3,630,180,000
東海理化電機製作所	48,700	2,380.00	115,906,000
川崎重工業	130,000	3,851.00	500,630,000
名村造船所	29,500	1,020.00	30,090,000
日本車輛製造	6,600	2,058.00	13,582,800
三菱ロジスネクスト	27,500	1,365.00	37,537,500
近畿車輛	1,600	2,018.00	3,228,800
日産自動車	2,451,100	633.00	1,551,546,300
いすゞ自動車	501,700	1,915.50	961,006,350
トヨタ自動車	9,474,700	2,589.00	24,529,998,300
日野自動車	222,500	576.30	128,226,750
三菱自動車工業	673,100	573.90	386,292,090
エフテック	8,200	838.00	6,871,600
レシップホールディングス	4,500	546.00	2,457,000
G M B	2,300	1,971.00	4,533,300
ファルテック	2,000	585.00	1,170,000
武蔵精密工業	42,200	1,750.00	73,850,000
日産車体	30,400	934.00	28,393,600
新明和工業	54,200	1,422.00	77,072,400
極東開発工業	28,500	1,833.00	52,240,500



トピー工業	14,000	2,440.00	34,160,000
ティラド	4,400	2,226.00	9,794,400
曙ブレーキ工業	105,300	139.00	14,636,700
タチエス	27,400	1,833.00	50,224,200
NOK	67,100	2,075.00	139,232,500
フタバ産業	46,500	724.00	33,666,000
KYB	16,600	4,960.00	82,336,000
大同メタル工業	34,000	543.00	18,462,000
プレス工業	77,300	683.00	52,795,900
ミクニ	13,500	490.00	6,615,000
太平洋工業	39,700	1,488.00	59,073,600
アイシン	133,100	4,932.00	656,449,200
マツダ	570,800	1,605.00	916,134,000
今仙電機製作所	7,500	679.00	5,092,500
本田技研工業	1,402,600	4,867.00	6,826,454,200
スズキ	316,900	5,958.00	1,888,090,200
SUBARU	546,000	2,893.50	1,579,851,000
安永	5,200	854.00	4,440,800
ヤマハ発動機	248,600	3,881.00	964,816,600
TBK	11,700	418.00	4,890,600
エクセディ	28,300	2,711.00	76,721,300
豊田合成	50,400	3,290.00	165,816,000
愛三工業	28,600	1,336.00	38,209,600
盟和産業	1,800	1,026.00	1,846,800
日本プラスト	9,300	483.00	4,491,900
ヨロズ	16,300	932.00	15,191,600
エフ・シー・シー	30,600	1,946.00	59,547,600
シマノ	70,100	21,840.00	1,530,984,000
テイ・エス テック	79,100	1,744.00	137,950,400
ジャムコ	6,300	1,595.00	10,048,500
テルモ	530,700	4,370.00	2,319,159,000
クリエートメディック	3,800	928.00	3,526,400
日機装	40,200	1,025.00	41,205,000
日本エム・ディ・エム	10,300	778.00	8,013,400
島津製作所	210,200	4,332.00	910,586,400
JMS	16,000	552.00	8,832,000
長野計器	12,500	2,629.00	32,862,500
ブイ・テクノロジー	8,400	2,400.00	20,160,000
東京計器	13,200	1,546.00	20,407,200
愛知時計電機	6,700	1,686.00	11,296,200
インターアクション	8,200	1,096.00	8,987,200
オーバル	10,200	450.00	4,590,000

東京精密	37,900	7,920.00	300,168,000
マニー	69,000	1,911.00	131,859,000
ニコン	249,500	1,581.50	394,584,250
トプコン	90,800	1,790.50	162,577,400
オリンパス	1,062,100	2,022.50	2,148,097,250
理研計器	10,700	5,500.00	58,850,000
タムロン	12,800	4,425.00	56,640,000
H O Y A	365,600	16,805.00	6,143,908,000
シード	5,800	794.00	4,605,200
ノーリツ鋼機	16,400	3,135.00	51,414,000
A & Dホロンホールディングス	25,200	1,783.00	44,931,600
朝日インテック	192,800	2,937.00	566,253,600
シチズン時計	158,800	919.00	145,937,200
リズム	3,600	1,748.00	6,292,800
大研医器	8,700	555.00	4,828,500
メニコン	59,300	2,125.00	126,012,500
シンシア	1,400	562.00	786,800
松風	7,800	2,226.00	17,362,800
セイコーグループ	26,700	2,728.00	72,837,600
ニプロ	143,800	1,212.00	174,285,600
K Y O R I T S U	17,200	189.00	3,250,800
中本パックス	3,500	1,678.00	5,873,000
スノーピーク	29,400	1,543.00	45,364,200
パラマウントベッドホールディングス	39,800	2,396.00	95,360,800
トランザクション	11,400	1,958.00	22,321,200
粧美堂	3,100	506.00	1,568,600
ニホンフラッシュ	16,200	925.00	14,985,000
前田工織	14,600	3,065.00	44,749,000
永大産業	12,200	222.00	2,708,400
アートネイチャー	17,800	787.00	14,008,600
バンダイナムコホールディングス	472,700	3,408.00	1,610,961,600
アイフィスジャパン	3,200	600.00	1,920,000
S H O E I	39,000	2,448.00	95,472,000
フランスベッドホールディングス	19,800	1,228.00	24,314,400
パイロットコーポレーション	24,300	4,704.00	114,307,200
萩原工業	11,500	1,725.00	19,837,500
フジシールインターナショナル	34,900	1,794.00	62,610,600
タカラトミー	78,900	2,411.00	190,227,900
広済堂ホールディングス	7,700	2,603.00	20,043,100
エステールホールディングス	2,700	639.00	1,725,300
タカノ	4,300	918.00	3,947,400
プロネクサス	14,300	1,117.00	15,973,100

ホクシン	8,800	136.00	1,196,800
ウッドワン	3,800	1,088.00	4,134,400
大建工業	10,500	3,045.00	31,972,500
凸版印刷	212,100	3,635.00	770,983,500
大日本印刷	188,600	4,056.00	764,961,600
共同印刷	4,900	3,320.00	16,268,000
N I S S H A	32,600	1,770.00	57,702,000
光村印刷	1,000	1,305.00	1,305,000
TAKARA & COMPANY	11,000	2,419.00	26,609,000
アシックス	147,000	5,402.00	794,094,000
ツツミ	3,000	2,527.00	7,581,000
ローランド	12,700	4,015.00	50,990,500
小松ウオール工業	6,300	2,977.00	18,755,100
ヤマハ	108,800	4,548.00	494,822,400
河合楽器製作所	4,700	3,445.00	16,191,500
クリナップ	19,300	728.00	14,050,400
ピジョン	109,900	1,709.00	187,819,100
キングジム	15,200	880.00	13,376,000
リンテック	34,600	2,484.50	85,963,700
イトーキ	35,400	1,446.00	51,188,400
任天堂	1,089,400	6,274.00	6,834,895,600
三菱鉛筆	24,500	1,924.00	47,138,000
タカラスタANDARD	31,800	1,905.00	60,579,000
コクヨ	74,800	2,366.00	176,976,800
ナカバヤシ	18,600	554.00	10,304,400
グローブライド	13,900	2,087.00	29,009,300
オカムラ	51,900	2,244.00	116,463,600
美津濃	17,100	4,720.00	80,712,000
東京電力ホールディングス	1,555,400	631.90	982,857,260
中部電力	635,800	1,937.00	1,231,544,600
関西電力	666,300	2,124.00	1,415,221,200
中国電力	274,800	951.70	261,527,160
北陸電力	162,900	839.90	136,819,710
東北電力	421,800	1,014.00	427,705,200
四国電力	147,300	1,040.00	153,192,000
九州電力	397,800	976.10	388,292,580
北海道電力	166,700	661.90	110,338,730
沖縄電力	40,400	1,148.00	46,379,200
電源開発	129,900	2,330.00	302,667,000
エフオン	11,200	529.00	5,924,800
イーレックス	30,700	904.00	27,752,800
レノバ	46,000	1,457.00	67,022,000

東京瓦斯	364,800	3,474.00	1,267,315,200
大阪瓦斯	349,500	2,389.50	835,130,250
東邦瓦斯	67,900	2,689.50	182,617,050
北海道瓦斯	10,300	2,411.00	24,833,300
広島ガス	36,400	396.00	14,414,400
西部ガスホールディングス	16,200	2,074.00	33,598,800
静岡ガス	39,100	1,038.00	40,585,800
メタウォーター	20,700	1,948.00	40,323,600
SBSホールディングス	15,400	3,085.00	47,509,000
東武鉄道	189,500	4,031.00	763,874,500
相鉄ホールディングス	57,000	2,879.50	164,131,500
東急	483,800	1,843.00	891,643,400
京浜急行電鉄	195,700	1,355.50	265,271,350
小田急電鉄	261,600	2,201.00	575,781,600
京王電鉄	91,200	5,071.00	462,475,200
京成電鉄	111,300	5,630.00	626,619,000
富士急行	21,200	5,350.00	113,420,000
東日本旅客鉄道	292,600	8,256.00	2,415,705,600
西日本旅客鉄道	220,400	6,439.00	1,419,155,600
東海旅客鉄道	132,900	18,835.00	2,503,171,500
西武ホールディングス	208,700	1,548.00	323,067,600
鴻池運輸	29,400	2,097.00	61,651,800
西日本鉄道	46,100	2,687.50	123,893,750
ハマキョウレックス	13,500	4,205.00	56,767,500
サカイ引越センター	8,200	5,560.00	45,592,000
近鉄グループホールディングス	172,200	4,610.00	793,842,000
阪急阪神ホールディングス	229,700	5,357.00	1,230,502,900
南海電気鉄道	82,300	3,066.00	252,331,800
京阪ホールディングス	94,900	4,154.00	394,214,600
神戸電鉄	4,700	3,095.00	14,546,500
名古屋鉄道	190,400	2,379.00	452,961,600
山陽電気鉄道	13,000	2,260.00	29,380,000
アルプス物流	13,700	1,583.00	21,687,100
ヤマトホールディングス	220,600	2,750.00	606,650,000
山九	43,800	5,284.00	231,439,200
丸運	5,600	255.00	1,428,000
丸全昭和運輸	10,600	4,045.00	42,877,000
センコーグループホールディングス	91,200	1,068.00	97,401,600
トナミホールディングス	3,800	4,955.00	18,829,000
ニッコンホールディングス	55,100	3,310.00	182,381,000
日本石油輸送	1,200	2,626.00	3,151,200
福山通運	13,100	3,780.00	49,518,000

セイノーホールディングス	96,900	2,161.00	209,400,900
エスライングループ本社	3,200	886.00	2,835,200
神奈川中央交通	4,900	3,330.00	16,317,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	41,600	2,296.00	95,513,600
C & F ロジホールディングス	16,600	1,464.00	24,302,400
九州旅客鉄道	121,800	3,199.00	389,638,200
S Gホールディングス	330,600	2,156.00	712,773,600
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	58,500	7,731.00	452,263,500
日本郵船	461,200	4,077.00	1,880,312,400
商船三井	304,000	4,292.00	1,304,768,000
川崎汽船	129,700	5,456.00	707,643,200
N S ユナイテッド海運	9,600	4,250.00	40,800,000
飯野海運	64,400	1,101.00	70,904,400
共栄タンカー	3,500	863.00	3,020,500
乾汽船	22,800	1,278.00	29,138,400
日本航空	423,100	3,015.00	1,275,646,500
A N Aホールディングス	468,700	3,309.00	1,550,928,300
パスコ	2,200	1,703.00	3,746,600
トランコム	5,000	7,720.00	38,600,000
日新	13,100	2,735.00	35,828,500
三菱倉庫	37,000	3,997.00	147,889,000
三井倉庫ホールディングス	16,100	4,235.00	68,183,500
住友倉庫	46,500	2,558.00	118,947,000
澁澤倉庫	6,900	3,240.00	22,356,000
東陽倉庫	15,200	288.00	4,377,600
日本トランスシティ	34,700	666.00	23,110,200
ケイヒン	2,000	1,848.00	3,696,000
中央倉庫	8,300	1,144.00	9,495,200
川西倉庫	1,900	1,085.00	2,061,500
安田倉庫	11,800	1,069.00	12,614,200
ファイズホールディングス	2,100	1,202.00	2,524,200
東洋埠頭	3,300	1,481.00	4,887,300
上組	82,600	3,368.00	278,196,800
サンリツ	2,600	736.00	1,913,600
キムラユニティー	5,500	1,446.00	7,953,000
キューソー流通システム	5,900	978.00	5,770,200
東海運	6,700	288.00	1,929,600
エーアイティー	10,800	1,826.00	19,720,800
内外トランスライン	6,900	2,689.00	18,554,100
日本コンセプト	6,300	1,873.00	11,799,900
N E C ネットズエスアイ	57,800	2,000.00	115,600,000
クロスキャット	9,900	1,086.00	10,751,400

システナ	291,100	284.00	82,672,400
デジタルアーツ	11,000	4,865.00	53,515,000
日鉄ソリューションズ	29,500	4,030.00	118,885,000
キューブシステム	10,300	1,206.00	12,421,800
コア	7,700	1,786.00	13,752,200
手間いらず	2,900	3,325.00	9,642,500
ラクーンホールディングス	14,400	780.00	11,232,000
ソリトンシステムズ	9,000	1,195.00	10,755,000
ソフトクリエイイトホールディングス	14,200	1,765.00	25,063,000
T I S	189,300	3,397.00	643,052,100
J N Sホールディングス	5,400	464.00	2,505,600
グリー	46,500	619.00	28,783,500
G M Oペパボ	2,500	1,386.00	3,465,000
コーエーテクモホールディングス	108,500	2,255.00	244,667,500
三菱総合研究所	8,500	5,130.00	43,605,000
電算	1,400	1,590.00	2,226,000
A G S	4,900	736.00	3,606,400
ファインデックス	13,800	722.00	9,963,600
ブレインパッド	13,000	920.00	11,960,000
K L a b	34,300	288.00	9,878,400
ポールトゥウィンホールディングス	29,600	698.00	20,660,800
ネクソン	385,800	2,952.00	1,138,881,600
アイスタイル	51,400	503.00	25,854,200
エムアップホールディングス	21,200	1,512.00	32,054,400
エイチーム	10,300	696.00	7,168,800
エニグモ	22,100	395.00	8,729,500
テクノスジャパン	9,500	740.00	7,030,000
コロブラ	67,200	651.00	43,747,200
ブロードリーフ	100,600	526.00	52,915,600
クロス・マーケティンググループ	7,000	740.00	5,180,000
デジタルハーツホールディングス	10,800	1,141.00	12,322,800
システム情報	13,800	767.00	10,584,600
メディアドゥ	6,900	1,222.00	8,431,800
じげん	50,500	613.00	30,956,500
ブイキューブ	20,800	428.00	8,902,400
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	508.00	1,422,400
サイバーリンクス	4,500	729.00	3,280,500
フィックスターズ	19,600	1,256.00	24,617,600
C A R T A H O L D I N G S	8,200	1,248.00	10,233,600
オブティム	14,300	884.00	12,641,200
セレス	7,000	1,005.00	7,035,000
S H I F T	11,500	29,405.00	338,157,500

ティーガイア	18,100	1,800.00	32,580,000
セック	1,600	3,365.00	5,384,000
テクマトリックス	31,600	1,668.00	52,708,800
プロシップ	7,600	1,288.00	9,788,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,100	2,385.00	107,563,500
GMOペイメントゲートウェイ	34,600	9,350.00	323,510,000
ザッパラス	3,300	492.00	1,623,600
システムリサーチ	5,400	2,665.00	14,391,000
インターネットイニシアティブ	94,600	2,557.50	241,939,500
さくらインターネット	19,500	1,280.00	24,960,000
ヴィンクス	2,800	1,310.00	3,668,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	3,095.00	16,403,500
SRAホールディングス	8,900	3,500.00	31,150,000
システムインテグレータ	3,500	429.00	1,501,500
朝日ネット	18,600	637.00	11,848,200
eBASE	24,400	720.00	17,568,000
アバントグループ	21,900	1,423.00	31,163,700
アドソル日進	7,300	1,780.00	12,994,000
ODKソリューションズ	2,600	598.00	1,554,800
フリービット	9,100	1,216.00	11,065,600
コムチュア	22,900	2,482.00	56,837,800
サイバーコム	1,900	1,336.00	2,538,400
アステリア	13,600	788.00	10,716,800
アイル	8,100	2,900.00	23,490,000
マークライنز	9,400	3,140.00	29,516,000
メディカル・データ・ビジョン	25,700	785.00	20,174,500
gumi	25,600	584.00	14,950,400
ショーケース	2,800	392.00	1,097,600
モバイルファクトリー	2,500	825.00	2,062,500
テラスカイ	7,500	2,146.00	16,095,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,000	1,840.00	18,400,000
PCIホールディングス	4,400	1,090.00	4,796,000
アイビーシー	1,800	619.00	1,114,200
ネオジャパン	5,800	1,119.00	6,490,200
PR TIMES	4,400	1,744.00	7,673,600
ラクス	81,900	2,333.00	191,072,700
ランドコンピュータ	2,800	1,228.00	3,438,400
ダブルスタンダード	7,000	1,475.00	10,325,000
オープンドア	12,100	1,109.00	13,418,900
アカツキ	8,200	2,131.00	17,474,200
ベネフィットジャパン	700	1,216.00	851,200
Ubicomホールディングス	5,400	1,367.00	7,381,800

カナミックネットワーク	18,700	517.00	9,667,900
ノムラシステムコーポレーション	12,900	117.00	1,509,300
チェンジホールディングス	42,400	2,074.00	87,937,600
シンクロ・フード	7,400	587.00	4,343,800
オークネット	8,500	1,869.00	15,886,500
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	870.00	2,001,000
セグエグループ	3,700	960.00	3,552,000
エイトレッド	1,800	1,497.00	2,694,600
マクロミル	34,000	767.00	26,078,000
ビーグリー	2,500	1,139.00	2,847,500
オロ	6,300	2,120.00	13,356,000
ユーザーローカル	6,300	1,940.00	12,222,000
テモナ	2,800	300.00	840,000
ニーズウェル	6,400	726.00	4,646,400
マネーフォワード	38,400	5,450.00	209,280,000
サインポスト	4,500	448.00	2,016,000
Sun Asterisk	12,300	1,413.00	17,379,900
プラスアルファ・コンサルティング	10,000	2,802.00	28,020,000
電算システムホールディングス	8,300	3,055.00	25,356,500
Appier Group	59,100	1,837.00	108,566,700
ソルクシーズ	9,400	426.00	4,004,400
フェイス	3,300	500.00	1,650,000
プロトコーポレーション	21,700	1,227.00	26,625,900
ハイマックス	5,400	1,475.00	7,965,000
野村総合研究所	344,800	4,226.00	1,457,124,800
サイバネットシステム	14,500	759.00	11,005,500
CEホールディングス	6,000	592.00	3,552,000
日本システム技術	4,800	2,281.00	10,948,800
インタージホールディングス	19,600	1,870.00	36,652,000
東邦システムサイエンス	4,800	1,405.00	6,744,000
ソースネクスト	88,200	184.00	16,228,800
インフォコム	22,300	2,864.00	63,867,200
シンプレクス・ホールディングス	29,700	2,939.00	87,288,300
HEROZ	5,800	1,784.00	10,347,200
ラクスル	41,500	1,435.00	59,552,500
メルカリ	104,700	3,204.00	335,458,800
I P S	5,600	2,298.00	12,868,800
F I G	13,500	303.00	4,090,500
システムサポート	6,700	2,093.00	14,023,100
イーソル	12,500	810.00	10,125,000
東海ソフト	1,800	1,104.00	1,987,200
ウイングアーク1st	17,900	2,576.00	46,110,400



ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,600	1,407.00	6,472,200
サーバーワークス	3,500	3,650.00	12,775,000
東名	900	2,301.00	2,070,900
ヴィッツ	1,200	1,121.00	1,345,200
トピラスシステムズ	3,300	1,010.00	3,333,000
S a n s a n	56,700	1,388.00	78,699,600
L i n k - U	2,800	926.00	2,592,800
ギフトィ	18,800	1,654.00	31,095,200
メドレー	23,200	5,790.00	134,328,000
ベース	5,900	4,600.00	27,140,000
J M D C	28,500	4,631.00	131,983,500
フォーカスシステムズ	12,700	1,000.00	12,700,000
クレスコ	13,400	1,930.00	25,862,000
フジ・メディア・ホールディングス	166,300	1,557.00	258,929,100
オービック	57,800	25,110.00	1,451,358,000
ジャストシステム	24,900	3,107.00	77,364,300
T D C ソフト	14,600	1,757.00	25,652,200
Zホールディングス	2,462,900	443.30	1,091,803,570
トレンドマイクロ	81,800	6,145.00	502,661,000
I Dホールディングス	11,700	1,424.00	16,660,800
日本オラクル	33,100	10,115.00	334,806,500
アルファシステムズ	5,500	3,225.00	17,737,500
フューチャー	36,900	1,554.00	57,342,600
C A C H o l d i n g s	10,600	1,744.00	18,486,400
S B テクノロジー	7,400	2,420.00	17,908,000
トーセ	3,400	742.00	2,522,800
オービックビジネスコンサルタント	34,100	6,180.00	210,738,000
伊藤忠テクノソリューションズ	92,900	4,321.00	401,420,900
アイティフォー	22,800	1,088.00	24,806,400
東計電算	2,400	6,660.00	15,984,000
エクスネット	1,600	1,053.00	1,684,800
大塚商会	85,800	6,477.00	555,726,600
サイボウズ	23,800	2,174.00	51,741,200
電通国際情報サービス	21,000	5,860.00	123,060,000
A C C E S S	20,500	867.00	17,773,500
デジタルガレージ	30,700	3,775.00	115,892,500
E M システムズ	28,900	751.00	21,703,900
ウェザーニューズ	5,400	6,440.00	34,776,000
C I J	28,800	580.00	16,704,000
ビジネスエンジニアリング	2,500	3,380.00	8,450,000
日本エンタープライズ	12,200	135.00	1,647,000
WOWOW	13,100	1,169.00	15,313,900

スカラ	16,100	758.00	12,203,800
インテリジェント ウェイブ	6,200	917.00	5,685,400
ANYCOLOR	6,000	3,705.00	22,230,000
IMAGICA GROUP	14,500	615.00	8,917,500
ネットワンシステムズ	64,500	2,867.50	184,953,750
システムソフト	60,700	82.00	4,977,400
アルゴグラフィックス	15,900	3,435.00	54,616,500
マーベラス	28,200	696.00	19,627,200
エイベックス	29,400	1,477.00	43,423,800
BIPROGY	63,700	3,803.00	242,251,100
都築電気	9,100	2,413.00	21,958,300
TBSホールディングス	88,600	2,652.50	235,011,500
日本テレビホールディングス	153,200	1,356.00	207,739,200
朝日放送グループホールディングス	16,300	680.00	11,084,000
テレビ朝日ホールディングス	42,000	1,720.00	72,240,000
スカパーJ SATホールディングス	153,600	672.00	103,219,200
テレビ東京ホールディングス	12,500	3,165.00	39,562,500
日本BS放送	4,200	908.00	3,813,600
ビジョン	26,100	1,659.00	43,299,900
スマートバリュー	2,900	392.00	1,136,800
USEN-NEXT HOLDINGS	19,400	3,555.00	68,967,000
ワイヤレスゲート	5,200	218.00	1,133,600
日本通信	159,900	226.00	36,137,400
クロップス	1,900	1,010.00	1,919,000
日本電信電話	55,437,200	168.00	9,313,449,600
KDDI	1,337,300	4,367.00	5,839,989,100
ソフトバンク	2,781,400	1,677.50	4,665,798,500
光通信	20,300	24,590.00	499,177,000
エムティーアイ	11,900	597.00	7,104,300
GMOインターネットグループ	64,000	2,392.00	153,088,000
ファイバーゲート	9,300	1,519.00	14,126,700
アйдママーケティングコミュニケーション	2,800	266.00	744,800
KADOKAWA	91,500	3,329.00	304,603,500
学研ホールディングス	28,800	872.00	25,113,600
ゼンリン	29,600	925.00	27,380,000
昭文社ホールディングス	5,100	310.00	1,581,000
インプレスホールディングス	10,300	188.00	1,936,400
アイネット	10,500	1,797.00	18,868,500
松竹	9,900	11,080.00	109,692,000
東宝	108,300	5,590.00	605,397,000
東映	4,800	18,490.00	88,752,000
NTTデータグループ	543,000	1,976.50	1,073,239,500

ピー・シー・エー	10,000	1,266.00	12,660,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,180.00	16,132,000
D T S	36,900	3,310.00	122,139,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	87,000	5,534.00	481,458,000
シーイーシー	24,300	1,793.00	43,569,900
カプコン	172,000	6,222.00	1,070,184,000
アイ・エス・ビー	8,900	1,414.00	12,584,600
ジャステック	10,600	1,468.00	15,560,800
S C S K	141,300	2,561.50	361,939,950
N S W	6,700	2,950.00	19,765,000
アイネス	12,200	1,703.00	20,776,600
T K C	27,600	3,720.00	102,672,000
富士ソフト	34,800	4,485.00	156,078,000
N S D	61,800	2,480.00	153,264,000
コナミグループ	74,100	8,453.00	626,367,300
福井コンピュータホールディングス	12,000	2,755.00	33,060,000
J B C Cホールディングス	12,600	2,614.00	32,936,400
ミロク情報サービス	15,700	1,571.00	24,664,700
ソフトバンクグループ	853,700	6,422.00	5,482,461,400
高千穂交易	4,300	3,265.00	14,039,500
オルバヘルスケアホールディングス	1,800	1,755.00	3,159,000
伊藤忠食品	4,100	6,400.00	26,240,000
エレマテック	16,400	1,932.00	31,684,800
あらた	14,000	5,630.00	78,820,000
トーメンデバイス	2,600	5,120.00	13,312,000
東京エレクトロン デバイス	6,700	10,520.00	70,484,000
円谷フィールズホールディングス	31,400	2,533.00	79,536,200
双日	182,000	3,250.00	591,500,000
アルフレッサ ホールディングス	183,300	2,502.50	458,708,250
横浜冷凍	49,700	1,362.00	67,691,400
ラサ商事	5,600	1,588.00	8,892,800
アルコニックス	24,000	1,416.00	33,984,000
神戸物産	141,200	3,619.00	511,002,800
ハイパー	2,800	361.00	1,010,800
あい ホールディングス	29,200	2,489.00	72,678,800
ディーブイエックス	3,400	899.00	3,056,600
ダイワボウホールディングス	74,600	2,992.50	223,240,500
マクニカホールディングス	43,200	7,060.00	304,992,000
ラクト・ジャパン	7,100	2,070.00	14,697,000
グリムス	7,600	2,425.00	18,430,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,500	989.00	26,208,500
八洲電機	14,800	1,344.00	19,891,200

