

【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】	2025年6月30日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCマイセレクション25
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】**(1)【ファンドの名称】**

DCマイセレクション25

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7)【申込期間】

2025年7月1日から2025年12月26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。

（ 1 0 ）【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。

（ 1 1 ）【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

（ 1 2 ）【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、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド ファン ド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ ショ ー ト型/ 絶対収益追求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニ ア 中南米 アフリカ 中近東 (中東)				
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、短期 金融資産)資産 配分固定型))	その他 ()					
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

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

[補足分類]

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

のとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般... 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般... 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他... 上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1) グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2) 日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) 欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

- (1) プル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信

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

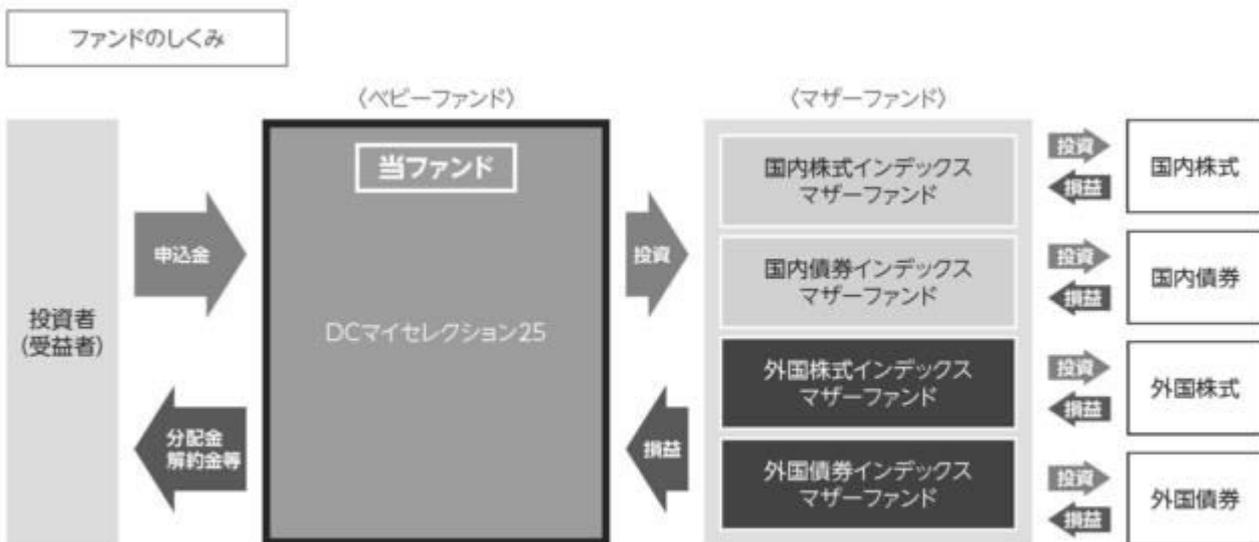
- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

<ファンドの特色>

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

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

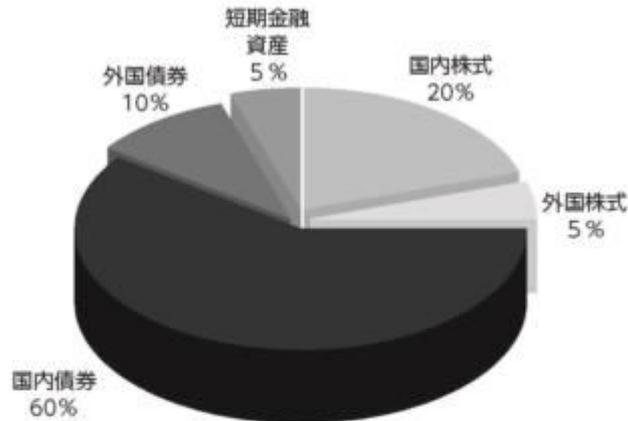
各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

- ※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※2 「NOMURA-BPI総合」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※3 「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※4 「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

3. 期待リターンとリスクのバランスを勘案し、国内株式20%、外国株式5%、国内債券60%、外国債券10%、短期金融資産5%を基準ポートフォリオとして運用します。

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

基準ポートフォリオ



ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

- 基準ポートフォリオに従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

- 資産配分比率が基準ポートフォリオから一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

- 原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の25%以下とします。

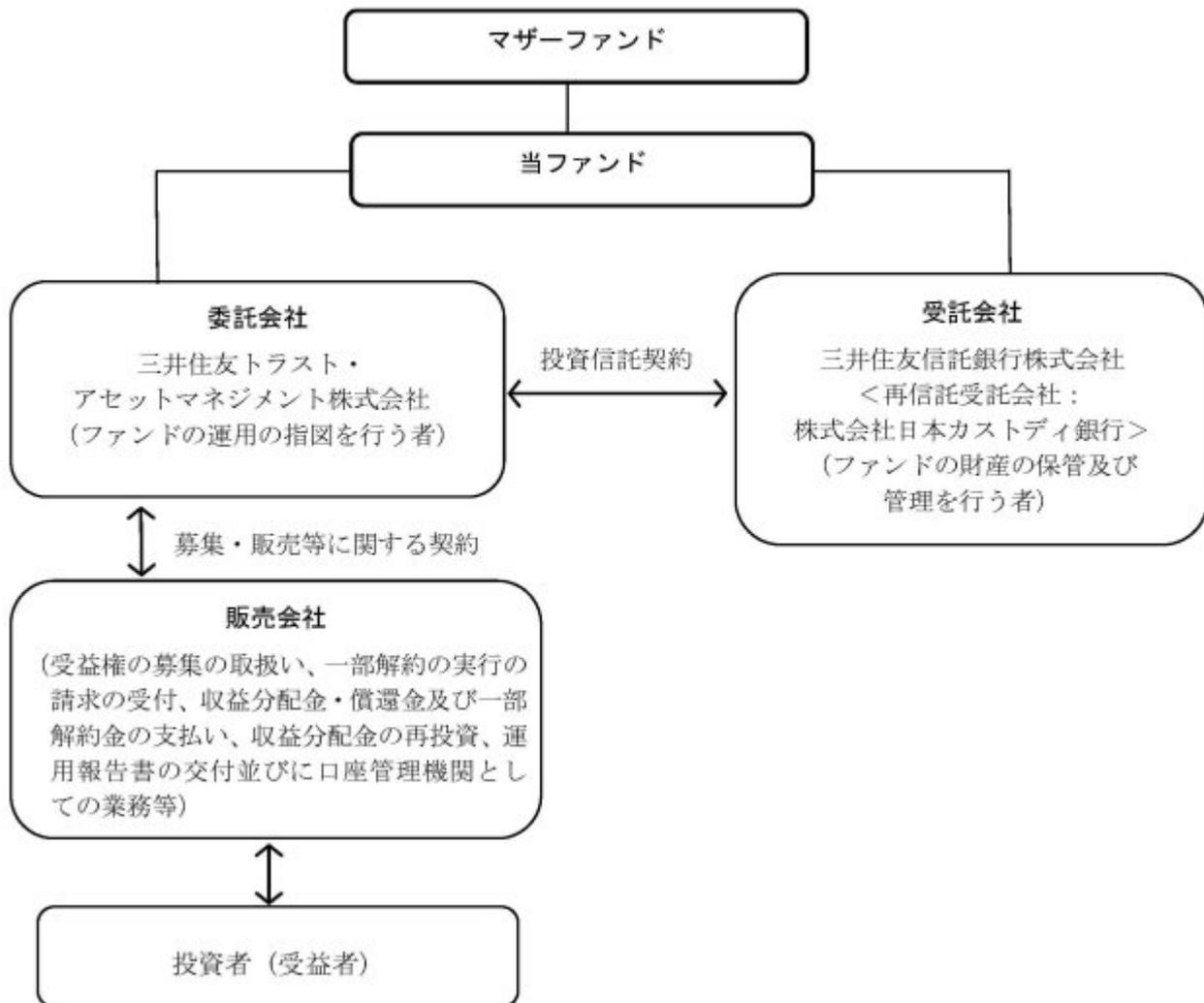
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2001年10月1日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年4月1日	本ファンドの名称を「すみしん DCマイセレクション25」から「DCマイセレクション25」に変更 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2025年 4月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

（１）【投資方針】

（イ）基本方針

本ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

（ロ）運用方法

投資対象

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

投資態度

- 1) 主として、マザーファンド受益証券への投資を通して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
- 2) 基準ポートフォリオは、国内株式20%、国内債券60%、外国株式5%、外国債券10%および短期金融資産5%の比率で基準配分します。
- 3) 各資産につき、上記の基本アロケーションにおける各資産毎の比率に一定の変動幅を設けません。市況動向等に応じて、基本アロケーションは1年に1回程度、若干の見直しを行う場合があります。
- 4) 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上をはかるため、為替のエクスポージャーのコントロールを行う場合があります。
- 5) 投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 7) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

（２）【投資対象】

（イ）本ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

- (ロ) 委託会社は、信託金を主として次に掲げる第1号から第4号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに第5号から第26号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
1. 国内株式インデックス マザーファンド
 2. 国内債券インデックス マザーファンド
 3. 外国株式インデックス マザーファンド
 4. 外国債券インデックス マザーファンド
 5. 株券または新株引受権証書
 6. 国債証券
 7. 地方債証券
 8. 特別の法律により法人の発行する債券
 9. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 12. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 13. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 14. コマーシャル・ペーパー
 15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 17. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 18. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 21. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 26. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5号の証券または

証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するもの、および第18号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を前記(八)第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

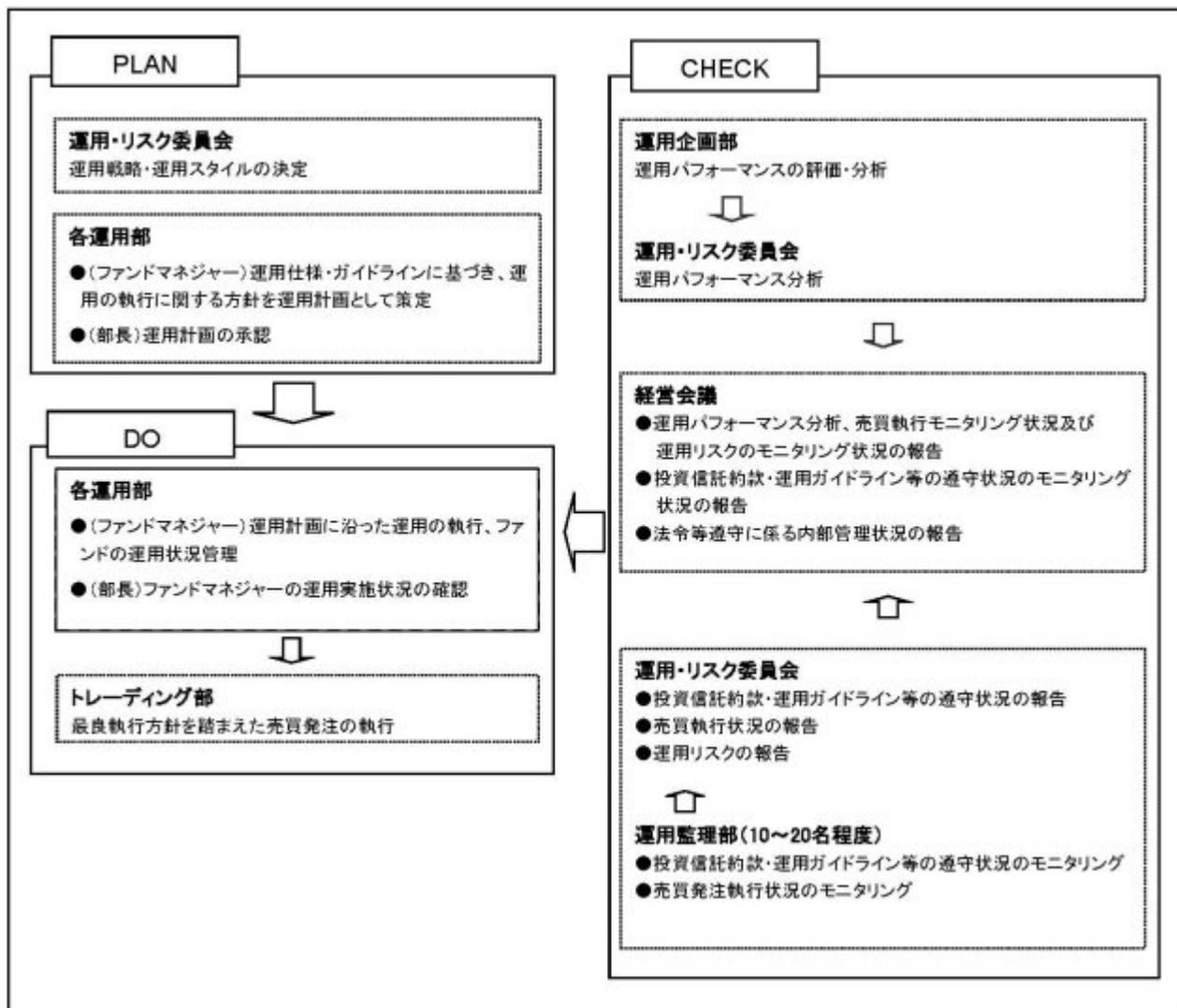
外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

(3) 【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・ 分配については、委託会社が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。
- ・ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

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

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の25%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することができるものとします。（投資信託約款第19条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有

価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

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

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

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第24条）

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

が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。（投資信託約款第25条）

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

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

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

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第28条）

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

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第39条）

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

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

前記 から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対す

る、本ファンドの投資信託財産に属する前記 から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記 、 および における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(イ)ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様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。

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

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

有価証券の貸付等に係るリスク

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

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されるこ

とがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

ファンドは、大量の換金申込が発生し短時間で換金代金を手当てする必要がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

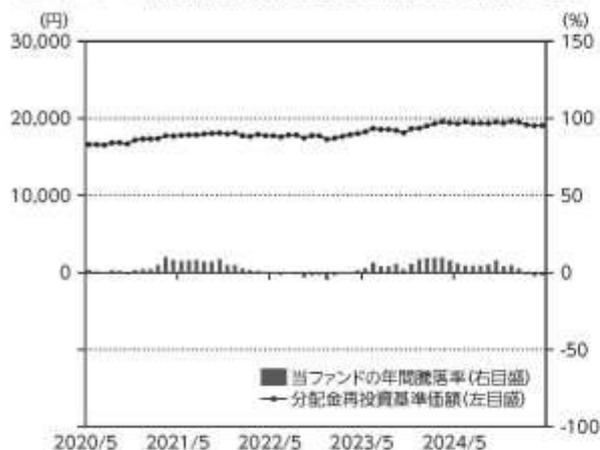
(ロ) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

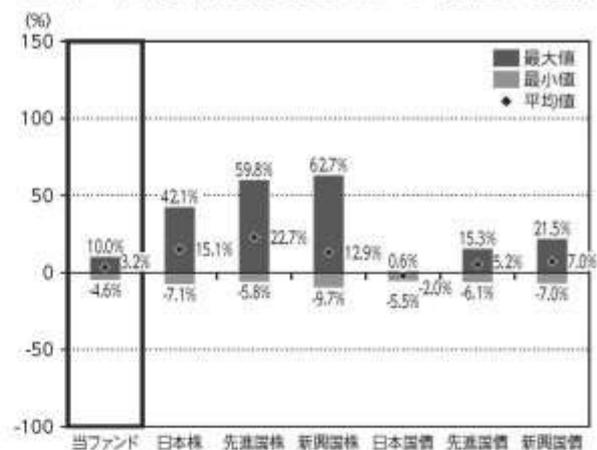
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2020年5月～2025年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(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 0.286%（税抜 0.26%）（ ）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 0.143% (税抜 0.13%)	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 0.11% (税抜 0.1%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.033% (税抜 0.03%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

2025年6月30日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2025年4月30日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(1+2)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.29%	0.28%	0.01%

※対象期間は2023年10月3日～2024年9月30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、2025年4月30日現在の状況について記載してあります。

【DCマイセレクション25】

（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	61,004,866,158	95.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,192,926,221	4.97
合計(純資産総額)		64,197,792,379	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
------	----	-----	----	-----------	-----------	----------	----------	---------

日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	30,013,353,766	1.3167	39,518,911,472	1.2792	38,393,082,137	59.80
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	4,577,394,591	2.7576	12,622,623,325	2.8369	12,985,610,715	20.23
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,806,496,811	3.5327	6,381,909,271	3.5409	6,396,624,558	9.96
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	500,208,901	6.5251	3,263,913,100	6.4564	3,229,548,748	5.03

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.03
合計	95.03

(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14期計算期間末	(2015年 9月30日)	30,481,047,032	30,481,047,032	15,019	15,019
第15期計算期間末	(2016年 9月30日)	33,555,285,756	33,555,285,756	15,159	15,159
第16期計算期間末	(2017年10月 2日)	38,809,433,024	38,809,433,024	16,209	16,209
第17期計算期間末	(2018年10月 1日)	45,795,333,892	45,795,333,892	16,626	16,626
第18期計算期間末	(2019年 9月30日)	49,435,522,659	49,435,522,659	16,682	16,682
第19期計算期間末	(2020年 9月30日)	53,033,176,111	53,033,176,111	16,849	16,849
第20期計算期間末	(2021年 9月30日)	58,943,107,139	58,943,107,139	18,052	18,052
第21期計算期間末	(2022年 9月30日)	59,387,024,159	59,387,024,159	17,462	17,462
第22期計算期間末	(2023年10月 2日)	63,636,475,736	63,636,475,736	18,417	18,417
第23期計算期間末	(2024年 9月30日)	65,464,225,548	65,464,225,548	19,347	19,347
	2024年 4月末日	66,243,884,243		19,430	
	5月末日	65,745,688,189		19,321	
	6月末日	66,235,706,764		19,536	
	7月末日	65,537,038,007		19,366	
	8月末日	65,550,227,171		19,366	
	9月末日	65,464,225,548		19,347	
	10月末日	66,152,257,065		19,514	
	11月末日	65,791,800,014		19,376	
	12月末日	66,593,643,807		19,621	
	2025年 1月末日	66,156,536,767		19,498	

2月末日	64,799,177,629		19,169
3月末日	64,404,549,891		19,044
4月末日	64,197,792,379		19,085

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	0
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	0
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	0
第22期計算期間	2022年10月 1日～2023年10月 2日	0
第23期計算期間	2023年10月 3日～2024年 9月30日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	3.8
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0.9
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	6.9
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	2.6
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0.3
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	1.0
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	7.1
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	3.3
第22期計算期間	2022年10月 1日～2023年10月 2日	5.5
第23期計算期間	2023年10月 3日～2024年 9月30日	5.0
第24期中間計算期間	2024年10月 1日～2025年 3月31日	1.6

(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14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	3,679,811,287	2,295,568,761	20,294,474,721
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	3,463,560,259	1,622,856,126	22,135,178,854
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	3,956,589,861	2,148,272,884	23,943,495,831
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	5,895,612,544	2,295,315,456	27,543,792,919
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	4,320,261,375	2,229,485,059	29,634,569,235
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	4,924,418,553	3,084,218,786	31,474,769,002
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	4,550,980,588	3,373,682,545	32,652,067,045
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	4,243,867,947	2,887,034,634	34,008,900,358

第22期計算期間	2022年10月 1日～2023年10月 2日	3,783,258,513	3,238,914,564	34,553,244,307
第23期計算期間	2023年10月 3日～2024年 9月30日	3,187,828,498	3,904,696,980	33,836,375,825
第24期中間計算期間	2024年10月 1日～2025年 3月31日	1,578,985,866	1,595,840,517	33,819,521,174

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

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	693,583,026,200	97.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		20,882,172,191	2.92
合計(純資産総額)		714,465,198,391	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	20,596,585,000	2.88

(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	9,718,900	3,308.21	32,152,214,955	2,729.00	26,522,878,100	3.71
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,306,800	2,541.09	16,026,186,946	3,771.00	23,782,942,800	3.33
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,550,700	1,636.65	18,904,466,739	1,803.50	20,831,687,450	2.92
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,697,300	3,261.05	15,318,161,733	3,518.00	16,525,101,400	2.31
日本	株式	任天堂	その他製品	1,154,300	8,312.45	9,595,070,192	11,830.00	13,655,369,000	1.91
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,718,000	3,346.96	12,444,021,078	3,400.00	12,641,200,000	1.77
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,390,000	8,008.58	11,131,928,275	7,942.00	11,039,380,000	1.55
日本	株式	キーエンス	電気機器	182,900	69,354.68	12,684,972,211	59,840.00	10,944,736,000	1.53
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,719,000	5,358.75	9,211,699,239	5,708.00	9,812,052,000	1.37
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,575,100	3,297.69	11,789,585,881	2,712.00	9,695,671,200	1.36
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,300,300	7,270.45	9,453,771,502	7,282.00	9,468,784,600	1.33
日本	株式	三菱重工業	機械	3,229,100	1,388.62	4,483,993,724	2,796.50	9,030,178,150	1.26
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,406,100	3,153.50	7,587,658,646	3,580.00	8,613,838,000	1.21

日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	386,900	34,262.87	13,256,306,062	21,225.00	8,211,952,500	1.15
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	54,542,600	151.92	8,286,504,683	149.30	8,143,210,180	1.14
日本	株式	三井物産	卸売業	2,780,800	3,934.55	10,941,217,594	2,898.00	8,058,758,400	1.13
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,631,600	4,111.88	6,708,959,052	4,333.00	7,069,722,800	0.99
日本	株式	信越化学工業	化学	1,628,500	5,857.34	9,538,692,156	4,330.00	7,051,405,000	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,697,400	2,163.81	5,836,674,526	2,523.50	6,806,888,900	0.95
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	904,500	8,904.00	8,053,676,708	7,164.00	6,479,838,000	0.91
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	29,382,500	188.17	5,529,105,999	215.90	6,343,681,750	0.89
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,331,800	1,703.08	7,377,405,626	1,453.00	6,294,105,400	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	1,696,100	5,368.07	9,104,791,408	3,644.00	6,180,588,400	0.87
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	130,500	42,135.78	5,498,719,773	46,980.00	6,130,890,000	0.86
日本	株式	HOYA	精密機器	354,700	18,678.49	6,625,260,634	16,780.00	5,951,866,000	0.83
日本	株式	富士通	電気機器	1,699,200	2,298.31	3,905,292,900	3,151.00	5,354,179,200	0.75
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,878,200	2,665.55	5,006,449,194	2,760.50	5,184,771,100	0.73
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,093,900	4,374.37	4,785,130,771	4,407.00	4,820,817,300	0.67
日本	株式	中外製薬	医薬品	574,000	4,883.44	2,803,099,891	8,219.00	4,717,706,000	0.66
日本	株式	日本電気	電気機器	1,305,800	2,361.02	3,083,032,265	3,476.00	4,538,960,800	0.64

(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	0.23
		建設業	2.26
		食料品	3.12
		繊維製品	0.39
		パルプ・紙	0.14
		化学	4.66
		医薬品	4.18
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.62
		ガラス・土石製品	0.61
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.47
		機械	5.37
		電気機器	16.69
		輸送用機器	7.23
		精密機器	2.08
		その他製品	3.13
		電気・ガス業	1.27
陸運業	2.41		

	海運業	0.60
	空運業	0.34
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.68
	卸売業	6.70
	小売業	4.76
	銀行業	8.38
	証券、商品先物取引業	0.79
	保険業	3.31
	その他金融業	1.08
	不動産業	1.91
	サービス業	4.39
	小計	97.08
合計		97.08

(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	773円		19,878,483,850	20,596,585,000	2.88

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	602,627,687,500	84.95
地方債証券	日本	35,544,651,238	5.01
特殊債券	日本	37,654,466,679	5.31
	国際機関	298,089,000	0.04
	小計	37,952,555,679	5.35
社債券	日本	30,896,613,000	4.36
	フランス	1,689,493,000	0.24
	オーストラリア	398,776,000	0.06
	韓国	99,700,000	0.01
	小計	33,084,582,000	4.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		178,283,137	0.03
合計(純資産総額)		709,387,759,554	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174回利付国債(5年)	6,750,000,000	99.74	6,732,681,200	99.38	6,708,555,000	0.700	2029/9/20	0.95
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	6,640,000,000	98.04	6,510,348,000	97.43	6,469,551,200	0.800	2033/9/20	0.91
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	98.46	6,469,413,300	98.26	6,455,747,700	0.100	2028/3/20	0.91
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	6,670,000,000	94.62	6,311,660,700	94.17	6,281,205,700	0.200	2032/9/20	0.89
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	6,340,000,000	98.92	6,272,004,000	98.97	6,275,205,200	0.005	2026/12/20	0.88
日本	国債証券	第377回利付国債(10年)	6,250,000,000	98.79	6,174,584,400	99.22	6,201,750,000	1.200	2034/12/20	0.87
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	6,470,000,000	96.10	6,217,670,000	95.71	6,192,825,200	0.500	2033/3/20	0.87
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	6,200,000,000	95.21	5,903,157,800	94.87	5,882,374,000	0.200	2032/3/20	0.83
日本	国債証券	第374回利付国債(10年)	6,070,000,000	97.54	5,920,681,100	96.74	5,872,664,300	0.800	2034/3/20	0.83
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	6,080,000,000	94.99	5,775,980,000	94.54	5,748,275,200	0.200	2032/6/20	0.81
日本	国債証券	第375回利付国債(10年)	5,790,000,000	101.57	5,881,469,600	98.97	5,730,478,800	1.100	2034/6/20	0.81
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	5,990,000,000	95.97	5,749,163,800	95.49	5,719,851,000	0.600	2033/12/20	0.81
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	99.08	5,697,387,500	98.95	5,690,027,500	0.100	2027/3/20	0.80
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	5,910,000,000	96.27	5,690,116,400	95.83	5,664,025,800	0.100	2030/9/20	0.80
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,970,000,000	94.96	5,669,511,300	94.79	5,659,201,800	0.100	2031/9/20	0.80
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,680,000,000	99.31	5,640,808,000	99.31	5,640,864,800	0.100	2026/9/20	0.80
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	5,865,000,000	96.67	5,669,861,500	96.07	5,634,622,800	0.100	2030/6/20	0.79
日本	国債証券	第376回利付国債(10年)	5,770,000,000	98.64	5,691,528,000	96.89	5,590,899,200	0.900	2034/9/20	0.79
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,630,000,000	98.82	5,563,654,000	98.62	5,552,531,200	0.100	2027/9/20	0.78
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	5,750,000,000	96.02	5,521,253,000	95.60	5,497,230,000	0.100	2030/12/20	0.77
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	5,770,000,000	95.31	5,499,387,000	94.63	5,460,151,000	0.400	2033/6/20	0.77
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	5,590,000,000	96.54	5,397,029,000	96.00	5,366,847,200	0.500	2032/12/20	0.76
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	5,617,000,000	94.78	5,324,007,900	94.51	5,308,907,550	0.100	2031/12/20	0.75
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,350,000,000	98.75	5,283,125,000	98.59	5,274,993,000	0.005	2027/6/20	0.74
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	5,325,000,000	98.29	5,234,346,200	98.05	5,221,269,000	0.100	2028/6/20	0.74
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	5,140,000,000	99.22	5,100,159,900	99.36	5,107,155,400	0.005	2026/6/20	0.72