メディアスホールディングス	11,700	761.00	8,903,700
レスターホールディングス	17,500	2,474.00	43,295,000
ジュテックホールディングス	2,800	1,230.00	3,444,000
大光	5,200	622.00	3,234,400
OCHIホールディングス	2,800	1,410.00	3,948,000
TOKAIホールディングス	90,200	946.00	85,329,200
黒谷	3,400	605.00	2,057,000
Cominix	2,400	865.00	2,076,000
三洋貿易	20,600	1,391.00	28,654,600
ビューティガレージ	2,900	4,680.00	13,572,000
ウイン・パートナーズ	13,300	1,119.00	14,882,700
ミタチ産業	3,100	1,162.00	3,602,200
シップヘルスケアホールディングス	65,600	2,447.50	160,556,000
明治電機工業	6,800	1,504.00	10,227,200
デリカフーズホールディングス	4,800	679.00	3,259,200
スターティアホールディングス	2,400	1,712.00	4,108,800
コメダホールディングス	44,800	2,906.00	130,188,800
ピーバンドットコム	1,800	460.00	828,000
アセンテック	6,200	647.00	4,011,400
富士興産	2,700	1,956.00	5,281,200
協栄産業	1,100	2,273.00	2,500,300
フルサト・マルカホールディングス	18,100	2,931.00	53,051,100
ヤマエグループホールディングス	10,300	4,080.00	42,024,000
小野建	17,900	1,735.00	31,056,500
南陽	2,300	2,191.00	5,039,300
佐島電機	7,700	1,707.00	13,143,900
エコートレーディング	2,400	1,391.00	3,338,400
伯東	10,500	5,400.00	56,700,000
コンドーテック	14,100	1,187.00	16,736,700
中山福	6,600	350.00	2,310,000
ナガイレーベン	23,100	2,249.00	51,951,900
三菱食品	16,900	4,005.00	67,684,500
松田産業	13,900	2,288.00	31,803,200
第一興商	70,600	2,854.50	201,527,700
メディバルホールディングス	174,600	2,560.50	447,063,300
SPK	8,100	2,060.00	16,686,000
萩原電気ホールディングス	7,400	4,065.00	30,081,000
アズワン	26,000	5,842.00	151,892,000
スズデン	6,400	2,286.00	14,630,400
尾家産業	2,900	1,842.00	5,341,800
シモジマ	12,600	1,230.00	15,498,000
ドウシシャ	19,300	2,435.00	46,995,500

小津産業	2,700	1,637.00	4,419,900
高速	9,500	2,102.00	19,969,000
たけびし	7,000	1,930.00	13,510,000
リックス	2,500	3,100.00	7,750,000
丸文	16,300	1,209.00	19,706,700
ハピネット	15,500	2,652.00	41,106,000
橋本総業ホールディングス	7,200	1,162.00	8,366,400
日本ライフライン	53,500	1,206.00	64,521,000
タカショー	15,900	659.00	10,478,100
I D O M	55,200	800.00	44,160,000
進和	11,200	2,344.00	26,252,800
エスケイジャパン	3,000	724.00	2,172,000
ダイトロン	7,200	3,075.00	22,140,000
シークス	26,000	1,602.00	41,652,000
田中商事	3,500	710.00	2,485,000
オーハシテクニカ	8,800	1,738.00	15,294,400
白銅	6,600	2,400.00	15,840,000
ダイコー通産	1,300	1,215.00	1,579,500
伊藤忠商事	1,124,900	5,673.00	6,381,557,700
丸紅	1,424,600	2,487.50	3,543,692,500
高島	1,900	3,960.00	7,524,000
長瀬産業	83,700	2,534.50	212,137,650
蝶理	9,800	2,945.00	28,861,000
豊田通商	159,900	9,025.00	1,443,097,500
三共生興	26,100	757.00	19,757,700
兼松	70,900	2,147.00	152,222,300
ツカモトコーポレーション	1,700	1,320.00	2,244,000
三井物産	1,295,700	5,632.00	7,297,382,400
日本紙パルプ商事	9,700	4,945.00	47,966,500
カメイ	19,400	1,513.00	29,352,200
東都水産	600	6,500.00	3,900,000
O U Gホールディングス	1,800	2,511.00	4,519,800
スターゼン	13,900	2,639.00	36,682,100
山善	49,200	1,157.00	56,924,400
椿本興業	2,900	5,220.00	15,138,000
住友商事	1,104,900	3,105.00	3,430,714,500
内田洋行	7,400	6,870.00	50,838,000
三菱商事	1,113,100	7,622.00	8,484,048,200
第一実業	6,400	5,560.00	35,584,000
キャノンマーケティングジャパン	42,300	3,878.00	164,039,400
西華産業	7,200	2,174.00	15,652,800
佐藤商事	12,700	1,510.00	19,177,000

菱洋エレクトロ	15,600	3,420.00	53,352,000
東京産業	16,700	853.00	14,245,100
ユアサ商事	15,700	4,350.00	68,295,000
神鋼商事	4,600	5,910.00	27,186,000
トルク	6,600	256.00	1,689,600
阪和興業	32,800	4,935.00	161,868,000
正栄食品工業	12,100	4,590.00	55,539,000
カナデン	12,200	1,440.00	17,568,000
R Y O D E N	14,700	2,437.00	35,823,900
岩谷産業	41,600	7,772.00	323,315,200
ナイス	3,300	1,545.00	5,098,500
ニチモウ	1,600	4,050.00	6,480,000
極東貿易	10,900	1,958.00	21,342,200
アステナホールディングス	34,400	470.00	16,168,000
三愛オブリ	48,300	1,717.00	82,931,100
稲畑産業	36,900	3,280.00	121,032,000
G S I クレオス	10,600	2,276.00	24,125,600
明和産業	24,300	679.00	16,499,700
クワザワホールディングス	3,900	576.00	2,246,400
ワキタ	33,600	1,412.00	47,443,200
東邦ホールディングス	45,500	2,958.50	134,611,750
サンゲツ	45,900	3,030.00	139,077,000
ミツウロコグループホールディングス	23,300	1,377.00	32,084,100
シナネンホールディングス	5,900	4,145.00	24,455,500
伊藤忠エネクス	45,300	1,503.00	68,085,900
サンリオ	51,700	7,922.00	409,567,400
サンワテクノス	9,300	2,240.00	20,832,000
リョーサン	19,400	4,480.00	86,912,000
新光商事	24,600	1,210.00	29,766,000
トーヨー	7,800	3,220.00	25,116,000
三信電気	7,400	2,220.00	16,428,000
東陽テクニカ	18,500	1,355.00	25,067,500
モスフードサービス	26,900	3,400.00	91,460,000
加賀電子	14,800	6,730.00	99,604,000
ソーダニッカ	8,900	975.00	8,677,500
立花エレテック	13,300	2,778.00	36,947,400
フォーバル	7,200	1,302.00	9,374,400
P A L T A C	28,700	4,832.00	138,678,400
三谷産業	32,000	331.00	10,592,000
西本Wismettacホールディングス	4,600	4,445.00	20,447,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,017.00	2,017,000
コア商事ホールディングス	10,300	708.00	7,292,400

K P Pグループホールディングス	42,600	677.00	28,840,200
ヤマタネ	8,100	2,075.00	16,807,500
丸紅建材リース	1,100	2,712.00	2,983,200
泉州電業	9,200	3,875.00	35,650,000
トラスコ中山	38,300	2,656.00	101,724,800
オートバックスセブン	63,600	1,632.00	103,795,200
モリト	13,100	1,272.00	16,663,200
加藤産業	22,600	4,295.00	97,067,000
北恵	3,100	855.00	2,650,500
イエローハット	32,200	1,941.00	62,500,200
J Kホールディングス	14,100	1,004.00	14,156,400
日伝	10,800	2,549.00	27,529,200
北沢産業	6,600	330.00	2,178,000
杉本商事	8,100	2,356.00	19,083,600
因幡電機産業	47,300	3,185.00	150,650,500
東テク	6,100	5,350.00	32,635,000
ミスミグループ本社	275,600	2,595.50	715,319,800
アルテック	6,600	258.00	1,702,800
タキヒヨー	3,000	1,128.00	3,384,000
蔵王産業	2,000	2,632.00	5,264,000
スズケン	53,500	4,359.00	233,206,500
ジェコス	10,900	974.00	10,616,600
グローセル	14,700	426.00	6,262,200
ローソン	45,300	7,144.00	323,623,200
サンエー	14,000	4,980.00	69,720,000
カワチ薬品	14,500	2,302.00	33,379,000
エービーシー・マート	79,800	2,645.50	211,110,900
ハードオフコーポレーション	5,200	1,589.00	8,262,800
アスクル	38,000	2,013.00	76,494,000
ゲオホールディングス	18,000	2,657.00	47,826,000
アダストリア	22,200	2,975.00	66,045,000
くら寿司	21,500	3,245.00	69,767,500
キャンドゥ	6,700	2,779.00	18,619,300
I Kホールディングス	5,100	391.00	1,994,100
パルグループホールディングス	36,000	2,083.00	74,988,000
エディオン	72,600	1,491.00	108,246,600
サーラコーポレーション	39,000	770.00	30,030,000
ワッツ	6,700	619.00	4,147,300
ハローズ	8,400	4,260.00	35,784,000
あみやき亭	4,600	3,555.00	16,353,000
大黒天物産	5,700	6,790.00	38,703,000
ハニーズホールディングス	14,700	1,707.00	25,092,900

ファーマライズホールディングス	3,400	645.00	2,193,000
アルペン	15,300	1,940.00	29,682,000
ハブ	4,500	962.00	4,329,000
クオールホールディングス	25,400	1,919.00	48,742,600
ジーンズホールディングス	11,000	3,385.00	37,235,000
ビックカメラ	97,600	1,076.00	105,017,600
D C Mホールディングス	106,500	1,250.00	133,125,000
Monotaro	259,100	1,766.50	457,700,150
東京一番フーズ	3,700	547.00	2,023,900
きちりホールディングス	2,900	879.00	2,549,100
J.フロント リテイリング	227,300	1,558.00	354,133,400
ドトール・日レスホールディングス	32,600	2,357.00	76,838,200
マツキヨココカラ&カンパニー	110,800	8,657.00	959,195,600
ブロンコビリー	10,900	3,130.00	34,117,000
Z O Z O	120,800	2,982.00	360,225,600
トレジャー・ファクトリー	7,900	1,455.00	11,494,500
物語コーポレーション	30,600	4,780.00	146,268,000
三越伊勢丹ホールディングス	307,700	1,701.00	523,397,700
Hamee	6,800	1,151.00	7,826,800
マーケットエンタープライズ	1,600	1,247.00	1,995,200
ウエルシアホールディングス	94,900	2,696.00	255,850,400
クリエイトSDホールディングス	30,300	3,805.00	115,291,500
丸善CHIホールディングス	15,800	345.00	5,451,000
ミサワ	3,000	624.00	1,872,000
ティーライフ	2,000	1,395.00	2,790,000
チムニー	3,700	1,558.00	5,764,600
シュッピン	14,000	1,191.00	16,674,000
オイシックス・ラ・大地	24,800	1,750.00	43,400,000
ネクステージ	41,800	3,470.00	145,046,000
ジョイフル本田	53,400	1,750.00	93,450,000
鳥貴族ホールディングス	6,900	3,110.00	21,459,000
ホットランド	14,300	1,693.00	24,209,900
すかいらーくホールディングス	249,800	2,035.50	508,467,900
SFPホールディングス	10,000	2,430.00	24,300,000
綿半ホールディングス	14,500	1,383.00	20,053,500
ヨシックスホールディングス	2,600	2,935.00	7,631,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	59,900	1,131.00	67,746,900
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,900	734.00	6,532,600
B E E N O S	8,000	1,703.00	13,624,000
あさひ	15,600	1,293.00	20,170,800
日本調剤	12,800	1,420.00	18,176,000
コスモス薬品	18,100	16,905.00	305,980,500



トーエル	6,000	773.00	4,638,000	
セブン&アイ・ホールディングス	629,200	5,994.00	3,771,424,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	137,300	1,212.00	166,407,600	
ツルハホールディングス	38,400	10,605.00	407,232,000	
サンマルクホールディングス	15,000	1,910.00	28,650,000	
フェリシモ	3,200	1,005.00	3,216,000	
トリドールホールディングス	45,500	4,060.00	184,730,000	
TOKYO BASE	20,300	313.00	6,353,900	
ウイルプラスホールディングス	2,400	1,197.00	2,872,800	
JMホールディングス	14,000	1,931.00	27,034,000	
サツドラホールディングス	6,100	810.00	4,941,000	
アレンザホールディングス	14,100	1,017.00	14,339,700	
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,614.00	8,392,800	
パロックジャパンリミテッド	12,400	840.00	10,416,000	
クスリのアオキホールディングス	16,300	9,159.00	149,291,700	
力の源ホールディングス	7,000	2,370.00	16,590,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	97,600	2,923.50	285,333,600	
メディカルシステムネットワーク	17,100	403.00	6,891,300	
はるやまホールディングス	6,100	520.00	3,172,000	
ノジマ	60,000	1,301.00	78,060,000	
カップ・クリエイト	28,700	1,648.00	47,297,600	
ライトオン	9,200	547.00	5,032,400	
良品計画	199,600	1,919.00	383,032,400	
パリミキホールディングス	16,600	395.00	6,557,000	
アドヴァングループ	17,900	1,020.00	18,258,000	
アルビス	6,200	2,473.00	15,332,600	
コナカ	13,300	440.00	5,852,000	
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,618.00	2,912,400	
G-7ホールディングス	23,100	1,278.00	29,521,800	
イオン北海道	27,200	872.00	23,718,400	
コジマ	30,900	637.00	19,683,300	
ヒマラヤ	4,300	948.00	4,076,400	
コーナン商事	24,800	3,700.00	91,760,000	
エコス	7,000	2,066.00	14,462,000	
ワタミ	22,000	1,187.00	26,114,000	
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	368,600	3,017.00	1,112,066,200	
西松屋チェーン	40,700	1,715.00	69,800,500	
ゼンショーホールディングス	100,000	6,904.00	690,400,000	
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,032.00	12,280,800	
ハークスレイ	5,000	778.00	3,890,000	

サイゼリヤ	27,100	4,650.00	126,015,000
V Tホールディングス	70,300	526.00	36,977,800
魚力	5,900	2,235.00	13,186,500
フジ・コーポレーション	10,600	1,944.00	20,606,400
ユナイテッドアローズ	19,700	2,103.00	41,429,100
ハイデイ日高	27,200	3,010.00	81,872,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	9,900	187.00	1,851,300
コロワイド	84,100	2,592.50	218,029,250
巻番屋	14,500	5,700.00	82,650,000
P L A N T	3,400	816.00	2,774,400
スギホールディングス	36,900	6,499.00	239,813,100
薬王堂ホールディングス	10,400	2,633.00	27,383,200
スクロール	27,600	1,025.00	28,290,000
ヨンドシーホールディングス	16,000	1,871.00	29,936,000
木曽路	27,800	2,679.00	74,476,200
S R S ホールディングス	30,600	1,103.00	33,751,800
千趣会	34,800	410.00	14,268,000
リテールパートナーズ	27,400	1,703.00	46,662,200
ケーヨー	29,600	876.00	25,929,600
上新電機	16,500	2,298.00	37,917,000
日本瓦斯	96,900	2,308.00	223,645,200
ロイヤルホールディングス	35,200	2,717.00	95,638,400
いなげや	17,900	1,544.00	27,637,600
チヨダ	17,900	993.00	17,774,700
ライフコーポレーション	16,000	3,695.00	59,120,000
リンガーハット	23,500	2,372.00	55,742,000
M r M a x H D	26,400	620.00	16,368,000
A O K I ホールディングス	34,000	1,067.00	36,278,000
オークワ	29,400	896.00	26,342,400
コメリ	28,200	3,155.00	88,971,000
青山商事	39,300	1,679.00	65,984,700
しまむら	21,500	15,155.00	325,832,500
はせがわ	7,200	356.00	2,563,200
高島屋	137,700	2,176.50	299,704,050
松屋	31,100	1,120.00	34,832,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	89,000	1,819.00	161,891,000
近鉄百貨店	8,000	2,901.00	23,208,000
丸井グループ	134,700	2,597.50	349,883,250
アクシアル リテイリング	12,600	3,815.00	48,069,000
イオン	618,900	3,033.00	1,877,123,700
イズミ	27,800	3,906.00	108,586,800
平和堂	30,600	2,458.00	75,214,800

フジ	28,100	1,843.00	51,788,300
ヤオコー	20,700	7,927.00	164,088,900
ゼビオホールディングス	25,200	1,046.00	26,359,200
ケーズホールディングス	129,400	1,371.50	177,472,100
Olympicグループ	5,400	537.00	2,899,800
日産東京販売ホールディングス	16,600	471.00	7,818,600
シルバーライフ	3,900	1,209.00	4,715,100
Genky DrugStores	8,100	5,240.00	42,444,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,194.00	2,865,600
ブックオフグループホールディングス	8,400	1,246.00	10,466,400
ギフトホールディングス	8,000	2,694.00	21,552,000
アインホールディングス	25,200	4,542.00	114,458,400
元気寿司	5,300	5,160.00	27,348,000
ヤマダホールディングス	749,600	467.40	350,363,040
アークランズ	55,137	1,681.00	92,685,297
ニトリホールディングス	73,900	17,515.00	1,294,358,500
グルメ杵屋	15,200	1,155.00	17,556,000
愛眼	9,000	183.00	1,647,000
ケーユーホールディングス	11,100	1,251.00	13,886,100
吉野家ホールディングス	71,600	2,846.00	203,773,600
松屋フーズホールディングス	8,700	4,250.00	36,975,000
サガミホールディングス	29,700	1,435.00	42,619,500
関西フードマーケット	16,800	1,504.00	25,267,200
王将フードサービス	12,100	7,110.00	86,031,000
ミニストップ	13,400	1,459.00	19,550,600
アークス	33,700	2,668.00	89,911,600
パローホールディングス	35,100	2,220.00	77,922,000
ベルク	9,200	6,950.00	63,940,000
大庄	7,000	1,153.00	8,071,000
ファーストリテイリング	82,100	33,830.00	2,777,443,000
サンドラッグ	69,400	4,373.00	303,486,200
サクスパー ホールディングス	17,900	954.00	17,076,600
ヤマザワ	2,600	1,268.00	3,296,800
やまや	2,700	3,090.00	8,343,000
ベルーナ	44,600	746.00	33,271,600
いよぎんホールディングス	202,200	1,064.00	215,140,800
しずおかフィナンシャルグループ	377,600	1,214.50	458,595,200
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	143,100	1,033.00	147,822,300
楽天銀行	59,100	1,986.00	117,372,600
島根銀行	3,900	518.00	2,020,200
じもとホールディングス	10,000	421.00	4,210,000
めぶきフィナンシャルグループ	843,300	413.50	348,704,550

東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,800	4,095.00	89,271,000
九州フィナンシャルグループ	299,000	737.70	220,572,300
ゆうちょ銀行	466,900	1,182.50	552,109,250
富山第一銀行	53,900	927.00	49,965,300
コンコルディア・フィナンシャルグループ	911,800	664.70	606,073,460
西日本フィナンシャルホールディングス	105,500	1,572.00	165,846,000
三十三フィナンシャルグループ	15,200	1,806.00	27,451,200
第四北越フィナンシャルグループ	26,700	3,775.00	100,792,500
ひろぎんホールディングス	221,700	922.20	204,451,740
おきなわフィナンシャルグループ	15,600	2,398.00	37,408,800
十六フィナンシャルグループ	22,000	3,785.00	83,270,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,900	5,210.00	93,259,000
プロクレアホールディングス	20,800	2,054.00	42,723,200
あいちフィナンシャルグループ	23,800	2,584.00	61,499,200
あおぞら銀行	106,900	2,951.50	315,515,350
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,643,000	1,217.50	12,957,852,500
りそなホールディングス	2,147,900	814.20	1,748,820,180
三井住友トラスト・ホールディングス	305,500	5,628.00	1,719,354,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,207,800	6,924.00	8,362,807,200
千葉銀行	473,600	1,072.00	507,699,200
群馬銀行	329,800	693.60	228,749,280
武蔵野銀行	21,800	2,724.00	59,383,200
千葉興業銀行	26,500	809.00	21,438,500
筑波銀行	74,600	260.00	19,396,000
七十七銀行	54,400	3,240.00	176,256,000
秋田銀行	11,400	1,897.00	21,625,800
山形銀行	18,900	1,125.00	21,262,500
岩手銀行	11,600	2,598.00	30,136,800
東邦銀行	134,400	281.00	37,766,400
東北銀行	5,500	1,109.00	6,099,500
ふくおかフィナンシャルグループ	135,700	3,597.00	488,112,900
スルガ銀行	149,800	632.00	94,673,600
八十二銀行	358,900	809.60	290,565,440
山梨中央銀行	17,500	1,600.00	28,000,000
大垣共立銀行	32,400	2,055.00	66,582,000
福井銀行	15,200	1,604.00	24,380,800
清水銀行	6,800	1,597.00	10,859,600
富山銀行	1,700	1,769.00	3,007,300
滋賀銀行	28,300	3,350.00	94,805,000
南都銀行	25,600	2,715.00	69,504,000
百五銀行	159,900	520.00	83,148,000
京都銀行	53,800	8,397.00	451,758,600

紀陽銀行	60,800	1,543.00	93,814,400
ほくほくフィナンシャルグループ	108,000	1,375.50	148,554,000
山陰合同銀行	106,400	946.00	100,654,400
鳥取銀行	3,600	1,314.00	4,730,400
百十四銀行	15,500	2,283.00	35,386,500
四国銀行	27,000	964.00	26,028,000
阿波銀行	23,800	2,316.00	55,120,800
大分銀行	10,200	2,531.00	25,816,200
宮崎銀行	11,100	2,731.00	30,314,100
佐賀銀行	10,000	1,895.00	18,950,000
琉球銀行	38,900	1,089.00	42,362,100
セブン銀行	608,800	315.90	192,319,920
みずほフィナンシャルグループ	2,457,700	2,485.00	6,107,384,500
高知銀行	3,900	986.00	3,845,400
山口フィナンシャルグループ	166,600	1,189.00	198,087,400
名古屋銀行	11,200	4,450.00	49,840,000
北洋銀行	257,500	329.00	84,717,500
大光銀行	3,400	1,277.00	4,341,800
愛媛銀行	22,900	933.00	21,365,700
トマト銀行	3,700	1,183.00	4,377,100
京葉銀行	77,800	623.00	48,469,400
栃木銀行	77,800	316.00	24,584,800
北日本銀行	6,000	2,232.00	13,392,000
東和銀行	31,200	584.00	18,220,800
福島銀行	11,900	230.00	2,737,000
大東銀行	4,400	709.00	3,119,600
トモニホールディングス	137,300	431.00	59,176,300
フィデアホールディングス	17,600	1,571.00	27,649,600
池田泉州ホールディングス	217,600	281.00	61,145,600
F P G	57,600	1,485.00	85,536,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,000	1,809.00	25,326,000
マーキュリアホールディングス	6,000	804.00	4,824,000
S B I ホールディングス	246,100	3,066.00	754,542,600
ジャフコ グループ	56,800	1,878.00	106,670,400
大和証券グループ本社	1,215,400	844.80	1,026,769,920
野村ホールディングス	3,062,300	587.40	1,798,795,020
岡三証券グループ	149,500	585.00	87,457,500
丸三証券	56,900	531.00	30,213,900
東洋証券	56,900	351.00	19,971,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,300	454.00	84,126,200
光世証券	2,900	626.00	1,815,400
水戸証券	46,000	435.00	20,010,000

いちよし証券	31,600	715.00	22,594,000
松井証券	100,600	819.00	82,391,400
マネックスグループ	183,400	541.00	99,219,400
極東証券	21,400	803.00	17,184,200
岩井コスモホールディングス	19,500	1,747.00	34,066,500
アイザワ証券グループ	24,700	925.00	22,847,500
マネーパートナーズグループ	12,400	287.00	3,558,800
スパークス・グループ	19,000	1,566.00	29,754,000
かんぽ生命保険	197,800	2,414.50	477,588,100
S O M P Oホールディングス	291,700	6,439.00	1,878,256,300
アニコム ホールディングス	57,700	657.00	37,908,900
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	345,800	5,401.00	1,867,665,800
第一生命ホールディングス	830,200	2,847.50	2,363,994,500
東京海上ホールディングス	1,679,800	3,304.00	5,550,059,200
T & Dホールディングス	456,100	2,367.00	1,079,588,700
アドバンスクリエイト	9,800	1,182.00	11,583,600
全国保証	44,500	5,098.00	226,861,000
あんしん保証	6,700	294.00	1,969,800
イントラスト	4,700	930.00	4,371,000
日本モーゲージサービス	6,900	574.00	3,960,600
C a s a	4,800	879.00	4,219,200
アルヒ	21,300	942.00	20,064,600
プレミアグループ	28,800	1,700.00	48,960,000
ネットプロテクションズホールディングス	57,200	423.00	24,195,600
クレディセゾン	107,800	2,385.50	257,156,900
芙蓉総合リース	15,700	12,520.00	196,564,000
みずほリース	25,400	4,920.00	124,968,000
東京センチュリー	31,800	5,896.00	187,492,800
日本証券金融	62,700	1,395.00	87,466,500
アイフル	282,300	363.00	102,474,900
リコーリース	16,200	4,395.00	71,199,000
イオンフィナンシャルサービス	97,800	1,289.00	126,064,200
アコム	304,200	359.60	109,390,320
ジャックス	18,200	5,240.00	95,368,000
オリエントコーポレーション	44,600	1,137.00	50,710,200
オリックス	1,115,600	2,816.50	3,142,087,400
三菱H C キャピタル	662,900	985.80	653,486,820
九州リースサービス	5,700	871.00	4,964,700
日本取引所グループ	477,600	2,578.00	1,231,252,800
イー・ギャランティ	27,800	2,032.00	56,489,600
アサックス	5,600	667.00	3,735,200
N E C キャピタルソリューション	8,400	3,255.00	27,342,000