日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	5,080,000,000	97.93	4,975,305,900	97.83	4,970,018,000	0.100	2028/9/20	0.70
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	4,880,000,000	99.20	4,841,057,600	99.13	4,837,641,600	0.100	2026/12/20	0.68
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,000,000,000	95.66	4,783,000,000	95.07	4,753,500,000	0.100	2031/6/20	0.67
日本	国債証券	第163回利付国債（5年）	4,730,000,000	99.31	4,697,459,700	98.82	4,674,469,800	0.400	2028/9/20	0.66

(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	84.95
地方債証券	5.01
特殊債券	5.35
社債券	4.66
合計	99.97

(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

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	520,984,250,591	69.50
	イギリス	29,135,006,936	3.89
	カナダ	25,463,155,308	3.40
	スイス	21,767,601,724	2.90
	フランス	20,803,417,245	2.78
	ドイツ	20,535,670,145	2.74
	アイルランド	13,237,113,424	1.77
	オーストラリア	12,268,206,877	1.64
	オランダ	12,152,728,424	1.62
	スペイン	6,247,933,376	0.83
	スウェーデン	6,180,249,100	0.82
	イタリア	5,127,900,621	0.68
	デンマーク	4,493,415,330	0.60
	香港	2,740,735,946	0.37
	シンガポール	2,423,268,758	0.32
	フィンランド	2,025,466,518	0.27
	イスラエル	1,904,622,669	0.25
	ベルギー	1,526,650,518	0.20

	ルクセンブルク	1,382,369,370	0.18
	ノルウェー	1,234,725,041	0.16
	ケイマン	1,209,343,997	0.16
	バミューダ	838,493,622	0.11
	ジャージー	835,422,538	0.11
	リベリア	634,168,474	0.08
	ニュージーランド	553,975,626	0.07
	キュラソー	536,989,109	0.07
	オーストリア	416,572,153	0.06
	ポルトガル	294,667,562	0.04
	パナマ	231,692,386	0.03
	マン島	61,530,873	0.01
	小計	717,247,344,261	95.68
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	香港	64,230,705	0.01
	オーストラリア	63,411,608	0.01
	小計	127,642,313	0.02
投資証券	アメリカ	11,831,521,010	1.58
	オーストラリア	772,400,828	0.10
	フランス	299,252,317	0.04
	シンガポール	209,545,315	0.03
	イギリス	194,122,068	0.03
	香港	114,117,379	0.02
	小計	13,420,958,917	1.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		18,806,724,980	2.51
合計(純資産総額)		749,602,670,471	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	15,483,663,369	2.07
	買建	カナダ	401,144,796	0.05
	買建	ドイツ	2,481,439,037	0.33
	買建	イギリス	1,035,921,820	0.14
	買建	オーストラリア	533,107,464	0.07

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		2,655,118,449	0.35

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,193,417	27,487.49	32,804,045,014	30,112.20	35,936,422,964	4.79
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	560,536	61,269.45	34,343,736,630	56,178.28	31,489,949,928	4.20
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,943,544	16,282.91	31,646,570,885	15,542.98	30,208,468,242	4.03
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	751,031	25,994.78	19,522,891,701	26,716.19	20,064,688,619	2.68
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	173,018	68,780.04	11,900,185,844	79,046.51	13,676,469,206	1.82
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	464,552	25,083.76	11,652,713,570	22,834.01	10,607,585,571	1.42
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	353,393	20,353.29	7,192,711,344	27,255.10	9,631,763,993	1.28
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	229,583	25,544.26	5,864,529,428	41,634.71	9,558,623,256	1.28
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	395,264	25,328.98	10,011,636,401	23,104.89	9,132,532,901	1.22
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	64,038	115,848.10	7,418,680,942	126,202.96	8,081,785,409	1.08
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	105,618	58,141.47	6,140,785,958	76,213.64	8,049,532,747	1.07
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	223,428	28,565.32	6,382,293,479	34,875.47	7,792,157,271	1.04
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	137,247	39,487.61	5,419,556,408	48,690.50	6,682,625,932	0.89
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	33,924	93,256.46	3,163,632,241	160,482.49	5,444,208,154	0.73
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	349,119	16,395.54	5,723,998,020	15,448.88	5,393,499,352	0.72
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	65,052	63,703.12	4,144,015,843	76,942.17	5,005,242,537	0.67
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	35,229	116,372.76	4,099,696,050	141,386.66	4,980,910,962	0.66
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	350,645	9,342.61	3,275,940,220	13,692.42	4,801,179,593	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	186,898	23,317.32	4,357,961,128	23,133.40	4,323,587,726	0.58
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,035	72,180.33	5,271,691,103	58,343.92	4,261,148,278	0.57

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	191,339	20,681.20	3,957,120,931	22,228.08	4,253,100,264	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	78,740	47,095.14	3,708,271,961	51,182.62	4,030,120,286	0.54
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	140,242	22,357.82	3,135,506,430	27,588.72	3,869,097,368	0.52
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	82,871	28,918.15	2,396,476,373	41,288.48	3,421,617,792	0.46
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	324,777	8,860.72	2,877,759,846	10,314.93	3,350,055,106	0.45
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	206,556	15,822.79	3,268,292,439	15,005.11	3,099,396,741	0.41
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	543,319	5,614.40	3,050,413,779	5,701.37	3,097,664,983	0.41
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	123,393	14,607.72	1,802,490,665	24,273.96	2,995,237,758	0.40
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,214	144,384.81	4,506,827,649	94,869.44	2,961,255,012	0.40
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	75,402	38,431.16	2,897,787,020	38,174.54	2,878,436,906	0.38

(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	3.80
		素材	3.30
		資本財	7.13
		商業・専門サービス	1.66
		運輸	1.40
		自動車・自動車部品	1.82
		耐久消費財・アパレル	1.05
		消費者サービス	1.95
		メディア・娯楽	6.50
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.78
		生活必需品流通・小売り	1.96
		食品・飲料・タバコ	3.09
		家庭用品・パーソナル用品	1.44
		ヘルスケア機器・サービス	3.81
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.85
		銀行	6.13
		金融サービス	7.42
		保険	3.35
エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.03		
ソフトウェア・サービス	9.86		

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.25
		電気通信サービス	1.29
		公益事業	2.79
		半導体・半導体製造装置	7.76
		不動産管理・開発	0.28
		小計	95.68
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.02
投資証券			1.79
合計			97.49

(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	389	アメリカドル	106,863,946.9	15,235,592,909	108,603,937.5	15,483,663,369	2.07
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	13	カナダドル	3,801,110.5	391,704,437	3,892,720	401,144,796	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	39	スイスフラン	4,659,963	805,567,803	4,696,380	811,863,210	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	201	ユーロ	10,121,653.2	1,641,428,499	10,295,220	1,669,575,827	0.22
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	29	オーストラリアドル	5,675,228	516,218,739	5,860,900	533,107,464	0.07
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	64	イギリスポンド	5,326,415	1,017,824,642	5,421,120	1,035,921,820	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	15,830,000.00	2,266,616,618	2,256,365,459	0.30
	カナダドル	買建	1,000,000.00	103,027,000	103,036,700	0.01
	ユーロ	買建	500,000.00	81,050,500	81,053,500	0.01
	イギリスポンド	買建	600,000.00	114,611,400	114,628,020	0.02
	オーストラリアドル	買建	1,100,000.00	100,028,500	100,034,770	0.01

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	171,261,009,683	45.25
	中国	40,711,670,947	10.76
	フランス	27,705,678,401	7.32
	イタリア	25,582,433,810	6.76
	ドイツ	21,601,928,419	5.71
	イギリス	20,034,327,084	5.29
	スペイン	16,806,574,792	4.44
	カナダ	7,183,258,159	1.90
	ベルギー	5,822,622,890	1.54
	オランダ	4,879,987,597	1.29
	オーストラリア	4,580,950,560	1.21
	オーストリア	4,102,777,321	1.08
	メキシコ	2,794,473,585	0.74
	ポーランド	2,312,265,138	0.61
	ポルトガル	2,254,046,931	0.60
	フィンランド	1,912,129,718	0.51
	マレーシア	1,875,648,135	0.50
	アイルランド	1,780,568,557	0.47
	シンガポール	1,471,105,666	0.39
	イスラエル	1,213,310,219	0.32
	ニュージーランド	1,064,985,225	0.28
デンマーク	814,161,869	0.22	
スウェーデン	689,140,679	0.18	
ノルウェー	584,353,906	0.15	
	小計	369,039,409,291	97.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,422,960,205	2.49
合計(純資産総額)		378,462,369,496	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	2,337,564,354	0.62
	買建	ドイツ	2,113,204,025	0.56

(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		5,580,423,702	1.47

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	19,030,000	13,384.88	2,547,143,065	13,692.56	2,605,695,623	1.250	2026/12/31	0.69
アメリカ	国債証券	T 0.875% 09/30/26	17,160,000	13,485.00	2,314,027,494	13,689.50	2,349,118,977	0.875	2026/9/30	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	15,500,000	13,248.42	2,053,506,432	13,841.54	2,145,439,038	1.500	2026/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	16,100,000	12,675.73	2,040,792,923	13,255.11	2,134,072,961	0.375	2027/7/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/29	15,200,000	13,417.17	2,039,410,386	13,643.28	2,073,778,655	2.625	2029/7/31	0.55
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/34	13,770,000	13,859.92	1,908,511,704	13,959.60	1,922,237,996	3.875	2034/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 4.375% 12/15/26	13,000,000	14,486.19	1,883,204,715	14,399.84	1,871,980,297	4.375	2026/12/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	13,032.62	1,776,346,702	13,596.49	1,853,202,948	3.375	2033/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 4.375% 07/15/27	12,800,000	14,349.70	1,836,762,179	14,472.52	1,852,483,299	4.375	2027/7/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	13,220,000	13,321.75	1,761,135,691	13,910.04	1,838,907,619	2.875	2028/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/26	12,300,000	13,507.19	1,661,385,161	13,817.31	1,699,529,916	1.625	2026/10/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 4% 02/15/34	11,600,000	14,064.85	1,631,523,099	14,136.42	1,639,825,662	4.000	2034/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,330.85	1,558,376,584	13,898.34	1,624,716,803	2.375	2027/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/31/29	11,000,000	14,331.59	1,576,475,785	14,676.35	1,614,399,188	4.500	2029/5/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	12,030,000	12,343.72	1,484,949,721	13,127.29	1,579,214,171	1.125	2028/8/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 3.875% 10/15/27	11,000,000	14,112.40	1,552,364,684	14,332.18	1,576,540,178	3.875	2027/10/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/29	11,300,000	13,512.44	1,526,906,323	13,816.48	1,561,262,345	2.875	2029/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	11,070,000	13,594.61	1,504,923,447	14,060.13	1,556,456,493	3.875	2033/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	13,183.82	1,476,588,575	13,755.49	1,540,615,877	3.500	2033/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	11,414.51	1,435,945,437	12,162.44	1,530,035,737	1.375	2031/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/31/28	10,420,000	14,114.43	1,470,723,606	14,566.92	1,517,873,340	4.375	2028/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/31/26	10,800,000	13,012.29	1,405,328,079	13,702.59	1,479,879,939	0.625	2026/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	11,791.81	1,382,001,286	12,494.08	1,464,307,182	1.875	2032/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.25% 11/15/34	10,180,000	14,173.66	1,442,879,197	14,358.35	1,461,680,887	4.250	2034/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	10,410,000	13,403.80	1,395,336,376	13,994.13	1,456,789,615	3.125	2028/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,135.87	1,413,587,125	14,365.04	1,436,504,126	4.500	2026/7/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 4.375% 05/15/34	9,830,000	14,426.32	1,418,107,310	14,516.80	1,427,001,485	4.375	2034/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/15/54	10,550,000	13,519.59	1,426,317,778	13,321.38	1,405,406,052	4.250	2054/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	10,980,000	11,874.28	1,303,796,758	12,528.61	1,375,642,166	1.625	2031/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	9,520,000	14,181.53	1,350,082,429	14,428.25	1,373,569,503	4.625	2026/10/15	0.36

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	97.51
合計	97.51

(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	62	アメリカドル	6,713,798.67	957,186,276	6,763,812.5	964,316,748	0.25
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	41	アメリカドル	4,554,989.9	649,404,910	4,598,406.25	655,594,779	0.17
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	43	アメリカドル	4,945,589.15	705,092,645	5,033,687.5	717,652,827	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	23	ユーロ	2,470,878.3	400,702,334	2,472,845	401,021,274	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	29	ユーロ	3,453,180.9	560,002,346	3,462,890	561,576,871	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	54	ユーロ	7,063,683.4	1,145,517,537	7,095,060	1,150,605,880	0.30

(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	18,790,000.00	2,680,461,010	2,674,286,750	0.71
	カナダドル	買建	1,970,000.00	202,373,777	202,811,500	0.05
	ユーロ	買建	10,750,000.00	1,740,913,869	1,741,876,250	0.46
	イギリスポンド	買建	1,660,000.00	312,394,137	316,669,900	0.08
	オフショア人民元	買建	32,910,000.00	644,528,042	644,779,302	0.17

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

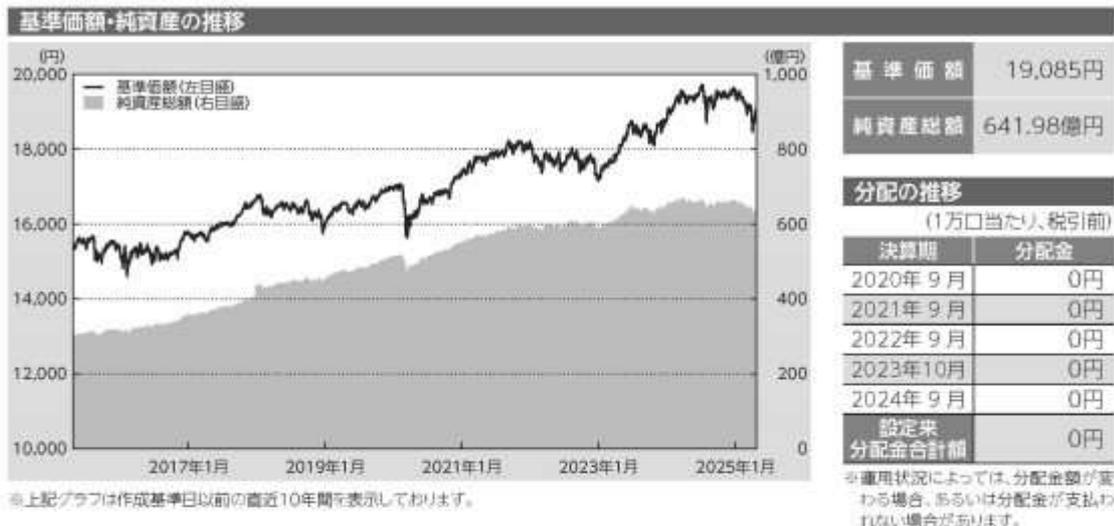
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

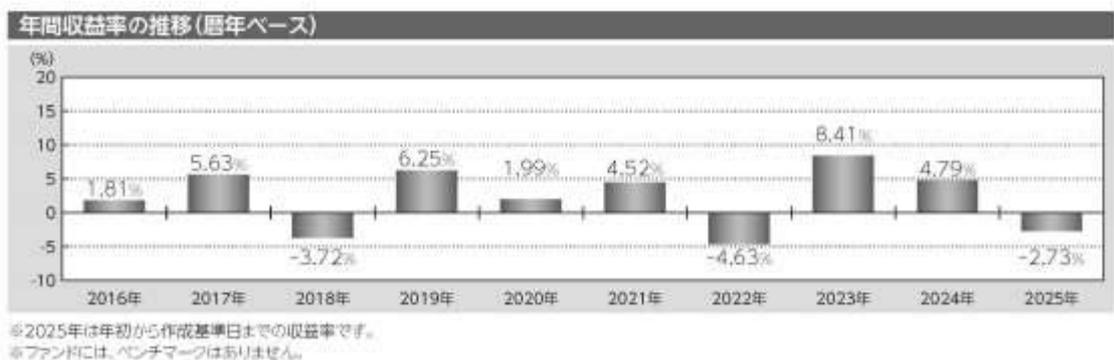
当初設定日：2001年10月1日
作成基準日：2025年4月30日



主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内債券 インデックス マザーファンド	59.8%	第174回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.700%	2029/09/20	0.6%
		第372回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.800%	2033/09/20	0.5%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.5%
国内株式 インデックス マザーファンド	20.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.8%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.6%
外国債券 インデックス マザーファンド	10.0%	T 1.25% 12/31/26	アメリカ	国債	-	1.250%	2026/12/31	0.1%
		T 0.875% 09/30/26	アメリカ	国債	-	0.875%	2026/09/30	0.1%
		T 1.5% 08/15/26	アメリカ	国債	-	1.500%	2026/08/15	0.1%
外国株式 インデックス マザーファンド	5.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	コンピューターソフトウェア機器	-	-	0.2%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.2%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.2%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作

成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、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、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があると

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

・株式

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

・公社債

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

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

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル： 0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2001年10月1日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意の

うえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

ファンドの繰上償還において、上記 から までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1)投資信託約款の変更

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができます。

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

委託会社は、投資信託約款の変更を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

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

したときは、原則として、公告を行いません。

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>に従い、新受託会社を選任します。

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

す。

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に依りて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期計算期間(2023年10月3日から2024年9月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCマイセレクション25】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第22期 (2023年10月2日現在)	第23期 (2024年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,293,315,318	3,351,381,206
親投資信託受益証券	60,437,252,762	62,188,074,653
未収入金	68,550,000	57,390,000
未収利息	-	19,698
流動資産合計	63,799,118,080	65,596,865,557
資産合計	63,799,118,080	65,596,865,557
負債の部		
流動負債		
未払解約金	69,125,079	37,937,807
未払受託者報酬	10,578,273	10,715,628
未払委託者報酬	81,100,054	82,153,019
未払利息	5,672	-
その他未払費用	1,833,266	1,833,555
流動負債合計	162,642,344	132,640,009
負債合計	162,642,344	132,640,009
純資産の部		
元本等		
元本	34,553,244,307	33,836,375,825
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	29,083,231,429	31,627,849,723
(分配準備積立金)	9,277,796,402	11,197,996,924
元本等合計	63,636,475,736	65,464,225,548
純資産合計	63,636,475,736	65,464,225,548
負債純資産合計	63,799,118,080	65,596,865,557

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第22期		第23期	
	自	2022年10月 1日	自	2023年10月 3日
	至	2023年10月 2日	至	2024年 9月30日
営業収益				
受取利息		9,610		1,999,878
有価証券売買等損益		3,449,166,828		3,385,411,891
営業収益合計		3,449,176,438		3,387,411,769
営業費用				
支払利息		1,759,130		273,031
受託者報酬		20,423,328		21,411,639
委託者報酬		156,578,799		164,155,701
その他費用		1,833,266		1,833,668
営業費用合計		180,594,523		187,674,039
営業利益又は営業損失（ ）		3,268,581,915		3,199,737,730
経常利益又は経常損失（ ）		3,268,581,915		3,199,737,730
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,268,581,915		3,199,737,730
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（ ）		172,730,170		275,548,006
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		25,378,123,801		29,083,231,429
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,031,779,821		2,916,254,308
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,031,779,821		2,916,254,308
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,422,523,938		3,295,825,738
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,422,523,938		3,295,825,738
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		29,083,231,429		31,627,849,723

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第23期計算期間は2023年10月3日から2024年9月30日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第22期 (2023年10月2日現在)	第23期 (2024年9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	34,553,244,307口	33,836,375,825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) 1.8417円 (18,417円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9347円 (19,347円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第22期 自 2022年10月1日 至 2023年10月2日			第23期 自 2023年10月3日 至 2024年9月30日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	1,606,856円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,361,354,247円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,921,088,922円
収益調整金額	C	19,805,435,027円	収益調整金額	C	20,429,852,799円
分配準備積立金額	D	7,916,442,155円	分配準備積立金額	D	8,275,301,146円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	29,083,231,429円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	31,627,849,723円
当ファンドの期末残存口数	F	34,553,244,307口	当ファンドの期末残存口数	F	33,836,375,825口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	8,416円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	9,347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23期 自 2023年10月3日 至 2024年9月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第23期 (2024年9月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第23期 (2024年 9月30日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第22期 自 2022年10月 1日 至 2023年10月 2日	第23期 自 2023年10月 3日 至 2024年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	34,008,900,358円	34,553,244,307円
期中追加設定元本額	3,783,258,513円	3,187,828,498円
期中一部解約元本額	3,238,914,564円	3,904,696,980円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第22期 (2023年10月 2日現在)	第23期 (2024年 9月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,956,829,894	2,746,884,499
合計	2,956,829,894	2,746,884,499

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	4,852,936,705	13,476,119,936	
	外国株式インデックス マザーファンド	517,912,121	3,388,232,886	
	国内債券インデックス マザーファンド	29,450,299,637	38,874,395,520	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,826,642,397	6,449,326,311	
合計		36,647,790,860	62,188,074,653	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託

受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,543,468,499
株式	661,440,523,950
派生商品評価勘定	183,693,900
未収入金	241,118,189
未収配当金	6,567,605,790
未収利息	32,583
差入委託証拠金	486,911,049
流動資産合計	674,463,353,960
資産合計	674,463,353,960
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	121,006,400
前受金	62,919,600
未払金	74,790,714
未払解約金	1,256,308,173
流動負債合計	1,515,024,887
負債合計	1,515,024,887
純資産の部	
元本等	
元本	242,341,869,199
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	430,606,459,874
元本等合計	672,948,329,073
純資産合計	672,948,329,073
負債純資産合計	674,463,353,960

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 9月30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 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		242,341,869,199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)	2.7769円 (27,769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

		2024年 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2024年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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	2024年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月 3日
期首元本額	241,361,431,252円
期中追加設定元本額	35,249,374,675円
期中一部解約元本額	34,268,936,728円
期末元本額	242,341,869,199円
期末元本額の内訳	

区分	2024年 9月30日現在
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	269,464,585円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,244,950,866円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,133,051円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,497,842,670円
世界経済インデックスファンド	6,653,714,429円
日本株式インデックス・オープン	2,765,780,661円
DCマイセクション25	4,852,936,705円
DCマイセクション50	16,358,007,142円
DCマイセクション75	18,500,287,400円
DC日本株式インデックス・オープン	6,007,489,298円
DCマイセクションS25	3,067,619,975円
DCマイセクションS50	9,722,962,512円
DCマイセクションS75	9,115,700,727円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,679,890,111円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	36,841,757円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	544,670,111円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	452,585,830円
DC世界経済インデックスファンド	3,677,700,468円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	388,546,908円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,619,540円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	8,427,170円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,766,275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）	94,763,235円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,891,172円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	10,915,598円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	44,028,752円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	12,846,382円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,018,082円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	338,920,010円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	279,770,776円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,890,650,523円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,473,660円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,218,030円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	284,694,786円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	155,155,354円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	212,971,710円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	15,840,106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）	361,060,805円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,443,556,351円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,860,908,744円
コア投資戦略ファンド（安定型）	526,088,837円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,284,647,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,277,593円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	690,840,629円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	420,971,781円
コア投資戦略ファンド（切替型）	434,167,482円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,858,693円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,716,937円
SMT インデックスバランス・オープン	46,420,449円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	16,874,133,482円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	189,957,492円
SMT 世界経済インデックス・オープン	56,693,244円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	266,284,586円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	43,172,878円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,782,375円
グローバル経済コア	296,098,220円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	35,086,746円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	3,099,244,666円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	31,797,516円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	442,995,610円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	129,749,321円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	65,925,018円

区分	2024年 9月30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	69,730,044円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	31,564,734円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	40,294,206円
10資産分散投資ファンド	113,559,583円
グローバル10資産バランスファンド	48,798,340円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	1,189,444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	158,581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	34,978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	198,906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	60,994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	44,599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	22,495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	31,132円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	1,854,987円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	43,975,323,665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）	234,681,472円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	303,394,456円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	22,442,918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）	50,480,491,273円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,038,740円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	216,978,126円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	21,088,509,232	
合計	21,088,509,232	

(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

（2024年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,109,530,400	-	11,172,450,000	62,919,600
合計		11,109,530,400	-	11,172,450,000	62,919,600

(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	10,300	4,365.00	44,959,500	