大東建託	62,300	16,555.00	1,031,376,500
いちご	198,200	319.00	63,225,800
日本駐車場開発	183,200	225.00	41,220,000
スター・マイカ・ホールディングス	20,900	638.00	13,334,200
S R Eホールディングス	8,600	3,525.00	30,315,000
A Dワークスグループ	28,500	220.00	6,270,000
ヒューリック	397,000	1,332.50	529,002,500
三栄建築設計	8,700	2,021.00	17,582,700
野村不動産ホールディングス	106,500	3,803.00	405,019,500
三重交通グループホールディングス	37,600	626.00	23,537,600
サムティ	27,400	2,381.00	65,239,400
ディア・ライフ	29,800	875.00	26,075,000
地主	13,400	1,890.00	25,326,000
プレサンスコーポレーション	27,200	1,989.00	54,100,800
ハウスコム	2,600	912.00	2,371,200
J P M C	10,500	1,150.00	12,075,000
サンセイランディック	4,100	1,077.00	4,415,700
フージャースホールディングス	26,200	1,115.00	29,213,000
オープンハウスグループ	62,400	5,234.00	326,601,600
東急不動産ホールディングス	511,700	945.10	483,607,670
飯田グループホールディングス	149,200	2,532.50	377,849,000
イーランド	2,200	1,551.00	3,412,200
ムゲンエステート	8,300	1,011.00	8,391,300
A n d D oホールディングス	10,100	1,044.00	10,544,400
シーアールイー	9,900	1,531.00	15,156,900
ケイアイスター不動産	8,300	4,900.00	40,670,000
グッドコムアセット	16,500	959.00	15,823,500
ジェイ・エス・ビー	4,300	5,710.00	24,553,000
ロードスターキャピタル	11,500	1,824.00	20,976,000
テンポイノベーション	4,000	1,281.00	5,124,000
フェイスネットワーク	3,600	1,459.00	5,252,400
パーク24	110,700	2,060.50	228,097,350
パラカ	6,300	2,090.00	13,167,000
三井不動産	725,400	3,402.00	2,467,810,800
三菱地所	1,025,800	1,962.00	2,012,619,600
平和不動産	27,800	4,070.00	113,146,000
東京建物	148,900	2,037.50	303,383,750
京阪神ビルディング	29,100	1,310.00	38,121,000
住友不動産	307,400	4,073.00	1,252,040,200
テーオーシー	31,900	644.00	20,543,600
東京楽天地	3,000	4,330.00	12,990,000
レオパレス21	191,300	357.00	68,294,100

スターツコーポレーション	24,600	3,070.00	75,522,000
フジ住宅	24,800	752.00	18,649,600
空港施設	21,800	598.00	13,036,400
明和地所	6,200	1,096.00	6,795,200
ゴールドクレスト	16,500	2,040.00	33,660,000
エスリード	8,200	3,155.00	25,871,000
日神グループホールディングス	28,700	526.00	15,096,200
日本エスコン	37,900	918.00	34,792,200
MIRARTHホールディングス	85,900	491.00	42,176,900
AVANTIA	7,200	882.00	6,350,400
イオンモール	88,500	1,765.00	156,202,500
毎日コムネット	5,200	782.00	4,066,400
ファースト住建	5,200	1,180.00	6,136,000
カチタス	46,000	2,414.00	111,044,000
トーセイ	28,700	1,945.00	55,821,500
穴吹興産	2,600	2,058.00	5,350,800
サンフロンティア不動産	28,800	1,522.00	43,833,600
FJネクストホールディングス	18,600	1,078.00	20,050,800
インテリックス	2,800	522.00	1,461,600
ランドビジネス	4,100	308.00	1,262,800
サンネクスタグループ	4,100	963.00	3,948,300
グランディハウス	10,800	619.00	6,685,200
日本空港ビルデング	60,200	6,904.00	415,620,800
明豊ファシリティワークス	6,400	756.00	4,838,400
LIFULL	62,000	249.00	15,438,000
MIXI	40,500	2,429.00	98,374,500
ジェイエイシーリクルートメント	16,100	2,741.00	44,130,100
日本M&Aセンターホールディングス	304,800	819.50	249,783,600
メンバーズ	5,500	1,304.00	7,172,000
中広	2,400	422.00	1,012,800
UTグループ	26,200	2,479.00	64,949,800
アイティメディア	7,000	1,175.00	8,225,000
E・Jホールディングス	10,600	1,743.00	18,475,800
オープンアップグループ	53,300	2,010.00	107,133,000
コシダカホールディングス	53,400	1,396.00	74,546,400
アルトナー	3,100	1,724.00	5,344,400
パソナグループ	21,700	1,713.00	37,172,100
CDS	3,100	1,741.00	5,397,100
リンクアンドモチベーション	51,100	480.00	24,528,000
エス・エム・エス	67,600	2,848.00	192,524,800
サニーサイドアップグループ	4,000	780.00	3,120,000
パーソルホールディングス	195,700	2,575.50	504,025,350



リニカル	7,100	723.00	5,133,300
クックパッド	50,400	165.00	8,316,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	676.00	4,258,800
学情	9,200	1,929.00	17,746,800
スタジオアリス	9,000	2,131.00	19,179,000
シミックホールディングス	8,700	1,780.00	15,486,000
エプコ	3,700	748.00	2,767,600
N J S	4,000	3,015.00	12,060,000
総合警備保障	329,600	944.20	311,208,320
カカクコム	130,400	1,729.00	225,461,600
アイロムグループ	6,500	1,852.00	12,038,000
セントケア・ホールディング	11,700	831.00	9,722,700
サイネックス	2,500	645.00	1,612,500
ルネサンス	12,800	941.00	12,044,800
ディップ	31,100	3,600.00	111,960,000
デジタルホールディングス	14,100	1,085.00	15,298,500
新日本科学	19,000	2,199.00	41,781,000
キャリアデザインセンター	2,600	2,180.00	5,668,000
ベネフィット・ワン	82,400	1,244.50	102,546,800
エムスリー	350,600	2,950.00	1,034,270,000
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	491.00	3,731,600
アウトソーシング	114,100	1,219.50	139,144,950
ウェルネット	9,500	600.00	5,700,000
ワールドホールディングス	8,100	2,490.00	20,169,000
ディー・エヌ・エー	71,100	1,532.00	108,925,200
博報堂D Yホールディングス	226,500	1,401.50	317,439,750
ぐるなび	33,500	337.00	11,289,500
タカミヤ	24,700	524.00	12,942,800
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	728.00	6,406,400
ファンコミュニケーションズ	35,400	399.00	14,124,600
ライク	6,800	1,560.00	10,608,000
ビジネス・ブレークスルー	5,200	401.00	2,085,200
エスプール	51,600	514.00	26,522,400
W D Bホールディングス	9,200	2,119.00	19,494,800
ティア	7,600	464.00	3,526,400
C D G	1,500	1,304.00	1,956,000
アドウェイズ	24,900	576.00	14,342,400
バリューコマース	15,800	1,292.00	20,413,600
インフォマート	184,800	490.00	90,552,000
J Pホールディングス	52,000	333.00	17,316,000
エコナックホールディングス	24,200	85.00	2,057,000
C Lホールディングス	5,300	840.00	4,452,000

プレステージ・インターナショナル	75,200	613.00	46,097,600	
アミューズ	9,800	1,577.00	15,454,600	
ドリームインキュベータ	5,500	3,020.00	16,610,000	
クイック	13,700	2,224.00	30,468,800	
T A C	7,300	201.00	1,467,300	
電通グループ	174,400	4,533.00	790,555,200	
イオンファンタジー	7,800	3,280.00	25,584,000	
シーティーエス	20,000	715.00	14,300,000	
ネクシィーズグループ	4,100	781.00	3,202,100	
H . U . グループホールディングス	52,000	2,616.00	136,032,000	
アルプス技研	17,000	2,615.00	44,455,000	
日本空調サービス	19,400	798.00	15,481,200	
オリエンタルランド	938,800	5,268.00	4,945,598,400	
ダスキン	39,600	3,302.00	130,759,200	
明光ネットワークジャパン	22,000	647.00	14,234,000	
ファルコホールディングス	8,200	2,046.00	16,777,200	
ラウンドワン	148,900	609.00	90,680,100	
リゾートトラスト	70,200	2,374.00	166,654,800	
ビー・エム・エル	21,900	2,971.00	65,064,900	
リソー教育	81,900	254.00	20,802,600	
早稲田アカデミー	10,000	1,509.00	15,090,000	
ユー・エス・エス	182,500	2,569.00	468,842,500	
東京個別指導学院	21,700	491.00	10,654,700	
サイバーエージェント	392,200	918.30	360,157,260	
楽天グループ	1,518,400	574.80	872,776,320	
クリーク・アンド・リバー社	10,500	2,173.00	22,816,500	
S B I グローバルアセットマネジメント	29,500	568.00	16,756,000	
テー・オー・ダブリュー	35,800	314.00	11,241,200	
山田コンサルティンググループ	9,200	1,724.00	15,860,800	
セントラルスポーツ	6,800	2,466.00	16,768,800	
フルキャストホールディングス	17,100	2,155.00	36,850,500	
エン・ジャパン	32,200	2,566.00	82,625,200	
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	105,000	3,615.00	379,575,000	
アトラグループ	3,400	266.00	904,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,400	2,218.00	20,849,200	
K e e P e r 技研	11,000	6,640.00	73,040,000	
ファーストロジック	3,800	555.00	2,109,000	
三機サービス	2,100	1,076.00	2,259,600	
G u n o s y	14,600	626.00	9,139,600	
デザインワン・ジャパン	4,800	172.00	825,600	
イー・ガーディアン	6,800	2,631.00	17,890,800	

リブセンス	6,600	335.00	2,211,000	
ジャパンマテリアル	54,400	2,658.00	144,595,200	
ベクトル	28,100	1,345.00	37,794,500	
ウチヤマホールディングス	5,900	362.00	2,135,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,000	1,212.00	18,180,000	
キャリアリンク	6,600	2,531.00	16,704,600	
I B J	14,100	632.00	8,911,200	
アサンテ	9,000	1,659.00	14,931,000	
バリューHR	15,700	1,284.00	20,158,800	
M & A キャピタルパートナーズ	14,400	2,866.00	41,270,400	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,020.00	6,732,000	
E R I ホールディングス	3,200	2,229.00	7,132,800	
アビスト	1,900	3,585.00	6,811,500	
シグマクシス・ホールディングス	27,100	1,650.00	44,715,000	
ウィルグループ	15,100	1,103.00	16,655,300	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	14,700	142.00	2,087,400	
メドピア	15,900	1,105.00	17,569,500	
レアジョブ	2,600	1,065.00	2,769,000	
リクルートホールディングス	1,313,300	5,283.00	6,938,163,900	
エラン	23,800	855.00	20,349,000	
土木管理総合試験所	6,400	339.00	2,169,600	
日本郵政	2,134,600	1,156.50	2,468,664,900	
ベルシステム24ホールディングス	24,000	1,600.00	38,400,000	
鎌倉新書	20,600	699.00	14,399,400	
S M N	3,600	429.00	1,544,400	
グローバルキッズCOMPANY	2,700	666.00	1,798,200	
エアトリ	13,100	2,386.00	31,256,600	
アトラエ	10,800	1,136.00	12,268,800	
ストライク	7,600	3,295.00	25,042,000	
ソラスト	49,300	685.00	33,770,500	
セラク	5,700	1,330.00	7,581,000	
インソース	38,800	1,100.00	42,680,000	
ベイカレント・コンサルティング	140,500	5,094.00	715,707,000	
Orchestra Holdings	4,100	1,195.00	4,899,500	
アイモバイル	8,100	1,259.00	10,197,900	
キャリアインデックス	5,200	269.00	1,398,800	
MS - Japan	4,100	1,181.00	4,842,100	
船場	2,800	861.00	2,410,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	63,400	2,390.00	151,526,000	
フルテック	1,900	1,141.00	2,167,900	
GameWith	4,500	335.00	1,507,500	
MS & Consulting	1,900	684.00	1,299,600	

ウェルビー	13,600	562.00	7,643,200
エル・ティー・エス	2,400	4,235.00	10,164,000
ミダックホールディングス	10,900	1,916.00	20,884,400
日総工産	13,700	818.00	11,206,600
キュービーネットホールディングス	8,600	1,629.00	14,009,400
R P Aホールディングス	24,900	358.00	8,914,200
スプリックス	3,800	826.00	3,138,800
マネジメントソリューションズ	9,800	4,035.00	39,543,000
プロレド・パートナーズ	5,000	515.00	2,575,000
テノ・ホールディングス	2,000	619.00	1,238,000
フロンティア・マネジメント	6,100	1,418.00	8,649,800
ピアラ	2,900	441.00	1,278,900
コプロ・ホールディングス	2,100	2,639.00	5,541,900
ギークス	2,000	767.00	1,534,000
アンビスホールディングス	19,100	3,020.00	57,682,000
カーブスホールディングス	48,900	748.00	36,577,200
フォーラムエンジニアリング	10,600	1,308.00	13,864,800
Fast Fitness Japan	6,300	1,458.00	9,185,400
ダイレクトマーケティングミックス	21,500	582.00	12,513,000
ポピンズ	2,900	1,265.00	3,668,500
L I T A L I C O	13,900	2,287.00	31,789,300
コンフィデンス・インターワークス	900	1,644.00	1,479,600
アドバンテッジリスクマネジメント	6,000	477.00	2,862,000
リログループ	98,900	1,736.00	171,690,400
東祥	12,600	1,283.00	16,165,800
I D & Eホールディングス	10,800	3,440.00	37,152,000
ビーウィズ	4,600	2,300.00	10,580,000
T R Eホールディングス	37,600	1,253.00	47,112,800
人・夢・技術グループ	6,900	1,800.00	12,420,000
大栄環境	45,300	2,310.00	104,643,000
日本管財ホールディングス	18,700	2,724.00	50,938,800
エイチ・アイ・エス	51,700	1,974.00	102,055,800
ラックランド	8,200	3,065.00	25,133,000
共立メンテナンス	30,400	6,441.00	195,806,400
イチネンホールディングス	19,000	1,394.00	26,486,000
建設技術研究所	9,200	4,595.00	42,274,000
スペース	13,100	930.00	12,183,000
燦ホールディングス	7,700	2,169.00	16,701,300
スバル興業	800	11,360.00	9,088,000
東京テアトル	4,300	1,137.00	4,889,100
タナベコンサルティンググループ	4,900	1,163.00	5,698,700
ナガワ	4,800	7,320.00	35,136,000

東京都競馬	14,900	3,970.00	59,153,000
カナモト	27,600	2,601.00	71,787,600
ニシオホールディングス	16,600	3,670.00	60,922,000
トランス・コスモス	22,100	3,275.00	72,377,500
乃村工藝社	77,700	854.00	66,355,800
藤田観光	7,800	4,875.00	38,025,000
KNT-CTホールディングス	10,600	1,497.00	15,868,200
トーカイ	15,900	1,940.00	30,846,000
セコム	180,700	10,230.00	1,848,561,000
セントラル警備保障	9,700	3,120.00	30,264,000
丹青社	34,800	787.00	27,387,600
メイテック	69,300	2,622.00	181,704,600
応用地質	16,700	2,705.00	45,173,500
船井総研ホールディングス	37,000	2,728.00	100,936,000
進学会ホールディングス	4,900	291.00	1,425,900
オオバ	7,700	905.00	6,968,500
いであ	3,400	1,709.00	5,810,600
学究社	7,200	2,041.00	14,695,200
ベネッセホールディングス	66,400	1,889.00	125,429,600
イオンディライト	19,700	3,255.00	64,123,500
ナック	8,100	990.00	8,019,000
ダイセキ	36,300	4,535.00	164,620,500
ステップ	6,600	1,806.00	11,919,600
合計	254,987,747		583,567,482,127

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年 9月 5日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,379,626,177
コール・ローン	1,805,386,534
国債証券	284,367,734,291
派生商品評価勘定	7,298,890
未収入金	4,244,729,713
未収利息	1,721,811,085
前払金	2,322,615

	2023年 9月 5日現在
項目	金額（円）
前払費用	95,730,190
差入委託証拠金	123,191,610
流動資産合計	294,747,831,105
資産合計	294,747,831,105
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,862,461
未払金	6,134,187,883
未払解約金	217,832,079
未払利息	4,668
流動負債合計	6,355,887,091
負債合計	6,355,887,091
純資産の部	
元本等	
元本	87,191,328,152
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	201,200,615,862
元本等合計	288,391,944,014
純資産合計	288,391,944,014
負債純資産合計	294,747,831,105

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 9月 5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 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	87,191,328,152口
2. 1口当たり純資産額	3.3076円

	2023年 9月 5日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(33,076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 9月 5日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
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 9月 5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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	101,538,827,807円
期中追加設定元本額	15,413,513,818円
期中一部解約元本額	29,761,013,473円
期末元本額	87,191,328,152円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,176,709,861円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	533,607,302円

区分	2023年 9月 5日現在
財産四分法ファンド（毎月決算型）	365,653,840円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,475,279,557円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,314,004円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,856,225,593円
世界経済インデックスファンド	18,095,171,338円
DCマイセレクション25	2,004,699,743円
DCマイセレクション50	1,780,305,487円
DCマイセレクション75	1,356,209,953円
DC外国債券インデックス・オープン	2,263,987,535円
DCマイセレクションS25	1,056,850,614円
DCマイセレクションS50	956,877,035円
DCマイセレクションS75	516,095,491円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	16,348,648円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	98,828,617円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	53,205,676円
DC世界経済インデックスファンド	13,605,996,406円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	398,867,259円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	918,807円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,033,203円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	18,960,039円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	30,032,397円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	54,159,658円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	58,223,216円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	56,156,862円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	922,491,089円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	392,033,179円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,598,924,796円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	54,609,735円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	32,798,558円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	371,831,725円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	140,922,813円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	186,034,953円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	664,839,829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）	1,946,143,805円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	635,702,212円
外国債券ファンド・シリーズ1	736,755,861円
分散投資コア戦略ファンドA	276,386,697円
分散投資コア戦略ファンドS	604,847,674円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	675,255,090円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,347,196,522円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	239,478,659円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,592,687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）	1,305,074,325円
SMT インデックスバランス・オープン	179,979,914円
SMT 世界経済インデックス・オープン	354,181,691円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	464,347,639円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	746,240,075円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,340,647円
グローバル経済コア	779,288,787円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	20,956,723円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,300,946円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	51,257,058円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	68,739,186円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	33,019,974円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	38,641,417円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	278,091,572円
10資産分散投資ファンド	26,157,930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）	12,182,534,004円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	188,888,957円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	514,216,666円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	121,941,684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）	58,564,932円



## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 9月 5日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	2,395,777,264	
合計	2,395,777,264	

(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 9月 5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	1,269,018,139	-	1,266,695,524	2,322,615
合計		1,269,018,139	-	1,266,695,524	2,322,615

(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 9月 5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	1,407,293,551	-	1,413,052,595	5,759,044
	アメリカドル	714,852,463	-	719,927,364	5,074,901
	カナダドル	56,842,421	-	57,019,149	176,728
	ユーロ	458,764,376	-	458,161,430	602,946
	イギリスポンド	75,404,567	-	75,776,200	371,633
	オフショア人民元	101,429,724	-	102,168,452	738,728
合計		1,407,293,551	-	1,413,052,595	5,759,044

(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	3,594,550.79	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,492,437.50	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,763,484.38	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,733,164.07	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,267,703.11	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,218,437.52	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,414,062.48	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,707,871.08	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,273,664.98	
		T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,409,964.08	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,722,500.00	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,623,593.76	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,062,128.89	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,726,445.27	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,551,426.16	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,028,320.33	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,006,534.35	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,998,225.38	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,398,144.55	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,557,519.55	
		T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,188,822.27	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,149,062.48	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,372,114.21	
		T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,826,297.63	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,138,574.22	
		T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,193,187.48	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,276,796.87	
		T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,443,359.36	
		T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,587,480.44	
		T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,605,468.76	
		T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,637,278.12	
		T 0.75% 11/15/24	2,750,000.00	2,607,666.02	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,227,187.52	
		T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,379,609.36	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,882,542.91			
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,440,609.39			
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,298,026.54			
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,018,554.73			

T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,951,875.04	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,045,037.10	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,150,468.77	
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,353,206.62	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,395,984.38	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,961,562.48	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,848,710.93	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,210,625.00	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,800,820.29	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,412,843.75	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,177,421.87	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,316,132.83	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,425,076.93	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,796,406.24	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	3,026,121.10	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,042,874.98	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,136,236.74	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,779,296.86	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,221,943.34	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,436,796.86	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,467,276.35	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,868,066.42	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,164,075.32	
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,406,750.00	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,515,039.10	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,203,625.00	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,098,508.58	
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,967,171.09	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,825,830.09	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,562,054.68	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,922,353.50	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,366,324.60	
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,260,546.86	
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,997,542.97	
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,103,059.39	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,599,218.75	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,791,693.75	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,411,808.57	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,000,476.54	
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,665,468.76	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,810,683.97	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,798,245.86	

T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,991,601.54
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,975,703.16
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,585,937.52
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,032,792.78
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,371,062.50
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,834,234.40
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,154,345.71
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,851,941.41
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,067,871.07
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,699,397.67
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	6,942,012.87
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,113,598.44
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,683,173.83
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,086,759.74
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,795,939.47
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,167,109.36
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,023,058.63
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,197,605.46
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,037,880.88
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,430,193.34
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,454,257.80
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,864,393.75
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,426,842.18
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,571,448.23
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,822,433.60
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,820,996.10
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,035,329.11
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,756,726.56
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,645,156.25
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,038,166.01
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,466,675.37
T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	3,065,885.16
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,982,656.25
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,249,531.25
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,549,915.62
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,123,482.40
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,247,785.14
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,290,312.50
T 2.75% 08/15/32	13,800,000.00	12,306,257.77
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	6,753,205.08
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,026,742.18
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,621,574.23
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,659,150.76

T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,277,432.62
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,863,125.00
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,061,910.14
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,435,179.63
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,121,562.50
T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	2,162,294.91
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,643,956.22
T 2.875% 05/15/52	7,600,000.00	5,803,312.50
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,685,180.85
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,257,702.74
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,666,118.76
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,775,492.17
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	1,918,164.05
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,094,832.05
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,732,285.17
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,265,371.11
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,896,744.12
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	2,978,122.64
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,281,875.00
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	871,253.90
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	3,116,519.53
T 3.125% 05/15/48	5,580,000.00	4,469,449.20
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,864,914.08
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,494,173.43
T 3.125% 08/31/27	8,850,000.00	8,431,007.81
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,706,476.56
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,932,750.00
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,498,806.65
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,835,468.75
T 3.375% 05/15/33	7,800,000.00	7,296,656.25
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,548,447.08
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,970,408.20
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,442,166.00
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,674,687.50
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	700,609.76
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,113,875.00
T 3.625% 02/15/53	8,350,000.00	7,402,796.87
T 3.625% 05/15/53	1,300,000.00	1,153,648.44
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,765,468.76
T 3.75% 04/15/26	2,800,000.00	2,737,328.13
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,695,195.32
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,373,046.87

T	3.875%	02/15/43	1,900,000.00	1,745,921.87	
T	3.875%	08/15/40	1,450,000.00	1,360,904.30	
T	3.875%	09/30/29	3,540,000.00	3,457,307.79	
T	3.875%	11/30/29	8,130,000.00	7,937,230.05	
T	3%	02/15/47	1,600,000.00	1,254,250.00	
T	3%	02/15/48	1,000,000.00	782,812.50	
T	3%	02/15/49	1,000,000.00	782,460.94	
T	3%	05/15/42	2,450,000.00	1,984,691.39	
T	3%	05/15/45	700,000.00	553,505.86	
T	3%	05/15/47	3,210,000.00	2,516,589.85	
T	3%	07/15/25	6,900,000.00	6,662,812.50	
T	3%	08/15/48	3,250,000.00	2,542,871.11	
T	3%	08/15/52	5,200,000.00	4,077,734.38	
T	3%	09/30/25	4,200,000.00	4,047,421.89	
T	3%	10/31/25	5,000,000.00	4,814,257.80	
T	3%	11/15/44	2,800,000.00	2,222,828.13	
T	4.125%	10/31/27	3,100,000.00	3,065,488.28	
T	4.125%	11/15/32	14,000,000.00	13,903,203.15	
T	4.25%	05/15/39	900,000.00	893,320.30	
T	4.25%	10/15/25	6,900,000.00	6,817,792.98	
T	4.25%	11/15/40	740,000.00	728,466.40	
T	4.375%	02/15/38	1,000,000.00	1,014,335.94	
T	4.375%	05/15/40	1,900,000.00	1,901,855.46	
T	4.375%	05/15/41	650,000.00	647,257.81	
T	4.375%	11/15/39	960,000.00	963,262.50	
T	4.5%	02/15/36	1,090,000.00	1,129,767.97	
T	4.5%	05/15/38	550,000.00	564,222.65	
T	4.5%	08/15/39	1,700,000.00	1,733,269.52	
T	4.625%	02/15/40	1,380,000.00	1,425,389.05	
T	4.75%	02/15/41	750,000.00	783,398.43	
T	4%	02/15/26	6,500,000.00	6,392,597.64	
T	4%	02/28/30	6,200,000.00	6,097,070.32	
T	4%	10/31/29	6,550,000.00	6,438,701.15	
T	4%	11/15/52	7,800,000.00	7,410,304.66	
T	5.0%	05/15/37	400,000.00	433,593.75	
T	5.25%	11/15/28	1,300,000.00	1,353,878.90	
T	5.375%	02/15/31	1,950,000.00	2,093,355.45	
T	6.0%	02/15/26	1,700,000.00	1,748,542.97	
T	6.125%	11/15/27	1,450,000.00	1,545,156.25	
T	6.25%	05/15/30	1,050,000.00	1,168,904.29	
アメリカドル 小計			1,069,790,000.00	935,951,774.33 (137,173,092,045)	
カナダドル	CAN	0.25%	03/01/26	2,280,000.00	2,063,094.27

CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,782,575.50	
CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,532,265.88	
CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	670,368.79	
CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,369,641.28	
CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,709,882.16	
CAN 1.25% 06/01/30	3,980,000.00	3,416,322.66	
CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,389,186.83	
CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	847,673.84	
CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,404,377.54	
CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,160,502.60	
CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,079,982.69	
CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	1,989,044.14	
CAN 1% 06/01/27	810,000.00	729,272.07	
CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,395,844.06	
CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,231,047.48	
CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	222,893.74	
CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,106,064.13	
CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	298,886.10	
CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,528,959.04	
CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	926,541.10	
CAN 2.75% 12/01/55	460,000.00	399,256.73	
CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	527,996.24	
CAN 2% 06/01/28	410,000.00	379,102.92	
CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,338,894.11	
CAN 2% 12/01/51	3,650,000.00	2,709,025.75	
CAN 3.25% 09/01/28	660,000.00	642,642.94	
CAN 3.25% 12/01/33	200,000.00	194,822.92	
CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,141,293.96	
CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,050,534.73	
CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	2,000,715.48	
CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,297,556.84	
CAN 3% 10/01/25	510,000.00	495,042.07	
CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,113,588.68	
CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	784,228.20	
CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,648,656.00	
CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,906,389.90	
CAN 5% 06/01/37	630,000.00	726,473.11	
カナダドル 小計	58,630,000.00	53,210,646.48	(5,732,915,051)
メキシコベ ン	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,970,660.00
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,220,280.06
	MBONO 5.5% 03/04/27	24,260,000.00	21,243,996.80

	MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	41,079,269.00	
	MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,195,220.00	
	MBONO 7.5% 05/26/33	18,500,000.00	16,344,010.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,374,882.40	
	MBONO 7.75% 05/29/31	40,630,000.00	36,945,671.60	
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	24,272,437.90	
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,877,562.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	32,400,000.00	31,088,448.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,320,000.00	15,060,585.60	
	MBONO 8% 07/31/53	14,950,000.00	12,814,243.00	
	MBONO 8% 09/05/24	22,160,000.00	21,496,220.02	
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	21,279,984.00	
	メキシコペソ 小計	364,710,000.00	334,263,470.38 (2,853,105,851)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,260,000.00	1,040,237.10	
	BGB 0.35% 06/22/32	1,570,000.00	1,239,792.10	
	BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	311,493.21	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,375,605.12	
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	167,393.60	
	BGB 0.8% 06/22/25	1,900,000.00	1,823,624.08	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,395,972.35	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,452,876.80	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,457,833.04	
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	692,866.20	
	BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,306,085.29	
	BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	739,125.90	
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	634,753.35	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	630,728.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	744,042.24	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	747,307.00	
	BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	534,911.26	
	BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,383,558.48	
	BGB 1% 06/22/31	1,270,000.00	1,092,352.40	
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	620,652.56	
	BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	499,191.54	
	BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	366,064.20	
	BGB 3.3% 06/22/54	690,000.00	644,908.50	
	BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	432,776.96	
	BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	960,924.36	
	BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,102,134.16	
	BGB 3% 06/22/34	950,000.00	927,471.70	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,032,554.30	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,180,338.90	



BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,154,201.40
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,264,002.20
BGB 5% 03/28/35	1,730,000.00	2,009,030.83
BKO 0.4% 09/13/24	1,820,000.00	1,766,198.66
BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,371,328.13
BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,613,626.65
BKO 2.8% 06/12/25	800,000.00	796,036.53
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,441,266.96
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	553,830.16
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,732,130.46
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,774,084.40
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,115,146.50
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,436,078.76
BTPS 0.85% 01/15/27	1,270,000.00	1,160,043.40
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,335,719.68
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	667,443.12
BTPS 0.95% 06/01/32	1,550,000.00	1,197,238.60
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,830,388.46
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,341,014.90
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,681,237.92
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,042,526.08
BTPS 0% 08/01/26	1,280,000.00	1,153,694.29
BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	715,870.50
BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,336,445.15
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,810,641.30
BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,578,719.70
BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	851,021.31
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,218,430.50
BTPS 1.45% 11/15/24	1,970,000.00	1,919,014.98
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	738,220.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,323,117.09
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,024,079.14
BTPS 1.65% 03/01/32	1,910,000.00	1,584,451.96
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,171,021.82
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	946,928.64
BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	444,948.90
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,616,421.50
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,583,108.69
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,381,707.36
BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	327,649.10
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	629,368.56
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,167,386.24

BTPS 2.25% 09/01/36	2,050,000.00	1,618,026.05
BTPS 2.45% 09/01/33	2,200,000.00	1,890,548.00
BTPS 2.45% 09/01/50	1,010,000.00	682,414.58
BTPS 2.5% 11/15/25	2,200,000.00	2,149,888.84
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,908,337.15
BTPS 2.5% 12/01/32	3,050,000.00	2,672,768.07
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,689,559.52
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	818,437.41
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	557,674.51
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,471,816.16
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,356,436.54
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	986,220.40
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,106,573.12
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,110,439.50
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,186,850.20
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	833,337.75
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,850,869.47
BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	1,019,829.29
BTPS 3.4% 04/01/28	1,200,000.00	1,183,500.00
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,520,903.02
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	907,902.45
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,310,827.04
BTPS 3.7% 06/15/30	300,000.00	295,596.60
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,149,921.43
BTPS 3.8% 04/15/26	1,350,000.00	1,355,703.75
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,301,830.53
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,853,230.38
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,100,765.38
BTPS 4.35% 11/01/33	470,000.00	474,072.08
BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	406,996.00
BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	831,232.00
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,122,983.20
BTPS 4.5% 10/01/53	650,000.00	627,453.45
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,749,796.50
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,527,858.00
BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,736,541.50
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	853,661.24
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,247,932.16
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,823,500.60
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,925,315.46
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,560,668.00
BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,188,125.97
BTPS 5% 08/01/34	3,770,000.00	3,993,659.02

BTPS 5% 09/01/40	2,450,000.00	2,583,627.90
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,996,289.63
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,294,042.50
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,549,495.08
DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,787,686.72
DBR 0.25% 02/15/29	3,030,000.00	2,685,819.27
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,354,386.52
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,965,279.24
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,835,519.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,243,982.01
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	322,827.75
DBR 0% 02/15/30	1,470,000.00	1,254,588.40
DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	941,445.94
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,971,380.14
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,755,602.24
DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,595,814.76
DBR 0% 08/15/26	3,050,000.00	2,816,824.93
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,547,856.00
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,982,225.00
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,250,048.10
DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,740,163.76
DBR 0% 08/15/50	4,380,000.00	2,174,613.06
DBR 0% 08/15/52	2,200,000.00	1,036,057.00
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,174,810.44
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,747,960.28
DBR 1.25% 08/15/48	3,230,000.00	2,408,433.35
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,954,663.20
DBR 1.8% 08/15/53	2,380,000.00	1,944,429.06
DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,515,604.10
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,338,534.80
DBR 2.1% 11/15/29	3,850,000.00	3,755,116.75
DBR 2.3% 02/15/33	4,630,000.00	4,534,608.11
DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,686,494.70
DBR 2.5% 08/15/46	3,040,000.00	2,941,987.36
DBR 2.6% 08/15/33	150,000.00	150,287.55
DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,965,662.29
DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,791,869.71
DBR 4.25% 07/04/39	1,900,000.00	2,267,142.70
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,572,336.62
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,556,419.61
DBR 4.75% 07/04/40	1,770,000.00	2,247,368.64
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,714,265.00

DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,652,191.60
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,521,266.25
DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,138,084.89
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,292,706.60
FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,429,036.96
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,206,483.00
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,457,154.55
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,698,638.16
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	344,383.82
FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	842,862.96
FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,277,902.40
FRTR 0.75% 05/25/28	6,140,000.00	5,560,985.72
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,498,131.39
FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,569,372.92
FRTR 0.75% 11/25/28	5,440,000.00	4,878,238.40
FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,136,062.49
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,732,943.86
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,120,685.04
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,558,164.00
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,531,599.12
FRTR 0% 11/25/29	3,700,000.00	3,095,560.60
FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,272,657.00
FRTR 0% 11/25/31	5,500,000.00	4,319,177.50
FRTR 1.25% 05/25/34	4,330,000.00	3,580,585.25
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,517,903.00
FRTR 1.25% 05/25/38	1,100,000.00	830,402.76
FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,662,760.96
FRTR 1.5% 05/25/50	2,870,000.00	1,885,248.47
FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	931,472.04
FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,354,481.26
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,079,420.80
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,335,239.17
FRTR 1% 11/25/25	4,280,000.00	4,091,363.28
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,431,026.70
FRTR 2.5% 05/25/43	820,000.00	705,455.34
FRTR 2.5% 09/24/26	900,000.00	886,034.70
FRTR 2.75% 02/25/29	500,000.00	495,269.00
FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,307,326.03
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,158,792.06
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,656,913.30
FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	2,973,803.47
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,781,962.83
FRTR 3% 05/25/33	2,780,000.00	2,756,739.74

FRTR 3% 05/25/54	1,210,000.00	1,081,654.09
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,922,205.44
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,794,878.48
FRTR 4% 04/25/55	1,940,000.00	2,100,785.26
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,938,612.06
FRTR 4% 10/25/38	2,750,000.00	2,957,070.32
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,698,349.76
FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,353,492.48
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,010,729.72
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	606,212.65
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	645,127.86
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	373,441.60
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	448,285.34
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	225,675.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	704,485.47
IRISH 0% 10/18/31	790,000.00	625,369.26
IRISH 1.1% 05/15/29	1,060,000.00	961,541.90
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	367,940.46
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	420,588.90
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	531,423.80
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	478,643.26
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	950,806.75
IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	767,214.03
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	767,104.80
IRISH 3% 10/18/43	470,000.00	447,082.80
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,197,762.87
NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,813,997.85
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	821,176.20
NETHER 0.5% 01/15/40	1,380,000.00	939,811.46
NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,327,366.30
NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	835,306.41
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	832,651.94
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,543,861.97
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,110,600.82
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,673,966.49
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,388,199.96
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	626,398.08
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	780,929.40
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,118,033.55
NETHER 0% 07/15/31	1,570,000.00	1,263,733.76
NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	392,264.00
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,505,383.25

NETHER 2.5% 07/15/33	740,000.00	717,999.80
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,775,703.04
NETHER 2% 01/15/54	720,000.00	584,366.40
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,874,828.00
NETHER 4% 01/15/37	1,760,000.00	1,953,316.64
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,694,378.91
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,856,564.39
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,190,307.50
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,319,895.65
OBL 0% 10/09/26	3,650,000.00	3,356,875.80
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,763,176.00
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,323,018.87
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,372,087.31
OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,360,383.20
OBL 2.4% 10/19/28	670,000.00	664,626.61
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	489,484.80
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,235,353.17
RAGB 0.5% 04/20/27	1,220,000.00	1,117,382.14
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	115,129.35
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	799,266.16
RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	402,853.78
RAGB 0.75% 10/20/26	1,410,000.00	1,318,599.57
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	89,185.72
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,029,564.12
RAGB 0% 02/20/30	1,280,000.00	1,054,853.96
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,333,282.32
RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	978,475.28
RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	627,343.75
RAGB 0% 10/20/40	470,000.00	268,476.69
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,145,018.00
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	759,969.38
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	149,398.23
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	970,483.14
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	343,620.92
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	444,085.85
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	678,628.16
RAGB 2.9% 02/20/33	640,000.00	626,312.96
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	219,127.70
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	681,001.30
RAGB 3.15% 10/20/53	270,000.00	259,235.10
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	459,983.58
RAGB 4.15% 03/15/37	1,570,000.00	1,708,379.80
RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,114,825.51

RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,316,718.34	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	297,886.60	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	200,126.03	
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	294,153.70	
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	181,498.71	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	582,171.07	
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	292,724.77	
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	491,002.02	
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	647,645.05	
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	458,768.00	
RFGB 0.75% 04/15/31	570,000.00	483,245.43	
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	421,004.90	
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	405,619.06	
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	274,303.50	
RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	519,740.16	
RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	302,793.20	
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	331,138.74	
RFGB 1.375% 04/15/47	510,000.00	354,859.53	
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	499,924.77	
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	472,116.84	
RFGB 2.75% 04/15/38	290,000.00	270,546.80	
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	545,812.30	
RFGB 2.875% 04/15/29	210,000.00	209,022.66	
RFGB 3% 09/15/33	460,000.00	455,148.14	
RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	588,231.36	
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,718,464.72	
SPGB 0.5% 04/30/30	2,750,000.00	2,293,090.25	
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,040,724.94	
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,039,615.68	
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,751,521.20	
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,224,418.68	
SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,384,646.00	
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	996,035.36	
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,173,936.68	
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,459,037.00	
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,607,627.72	
SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,110,637.25	
SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,886,507.25	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,392,144.24	
SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,725,684.22	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,650,000.00	2,496,980.70	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	1,999,872.00	

	SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,880,805.30
	SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,439,569.93
	SPGB 1.45% 10/31/27	2,480,000.00	2,309,128.00
	SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	297,071.73
	SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,410,784.50
	SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,408,698.35
	SPGB 1.85% 07/30/35	2,180,000.00	1,798,096.70
	SPGB 1.9% 10/31/52	1,380,000.00	862,525.94
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,222,711.95
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,848,456.89
	SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	542,222.24
	SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	946,185.20
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,533,709.05
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,440,000.00	1,296,554.40
	SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,833,390.50
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,345,819.59
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,337,862.39
	SPGB 2.8% 05/31/26	1,000,000.00	986,262.80
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,628,389.56
	SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,643,709.94
	SPGB 3.45% 07/30/43	730,000.00	670,539.23
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,180,646.51
	SPGB 3.55% 10/31/33	1,490,000.00	1,482,319.05
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,030,000.00	1,022,934.71
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,035,410.00
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,906,398.91
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,056,242.48
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,928,292.60
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,415,880.40
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,647,572.04
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,355,981.20
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,204,785.45
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,031,197.44
	ユーロ 小計	652,570,000.00	593,096,771.07 (93,810,116,280)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,131,470.67
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,247,783.66
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,772,447.29
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	1,966,511.50
	UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,259,285.36
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,626,281.50
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,762,094.00
	UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	494,104.32



UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,300,605.32
UKT 0.625% 07/31/35	1,700,000.00	1,093,610.00
UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	406,557.20
UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	760,104.00
UKT 0.875% 07/31/33	1,630,000.00	1,165,886.84
UKT 0.875% 10/22/29	1,810,000.00	1,472,078.43
UKT 1.125% 01/31/39	2,050,000.00	1,253,429.04
UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	368,049.36
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	839,277.50
UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,128,325.00
UKT 1.25% 10/22/41	1,960,000.00	1,138,358.20
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,465,728.00
UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	914,537.44
UKT 1.5% 07/31/53	1,140,000.00	558,018.60
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	933,369.13
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	673,738.60
UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	530,244.80
UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	336,858.00
UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	800,436.00
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,331,895.09
UKT 1% 01/31/32	3,940,000.00	3,000,901.00
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	878,838.00
UKT 2.75% 09/07/24	1,440,000.00	1,406,473.34
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,245,910.80
UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,531,575.52
UKT 3.25% 01/31/33	2,630,000.00	2,388,473.95
UKT 3.5% 01/22/45	1,970,000.00	1,630,726.60
UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,224,791.31
UKT 3.5% 10/22/25	850,000.00	821,427.25
UKT 3.75% 01/29/38	1,410,000.00	1,271,664.90
UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,115,960.47
UKT 3.75% 10/22/53	1,620,000.00	1,362,582.00
UKT 4.125% 01/29/27	2,800,000.00	2,735,644.80
UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,835,190.00
UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,487,340.00
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,204,085.98
UKT 4.25% 12/07/27	2,180,000.00	2,151,551.00
UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,366,644.72
UKT 4.25% 12/07/46	1,590,000.00	1,469,796.00
UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,485,142.56
UKT 4.25% 12/07/55	1,780,000.00	1,649,704.00
UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,388,901.90

	UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,742,946.48
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,492,645.60
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,412,468.40
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,112,074.00
	UKT 4% 10/22/63	560,000.00	496,832.00
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,179,988.20
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,443,102.48
イギリスポンド 小計		95,710,000.00	76,264,468.11 (14,117,315,691)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,656,097.93
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,830,797.81
	SGB 0.75% 11/12/29	5,260,000.00	4,653,836.49
	SGB 1.75% 11/11/33	2,700,000.00	2,457,571.77
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,475,311.59
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,283,989.77
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,612,494.26
	SGB 3.5% 03/30/39	4,300,000.00	4,618,415.00
スウェーデンクローナ 小計		44,380,000.00	41,588,514.62 (553,543,129)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	3,017,622.08
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,410,416.40
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,839,790.16
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,917,233.80
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,032,758.23
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,762,805.50
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	2,925,437.76
	NGB 2% 04/26/28	2,630,000.00	2,411,725.78
	NGB 3% 08/15/33	3,460,000.00	3,216,139.20
ノルウェークローネ 小計		37,160,000.00	33,533,928.91 (462,097,540)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,554,858.90
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,249,522.15
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,337,970.92
	DGB 0% 11/15/24	3,950,000.00	3,799,692.00
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,244,150.00
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,380,999.24
	DGB 2.25% 11/15/33	930,000.00	885,546.00
	DGB 4.5% 11/15/39	10,590,000.00	12,760,085.85
デンマーククローネ 小計		46,690,000.00	43,212,825.06 (916,976,147)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,939,315.04
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,313,114.00
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,142,284.55

	POLGB 1.75% 04/25/32	3,110,000.00	2,312,907.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,796,222.80	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,544,392.30	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,760,000.00	4,300,184.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,882,482.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,191,098.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,884,616.13	
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,332,665.48	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	609,390.00	
	POLGB 6% 10/25/33	2,100,000.00	2,170,350.00	
	POLGB 7.5% 07/25/28	1,510,000.00	1,644,184.48	
	ポーランドズロチ 小計	45,470,000.00	41,063,205.78 (1,451,875,873)	
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,676,799.83	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,942,032.51	
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,096,447.04	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,941,653.78	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	1,999,793.04	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,710,000.00	972,131.15	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,497,578.17	
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,195,015.05	
	ACGB 1% 12/21/30	2,020,000.00	1,641,812.71	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,380,854.47	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,142,490.20	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,059,975.22	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,044,152.71	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,851,677.43	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,575,003.35	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,367,435.86	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,048,306.37	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,627,339.02	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	981,129.35	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,368,933.47	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,101,296.14	
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,490,000.00	1,444,918.36	
	ACGB 3% 03/21/47	1,450,000.00	1,141,668.58	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,674,040.04	
ACGB 4.25% 04/21/26	1,500,000.00	1,516,795.35		
ACGB 4.5% 04/21/33	2,690,000.00	2,780,749.84		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,394,310.99		
	オーストラリアドル 小計	49,450,000.00	44,464,340.03 (4,204,103,349)	
	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	524,066.89	

ニュージーランドドル	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	592,729.33	
	NZGB 1.5% 05/15/31	790,000.00	619,354.25	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	281,930.06	
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	814,833.51	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	489,313.96	
	NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	340,446.79	
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	421,760.55	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,160,000.00	1,035,832.75	
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	589,686.09	
	NZGB 4.25% 05/15/34	380,000.00	358,326.27	
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	825,361.09	
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	478,659.77	
	ニュージーランドドル 小計		8,620,000.00	7,372,301.31
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	590,000.00	554,069.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	760,104.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	501,312.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	606,760.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	249,814.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	609,210.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	590,525.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	881,824.50	
	SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	426,668.35	
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	704,592.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	360,000.00	345,348.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	608,640.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	599,467.05	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	640,705.00	
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	415,422.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	619,605.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	846,790.90	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	746,290.00	
	SIGB 3% 08/01/72	220,000.00	220,000.00	
	SIGB 3% 09/01/24	900,000.00	894,770.46	
シンガポールドドル 小計		12,440,000.00	11,821,917.66	(1,278,658,614)
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,518,413.83	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,502,934.42	
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	695,394.85	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,935,214.22	
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,254,994.18	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,744,691.72	

	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,871,604.82
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,381,121.93
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,174,709.38
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,141,109.25
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,991,276.19
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,497,001.29
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	606,798.90
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,706,698.21
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,288,744.83
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,950,734.81
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,554,069.44
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,781,411.80
	MGS 4.392% 04/15/26	2,520,000.00	2,574,412.84
	MGS 4.498% 04/15/30	1,100,000.00	1,148,383.71
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	362,938.80
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	927,121.24
	MGS 4.696% 10/15/42	1,450,000.00	1,553,688.48
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,045,132.17
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,444,441.58
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,009,857.76
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,830,150.16
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,124,656.79
	マレーシアリングット 小計	46,890,000.00	47,617,707.60 (1,498,153,078)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,952,228.32
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,033,510.43
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,276,001.77
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,550,000.00	1,258,818.69
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,301,328.24
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,182,042.77
	ILGOV 1% 03/31/30	2,220,000.00	1,854,080.05
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,501,255.97
	ILGOV 2.8% 11/29/52	500,000.00	377,873.65
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,498,068.00
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,492,311.82
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,204,772.63
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,428,894.26
	イスラエルシェケル 小計	24,120,000.00	22,361,186.60 (865,315,310)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000.00	53,712,469.03
	CGB 2.18% 08/25/25	19,000,000.00	18,977,534.40
	CGB 2.26% 02/24/25	32,000,000.00	32,056,758.40
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,243,118.30

CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,419,617.43
CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,149,139.43
CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,949,991.19
CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	42,526,728.12
CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,304,110.60
CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,614,895.35
CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,627,663.82
CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,071,530.00
CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,128,499.73
CGB 2.6% 09/01/32	32,800,000.00	32,666,678.49
CGB 2.62% 04/15/28	15,050,000.00	15,138,974.09
CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,044,170.00
CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,598,028.94
CGB 2.68% 05/21/30	33,530,000.00	33,706,964.63
CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,285,778.82
CGB 2.69% 08/15/32	20,220,000.00	20,310,173.11
CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,598,678.30
CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	25,779,966.59
CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	10,767,802.69
CGB 2.79% 12/15/29	13,000,000.00	13,134,119.70
CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,360,992.07
CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,256,012.00
CGB 2.8% 11/15/32	4,000,000.00	4,048,500.00
CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	30,010,305.45
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,518,475.33
CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,673,590.02
CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,788,890.99
CGB 2% 06/15/25	3,600,000.00	3,590,696.05
CGB 3.01% 05/13/28	14,000,000.00	14,343,170.80
CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,325,176.46
CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,180,780.84
CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,632,144.92
CGB 3.19% 04/15/53	2,600,000.00	2,727,869.30
CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,191,688.96
CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,645,523.88
CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,605,265.30
CGB 3.39% 03/16/50	16,830,000.00	18,127,904.35
CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	8,223,346.50
CGB 3.72% 04/12/51	7,940,000.00	9,040,907.99
CGB 3.81% 09/14/50	18,550,000.00	21,455,258.32
CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,922,370.11
CGB 4.08% 10/22/48	14,010,000.00	16,712,440.73

	オフショア人民元 小計	916,230,000.00	934,194,701.53 (18,809,076,120)	
	合計		284,367,734,291 (284,367,734,291)	

## 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 205銘柄	100.0%	48.2%
カナダドル	国債証券 38銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 359銘柄	100.0%	33.0%
イギリスポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	5.0%
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 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 28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 46銘柄	100.0%	6.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 9月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,993,182,089
コール・ローン	648,353,286
株式	575,911,875,483
投資信託受益証券	166,702,236
投資証券	11,573,155,351
派生商品評価勘定	151,843,576
未収入金	371,117,129

	2023年 9月 5日現在
項目	金額（円）
未収配当金	919,145,447
差入委託証拠金	5,004,713,330
流動資産合計	602,740,087,927
資産合計	602,740,087,927
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,269,562
前受金	101,467,431
未払金	1,242,116,608
未払解約金	335,601,588
未払利息	1,676
流動負債合計	1,728,456,865
負債合計	1,728,456,865
純資産の部	
元本等	
元本	113,750,742,062
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	487,260,889,000
元本等合計	601,011,631,062
純資産合計	601,011,631,062
負債純資産合計	602,740,087,927

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>



2023年 9月 5日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 9月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	113,750,742,062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 5.2836円 (1万口当たり純資産額) (52,836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 9月 5日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月 5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。

2023年 9月 5日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	128,253,256,319円
期中追加設定元本額	14,488,961,718円
期中一部解約元本額	28,991,475,975円
期末元本額	113,750,742,062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）	1,583,156,399円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,451,884円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,138,635,908円
世界経済インデックスファンド	12,473,117,118円
外国株式インデックス・オープン	881,853,611円
D Cマイセレクション25	652,096,103円
D Cマイセレクション50	3,506,569,441円
D Cマイセレクション75	4,351,060,140円
D C外国株式インデックス・オープン	12,589,044,597円
D CマイセレクションS25	411,750,531円
D CマイセレクションS50	1,887,993,275円
D CマイセレクションS75	1,867,193,359円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	20,902,667円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	138,989,959円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	108,842,589円
D C世界経済インデックスファンド	9,409,018,118円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	982,975,423円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,777,533円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,528,471円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	23,410,402円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	8,018,426円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	35,143,695円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	7,658,668円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	22,159,960円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	176,206,479円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	136,873,254円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,035,534,594円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	69,039,611円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	17,787,627円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	117,008,073円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	39,232,017円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	824,893,776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）	895,464,471円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,124,858,674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	1,510,074,324円
分散投資コア戦略ファンドS	7,640,398,474円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,450,286,590円

区分	2023年 9月 5日現在
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,003,916,061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）	511,811,539円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,412,377円
S M T インデックスバランス・オープン	128,596,189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）	4,328,439,591円
S M T 世界経済インデックス・オープン	245,944,167円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	993,102,585円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	172,982,232円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,275,826円
M y S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,023,702,905円
グローバル経済コア	527,275,991円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	15,282,715円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	6,178,365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）	27,008,065円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	137,294,680円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	129,828,601円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	55,083,985円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	58,918,218円
10資産分散投資ファンド	53,221,998円
F O F s用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	53,282,589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）	23,177,476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）	439,288,922円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,439,019,359円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,140,924円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	68,475,569円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	84,684,175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）	70,538,751円
S M T A M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
S M T A M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
S M T A M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
S M T A M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
S M T A M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）	85,911,878円
S M T A M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 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	30,365,123,924
投資信託受益証券	19,034,020
投資証券	278,441,880
合計	30,624,531,784

(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 9月 5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	13,084,475,200	-	13,185,942,631	101,467,431
	合計	13,084,475,200	-	13,185,942,631	101,467,431

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2023年 9月 5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	482,180,670	-	484,244,403	2,063,733
	アメリカドル	406,729,000	-	408,837,393	2,108,393
	カナダドル	75,451,670	-	75,407,010	44,660
	売建	251,106,755	-	252,063,905	957,150
	スイスフラン	98,838,960	-	99,402,420	563,460
	スウェーデンクローナ	119,399,400	-	119,778,300	378,900
	イスラエルシェケル	32,868,395	-	32,883,185	14,790
合計		733,287,425	-	736,308,308	1,106,583

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	23,392	45.08	1,054,511.36	
	BAKER HUGHES CO	77,332	36.81	2,846,590.92	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	167.34	3,028,686.66	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	90.26	765,585.32	
	CHEVRON CORP	135,745	164.30	22,302,903.50	
	CONOCOPHILLIPS	90,080	122.14	11,002,371.20	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	28.46	1,552,379.16	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	52.92	2,659,547.52	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	154.66	2,051,874.22	
	EOG RESOURCES INC	43,691	130.98	5,722,647.18	

EQT CORPORATION	27,026	44.22	1,195,089.72
EXXON MOBIL	301,729	113.52	34,252,276.08
HALLIBURTON CO	70,302	39.81	2,798,722.62
HESS CORP	21,602	157.20	3,395,834.40
HF SINCLAIR CORP	13,429	56.88	763,841.52
KINDER MORGAN INC	144,061	17.14	2,469,205.54
MARATHON OIL CORP	50,360	27.11	1,365,259.60
MARATHON PETROLEUM CORP	31,527	145.96	4,601,680.92
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	64.57	3,190,145.42
ONEOK INC	35,535	65.55	2,329,319.25
OVINTIV INC	20,398	48.28	984,815.44
PHILLIPS 66	34,260	117.17	4,014,244.20
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	241.66	4,198,600.84
SCHLUMBERGER	105,564	60.12	6,346,507.68
TARGA RESOURCES CORP	17,298	87.53	1,514,093.94
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,908.33	1,017,139.89
VALERO ENERGY CORP	26,571	133.58	3,549,354.18
WILLIAMS COS	90,577	34.69	3,142,116.13
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,508	298.02	4,919,714.16
ALBEMARLE CORP	8,403	200.26	1,682,784.78
AMCOR PLC	110,292	9.78	1,078,655.76
AVERY DENNISON CORP	6,638	189.02	1,254,714.76
BALL CORP	21,539	54.93	1,183,137.27
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	128.90	1,106,219.80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,149	79.21	1,041,532.29
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	15.51	666,930.00
CORTEVA INC	51,304	51.11	2,622,147.44
CROWN HOLDINGS INC	9,940	93.87	933,067.80
DOW INC	51,372	55.29	2,840,357.88
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	77.97	2,660,258.43
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	85.96	759,198.72
ECOLAB INC	18,665	182.70	3,410,095.50
FMC CORP	8,264	86.09	711,447.76
FREEMPORT-MCMORAN INC	105,762	41.49	4,388,065.38
INT'L PAPER CO	25,191	35.19	886,471.29
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	70.25	1,356,316.75
LINDE PLC	36,447	388.91	14,174,602.77
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	100.97	1,993,652.65
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,371	457.39	1,999,251.69
MOSAIC CO/THE	27,732	39.85	1,105,120.20
NEWMONT CORPORATION	61,808	39.32	2,430,290.56
NUCOR CORP	18,727	172.58	3,231,905.66