ニッセイ	249,100	917.50	228,549,250
マルハニチロ	37,000	3,171.00	117,327,000
雪国まいたけ	21,200	1,001.00	21,221,200
カネコ種苗	7,000	1,390.00	9,730,000
サカタのタネ	28,300	3,530.00	99,899,000
ホクト	19,900	1,821.00	36,237,900
ホクリヨウ	900	1,008.00	907,200
住石ホールディングス	35,200	921.00	32,419,200
日鉄鉱業	10,000	4,270.00	42,700,000
三井松島ホールディングス	14,800	4,825.00	71,410,000
I N P E X	752,900	1,938.00	1,459,120,200
石油資源開発	144,500	1,042.00	150,569,000
K & O エナジーグループ	11,300	3,195.00	36,103,500
ショーボンドホールディングス	33,900	5,672.00	192,280,800
ミライト・ワン	75,200	2,124.00	159,724,800
タマホーム	15,700	4,010.00	62,957,000
サンヨーホームズ	600	719.00	431,400
日本アクア	2,700	906.00	2,446,200
ファーストコーポレーション	1,500	795.00	1,192,500
ベステラ	1,300	925.00	1,202,500
キャンディル	1,000	528.00	528,000
ダイセキ環境ソリューション	1,100	1,147.00	1,261,700
第一カッター興業	7,200	1,476.00	10,627,200
安藤・間	144,300	1,119.00	161,471,700
東急建設	78,000	706.00	55,068,000
コムシスホールディングス	79,500	3,125.00	248,437,500
ビーアールホールディングス	36,500	350.00	12,775,000
高松コンストラクショングループ	18,500	2,937.00	54,334,500
東建コーポレーション	6,300	11,300.00	71,190,000
ソネック	600	923.00	553,800
ヤマウラ	12,600	1,158.00	14,590,800
オリエンタル白石	92,200	390.00	35,958,000
大成建設	159,600	6,260.00	999,096,000
大林組	623,200	1,813.00	1,129,861,600
清水建設	494,100	983.50	485,947,350
飛島建設	18,000	1,439.00	25,902,000
長谷工コーポレーション	159,900	1,872.50	299,412,750
松井建設	16,300	771.00	12,567,300
銭高組	600	3,400.00	2,040,000
鹿島建設	386,400	2,675.50	1,033,813,200
不動テトラ	12,100	2,289.00	27,696,900
大末建設	1,500	1,604.00	2,406,000

鉄建建設	12,500	2,356.00	29,450,000
西松建設	33,200	5,087.00	168,888,400
三井住友建設	129,700	400.00	51,880,000
大豊建設	6,000	3,465.00	20,790,000
佐田建設	2,400	903.00	2,167,200
ナカノフドー建設	2,700	490.00	1,323,000
奥村組	28,300	4,340.00	122,822,000
東鉄工業	21,600	3,410.00	73,656,000
イチケン	900	2,485.00	2,236,500
富士ピー・エス	1,700	435.00	739,500
浅沼組	64,400	682.00	43,920,800
戸田建設	235,800	941.90	222,100,020
熊谷組	28,800	3,600.00	103,680,000
北野建設	700	4,020.00	2,814,000
植木組	1,100	1,574.00	1,731,400
矢作建設工業	23,700	1,534.00	36,355,800
ピーエス・コンストラクション	22,100	1,049.00	23,182,900
日本ハウスホールディングス	37,200	352.00	13,094,400
新日本建設	24,500	1,591.00	38,979,500
東亜道路工業	33,500	1,379.00	46,196,500
日本道路	20,400	1,721.00	35,108,400
東亜建設工業	52,600	980.00	51,548,000
日本国土開発	49,600	500.00	24,800,000
若築建設	6,000	3,435.00	20,610,000
東洋建設	43,900	1,334.00	58,562,600
五洋建設	247,000	639.20	157,882,400
世紀東急工業	22,400	1,533.00	34,339,200
福田組	6,600	5,380.00	35,508,000
住友林業	150,600	7,095.00	1,068,507,000
日本基礎技術	2,300	684.00	1,573,200
巴コーポレーション	4,700	882.00	4,145,400
大和ハウス工業	481,900	4,505.00	2,170,959,500
ライト工業	32,100	2,165.00	69,496,500
積水ハウス	528,500	3,974.00	2,100,259,000
日特建設	16,600	1,026.00	17,031,600
北陸電気工事	11,900	1,207.00	14,363,300
ユアテック	38,400	1,532.00	58,828,800
日本リーテック	13,600	1,090.00	14,824,000
四電工	21,900	1,270.00	27,813,000
中電工	27,000	3,355.00	90,585,000
関電工	109,100	2,226.00	242,856,600
きんでん	121,200	3,150.00	381,780,000

東京エネシス	16,300	1,105.00	18,011,500
トーエネック	29,000	930.00	26,970,000
住友電設	16,600	4,400.00	73,040,000
日本電設工業	32,700	1,919.00	62,751,300
エクシオグループ	170,300	1,555.50	264,901,650
新日本空調	11,300	3,465.00	39,154,500
九電工	37,700	6,763.00	254,965,100
三機工業	37,600	2,399.00	90,202,400
日揮ホールディングス	172,400	1,252.50	215,931,000
中外炉工業	5,700	2,613.00	14,894,100
ヤマト	3,100	971.00	3,010,100
太平電業	11,000	5,180.00	56,980,000
高砂熱学工業	46,700	5,140.00	240,038,000
三晃金属工業	500	4,005.00	2,002,500
朝日工業社	16,300	1,309.00	21,336,700
明星工業	33,700	1,196.00	40,305,200
大気社	20,100	4,895.00	98,389,500
ダイダン	22,900	2,940.00	67,326,000
日比谷総合設備	12,600	3,405.00	42,903,000
フィル・カンパニー	3,400	604.00	2,053,600
テスホールディングス	37,500	294.00	11,025,000
インフロニア・ホールディングス	200,900	1,172.50	235,555,250
東洋エンジニアリング	25,600	726.00	18,585,600
レイズネクスト	25,200	1,653.00	41,655,600
ニッポン	52,400	2,219.00	116,275,600
日清製粉グループ本社	161,800	1,818.50	294,233,300
日東富士製粉	3,100	6,980.00	21,638,000
昭和産業	16,400	2,920.00	47,888,000
鳥越製粉	3,300	680.00	2,244,000
中部飼料	24,200	1,481.00	35,840,200
フィード・ワン	25,600	888.00	22,732,800
東洋精糖	700	1,420.00	994,000
日本甜菜製糖	10,200	2,705.00	27,591,000
D M三井製糖ホールディングス	17,300	3,365.00	58,214,500
塩水港精糖	4,900	280.00	1,372,000
ウェルネオシュガー	8,700	2,199.00	19,131,300
森永製菓	73,200	2,869.50	210,047,400
中村屋	4,400	3,250.00	14,300,000
江崎グリコ	50,000	4,389.00	219,450,000
名糖産業	6,900	1,814.00	12,516,600
井村屋グループ	10,400	2,512.00	26,124,800
不二家	12,000	2,770.00	33,240,000

山崎製パン	117,100	2,845.50	333,208,050
第一屋製パン	800	631.00	504,800
モロゾフ	5,700	4,545.00	25,906,500
亀田製菓	10,000	4,475.00	44,750,000
寿スピリッツ	82,700	1,820.50	150,555,350
カルビー	80,100	3,493.00	279,789,300
森永乳業	61,100	3,513.00	214,644,300
六甲バター	12,800	1,580.00	20,224,000
ヤクルト本社	250,000	3,319.00	829,750,000
明治ホールディングス	214,500	3,590.00	770,055,000
雪印メグミルク	42,300	2,706.00	114,463,800
プリマハム	23,500	2,374.00	55,789,000
日本ハム	75,200	5,333.00	401,041,600
林兼産業	1,300	479.00	622,700
丸大食品	17,600	1,818.00	31,996,800
S Foods	19,300	2,763.00	53,325,900
柿安本店	6,800	2,665.00	18,122,000
伊藤ハム米久ホールディングス	26,700	3,865.00	103,195,500
サッポロホールディングス	57,600	7,909.00	455,558,400
アサヒグループホールディングス	1,313,700	1,878.50	2,467,785,450
キリンホールディングス	728,700	2,186.00	1,592,938,200
シマダヤ	5,700	1,880.00	10,716,000
宝ホールディングス	118,000	1,217.00	143,606,000
オエノンホールディングス	56,600	425.00	24,055,000
養命酒製造	5,800	2,386.00	13,838,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	123,300	1,994.00	245,860,200
ライフドリンク カンパニー	14,000	1,917.00	26,838,000
サントリー食品インターナショナル	123,200	5,394.00	664,540,800
ダイドーグループホールディングス	19,800	3,030.00	59,994,000
伊藤園	59,100	3,413.00	201,708,300
キーコーヒー	19,600	2,010.00	39,396,000
ユニカフェ	1,200	935.00	1,122,000
日清オイリオグループ	24,600	5,270.00	129,642,000
不二製油グループ本社	40,700	3,171.00	129,059,700
かどや製油	500	3,675.00	1,837,500
J - オイルミルズ	20,000	2,101.00	42,020,000
キッコーマン	579,700	1,628.00	943,751,600
味の素	411,200	5,546.00	2,280,515,200
ブルドックソース	9,300	1,725.00	16,042,500
キューピー	94,000	3,580.00	336,520,000
ハウス食品グループ本社	60,100	3,046.00	183,064,600
カゴメ	75,000	3,208.00	240,600,000

アリアケジャパン	17,400	5,290.00	92,046,000
ピエトロ	500	1,765.00	882,500
エバラ食品工業	4,200	2,801.00	11,764,200
やまみ	500	4,615.00	2,307,500
ニチレイ	80,200	4,467.00	358,253,400
東洋水産	88,400	9,349.00	826,451,600
イトアンドホールディングス	8,300	2,056.00	17,064,800
大冷	500	1,906.00	953,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	1,811.00	14,488,000
日清食品ホールディングス	184,500	4,007.00	739,291,500
一正蒲鉾	1,600	750.00	1,200,000
フジッコ	18,000	1,719.00	30,942,000
ロック・フィールド	21,400	1,468.00	31,415,200
日本たばこ産業	1,063,100	4,179.00	4,442,694,900
ケンコーマヨネーズ	12,000	2,236.00	26,832,000
わらべや日洋ホールディングス	11,700	2,324.00	27,190,800
なとり	11,000	2,121.00	23,331,000
イフジ産業	700	1,446.00	1,012,200
ファーマフーズ	23,200	891.00	20,671,200
ユーグレナ	108,700	448.00	48,697,600
紀文食品	15,200	1,156.00	17,571,200
ピクルスホールディングス	10,300	1,032.00	10,629,600
ミヨシ油脂	1,500	1,606.00	2,409,000
理研ビタミン	15,100	2,582.00	38,988,200
片倉工業	16,600	2,061.00	34,212,600
ゲンゼ	12,700	5,630.00	71,501,000
東洋紡	77,300	991.00	76,604,300
ユニチカ	58,900	312.00	18,376,800
富士紡ホールディングス	7,900	4,545.00	35,905,500
倉敷紡績	12,700	4,850.00	61,595,000
シキボウ	12,800	1,066.00	13,644,800
日本毛織	45,900	1,321.00	60,633,900
トーア紡コーポレーション	1,600	397.00	635,200
帝国繊維	20,300	3,075.00	62,422,500
帝人	171,300	1,416.00	242,560,800
東レ	1,192,900	843.20	1,005,853,280
住江織物	800	2,053.00	1,642,400
日本フェルト	2,900	486.00	1,409,400
イチカワ	700	1,650.00	1,155,000
日東製網	400	1,418.00	567,200
アツギ	2,700	764.00	2,062,800
ダイニック	1,200	753.00	903,600

セーレン	34,500	2,702.00	93,219,000
ソトー	1,300	692.00	899,600
東海染工	400	693.00	277,200
小松マテーレ	25,900	765.00	19,813,500
ワコールホールディングス	33,200	4,481.00	148,769,200
ホギメディカル	23,400	4,665.00	109,161,000
T S Iホールディングス	53,400	877.00	46,831,800
マツオカコーポレーション	1,200	1,790.00	2,148,000
ワールド	25,200	1,918.00	48,333,600
三陽商会	8,400	2,380.00	19,992,000
ナイガイ	1,500	234.00	351,000
オンワードホールディングス	105,000	527.00	55,335,000
ルックホールディングス	5,700	2,595.00	14,791,500
ゴールドウイン	31,500	8,278.00	260,757,000
デサント	30,700	4,345.00	133,391,500
キング	1,500	762.00	1,143,000
ヤマトインターナショナル	3,100	320.00	992,000
特種東海製紙	9,500	3,710.00	35,245,000
王子ホールディングス	741,400	574.00	425,563,600
日本製紙	100,400	980.00	98,392,000
三菱製紙	5,200	533.00	2,771,600
北越コーポレーション	87,500	1,568.00	137,200,000
中越パルプ工業	1,500	1,273.00	1,909,500
大王製紙	78,600	906.20	71,227,320
阿波製紙	1,000	446.00	446,000
レンゴー	162,100	998.90	161,921,690
トーモク	10,300	2,355.00	24,256,500
ザ・パック	13,200	3,675.00	48,510,000
北の達人コーポレーション	75,000	166.00	12,450,000
クラレ	259,400	2,119.50	549,798,300
旭化成	1,204,000	1,082.00	1,302,728,000
共和レザー	2,200	654.00	1,438,800
巴川コーポレーション	1,100	743.00	817,300
レゾナック・ホールディングス	159,700	3,680.00	587,696,000
住友化学	1,320,600	407.50	538,144,500
住友精化	8,400	5,150.00	43,260,000
日産化学	83,000	5,126.00	425,458,000
ラサ工業	6,900	2,680.00	18,492,000
クレハ	36,800	2,843.00	104,622,400
多木化学	6,900	3,825.00	26,392,500
テイカ	14,600	1,647.00	24,046,200
石原産業	29,500	1,507.00	44,456,500

片倉コープアグリ	900	981.00	882,900
日本曹達	41,600	2,494.00	103,750,400
東ソー	237,600	1,913.00	454,528,800
トクヤマ	57,500	2,883.50	165,801,250
セントラル硝子	19,000	3,400.00	64,600,000
東亜合成	85,600	1,615.50	138,286,800
大阪ソーダ	62,000	1,919.00	118,978,000
関東電化工業	34,400	948.00	32,611,200
デンカ	64,700	2,252.50	145,736,750
信越化学工業	1,596,000	5,977.00	9,539,292,000
日本カーバイド工業	9,400	1,705.00	16,027,000
堺化学工業	13,600	2,561.00	34,829,600
第一稀元素化学工業	19,500	826.00	16,107,000
エア・ウォーター	167,900	2,011.50	337,730,850
日本酸素ホールディングス	172,700	5,213.00	900,285,100
日本化学工業	6,500	2,865.00	18,622,500
東邦アセチレン	4,000	344.00	1,376,000
日本パーカライズニング	79,300	1,241.00	98,411,300
高压ガス工業	25,800	867.00	22,368,600
チタン工業	500	904.00	452,000
四国化成ホールディングス	20,100	2,057.00	41,345,700
戸田工業	4,100	1,769.00	7,252,900
ステラ ケミファ	9,700	4,125.00	40,012,500
保土谷化学工業	5,600	4,560.00	25,536,000
日本触媒	103,600	1,734.00	179,642,400
大日精化工業	12,400	3,005.00	37,262,000
カネカ	43,900	3,902.00	171,297,800
三菱瓦斯化学	129,900	2,769.50	359,758,050
三井化学	146,800	3,805.00	558,574,000
東京応化工業	84,900	3,489.00	296,216,100
大阪有機化学工業	14,900	3,125.00	46,562,500
三菱ケミカルグループ	1,301,100	918.90	1,195,580,790
KHネオケム	32,100	2,100.00	67,410,000
ダイセル	220,800	1,332.50	294,216,000
住友ベークライト	49,800	4,017.00	200,046,600
積水化学工業	354,400	2,231.50	790,843,600
日本ゼオン	122,000	1,359.50	165,859,000
アイカ工業	44,900	3,397.00	152,525,300
UBE	84,700	2,669.50	226,106,650
積水樹脂	26,600	2,309.00	61,419,400
旭有機材	11,800	4,070.00	48,026,000
ニチバン	9,600	1,910.00	18,336,000

リケンテクノス	33,400	1,035.00	34,569,000
大倉工業	8,200	2,677.00	21,951,400
積水化成成品工業	25,000	392.00	9,800,000
群栄化学工業	4,200	2,704.00	11,356,800
タイガースポリマー	1,700	736.00	1,251,200
ミライアル	1,300	1,463.00	1,901,900
ダイキアクシス	1,600	742.00	1,187,200
ダイキョーニシカワ	39,300	639.00	25,112,700
竹本容器	1,400	846.00	1,184,400
森六ホールディングス	9,200	2,223.00	20,451,600
恵和	11,500	1,080.00	12,420,000
日本化薬	135,900	1,249.00	169,739,100
カーリット	19,200	1,183.00	22,713,600
日本精化	11,800	2,305.00	27,199,000
扶桑化学工業	18,900	3,980.00	75,222,000
トリケミカル研究所	21,600	3,485.00	75,276,000
A D E K A	62,100	2,916.50	181,114,650
日油	161,100	2,460.00	396,306,000
新日本理化	5,300	192.00	1,017,600
ハリマ化成グループ	13,900	843.00	11,717,700
花王	433,400	7,109.00	3,081,040,600
第一工業製薬	7,100	3,220.00	22,862,000
石原ケミカル	8,000	2,472.00	19,776,000
日華化学	1,500	1,222.00	1,833,000
ニイタカ	800	1,917.00	1,533,600
三洋化成工業	10,900	4,145.00	45,180,500
有機合成薬品工業	3,100	267.00	827,700
大日本塗料	19,700	1,090.00	21,473,000
日本ペイントホールディングス	787,500	1,097.50	864,281,250
関西ペイント	153,800	2,552.00	392,497,600
神東塗料	3,200	133.00	425,600
中国塗料	36,500	2,038.00	74,387,000
日本特殊塗料	2,700	1,174.00	3,169,800
藤倉化成	20,500	466.00	9,553,000
太陽ホールディングス	31,000	3,700.00	114,700,000
D I C	63,200	3,243.00	204,957,600
サカタインクス	39,600	1,611.00	63,795,600
a r t i e n c e	31,900	3,870.00	123,453,000
富士フイルムホールディングス	991,700	3,688.00	3,657,389,600
資生堂	372,100	3,875.00	1,441,887,500
ライオン	226,800	1,615.00	366,282,000
高砂香料工業	13,400	5,510.00	73,834,000

マンダム	38,500	1,239.00	47,701,500
ミルボン	28,600	3,168.00	90,604,800
コーセー	36,200	9,284.00	336,080,800
コタ	18,100	1,649.00	29,846,900
シーボン	500	1,282.00	641,000
ポーラ・オルビスホールディングス	91,300	1,479.00	135,032,700
ノエビアホールディングス	15,900	5,170.00	82,203,000
アジュバンホールディングス	900	822.00	739,800
新日本製薬	10,200	1,710.00	17,442,000
I - n e	5,900	1,819.00	10,732,100
アクシージア	11,700	638.00	7,464,600
エステー	13,800	1,478.00	20,396,400
アグロ カネショウ	6,200	1,278.00	7,923,600
コニシ	51,500	1,208.00	62,212,000
長谷川香料	34,100	3,275.00	111,677,500
小林製薬	46,700	5,703.00	266,330,100
荒川化学工業	15,100	1,224.00	18,482,400
メック	14,700	3,680.00	54,096,000
日本高純度化学	4,000	3,155.00	12,620,000
タカラバイオ	48,000	1,006.00	48,288,000
J C U	19,700	3,485.00	68,654,500
新田ゼラチン	2,600	871.00	2,264,600
O A T アグリオ	7,400	2,074.00	15,347,600
デクセリアルズ	132,000	2,025.50	267,366,000
アース製薬	16,200	5,330.00	86,346,000
北興化学工業	15,900	1,320.00	20,988,000
大成ラミック	5,200	2,632.00	13,686,400
クミアイ化学工業	70,800	842.00	59,613,600
日本農薬	32,700	605.00	19,783,500
アキレス	11,200	1,485.00	16,632,000
有沢製作所	31,200	1,422.00	44,366,400
日東電工	563,500	2,388.50	1,345,919,750
レック	22,800	1,312.00	29,913,600
三光合成	22,400	569.00	12,745,600
きもと	6,300	233.00	1,467,900
藤森工業	14,100	4,405.00	62,110,500
前澤化成工業	11,500	1,768.00	20,332,000
未来工業	6,400	3,515.00	22,496,000
ウェーブロックホールディングス	1,400	610.00	854,000
J S P	12,500	1,938.00	24,225,000
エフピコ	33,700	2,863.50	96,499,950
天馬	11,900	2,604.00	30,987,600

信越ポリマー	38,400	1,550.00	59,520,000
東リ	8,500	382.00	3,247,000
ニフコ	53,300	3,636.00	193,798,800
バルカー	14,900	3,295.00	49,095,500
ユニ・チャーム	371,200	5,183.00	1,923,929,600
ショーエイコーポレーション	1,200	575.00	690,000
協和キリン	215,300	2,527.00	544,063,100
武田薬品工業	1,577,100	4,103.00	6,470,841,300
アステラス製薬	1,563,100	1,647.00	2,574,425,700
住友ファーマ	132,200	596.00	78,791,200
塩野義製薬	650,100	2,053.50	1,334,980,350
わかもと製薬	4,000	265.00	1,060,000
日本新薬	46,700	3,726.00	174,004,200
中外製薬	557,800	6,932.00	3,866,669,600
科研製薬	30,500	3,823.00	116,601,500
エーザイ	216,700	5,345.00	1,158,261,500
ロート製薬	172,600	3,572.00	616,527,200
小野薬品工業	364,500	1,911.50	696,741,750
久光製薬	39,600	3,863.00	152,974,800
持田製薬	19,900	3,355.00	66,764,500
参天製薬	314,400	1,734.50	545,326,800
扶桑薬品工業	6,300	2,247.00	14,156,100
日本ケミファ	400	1,579.00	631,600
ツムラ	56,100	4,512.00	253,123,200
キッセイ薬品工業	29,500	3,545.00	104,577,500
生化学工業	30,200	850.00	25,670,000
栄研化学	30,700	2,324.00	71,346,800
鳥居薬品	9,600	3,875.00	37,200,000
JCRファーマ	60,300	657.00	39,617,100
東和薬品	27,400	3,010.00	82,474,000
富士製薬工業	13,200	1,273.00	16,803,600
ゼリア新薬工業	24,700	2,270.00	56,069,000
ネクセラファーマ	83,600	1,232.00	102,995,200
第一三共	1,552,400	4,709.00	7,310,251,600
杏林製薬	38,600	1,520.00	58,672,000
大幸薬品	40,400	392.00	15,836,800
ダイト	13,500	2,249.00	30,361,500
大塚ホールディングス	444,800	8,083.00	3,595,318,400
ペプチドリーム	86,400	2,661.00	229,910,400
セルソース	11,800	1,250.00	14,750,000
あすか製薬ホールディングス	18,300	2,218.00	40,589,400
サワイグループホールディングス	122,400	2,037.50	249,390,000

日本コークス工業	180,800	99.00	17,899,200
ニチレキ	23,200	2,502.00	58,046,400
ユシロ化学工業	9,200	1,562.00	14,370,400
ビーピー・カストロール	1,800	880.00	1,584,000
富士石油	51,900	353.00	18,320,700
MORESCO	1,400	1,218.00	1,705,200
出光興産	925,300	1,028.00	951,208,400
ENEOSホールディングス	2,821,100	778.70	2,196,790,570
コスモエネルギーホールディングス	52,800	7,814.00	412,579,200
横浜ゴム	90,100	3,212.00	289,401,200
TOYO TIRE	102,400	2,087.00	213,708,800
ブリヂストン	521,600	5,500.00	2,868,800,000
住友ゴム工業	174,800	1,567.50	273,999,000
藤倉コンポジット	17,100	1,185.00	20,263,500
オカモト	8,300	5,230.00	43,409,000
フコク	9,400	1,765.00	16,591,000
ニッタ	18,100	3,690.00	66,789,000
住友理工	27,700	1,457.00	40,358,900
三ツ星ベルト	20,700	3,975.00	82,282,500
バンドー化学	26,400	1,769.00	46,701,600
日東紡績	22,600	5,890.00	133,114,000
AGC	173,400	4,647.00	805,789,800
日本板硝子	85,000	373.00	31,705,000
石塚硝子	700	2,380.00	1,666,000
日本山村硝子	1,400	1,515.00	2,121,000
日本電気硝子	66,100	3,362.00	222,228,200
オハラ	8,500	1,437.00	12,214,500
住友大阪セメント	29,700	4,086.00	121,354,200
太平洋セメント	102,100	3,369.00	343,974,900
日本ヒューム	15,600	1,332.00	20,779,200
日本コンクリート工業	34,600	341.00	11,798,600
三谷セキサン	7,500	5,680.00	42,600,000
アジアパイルホールディングス	25,300	829.00	20,973,700
東海カーボン	164,400	921.00	151,412,400
日本カーボン	10,200	4,515.00	46,053,000
東洋炭素	12,600	5,690.00	71,694,000
ノリタケ	19,700	3,905.00	76,928,500
TOTO	117,600	5,337.00	627,631,200
日本碍子	207,300	1,871.00	387,858,300
日本特殊陶業	145,600	3,995.00	581,672,000
MARUWA	6,600	41,950.00	276,870,000
品川リフラクトリーズ	21,900	1,699.00	37,208,100

黒崎播磨	14,500	2,227.00	32,291,500
ヨータイ	10,400	1,699.00	17,669,600
東京窯業	4,100	403.00	1,652,300
ニッカトー	1,700	544.00	924,800
フジインコーポレーテッド	47,900	2,370.00	113,523,000
クミネ工業	1,100	1,070.00	1,177,000
エーアンドエーマテリアル	800	1,177.00	941,600
ニチアス	45,100	5,690.00	256,619,000
ニチハ	22,300	3,475.00	77,492,500
日本製鉄	869,300	3,198.00	2,780,021,400
神戸製鋼所	368,700	1,711.50	631,030,050
中山製鋼所	41,900	776.00	32,514,400
合同製鐵	10,300	4,125.00	42,487,500
J F E ホールディングス	509,800	1,918.50	978,051,300
東京製鐵	51,500	1,984.00	102,176,000
共英製鋼	20,900	1,730.00	36,157,000
大和工業	34,600	7,157.00	247,632,200
東京鐵鋼	8,100	5,150.00	41,715,000
大阪製鐵	8,400	3,425.00	28,770,000
淀川製鋼所	19,000	5,590.00	106,210,000
中部鋼鈹	12,000	2,511.00	30,132,000
丸一鋼管	55,800	3,363.00	187,655,400
モリ工業	4,600	5,180.00	23,828,000
大同特殊鋼	115,500	1,404.50	162,219,750
日本高周波鋼業	1,600	391.00	625,600
日本冶金工業	13,400	4,530.00	60,702,000
山陽特殊製鋼	18,100	1,914.00	34,643,400
愛知製鋼	10,600	3,925.00	41,605,000
日本金属	1,000	677.00	677,000
大平洋金属	15,600	1,378.00	21,496,800
新日本電工	109,500	306.00	33,507,000
栗本鐵工所	8,500	4,095.00	34,807,500
虹技	500	1,068.00	534,000
三菱製鋼	13,600	1,356.00	18,441,600
日亜鋼業	4,100	302.00	1,238,200
日本精線	14,600	1,229.00	17,943,400
エンビプロ・ホールディングス	18,100	498.00	9,013,800
シンニッタン	5,000	212.00	1,060,000
新家工業	900	4,760.00	4,284,000
大紀アルミニウム工業所	23,700	1,080.00	25,596,000
日本輕金属ホールディングス	53,900	1,628.00	87,749,200
三井金属鋳業	53,500	4,880.00	261,080,000

三菱マテリアル	131,300	2,575.00	338,097,500
住友金属鉱山	212,700	4,291.00	912,695,700
DOWAホールディングス	45,400	5,255.00	238,577,000
古河機械金属	24,500	1,614.00	39,543,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	32,000	2,484.00	79,488,000
東邦チタニウム	38,400	1,132.00	43,468,800
UACJ	25,800	5,120.00	132,096,000
CKサンエツ	4,600	3,450.00	15,870,000
古河電気工業	61,200	3,608.00	220,809,600
住友電気工業	686,000	2,295.50	1,574,713,000
フジクラ	216,400	4,818.00	1,042,615,200
SWCC	20,600	5,730.00	118,038,000
カナレ電気	1,000	1,451.00	1,451,000
平河ビューテック	12,100	1,485.00	17,968,500
リョービ	19,800	1,947.00	38,550,600
アーレスティ	4,900	573.00	2,807,700
AREホールディングス	69,100	1,815.00	125,416,500
稲葉製作所	10,200	1,737.00	17,717,400
宮地エンジニアリンググループ	18,400	2,079.00	38,253,600
トーカロ	52,900	1,916.00	101,356,400
アルファCO	1,400	1,183.00	1,656,200
SUMCO	349,000	1,542.00	538,158,000
川田テクノロジーズ	13,000	2,541.00	33,033,000
RS Technologies	14,000	3,600.00	50,400,000
ジェイテックコーポレーション	700	1,640.00	1,148,000
信和	2,500	744.00	1,860,000
東洋製罐グループホールディングス	105,200	2,251.00	236,805,200
ホッカンホールディングス	8,900	1,723.00	15,334,700
コロナ	10,200	936.00	9,547,200
横河ブリッジホールディングス	28,700	2,659.00	76,313,300
駒井ハルテック	700	1,672.00	1,170,400
高田機工	900	1,158.00	1,042,200
三和ホールディングス	182,600	3,775.00	689,315,000
文化シャッター	48,000	1,805.00	86,640,000
三協立山	23,100	747.00	17,255,700
アルインコ	14,000	979.00	13,706,000
東洋シャッター	900	795.00	715,500
LIXIL	286,300	1,713.50	490,575,050
日本フィルコン	2,600	525.00	1,365,000
ノーリツ	25,800	1,822.00	47,007,600
長府製作所	20,500	1,967.00	40,323,500
リンナイ	87,700	3,531.00	309,668,700

ダイニチ工業	2,000	632.00	1,264,000	
日東精工	26,600	569.00	15,135,400	
三洋工業	500	3,025.00	1,512,500	
岡部	32,700	792.00	25,898,400	
ジーテクト	23,400	1,570.00	36,738,000	
東プレ	32,300	1,789.00	57,784,700	
高周波熱錬	27,100	987.00	26,747,700	
東京製綱	11,900	1,084.00	12,899,600	
サンコール	20,400	381.00	7,772,400	
モリテック スチール	3,500	186.00	651,000	
パイオラックス	22,200	2,337.00	51,881,400	
エイチワン	18,900	936.00	17,690,400	
日本発條	162,200	1,818.00	294,879,600	
中央発條	13,600	1,168.00	15,884,800	
アドバネクス	500	895.00	447,500	
立川ブラインド工業	8,300	1,290.00	10,707,000	
日本ドライケミカル	900	3,405.00	3,064,500	
日本製鋼所	49,400	5,024.00	248,185,600	
三浦工業	74,900	3,512.00	263,048,800	
タクマ	60,700	1,603.00	97,302,100	
ツガミ	38,300	1,482.00	56,760,600	
オークマ	31,400	3,063.00	96,178,200	
芝浦機械	16,900	3,950.00	66,755,000	
アマダ	272,000	1,457.50	396,440,000	
アイダエンジニアリング	41,500	767.00	31,830,500	
F U J I	84,500	2,281.00	192,744,500	
牧野フライス製作所	19,900	5,870.00	116,813,000	
オーエスジー	79,100	2,024.50	160,137,950	
ダイジェット工業	400	760.00	304,000	
旭ダイヤモンド工業	41,400	860.00	35,604,000	
D M G 森精機	113,200	3,016.00	341,411,200	
ソディック	47,400	798.00	37,825,200	
ディスコ	86,400	37,490.00	3,239,136,000	
日東工器	8,300	2,459.00	20,409,700	
日進工具	16,700	751.00	12,541,700	
パンチ工業	3,900	419.00	1,634,100	
富士ダイス	13,300	776.00	10,320,800	
豊和工業	2,100	870.00	1,827,000	
リケンNPR	19,500	2,296.00	44,772,000	
東洋機械金属	3,200	628.00	2,009,600	
エンシュウ	1,000	622.00	622,000	
島精機製作所	28,600	1,140.00	32,604,000	

オプトラン	29,500	1,778.00	52,451,000
イワキポンプ	12,000	2,882.00	34,584,000
フリュー	16,900	1,057.00	17,863,300
ヤマシンフィルタ	42,700	513.00	21,905,100
日阪製作所	19,600	1,051.00	20,599,600
やまびこ	29,300	2,541.00	74,451,300
野村マイクロ・サイエンス	24,300	2,426.00	58,951,800
平田機工	8,600	4,870.00	41,882,000
P E G A S U S	19,800	493.00	9,761,400
マルマエ	7,800	1,546.00	12,058,800
タツモ	12,800	2,935.00	37,568,000
ナプテスコ	112,600	2,469.00	278,009,400
三井海洋開発	22,700	3,385.00	76,839,500
レオン自動機	20,800	1,356.00	28,204,800
S M C	53,700	63,650.00	3,418,005,000
ホソカワミクロン	12,500	4,100.00	51,250,000
ユニオンツール	7,900	6,150.00	48,585,000
瑞光	12,900	1,248.00	16,099,200
オイレス工業	24,300	2,036.00	49,474,800
日精エー・エス・ビー機械	6,100	4,780.00	29,158,000
サトーホールディングス	24,600	2,095.00	51,537,000
技研製作所	16,900	1,812.00	30,622,800
日本エアーテック	8,400	1,169.00	9,819,600
カワタ	1,200	831.00	997,200
日精樹脂工業	13,400	921.00	12,341,400
オカダアイヨン	1,300	2,087.00	2,713,100
ワイエイシイホールディングス	8,400	2,171.00	18,236,400
小松製作所	841,100	3,966.00	3,335,802,600
住友重機械工業	106,200	3,440.00	365,328,000
日立建機	71,500	3,471.00	248,176,500
日工	26,600	689.00	18,327,400
巴工業	7,000	4,305.00	30,135,000
井関農機	16,800	995.00	16,716,000
T O W A	60,000	2,197.00	131,820,000
丸山製作所	700	2,410.00	1,687,000
北川鉄工所	7,100	1,210.00	8,591,000
ローツェ	93,800	1,970.00	184,786,000
タカキタ	1,300	430.00	559,000
クボタ	938,200	2,031.00	1,905,484,200
荏原実業	8,600	4,070.00	35,002,000
三菱化工機	6,300	3,535.00	22,270,500
月島ホールディングス	24,300	1,287.00	31,274,100

帝国電機製作所	12,300	2,713.00	33,369,900
新東工業	36,300	964.00	34,993,200
澁谷工業	16,800	3,800.00	63,840,000
アイチ コーポレーション	24,800	1,174.00	29,115,200
小森コーポレーション	44,200	1,126.00	49,769,200
鶴見製作所	13,700	4,040.00	55,348,000
日本ギア工業	1,500	468.00	702,000
酒井重工業	7,000	2,420.00	16,940,000
荏原製作所	368,400	2,327.50	857,451,000
西島製作所	15,500	2,720.00	42,160,000
北越工業	18,100	1,866.00	33,774,600
ダイキン工業	214,200	20,075.00	4,300,065,000
オルガノ	21,600	7,000.00	151,200,000
トーヨーカネツ	6,100	4,005.00	24,430,500
栗田工業	100,400	6,166.00	619,066,400
椿本チエイン	73,800	1,879.00	138,670,200
大同工業	1,700	845.00	1,436,500
木村化工機	13,700	706.00	9,672,200
アネスト岩田	27,800	1,331.00	37,001,800
ダイフク	302,900	2,761.50	836,458,350
サムコ	4,300	3,355.00	14,426,500
加藤製作所	2,000	1,180.00	2,360,000
油研工業	700	2,175.00	1,522,500
タダノ	103,300	955.40	98,692,820
フジテック	41,900	4,966.00	208,075,400
C K D	49,600	2,945.00	146,072,000
平和	53,100	2,122.00	112,678,200
理想科学工業	14,400	3,415.00	49,176,000
S A N K Y O	172,800	2,106.00	363,916,800
日本金銭機械	21,700	917.00	19,898,900
マースグループホールディングス	9,100	3,295.00	29,984,500
フクシマガリレイ	11,700	5,470.00	63,999,000
オーイズミ	1,500	359.00	538,500
ダイコク電機	8,800	3,330.00	29,304,000
竹内製作所	32,600	4,420.00	144,092,000
アマノ	50,900	4,306.00	219,175,400
J U K I	27,900	400.00	11,160,000
ジャノメ	18,200	826.00	15,033,200
マックス	25,300	3,600.00	91,080,000
グローリー	43,100	2,558.00	110,249,800
新晃工業	18,100	4,690.00	84,889,000
大和冷機工業	27,500	1,468.00	40,370,000

セガサミーホールディングス	160,300	2,860.00	458,458,000
T P R	22,800	2,199.00	50,137,200
ツバキ・ナカシマ	44,300	703.00	31,142,900
ホシザキ	115,500	4,984.00	575,652,000
大豊工業	15,500	612.00	9,486,000
日本精工	332,200	720.90	239,482,980
N T N	389,300	256.30	99,777,590
ジェイテクト	159,700	1,021.50	163,133,550
不二越	13,300	3,115.00	41,429,500
日本トムソン	48,900	471.00	23,031,900
T H K	103,500	2,514.00	260,199,000
ユーシン精機	14,200	646.00	9,173,200
前澤給装工業	12,900	1,270.00	16,383,000
イーグル工業	19,800	2,047.00	40,530,600
前澤工業	2,400	1,265.00	3,036,000
P I L L A R	16,600	4,150.00	68,890,000
キッツ	60,100	1,041.00	62,564,100
マキタ	204,700	4,841.00	990,952,700
三井E & S	89,100	1,131.00	100,772,100
日立造船	158,400	991.00	156,974,400
三菱重工業	3,138,200	2,117.50	6,645,138,500
I H I	133,600	7,443.00	994,384,800
スター精密	30,300	1,923.00	58,266,900
日清紡ホールディングス	134,900	958.80	129,342,120
イビデン	93,600	4,425.00	414,180,000
コニカミノルタ	401,300	413.20	165,817,160
ブラザー工業	239,800	2,780.00	666,644,000
ミネベアミツミ	312,200	2,818.00	879,779,600
日立製作所	4,312,300	3,781.00	16,304,806,300
三菱電機	1,965,700	2,303.50	4,527,989,950
富士電機	109,100	8,620.00	940,442,000
東洋電機製造	1,400	1,153.00	1,614,200
安川電機	194,900	4,998.00	974,110,200
シンフォニアテクノロジー	19,800	5,050.00	99,990,000
明電舎	33,300	3,345.00	111,388,500
オリジン	900	1,194.00	1,074,600
山洋電気	7,800	9,630.00	75,114,000
デンヨー	13,700	2,574.00	35,263,800
P H C ホールディングス	33,800	1,054.00	35,625,200
K O K U S A I E L E C T R I C	93,900	3,180.00	298,602,000
ソシオネクスト	131,000	2,836.00	371,516,000
東芝テック	23,000	3,470.00	79,810,000

芝浦メカトロニクス	10,200	7,840.00	79,968,000
マブチモーター	78,900	2,224.00	175,473,600
ニデック	792,400	3,006.00	2,381,954,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,900	383.00	4,557,700
トレックス・セミコンダクター	9,400	1,551.00	14,579,400
東光高岳	10,900	1,798.00	19,598,200
ダブル・スコープ	51,400	363.00	18,658,200
ダイヘン	17,000	6,520.00	110,840,000
ヤーマン	35,200	850.00	29,920,000
JVCケンウッド	141,800	1,345.00	190,721,000
ミマキエンジニアリング	17,200	1,365.00	23,478,000
IPEX	10,100	1,569.00	15,846,900
大崎電気工業	38,500	738.00	28,413,000
オムロン	137,000	6,547.00	896,939,000
日東工業	24,200	3,010.00	72,842,000
IDEC	26,500	2,551.00	67,601,500
正興電機製作所	1,400	1,289.00	1,804,600
不二電機工業	900	1,065.00	958,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	70,100	2,847.50	199,609,750
サクサ	900	2,351.00	2,115,900
メルコホールディングス	5,700	2,292.00	13,064,400
テクノメディカ	4,500	1,831.00	8,239,500
日本電気	235,700	13,750.00	3,240,875,000
富士通	1,651,300	2,935.50	4,847,391,150
沖電気工業	81,100	974.00	78,991,400
電気興業	7,200	1,930.00	13,896,000
サンケン電気	16,700	6,706.00	111,990,200
ナカヨ	600	1,166.00	699,600
アイホン	9,700	2,818.00	27,334,600
ルネサスエレクトロニクス	1,367,300	2,079.00	2,842,616,700
セイコーエプソン	230,200	2,639.50	607,612,900
ワコム	126,500	683.00	86,399,500
アルバック	39,400	7,619.00	300,188,600
アクセル	9,100	1,328.00	12,084,800
EIZO	26,200	2,177.00	57,037,400
日本信号	40,900	956.00	39,100,400
京三製作所	37,600	504.00	18,950,400
能美防災	24,300	2,916.00	70,858,800
ホーチキ	13,500	2,121.00	28,633,500
星和電機	2,000	542.00	1,084,000
エレコム	43,100	1,451.00	62,538,100
パナソニック ホールディングス	2,120,000	1,243.00	2,635,160,000

シャープ	302,500	949.80	287,314,500
アンリツ	126,400	1,087.00	137,396,800
富士通ゼネラル	50,900	2,110.00	107,399,000
ソニーグループ	6,221,000	2,777.50	17,278,827,500
T D K	1,421,000	1,823.00	2,590,483,000
帝国通信工業	8,000	2,379.00	19,032,000
タムラ製作所	71,500	609.00	43,543,500
アルプスアルパイン	160,400	1,544.00	247,657,600
池上通信機	1,200	677.00	812,400
日本電波工業	21,700	1,073.00	23,284,100
鈴木	9,700	1,635.00	15,859,500
メイコー	17,900	6,170.00	110,443,000
日本トリム	4,100	3,600.00	14,760,000
フォスター電機	13,300	1,814.00	24,126,200
S M K	4,800	2,290.00	10,992,000
ヨコオ	16,000	1,490.00	23,840,000
ホシデン	40,900	2,090.00	85,481,000
ヒロセ電機	26,100	18,210.00	475,281,000
日本航空電子工業	42,900	2,543.00	109,094,700
T O A	20,400	972.00	19,828,800
マクセル	39,800	1,839.00	73,192,200
古野電気	23,500	1,620.00	38,070,000
スミダコーポレーション	24,400	916.00	22,350,400
アイコム	6,900	2,796.00	19,292,400
リオン	7,500	2,123.00	15,922,500
横河電機	196,300	3,655.00	717,476,500
新電元工業	6,900	2,345.00	16,180,500
アズビル	488,800	1,160.50	567,252,400
東亜ディーケーケー	2,000	829.00	1,658,000
日本光電工業	152,100	2,127.00	323,516,700
チノー	7,400	2,290.00	16,946,000
共和電業	3,900	421.00	1,641,900
日本電子材料	10,900	2,499.00	27,239,100
堀場製作所	33,700	9,344.00	314,892,800
アドバンテスト	509,000	6,741.00	3,431,169,000
小野測器	2,100	581.00	1,220,100
エスベック	14,300	2,566.00	36,693,800
キーエンス	177,800	68,360.00	12,154,408,000
日置電機	9,300	8,220.00	76,446,000
シスメックス	460,100	2,827.00	1,300,702,700
日本マイクロニクス	29,300	3,935.00	115,295,500
メガチップス	13,800	5,200.00	71,760,000

OBARA GROUP	11,200	4,040.00	45,248,000
澤藤電機	600	1,080.00	648,000
原田工業	2,000	549.00	1,098,000
コーセル	19,200	1,173.00	22,521,600
イリソ電子工業	16,400	2,551.00	41,836,400
オブテックスグループ	32,700	1,551.00	50,717,700
千代田インテグレ	6,200	3,375.00	20,925,000
レーザーテック	81,500	23,605.00	1,923,807,500
スタンレー電気	113,800	2,663.50	303,106,300
ウシオ電機	78,700	2,030.00	159,761,000
岡谷電機産業	3,700	235.00	869,500
ヘリオス テクノ ホールディング	4,100	941.00	3,858,100
エノモト	1,200	1,385.00	1,662,000
日本セラミック	16,400	2,529.00	41,475,600
遠藤照明	1,800	1,328.00	2,390,400
古河電池	13,200	1,377.00	18,176,400
山一電機	16,100	2,514.00	40,475,400
図研	14,900	3,590.00	53,491,000
日本電子	44,600	5,559.00	247,931,400
カシオ計算機	128,400	1,188.50	152,603,400
ファナック	859,800	4,190.00	3,602,562,000
日本シイエムケイ	42,300	407.00	17,216,100
エンプラス	5,200	6,500.00	33,800,000
大真空	26,900	593.00	15,951,700
ローム	322,100	1,606.00	517,292,600
浜松ホトニクス	285,400	1,875.50	535,267,700
三井ハイテック	78,900	900.60	71,057,340
新光電気工業	62,900	5,489.00	345,258,100
京セラ	1,104,100	1,660.00	1,832,806,000
太陽誘電	86,600	2,915.50	252,482,300
村田製作所	1,587,200	2,806.50	4,454,476,800
双葉電子工業	34,300	498.00	17,081,400
北陸電気工業	1,600	1,323.00	2,116,800
ニチコン	46,900	952.00	44,648,800
日本ケミコン	19,100	1,045.00	19,959,500
K O A	27,100	1,133.00	30,704,300
市光工業	32,600	447.00	14,572,200
小糸製作所	184,200	1,975.00	363,795,000
ミツバ	33,300	898.00	29,903,400
S C R E E Nホールディングス	60,700	9,973.00	605,361,100
キヤノン電子	16,900	2,291.00	38,717,900
キヤノン	886,200	4,703.00	4,167,798,600

リコー	445,500	1,542.50	687,183,750
象印マホービン	53,200	1,653.00	87,939,600
MUTOHホールディングス	600	2,378.00	1,426,800
東京エレクトロン	376,000	25,290.00	9,509,040,000
イノテック	12,000	1,406.00	16,872,000
トヨタ紡織	74,800	1,868.00	139,726,400
芦森工業	800	2,272.00	1,817,600
ユニプレス	31,900	1,117.00	35,632,300
豊田自動織機	151,500	11,025.00	1,670,287,500
モリタホールディングス	31,200	2,203.00	68,733,600
三櫻工業	27,200	738.00	20,073,600
デンソー	1,465,900	2,125.50	3,115,770,450
東海理化電機製作所	50,100	1,960.00	98,196,000
川崎重工業	145,000	5,805.00	841,725,000
名村造船所	55,300	1,395.00	77,143,500
日本車輛製造	5,900	2,153.00	12,702,700
三菱ロジスネクスト	28,400	1,299.00	36,891,600
近畿車輛	500	1,439.00	719,500
日産自動車	2,337,800	402.50	940,964,500
いすゞ自動車	498,900	1,931.00	963,375,900
トヨタ自動車	9,445,100	2,542.50	24,014,166,750
日野自動車	267,200	463.10	123,740,320
三菱自動車工業	693,100	384.50	266,496,950
エフテック	2,700	514.00	1,387,800
レシップホールディングス	1,800	558.00	1,004,400
GMB	800	1,165.00	932,000
ファルテック	800	462.00	369,600
武蔵精密工業	43,400	1,954.00	84,803,600
日産車体	18,000	1,039.00	18,702,000
新明和工業	51,200	1,324.00	67,788,800
極東開発工業	29,300	2,524.00	73,953,200
トピー工業	14,400	1,975.00	28,440,000
ティラド	3,900	3,410.00	13,299,000
曙ブレーキ工業	108,400	128.00	13,875,200
タチエス	32,800	1,824.00	59,827,200
NOK	69,000	2,244.00	154,836,000
フタバ産業	47,700	690.00	32,913,000
カヤバ	16,800	4,815.00	80,892,000
大同メタル工業	34,800	483.00	16,808,400
プレス工業	71,000	576.00	40,896,000
ミクニ	4,900	339.00	1,661,100
太平洋工業	40,800	1,371.00	55,936,800

アイシン	376,200	1,577.00	593,267,400
マツダ	587,700	1,070.00	628,839,000
今仙電機製作所	2,500	554.00	1,385,000
本田技研工業	4,209,800	1,507.50	6,346,273,500
スズキ	1,305,300	1,592.50	2,078,690,250
S U B A R U	551,000	2,482.00	1,367,582,000
安永	1,700	577.00	980,900
ヤマハ発動機	749,900	1,280.00	959,872,000
T B K	4,300	288.00	1,238,400
エクセディ	29,100	3,195.00	92,974,500
豊田合成	50,900	2,445.00	124,450,500
愛三工業	29,500	1,396.00	41,182,000
盟和産業	600	1,170.00	702,000
日本プラスト	3,300	365.00	1,204,500
ヨロズ	16,700	1,078.00	18,002,600
エフ・シー・シー	31,400	2,380.00	74,732,000
シマノ	77,600	27,170.00	2,108,392,000
テイ・エス テック	63,300	1,743.50	110,363,550
ジャムコ	10,700	1,328.00	14,209,600
テルモ	990,500	2,700.00	2,674,350,000
クリエートメディック	1,200	957.00	1,148,400
日機装	46,000	1,012.00	46,552,000
日本エム・ディ・エム	14,100	719.00	10,137,900
島津製作所	236,100	4,774.00	1,127,141,400
J M S	16,400	497.00	8,150,800
長野計器	12,900	2,494.00	32,172,600
ブイ・テクノロジー	9,400	2,490.00	23,406,000
東京計器	13,600	3,205.00	43,588,000
愛知時計電機	7,700	2,019.00	15,546,300
インターアクション	10,700	1,208.00	12,925,600
オーバル	3,400	379.00	1,288,600
東京精密	36,400	7,550.00	274,820,000
マニー	71,100	1,821.00	129,473,100
ニコン	256,900	1,485.50	381,624,950
トプコン	86,400	1,545.50	133,531,200
オリンパス	1,017,200	2,718.50	2,765,258,200
理研計器	25,200	3,840.00	96,768,000
タムロン	24,500	4,470.00	109,515,000
H O Y A	349,800	19,785.00	6,920,793,000
シード	2,300	508.00	1,168,400
ノーリツ鋼機	16,800	4,370.00	73,416,000
A & D ホロンホールディングス	25,900	2,111.00	54,674,900

朝日インテック	216,600	2,521.00	546,048,600
シチズン時計	163,500	911.00	148,948,500
リズム	900	4,090.00	3,681,000
大研医器	3,300	523.00	1,725,900
メニコン	61,100	1,459.00	89,144,900
シンシア	400	434.00	173,600
松風	16,000	2,322.00	37,152,000
セイコーグループ	24,800	3,890.00	96,472,000
ニプロ	148,100	1,423.50	210,820,350
KYORITSU	5,700	152.00	866,400
中本パックス	1,300	1,598.00	2,077,400
パラマウントベッドホールディングス	36,900	2,590.00	95,571,000
トランザクション	11,700	2,330.00	27,261,000
粧美堂	1,000	538.00	538,000
ニホンフラッシュ	16,700	902.00	15,063,400
前田工織	31,700	1,875.00	59,437,500
永大産業	4,500	225.00	1,012,500
アートネイチャー	16,000	820.00	13,120,000
フルヤ金属	16,900	4,015.00	67,853,500
バンダイナムコホールディングス	482,400	3,276.00	1,580,342,400
アイフィスジャパン	1,100	568.00	624,800
SHOEI	50,000	2,233.00	111,650,000
フランスベッドホールディングス	23,000	1,217.00	27,991,000
パイロットコーポレーション	27,800	4,435.00	123,293,000
萩原工業	11,900	1,541.00	18,337,900
フジシールインターナショナル	36,000	2,526.00	90,936,000
タカラトミー	80,900	3,912.00	316,480,800
広済堂ホールディングス	57,500	510.00	29,325,000
エステールホールディングス	900	625.00	562,500
タカノ	1,400	772.00	1,080,800
プロネクサス	18,400	1,245.00	22,908,000
ホクシン	2,900	106.00	307,400
ウッドワン	1,400	800.00	1,120,000
TOPPANホールディングス	211,800	4,244.00	898,879,200
大日本印刷	368,400	2,552.00	940,156,800
共同印刷	5,000	3,310.00	16,550,000
NISSHA	30,400	1,942.00	59,036,800
光村印刷	300	1,533.00	459,900
TAKARA & COMPANY	10,500	2,790.00	29,295,000
アシックス	656,000	3,001.00	1,968,656,000
ツツミ	4,200	2,119.00	8,899,800
ローランド	13,100	3,745.00	49,059,500