PACKAGING CORP OF AMERICA	7,783	149.56	1,164,025.48
PPG INDUSTRIES INC	17,495	142.01	2,484,464.95
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	285.53	1,178,096.78
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	100.34	1,049,155.04
SEALED AIR CORP	11,690	37.29	435,920.10
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,250	274.82	5,015,465.00
STEEL DYNAMICS INC	11,618	107.30	1,246,611.40
VULCAN MATERIALS CO	10,153	222.92	2,263,306.76
WESTLAKE CORP	2,222	132.70	294,859.40
WESTROCK CO	21,356	32.85	701,544.60
3 M COMPANY	40,676	106.95	4,350,298.20
AECOM	10,456	88.57	926,087.92
AERCAP HOLDINGS NV	11,968	61.52	736,271.36
ALLEGION PLC	5,598	114.75	642,370.50
AMETEK INC	17,753	160.65	2,852,019.45
AXON ENTERPRISE INC	5,367	215.39	1,155,998.13
BOEING CO	42,311	223.40	9,452,277.40
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	148.74	1,637,627.40
CARLISLE COS INC	3,456	268.59	928,247.04
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	57.94	3,595,930.22
CATERPILLAR	38,381	286.25	10,986,561.25
CUMMINS INC	10,414	236.64	2,464,368.96
DEERE&CO	20,925	418.90	8,765,482.50
DOVER CORP	10,657	148.70	1,584,695.90
EATON CORP	29,584	233.67	6,912,893.28
EMERSON ELECTRIC CO	42,473	98.92	4,201,429.16
FASTENAL CO	44,011	57.28	2,520,950.08
FERGUSON PLC	16,260	162.23	2,637,859.80
FORTIVE CORP	25,894	79.02	2,046,143.88
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	70.26	724,380.60
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	118.94	619,796.34
GENERAL DYNAMICS CORP	17,004	226.37	3,849,195.48
GENERAL ELECTRIC CO	81,042	114.24	9,258,238.08
GRACO INC	13,378	79.46	1,063,015.88
GRAINGER (WW) INC	3,363	710.78	2,390,353.14
HEICO CORP	3,640	169.36	616,470.40
HEICO CORP-CLASS A	4,690	135.98	637,746.20
HONEYWELL INTL INC	49,482	188.39	9,321,913.98
HOWMET AEROSPACE INC	32,364	49.69	1,608,167.16
HUBBELL INC	3,709	328.53	1,218,517.77
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	220.86	548,174.52
IDEX CORP	5,916	228.28	1,350,504.48

ILLINOIS TOOL WORKS	22,658	247.37	5,604,909.46
INGERSOLL-RAND INC	31,562	69.95	2,207,761.90
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	47.45	602,615.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	59.78	3,004,901.48
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	177.26	2,602,531.32
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	382.36	965,841.36
LOCKHEED MARTIN CORP	16,942	448.18	7,593,065.56
MASCO CORP	15,277	59.72	912,342.44
NORDSON CORP	4,121	245.51	1,011,746.71
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,740	435.62	4,678,558.80
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	86.17	2,646,883.89
OWENS CORNING	6,460	146.75	948,005.00
PACCAR INC	38,842	83.52	3,244,083.84
PARKER HANNIFIN CORP	9,535	422.46	4,028,156.10
PENTAIR PLC	10,813	70.96	767,290.48
QUANTA SERVICES INC	11,573	212.36	2,457,642.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	314.05	2,658,747.30
RTX CORP	108,761	86.28	9,383,899.08
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	38.00	525,464.00
SMITH (A.O.) CORP	9,016	73.57	663,307.12
SNAP-ON INC	4,000	270.52	1,082,080.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	94.45	1,189,881.10
TEXTRON	17,063	78.22	1,334,667.86
TORO CO	8,812	103.65	913,363.80
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	205.23	3,494,656.44
TRANSDIGM GROUP INC	4,084	911.32	3,721,830.88
UNITED RENTALS INC	5,364	491.17	2,634,635.88
WABTEC CORP	13,304	113.49	1,509,870.96
WATSCO INC	2,656	365.23	970,050.88
XYLEM INC	16,864	102.58	1,729,909.12
AUTOMATIC DATA PROCESS	30,799	255.75	7,876,844.25
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	114.78	1,060,567.20
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,290	187.74	1,556,364.60
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	73.11	779,937.48
CINTAS CORP	6,804	505.26	3,437,789.04
CLARIVATE PLC	27,357	7.29	199,432.53
COPART INC	63,766	44.98	2,868,194.68
EQUIFAX INC	9,160	206.83	1,894,562.80
JACOBS SOLUTIONS INC	8,667	135.38	1,173,338.46
LEIDOS HOLDINGS	8,529	98.84	843,006.36
PAYCHEX INC	24,118	122.40	2,952,043.20
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	295.79	1,252,670.65

PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	203.78	697,538.94
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	144.90	2,384,329.50
ROBERT HALF INC	7,185	74.98	538,731.30
ROLLINS INC	17,468	39.37	687,715.16
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	57.53	886,077.06
TRANSUNION	15,741	81.13	1,277,067.33
VERISK ANALYTICS INC	10,738	242.84	2,607,615.92
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	139.29	2,754,459.75
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	157.01	4,747,354.36
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	88.35	739,224.45
CSX CORP	152,261	30.63	4,663,754.43
DELTA AIR LINES INC	9,648	42.86	413,513.28
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	116.37	1,429,023.60
FEDEX CORP	17,749	260.97	4,631,956.53
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.83	432,832.13
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	191.73	1,102,064.04
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	55.24	752,534.52
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	206.38	3,491,949.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	435.87	3,206,259.72
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	31.42	425,206.86
U-HAUL HOLDING CO	6,606	54.48	359,894.88
UBER TECHNOLOGIES INC	134,723	47.04	6,337,369.92
UNION PACIFIC CORP	45,361	221.03	10,026,141.83
UNITED PARCEL SERVICE B	53,764	168.00	9,032,352.00
APTIV PLC	21,896	104.49	2,287,913.04
BORGWARNER INC	19,781	41.29	816,757.49
FORD MOTOR COMPANY	290,797	12.14	3,530,275.58
GENERAL MOTORS CO	103,664	33.54	3,476,890.56
LEAR CORP	3,648	145.98	532,535.04
LUCID GROUP INC	61,234	6.36	389,448.24
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	23.31	1,196,642.16
TESLA INC	213,419	245.01	52,289,789.19
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	532.75	1,120,373.25
DR HORTON INC	22,973	120.18	2,760,895.14
GARMIN LTD	10,561	106.04	1,119,888.44
HASBRO INC	10,572	72.79	769,535.88
LENNAR CORP-CL A	18,864	120.66	2,276,130.24
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	404.19	3,483,713.61
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	101.78	423,710.14
NIKE B	91,582	102.36	9,374,333.52
NVR INC	247	6,509.35	1,607,809.45
PULTE GROUP INC	16,747	82.63	1,383,804.61



VF CORP	25,718	20.46	526,190.28
WHIRLPOOL CORP	3,785	141.95	537,280.75
AIRBNB INC-CLASS A	30,729	132.69	4,077,431.01
ARAMARK	16,686	38.19	637,238.34
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	3,114.89	8,718,577.11
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	55.75	978,970.00
CARNIVAL CORPORATION	71,810	15.73	1,129,571.30
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,047	1,938.61	3,968,334.67
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	155.56	1,432,240.92
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	391.14	1,113,966.72
DOORDASH INC - A	19,212	84.04	1,614,576.48
DRAFTKINGS INC	32,654	29.64	967,864.56
EXPEDIA GROUP INC	11,638	109.57	1,275,175.66
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,175	151.00	2,895,425.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	114.80	434,747.60
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	54.93	1,404,010.80
MARRIOTT INTL A	19,516	205.82	4,016,783.12
MCDONALD'S CORP	54,264	280.94	15,244,928.16
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	44.35	1,009,139.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	97.70	1,672,233.20
STARBUCKS CORP	85,428	98.00	8,371,944.00
VAIL RESORTS INC	3,014	227.90	686,890.60
WYNN RESORTS LTD	6,702	101.64	681,191.28
YUM BRANDS INC	22,162	129.64	2,873,081.68
ACTIVISION BLIZZARD INC	58,681	92.04	5,400,999.24
ALPHABET INC-CL A	444,829	135.66	60,345,502.14
ALPHABET INC-CL C	395,244	136.80	54,069,379.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	422.32	3,037,325.44
COMCAST CORP-CL A	312,679	45.73	14,298,810.67
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	120.54	2,378,615.82
FOX CORP - CLASS A	21,544	30.98	667,433.12
FOX CORP- CLASS B	10,345	28.75	297,418.75
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	32.60	929,458.60
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	91.27	835,394.31
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	69.03	1,061,612.37
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	24.58	333,894.72
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	84.05	976,072.65
MATCH GROUP INC	22,730	46.46	1,056,035.80
META PLATFORMS INC-CLASS A	165,576	296.38	49,073,414.88
NETFLIX INC	33,103	439.88	14,561,347.64
NEWS CORP-CLASS A	33,479	21.28	712,433.12
OMNICOM GROUP	14,048	80.21	1,126,790.08

PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	13.65	443,734.20
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	27.65	1,265,457.55
ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	28.44	810,625.32
ROKU INC	9,122	81.72	745,449.84
SEA LTD-ADR	28,338	38.52	1,091,579.76
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.50	272,106.00
SNAP INC - A	63,578	10.44	663,754.32
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	141.83	1,824,926.61
THE WALT DISNEY CO	135,788	81.64	11,085,732.32
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	79.93	2,684,289.19
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	11.56	2,050,894.28
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	18.58	407,552.30
AMAZON.COM	690,901	138.12	95,427,246.12
AUTOZONE INC	1,368	2,542.39	3,477,989.52
BATH & BODY WORKS INC	13,528	38.15	516,093.20
BEST BUY COMPANY INC	15,285	75.27	1,150,501.95
BURLINGTON STORES INC	5,108	162.48	829,947.84
CARMAX INC	10,695	83.58	893,888.10
CHEWY INC - CLASS A	6,878	24.67	169,680.26
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	116.66	577,467.00
EBAY	41,952	45.10	1,892,035.20
ETSY INC	10,294	74.63	768,292.69
GENUINE PARTS CO	9,903	155.08	1,535,757.24
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	40.00	280,000.00
HOME DEPOT	75,273	333.08	25,071,930.84
LKQ CORP	19,286	52.87	1,019,650.82
LOWES COMPANIES	44,328	232.51	10,306,703.28
MERCADOLIBRE INC	3,353	1,421.64	4,766,758.92
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	947.45	4,336,478.65
POOL CORP	2,664	368.18	980,831.52
ROSS STORES INC	25,425	121.70	3,094,222.50
TJX COMPANIES INC	85,671	92.64	7,936,561.44
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	220.52	1,730,199.92
ULTA BEAUTY INC	3,920	416.01	1,630,759.20
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	22.46	561,500.00
COSTCO WHOLESALE CORP	32,965	544.25	17,941,201.25
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	130.27	2,121,707.49
DOLLAR TREE INC	16,318	118.74	1,937,599.32
KROGER CO	50,664	45.98	2,329,530.72
SYSCO CORP	40,090	70.29	2,817,926.10
TARGET (DAYTON HUDSON)	34,220	125.52	4,295,294.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	23.43	1,208,214.81

WALMART INC	110,203	161.57	17,805,498.71
ALTRIA GROUP INC	132,765	44.11	5,856,264.15
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	79.79	3,240,910.22
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	66.74	1,602,160.44
BUNGE LIMITED	11,604	115.02	1,334,692.08
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	40.89	648,883.41
COCA-COLA CO	305,497	59.31	18,119,027.07
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	62.32	959,354.08
CONAGRA BRANDS INC	33,324	29.32	977,059.68
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,979	259.48	3,108,310.92
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	61.91	819,812.22
GENERAL MILLS INC	43,531	66.25	2,883,928.75
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	213.85	2,339,946.70
HORMEL FOODS CORP	23,338	38.40	896,179.20
JM SMUCKER CO	7,850	142.49	1,118,546.50
KELLOGG CO	18,819	59.89	1,127,069.91
KEURIG DR PEPPER INC	65,371	33.55	2,193,197.05
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	32.58	2,246,847.12
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	97.28	1,155,297.28
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	80.46	1,455,682.32
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	62.91	922,826.79
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	101,324	69.69	7,061,269.56
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	56.55	3,299,579.40
PEPSICO INC	102,377	175.32	17,948,735.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,372	95.68	11,038,792.96
TYSON FOODS INC	23,306	52.59	1,225,662.54
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	96.26	1,862,245.96
CLOROX COMPANY	9,570	155.24	1,485,646.80
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	73.27	4,305,418.47
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	161.70	2,744,534.10
KENVUE INC	111,921	22.96	2,569,706.16
KIMBERLY-CLARK CORP	24,643	127.46	3,140,996.78
PROCTER & GAMBLE CO	177,374	154.51	27,406,056.74
ABBOTT LABORATORIES	129,183	102.85	13,286,471.55
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	374.90	1,969,349.70
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	40.60	1,687,985.60
BECTON DICKINSON & CO	21,103	278.46	5,876,341.38
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,838	53.62	5,728,653.56
CARDINAL HEALTH	19,151	87.58	1,677,244.58
CENCORA INC	12,469	174.96	2,181,576.24
CENTENE CORP	40,934	61.27	2,508,026.18
CVS HEALTH CORP	95,131	65.67	6,247,252.77

DAVITA INC	4,627	102.99	476,534.73
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	37.48	666,169.52
DEXCOM INC	28,772	101.89	2,931,722.94
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	76.38	3,441,071.76
ELEVANCE HEALTH INC	17,637	442.38	7,802,256.06
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	69.25	2,072,029.25
HCA HEALTHCARE INC	15,457	280.81	4,340,480.17
HENRY SCHEIN INC	8,755	76.35	668,444.25
HOLOGIC INC	18,875	75.12	1,417,890.00
HUMANA INC	9,297	460.61	4,282,291.17
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	511.29	3,153,636.72
INSULET CORP	5,246	192.18	1,008,176.28
INTUITIVE SURGICAL INC	26,035	310.41	8,081,524.35
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	206.58	1,352,685.84
MCKESSON CORP	10,179	412.34	4,197,208.86
MEDTRONIC PLC	98,891	82.13	8,121,917.83
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	310.44	1,410,949.80
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	130.52	1,132,783.08
RESMED INC	10,920	159.19	1,738,354.80
STERIS PLC	6,933	230.87	1,600,621.71
STRYKER CORP	25,363	284.45	7,214,505.35
TELEFLEX INC	3,934	213.55	840,105.70
THE CIGNA GROUP	22,079	276.67	6,108,596.93
THE COOPER COS INC	3,504	364.69	1,277,873.76
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,912	476.24	33,294,890.88
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	134.57	628,711.04
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	216.57	2,437,495.35
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	119.45	1,822,090.30
ABBVIE INC	133,056	148.20	19,718,899.20
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	121.91	2,656,540.81
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	201.17	1,939,882.31
AMGEN	39,709	256.71	10,193,697.39
AVANTOR INC	49,647	21.70	1,077,339.90
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	394.60	731,193.80
BIO-TECHNE CORP	12,980	78.76	1,022,304.80
BIOGEN INC	10,740	267.17	2,869,405.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	93.03	1,375,262.49
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	156,340	62.02	9,696,206.80
CATALENT INC	13,739	50.20	689,697.80
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	209.62	881,242.48
DANAHER CORP	53,074	265.59	14,095,923.66
ELI LILLY & CO	60,535	557.11	33,724,653.85

EXACT SCIENCES CORP	12,208	85.16	1,039,633.28
GILEAD SCIENCES INC	92,825	76.65	7,115,036.25
HORIZON THERAPEUTICS PLC	15,618	115.30	1,800,755.40
ILLUMINA INC	11,423	168.46	1,924,318.58
INCYTE CORP	15,212	64.69	984,064.28
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	224.33	3,103,829.88
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	143.76	714,630.96
JOHNSON & JOHNSON	179,427	160.48	28,794,444.96
MERCK & CO	191,177	109.84	20,998,881.68
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,222.50	1,989,007.50
MODERNA INC	24,153	112.56	2,718,661.68
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	110.63	745,867.46
PFIZER	419,551	35.78	15,011,534.78
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,992	831.63	6,646,386.96
REPLIGEN CORP	4,353	175.74	764,996.22
REVVITY INC	8,524	116.92	996,626.08
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	30.27	910,612.41
SEAGEN INC	11,325	207.91	2,354,580.75
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	9.84	906,667.44
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,670	557.22	15,975,497.40
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	228.05	825,084.90
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,147	351.10	6,722,511.70
VIATRIS INC	89,720	10.79	968,078.80
WATERS CORP	4,749	281.02	1,334,563.98
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	407.69	2,351,148.23
ZOETIS INC	34,383	192.52	6,619,415.16
BANK OF AMERICA CORP	535,131	28.98	15,508,096.38
CITIGROUP	144,682	41.59	6,017,324.38
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	28.63	1,131,514.86
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	27.05	1,472,061.00
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,369.15	1,048,768.90
FIRST HORIZON CORP	44,308	12.75	564,927.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	11.22	1,280,336.64
JPMORGAN CHASE & CO	217,897	146.82	31,991,637.54
KEY CORP	71,223	11.56	823,337.88
M & T BANK CORP	11,807	125.76	1,484,848.32
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	122.22	3,624,800.76
REGIONS FINL CORP	70,810	18.56	1,314,233.60
TRUIST FINANCIAL CORP	96,574	30.90	2,984,136.60
US BANCORP	113,859	37.07	4,220,753.13
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	43.56	621,731.88
WELLS FARGO & CO	273,135	41.65	11,376,072.75

ALLY FINANCIAL INC	21,529	28.94	623,049.26
AMERICAN EXPRESS	47,011	159.62	7,503,895.82
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	342.31	2,675,494.96
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	28,767	86.44	2,486,619.48
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	103.18	1,318,640.40
BANK NEW YORK CO	61,254	45.42	2,782,156.68
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	97,275	362.46	35,258,296.50
BLACKROCK INC	11,143	706.19	7,869,075.17
BLACKSTONE INC	52,505	104.49	5,486,247.45
BLOCK INC	39,463	58.17	2,295,562.71
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	103.50	3,115,039.50
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	32.67	511,906.23
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,144	150.36	1,074,171.84
CME GROUP INC	26,740	202.89	5,425,278.60
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,595	77.99	982,284.05
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	92.06	1,747,943.22
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	29.19	816,823.77
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	435.48	1,370,891.04
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	42,810	56.68	2,426,470.80
FISERV INC	46,319	122.81	5,688,436.39
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	272.86	1,381,763.04
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	26.87	700,500.90
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	63.39	273,591.24
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	129.32	2,683,260.68
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,812	327.40	8,123,448.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41,604	117.01	4,868,084.04
INVESCO LTD	26,420	16.03	423,512.60
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	158.08	824,071.04
KKR & CO INC	44,805	62.20	2,786,871.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,307	234.35	1,243,695.45
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	238.84	765,959.88
MASTERCARD INC-CLASS A	63,267	415.57	26,291,867.19
MOODY'S CORP	12,261	339.32	4,160,402.52
MORGAN STANLEY	93,231	85.75	7,994,558.25
MSCI INC	5,952	541.39	3,222,353.28
NASDAQ INC	24,183	51.94	1,256,065.02
NORTHERN TRUST CORP	15,902	77.29	1,229,065.58
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	63.57	5,040,211.02
PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	112.90	1,784,497.40
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	106.41	1,647,865.26
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,913	11.11	354,553.43
S&P GLOBAL INC	24,377	394.24	9,610,388.48

SCHWAB (CHARLES) CORP	111,693	60.50	6,757,426.50
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	62.01	592,195.50
STATE STREET CORP	26,059	69.85	1,820,221.15
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	32.66	953,541.36
TOAST INC-CLASS A	20,341	21.98	447,095.18
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	86.00	779,246.00
VISA INC-CLASS A SHARES	120,784	248.11	29,967,718.24
AFLAC	43,196	74.77	3,229,764.92
ALLSTATE CORP	18,556	110.56	2,051,551.36
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	117.63	743,303.97
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	59.24	3,230,594.16
AON PLC	15,249	334.34	5,098,350.66
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,510	77.01	2,041,535.10
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,913	231.07	3,677,016.91
ASSURANT INC	4,726	140.02	661,734.52
BROWN & BROWN INC	20,155	74.20	1,495,501.00
CHUBB LTD	30,784	203.29	6,258,079.36
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	106.48	1,182,992.80
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	282.30	611,461.80
EVEREST GROUP LTD	3,288	364.80	1,199,462.40
FNF GROUP	20,461	41.95	858,338.95
GLOBE LIFE INC	5,948	111.45	662,904.60
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	72.43	1,791,266.33
LOEWS CORP	12,757	62.30	794,761.10
MARKEL GROUP INC	1,007	1,490.06	1,500,490.42
MARSH & MCLENNAN COS	36,799	195.77	7,204,140.23
METLIFE INC	48,925	64.30	3,145,877.50
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	78.43	1,453,778.48
PROGRESSIVE CORP	43,513	135.48	5,895,141.24
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	96.09	2,548,402.89
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	162.30	2,782,958.10
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,429	207.87	1,544,266.23
WR BERKLEY CORP	17,572	62.43	1,097,019.96
WEYERHAEUSER CO	52,615	32.75	1,723,141.25
ACCENTURE PLC-CL A	46,943	327.74	15,385,098.82
ADOBE INC	34,096	563.21	19,203,208.16
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	105.35	1,209,839.40
ANSYS INC	6,794	319.03	2,167,489.82
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	194.16	464,819.04
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	204.45	2,338,090.20
AUTODESK INC	15,965	220.02	3,512,619.30
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	50.18	743,316.34

BILL HOLDINGS, INC.	7,443	116.45	866,737.35
BLACK KNIGHT INC	11,543	75.76	874,497.68
CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,308	243.56	4,946,216.48
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,186	133.14	823,604.04
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	63.99	1,297,909.17
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,307	71.73	2,604,301.11
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	33.25	408,975.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,571	161.23	2,671,742.33
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	167.86	520,366.00
DATADOG INC - CLASS A	17,716	97.73	1,731,384.68
DOCUSIGN INC	14,969	51.67	773,448.23
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	27.86	642,674.48
DYNATRACE INC	22,028	48.19	1,061,529.32
EPAM SYSTEMS INC	4,768	258.55	1,232,766.40
FAIR ISAAC CORP	1,816	896.56	1,628,152.96
FORTINET INC	48,642	60.87	2,960,838.54
GARTNER INC	5,655	350.04	1,979,476.20
GEN DIGITAL INC	43,555	20.47	891,570.85
GODADDY INC - CLASS A	11,388	72.65	827,338.20
HUBSPOT INC	3,646	551.61	2,011,170.06
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,426	147.94	9,975,002.44
INTUIT INC	20,854	549.60	11,461,358.40
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	201.20	944,432.80
MICROSOFT CORP	528,983	328.66	173,855,552.78
MONDAY.COM LTD	1,631	176.59	288,018.29
MONGODB INC	5,325	392.88	2,092,086.00
OKTA INC	11,505	86.16	991,270.80
ORACLE CORP	123,187	120.93	14,897,003.91
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	130,741	15.18	1,984,648.38
PALO ALTO NETWORKS INC	22,493	242.72	5,459,500.96
PTC INC	8,226	146.75	1,207,165.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,898	499.54	3,945,366.92
SALESFORCE INC	72,631	221.53	16,089,945.43
SERVICENOW INC	15,145	590.88	8,948,877.60
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,326	157.08	3,035,728.08
SPLUNK INC	11,101	122.85	1,363,757.85
SYNOPSYS INC	11,321	460.45	5,212,754.45
TWILIO INC - A	12,842	65.42	840,123.64
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	396.66	1,324,447.74
UIPATH INC - CLASS A	28,419	15.89	451,577.91
UNITY SOFTWARE INC	16,437	37.09	609,648.33
VERISIGN INC	6,723	205.15	1,379,223.45



VMWARE INC-CLASS A	17,149	164.10	2,814,150.90
WIX.COM LTD	5,010	97.46	488,274.60
WORKDAY INC-CLASS A	15,164	248.49	3,768,102.36
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	71.72	1,186,750.84
ZSCALER INC	7,204	158.38	1,140,969.52
AMPHENOL CORPORATION	44,247	88.57	3,918,956.79
APPLE INC	1,177,684	189.46	223,124,010.64
ARISTA NETWORKS INC	19,289	197.36	3,806,877.04
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	133.88	580,771.44
CDW CORP/DE	9,584	213.18	2,043,117.12
CISCO SYSTEMS	304,444	57.84	17,609,040.96
COGNEX CORP	14,352	47.48	681,432.96
CORNING	58,221	32.86	1,913,142.06
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	68.19	1,235,875.56
F5 INC	4,851	164.61	798,523.11
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	17.98	1,751,827.36
HP INC	68,329	30.37	2,075,151.73
JABIL INC	11,304	115.42	1,304,707.68
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	29.31	742,158.51
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	133.88	1,852,631.44
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,202	283.68	3,461,463.36
NETAPP INC	15,191	77.60	1,178,821.60
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,756	73.70	940,117.20
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,534	282.16	997,153.44
TE CONNECTIVITY LTD	22,795	133.27	3,037,889.65
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	420.53	1,396,159.60
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	55.06	975,553.08
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	45.96	1,185,308.40
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	275.95	1,148,503.90
AT&T INC	529,966	14.65	7,764,001.90
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	19.22	362,662.18
T-MOBILE US INC	40,399	137.33	5,547,994.67
VERIZON COMMUNICATIONS	312,179	34.86	10,882,559.94
AES CORP	54,375	17.89	972,768.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	49.79	1,034,536.62
AMEREN CORPORATION	20,898	78.45	1,639,448.10
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,118	77.52	2,877,387.36
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	137.80	1,993,690.40
ATMOS ENERGY CORP	11,302	115.47	1,305,041.94
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	27.65	1,312,434.90
CMS ENERGY CORP	23,697	55.39	1,312,576.83
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	88.35	2,445,086.25