小松ウオール工業	14,400	1,520.00	21,888,000
ヤマハ	324,600	1,233.50	400,394,100
河合楽器製作所	5,400	2,859.00	15,438,600
クリナップ	17,400	700.00	12,180,000
ピジョン	113,200	1,682.00	190,402,400
キングジム	15,700	836.00	13,125,200
リンテック	35,700	3,305.00	117,988,500
イトーキ	35,500	1,490.00	52,895,000
任天堂	1,121,700	7,636.00	8,565,301,200
三菱鉛筆	24,600	2,409.00	59,261,400
タカラスタンダード	36,300	1,596.00	57,934,800
コクヨ	88,800	2,531.00	224,752,800
ナカバヤシ	19,100	520.00	9,932,000
グローブライド	15,900	1,846.00	29,351,400
オカムラ	53,500	1,977.00	105,769,500
美津濃	17,700	9,100.00	161,070,000
東京電力ホールディングス	1,601,600	636.90	1,020,059,040
中部電力	654,700	1,681.00	1,100,550,700
関西電力	686,100	2,370.00	1,626,057,000
中国電力	308,700	977.00	301,599,900
北陸電力	181,700	924.80	168,036,160
東北電力	467,800	1,371.00	641,353,800
四国電力	165,500	1,272.50	210,598,750
九州電力	409,600	1,562.50	640,000,000
北海道電力	171,700	965.30	165,742,010
沖縄電力	45,400	1,039.00	47,170,600
電源開発	145,900	2,395.00	349,430,500
エフオン	12,900	379.00	4,889,100
イーレックス	31,600	721.00	22,783,600
レノバ	47,400	1,010.00	47,874,000
東京瓦斯	345,900	3,337.00	1,154,268,300
大阪瓦斯	354,100	3,224.00	1,141,618,400
東邦瓦斯	76,900	3,969.00	305,216,100
北海道瓦斯	53,000	596.00	31,588,000
広島ガス	37,500	384.00	14,400,000
西部ガスホールディングス	18,500	1,825.00	33,762,500
静岡ガス	40,500	1,063.00	43,051,500
メタウォーター	21,300	1,780.00	37,914,000
SBSホールディングス	15,800	2,723.00	43,023,400
東武鉄道	195,200	2,503.00	488,585,600
相鉄ホールディングス	63,600	2,385.00	151,686,000
東急	498,200	1,853.00	923,164,600

京浜急行電鉄	219,900	1,169.50	257,173,050
小田急電鉄	293,800	1,599.00	469,786,200
京王電鉄	85,400	3,424.00	292,409,600
京成電鉄	114,600	4,269.00	489,227,400
富士急行	21,900	2,763.00	60,509,700
東日本旅客鉄道	979,200	2,848.50	2,789,251,200
西日本旅客鉄道	421,500	2,724.00	1,148,166,000
東海旅客鉄道	684,400	3,317.00	2,270,154,800
西武ホールディングス	214,900	3,191.00	685,745,900
鴻池運輸	30,300	2,491.00	75,477,300
西日本鉄道	47,500	2,288.00	108,680,000
ハマキョウレックス	60,800	1,248.00	75,878,400
サカイ引越センター	19,700	2,511.00	49,466,700
近鉄グループホールディングス	177,400	3,566.00	632,608,400
阪急阪神ホールディングス	236,500	4,422.00	1,045,803,000
南海電気鉄道	79,100	2,359.50	186,636,450
京阪ホールディングス	97,800	3,029.00	296,236,200
神戸電鉄	4,800	2,524.00	12,115,200
名古屋鉄道	183,000	1,741.00	318,603,000
山陽電気鉄道	13,400	2,023.00	27,108,200
アルプス物流	14,200	5,770.00	81,934,000
ヤマトホールディングス	215,600	1,634.00	352,290,400
山九	42,800	4,814.00	206,039,200
丸運	2,200	490.00	1,078,000
丸全昭和運輸	11,000	5,460.00	60,060,000
センコーグループホールディングス	93,900	1,247.00	117,093,300
トナミホールディングス	3,900	6,270.00	24,453,000
ニッコンホールディングス	109,200	1,893.50	206,770,200
日本石油輸送	400	2,830.00	1,132,000
福山通運	16,300	3,800.00	61,940,000
セイノーホールディングス	99,800	2,407.00	240,218,600
神奈川中央交通	5,000	3,305.00	16,525,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	45,300	1,147.00	51,959,100
九州旅客鉄道	125,400	4,135.00	518,529,000
S Gホールディングス	297,800	1,541.00	458,909,800
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	66,200	7,541.00	499,214,200
日本郵船	459,500	5,220.00	2,398,590,000
商船三井	385,400	4,926.00	1,898,480,400
川崎汽船	403,800	2,214.00	894,013,200
N Sユナイテッド海運	9,700	4,510.00	43,747,000
飯野海運	65,500	1,255.00	82,202,500
共栄タンカー	1,000	1,025.00	1,025,000

乾汽船	21,200	1,151.00	24,401,200
日本航空	435,700	2,517.50	1,096,874,750
A N Aホールディングス	482,700	3,069.00	1,481,406,300
パスコ	700	2,137.00	1,495,900
トランコム	5,100	10,660.00	54,366,000
日新	13,500	4,140.00	55,890,000
三菱倉庫	42,300	5,222.00	220,890,600
三井倉庫ホールディングス	16,600	6,210.00	103,086,000
住友倉庫	47,400	2,693.00	127,648,200
澁澤倉庫	8,100	3,005.00	24,340,500
東陽倉庫	1,000	1,310.00	1,310,000
日本トランスシティ	35,700	880.00	31,416,000
ケイヒン	700	2,001.00	1,400,700
中央倉庫	9,500	1,388.00	13,186,000
川西倉庫	700	1,131.00	791,700
安田倉庫	12,100	1,616.00	19,553,600
ファイズホールディングス	600	847.00	508,200
東洋埠頭	1,100	1,280.00	1,408,000
上組	81,900	3,259.00	266,912,100
サンリツ	900	781.00	702,900
キムラユニティー	1,800	1,442.00	2,595,600
キューソー流通システム	11,800	1,965.00	23,187,000
東海運	2,200	322.00	708,400
エーアイティー	11,100	1,706.00	18,936,600
内外トランスライン	7,100	2,919.00	20,724,900
日本コンセプト	6,500	1,709.00	11,108,500
N E C ネットズエスアイ	69,500	2,769.00	192,445,500
クロスキャット	11,300	1,200.00	13,560,000
システナ	269,600	371.00	100,021,600
デジタルアーツ	11,300	4,930.00	55,709,000
日鉄ソリューションズ	60,800	3,735.00	227,088,000
キューブシステム	9,400	988.00	9,287,200
コア	7,900	1,899.00	15,002,100
手間いらず	3,000	3,475.00	10,425,000
ラクーンホールディングス	13,300	749.00	9,961,700
ソリトンシステムズ	9,200	1,062.00	9,770,400
ソフトクリエイトホールディングス	14,700	1,846.00	27,136,200
T I S	188,400	3,651.00	687,848,400
テクミラホールディングス	1,800	343.00	617,400
グリー	59,700	468.00	27,939,600
G M O ペパボ	2,200	1,338.00	2,943,600
コーエーテクモホールディングス	111,700	1,654.50	184,807,650

三菱総合研究所	8,700	4,160.00	36,192,000
電算	500	1,400.00	700,000
A G S	1,600	871.00	1,393,600
ファインデックス	14,200	856.00	12,155,200
ブレインパッド	14,800	843.00	12,476,400
K L a b	43,300	183.00	7,923,900
ポールトゥウィンホールディングス	30,400	432.00	13,132,800
ネクソン	391,200	2,829.50	1,106,900,400
アイスタイル	59,600	541.00	32,243,600
エムアップホールディングス	21,800	1,325.00	28,885,000
エイチーム	11,900	611.00	7,270,900
エニグモ	22,700	329.00	7,468,300
テクノスジャパン	3,400	686.00	2,332,400
コロプラ	60,500	531.00	32,125,500
ブロードリーフ	71,600	667.00	47,757,200
クロス・マーケティンググループ	1,800	676.00	1,216,800
デジタルハーツホールディングス	11,100	845.00	9,379,500
メディアドゥ	8,100	1,376.00	11,145,600
じげん	52,000	605.00	31,460,000
ブイキューブ	24,600	217.00	5,338,200
エンカレッジ・テクノロジー	900	609.00	548,100
サイバーリンクス	1,500	737.00	1,105,500
フィックスターズ	17,900	1,597.00	28,586,300
C A R T A H O L D I N G S	10,100	1,402.00	14,160,200
オブティム	18,400	606.00	11,150,400
セレス	8,000	1,434.00	11,472,000
S H I F T	11,800	13,660.00	161,188,000
ティーガイア	18,600	3,670.00	68,262,000
セック	2,700	4,310.00	11,637,000
テクマトリックス	32,500	2,402.00	78,065,000
プロシップ	8,600	1,531.00	13,166,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,200	3,081.00	136,180,200
G M O ペイメントゲートウェイ	40,700	8,800.00	358,160,000
ザッパラス	900	378.00	340,200
システムリサーチ	12,200	1,420.00	17,324,000
インターネットイニシアティブ	85,200	3,020.00	257,304,000
さくらインターネット	22,300	4,290.00	95,667,000
G M O グローバルサイン・ホールディングス	5,400	2,887.00	15,589,800
S R A ホールディングス	9,100	4,270.00	38,857,000
システムインテグレータ	1,200	323.00	387,600
朝日ネット	19,200	636.00	12,211,200
e B A S E	25,100	617.00	15,486,700

アバントグループ	22,500	2,254.00	50,715,000
アドソル日進	7,500	1,737.00	13,027,500
ODKソリューションズ	800	583.00	466,400
フリービット	7,800	1,172.00	9,141,600
コムチュア	25,700	1,740.00	44,718,000
アステリア	14,000	541.00	7,574,000
アイル	10,000	2,972.00	29,720,000
マークラインズ	10,500	2,931.00	30,775,500
メディカル・データ・ビジョン	21,300	538.00	11,459,400
gumi	29,000	332.00	9,628,000
ショーケース	900	302.00	271,800
モバイルファクトリー	800	837.00	669,600
テラスカイ	7,700	2,136.00	16,447,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,300	1,975.00	18,367,500
PCIホールディングス	100	1,043.00	104,300
アイビーシー	600	543.00	325,800
ネオジャパン	5,900	1,919.00	11,322,100
PR TIMES	3,600	1,736.00	6,249,600
ラクス	84,300	2,236.50	188,536,950
ランドコンピュータ	1,900	775.00	1,472,500
ダブルスタンダード	5,400	1,555.00	8,397,000
オープンドア	10,400	704.00	7,321,600
アカツキ	8,700	2,038.00	17,730,600
ベネフィットジャパン	200	1,139.00	227,800
Ubicomホールディングス	5,700	1,432.00	8,162,400
カナミックネットワーク	22,400	534.00	11,961,600
ノムラシステムコーポレーション	4,300	111.00	477,300
チェンジホールディングス	39,300	1,395.00	54,823,500
シンクロ・フード	2,500	501.00	1,252,500
オークネット	8,200	2,430.00	19,926,000
キャピタル・アセット・プランニング	800	751.00	600,800
セグエグループ	3,500	583.00	2,040,500
エイトレッド	600	1,563.00	937,800
マクロミル	35,000	796.00	27,860,000
ビーグリー	700	1,392.00	974,400
オロ	7,500	2,596.00	19,470,000
ユーザーローカル	7,500	1,857.00	13,927,500
テモナ	900	184.00	165,600
ニーズウェル	4,200	301.00	1,264,200
マネーフォワード	43,600	5,857.00	255,365,200
サインポスト	1,500	498.00	747,000
Sun Asterisk	12,700	524.00	6,654,800

プラスアルファ・コンサルティング	22,500	2,183.00	49,117,500
電算システムホールディングス	7,900	2,659.00	21,006,100
Appier Group	54,300	1,782.00	96,762,600
ビジョナル	21,100	7,930.00	167,323,000
ソルクシーズ	3,100	290.00	899,000
フェイス	1,100	392.00	431,200
プロトコーポレーション	19,500	1,485.00	28,957,500
ハイマックス	5,600	1,323.00	7,408,800
野村総合研究所	385,900	5,300.00	2,045,270,000
CEホールディングス	1,800	464.00	835,200
日本システム技術	16,500	1,968.00	32,472,000
インテージホールディングス	20,200	1,587.00	32,057,400
東邦システムサイエンス	8,300	1,404.00	11,653,200
ソースネクスト	81,600	198.00	16,156,800
シンプレクス・ホールディングス	27,100	2,420.00	65,582,000
HEROZ	7,000	1,036.00	7,252,000
ラクスル	43,100	1,306.00	56,288,600
メルカリ	87,000	2,507.00	218,109,000
I P S	5,100	2,167.00	11,051,700
F I G	4,500	316.00	1,422,000
システムサポート	6,900	1,955.00	13,489,500
イーソル	12,000	734.00	8,808,000
東海ソフト	600	1,238.00	742,800
ウイングアーク1st	18,500	3,205.00	59,292,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	6,000	863.00	5,178,000
サーバーワークス	3,700	2,879.00	10,652,300
東名	800	1,733.00	1,386,400
ヴィッツ	400	819.00	327,600
トピラシステムズ	1,100	757.00	832,700
Sansan	58,600	2,149.00	125,931,400
Link-Uグループ	800	497.00	397,600
ギフトィ	15,700	1,071.00	16,814,700
メドレー	19,600	3,825.00	74,970,000
ベース	8,700	3,115.00	27,100,500
JMDC	30,400	4,665.00	141,816,000
フォーカスシステムズ	11,900	1,114.00	13,256,600
クレスコ	29,200	1,362.00	39,770,400
フジ・メディア・ホールディングス	171,200	1,717.50	294,036,000
オービック	298,000	5,046.00	1,503,708,000
ジャストシステム	25,600	3,580.00	91,648,000
TDCソフト	33,400	1,245.00	41,583,000
LINEヤフー	2,537,300	419.30	1,063,889,890

トレンドマイクロ	93,600	8,486.00	794,289,600
I Dホールディングス	12,000	1,392.00	16,704,000
日本オラクル	34,100	14,745.00	502,804,500
アルファシステムズ	4,700	2,905.00	13,653,500
フューチャー	44,300	1,820.00	80,626,000
C A C H o l d i n g s	10,900	1,771.00	19,303,900
トーセ	1,100	629.00	691,900
オービックビジネスコンサルタント	25,100	7,423.00	186,317,300
アイティフォー	22,800	1,376.00	31,372,800
東計電算	5,000	4,845.00	24,225,000
エクスネット	500	1,467.00	733,500
大塚商会	202,000	3,544.00	715,888,000
サイボウズ	24,500	1,957.00	47,946,500
電通総研	17,300	5,540.00	95,842,000
A C C E S S	18,500	1,434.00	26,529,000
デジタルガレージ	28,500	3,060.00	87,210,000
E Mシステムズ	29,700	507.00	15,057,900
ウェザーニューズ	5,500	5,790.00	31,845,000
C I J	44,400	417.00	18,514,800
ビジネスエンジニアリング	4,200	4,230.00	17,766,000
日本エンタープライズ	4,100	119.00	487,900
WOWOW	13,400	1,035.00	13,869,000
スカラ	16,500	464.00	7,656,000
インテリジェント ウェイブ	2,000	908.00	1,816,000
A N Y C O L O R	25,400	2,505.00	63,627,000
I M A G I C A G R O U P	17,900	512.00	9,164,800
ネットワンシステムズ	69,400	3,579.00	248,382,600
システムソフト	62,200	63.00	3,918,600
アルゴグラフィックス	16,300	5,270.00	85,901,000
マーベラス	29,000	587.00	17,023,000
エイベックス	30,300	1,477.00	44,753,100
B I P R O G Y	53,500	4,860.00	260,010,000
都築電気	9,400	2,200.00	20,680,000
T B Sホールディングス	89,600	3,897.00	349,171,200
日本テレビホールディングス	157,800	2,244.50	354,182,100
朝日放送グループホールディングス	16,700	639.00	10,671,300
テレビ朝日ホールディングス	43,300	1,986.00	85,993,800
スカパーJ S A Tホールディングス	138,400	892.00	123,452,800
テレビ東京ホールディングス	12,800	3,730.00	47,744,000
日本BS放送	1,400	888.00	1,243,200
ビジョン	26,700	1,251.00	33,401,700
スマートバリュー	1,100	320.00	352,000

U - NEXT HOLDINGS	20,000	5,480.00	109,600,000
ワイヤレスゲート	1,900	239.00	454,100
日本通信	175,500	163.00	28,606,500
クロップス	500	989.00	494,500
日本電信電話	53,005,500	146.80	7,781,207,400
KDDI	1,310,700	4,594.00	6,021,355,800
ソフトバンク	28,482,000	187.20	5,331,830,400
光通信	17,600	31,870.00	560,912,000
エムティーアイ	12,200	1,156.00	14,103,200
GMOインターネットグループ	58,000	2,510.00	145,580,000
ファイバーゲート	9,600	1,020.00	9,792,000
アйдママーケティングコミュニケーション	1,100	222.00	244,200
KADOKAWA	94,200	3,194.00	300,874,800
学研ホールディングス	32,600	1,007.00	32,828,200
ゼンリン	30,500	874.00	26,657,000
昭文社ホールディングス	1,700	391.00	664,700
インプレスホールディングス	3,900	151.00	588,900
アイネット	10,800	1,545.00	16,686,000
松竹	9,300	10,575.00	98,347,500
東宝	99,100	5,813.00	576,068,300
東映	29,400	4,550.00	133,770,000
NTTデータグループ	465,900	2,574.50	1,199,459,550
ピー・シー・エー	10,200	2,060.00	21,012,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,000	1,814.00	12,698,000
DTS	35,200	4,050.00	142,560,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	81,400	5,695.00	463,573,000
シーイーシー	22,500	1,870.00	42,075,000
カブコン	318,700	3,328.00	1,060,633,600
アイ・エス・ビー	8,400	1,456.00	12,230,400
SCSK	124,700	2,959.50	369,049,650
NSW	7,900	3,025.00	23,897,500
アイネス	13,900	1,633.00	22,698,700
TKC	31,800	3,825.00	121,635,000
富士ソフト	49,300	9,020.00	444,686,000
NSD	62,900	3,165.00	199,078,500
コナミグループ	66,700	14,545.00	970,151,500
福井コンピュータホールディングス	11,000	2,694.00	29,634,000
JBCホールディングス	11,800	4,270.00	50,386,000
ミロク情報サービス	16,200	1,855.00	30,051,000
ソフトバンクグループ	879,000	8,427.00	7,407,333,000
リョーサン菱洋ホールディングス	35,400	2,540.00	89,916,000
高千穂交易	7,400	3,905.00	28,897,000

オルパヘルスケアホールディングス	700	1,958.00	1,370,600
伊藤忠食品	4,200	7,190.00	30,198,000
エレマテック	16,900	1,728.00	29,203,200
あらた	28,800	3,630.00	104,544,000
トーメンデバイス	2,700	5,870.00	15,849,000
東京エレクトロン デバイス	18,700	3,600.00	67,320,000
円谷フィールズホールディングス	30,400	2,494.00	75,817,600
双日	209,300	3,365.00	704,294,500
アルフレッサ ホールディングス	188,700	2,256.00	425,707,200
横浜冷凍	47,300	949.00	44,887,700
ラサ商事	9,600	1,430.00	13,728,000
アルコニックス	24,800	1,363.00	33,802,400
神戸物産	145,400	4,524.00	657,789,600
ハイパー	900	324.00	291,600
あい ホールディングス	31,100	2,382.00	74,080,200
ディーブイエックス	1,100	930.00	1,023,000
ダイワボウホールディングス	83,200	2,717.50	226,096,000
マクニカホールディングス	133,500	1,986.00	265,131,000
ラクト・ジャパン	8,000	2,974.00	23,792,000
グリムス	7,900	2,831.00	22,364,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,500	1,199.00	34,171,500
八洲電機	15,200	1,728.00	26,265,600
メディアスホールディングス	10,900	829.00	9,036,100
レスター	16,000	2,710.00	43,360,000
ジオリーブグループ	900	1,133.00	1,019,700
大光	2,100	613.00	1,287,300
OCHIホールディングス	900	1,401.00	1,260,900
TOKAIホールディングス	102,100	971.00	99,139,100
黒谷	1,100	609.00	669,900
Cominix	800	900.00	720,000
三洋貿易	19,300	1,509.00	29,123,700
ビューティガレージ	5,900	1,603.00	9,457,700
ウイン・パートナーズ	12,200	1,186.00	14,469,200
ミタチ産業	1,100	1,175.00	1,292,500
シップヘルスケアホールディングス	67,600	2,338.50	158,082,600
明治電機工業	7,000	1,440.00	10,080,000
デリカフーズホールディングス	1,800	542.00	975,600
スターティアホールディングス	1,100	1,966.00	2,162,600
コメダホールディングス	46,100	2,766.00	127,512,600
ピーバンドットコム	500	361.00	180,500
アセンテック	7,200	606.00	4,363,200
富士興産	1,100	1,514.00	1,665,400

協栄産業	400	2,215.00	886,000
フルサト・マルカホールディングス	15,100	2,254.00	34,035,400
ヤマエグループホールディングス	16,600	2,033.00	33,747,800
小野建	18,900	1,488.00	28,123,200
南陽	1,700	1,041.00	1,769,700
佐島電機	13,100	1,916.00	25,099,600
エコートレーディング	800	929.00	743,200
伯東	10,800	4,675.00	50,490,000
コンドーテック	14,500	1,206.00	17,487,000
中山福	2,200	370.00	814,000
ナガイレーベン	23,700	2,536.00	60,103,200
三菱食品	17,400	5,260.00	91,524,000
松田産業	14,300	3,205.00	45,831,500
第一興商	72,700	1,742.00	126,643,400
メディパルホールディングス	191,100	2,490.50	475,934,550
S P K	8,300	1,938.00	16,085,400
萩原電気ホールディングス	8,100	3,420.00	27,702,000
アズワン	58,300	2,896.00	168,836,800
スズデン	6,600	1,772.00	11,695,200
尾家産業	1,000	1,978.00	1,978,000
シモジマ	12,600	1,302.00	16,405,200
ドウシシャ	17,400	2,153.00	37,462,200
小津産業	900	1,652.00	1,486,800
高速	11,200	2,534.00	28,380,800
たけびし	7,200	2,185.00	15,732,000
リックス	4,700	2,866.00	13,470,200
丸文	16,800	1,047.00	17,589,600
ハピネット	16,000	4,145.00	66,320,000
橋本総業ホールディングス	7,400	1,178.00	8,717,200
日本ライフライン	50,300	1,225.00	61,617,500
タカショー	16,400	480.00	7,872,000
I D O M	49,700	1,075.00	53,427,500
進和	11,500	2,574.00	29,601,000
エスケイジャパン	1,000	748.00	748,000
ダイトロン	8,200	2,824.00	23,156,800
シークス	26,800	1,105.00	29,614,000
田中商事	1,200	688.00	825,600
オーハシテクニカ	9,900	1,750.00	17,325,000
白銅	5,300	2,375.00	12,587,500
ダイコー通産	400	1,108.00	443,200
伊藤忠商事	1,263,600	7,678.00	9,701,920,800
丸紅	1,559,300	2,340.00	3,648,762,000

高島	2,700	1,228.00	3,315,600
長瀬産業	84,000	3,201.00	268,884,000
蝶理	11,800	3,755.00	44,309,000
豊田通商	494,000	2,585.00	1,276,990,000
三共生興	26,100	580.00	15,138,000
兼松	78,600	2,419.00	190,133,400
ツカモトコーポレーション	600	1,202.00	721,200
三井物産	2,816,000	3,178.00	8,949,248,000
日本紙パルプ商事	90,000	674.00	60,660,000
カメイ	20,000	1,942.00	38,840,000
東都水産	400	6,400.00	2,560,000
OUGホールディングス	600	2,539.00	1,523,400
スターゼン	13,000	2,904.00	37,752,000
山善	57,000	1,359.00	77,463,000
椿本興業	11,700	1,731.00	20,252,700
住友商事	1,125,900	3,194.00	3,596,124,600
内田洋行	7,600	6,800.00	51,680,000
三菱商事	3,609,600	2,952.50	10,657,344,000
第一実業	17,700	2,313.00	40,940,100
キャノンマーケティングジャパン	43,500	4,646.00	202,101,000
西華産業	7,400	3,975.00	29,415,000
佐藤商事	13,000	1,376.00	17,888,000
東京産業	17,200	690.00	11,868,000
ユアサ商事	14,700	4,980.00	73,206,000
神鋼商事	4,700	6,450.00	30,315,000
トルク	2,900	220.00	638,000
阪和興業	33,800	4,970.00	167,986,000
正栄食品工業	12,500	4,630.00	57,875,000
カナデン	14,100	1,434.00	20,219,400
RYODEN	15,200	2,468.00	37,513,600
岩谷産業	171,200	2,064.00	353,356,800
ナイス	1,300	1,868.00	2,428,400
ニチモウ	1,300	1,846.00	2,399,800
極東貿易	11,200	1,470.00	16,464,000
アステナホールディングス	35,400	513.00	18,160,200
三愛オブリ	43,900	1,945.00	85,385,500
稲畑産業	37,000	3,330.00	123,210,000
G S Iクレオス	10,100	1,996.00	20,159,600
明和産業	22,200	651.00	14,452,200
クワザワホールディングス	1,500	638.00	957,000
ワキタ	31,100	1,733.00	53,896,300
東邦ホールディングス	50,800	4,539.00	230,581,200

サンゲツ	43,300	2,813.00	121,802,900
ミツウロコグループホールディングス	24,000	1,731.00	41,544,000
シナネンホールディングス	5,200	5,700.00	29,640,000
伊藤忠エネクス	46,600	1,558.00	72,602,800
サンリオ	152,700	4,130.00	630,651,000
サンワテクノス	9,600	1,908.00	18,316,800
新光商事	25,300	924.00	23,377,200
トーヨー	7,300	2,764.00	20,177,200
三信電気	7,600	1,987.00	15,101,200
東陽テクニカ	17,300	1,614.00	27,922,200
モスフードサービス	27,700	3,580.00	99,166,000
加賀電子	34,400	2,800.00	96,320,000
ソーダニッカ	19,900	1,160.00	23,084,000
立花エレテック	12,500	2,555.00	31,937,500
フォーバル	7,400	1,398.00	10,345,200
PALTAC	25,100	4,410.00	110,691,000
三谷産業	32,900	321.00	10,560,900
西本Wismettacホールディングス	11,500	1,368.00	15,732,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	2,805.00	841,500
コア商事ホールディングス	13,900	621.00	8,631,900
KPPグループホールディングス	48,700	674.00	32,823,800
ヤマタネ	8,300	3,040.00	25,232,000
丸紅建材リース	300	2,858.00	857,400
泉州電業	13,000	5,030.00	65,390,000
トラスコ中山	39,500	2,472.00	97,644,000
オートバックスセブン	65,400	1,480.00	96,792,000
モリト	15,000	1,392.00	20,880,000
加藤産業	23,300	4,240.00	98,792,000
北恵	1,000	938.00	938,000
イエローハット	29,900	2,600.00	77,740,000
JKホールディングス	14,500	998.00	14,471,000
日伝	12,300	3,350.00	41,205,000
北沢産業	2,500	350.00	875,000
杉本商事	18,200	1,372.00	24,970,400
因幡電機産業	48,700	3,830.00	186,521,000
東テク	18,800	2,656.00	49,932,800
ミスミグループ本社	284,000	2,590.00	735,560,000
アルテック	2,200	217.00	477,400
タキヒヨー	900	1,213.00	1,091,700
蔵王産業	700	2,501.00	1,750,700
スズケン	67,200	5,003.00	336,201,600
ジェコス	11,200	889.00	9,956,800

サンエー	28,800	2,575.00	74,160,000
カワチ薬品	14,800	2,698.00	39,930,400
エービーシー・マート	82,400	3,050.00	251,320,000
ハードオフコーポレーション	8,500	1,978.00	16,813,000
アスクル	45,600	2,163.00	98,632,800
ゲオホールディングス	21,300	1,539.00	32,780,700
アダストリア	22,800	3,335.00	76,038,000
くら寿司	22,100	3,760.00	83,096,000
キャンドウ	6,800	3,525.00	23,970,000
I Kホールディングス	2,200	360.00	792,000
パルグループホールディングス	37,000	2,538.00	93,906,000
エディオン	74,600	1,837.00	137,040,200
サーラコーポレーション	39,900	824.00	32,877,600
ワッツ	2,200	822.00	1,808,400
ハローズ	8,600	4,190.00	36,034,000
あみやき亭	13,800	1,896.00	26,164,800
大黒天物産	5,800	11,720.00	67,976,000
ハニーズホールディングス	16,900	1,721.00	29,084,900
ファーマライズホールディングス	1,500	625.00	937,500
アルペン	15,700	2,133.00	33,488,100
ハブ	1,700	753.00	1,280,100
クオールホールディングス	26,100	1,418.00	37,009,800
ジinzホールディングス	14,400	5,260.00	75,744,000
ビックカメラ	112,700	1,583.00	178,404,100
D C Mホールディングス	97,600	1,579.00	154,110,400
Monotaro	266,600	2,397.50	639,173,500
東京一番フーズ	1,800	504.00	907,200
きちりホールディングス	1,100	880.00	968,000
J.フロント リテイリング	216,000	1,546.50	334,044,000
ドトール・日レスホールディングス	33,500	2,294.00	76,849,000
マツキヨココカラ&カンパニー	342,100	2,353.00	804,961,300
ブロンコビリー	11,100	3,765.00	41,791,500
Z O Z O	119,900	5,214.00	625,158,600
トレジャー・ファクトリー	13,200	1,775.00	23,430,000
物語コーポレーション	31,500	3,890.00	122,535,000
三越伊勢丹ホールディングス	311,400	2,226.00	693,176,400
Hamee	7,900	1,055.00	8,334,500
マーケットエンタープライズ	700	948.00	663,600
ウエルシアホールディングス	97,700	2,038.00	199,112,600
クリエイトSDホールディングス	26,800	3,205.00	85,894,000
丸善CHIホールディングス	5,800	327.00	1,896,600
ミサワ	1,400	651.00	911,400

ティーライフ	800	1,127.00	901,600	
チムニー	1,200	1,296.00	1,555,200	
シュッピン	17,300	1,249.00	21,607,700	
オイシックス・ラ・大地	25,500	1,420.00	36,210,000	
ネクステージ	43,200	1,837.00	79,358,400	
ジョイフル本田	52,300	2,083.00	108,940,900	
エターナルホスピタリティグループ	7,100	4,085.00	29,003,500	
ホットランド	14,600	2,366.00	34,543,600	
すかいらーくホールディングス	257,100	2,310.50	594,029,550	
SFPホールディングス	9,100	1,977.00	17,990,700	
綿半ホールディングス	14,800	1,721.00	25,470,800	
ヨシックスホールディングス	4,900	3,410.00	16,709,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,900	848.00	44,859,200	
B E E N O S	11,300	2,644.00	29,877,200	
あさひ	17,700	1,723.00	30,497,100	
日本調剤	12,700	1,353.00	17,183,100	
コスモス薬品	31,900	7,487.00	238,835,300	
トーエル	2,200	805.00	1,771,000	
セブン&アイ・ホールディングス	1,903,600	2,147.00	4,087,029,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	127,300	1,128.00	143,594,400	
ツルハホールディングス	39,500	9,070.00	358,265,000	
サンマルクホールディングス	15,300	2,170.00	33,201,000	
フェリシモ	1,300	904.00	1,175,200	
トリドールホールディングス	52,800	3,720.00	196,416,000	
T O K Y O B A S E	21,600	242.00	5,227,200	
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,189.00	1,307,900	
J Mホールディングス	14,300	3,210.00	45,903,000	
サツドラホールディングス	2,000	800.00	1,600,000	
アレンザホールディングス	14,400	1,100.00	15,840,000	
串カツ田中ホールディングス	5,900	1,519.00	8,962,100	
パロックジャパンリミテッド	15,100	762.00	11,506,200	
クスリのアオキホールディングス	63,000	3,333.00	209,979,000	
力の源ホールディングス	12,100	1,190.00	14,399,000	
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	100,400	2,877.50	288,901,000	
メディカルシステムネットワーク	21,200	433.00	9,179,600	
はるやまホールディングス	2,500	578.00	1,445,000	
ノジマ	54,700	2,026.00	110,822,200	
カッパ・クリエイト	29,500	1,676.00	49,442,000	
ライトオン	3,000	319.00	957,000	
良品計画	224,000	2,634.00	590,016,000	

パリミキホールディングス	5,900	334.00	1,970,600
アドヴァングループ	16,500	899.00	14,833,500
アルビス	6,300	2,753.00	17,343,900
コナカ	4,800	245.00	1,176,000
ハウス オブ ローゼ	700	1,506.00	1,054,200
G - 7ホールディングス	20,700	1,669.00	34,548,300
イオン北海道	55,700	920.00	51,244,000
コジマ	36,600	959.00	35,099,400
ヒマラヤ	1,800	876.00	1,576,800
コーナン商事	23,100	3,805.00	87,895,500
エコス	7,100	2,119.00	15,044,900
ワタミ	19,900	868.00	17,273,200
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	379,800	3,695.00	1,403,361,000
西松屋チェーン	37,100	2,464.00	91,414,400
ゼンショーホールディングス	95,800	7,936.00	760,268,800
幸楽苑ホールディングス	13,900	1,231.00	17,110,900
ハークスレイ	1,700	740.00	1,258,000
サイゼリヤ	27,900	5,710.00	159,309,000
V Tホールディングス	74,100	470.00	34,827,000
魚力	6,700	2,442.00	16,361,400
フジ・コーポレーション	9,100	2,032.00	18,491,200
ユナイテッドアローズ	22,200	2,071.00	45,976,200
ハイデイ日高	28,000	2,696.00	75,488,000
京都きもの友禅ホールディングス	4,900	85.00	416,500
コロナイド	96,600	1,728.50	166,973,100
壱番屋	74,600	1,041.00	77,658,600
P L A N T	1,100	1,483.00	1,631,300
スギホールディングス	113,800	2,665.50	303,333,900
薬王堂ホールディングス	9,300	2,468.00	22,952,400
スクロール	28,400	965.00	27,406,000
ヨンドシーホールディングス	18,000	1,863.00	33,534,000
木曽路	28,600	2,406.00	68,811,600
S R Sホールディングス	31,300	1,197.00	37,466,100
千趣会	38,000	303.00	11,514,000
リテールパートナーズ	28,200	1,367.00	38,549,400
上新電機	18,700	2,706.00	50,602,200
日本瓦斯	99,500	2,297.00	228,551,500
ロイヤルホールディングス	33,100	2,474.00	81,889,400
いなげや	18,300	1,219.00	22,307,700
チヨダ	18,400	984.00	18,105,600
ライフコーポレーション	19,700	3,630.00	71,511,000
リンガーハット	24,200	2,198.00	53,191,600

MrMaxHD	24,200	724.00	17,520,800
AOKIホールディングス	40,600	1,194.00	48,476,400
オークワ	27,100	887.00	24,037,700
コメリ	29,000	3,700.00	107,300,000
青山商事	40,500	1,347.00	54,553,500
しまむら	44,200	7,824.00	345,820,800
はせがわ	2,900	328.00	951,200
高島屋	239,500	1,143.00	273,748,500
松屋	31,900	865.00	27,593,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	95,900	2,058.00	197,362,200
近鉄百貨店	8,200	2,111.00	17,310,200
丸井グループ	124,800	2,390.50	298,334,400
アクシアル リテイリング	51,700	940.00	48,598,000
イオン	637,300	3,899.00	2,484,832,700
イズミ	33,300	3,547.00	118,115,100
平和堂	31,400	2,390.00	75,046,000
フジ	28,900	2,115.00	61,123,500
ヤオコー	22,300	9,722.00	216,800,600
ゼビオホールディングス	25,800	1,254.00	32,353,200
ケーズホールディングス	126,500	1,542.50	195,126,250
Olympicグループ	2,400	498.00	1,195,200
日産東京販売ホールディングス	6,700	439.00	2,941,300
シルバーライフ	5,500	804.00	4,422,000
Genky DrugStores	16,600	3,745.00	62,167,000
ナルミヤ・インターナショナル	900	1,237.00	1,113,300
ブックオフグループホールディングス	13,900	1,363.00	18,945,700
ギフトホールディングス	9,400	2,827.00	26,573,800
アインホールディングス	26,000	5,434.00	141,284,000
Genki Global Dining	10,700	4,445.00	47,561,500
ヤマダホールディングス	579,000	448.70	259,797,300
アーケランズ	56,100	1,753.00	98,343,300
ニトリホールディングス	68,500	21,795.00	1,492,957,500
グルメ杵屋	15,600	1,049.00	16,364,400
愛眼	3,000	160.00	480,000
ケーユーホールディングス	9,100	1,056.00	9,609,600
吉野家ホールディングス	69,400	3,141.00	217,985,400
松屋フーズホールディングス	8,900	6,290.00	55,981,000
サガミホールディングス	28,400	1,653.00	46,945,200
王将フードサービス	42,000	2,849.00	119,658,000
ミニストップ	13,700	1,614.00	22,111,800
アークス	34,600	2,561.00	88,610,600
パローホールディングス	36,000	2,203.00	79,308,000

ベルク	9,400	6,430.00	60,442,000
大庄	11,600	1,072.00	12,435,200
ファーストリテイリング	105,700	47,420.00	5,012,294,000
サンドラッグ	63,500	4,234.00	268,859,000
サクスパー ホールディングス	16,300	833.00	13,577,900
ヤマザワ	1,100	1,209.00	1,329,900
やまや	900	3,000.00	2,700,000
ペルーナ	45,700	723.00	33,041,100
いよぎんホールディングス	208,200	1,359.00	282,943,800
しずおかフィナンシャルグループ	385,400	1,244.50	479,630,300
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	147,300	1,429.00	210,491,700
楽天銀行	81,200	3,225.00	261,870,000
京都フィナンシャルグループ	220,300	2,204.50	485,651,350
島根銀行	1,100	510.00	561,000
じもとホールディングス	3,300	282.00	930,600
めぶきフィナンシャルグループ	810,900	574.50	465,862,050
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,400	4,135.00	92,624,000
九州フィナンシャルグループ	338,700	697.10	236,107,770
ゆうちょ銀行	1,922,900	1,338.00	2,572,840,200
富山第一銀行	55,500	1,061.00	58,885,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	930,900	792.00	737,272,800
西日本フィナンシャルホールディングス	97,900	1,632.00	159,772,800
三十三フィナンシャルグループ	15,600	1,647.00	25,693,200
第四北越フィナンシャルグループ	55,000	2,351.00	129,305,000
ひろぎんホールディングス	249,100	1,106.00	275,504,600
おきなわフィナンシャルグループ	14,900	2,278.00	33,942,200
十六フィナンシャルグループ	22,700	3,950.00	89,665,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,100	4,255.00	72,760,500
プロクレアホールディングス	20,000	1,756.00	35,120,000
あいちフィナンシャルグループ	35,900	2,356.00	84,580,400
あおぞら銀行	125,800	2,664.00	335,131,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,656,700	1,453.50	15,489,513,450
りそなホールディングス	2,006,800	997.60	2,001,983,680
三井住友トラスト・ホールディングス	623,100	3,391.00	2,112,932,100
三井住友フィナンシャルグループ	3,648,600	3,045.00	11,109,987,000
千葉銀行	487,700	1,152.50	562,074,250
群馬銀行	339,600	877.80	298,100,880
武蔵野銀行	24,400	2,665.00	65,026,000
千葉興業銀行	41,300	1,039.00	42,910,700
筑波銀行	76,800	236.00	18,124,800
七十七銀行	50,900	3,915.00	199,273,500
秋田銀行	11,700	2,172.00	25,412,400

山形銀行	19,400	1,011.00	19,613,400
岩手銀行	11,100	2,266.00	25,152,600
東邦銀行	138,400	262.00	36,260,800
東北銀行	1,800	1,110.00	1,998,000
ふくおかフィナンシャルグループ	152,400	3,671.00	559,460,400
スルガ銀行	131,000	1,115.00	146,065,000
八十二銀行	375,500	840.50	315,607,750
山梨中央銀行	19,600	1,600.00	31,360,000
大垣共立銀行	33,400	1,822.00	60,854,800
福井銀行	15,600	1,835.00	28,626,000
清水銀行	7,000	1,474.00	10,318,000
富山銀行	600	1,609.00	965,400
滋賀銀行	29,100	3,245.00	94,429,500
南都銀行	26,300	3,010.00	79,163,000
百五銀行	164,600	545.00	89,707,000
紀陽銀行	62,600	1,675.00	104,855,000
ほくほくフィナンシャルグループ	108,300	1,562.50	169,218,750
山陰合同銀行	109,500	1,220.00	133,590,000
鳥取銀行	1,300	1,328.00	1,726,400
百十四銀行	17,200	2,475.00	42,570,000
四国銀行	25,700	963.00	24,749,100
阿波銀行	24,500	2,448.00	59,976,000
大分銀行	10,500	3,075.00	32,287,500
宮崎銀行	10,500	2,675.00	28,087,500
佐賀銀行	10,200	2,085.00	21,267,000
琉球銀行	37,200	994.00	36,976,800
セブン銀行	548,500	286.30	157,035,550
みずほフィナンシャルグループ	2,362,000	2,936.00	6,934,832,000
高知銀行	1,300	790.00	1,027,000
山口フィナンシャルグループ	171,600	1,549.50	265,894,200
名古屋銀行	11,100	6,200.00	68,820,000
北洋銀行	265,100	386.00	102,328,600
大光銀行	1,200	1,334.00	1,600,800
愛媛銀行	23,600	1,039.00	24,520,400
トマト銀行	1,300	1,143.00	1,485,900
京葉銀行	72,000	700.00	50,400,000
栃木銀行	87,400	263.00	22,986,200
北日本銀行	5,700	2,375.00	13,537,500
東和銀行	32,100	590.00	18,939,000
福島銀行	3,900	243.00	947,700
大東銀行	1,600	699.00	1,118,400
トモニホールディングス	165,600	372.00	61,603,200

フィデアホールディングス	18,100	1,421.00	25,720,100
池田泉州ホールディングス	242,700	325.00	78,877,500
F P G	62,400	2,220.00	138,528,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	28,400	1,055.00	29,962,000
マーキュリアホールディングス	1,700	859.00	1,460,300
S B I ホールディングス	281,100	3,295.00	926,224,500
ジャフコ グループ	52,200	2,022.00	105,548,400
大和証券グループ本社	1,355,600	1,005.00	1,362,378,000
野村ホールディングス	2,942,800	743.00	2,186,500,400
岡三証券グループ	153,700	620.00	95,294,000
丸三証券	58,300	920.00	53,636,000
東洋証券	46,600	417.00	19,432,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	207,900	483.00	100,415,700
光世証券	1,000	435.00	435,000
水戸証券	48,100	466.00	22,414,600
いちよし証券	32,800	674.00	22,107,200
松井証券	86,200	782.00	67,408,400
マネックスグループ	171,500	602.00	103,243,000
極東証券	24,000	1,390.00	33,360,000
岩井コスモホールディングス	20,000	1,995.00	39,900,000
アイザワ証券グループ	25,300	1,768.00	44,730,400
マネーパートナーズグループ	4,100	219.00	897,900
スパークス・グループ	19,500	1,315.00	25,642,500
かんぽ生命保険	178,200	2,604.00	464,032,800
F P パートナー	7,700	2,685.00	20,674,500
S O M P O ホールディングス	789,700	3,201.00	2,527,829,700
アニコム ホールディングス	59,400	678.00	40,273,200
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	1,175,300	3,330.00	3,913,749,000
第一生命ホールディングス	822,800	3,682.00	3,029,549,600
東京海上ホールディングス	1,708,500	5,231.00	8,937,163,500
T & D ホールディングス	469,900	2,495.00	1,172,400,500
アドバンスクリエイト	13,600	936.00	12,729,600
N E X Y Z . G r o u p	2,000	856.00	1,712,000
全国保証	45,900	5,644.00	259,059,600
あんしん保証	4,300	183.00	786,900
イントラスト	2,200	747.00	1,643,400
日本モーゲージサービス	3,400	421.00	1,431,400
C a s a	2,100	835.00	1,753,500
S B I アルヒ	17,500	814.00	14,245,000
プレミアグループ	29,900	2,118.00	63,328,200
ネットプロテクションズホールディングス	60,400	339.00	20,475,600
クレディセゾン	111,100	3,581.00	397,849,100

芙蓉総合リース	16,200	11,000.00	178,200,000
みずほリース	147,200	987.00	145,286,400
東京センチュリー	131,100	1,606.00	210,546,600
日本証券金融	64,700	1,915.00	123,900,500
アイフル	259,500	322.00	83,559,000
リコーリース	16,700	4,945.00	82,581,500
イオンフィナンシャルサービス	101,000	1,258.00	127,058,000
アコム	314,000	381.20	119,696,800
ジャックス	18,800	3,845.00	72,286,000
オリエントコーポレーション	57,800	938.00	54,216,400
オリックス	1,049,600	3,318.00	3,482,572,800
三菱HCキャピタル	780,300	1,010.50	788,493,150
九州リースサービス	2,100	997.00	2,093,700
日本取引所グループ	902,600	1,855.50	1,674,774,300
イー・ギャランティ	29,000	1,419.00	41,151,000
アサックス	2,400	727.00	1,744,800
NECキャピタルソリューション	8,800	3,755.00	33,044,000
robot home	52,600	141.00	7,416,600
大東建託	64,100	17,410.00	1,115,981,000
サムティホールディングス	34,300	2,792.00	95,765,600
いちご	179,400	367.00	65,839,800
日本駐車場開発	211,100	232.00	48,975,200
スター・マイカ・ホールディングス	19,100	605.00	11,555,500
SREホールディングス	7,700	4,410.00	33,957,000
ADワークスグループ	9,500	209.00	1,985,500
ヒューリック	408,600	1,454.50	594,308,700
野村不動産ホールディングス	97,600	3,831.00	373,905,600
三重交通グループホールディングス	38,700	499.00	19,311,300
ディア・ライフ	30,500	822.00	25,071,000
地主	15,800	2,097.00	33,132,600
プレサンスコーポレーション	23,500	1,922.00	45,167,000
ハウスコム	1,200	1,059.00	1,270,800
JPMC	10,600	1,160.00	12,296,000
サンセイランディック	1,800	955.00	1,719,000
フージャースホールディングス	27,000	1,040.00	28,080,000
オープンハウスグループ	64,200	5,405.00	347,001,000
東急不動産ホールディングス	526,700	986.00	519,326,200
飯田グループホールディングス	167,900	2,211.00	371,226,900
イーランド	1,000	1,429.00	1,429,000
ムゲンエステート	3,300	1,625.00	5,362,500
And Doホールディングス	10,600	1,044.00	11,066,400
シーアールイー	8,200	1,312.00	10,758,400

ケイアイスター不動産	8,600	3,910.00	33,626,000
グッドコムアセット	15,000	880.00	13,200,000
ジェイ・エス・ビー	7,500	2,817.00	21,127,500
ロードスターキャピタル	10,200	2,308.00	23,541,600
テンポイノベーション	1,800	945.00	1,701,000
フェイスネットワーク	1,400	1,692.00	2,368,800
霞ヶ関キャピタル	7,200	14,980.00	107,856,000
パーク24	136,700	1,792.50	245,034,750
パラカ	5,800	1,726.00	10,010,800
三井不動産	2,427,900	1,338.00	3,248,530,200
三菱地所	1,098,300	2,258.50	2,480,510,550
平和不動産	28,600	4,080.00	116,688,000
東京建物	153,100	2,296.50	351,594,150
京阪神ビルディング	33,100	1,606.00	53,158,600
住友不動産	253,200	4,806.00	1,216,879,200
テオオーシー	32,200	624.00	20,092,800
レオパレス21	175,100	598.00	104,709,800
スターツコーポレーション	25,300	3,475.00	87,917,500
フジ住宅	22,900	718.00	16,442,200
空港施設	25,700	572.00	14,700,400
明和地所	13,100	966.00	12,654,600
ゴールドクレスト	14,500	3,245.00	47,052,500
エスリード	8,400	4,760.00	39,984,000
日神グループホールディングス	29,300	495.00	14,503,500
日本エスコン	32,700	1,032.00	33,746,400
MIRARTHホールディングス	91,000	503.00	45,773,000
AVANTIA	2,800	776.00	2,172,800
イオンモール	91,000	2,091.00	190,281,000
毎日コムネット	2,100	735.00	1,543,500
ファースト住建	2,100	1,120.00	2,352,000
カチタス	47,400	1,991.00	94,373,400
トーセイ	29,400	2,300.00	67,620,000
穴吹興産	1,200	2,026.00	2,431,200
サンフロンティア不動産	26,300	1,758.00	46,235,400
FJネクストホールディングス	18,900	1,213.00	22,925,700
インテリックス	900	707.00	636,300
ランドビジネス	1,400	200.00	280,000
サンネクスタグループ	1,800	1,018.00	1,832,400
グランディハウス	17,500	556.00	9,730,000
日本空港ビルデング	62,000	5,153.00	319,486,000
明豊ファシリティワークス	2,200	858.00	1,887,600
LIFULL	45,900	142.00	6,517,800

MIXI	39,300	2,760.00	108,468,000
ジェイエイシーリクルートメント	66,200	764.00	50,576,800
日本M&Aセンターホールディングス	291,300	654.70	190,714,110
メンバーズ	6,400	925.00	5,920,000
中広	900	502.00	451,800
UTグループ	23,900	2,752.00	65,772,800
アイティメディア	7,100	1,625.00	11,537,500
ケアネット	37,700	629.00	23,713,300
E・Jホールディングス	10,800	1,810.00	19,548,000
オープンアップグループ	55,000	2,044.00	112,420,000
コシダカホールディングス	54,900	1,015.00	55,723,500
アルトナー	1,700	1,815.00	3,085,500
パソナグループ	22,200	2,199.00	48,817,800
CDS	1,300	1,818.00	2,363,400
リンクアンドモチベーション	45,100	632.00	28,503,200
エス・エム・エス	64,100	2,156.50	138,231,650
サニーサイドアップグループ	1,600	583.00	932,800
パーソルホールディングス	1,860,000	256.80	477,648,000
リニカル	3,000	389.00	1,167,000
クックパッド	50,900	177.00	9,009,300
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,900	806.00	2,337,400
学情	9,400	1,783.00	16,760,200
スタジオアリス	9,200	2,064.00	18,988,800
エプコ	1,300	820.00	1,066,000
NJS	4,600	3,420.00	15,732,000
総合警備保障	305,300	1,035.00	315,985,500
カカクコム	118,600	2,491.50	295,491,900
アイロムグループ	7,400	2,775.00	20,535,000
セントケア・ホールディング	13,500	751.00	10,138,500
サイネックス	900	854.00	768,600
ルネサンス	14,400	1,006.00	14,486,400
ディップ	28,000	2,840.00	79,520,000
デジタルホールディングス	9,500	934.00	8,873,000
新日本科学	16,800	1,165.00	19,572,000
キャリアデザインセンター	800	1,726.00	1,380,800
エムスリー	361,100	1,438.00	519,261,800
ツカダ・グローバルホールディング	3,100	411.00	1,274,100
ウェルネット	3,700	739.00	2,734,300
ワールドホールディングス	7,300	1,948.00	14,220,400
ディー・エヌ・エー	65,000	1,783.00	115,895,000
博報堂DYホールディングス	233,100	1,169.00	272,493,900
ぐるなび	34,500	340.00	11,730,000