CONSTELLATION ENERGY	25,114	107.29	2,694,481.06
DOMINION ENERGY INC	60,549	47.88	2,899,086.12
DTE ENERGY COMPANY	15,851	102.18	1,619,655.18
DUKE ENERGY CORP	57,283	87.93	5,036,894.19
EDISON INTL	30,900	68.41	2,113,869.00
ENERGY CORP	16,181	94.34	1,526,515.54
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	36.69	748,439.31
EVERGY INC	18,475	53.60	990,260.00
EVERSOURCE ENERGY	27,450	63.05	1,730,722.50
EXELON CORP	73,907	39.99	2,955,540.93
FIRSTENERGY CORP	39,425	35.69	1,407,078.25
NEXTERA ENERGY INC	150,399	66.87	10,057,181.13
NISOURCE INC	32,351	26.56	859,242.56
NRG ENERGY INC	19,068	38.45	733,164.60
PG&E CORP	148,742	16.46	2,448,293.32
PPL CORPORATION	58,459	24.76	1,447,444.84
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,683	60.50	2,158,821.50
SEMPRA	45,886	70.06	3,214,773.16
SOUTHERN CO	81,133	67.22	5,453,760.26
VISTRA CORP	22,676	31.79	720,870.04
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	83.11	1,948,680.17
XCEL ENERGY INC	39,963	56.51	2,258,309.13
ADVANCED MICRO DEVICES	119,628	109.45	13,093,284.60
ANALOG DEVICES	37,601	182.43	6,859,550.43
APPLIED MATERIALS	62,818	153.99	9,673,343.82
BROADCOM INC	30,991	872.52	27,040,267.32
ENPHASE ENERGY INC	9,617	128.73	1,237,996.41
ENTEGRIS INC	10,321	102.49	1,057,799.29
FIRST SOLAR INC	7,921	186.37	1,476,236.77
INTEL CORP	310,036	36.61	11,350,417.96
KLA CORP	10,294	507.02	5,219,263.88
LAM RESEARCH CORP	10,237	701.96	7,185,964.52
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	97.02	1,065,085.56
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	57.95	3,691,067.30
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	82.29	3,350,684.22
MICRON TECHNOLOGY	81,347	70.39	5,726,015.33
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	524.92	1,853,492.52
NVIDIA CORP	184,802	485.09	89,645,602.18
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	209.96	4,054,327.60
ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	99.40	3,181,893.40
QORVO INC	6,249	108.45	677,704.05
QUALCOMM	82,879	115.38	9,562,993.41

	SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	109.68	1,233,022.56
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	161.95	673,064.20
	TERADYNE INC	12,318	108.46	1,336,010.28
	TEXAS INSTRUMENTS	67,444	169.83	11,454,014.52
	WOLFSPEED INC	10,256	45.93	471,058.08
	CBRE GROUP INC-A	22,995	86.02	1,978,029.90
	COSTAR GROUP INC	29,397	82.57	2,427,310.29
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.54	349,398.00
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	52.52	620,208.68
	アメリカドル 小計	25,635,701		2,931,095,760.99 (429,581,394,730)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	37,400	21.22	793,628.00
	CAMECO CORP	31,793	50.80	1,615,084.40
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,307	88.33	7,270,177.31
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	27.41	3,050,541.13
	ENBRIDGE	150,513	48.30	7,269,777.90
	IMPERIAL OIL	16,488	78.81	1,299,419.28
	KEYERA CORP	18,607	33.78	628,544.46
	PARKLAND CORP	14,896	36.84	548,768.64
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	42.51	1,620,948.81
	SUNCOR ENERGY	98,973	46.45	4,597,295.85
	TC ENERGY CORP	75,669	49.51	3,746,372.19
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	70.87	1,772,387.83
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	65.46	2,363,106.00
	BARRICK GOLD CORP	133,727	21.95	2,935,307.65
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	14,689	60.84	893,678.76
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	37.09	1,608,222.40
	FRANCO-NEVADA CORP	13,695	195.21	2,673,400.95
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	12.30	637,718.10
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.84	741,804.84
	LUNDIN MINING CORP	31,977	10.81	345,671.37
	NUTRIEN LTD	37,152	87.84	3,263,431.68
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	22.14	496,290.24
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	57.80	2,045,310.80
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	102.45	359,087.25
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	58.74	1,874,158.44
	CAE INC	25,999	32.94	856,407.06
	STANTEC INC	9,001	90.85	817,740.85
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	112.63	587,140.19
	WSP GLOBAL INC	9,951	191.28	1,903,427.28
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	44.15	616,819.65
	RB GLOBAL INC	14,445	84.76	1,224,358.20

THOMSON REUTERS CORP	11,033	175.29	1,933,974.57
AIR CANADA	13,805	22.77	314,339.85
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	153.91	6,500,696.67
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	69,248	109.32	7,570,191.36
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	186.93	1,091,110.41
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	80.17	1,623,763.18
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	106.18	325,972.60
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	41.02	402,816.40
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	95.09	2,194,011.57
QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.49	463,448.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	159.48	719,733.24
DOLLARAMA INC	22,000	88.57	1,948,540.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	56,821	72.39	4,113,272.19
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	35.24	244,213.20
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	118.57	1,531,094.41
METRO INC	18,840	70.50	1,328,220.00
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	152.70	798,010.20
SAPUTO INC	20,898	29.45	615,446.10
BANK MONTREAL	52,757	117.10	6,177,844.70
BANK NOVA SCOTIA	88,533	65.48	5,797,140.84
CANADIAN IMPERIAL BANK	67,344	54.16	3,647,351.04
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	94.88	2,287,651.68
ROYAL BANK OF CANADA	103,016	122.85	12,655,515.60
TORONTO-DOMINION BANK	135,406	83.27	11,275,257.62
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	47.46	1,376,387.46
BROOKFIELD CORP	104,769	47.19	4,944,049.11
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	20.92	681,552.68
IGM FINANCIAL INC	7,685	38.71	297,486.35
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	25.24	108,557.24
ONEX CORP	6,603	85.56	564,952.68
TMX GROUP LTD	23,425	29.39	688,460.75
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,125.02	1,973,285.08
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	39.47	938,912.36
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	85.30	595,138.10
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	193.99	2,571,337.45
MANULIFE FINANCIAL CORP	130,818	25.34	3,314,928.12
POWER CORP OF CANADA	43,577	37.34	1,627,165.18
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	66.68	2,908,181.52
CGI INC - CL A	16,084	141.40	2,274,277.60
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,490	2,847.35	4,242,551.50
CONSTELLATION SOFTWARE-RTS	1,490	0.46	685.40
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	102.66	716,977.44

	OPEN TEXT CORP	20,463	55.04	1,126,283.52
	SHOPIFY INC - CLASS A	88,987	90.73	8,073,790.51
	BCE INC	6,203	56.40	349,849.20
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	55.84	1,556,875.04
	TELUS CORP	32,908	23.81	783,539.48
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	10.38	537,870.84
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	27.23	664,275.85
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	37.61	424,804.95
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.28	333,258.72
	EMERA INC	17,459	51.27	895,122.93
	FORTIS INC	35,547	53.40	1,898,209.80
	HYDRO ONE LTD	20,587	36.09	742,984.83
	NORTHLAND POWER INC	17,854	25.37	452,955.98
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	207.86	559,143.40
	カナダドル 小計	3,043,360		184,239,494.01 (19,849,963,084)
ユーロ	ENI	174,687	14.60	2,550,779.57
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	13.05	517,589.10
	NESTE OIL OYJ	32,766	33.82	1,108,146.12
	OMV AG	12,549	44.01	552,281.49
	REPSOL SA	89,536	14.65	1,311,702.40
	TENARIS SA	40,648	14.84	603,216.32
	TOTALENERGIES SE	167,847	58.72	9,855,975.84
	AIR LIQUIDE	38,920	166.46	6,478,623.20
	AKZO NOBEL	12,357	74.64	922,326.48
	ARCELORMITTAL	42,704	24.95	1,065,464.80
	ARKEMA	4,369	95.84	418,724.96
	BASF SE	64,204	46.61	2,992,869.46
	COVESTRO AG	14,454	48.88	706,511.52
	CRH PLC	55,581	52.58	2,922,448.98
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	84.24	1,154,677.68
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.70	283,854.90
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	73.58	792,088.70
	OCI NV	7,248	24.09	174,604.32
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	38.17	744,467.68
	SOLVAY SA	5,356	108.50	581,126.00
	STORA ENSO OYJ R	42,169	11.81	498,015.89
	SYMRISE AG	10,018	95.60	957,720.80
	UMICORE	17,605	24.19	425,864.95
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	31.76	1,344,210.24
	VOESTALPINE AG	7,152	27.78	198,682.56
	WACKER CHEMIE AG	1,770	136.05	240,808.50

ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,403	32.37	530,965.11
AIRBUS SE	44,063	134.18	5,912,373.34
ALSTOM	24,388	24.97	608,968.36
BOUYGUES ORD	16,606	31.49	522,922.94
BRENTAG SE	12,514	74.90	937,298.60
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.88	1,043,614.88
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	34,575	32.05	1,108,128.75
DASSAULT AVIATION SA	2,130	180.00	383,400.00
EIFFAGE	5,924	91.92	544,534.08
FERROVIAL SE	37,026	29.13	1,078,567.38
GEA GROUP AG	13,382	36.26	485,231.32
IMCD NV	4,641	126.90	588,942.90
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	77.42	959,853.16
KNORR-BREMSE AG	5,022	63.44	318,595.68
KONE OYJ-B	26,369	42.12	1,110,662.28
LEGRAND SA	19,340	90.76	1,755,298.40
METSO CORPORATION	51,970	10.72	557,378.25
MTU AERO ENGINES AG	3,962	213.30	845,094.60
PRYSMIAN SPA	21,155	37.31	789,293.05
RATIONAL AG	483	681.00	328,923.00
RHEINMETALL AG	3,820	247.60	945,832.00
SAFRAN SA	24,910	146.08	3,638,852.80
SAINT-GOBAIN	36,177	58.36	2,111,289.72
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,328	157.26	6,341,981.28
SIEMENS	56,492	138.14	7,803,804.88
SIEMENS ENERGY AG	36,841	13.03	480,038.23
THALES SA	8,524	136.70	1,165,230.80
VINCI S.A.	39,327	102.78	4,042,029.06
WARTSILA OYJ	41,917	11.95	500,908.15
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.75	620,556.75
RANDSTAD NV	10,680	53.84	575,011.20
TELEPERFORMANCE	4,734	131.90	624,414.60
WOLTERS KLUWER	18,738	111.40	2,087,413.20
ADP	2,382	122.50	291,795.00
AENA SME SA	5,508	145.05	798,935.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	8.33	377,888.56
DHL GROUP	74,810	42.14	3,152,867.45
GETLINK	21,115	15.55	328,443.82
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,011	94.48	2,079,599.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	86.95	433,967.45
CONTINENTAL AG	8,168	67.40	550,523.20
DR ING HC F PORSCHE AG	7,331	98.88	724,889.28

FERRARI NV	9,370	283.50	2,656,395.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	59,903	66.50	3,983,549.50
MICHELIN	47,236	29.20	1,379,291.20
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	48.69	571,864.05
RENAULT SA	11,597	34.79	403,517.61
STELLANTIS NV	162,367	16.81	2,730,363.47
VALEO SA	16,596	17.74	294,413.04
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	108.30	1,660,022.40
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	126.05	313,360.30
ADIDAS AG	12,783	185.86	2,375,848.38
HERMES INTERNATIONAL	2,355	1,882.40	4,433,052.00
KERING	5,534	490.55	2,714,703.70
LVMH	20,525	772.60	15,857,615.00
MONCLER SPA	14,605	62.64	914,857.20
PUMA SE	9,220	62.10	572,562.00
SEB SA	2,282	99.95	228,085.90
ACCOR	14,436	33.67	486,060.12
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	32,105	63.28	2,031,604.40
DELIVERY HERO SE	13,414	33.62	450,978.68
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,042	167.15	2,179,970.30
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.96	267,239.68
SODEXO	6,173	100.40	619,769.20
BOLLORE SE	83,646	5.36	448,342.56
PUBLICIS GROUPE	17,217	72.28	1,244,444.76
SCOUT24 SE	3,716	63.78	237,006.48
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	22.70	1,494,250.20
VIVENDI SE	61,243	8.41	515,176.11
D'IETEREN GROUP	2,217	150.60	333,880.20
INDITEX	81,082	34.95	2,833,815.90
PROSUS	52,474	65.01	3,411,334.74
ZALANDO SE	17,664	28.63	505,720.32
CARREFOUR	39,746	17.13	681,047.71
HELLOFRESH SE	13,805	30.25	417,601.25
JERONIMO MARTINS	27,312	23.02	628,722.24
KESKO OYJ-B SHS	20,083	18.11	363,703.13
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	30.37	2,153,233.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,422	51.37	3,257,988.14
DANONE (GROUPE)	47,639	53.37	2,542,493.43
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	12.07	408,895.72
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	73.20	696,278.40
HEINEKEN NV	23,160	88.82	2,057,071.20
JDE PEET'S BV	7,000	25.52	178,640.00

KERRY GROUP PLC-A	10,592	84.90	899,260.80
LOTUS BAKERIES	50	7,160.00	358,000.00
PERNOD-RICARD	15,339	181.00	2,776,359.00
REMY COINTREAU	1,032	141.95	146,492.40
BEIERSDORF AG	7,430	121.15	900,144.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	64.04	562,271.20
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	70.58	805,670.70
LOREAL	17,902	405.75	7,263,736.50
AMPLIFON SPA	11,650	29.36	342,044.00
BIOMERIEUX	3,044	95.66	291,189.04
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	92.58	317,549.40
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	96.36	199,465.20
ESSILORLUXOTTICA	21,384	175.32	3,749,042.88
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	44.58	757,191.30
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	29.49	993,488.61
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	20.43	1,467,743.87
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	45.57	982,808.19
ARGENX SE	4,177	474.90	1,983,657.30
BAYER	72,310	50.64	3,661,778.40
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	56.82	580,700.40
GRIFOLS SA	27,685	12.69	351,461.07
IPSEN	3,532	115.90	409,358.80
MERCK KGAA	9,080	168.85	1,533,158.00
ORION OYJ-CLASS B	3,129	37.72	118,025.88
QIAGEN N.V.	17,038	40.98	698,217.24
RECORDATI SPA	5,163	45.57	235,277.91
SANOFI	84,347	98.03	8,268,536.41
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	371.90	678,345.60
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	262.90	413,804.60
UCB (GROUPE)	9,389	81.72	767,269.08
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	13.56	375,547.02
AIB GROUP PLC	88,299	4.18	369,796.21
BANCO BILBAO VIZCAYA	441,393	7.28	3,216,872.18
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.51	4,298,953.96
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.04	799,113.87
BNP PARIBAS	77,654	59.44	4,615,753.76
CAIXABANK	336,789	3.64	1,226,248.74
COMMERZBANK AG	81,889	10.23	837,724.47
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	11.59	1,152,859.17
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	33.17	841,721.92
FINECOBANK SPA	41,585	12.82	533,119.70
ING GROEP NV-CVA	269,040	12.97	3,489,448.80



INTESA SANPAOLO	1,145,097	2.45	2,810,640.58
KBC GROEP NV	18,057	60.82	1,098,226.74
MEDIOBANCA	53,422	12.08	645,337.76
SOCIETE GENERALE	53,019	25.83	1,369,745.86
UNICREDIT SPA	139,080	22.43	3,119,564.40
ADYEN NV	1,609	790.40	1,271,753.60
AMUNDI SA	4,626	54.95	254,198.70
DEUTSCHE BANK NAMEN	134,445	10.05	1,352,247.81
DEUTSCHE BOERSE	14,123	162.95	2,301,342.85
EDENRED	20,131	58.72	1,182,092.32
EURAZEO SA	3,357	55.00	184,635.00
EURONEXT NV	6,480	67.30	436,104.00
EXOR NV	7,825	81.58	638,363.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	74.90	637,773.50
NEXI SPA	48,458	6.61	320,404.29
SOFINA	1,238	208.20	257,751.60
WENDEL	2,023	83.65	169,223.95
WORLDLINE SA	20,332	29.34	596,540.88
AEGON	148,741	4.68	697,149.06
AGEAS	11,086	36.55	405,193.30
ALLIANZ SE-REG	29,979	223.30	6,694,310.70
ASR NEDERLAND NV	11,959	40.57	485,176.63
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	19.01	1,354,196.36
AXA SA	136,364	27.72	3,780,691.90
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	194.65	867,165.75
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	355.20	3,699,052.80
NN GROUP NV	16,208	35.50	575,384.00
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.15	467,485.42
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	40.44	1,339,858.08
TALANX AG	5,053	62.15	314,043.95
BECHTLE AG	7,659	44.67	342,127.53
CAPGEMINI SA	12,235	171.30	2,095,855.50
DASSAULT SYSTEMES SA	47,353	36.68	1,736,908.04
NEMETSCHKE SE	5,455	63.30	345,301.50
SAP SE	77,618	128.00	9,935,104.00
NOKIA OYJ	396,129	3.72	1,475,778.58
CELLNEX TELECOM SA	41,890	35.70	1,495,473.00
DEUTSCHE TELEKOM	240,920	19.65	4,735,523.52
ELISA A	10,227	45.29	463,180.83
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.49	349,160.62
KPN (KON.)	216,358	3.20	693,427.39
ORANGE	153,281	10.38	1,591,669.90

	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.30	259,687.33
	TELEFONICA	373,259	3.75	1,400,841.02
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	1.74	171,813.45
	ACCIONA SA	2,181	127.85	278,840.85
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	26.12	142,014.44
	E.ON SE	166,881	11.29	1,884,086.49
	EDP RENOVAVEIS SA	21,752	16.75	364,454.76
	ELIA GROUP SA/NV	987	103.50	102,154.50
	ENAGAS	21,663	15.54	336,643.02
	ENDESA	25,972	18.82	488,793.04
	ENEL	596,378	6.14	3,667,128.32
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	223,128	4.14	923,749.92
	ENGIE	146,393	14.75	2,159,882.32
	FORTUM OYJ	32,550	12.20	397,110.00
	IBERDROLA SA	444,395	10.73	4,770,580.32
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.08	261,060.80
	REDEIA CORP SA	30,678	14.81	454,494.57
	RWE STAMM	44,929	37.13	1,668,213.77
	SNAM SPA	147,559	4.74	699,872.33
	TERNA SPA	95,819	7.58	726,308.02
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	28.34	1,410,793.54
	VERBUND AG	6,430	74.35	478,070.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,400	446.65	1,518,610.00
	ASML HOLDING NV	29,993	616.80	18,499,682.40
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	107.40	682,741.80
	INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	33.16	3,219,326.55
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	43.47	2,186,183.85
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	66.50	350,787.50
	VONOVIA SE	52,580	21.98	1,155,708.40
	ユーロ 小計	13,585,906		350,537,876.86 (55,444,575,982)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	5.01	6,598,664.43
	SHELL PLC-NEW	499,932	24.44	12,220,837.74
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	21.35	1,992,531.45
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	14.61	436,196.16
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	54.68	597,324.32
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	15.93	280,431.72
	GLENCORE PLC	793,369	4.36	3,459,088.84
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	17.52	295,176.96
	MONDI PLC	41,710	13.07	545,358.25
	RIO TINTO PLC REG	83,678	50.00	4,183,900.00
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	54.68	1,821,773.56

BAE SYSTEMS PLC	219,532	10.07	2,211,784.90
BUNZL PLC	22,799	28.24	643,843.76
DCC PLC	6,622	42.96	284,481.12
MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	5.13	519,129.54
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	2.19	1,398,363.89
SMITHS GROUP PLC	26,476	16.40	434,338.78
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	100.15	552,227.10
EXPERIAN PLC	67,859	27.92	1,894,623.28
INTERTEK GROUP PLC	13,890	41.77	580,185.30
RELX PLC	141,442	25.84	3,654,861.28
RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	5.89	1,072,456.93
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.48	328,164.56
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	40.20	279,470.40
BURBERRY GROUP PLC	29,776	22.00	655,072.00
PERSIMMON PLC	25,686	10.54	270,858.87
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.14	301,210.61
COMPASS GROUP PLC	129,701	20.10	2,606,990.10
ENTAIN PLC	49,630	11.86	588,611.80
INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	59.82	679,734.66
PEARSON	55,305	8.51	470,756.16
WHITBREAD PLC	17,434	34.85	607,574.90
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.03	437,090.78
INFORMA PLC	110,598	7.37	815,549.65
WPP PLC	85,821	7.72	662,881.40
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.42	294,829.03
KINGFISHER PLC	153,717	2.31	356,162.28
NEXT PLC	7,832	70.36	551,059.52
OCADO GROUP PLC	54,753	8.78	481,169.36
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.68	398,427.81
TESCO PLC	525,585	2.63	1,386,493.23
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.89	512,097.30
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,888	25.81	4,075,878.72
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	22.28	400,148.80
DIAGEO	167,595	31.82	5,332,872.90
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.68	1,210,691.04
HALEON PLC	452,525	3.15	1,428,621.42
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	52,885	56.98	3,013,387.30
UNILEVER PLC	187,760	40.26	7,559,217.60
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.55	723,677.25
ASTRAZENECA	115,201	106.90	12,314,986.90
GSK PLC	304,379	13.73	4,180,949.94
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,620	21.69	143,587.80

	BARCLAYS	1,129,529	1.50	1,703,329.73
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,029	5.85	8,699,299.88
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.41	2,026,752.80
	NATWEST GROUP PLC	426,244	2.33	993,148.52
	STANDARD CHARTERED PLC	190,159	7.09	1,348,987.94
	3I GROUP PLC	74,757	20.02	1,496,635.14
	ABRDN PLC	153,430	1.63	251,471.77
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.66	253,517.45
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,849	81.68	2,438,066.32
	M&G PLC	131,539	1.90	250,384.48
	SCHRODERS PLC	39,932	4.11	164,479.90
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	8.77	358,991.18
	WISE PLC - A	49,048	6.47	317,634.84
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.71	385,406.05
	AVIVA PLC	193,334	3.72	720,749.15
	LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.16	884,416.09
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.15	263,063.15
	PRUDENTIAL	212,226	9.69	2,057,743.29
	SAGE GROUP PLC	76,660	9.73	745,901.80
	HALMA PLC	31,069	21.43	665,808.67
	BT GROUP PLC	464,863	1.14	532,500.56
	VODAFONE GROUP PLC	1,564,850	0.72	1,133,733.82
	CENTRICA PLC	453,631	1.53	694,055.43
	NATIONAL GRID PLC	260,089	9.78	2,544,190.59
	SEVERN TRENT PLC	17,468	23.81	415,913.08
	SSE PLC	81,692	16.09	1,314,424.28
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	9.32	471,405.60
	イギリスポンド 小計	20,508,133		131,877,814.91 (24,411,902,317)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	14.80	257,490.40
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	665.50	381,997.00
	GIVAUDAN-REG	678	2,922.00	1,981,116.00
	HOLCIM LTD	38,804	57.66	2,237,438.64
	SIG GROUP AG	26,203	23.28	610,005.84
	SIKA AG-BR	10,856	247.50	2,686,860.00
	ABB LTD	116,833	33.32	3,892,875.56
	GEBERIT AG-REG	2,530	456.40	1,154,692.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	181.80	372,326.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	192.15	594,127.80
	VAT GROUP AG	1,956	358.60	701,421.60
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	37.66	559,476.96
	SGS SA	10,147	81.08	822,718.76

	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	256.40	969,448.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	38,748	125.60	4,866,748.80	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	255.20	633,661.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	48.35	190,402.30	
	DUFREY AG-REG	7,820	39.06	305,449.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,526.00	427,280.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	103,800.00	830,400.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,420.00	854,440.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	199,766	105.04	20,983,420.64	
	ALCON INC	38,399	72.80	2,795,447.20	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	232.90	905,282.30	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	136.45	1,165,283.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	81.15	150,127.50	
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	495.30	2,741,980.80	
	NOVARTIS	152,294	89.03	13,558,734.82	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	277.40	614,441.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	52,222	257.65	13,454,998.30	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	95.10	236,513.70	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	61.30	937,215.70	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,574	964.40	1,517,965.60	
	UBS GROUP AG	249,657	23.71	5,919,367.47	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,379	138.40	329,253.60	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	134.40	397,152.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	551.20	1,167,992.80	
	SWISS RE LTD	22,063	85.08	1,877,120.04	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,184	412.30	4,611,163.20	
	TEMENOS AG - REG	5,150	69.08	355,762.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,702	62.14	665,022.28	
	SWISSCOM	1,856	534.00	991,104.00	
	BKW AG	1,744	151.30	263,867.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	83.70	475,332.30	
	スイスフラン 小計	1,102,662		101,444,924.71 (16,807,395,125)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	295.40	6,573,240.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	416.00	2,239,328.00	
	SCA SV CELLULOSA B	35,790	145.80	5,218,182.00	
	ALFA LAVAL AB	18,955	389.40	7,381,077.00	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	249.60	18,963,859.20	
	ATLAS COPCO A	207,097	146.35	30,308,645.95	
	ATLAS COPCO B	108,178	128.30	13,879,237.40	
	BEIJER REF AB	26,868	127.10	3,414,922.80	
	EPIROC AB-A	53,479	213.50	11,417,766.50	

EPIROC AB-B	28,804	181.90	5,239,447.60	
HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	89.98	3,483,305.76	
INDUTRADE AB	22,644	211.00	4,777,884.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	199.85	2,798,299.70	
LIFCO AB-B SHS	17,970	207.00	3,719,790.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	82.44	10,127,589.12	
SAAB AB-B	6,388	583.80	3,729,314.40	
SANDVIK AB	75,334	209.00	15,744,806.00	
SKANSKA B	25,507	159.35	4,064,540.45	
SKF AB-B	21,050	180.85	3,806,892.50	
VOLVO AB-A SHS	13,514	221.80	2,997,405.20	
VOLVO B	114,238	219.35	25,058,105.30	
SECURITAS B	28,375	91.00	2,582,125.00	
VOLVO CAR AB-B	49,839	40.14	2,000,537.46	
EVOLUTION AB	13,186	1,200.40	15,828,474.40	
HENNES & MAURITZ B	41,351	167.48	6,925,465.48	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	253.60	12,546,606.40	
GETINGE AB-B SHS	17,796	192.00	3,416,832.00	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	215.80	3,093,493.00	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM-RTS	14,335	10.75	154,101.25	
NORDEA BANK ABP	236,636	120.48	28,509,905.28	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	110,001	127.65	14,041,627.65	
SVENSKA HANDELSBK A	120,736	93.14	11,245,351.04	
SWEDBANK AB-A	58,652	193.75	11,363,825.00	
EQT AB	31,471	220.40	6,936,208.40	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	287.60	3,398,856.80	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	287.00	3,205,216.00	
INVESTOR AB-B SHS	128,538	210.40	27,044,395.20	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	446.70	3,251,976.00	
ERICSSON (LM) B	214,689	56.78	12,190,041.42	
HEXAGON AB-B SHS	148,878	98.66	14,688,303.48	
TELE2 AB-B SHS	46,762	77.24	3,611,896.88	
TELIA CO AB	123,760	22.04	2,727,670.40	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	52.68	2,986,956.00	
SAGAX AB-B	17,402	228.80	3,981,577.60	
スウェーデンクローナ 小計	2,608,172		380,675,081.82 (5,066,785,339)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	18,105	293.70	5,317,438.50
	EQUINOR ASA	66,436	335.80	22,309,208.80
	NORSK HYDRO	100,517	62.54	6,286,333.18
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	405.00	5,061,690.00
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	451.40	3,902,353.00