タカミヤ	25,200	431.00	10,861,200
ファンコミュニケーションズ	26,000	404.00	10,504,000
ライク	6,900	1,446.00	9,977,400
A o b a - B B T	2,000	325.00	650,000
エスプール	58,300	340.00	19,822,000
W D B ホールディングス	9,400	1,710.00	16,074,000
ティア	3,000	456.00	1,368,000
アドウェイズ	22,800	332.00	7,569,600
バリューコマース	16,200	1,121.00	18,160,200
インフォマート	172,900	327.00	56,538,300
J P ホールディングス	47,000	725.00	34,075,000
エコナックホールディングス	4,800	115.00	552,000
C L ホールディングス	4,500	956.00	4,302,000
プレステージ・インターナショナル	85,700	703.00	60,247,100
アミューズ	11,300	1,400.00	15,820,000
ドリームインキュベータ	5,800	2,253.00	13,067,400
クイック	12,800	2,078.00	26,598,400
T A C	2,900	163.00	472,700
電通グループ	197,500	4,407.00	870,382,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	9,000	828.00	7,452,000
イオンファンタジー	6,700	2,271.00	15,215,700
シーティーエス	22,800	826.00	18,832,800
H . U . グループホールディングス	53,500	2,651.50	141,855,250
アルプス技研	16,000	2,777.00	44,432,000
日本空調サービス	19,800	1,047.00	20,730,600
オリエンタルランド	966,600	3,698.00	3,574,486,800
ダスキン	39,900	3,860.00	154,014,000
明光ネットワークジャパン	22,400	680.00	15,232,000
ファルコホールディングス	8,200	2,355.00	19,311,000
ラウンドワン	172,500	1,095.00	188,887,500
リゾートトラスト	79,400	2,876.00	228,354,400
ビー・エム・エル	22,500	2,652.00	59,670,000
リソー教育	94,100	258.00	24,277,800
早稲田アカデミー	10,200	1,588.00	16,197,600
ユー・エス・エス	409,900	1,356.50	556,029,350
東京個別指導学院	22,100	406.00	8,972,600
サイバーエージェント	403,800	1,019.50	411,674,100
楽天グループ	1,285,600	925.60	1,189,951,360
クリーク・アンド・リバー社	9,300	1,464.00	13,615,200
S B I グローバルアセットマネジメント	36,100	588.00	21,226,800
テー・オー・ダブリュー	36,400	329.00	11,975,600
山田コンサルティンググループ	8,000	2,251.00	18,008,000

セントラルスポーツ	6,900	2,425.00	16,732,500
フルキャストホールディングス	15,100	1,604.00	24,220,400
エン・ジャパン	29,800	2,432.00	72,473,600
リソルホールディングス	400	4,585.00	1,834,000
テクノプロ・ホールディングス	106,100	2,779.00	294,851,900
アトラグループ	1,500	135.00	202,500
アイ・アールジャパンホールディングス	9,700	879.00	8,526,300
K e e P e r 技研	11,300	4,285.00	48,420,500
ファーストロジック	1,500	777.00	1,165,500
三機サービス	800	976.00	780,800
G u n o s y	14,700	792.00	11,642,400
デザインワン・ジャパン	2,500	125.00	312,500
イー・ガーディアン	8,800	1,756.00	15,452,800
リブセンス	3,000	166.00	498,000
ジャパンマテリアル	56,000	1,853.00	103,768,000
ベクトル	22,000	915.00	20,130,000
ウチヤマホールディングス	2,200	335.00	737,000
チャーム・ケア・コーポレーション	15,300	1,374.00	21,022,200
キャリアリンク	6,800	2,433.00	16,544,400
I B J	14,200	723.00	10,266,600
アサンテ	9,100	1,628.00	14,814,800
バリューHR	16,500	1,608.00	26,532,000
M & A キャピタルパートナーズ	14,900	2,307.00	34,374,300
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,400	1,000.00	7,400,000
E R I ホールディングス	1,200	1,950.00	2,340,000
アビスト	700	3,170.00	2,219,000
シグマクシス・ホールディングス	24,000	1,682.00	40,368,000
ウィルグループ	15,500	988.00	15,314,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,000	145.00	870,000
メドピア	14,900	562.00	8,373,800
レアジョブ	1,200	403.00	483,600
リクルートホールディングス	1,315,400	8,705.00	11,450,557,000
エラン	24,400	996.00	24,302,400
土木管理総合試験所	2,400	316.00	758,400
日本郵政	1,909,400	1,366.00	2,608,240,400
ベルシステム24ホールディングス	19,700	1,505.00	29,648,500
鎌倉新書	16,000	534.00	8,544,000
S M N	1,400	278.00	389,200
グローバルキッズCOMPANY	1,000	679.00	679,000
エアトリ	13,500	1,217.00	16,429,500
アトラエ	13,500	850.00	11,475,000
ストライク	9,000	4,350.00	39,150,000

ソラスト	50,700	558.00	28,290,600
セラク	5,700	1,458.00	8,310,600
インソース	39,800	1,022.00	40,675,600
ペイカレント	134,300	5,304.00	712,327,200
Orchestra Holdings	4,200	857.00	3,599,400
アイモバイル	23,600	522.00	12,319,200
キャリアインデックス	2,300	182.00	418,600
MS - Japan	8,500	1,014.00	8,619,000
船場	1,000	1,212.00	1,212,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	59,200	3,110.00	184,112,000
フルテック	700	1,156.00	809,200
GameWith	2,400	287.00	688,800
MS&Consulting	800	504.00	403,200
エル・ティー・エス	2,500	1,936.00	4,840,000
ミダックホールディングス	11,200	1,775.00	19,880,000
キュービーネットホールディングス	10,600	1,085.00	11,501,000
オープングループ	25,700	199.00	5,114,300
スプリックス	1,400	795.00	1,113,000
マネジメントソリューションズ	9,100	1,649.00	15,005,900
プロレド・パートナーズ	4,800	527.00	2,529,600
テノ・ホールディングス	900	490.00	441,000
フロンティア・マネジメント	5,600	1,233.00	6,904,800
コプロ・ホールディングス	1,400	1,477.00	2,067,800
ギークス	900	416.00	374,400
アンビスホールディングス	39,200	1,926.00	75,499,200
カーブスホールディングス	50,100	755.00	37,825,500
フォーラムエンジニアリング	25,000	932.00	23,300,000
Fast Fitness Japan	6,400	1,357.00	8,684,800
Macbee Planet	5,200	2,643.00	13,743,600
ダイレクトマーケティングミックス	22,900	252.00	5,770,800
ポピンズ	3,500	1,386.00	4,851,000
LITALICO	14,400	1,246.00	17,942,400
コンフィデンス・インターワークス	400	1,740.00	696,000
アドバンテッジリスクマネジメント	2,300	530.00	1,219,000
リログループ	91,600	1,878.00	172,024,800
東祥	13,000	681.00	8,853,000
ID&Eホールディングス	11,100	4,280.00	47,508,000
ビーウィズ	3,800	1,908.00	7,250,400
サンウェルズ	7,100	1,617.00	11,480,700
TREホールディングス	35,100	1,651.00	57,950,100
人・夢・技術グループ	7,600	1,721.00	13,079,600
NISSOホールディングス	16,100	809.00	13,024,900

大栄環境	33,200	3,110.00	103,252,000	
日本管財ホールディングス	19,200	2,680.00	51,456,000	
M & A 総研ホールディングス	19,800	2,985.00	59,103,000	
エイチ・アイ・エス	58,500	1,683.00	98,455,500	
ラックランド	8,300	2,018.00	16,749,400	
共立メンテナンス	57,400	2,402.00	137,874,800	
イチネンホールディングス	19,500	1,834.00	35,763,000	
建設技術研究所	9,400	4,520.00	42,488,000	
スペース	13,400	1,222.00	16,374,800	
燦ホールディングス	17,000	1,181.00	20,077,000	
スバル興業	7,100	3,025.00	21,477,500	
東京テアトル	1,400	1,086.00	1,520,400	
タナベコンサルティンググループ	8,000	1,252.00	10,016,000	
ナガワ	5,700	7,340.00	41,838,000	
東京都競馬	13,400	4,385.00	58,759,000	
カナモト	28,400	2,975.00	84,490,000	
ニシオホールディングス	15,100	4,015.00	60,626,500	
トランス・コスモス	20,500	3,545.00	72,672,500	
乃村工藝社	79,900	818.00	65,358,200	
藤田観光	8,100	9,710.00	78,651,000	
KNT - CTホールディングス	10,900	1,345.00	14,660,500	
トーカイ	16,200	2,145.00	34,749,000	
セコム	372,000	5,294.00	1,969,368,000	
セントラル警備保障	9,900	2,847.00	28,185,300	
丹青社	35,600	835.00	29,726,000	
メイテックグループホールディングス	62,200	3,171.00	197,236,200	
応用地質	17,100	2,722.00	46,546,200	
船井総研ホールディングス	36,600	2,412.00	88,279,200	
進学会ホールディングス	1,800	227.00	408,600	
オオバ	2,800	1,019.00	2,853,200	
いであ	1,100	2,402.00	2,642,200	
学究社	7,400	1,943.00	14,378,200	
イオンディライト	19,600	4,055.00	79,478,000	
ナック	15,800	549.00	8,674,200	
ダイセキ	37,300	3,745.00	139,688,500	
ステップ	6,700	1,933.00	12,951,100	
合 計	329,583,100		661,440,523,950	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,896,391,553
国債証券	570,702,119,170
地方債証券	34,234,679,100
特殊債券	36,259,745,148
社債券	31,161,194,000
未収入金	2,734,138,340
未収利息	742,370,278
前払費用	39,279,883
流動資産合計	679,769,917,472
資産合計	679,769,917,472
負債の部	
流動負債	
未払金	6,616,900,800
未払解約金	162,477,632
流動負債合計	6,779,378,432
負債合計	6,779,378,432
純資産の部	
元本等	
元本	509,858,434,543
剰余金	
剰余金又は欠損金()	163,132,104,497
元本等合計	672,990,539,040
純資産合計	672,990,539,040
負債純資産合計	679,769,917,472

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2024年 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	509,858,434,543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。

		2024年 9月30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	有価証券	98,957,000円
	1口当たり純資産額	1.3200円
	(1万口当たり純資産額)	(13,200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

		2024年 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2024年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月 3日
期首元本額	483,216,028,480円
期中追加設定元本額	81,218,995,140円
期中一部解約元本額	54,576,589,077円
期末元本額	509,858,434,543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）	5,127,036,066円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,812,956円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,754,501,055円
世界経済インデックスファンド	9,164,628,308円
D C マイセレクション 2 5	29,450,299,637円

区分	2024年 9月30日現在
DCマイセレクション50	37,298,329,932円
DCマイセレクション75	12,565,557,950円
DC日本債券インデックス・オープン	396,805,472円
DC日本債券インデックス・オープンS	86,607,794,261円
DC日本債券インデックス・オープンP	60,392,016,233円
DCマイセレクションS25	18,599,925,995円
DCマイセレクションS50	22,545,361,722円
DCマイセレクションS75	6,179,771,034円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	234,426,546円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	3,191,354,132円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,335,713,422円
DC世界経済インデックスファンド	6,849,306,402円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	1,772,597円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	18,922,347円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	8,589,478円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,260,056円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	45,814,060円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	74,890,445円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	26,166,029円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	23,786,656円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,624,553,349円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	741,340,537円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,228,196,365円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	64,760,277円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	42,939,298円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	886,319,476円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	962,002,276円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,326,646,318円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	92,128,509円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,009,377,995円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,522,301,258円
分散投資コア戦略ファンドA	19,221,920,466円
分散投資コア戦略ファンドS	26,765,256,706円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	351,427,380円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,254,569,672円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	91,541,857円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	50,593,438円
SMT インデックスバランス・オープン	65,823,058円
SMT 世界経済インデックス・オープン	67,137,121円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	169,156,446円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	253,159,705円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	23,104,906円
グローバル経済コア	441,225,294円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	57,787,743円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	46,495,408円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	216,342,514円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	131,313,537円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	39,489,186円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	31,863,897円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	1,312,124,531円
10資産分散投資ファンド	475,287,609円
グローバル10資産バランスファンド	673,633,453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	814,846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	154,544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	720,489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	228,181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	192,182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	210,850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	400,617円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	34,701,929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）	107,981,834,037円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	57,262,531円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	22,253,252円

区分	2024年 9月30日現在
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	603,771,469円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	7,523,870,870
地方債証券	341,697,934
特殊債券	340,345,949
社債券	238,939,000
合計	8,444,853,753

(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 4 5 4 回利付国債（2年）	1,910,000,000	1,907,001,300	
	第 4 5 5 回利付国債（2年）	1,550,000,000	1,545,210,500	
	第 4 5 6 回利付国債（2年）	1,100,000,000	1,097,382,000	
	第 4 5 7 回利付国債（2年）	2,720,000,000	2,712,574,400	
	第 4 5 8 回利付国債（2年）	1,490,000,000	1,487,481,900	
	第 4 5 9 回利付国債（2年）	1,030,000,000	1,028,001,800	
	第 4 6 0 回利付国債（2年）	2,300,000,000	2,298,551,000	
	第 4 6 1 回利付国債（2年）	2,850,000,000	2,852,337,000	
	第 4 6 2 回利付国債（2年）	1,580,000,000	1,581,090,200	
	第 4 6 3 回利付国債（2年）	2,870,000,000	2,871,549,800	
	第 4 6 4 回利付国債（2年）	1,890,000,000	1,890,718,200	
	第 1 4 6 回利付国債（5年）	5,160,000,000	5,148,699,600	
	第 1 4 7 回利付国債（5年）	5,900,000,000	5,872,447,000	
	第 1 4 8 回利付国債（5年）	4,960,000,000	4,930,339,200	
	第 1 4 9 回利付国債（5年）	4,580,000,000	4,546,840,800	
	第 1 5 0 回利付国債（5年）	4,340,000,000	4,304,629,000	
	第 1 5 1 回利付国債（5年）	3,250,000,000	3,220,620,000	
	第 1 5 2 回利付国債（5年）	690,000,000	685,363,200	
	第 1 5 3 回利付国債（5年）	5,850,000,000	5,790,973,500	
	第 1 5 4 回利付国債（5年）	5,100,000,000	5,057,313,000	
第 1 5 5 回利付国債（5年）	2,670,000,000	2,661,936,600		

第156回利付国債（5年）	3,490,000,000	3,468,362,000	
第157回利付国債（5年）	2,660,000,000	2,641,353,400	
第158回利付国債（5年）	3,220,000,000	3,186,415,400	
第159回利付国債（5年）	1,750,000,000	1,729,490,000	
第160回利付国債（5年）	1,730,000,000	1,716,056,200	
第161回利付国債（5年）	2,840,000,000	2,827,504,000	
第162回利付国債（5年）	1,710,000,000	1,700,988,300	
第163回利付国債（5年）	4,240,000,000	4,234,191,200	
第164回利付国債（5年）	1,750,000,000	1,731,870,000	
第165回利付国債（5年）	2,510,000,000	2,494,387,800	
第166回利付国債（5年）	1,540,000,000	1,536,796,800	
第167回利付国債（5年）	1,160,000,000	1,156,438,800	
第168回利付国債（5年）	2,410,000,000	2,423,688,800	
第169回利付国債（5年）	1,780,000,000	1,782,331,800	
第170回利付国債（5年）	2,580,000,000	2,592,487,200	
第171回利付国債（5年）	3,070,000,000	3,056,553,400	
第172回利付国債（5年）	650,000,000	650,149,500	
第1回利付国債（40年）	740,000,000	811,905,800	
第2回利付国債（40年）	1,030,000,000	1,085,228,600	
第3回利付国債（40年）	730,000,000	764,302,700	
第4回利付国債（40年）	1,030,000,000	1,070,273,000	
第5回利付国債（40年）	1,050,000,000	1,039,857,000	
第6回利付国債（40年）	1,630,000,000	1,573,308,600	
第7回利付国債（40年）	1,460,000,000	1,336,659,200	
第8回利付国債（40年）	1,480,000,000	1,248,098,800	
第9回利付国債（40年）	2,260,000,000	1,374,509,400	
第10回利付国債（40年）	2,140,000,000	1,526,397,800	
第11回利付国債（40年）	1,915,000,000	1,301,644,650	
第12回利付国債（40年）	1,430,000,000	853,867,300	
第13回利付国債（40年）	2,360,000,000	1,376,942,000	
第14回利付国債（40年）	2,270,000,000	1,406,060,700	
第15回利付国債（40年）	2,950,000,000	2,012,195,000	
第16回利付国債（40年）	2,680,000,000	2,000,325,200	
第17回利付国債（40年）	1,070,000,000	1,033,951,700	
第341回利付国債（10年）	5,030,000,000	5,031,207,200	
第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	4,744,339,600	
第343回利付国債（10年）	3,670,000,000	3,653,998,800	
第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	5,868,258,000	
第345回利付国債（10年）	4,880,000,000	4,850,427,200	
第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,711,360,000	
第347回利付国債（10年）	3,840,000,000	3,811,046,400	
第348回利付国債（10年）	4,340,000,000	4,303,674,200	

第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,111,599,200	
第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	6,501,474,900	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	5,325,000,000	5,262,591,000	
第352回利付国債(10年)	4,230,000,000	4,174,671,600	
第353回利付国債(10年)	4,415,000,000	4,350,982,500	
第354回利付国債(10年)	4,420,000,000	4,347,512,000	
第355回利付国債(10年)	4,170,000,000	4,094,022,600	
第356回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,706,880,000	
第357回利付国債(10年)	4,630,000,000	4,535,779,500	
第358回利付国債(10年)	3,370,000,000	3,297,376,500	
第359回利付国債(10年)	4,065,000,000	3,972,399,300	
第360回利付国債(10年)	5,370,000,000	5,239,401,600	
第361回利付国債(10年)	5,580,000,000	5,433,859,800	
第362回利付国債(10年)	4,550,000,000	4,422,145,000	
第363回利付国債(10年)	5,260,000,000	5,101,674,000	
第364回利付国債(10年)	5,120,000,000	4,953,702,400	
第365回利付国債(10年)	4,767,000,000	4,600,441,020	
第366回利付国債(10年)	5,400,000,000	5,238,162,000	
第367回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,633,271,200	
第368回利付国債(10年)	6,120,000,000	5,902,372,800	
第369回利付国債(10年)	5,170,000,000	5,095,552,000	
第370回利付国債(10年)	5,880,000,000	5,779,040,400	
第371回利付国債(10年)	5,540,000,000	5,383,495,000	
第372回利付国債(10年)	5,360,000,000	5,377,956,000	
第373回利付国債(10年)	6,180,000,000	6,073,827,600	
第374回利付国債(10年)	5,320,000,000	5,308,296,000	
第375回利付国債(10年)	5,700,000,000	5,827,908,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	122,416,800	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	176,137,600	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	131,977,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	125,756,400	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	55,350,000	
第6回利付国債(30年)	580,000,000	653,236,600	
第7回利付国債(30年)	880,000,000	989,181,600	
第8回利付国債(30年)	850,000,000	925,590,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	253,747,200	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	165,113,600	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	281,130,200	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	212,002,000	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	442,732,000	
第14回利付国債(30年)	750,000,000	857,475,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	391,938,400	

第16回利付国債(30年)	400,000,000	461,296,000
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,292,855,600
第18回利付国債(30年)	505,000,000	572,897,250
第19回利付国債(30年)	630,000,000	715,163,400
第20回利付国債(30年)	660,000,000	763,144,800
第21回利付国債(30年)	960,000,000	1,089,734,400
第22回利付国債(30年)	300,000,000	347,001,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	497,651,900
第24回利付国債(30年)	780,000,000	902,662,800
第25回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,134,750,000
第26回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,844,496,500
第27回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,584,994,100
第28回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,862,335,300
第29回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,021,694,000
第30回利付国債(30年)	1,970,000,000	2,220,682,500
第31回利付国債(30年)	1,760,000,000	1,956,028,800
第32回利付国債(30年)	1,950,000,000	2,189,811,000
第33回利付国債(30年)	2,410,000,000	2,597,016,000
第34回利付国債(30年)	2,085,000,000	2,298,962,700
第35回利付国債(30年)	2,480,000,000	2,654,889,600
第36回利付国債(30年)	2,310,000,000	2,466,433,200
第37回利付国債(30年)	2,705,000,000	2,838,058,950
第38回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,430,643,600
第39回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,879,128,000
第40回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,322,727,300
第41回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,319,549,900
第42回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,566,864,000
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,392,043,300
第44回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,607,601,100
第45回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,539,104,000
第46回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,794,134,100
第47回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,773,080,400
第48回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,611,571,200
第49回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,700,371,400
第50回利付国債(30年)	1,860,000,000	1,533,997,800
第51回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,345,996,800
第52回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,380,849,000
第53回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,204,133,000
第54回利付国債(30年)	1,880,000,000	1,522,029,200
第55回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,289,008,000
第56回利付国債(30年)	1,780,000,000	1,426,954,800
第57回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,381,110,900
第58回利付国債(30年)	2,090,000,000	1,661,591,800

第59回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,120,618,000	
第60回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,299,881,800	
第61回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,171,077,300	
第62回利付国債(30年)	1,335,000,000	964,817,850	
第63回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,021,240,800	
第64回利付国債(30年)	1,620,000,000	1,126,434,600	
第65回利付国債(30年)	1,235,000,000	854,335,950	
第66回利付国債(30年)	1,515,000,000	1,041,850,350	
第67回利付国債(30年)	1,695,000,000	1,226,383,350	
第68回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,201,581,700	
第69回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,258,371,900	
第70回利付国債(30年)	1,920,000,000	1,405,344,000	
第71回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,070,145,300	
第72回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,311,580,300	
第73回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,327,192,000	
第74回利付国債(30年)	2,110,000,000	1,646,897,200	
第75回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,455,639,300	
第76回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,557,921,300	
第77回利付国債(30年)	1,890,000,000	1,704,420,900	
第78回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,252,256,600	
第79回利付国債(30年)	950,000,000	772,606,500	
第80回利付国債(30年)	2,270,000,000	2,135,774,900	
第81回利付国債(30年)	1,910,000,000	1,710,729,700	
第82回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,565,975,700	
第83回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,578,284,400	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	296,411,900	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	479,818,300	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	297,528,400	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	524,728,800	
第87回利付国債(20年)	1,790,000,000	1,839,081,800	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	433,981,800	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	361,053,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	652,541,400	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	466,983,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	913,501,600	
第93回利付国債(20年)	120,000,000	124,778,400	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	635,784,700	
第95回利付国債(20年)	830,000,000	873,101,900	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,663,998,600	
第97回利付国債(20年)	900,000,000	948,240,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	462,290,400	
第99回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,486,887,300	

第100回利付国債（20年）	480,000,000	509,620,800
第101回利付国債（20年）	715,000,000	764,006,100
第102回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,266,222,600
第103回利付国債（20年）	400,000,000	427,760,000
第104回利付国債（20年）	160,000,000	169,932,800
第105回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,257,396,200
第106回利付国債（20年）	680,000,000	727,260,000
第107回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,175,878,000
第108回利付国債（20年）	840,000,000	890,979,600
第109回利付国債（20年）	920,000,000	977,969,200
第110回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,179,189,000
第111回利付国債（20年）	970,000,000	1,046,959,800
第112回利付国債（20年）	990,000,000	1,063,982,700
第113回利付国債（20年）	2,020,000,000	2,178,832,600
第114回利付国債（20年）	1,830,000,000	1,980,938,400
第115回利付国債（20年）	700,000,000	761,299,000
第116回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,812,056,000
第117回利付国債（20年）	1,980,000,000	2,150,834,400
第118回利付国債（20年）	660,000,000	715,624,800
第119回利付国債（20年）	460,000,000	493,515,600
第120回利付国債（20年）	1,070,000,000	1,136,051,100
第121回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,751,463,000
第122回利付国債（20年）	750,000,000	806,512,500
第123回利付国債（20年）	1,800,000,000	1,972,512,000
第124回利付国債（20年）	760,000,000	828,255,600
第125回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,370,311,600
第126回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,190,912,200
第127回利付国債（20年）	1,020,000,000	1,107,699,600
第128回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,762,819,200
第129回利付国債（20年）	740,000,000	800,443,200
第130回利付国債（20年）	2,055,000,000	2,226,674,700
第131回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,389,110,700
第132回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,325,903,100
第133回利付国債（20年）	1,810,000,000	1,963,687,100
第134回利付国債（20年）	1,140,000,000	1,238,632,800
第135回利付国債（20年）	170,000,000	183,492,900
第136回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,329,552,800
第137回利付国債（20年）	1,390,000,000	1,501,116,600
第138回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,416,716,000
第139回利付国債（20年）	480,000,000	514,833,600
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,691,167,100
第141回利付国債（20年）	1,700,000,000	1,837,836,000
第142回利付国債（20年）	1,315,000,000	1,432,429,500