	ADEVINTA ASA	19,117	76.35	1,459,582.95	
	MOWI ASA	31,968	192.00	6,137,856.00	
	ORKLA	77,073	79.72	6,144,259.56	
	SALMAR ASA	5,423	522.00	2,830,806.00	
	DNB BANK ASA	71,795	209.80	15,062,591.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	162.80	3,023,847.20	
	TELENOR ASA	51,193	113.95	5,833,442.35	
	ノルウェークローネ 小計	481,344		83,369,408.54 (1,148,830,449)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	453.90	3,850,433.70	
	NOVOZYMES A/S	17,111	300.70	5,145,277.70	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,763.50	1,331,442.50	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	72,778	162.62	11,835,158.36	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,670.00	2,774,730.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	12,830.00	3,925,980.00	
	DSV A/S	14,203	1,308.50	18,584,625.50	
	PANDORA A/S	7,957	726.00	5,776,782.00	
	CARLSBERG AS-B	6,810	981.00	6,680,610.00	
	COLOPLAST-B	9,208	804.80	7,410,598.40	
	DEMANT A/S	8,512	286.80	2,441,241.60	
	GENMAB A/S	4,628	2,663.00	12,324,364.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	123,050	1,310.80	161,293,940.00	
	DANSKE BANK A/S	58,346	155.00	9,043,630.00	
	TRYG A/S	29,772	129.85	3,865,894.20	
ORSTED A/S	12,910	431.40	5,569,374.00		
	デンマーククローネ 小計	375,048		261,854,081.96 (5,556,543,619)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	34.66	715,001.14	
	SANTOS	218,974	7.91	1,732,084.34	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	38.24	5,397,002.40	
	BHP GROUP LTD	377,956	45.93	17,359,519.08	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	21.93	762,506.10	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	122,505	20.20	2,474,601.00	
	IGO LTD	56,345	14.27	804,043.15	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,852	46.72	1,768,445.44	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	73.90	1,064,825.10	
	NEWCREST MINING LIMITED	60,966	25.95	1,582,067.70	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	11.68	860,605.76	
	ORICA LTD	38,288	15.59	596,909.92	
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.77	999,243.45	
	RIO TINTO LTD	28,272	117.12	3,311,216.64	
SOUTH32 LTD	346,773	3.53	1,224,108.69		

	REECE LTD	16,814	20.29	341,156.06	
	BRAMBLES LTD	108,007	15.04	1,624,425.28	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	25.14	1,115,612.64	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.63	434,115.33	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.65	480,250.00	
	TRANSURBAN GROUP	224,973	13.22	2,974,143.06	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	41.39	1,912,631.90	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	25.35	451,052.55	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.01	911,885.13	
	REA GROUP LTD	3,586	162.24	581,792.64	
	SEEK LTD	28,001	22.84	639,542.84	
	WESFARMERS LTD	84,329	53.60	4,520,034.40	
	COLES GROUP LTD	108,486	15.86	1,720,587.96	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.42	595,663.42	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	37.94	3,493,173.74	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.49	734,900.40	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	267.90	1,281,365.70	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	49.72	601,960.04	
	SONIC HEALTHCARE LTD	27,240	32.12	874,948.80	
	CSL LIMITED	35,855	268.43	9,624,557.65	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	221,609	25.19	5,582,330.71	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	125,501	102.01	12,802,357.01	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	233,298	28.95	6,753,977.10	
	WESTPAC BANKING	255,840	21.83	5,584,987.20	
	ASX LTD	14,549	56.52	822,309.48	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,105	177.65	4,815,203.25	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	33.46	462,149.52	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.79	964,972.98	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.60	835,858.80	
	QBE INSURANCE GROUP	104,083	14.98	1,559,163.34	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.64	1,293,944.96	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	70.00	966,070.00	
	XERO LTD	11,340	123.81	1,404,005.40	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.04	1,246,206.68	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	8.63	944,821.03	
	オーストラリアドル 小計	5,129,732		121,604,336.91 (11,497,690,054)	
ニュージーランド ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.05	663,811.05	
	EBOS GROUP LTD	14,283	37.66	537,897.78	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	22.54	901,149.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	97,207	5.00	486,521.03	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.20	400,600.60	



	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.50	607,992.00	
	ニュージーランドドル 小計	409,088		3,597,971.66 (313,023,534)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,496	41.95	7,362,057.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	79.65	8,522,550.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	12.20	1,122,400.00	
	MTR CORP	125,000	33.10	4,137,500.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	14.58	1,749,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	51.65	8,987,100.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	27.35	5,415,300.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	17.14	2,500,726.00	
	WH GROUP LTD	658,301	4.13	2,718,783.13	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	22.50	6,333,750.00	
	HANG SENG BANK	59,400	101.20	6,011,280.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	313.40	27,673,220.00	
	AIA GROUP LTD	865,600	71.95	62,279,920.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	39.05	1,464,375.00	
	CLP HOLDINGS	102,000	60.45	6,165,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.84	5,283,196.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	39.25	4,396,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	42.95	5,239,728.20	
	ESR GROUP LTD	157,000	11.86	1,862,020.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	10.68	1,847,640.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	21.45	2,686,140.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	17.40	2,372,925.00	
	SINO LAND CO	315,400	9.09	2,866,986.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	90.45	9,497,250.00	
	SWIRE PACIFIC A	44,500	55.00	2,447,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	17.10	1,645,020.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	33.15	4,077,450.00	
	香港ドル 小計	5,644,353		196,666,318.01 (3,677,660,146)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	33.75	270,000.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.92	780,576.00	
	SEATRIM LTD	2,152,791	0.14	314,307.48	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.85	567,490.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.93	750,740.76	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.89	260,592.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.69	659,034.00	
	DBS GROUP	141,600	33.42	4,732,272.00	
	OCBC BANK	257,100	12.67	3,257,457.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	28.60	2,688,400.00	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.64	636,240.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	555,643	2.36	1,311,317.48
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.17	434,797.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	127,200	3.17	403,224.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.80	291,040.00
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.56	311,600.00
	シンガポールドル 小計	4,416,666		17,669,087.72 (1,911,088,527)
イスラエルシ ケル	ICL LTD	59,427	22.96	1,364,443.92
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	764.10	1,639,758.60
	BANK HAPOALIM BM	98,310	30.71	3,019,100.10
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	28.92	3,253,847.04
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.55	1,845,725.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	121.70	1,521,615.10
	NICE LTD	4,991	744.90	3,717,795.90
	AZRIELI GROUP	1,537	199.20	306,170.40
	イスラエルシケル 小計	390,926		16,668,456.06 (645,022,577)
	合 計	83,331,091		575,911,875,483 (575,911,875,483)

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	オーストラ リアドル	APA GROUP	83,290	727,954.60	
		LENLEASE GROUP	64,786	512,457.26	
		オーストラリアドル 小計	148,076	1,240,411.86 (117,280,941)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,642,850.00	
		香港ドル 小計	315,000	2,642,850.00 (49,421,295)	
		投資信託受益証券合計	463,076	166,702,236 (166,702,236)	
投資証券	アメリカド ル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,462,225.85	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	898,564.52	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,641	6,262,746.39	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	761,504.72	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,083	1,828,552.05	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	750,750.12	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	827,128.26	
		CROWN CASTLE INC	32,235	3,216,085.95	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,366	2,822,662.26	
		EQUINIX INC	6,951	5,404,541.52	

	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	937,125.90
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,656,640.00
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,236,291.60
	EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	2,021,729.19
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	858,064.90
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	535,344.00
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	934,722.25
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	898,148.86
	INVITATION HOMES INC	45,008	1,538,373.44
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,483,766.86
	KIMCO REALTY CORP	47,897	904,295.36
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,326,562.65
	PROLOGIS INC	68,641	8,551,982.19
	PUBLIC STORAGE	11,847	3,267,402.60
	REALTY INCOME CORP	49,099	2,759,363.80
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	780,561.29
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,567	1,677,528.23
	SIMON PROPERTY GROUP	23,439	2,693,375.49
	SUN COMMUNITIES INC	8,423	1,027,353.31
	UDR INC	23,815	946,169.95
	VENTAS INC	31,565	1,359,820.20
	VICI PROPERTIES INC	74,643	2,313,186.57
	WELLTOWER INC	36,855	3,045,697.20
	WP CAREY INC	16,024	1,046,367.20
	アメリカドル 小計	900,424	68,034,634.68 (9,971,156,058)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	240,196.05
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	300,351.10
	カナダドル 小計	20,377	540,547.15 (58,238,549)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	216,839.40
	GECINA SA	3,139	305,895.55
	KLEPIERRE	17,225	416,500.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	508,740.30
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	325,432.80
	ユーロ 小計	48,695	1,773,408.55 (280,500,030)
イギリスポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	328,052.29
	SEGR0 PLC	78,133	562,713.86
	イギリスポンド 小計	134,422	890,766.15 (164,889,722)
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	732,020.20
	GOODMAN GROUP	135,303	3,134,970.51

		GPT GROUP	167,884	711,828.16	
		MIRVAC GROUP	266,683	640,039.20	
		SCENTRE GROUP	381,283	1,056,153.91	
		STOCKLAND	207,412	877,352.76	
		VICINITY CENTERS	305,149	570,628.63	
	オーストラリアドル 小計		1,557,804	7,722,993.37	(730,209,023)
香港ドル		LINK REIT	166,900	6,617,585.00	
	香港ドル 小計		166,900	6,617,585.00	(123,748,839)
シンガポールドル		CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	795,586.40	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	653,360.97	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	478,589.41	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	332,200.00	
	シンガポールドル 小計		1,125,856	2,259,736.78	(244,413,130)
投資証券合計			3,954,478	11,573,155,351	(11,573,155,351)
合計				11,739,857,587	(11,739,857,587)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 607銘柄	97.7%			73.1%
	投資証券 34銘柄			2.3%	1.7%
カナダドル	株式 87銘柄	99.7%			3.4%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 223銘柄	99.5%			9.4%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 80銘柄	99.3%			4.2%
	投資証券 2銘柄			0.7%	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 44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	93.1%			2.0%

	投資信託受 2銘柄 益証券		1.0%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.9%	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	95.5%			0.6%
	投資信託受 1銘柄 益証券		1.3%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.2%	0.0%
シンガポールドル	株式 16銘柄	88.7%			0.3%
	投資証券 4銘柄			11.3%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年 9月 5日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,752,813,690
投資証券	139,606,619,800
派生商品評価勘定	3,862,580
未収入金	1,608,861,465
未収配当金	1,887,233,998
差入委託証拠金	160,813,880
流動資産合計	146,020,205,413
資産合計	146,020,205,413
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	3,862,580
未払解約金	182,115,734
未払利息	7,118
流動負債合計	185,985,432
負債合計	185,985,432
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	66,386,286,728
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	79,447,933,253
元本等合計	145,834,219,981
純資産合計	145,834,219,981
負債純資産合計	146,020,205,413

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2023年 9月 5日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 9月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,386,286,728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) 2.1968円 (21,968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 9月 5日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 9月 5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。

2023年 9月 5日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	54,801,519,931円
期中追加設定元本額	17,238,811,950円
期中一部解約元本額	5,654,045,153円
期末元本額	66,386,286,728円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,925,524,560円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,245,990円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,714,543,520円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	36,111,220,459円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,403,182,278円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,252,990,018円
分散投資コア戦略ファンドA	1,060,652,310円
分散投資コア戦略ファンドS	1,874,236,312円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,065,600,194円
SMT インデックスバランス・オープン	24,452,463円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	256,354,957円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,958,883円
グローバル経済コア	275,310,641円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,952,793円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	678,301,763円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	157,703,826円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	388,670,718円
10資産分散投資ファンド	23,177,769円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	492,003,083円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,073,930円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	504,418,156円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	100,903,075円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	509,074,871円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	246,106,109円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	280,628,050円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	850,746,765
合計	850,746,765

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

(2023年 9月 5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	不動産投信指数先物 取引 買建	4,872,964,420	-	4,876,827,000	3,862,580
合計		4,872,964,420	-	4,876,827,000	3,862,580

## (注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,609	308,383,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	4,111	390,956,100	
	S O S i L A 物流リート投資法人	6,403	834,951,200	
	東海道リート投資法人	1,910	237,222,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,432	2,925,120,000	
	森ヒルズリート投資法人	15,092	2,235,125,200	
	産業ファンド投資法人	19,582	2,888,345,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	12,191	4,260,754,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	9,422	2,168,944,400	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	6,733	2,790,828,500	
	G L P 投資法人	43,352	6,030,263,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	6,311	2,167,828,500	
	日本プロロジスリート投資法人	22,357	6,662,386,000	
	星野リゾート・リート投資法人	2,368	1,498,944,000	
	O n e リート投資法人	2,239	584,826,800	
	イオンリート投資法人	15,743	2,350,429,900	
	ヒューリックリート投資法人	12,008	1,974,115,200	
	日本リート投資法人	4,169	1,502,924,500	
	積水ハウス・リート投資法人	38,565	3,258,742,500	
	トーセイ・リート投資法人	2,702	380,711,800	
	ケネディクス商業リート投資法人	5,579	1,639,110,200	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	3,164	474,283,600	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	3,497	407,400,500	



野村不動産マスターファンド投資法人	41,503	7,217,371,700	
いちごホテルリート投資法人	2,126	246,828,600	
ラサールロジポート投資法人	16,406	2,452,697,000	
スターアジア不動産投資法人	19,779	1,145,204,100	
マリモ地方創生リート投資法人	1,978	251,799,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	5,338	2,652,986,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,962	127,530,000	
投資法人みらい	16,413	782,900,100	
三菱地所物流リート投資法人	4,432	1,752,856,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	5,525	955,272,500	
ザイマックス・リート投資法人	2,082	246,508,800	
タカラレーベン不動産投資法人	6,085	596,330,000	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,624	741,805,600	
日本ビルファンド投資法人	14,972	9,417,388,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	13,183	8,094,362,000	
日本都市ファンド投資法人	61,517	6,151,700,000	
オリックス不動産投資法人	25,572	4,748,720,400	
日本プライムリアルティ投資法人	8,777	3,317,706,000	
N T T 都市開発リート投資法人	12,337	1,732,114,800	
東急リアル・エステート投資法人	8,605	1,621,182,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	9,477	1,120,181,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	28,709	4,602,052,700	
森トラストリート投資法人	24,738	1,855,350,000	
インヴィンシブル投資法人	62,140	3,902,392,000	
フロンティア不動産投資法人	4,762	2,261,950,000	
平和不動産リート投資法人	9,589	1,420,130,900	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,221	2,532,068,000	
福岡リート投資法人	6,638	1,093,942,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	7,468	2,625,002,000	
いちごオフィスリート投資法人	10,516	953,801,200	
大和証券オフィス投資法人	2,659	1,866,618,000	
阪急阪神リート投資法人	6,119	887,866,900	
スターツプロシード投資法人	2,225	491,502,500	
大和ハウスリート投資法人	19,346	5,159,578,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	41,388	3,091,683,600	
大和証券リビング投資法人	17,805	2,011,965,000	
ジャパンエクセレント投資法人	11,154	1,504,674,600	
合計	791,709	139,606,619,800	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年 9月 5日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	424,282,830
コール・ローン	104,112,547
投資証券	93,979,089,256
派生商品評価勘定	174,185
未収入金	10,616,542
未収配当金	133,170,460
流動資産合計	94,651,445,820
資産合計	94,651,445,820
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	17,579,497
未払利息	269
流動負債合計	17,579,766
負債合計	17,579,766
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	36,159,243,737
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	58,474,622,317
元本等合計	94,633,866,054
純資産合計	94,633,866,054
負債純資産合計	94,651,445,820

### 注記表

#### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 9月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p>

	2023年 9月 5日現在
	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 9月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	36,159,243,737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) 2.6171円 (26,171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 9月 5日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 9月 5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る場合、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 9月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 9月 6日
期首元本額	41,138,994,709円

区分	2023年 9月 5日現在
期中追加設定元本額	6,022,411,343円
期中一部解約元本額	11,002,162,315円
期末元本額	36,159,243,737円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	55,859,963円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	92,963,651円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,580,449,209円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,242,491円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,159,410,996円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	14,183,831,798円
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,133,064円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,090,366,067円
分散投資コア戦略ファンドA	1,038,546,021円
分散投資コア戦略ファンドS	1,578,869,574円
コア投資戦略ファンド（切替型）	510,318,247円
SMT インデックスバランス・オープン	113,601,826円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	176,477,358円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,530,781円
グローバル経済コア	233,218,320円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,099,265円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	356,884,088円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	82,988,994円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	145,931,817円
10資産分散投資ファンド	12,825,323円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,420,396,958円
FOS用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	173,576,923円
FOS用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	81,218,631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）	57,560,119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）	36,366,918円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	94,617,784円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	92,985,353円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	92,513,618円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	92,104,212円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	91,193,091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）	72,210,338円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	59,950,939円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 9月 5日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	2,227,112,904
合計	2,227,112,904

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

(2023年 9月 5日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	買建	80,421,000	-	174,185
	アメリカドル	80,421,000	-	174,185

合計	80,421,000	-	80,595,185	174,185
----	------------	---	------------	---------

## (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
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	48,737	729,592.89	
		AGREE REALTY CORP	47,425	2,911,895.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	36,043	655,982.60	
		ALEXANDER'S INC	886	170,413.24	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	80,197	9,379,039.15	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	98,610.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	29,042	625,564.68	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	160,402	5,771,263.96	
		AMERICOLD REALTY TRUST	138,421	4,641,256.13	
		APARTMENT INCOME REIT CO	73,779	2,504,059.26	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	69,944	539,268.24	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	104,891	1,576,511.73	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	32,051	366,983.95	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	47,600.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	71,997	13,056,655.95	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	25,427.20	
		BOSTON PROPERTIES	72,655	4,844,635.40	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	78,925.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	81,217	414,206.70	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	148,786	3,271,804.14	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	95,237	1,544,744.14	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	92,250.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	54,497	5,817,009.78	
		CARETRUST REIT INC	52,232	1,068,666.72	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,597	249,915.35	
		CENTERSPACE	7,349	471,070.90	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,562	249,996.36	
		CITY OFFICE REIT INC	15,298	76,642.98	
CLIPPER REALTY INC	7,300	43,581.00			

COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,050	368,959.50	
CORPORATE OFFICE PPTYS	59,276	1,549,474.64	
COUSINS PROPERTIES INC	74,825	1,776,345.50	
CTO REALTY GROWTH INC	8,400	147,840.00	
CUBESMART	114,379	4,745,584.71	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	112,866	904,056.66	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	101,022.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	147,927	19,542,635.97	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	307,184.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	82,382	1,155,819.46	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	49,311	657,315.63	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,674	4,066,355.16	
ELME COMMUNITIES	47,407	722,956.75	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	62,623	549,829.94	
EPR PROPERTIES	38,177	1,710,711.37	
EQUINIX INC	47,401	36,855,225.52	
EQUITY COMMONWEALTH	57,330	1,089,843.30	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	88,540	5,888,795.40	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	173,522	11,105,408.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	74,641	1,798,848.10	
ESSEX PROPERTY TRUST	32,393	7,693,985.36	
EXTRA SPACE STORAGE INC	107,050	13,791,251.50	
FARMLAND PARTNERS INC	22,851	255,474.18	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	37,771	3,703,824.26	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	66,879	3,497,102.91	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	42,562	1,068,731.82	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	89,647.35	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	132,802	6,297,470.84	
GETTY REALTY CORP	22,990	693,838.20	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	264,972.50	
GLADSTONE LAND CORP	15,061	238,716.85	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,431	255,587.77	
GLOBAL NET LEASE INC	49,084	535,997.28	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	190,423	3,353,349.03	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	276,817	5,716,271.05	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,211	189,036.24	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	53,689	1,293,368.01	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	359,759	5,691,387.38	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,023	428,381.46	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	111,096	1,844,193.60	

INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	132,332.34
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	14,642	1,284,396.24
INVENTRUST PROPERTIES CORP	32,229	779,297.22
INVITATION HOMES INC	295,991	10,116,972.38
IRON MOUNTAIN INC	146,534	9,321,027.74
JBG SMITH PROPERTIES	46,081	736,374.38
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	73,680.50
KILROY REALTY CORPORATION	52,622	1,990,690.26
KIMCO REALTY CORP	313,435	5,917,652.80
KITE REALTY GROUP TRUST	108,393	2,446,430.01
LTC PROPERTIES INC	22,125	727,470.00
LXP INDUSTRIAL TRUST	144,466	1,424,434.76
MACERICH CO/THE	112,250	1,326,795.00
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	50,109.84
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	295,942	2,157,417.18
MID-AMERICA APARTMENT COMM	58,819	8,485,817.13
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	43,098	1,463,608.08
NATL HEALTH INVESTORS INC	23,139	1,197,906.03
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	63,086	429,615.66
NETSTREIT CORP	27,610	470,198.30
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	15,490	147,309.90
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,806	402,955.74
NNN REIT INC	93,618	3,672,634.14
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	168,135.54
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	120,633	3,944,699.10
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	167,766.49
ORION OFFICE REIT INC	34,844	203,488.96
PARAMOUNT GROUP INC	80,008	410,441.04
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	109,726	1,404,492.80
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	62,648	909,648.96
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	57,873	1,972,890.57
PHYSICIANS REALTY TRUST	119,855	1,648,006.25
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,412	409,468.12
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,962	414,742.58
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	100,590.00
PRIME US REIT	295,000	40,120.00
PROLOGIS INC	467,762	58,278,467.58
PUBLIC STORAGE	80,288	22,143,430.40
REALTY INCOME CORP	341,725	19,204,945.00
REGENCY CENTERS CORP	82,452	5,144,180.28
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	66,925	896,125.75

	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	102,676	5,492,139.24
	RLJ LODGING TRUST	76,182	760,296.36
	RPT REALTY	39,523	447,400.36
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,109	2,571,910.78
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	117,928	1,524,809.04
	SAFEHOLD INC	21,624	454,104.00
	SAUL CENTERS INC	6,846	254,602.74
	SERVICE PROPERTIES TRUST	89,293	734,881.39
	SIMON PROPERTY GROUP	165,491	19,016,570.81
	SITE CENTERS CORP	96,944	1,299,049.60
	SL GREEN REALTY CORP	31,274	1,223,126.14
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71,857	2,777,273.05
	STAG INDUSTRIAL INC	88,787	3,274,464.56
	STAR HOLDINGS	6,183	83,717.82
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	307,755.70
	SUN COMMUNITIES INC	62,748	7,653,373.56
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,395	903,555.00
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	55,858	1,290,319.80
	TERRENO REALTY CORP	37,611	2,290,509.90
	UDR INC	157,031	6,238,841.63
	UMH PROPERTIES INC	25,129	375,678.55
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,281	293,322.70
	URBAN EDGE PROPERTIES	57,394	942,983.42
	VENTAS INC	201,590	8,684,497.20
	VERIS RESIDENTIAL INC	43,050	790,398.00
	VICI PROPERTIES INC	508,755	15,766,317.45
	VORNADO REALTY TRUST	80,077	1,961,886.50
	WELLTOWER INC	252,248	20,845,774.72
	WHITESTONE REIT	23,074	229,586.30
	WP CAREY INC	108,417	7,079,630.10
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	54,932	650,944.20
	アメリカドル 小計	13,019,480	501,706,857.34 (73,530,157,011)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	29,679	619,994.31
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	215,039.70
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	126,000.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,093	764,196.77
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	156,275.00
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	65,600.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	40,850	2,007,777.50
	CHOICE PROPERTIES REIT	82,975	1,101,908.00



CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	359,321.04	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	407,631.00	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	66,102	922,122.90	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,339	69,673.95	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	60,945.00	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	49,125	690,206.25	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,135	1,304,830.25	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	61,841	645,620.04	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	28,710.00	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,790	423,388.70	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,096	535,366.40	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	147,297.00	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	6,956	109,487.44	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	130,041.80	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	403,273.20	
PRIMARIS REIT	22,050	299,439.00	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	80,000.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	78,439	1,520,932.21	
SLATE GROCERY REIT	8,419	107,173.87	
SLATE OFFICE REI	17,000	26,860.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	35,154	851,781.42	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	62,952.00	
カナダドル 小計	881,567	14,243,844.75 (1,534,631,833)	
ユーロ			
AEDIFICA	23,987	1,451,213.50	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	35,280.00	
ALTAREA	1,959	175,330.50	
CARE PROPERTY INVEST	17,887	216,790.44	
CARMILA	26,392	382,684.00	
COFINIMMO	15,898	1,118,424.30	
COVIVIO(FP)	23,027	1,006,279.90	
CROMWELL REIT EUR	170,400	243,672.00	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,490	461,025.00	
GECINA SA	28,030	2,731,523.50	
HAMBORNER REIT AG	37,000	240,500.00	
ICADE	17,300	591,660.00	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	76,027.50	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	153,184	840,980.16	
	12,100	175,692.00	

	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES			
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	207,900.00	
	KLEPIERRE	100,775	2,436,739.50	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	193,800.00	
	MERCIALYS	36,384	318,178.08	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	166,888	1,355,130.56	
	MONTEA NV	6,890	508,482.00	
	NSI NV	7,359	138,202.02	
	RETAIL ESTATES	5,335	301,427.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	54,250	2,639,805.00	
	VASTNED RETAIL	10,650	210,231.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	78,709	1,983,466.80	
	WERELDHAVE NV	22,376	354,883.36	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	12,191	325,499.70	
	ユーロ 小計	1,334,451	20,720,828.32 (3,277,413,415)	
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	123,848	58,208.56	
	AEW UK REIT PLC	68,000	67,320.00	
	ASSURA PLC	1,556,822	707,731.28	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	261,474.40	
	BIG YELLOW GROUP PLC	87,773	928,638.34	
	BRITISH LAND CO PLC	468,934	1,454,164.33	
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	94,696.27	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	188,826.45	
	DERWENT LONDON PLC	56,125	1,029,332.50	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	77,000.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	265,914.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	121,885	499,728.50	
	HAMMERSON PLC	1,931,365	473,184.42	
	HELICAL PLC	45,400	104,647.00	
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	162,293	146,712.87	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	383,635	2,235,824.78	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	499,236	873,663.00	
	LXI REIT PLC	918,439	843,586.22	
	NEWRIVER REIT PL	126,000	103,698.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	180,900.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	690,955	640,515.28	
	PRS REIT PLC/THE	260,002	184,341.41	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	97,236.00	

	SAFESTORE HOLDINGS PLC	107,256	913,821.12
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	87,182.50
	SEGRO PLC	619,040	4,458,326.08
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,016,907	1,177,578.30
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	675,749	507,487.49
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	116,889.45
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	932,234	1,282,753.98
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	405,972	218,412.93
	UNITE GROUP PLC	217,400	2,006,602.00
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	223,421	256,934.15
	WAREHOUSE REIT PLC	237,876	199,577.96
	WORKSPACE GROUP PLC	65,316	321,224.08
	イギリスポンド 小計	14,910,677	23,215,800.44 (4,297,476,819)
オーストラ リアドル	ABACUS GROUP	194,329	228,336.57
	ABACUS STORAGE KING	194,329	246,797.83
	ARENA REIT	192,648	718,577.04
	BWP TRUST	237,407	873,657.76
	CENTURIA CAPITAL GROUP	348,575	512,405.25
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	270,296	829,808.72
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	256,950.54
	CHARTER HALL GROUP	243,752	2,600,833.84
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	330,964	1,181,541.48
	CHARTER HALL RETAIL REIT	275,874	957,282.78
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	157,784	444,950.88
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	317,984.00
	DEXUS	543,275	4,226,679.50
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	318,660.00
	GDI PROPERTY GROUP	185,597	118,782.08
	GOODMAN GROUP	870,609	20,172,010.53
	GPT GROUP	953,138	4,041,305.12
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	341,472.60
	HEALTHCO REIT	194,021	293,941.81
	HMC CAPITAL LTD	122,191	657,387.58
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	839,293	1,040,723.32
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	308,118.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	173,646	725,840.28
	MIRVAC GROUP	1,987,126	4,769,102.40
NATIONAL STORAGE REIT	603,590	1,394,292.90	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	145,839.60	
REGION RE GROUP	588,421	1,276,873.57	
RURAL FUNDS GROUP	181,331	384,421.72	
SCENTRE GROUP	2,629,933	7,284,914.41	

	STOCKLAND	1,231,527	5,209,359.21	
	VICINITY CENTERS	1,985,803	3,713,451.61	
	WAYPOINT REIT LTD	336,956	849,129.12	
オーストラリアドル 小計		17,290,940	66,441,432.05 (6,282,037,400)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	479,869.70	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	556,435	1,215,810.47	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	743,753	650,783.87	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	651,295	788,066.95	
	STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	408,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	241,387	526,223.66	
ニュージーランドドル 小計		2,910,148	4,068,754.65 (353,981,654)	
香港ドル	CHAMPION REIT	927,000	2,428,740.00	
	FORTUNE REIT	735,000	3,601,500.00	
	LINK REIT	1,295,300	51,358,645.00	
	PROSPERITY REIT	492,000	738,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,492,260.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,999,189.80	
香港ドル 小計		5,316,960	61,618,334.80 (1,152,262,860)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	346,500.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,688,518	4,727,850.40	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,092,277	1,054,047.30	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	585,331.11	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,559,744	4,940,305.92	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	401,879.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400	188,830.00	
	EC WORLD REIT	180,000	50,400.00	
	ESR-LOGOS REIT	3,029,264	954,218.16	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	342,900.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	134,525.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	529,862	1,192,189.50	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,448,796	1,709,579.28	
	KEPPEL DC REIT	661,303	1,435,027.51	
	KEPPEL REIT	1,047,300	911,151.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	871,250	487,900.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,029,063	2,377,135.53	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,642,585	2,775,968.65	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	1,142,873	1,725,738.23		

	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	305,674.56	
	PARAGON REIT	519,600	465,042.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	197,500	754,450.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	204,102.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	663,000	324,870.00	
	SUNTEC REIT	1,134,100	1,372,261.00	
	シンガポールドル 小計	23,729,100	29,767,876.15 (3,219,693,484)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	86,838,000.00	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	67,584,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	324,953,300.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	15,754	68,529,900.00	
	JR REIT XXVII	76,683	312,099,810.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	140,898,820.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	248,606,400.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	175,236,000.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	49,032,720.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	228,102,600.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	48,070,385.00	
	SK REITS CO LTD	39,229	179,276,530.00	
	韓国ウォン 小計	460,839	1,929,228,465.00 (213,951,436)	
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	542,880.00	
	REIT 1 LTD	103,500	1,627,020.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	866,065.00	
	イスラエルシェケル 小計	578,500	3,035,965.00 (117,483,344)	
	合計	80,432,662	93,979,089,256 (93,979,089,256)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 142銘柄	100.0%	78.2%
カナダドル	投資証券 30銘柄	100.0%	1.6%
ユーロ	投資証券 28銘柄	100.0%	3.5%
イギリスポンド	投資証券 37銘柄	100.0%	4.6%
オーストラリアドル	投資証券 32銘柄	100.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券 6銘柄	100.0%	0.4%

香港ドル	投資証券	6銘柄	100.0%	1.2%
シンガポールドル	投資証券	25銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券	12銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	3銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期中間計算期間(2023年9月6日から2024年3月5日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2023年 9月 5日現在）	第7期中間計算期間 （2024年 3月 5日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	12,043,077	13,684,054
親投資信託受益証券	357,148,018	401,654,218
流動資産合計	369,191,095	415,338,272
資産合計	369,191,095	415,338,272
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	649	199,370
未払受託者報酬	92,968	103,166
未払委託者報酬	836,624	928,401
未払利息	31	2
その他未払費用	9,234	10,255
流動負債合計	939,506	1,241,194
負債合計	939,506	1,241,194
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	263,909,586	275,280,349
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	104,342,003	138,816,729
（分配準備積立金）	68,258,601	62,422,717
元本等合計	368,251,589	414,097,078
純資産合計	368,251,589	414,097,078
負債純資産合計	369,191,095	415,338,272



## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期中間計算期間 自 2022年 9月 6日 至 2023年 3月 5日	第7期中間計算期間 自 2023年 9月 6日 至 2024年 3月 5日
<b>営業収益</b>		
受取利息	16	29
有価証券売買等損益	1,526,415	30,446,022
営業収益合計	1,526,399	30,446,051
<b>営業費用</b>		
支払利息	2,593	1,553
受託者報酬	79,672	103,166
委託者報酬	716,991	928,401
その他費用	7,903	10,255
営業費用合計	807,159	1,043,375
営業利益又は営業損失（ ）	2,333,558	29,402,676
経常利益又は経常損失（ ）	2,333,558	29,402,676
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,333,558	29,402,676
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（ ）	113,718	572,190
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	60,504,224	104,342,003
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,862,701	15,117,347
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,862,701	15,117,347
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,509,368	9,473,107
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,509,368	9,473,107
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	63,637,717	138,816,729

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (中間貸借対照表に関する注記)

	第6期 (2023年 9月 5日現在)	第7期中間計算期間 (2024年 3月 5日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	263,909,586口	275,280,349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) 1.3954円 (13,954円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5043円 (15,043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7期中間計算期間 (2024年 3月 5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6期 自 2022年 9月 6日 至 2023年 9月 5日	第7期中間計算期間 自 2023年 9月 6日 至 2024年 3月 5日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	223,078,987円	263,909,586円
期中追加設定元本額	54,268,074円	35,416,229円
期中一部解約元本額	13,437,475円	24,045,466円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,974,482,251
国債証券	562,513,695,720
地方債証券	32,757,867,590
特殊債券	37,118,443,582
社債券	30,535,669,000
未収入金	196,753,100
未収利息	1,656,031,965
前払費用	86,337,594
流動資産合計	666,839,280,802
資産合計	666,839,280,802
負債の部	
流動負債	
未払金	1,333,017,200
未払解約金	692,502,585
未払利息	422
流動負債合計	2,025,520,207
負債合計	2,025,520,207
純資産の部	
元本等	
元本	497,038,258,218
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	167,775,502,377
元本等合計	664,813,760,595
純資産合計	664,813,760,595
負債純資産合計	666,839,280,802

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 3月 5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）

	2024年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	497,038,258,218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 99,261,000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 1.3376円 (1万口当たり純資産額) (13,376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 3月 5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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 9月 6日
期首元本額	481,685,965,946円
期中追加設定元本額	31,116,454,231円
期中一部解約元本額	15,764,161,959円
期末元本額	497,038,258,218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）	5,125,115,674円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,910,303円
S M T 国内債券インデックス・オープン	17,142,118,912円
世界経済インデックスファンド	6,974,058,903円
D C マイセレクション 2 5	29,856,782,481円
D C マイセレクション 5 0	36,643,266,452円
D C マイセレクション 7 5	11,477,717,443円
D C 日本債券インデックス・オープン	406,263,226円
D C 日本債券インデックス・オープン S	88,287,124,416円
D C 日本債券インデックス・オープン P	62,997,961,549円
D C マイセレクション S 2 5	17,467,112,507円
D C マイセレクション S 5 0	20,770,518,773円
D C マイセレクション S 7 5	5,574,867,069円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	355,245,533円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	3,036,641,561円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	1,247,150,643円
D C 世界経済インデックスファンド	4,710,534,215円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,725,330円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	19,208,241円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	7,880,588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）	57,897,813円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	108,206,471円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	27,473,655円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	23,514,206円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,065,954,459円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	752,206,116円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,306,296,013円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	67,613,810円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	50,141,665円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	931,652,042円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,028,010,373円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,352,456,424円

区分	2024年 3月 5日現在
国内バランス 25VA1（適格機関投資家専用）	97,062,789円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,061,701,015円
日本債券ファンド・シリーズ1	18,678,288,423円
分散投資コア戦略ファンドA	18,505,094,073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）	311,208,108円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,975,423,225円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	88,474,334円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	45,101,615円
SMT インデックスバランス・オープン	65,713,134円
SMT 世界経済インデックス・オープン	58,806,338円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	138,741,193円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	213,241,185円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	17,527,900円
グローバル経済コア	348,735,142円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	46,791,686円
DCターゲット・イヤー ファンド 2055	40,076,500円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	142,217,548円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	80,203,582円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	24,533,248円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	17,781,392円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	898,478,329円
10資産分散投資ファンド	450,210,857円
グローバル10資産バランスファンド	308,206,577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）	99,546,872,491円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	40,883,299円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	18,518,730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）	472,159,907円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,267,388,768
株式	671,549,442,160
派生商品評価勘定	1,985,750
未収入金	1,748,791,584
未収配当金	1,061,250,795
差入委託証拠金	28,732,790
流動資産合計	678,657,591,847
資産合計	678,657,591,847
負債の部	
流動負債	
前受金	2,078,700
未払金	348,200
未払解約金	1,746,334,090

	2024年 3月 5日現在
項目	金額（円）
未払利息	913
流動負債合計	1,748,761,903
負債合計	1,748,761,903
純資産の部	
元本等	
元本	242,163,139,694
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	434,745,690,250
元本等合計	676,908,829,944
純資産合計	676,908,829,944
負債純資産合計	678,657,591,847

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 3月 5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 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,163,139,694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 2.7953円 (1万口当たり純資産額) (27,953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 3月 5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。

2024年 3月 5日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2024年 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 9月 6日
期首元本額	242,651,408,927円
期中追加設定元本額	12,118,128,589円
期中一部解約元本額	12,606,397,822円
期末元本額	242,163,139,694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）	299,813,191円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,308,756,260円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,825,598円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,655,812,544円
世界経済インデックスファンド	5,613,984,243円
日本株式インデックス・オープン	2,888,400,274円
DCマイセレクション25	4,779,401,227円
DCマイセレクション50	16,492,076,997円
DCマイセレクション75	18,629,664,406円
DC日本株式インデックス・オープン	6,028,109,237円
DCマイセレクションS25	2,882,394,125円
DCマイセレクションS50	9,180,910,570円
DCマイセレクションS75	8,354,039,572円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,377,596,428円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	57,665,152円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	550,460,398円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	447,430,970円
DC世界経済インデックスファンド	3,898,128,473円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	772,574,575円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,573,533円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	8,161,792円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,731,768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）	145,802,987円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,942,020円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	13,916,110円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	66,062,210円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,929,915円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,884,615円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	456,138,718円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	296,018,039円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,013,299,545円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	27,432,622円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	11,094,881円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	305,603,246円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	167,048,030円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	225,529,936円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	16,413,070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）	393,886,288円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,442,277,960円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,912,323,543円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,036,995,340円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,507,401,167円

区分	2024年 3月 5日現在
分散投資コア戦略ファンドA	1,836,701,973円
分散投資コア戦略ファンドS	6,134,390,087円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	633,294,929円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	410,743,025円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,094,128,245円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,187,807円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,470,331円
SMT インデックスバランス・オープン	46,263,072円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	19,882,707,441円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	246,392,513円
SMT 世界経済インデックス・オープン	50,233,884円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	222,067,767円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,901,703円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,760,057円
グローバル経済コア	238,059,031円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	32,947,468円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,621,251,237円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	29,180,370円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	922,399,847円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	232,930,305円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	56,796,842円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	54,795,529円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	24,341,806円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	29,669,939円
10資産分散投資ファンド	114,531,109円
グローバル10資産バランスファンド	23,202,342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）	41,720,405,689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）	454,993,406円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	287,763,196円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	16,781,173円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	139,797,804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）	48,797,133,861円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,832,225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）	199,322,331円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年 3月 5日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引	4,564,301,300	-	2,078,700
	買建			
合計		4,564,301,300	-	2,078,700

## （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。



## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2024年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,227,030,432
コール・ローン	2,691,467,081
国債証券	319,275,576,518
派生商品評価勘定	5,553,632
未収入金	5,445,416,450
未収利息	2,186,980,920
前払費用	187,348,857
差入委託証拠金	234,185,819
流動資産合計	332,253,559,709
資産合計	332,253,559,709
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,387,923
前受金	3,832,947
未払金	8,287,367,838
未払解約金	289,086,273
未払利息	575
流動負債合計	8,581,675,556
負債合計	8,581,675,556
純資産の部	
元本等	
元本	92,318,422,948
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	231,353,461,205
元本等合計	323,671,884,153
純資産合計	323,671,884,153
負債純資産合計	332,253,559,709

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 3月 5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>

2024年 3月 5日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 3月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	92,318,422,948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) 3,5060円 (35,060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 3月 5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る場合、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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 9月 6日
期首元本額	87,191,328,152円
期中追加設定元本額	8,539,458,958円
期中一部解約元本額	3,412,364,162円
期末元本額	92,318,422,948円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	1,120,335,260円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	506,944,894円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	338,394,891円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,365,298,244円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,160,665円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,734,611,542円

区分	2024年 3月 5日現在
世界経済インデックスファンド	20,831,510,680円
DCマイセレクション25	1,905,251,135円
DCマイセレクション50	1,762,172,865円
DCマイセレクション75	1,368,898,850円
DC外国債券インデックス・オープン	2,255,727,015円
DCマイセレクションS25	1,115,572,274円
DCマイセレクションS50	992,051,971円
DCマイセレクションS75	550,623,425円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	11,343,625円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	100,703,751円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	55,871,338円
DC世界経済インデックスファンド	14,273,212,182円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	691,062,271円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	911,209円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	940,568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）	15,043,341円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	25,158,124円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	49,709,449円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	52,686,223円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	51,537,670円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	780,118,576円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	363,697,934円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,522,428,050円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	54,031,517円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	30,598,669円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	348,209,207円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	129,434,332円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	170,584,889円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	635,980,303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）	1,484,393,444円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	630,579,214円
外国債券ファンド・シリーズ1	780,432,361円
分散投資コア戦略ファンドA	518,368,608円
分散投資コア戦略ファンドS	1,397,259,111円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	747,718,809円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,439,161,374円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	218,827,647円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,202,676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）	1,263,594,917円
SMT インデックスバランス・オープン	162,834,247円
SMT 世界経済インデックス・オープン	408,531,416円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	578,275,570円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	888,738,073円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,988,120円
グローバル経済コア	987,977,832円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	22,230,462円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,766,002円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	57,807,967円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	78,636,250円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	40,069,428円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	53,329,121円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	579,193,697円
10資産分散投資ファンド	36,008,747円
グローバル10資産バランスファンド	17,308,020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）	12,888,144,004円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	170,406,330円

区分	2024年 3月 5日現在
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	279,564,730円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	128,659,050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）	127,444,306円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2024年 3月 5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	1,323,105,257	-	1,326,938,204	3,832,947
合計		1,323,105,257	-	1,326,938,204	3,832,947

## （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 3月 5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	2,368,672,056	-	2,369,004,818	332,762
	アメリカドル	1,142,025,991	-	1,142,001,312	24,679
	カナダドル	83,172,699	-	83,018,020	154,679
	ユーロ	755,420,936	-	755,853,106	432,170
	イギリスポンド	136,210,483	-	136,382,288	171,805
	オーストラリアドル	19,575,200	-	19,573,220	1,980
	オフショア人民元	232,266,747	-	232,176,872	89,875
合計		2,368,672,056	-	2,369,004,818	332,762

## （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。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2024年 3月 5日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	

	2024年 3月 5日現在
項目	金額（円）
預金	9,207,001,941
コール・ローン	582,918,075
株式	678,613,187,133
投資信託受益証券	120,976,464
投資証券	13,406,926,516
派生商品評価勘定	512,239,340
未収入金	848,676
未収配当金	816,875,933
差入委託証拠金	5,891,932,543
流動資産合計	709,152,906,621
資産合計	709,152,906,621
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,117,084
前受金	509,203,386
未払金	83,038,558
未払解約金	913,791,229
未払利息	124
流動負債合計	1,510,150,381
負債合計	1,510,150,381
純資産の部	
元本等	
元本	115,300,212,988
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	592,342,543,252
元本等合計	707,642,756,240
純資産合計	707,642,756,240
負債純資産合計	709,152,906,621

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 3月 5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> <p>(1)先物取引</p>

2024年 3月 5日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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 3月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,300,212,988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 6.1374円 (1万口当たり純資産額) (61,374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 3月 5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ぬ。
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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 9月 6日
期首元本額	113,750,742,062円
期中追加設定元本額	6,210,729,980円
期中一部解約元本額	4,661,259,054円
期末元本額	115,300,212,988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）	1,514,811,951円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,792,969円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,265,130,304円
世界経済インデックスファンド	13,354,725,793円
外国株式インデックス・オープン	887,290,652円
D C マイセレクション 2 5	547,241,072円
D C マイセレクション 5 0	3,230,327,053円
D C マイセレクション 7 5	4,289,339,576円
D C 外国株式インデックス・オープン	13,022,082,420円
D C マイセレクション S 2 5	323,274,406円
D C マイセレクション S 5 0	1,802,378,693円
D C マイセレクション S 7 5	1,926,450,181円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	13,048,321円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	124,553,273円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	101,239,132円
D C 世界経済インデックスファンド	9,353,347,660円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	910,919,967円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,700,446円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,927,777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）	21,842,526円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,274,054円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	29,668,119円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	6,292,963円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	18,468,486円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	140,793,709円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	117,546,875円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	913,413,981円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	62,093,976円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	15,069,905円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	103,531,891円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	32,263,324円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	733,796,914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）	781,650,936円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,179,156,345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）	1,495,414,759円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,021,034,061円
コア投資戦略ファンド（切替型）	130,977,347円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	435,803,900円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	23,414,395円
S M T インデックスバランス・オープン	107,863,577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 セレクション（SMA専用）	5,073,214,982円
S M T 世界経済インデックス・オープン	243,671,967円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,077,254,644円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	179,013,430円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	5,307,923円
M y S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,825,025,383円
グローバル経済コア	595,012,884円

区分	2024年 3月 5日現在
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,858,659円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,602,494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）	31,671,774円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	154,286,846円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	147,943,592円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	66,483,824円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	80,591,254円
10資産分散投資ファンド	63,692,877円
グローバル10資産バランスファンド	10,499,281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）	53,367,923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）	196,686,198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）	607,278,040円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,395,379,174円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	81,381,992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）	76,776,522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）	78,482,921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 3月 5日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引			
	買建	14,534,970,241	-	15,044,173,627
合計		14,534,970,241	-	15,044,173,627

(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

（2024年 3月 5日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
	為替予約取引			



市場取引以外の取引	売建	749,595,540	-	750,676,670	1,081,130
	アメリカドル	630,704,000	-	631,625,180	921,180
	カナダドル	33,231,300	-	33,233,520	2,220
	ユーロ	52,080,640	-	52,240,320	159,680
	シンガポールドル	33,579,600	-	33,577,650	1,950
合計		749,595,540	-	750,676,670	1,081,130

## (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。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

2024年 3月 5日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,842,218,957
投資証券	110,197,248,000
未収配当金	1,751,411,623
前払金	8,421,600
差入委託証拠金	434,468,048
流動資産合計	115,233,768,228
資産合計	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,002,400
未払金	463,532,069
未払解約金	59,904,384
未払利息	608
流動負債合計	532,439,461
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	57,543,727,386
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	57,157,601,381
元本等合計	114,701,328,767
純資産合計	
負債純資産合計	
115,233,768,228	

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年 3月 5日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

2024年 3月 5日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 3月 5日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,543,727,386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 1.9933円 (1万口当たり純資産額) (19,933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 3月 5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ぬ。
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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 9月 6日
期首元本額	66,386,286,728円
期中追加設定元本額	6,014,542,329円
期中一部解約元本額	14,857,101,671円
期末元本額	57,543,727,386円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,835,331,401円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,908,026円
SMT J-REITインデックス・オープン	17,235,630,574円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	27,824,120,113円
コア投資戦略ファンド(安定型)	994,368,691円

区分	2024年 3月 5日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,637,547,155円
分散投資コア戦略ファンドA	1,017,119,866円
分散投資コア戦略ファンドS	2,029,781,182円
コア投資戦略ファンド（切替型）	737,523,051円
SMT インデックスバランス・オープン	21,854,926円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	211,531,584円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,665,970円
グローバル経済コア	373,875,188円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	17,494,737円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	526,962,705円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	133,905,607円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	978,731,668円
10資産分散投資ファンド	33,428,660円
グローバル10資産バランスファンド	28,519,998円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	343,473,733円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	8,660,501円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	689,306,473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）	71,984,359円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	497,651,730円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	274,349,488円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2024年 3月 5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	不動産投信指数先物 取引 買建	4,464,741,600	-	4,456,320,000	8,421,600
	合計	4,464,741,600	-	4,456,320,000	8,421,600

（注）1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 3月 5日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	419,175,719
コール・ローン	103,325,542
投資証券	112,627,490,043
派生商品評価勘定	513,904
未収入金	53,840,054
未収配当金	212,973,343
流動資産合計	113,417,318,605
資産合計	113,417,318,605
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	171,380

	2024年 3月 5日現在
項目	金額（円）
未払金	132,172,178
未払解約金	33,777,402
未払利息	22
流動負債合計	166,120,982
負債合計	166,120,982
純資産の部	
元本等	
元本	39,330,952,476
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	73,920,245,147
元本等合計	113,251,197,623
純資産合計	113,251,197,623
負債純資産合計	113,417,318,605

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 3月 5日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2024年 3月 5日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	39,330,952,476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 2.8794円 (1万口当たり純資産額) (28,794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 3月 5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ぬ。
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。

2024年 3月 5日現在	
	(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 3月 5日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 9月 6日
期首元本額	36,159,243,737円
期中追加設定元本額	8,020,628,799円
期中一部解約元本額	4,848,920,060円
期末元本額	39,330,952,476円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	52,864,691円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	92,963,651円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,511,672,187円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,794,103円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,209,324,883円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,330,392,371円
コア投資戦略ファンド（安定型）	448,238,308円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,227,996,779円
分散投資コア戦略ファンドA	1,006,149,778円
分散投資コア戦略ファンドS	1,578,869,574円
コア投資戦略ファンド（切替型）	555,506,587円
SMT インデックスバランス・オープン	102,515,531円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	162,214,836円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,372,934円
グローバル経済コア	281,618,107円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,920,404円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	404,702,572円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	104,627,417円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	249,890,302円
10資産分散投資ファンド	17,723,165円
グローバル10資産バランスファンド	21,672,071円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	975,686,938円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	210,346,223円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	71,893,831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）	61,280,541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）	45,811,137円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	89,154,296円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	89,098,754円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	88,645,928円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	86,789,890円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	85,929,475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）	78,969,031円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	57,316,181円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2024年 3月 5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	165,816,740	-	166,330,644	513,904
	アメリカドル	39,096,200	-	39,096,954	754
	イギリスポンド	110,225,520	-	110,728,554	503,034
	ニュージーランド ドル	16,495,020	-	16,505,136	10,116
	売建	58,946,040	-	59,117,420	171,380
	アメリカドル	15,003,000	-	15,039,650	36,650
	ユーロ	43,943,040	-	44,077,770	134,730
合計		224,762,780	-	225,448,064	342,524

## (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】

## 【SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）】

## 【純資産額計算書】

（2024年 3月29日現在）

資産総額	420,921,322円
負債総額	785,757円
純資産総額（ - ）	420,135,565円
発行済口数	273,631,738口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5354円
（1万口当たり純資産額）	（15,354円）

（参考）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 3月29日現在）

資産総額	677,726,781,217円
負債総額	7,626,379,038円
純資産総額（ - ）	670,100,402,179円
発行済口数	501,918,750,868口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3351円
（1万口当たり純資産額）	（13,351円）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 3月29日現在）

資産総額	676,203,749,033円
負債総額	1,335,433,150円
純資産総額（ - ）	674,868,315,883円
発行済口数	235,007,874,679口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8717円
（1万口当たり純資産額）	（28,717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 3月29日現在）

資産総額	340,998,582,554円
負債総額	7,730,329,196円
純資産総額（ - ）	333,268,253,358円
発行済口数	94,172,499,508口

1口当たり純資産額（ / ）	3.5389円
（1万口当たり純資産額）	（35,389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 3月29日現在）

資産総額	730,643,685,637円
負債総額	850,664,733円
純資産総額（ - ）	729,793,020,904円
発行済口数	115,282,640,037口
1口当たり純資産額（ / ）	6.3305円
（1万口当たり純資産額）	（63,305円）

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 3月29日現在）

資産総額	122,828,888,229円
負債総額	537,933,440円
純資産総額（ - ）	122,290,954,789円
発行済口数	58,019,973,399口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1077円
（1万口当たり純資産額）	（21,077円）

## グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 3月29日現在）

資産総額	115,272,398,455円
負債総額	49,560,128円
純資産総額（ - ）	115,222,838,327円
発行済口数	39,358,089,469口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9276円
（1万口当たり純資産額）	（29,276円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。



## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

## 受益権の譲渡の対抗要件

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

## 受益権の再分割

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

## 償還金

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

## 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2024年 3月29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 5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 3月29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	529	14,768,608
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	62	216,733
単体型公社債投資信託	51	173,672
合計	642	15,159,012

## 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
	其他有価証券 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)				
その他有価証券	-	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) 通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこ

と。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2024年 6月 5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。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

## (1)受託会社

該当事項はありません。

## (2)販売会社

該当事項はありません。

## (参考)再信託受託会社

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11月15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SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2022年9月6日から2023年9月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2023年9月5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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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드는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. XBR 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5月17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SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2023年9月6日から2024年3月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）の2024年3月5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9月6日から2024年3月5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。