第143回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,738,600,200	
第144回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,235,144,800	
第145回利付国債(20年)	2,275,000,000	2,459,889,250	
第146回利付国債(20年)	2,670,000,000	2,886,804,000	
第147回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,935,745,600	
第148回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,505,352,400	
第149回利付国債(20年)	2,950,000,000	3,126,321,500	
第150回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,506,201,800	
第151回利付国債(20年)	2,205,000,000	2,265,835,950	
第152回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,481,129,200	
第153回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,428,819,000	
第154回利付国債(20年)	2,735,000,000	2,793,200,800	
第155回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,435,071,200	
第156回利付国債(20年)	2,690,000,000	2,503,367,800	
第157回利付国債(20年)	2,910,000,000	2,632,677,000	
第158回利付国債(20年)	2,790,000,000	2,604,660,300	
第159回利付国債(20年)	2,640,000,000	2,484,424,800	
第160回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,286,752,600	
第161回利付国債(20年)	2,520,000,000	2,351,865,600	
第162回利付国債(20年)	1,820,000,000	1,691,744,600	
第163回利付国債(20年)	2,620,000,000	2,425,412,600	
第164回利付国債(20年)	2,370,000,000	2,155,183,200	
第165回利付国債(20年)	2,310,000,000	2,089,972,500	
第166回利付国債(20年)	2,150,000,000	1,990,405,500	
第167回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,096,452,800	
第168回利付国債(20年)	1,740,000,000	1,527,928,800	
第169回利付国債(20年)	2,160,000,000	1,857,578,400	
第170回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,164,136,700	
第171回利付国債(20年)	2,060,000,000	1,752,606,800	
第172回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,504,562,500	
第173回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,223,494,000	
第174回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,007,416,000	
第175回利付国債(20年)	2,210,000,000	1,900,600,000	
第176回利付国債(20年)	2,380,000,000	2,036,137,600	
第177回利付国債(20年)	2,230,000,000	1,865,952,500	
第178回利付国債(20年)	2,460,000,000	2,083,546,200	
第179回利付国債(20年)	2,825,000,000	2,381,362,000	
第180回利付国債(20年)	2,300,000,000	2,034,925,000	
第181回利付国債(20年)	2,540,000,000	2,277,262,400	
第182回利付国債(20年)	2,240,000,000	2,070,656,000	
第183回利付国債(20年)	2,490,000,000	2,411,241,300	
第184回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,323,172,500	

	第185回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,270,316,000	
	第186回利付国債（20年）	2,500,000,000	2,442,275,000	
	第187回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,910,981,100	
	第188回利付国債（20年）	1,980,000,000	1,955,329,200	
	第189回利付国債（20年）	1,260,000,000	1,303,948,800	
	国債証券合計	589,987,000,000	570,702,119,170	
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	99,187,000	
	第5回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	71,474,000	
	第6回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（5年））	100,000,000	99,559,000	
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	112,254,000	
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	108,990,000	
	第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	104,355,000	
	第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	100,539,000	
	第16回東京都公募公債（20年）	200,000,000	212,152,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	106,451,000	
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	107,206,000	
	第19回東京都公募公債（30年）	100,000,000	72,622,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	215,090,000	
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	214,342,000	
	第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,124,000	
	第38回東京都公募公債（20年）	200,000,000	165,956,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	99,993,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	99,365,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	99,207,000	
	第781回東京都公募公債	300,000,000	296,046,000	
	第800回東京都公募公債	200,000,000	194,828,000	
	第830回東京都公募公債	300,000,000	289,689,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	99,747,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,467,000	
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,464,000	
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	197,096,000	
	令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	196,412,000	
	令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,507,000	
	第39回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	97,921,000	
	第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	231,526,000	
	第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,094,000	
	第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	215,712,000	
	第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	108,687,000	
	第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,296,000	
	第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	103,787,000	
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	99,787,000	

第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,340,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,207,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	194,778,000	
第260回神奈川県公募公債	208,000,000	207,413,440	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	215,828,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	300,000,000	323,688,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	107,447,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,154,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,182,560	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,364,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	197,082,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,497,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	97,071,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	154,784,000	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	175,771,960	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	192,998,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	107,871,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	107,585,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	90,501,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	92,385,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	136,129,045	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	105,545,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,103,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	102,427,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	102,329,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	433,660,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	90,464,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	293,100,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	94,575,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	78,144,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	107,310,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	104,678,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,234,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,301,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,212,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	301,899,700	
令和5年度第7回静岡県公募公債	165,000,000	163,729,500	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	107,921,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,986,000	

平成27年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,752,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,349,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,576,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	275,034,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,856,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	76,923,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	194,732,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,323,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	142,690,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,521,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	107,119,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	215,000,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	125,405,322	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,226,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	379,337,400	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	97,185,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	99,000,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	105,258,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	106,786,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	82,358,000	
第7回埼玉県公募公債(15年)	600,000,000	553,968,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	215,954,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	182,998,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	215,712,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	181,804,000	
第23回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	90,125,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	400,000,000	400,460,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,237,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,474,000	
第28回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	167,724,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,231,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	97,027,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	96,888,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	144,174,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	105,446,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,285,000	

平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	101,492,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,769,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	102,193,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	106,730,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	102,059,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,109,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	76,923,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	90,827,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	292,350,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,742,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	90,367,000	
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	98,755,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	98,508,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	213,572,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	107,583,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	107,310,000	
第20回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	92,089,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,241,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,199,600	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	291,672,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	97,227,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	127,669,100	
令和6年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	99,334,000	
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	291,156,000	
令和4年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	290,715,000	
令和6年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	302,451,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	98,669,000	
令和6年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	100,733,000	
第1回群馬県公募公債(20年)	200,000,000	214,386,000	
第28回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	98,465,000	
第30回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	101,116,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	99,151,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,157,000	
第153回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,575,000	
第154回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,095,000	
第156回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,070,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,463,000	

第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,706,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,552,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	396,952,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,103,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,333,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,463,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,432,000	
第174回共同発行市場公募地方債	594,300,000	588,362,943	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,184,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,523,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,611,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,518,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	193,360,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,669,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,799,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,307,000	
第255回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,348,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	97,249,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	98,427,530	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,140,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,163,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,269,000	
令和2年度第1回静岡市公募公債	200,000,000	194,146,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	216,470,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	71,065,000	
第19回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	100,805,000	
第19回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	102,251,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	600,000,000	546,780,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	93,179,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	193,572,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	114,638,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	113,775,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	106,368,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	99,398,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	99,397,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	292,281,000	
第528回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,116,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	198,662,000	
令和2年度第1回京都市公募公債	200,000,000	194,410,000	
令和5年度第7回京都市公募公債	100,000,000	99,639,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	124,308,000	
	200,000,000	213,494,000	

平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）			
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,617,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	107,405,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	72,038,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	71,209,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	322,599,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,324,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,351,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	98,900,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,032,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	207,138,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	292,311,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	96,783,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	102,410,000	
平成26年度第10回札幌市公募公債（20年）	100,000,000	102,147,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	99,781,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	196,100,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	107,187,000	
第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	179,758,000	
第17回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	105,822,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,319,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,974,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,138,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,479,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	107,621,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	105,340,000	
2023年度第8回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	99,132,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,290,200	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	168,459,800	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	536,162,000	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	194,600,000	
令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	289,095,000	
令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	96,726,000	
令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	97,965,000	
平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	98,159,000	
第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	105,594,000	

地方債証券合計		34,577,030,000	34,234,679,100	
特殊債券	第37回新関西国際空港株式会社社債	100,000,000	92,884,000	
	第1回国立大学法人東京大学債券	100,000,000	61,171,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,223,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,236,000	
	第109回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	62,143,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	52,962,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	130,000,000	132,798,900	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,874,000	
	第21回道路債券	100,000,000	115,459,000	
	第28回道路債券	200,000,000	232,440,000	
	第33回道路債券	200,000,000	233,996,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,252,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,202,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,784,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,937,000	
	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	107,434,000	
	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	215,096,000	
	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	216,648,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,303,000	
	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	109,605,000	
	第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,170,000	
	第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,804,000	
	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	107,966,000	
	第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	91,653,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,436,000		
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,348,000		
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,984,000		
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,159,000		

第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	547,032,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,063,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	71,865,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,256,000	
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,428,000	
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	207,936,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,366,000	
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	203,636,000	
第247回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	166,520,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,892,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,676,000	
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	73,675,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	247,000,000	244,690,550	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,463,000	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	111,115,200	
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	203,458,400	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,276,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,957,000	
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	99,269,000	
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	198,466,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	286,422,000	
第314回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,752,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,967,000	
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	99,151,000	
第331回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,785,000	
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	118,888,800	
	200,000,000	197,544,000	

第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	272,463,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	211,528,300	
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	97,455,000	
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	97,245,000	
第400回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	274,232,000	
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	116,359,200	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	338,145,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	102,453,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	347,325,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	230,924,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	113,904,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	215,566,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	212,502,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	139,880,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,587,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	538,415,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	106,728,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	106,915,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	529,600,000	
第43回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	100,641,000	
第45回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	101,183,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,124,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,053,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,690,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	201,000,000	199,954,800	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,826,000	
第86回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	251,205,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,140,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,223,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	249,102,440	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	359,000,000	355,970,040	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,213,000	

第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,164,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	108,992,400	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	154,302,720	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,872,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,103,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,775,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,416,000	
F143回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,392,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	196,454,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,995,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,528,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,718,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,572,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,105,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,114,000	
F246回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,160,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,071,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,089,000	
第33回首都高速道路株式会社社債	200,000,000	199,122,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,341,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,650,000	
第30回阪神高速道路株式会社社債	300,000,000	298,410,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	107,555,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,216,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,344,800	
第44回政府保証日本政策金融公庫債券	117,000,000	116,131,860	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,210,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	207,744,600	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	184,886,900	
第117回都市再生債券	200,000,000	201,286,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	106,672,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	59,307,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	122,426,000	
第191回都市再生債券	100,000,000	83,625,000	
第17回政府保証民間都市開発債券	300,000,000	299,031,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	97,216,000	
第23回政府保証中部国際空港債券	104,000,000	103,459,200	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	79,215,000	78,294,521	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,250,000	
	55,292,000	54,734,656	

第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券			
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	104,143,000	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	95,934,000	94,644,647	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	109,902,000	107,988,606	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	39,018,000	38,424,146	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	138,879,000	136,461,116	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	94,962,000	93,393,227	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,548,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,726,000	13,041,986	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,209,000	12,522,038	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,837,000	14,311,193	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,038,000	16,599,169	
第29回政府保証住宅金融支援機構債券	600,000,000	600,438,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,888,000	17,535,823	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,268,000	17,898,282	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,978,000	37,269,969	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,102,000	16,600,839	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,633,000	17,139,142	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,227,000	16,728,252	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,390,000	15,856,317	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,414,000	33,283,667	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,206,000	17,676,412	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,026,000	23,607,406	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,891,000	22,441,339	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,041,000	22,612,302	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,220,000	48,269,700	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,456,000	60,138,554	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,814,000	31,096,256	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,721,000	97,331,027	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,275,000	32,845,944	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,942,000	28,455,573	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,784,000	27,081,570	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,674,000	32,280,240	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	163,084,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,290,000	83,201,773	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	112,164,000	113,283,396	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,574,000	32,723,840	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,002,000	34,140,388	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,015,000	35,010,097	

第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,622,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,800,000	109,618,830	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,835,000	37,620,097	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,054,000	78,815,564	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,375,000	44,701,635	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,314,000	47,321,147	
第 9 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	307,764,000	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,580,000	46,846,316	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,508,000	147,506,087	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,590,000	99,021,801	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,262,000	48,387,599	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,977,000	51,915,870	
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,155,000	55,918,629	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,600,000	61,172,324	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,748,000	60,162,175	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,503,000	61,074,020	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,850,000	61,724,878	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,234,000	61,923,374	
第 1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,432,000	123,862,140	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,286,000	63,616,894	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	269,976,000	255,394,596	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,891,000	63,073,530	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,799,000	62,982,105	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,673,000	63,781,125	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,156,000	129,805,851	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	135,084,000	127,263,987	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,938,000	131,017,144	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,402,000	65,294,095	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,044,000	129,489,413	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,735,000	65,502,782	
	140,890,000	131,874,448	

第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	140,696,000	131,667,537	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,405,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,576,000	67,336,553	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,981,000	66,955,667	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,149,000	66,366,364	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,204,000	136,483,132	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,885,000	68,359,879	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,910,000	67,594,861	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,464,000	138,171,994	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,489,000	69,219,638	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	229,116,000	208,722,384	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,804,000	140,897,956	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,906,000	72,935,182	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,701,000	73,410,997	
第158回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,043,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,052,000	150,554,064	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,598,000	76,140,488	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,612,000	153,469,645	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,892,000	155,186,414	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,438,000	76,892,288	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,042,000	155,536,314	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,294,000	154,564,599	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,249,000	78,620,037	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,234,000	79,155,050	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	257,739,000	236,563,163	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,475,000	79,411,722	
	88,092,000	81,145,064	

第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,571,000	81,490,945	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,081,000	82,966,480	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,923,000	83,836,112	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,982,000	169,177,746	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,027,000	87,700,810	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,258,000	178,562,930	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,687,000	90,371,678	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	88,537,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,703,000	90,373,373	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,683,000	91,168,548	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,978,000	187,137,432	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,790,000	94,269,812	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,922,000	94,696,116	
第206回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,287,000	100,025,695	
第208回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,358,000	
第299回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	59,886,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	70,263,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	282,576,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,492,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,513,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,714,000	
い第876号商工債	400,000,000	395,648,000	
い第878号商工債	100,000,000	98,753,000	
い第888号商工債	200,000,000	200,224,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,357,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,181,000	
第384回信金中金債（5年）	200,000,000	197,736,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	395,400,000	
第394回信金中金債（5年）	100,000,000	98,750,000	
第411回信金中金債（5年）	200,000,000	198,456,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	99,945,000	
第20回アンデス開発公社円貨債券（2023）	300,000,000	298,305,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	106,976,000	

	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,297,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	195,006,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	485,795,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,903,000	
	第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,155,000	
	第111回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,765,000	
	第114回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,412,000	
	第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,558,000	
	第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,268,000	
	第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,370,000	
	第103回中日本高速道路株式会社社債	400,000,000	399,380,000	
	第104回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,507,000	
	第105回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,496,000	
	第107回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,370,000	
	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,272,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,552,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,530,000	
	第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,116,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,518,000	
	第82回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,742,000	
	第85回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,395,000	
	第91回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,713,000	
	第93回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,931,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,143,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	186,906,000	
	特殊債券合計	37,093,188,000	36,259,745,148	
社債券	第41回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	200,000,000	199,618,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,165,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,168,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,077,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	398,536,000	
	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	99,418,000	
	第8回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債（2023）	400,000,000	398,376,000	
	第12回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	99,805,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	96,751,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,839,000	

第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,303,000	
第9回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,433,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,402,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,820,000	
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	99,693,000	
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	99,635,000	
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	198,366,000	
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	97,524,000	
第27回株式会社ニチレイ無担保社債	200,000,000	198,998,000	
第7回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,536,000	
第8回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,239,000	
第9回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,724,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,408,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,448,000	
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	98,564,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,914,000	
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	99,557,000	
第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,747,000	
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	199,168,000	
第16回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,533,000	
第17回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,550,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,566,000	
第9回株式会社クレハ無担保社債	100,000,000	100,021,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,459,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,626,000	
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	98,589,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	197,692,000	
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	79,389,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,626,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,880,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	195,602,000	
第2回株式会社ADEKA無担保社債	100,000,000	99,473,000	

第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	285,795,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,716,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	198,896,000	
第10回テルモ株式会社無担保社債	300,000,000	299,403,000	
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	99,522,000	
第10回関西ペイント株式会社無担保社債	200,000,000	200,328,000	
第23回株式会社オリエントランド無担保社債	100,000,000	100,037,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,734,000	
第2回サワイグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,611,000	
第20回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,968,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,278,000	
第2回インフロニア・ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,067,000	
第11回株式会社プリヂストン無担保社債	100,000,000	99,037,000	
第13回株式会社プリヂストン無担保社債	100,000,000	99,413,000	
第14回株式会社プリヂストン無担保社債	100,000,000	98,043,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	96,854,000	
第20回住友大阪セメント株式会社無担保社債	100,000,000	100,448,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,291,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,722,000	
第17回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	100,377,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,344,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	98,375,000	
第59回日本精工株式会社無担保社債	100,000,000	100,218,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,574,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	97,004,000	
第23回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,659,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,130,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,691,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,481,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	96,302,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,801,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,444,000	
第39回ソニーグループ株式会社無担保社債	500,000,000	497,060,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,746,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,973,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,087,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,299,000	
第28回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,931,000	

第29回J A三井リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,790,000	
第31回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,021,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,363,000	
第32回いすゞ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,730,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	192,500,000	
第32回マツダ株式会社無担保社債	100,000,000	100,629,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	99,820,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,253,000	
第4回オリックス銀行株式会社無担保社債	200,000,000	199,872,000	
第9回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	92,017,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	83,438,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,062,000	
第119回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,055,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	107,481,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	195,210,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,897,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,503,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	200,000,000	192,916,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,347,000	
第43回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	198,376,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	100,000,000	98,871,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,907,000	
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	96,677,000	
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	98,971,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	108,122,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,089,000	
第41回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,848,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,774,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,046,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	389,300,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,005,000	
第26回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	194,994,000	
第30回NTTファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	301,107,000	
第34回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,203,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,800,000	
	100,000,000	99,257,000	

第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債			
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,693,000	
第86回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	300,000,000	300,315,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,207,000	
第44回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,194,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,014,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,146,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,865,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,880,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,238,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,739,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,645,000	
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	198,676,000	
第42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	199,378,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,878,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,937,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,525,000	
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	98,626,000	
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	99,517,000	
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	98,738,000	
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	198,382,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,010,000	
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	197,760,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,130,000	
第84回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	197,798,000	
第86回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	190,344,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,738,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	83,738,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,666,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,897,000	
第17回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	87,192,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,630,000	
第135回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,207,000	

第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	77,442,000	
第89回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	88,112,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,126,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,474,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,674,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	70,792,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,917,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,640,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,627,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	213,776,000	
第109回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,020,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,056,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	81,436,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	70,420,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,174,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	70,694,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	83,030,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	61,660,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,035,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	67,153,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	79,633,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	82,792,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,108,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,388,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,318,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	70,194,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	58,858,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	48,567,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	62,575,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	73,632,000	
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	141,804,000	
第56回名古屋鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	88,090,000	
第13回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	100,686,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,233,000	

第32回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,998,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,926,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	169,060,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	92,654,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,551,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	91,644,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	82,242,000	
第545回中部電力株式会社社債	100,000,000	95,613,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,432,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,922,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,172,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,997,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,627,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,226,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,243,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,282,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,962,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,830,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,840,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	291,903,000	
第457回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,252,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,179,000	
第323回北陸電力株式会社社債	100,000,000	90,502,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,696,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	179,778,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,006,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,457,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,682,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,728,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,974,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,230,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,241,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,738,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,642,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,804,000	
第476回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,251,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,910,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,288,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,365,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,602,000	
第332回北海道電力株式会社社債	100,000,000	92,774,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,444,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	87,777,000	

第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	98,045,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	89,528,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,260,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,555,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,279,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,146,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,321,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,848,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,373,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,697,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,060,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	265,875,000	
第64回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,387,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	93,622,000	
第69回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,234,000	
第75回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,830,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	95,802,000	
第22回株式会社JERA無担保社債	200,000,000	198,924,000	
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	99,942,000	
第5回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	98,227,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	70,507,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	193,352,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,844,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	82,545,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	197,560,000	
社債券合計	32,300,000,000	31,161,194,000	
合計		672,357,737,418	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	10,375,925,139
コール・ローン	2,066,175,817
株式	731,363,188,888
投資信託受益証券	122,024,893
投資証券	14,720,551,505
派生商品評価勘定	306,365,511
未収入金	4,048,885
未収配当金	764,079,134
未収利息	12,144
差入委託証拠金	7,658,821,670
流動資産合計	767,381,193,586
資産合計	767,381,193,586
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,310,848
前受金	303,233,879
未払解約金	530,163,191
流動負債合計	862,707,918
負債合計	862,707,918
純資産の部	
元本等	
元本	117,167,283,618
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	649,351,202,050
元本等合計	766,518,485,668
純資産合計	766,518,485,668
負債純資産合計	767,381,193,586

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券</p>

2024年 9月30日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <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 9月30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	117,167,283,618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 6.5421円 (1万口当たり純資産額) (65,421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

2024年 9月30日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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つた場合、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ぬ。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありませぬ。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月 3日
期首元本額	114,577,143,137円
期中追加設定元本額	13,699,425,059円
期中一部解約元本額	11,109,284,578円
期末元本額	117,167,283,618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)	1,400,746,250円
S B I 資産設計オープン (分配型)	5,292,308円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,686,745,167円
世界経済インデックスファンド	15,043,303,209円
外国株式インデックス・オープン	871,255,624円
D C マイセクション 2 5	517,912,121円
D C マイセクション 5 0	2,986,004,537円
D C マイセクション 7 5	3,946,646,333円
D C 外国株式インデックス・オープン	13,409,320,994円
D C マイセクション S 2 5	326,948,366円
D C マイセクション S 5 0	1,778,970,665円
D C マイセクション S 7 5	1,945,526,785円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	7,926,249円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	116,555,618円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	96,839,605円
D C 世界経済インデックスファンド	8,620,573,743円
外国株式インデックス・オープン (S M A 専用)	873,837,185円
マイセクション 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	1,536,969円
マイセクション 7 5 V A 1 (適格機関投資家専用)	2,714,147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)	12,063,090円
バランス 3 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	4,670,631円
バランス 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	18,803,578円
バランス 2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	5,567,393円
バランス 5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	17,341,156円

区分	2024年 9月30日現在
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	96,628,639円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	103,376,471円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	808,812,565円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	54,517,863円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	11,833,992円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	87,457,037円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	27,556,506円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	696,998,367円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	675,963,066円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,145,397,376円
コア投資戦略ファンド（安定型）	106,117,974円
コア投資戦略ファンド（成長型）	263,824,942円
分散投資コア戦略ファンドA	1,285,712,778円
分散投資コア戦略ファンドS	6,018,408,147円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,564,201,992円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	975,312,104円
コア投資戦略ファンド（切替型）	84,277,565円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	425,578,005円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	22,508,331円
SMT インデックスバランス・オープン	102,563,007円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	65,295,576円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	5,745,625,656円
SMT 世界経済インデックス・オープン	273,888,332円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,284,782,264円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	208,390,515円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,630,611円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	2,945,880,325円
グローバル経済コア	685,542,718円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,027,214円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,803,312円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	95,535,998円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,938,040円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	170,132,188円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	179,920,648円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	81,016,052円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	104,498,197円
10資産分散投資ファンド	60,406,217円
グローバル10資産バランスファンド	19,722,659円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	2,784,348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	102,240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	22,941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	129,099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	39,761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	28,777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	14,732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	20,312円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	196,948円
DC全世界株式インデックスファンド（オール・カンントリー）	67,382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）	43,586,155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）	455,880,313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）	714,446,027円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,467,379,379円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	109,575,415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）	52,091,389円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	74,111,360円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	85,923,936円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	148,051,885円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	161,831,680円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	161,134,831円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	144,550,011円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	143,116,935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）	66,943,643円

区分	2024年 9月30日現在
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	103,069,147円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	43,524,243,628	
投資信託受益証券	1,842,738	
投資証券	2,188,485,298	
合計	45,710,886,188	

(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

（2024年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	20,064,132,381	-		20,367,366,260	303,233,879
合計		20,064,132,381	-		20,367,366,260	303,233,879

(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 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,654,714,100	-		1,628,534,884	26,179,216
	アメリカドル	1,359,000,800	-		1,338,578,634	20,422,166
	ユーロ	178,718,100	-		175,354,630	3,363,470
	イギリスポンド	116,995,200	-		114,601,620	2,393,580
合計		1,654,714,100	-		1,628,534,884	26,179,216

(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	33,009	24.53	809,710.77	
	BAKER HUGHES CO	77,332	36.18	2,797,871.76	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	179.63	3,251,123.37	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	82.60	700,613.20	
	CHEVRON CORP	138,866	145.49	20,203,614.34	
	CHORD ENERGY CORP	4,800	130.80	627,840.00	
	CONOCOPHILLIPS	93,272	104.72	9,767,443.84	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	23.74	1,294,922.04	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	38.96	1,957,973.76	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	170.63	2,263,748.21	
	EOG RESOURCES INC	45,763	122.44	5,603,221.72	
	EQT CORPORATION	43,539	36.53	1,590,479.67	
	EXXON MOBIL	355,800	115.82	41,208,756.00	
	HALLIBURTON CO	70,302	28.65	2,014,152.30	
	HESS CORP	21,602	133.61	2,886,243.22	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	45.29	608,199.41	
	KINDER MORGAN INC	160,038	21.79	3,487,228.02	
	MARATHON OIL CORP	39,344	26.48	1,041,829.12	
	MARATHON PETROLEUM CORP	27,588	163.65	4,514,776.20	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	55,201	51.03	2,816,907.03	
	ONEOK INC	47,287	90.24	4,267,178.88	
	OVINTIV INC	20,398	38.37	782,671.26	
	PHILLIPS 66	32,264	131.05	4,228,197.20	
	SCHLUMBERGER	110,287	42.29	4,664,037.23	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	146.80	2,539,346.40	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,599	887.08	1,418,440.92	
	VALERO ENERGY CORP	26,282	135.97	3,573,563.54	
	WILLIAMS COS	97,655	45.16	4,410,099.80	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	300.36	5,249,992.44	
	ALBEMARLE CORP	8,403	96.05	807,108.15	
	AMCOR PLC	110,292	11.35	1,251,814.20	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	222.34	1,475,892.92	
	BALL CORP	25,896	67.47	1,747,203.12	
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	139.29	1,195,386.78		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,872	85.64	1,102,358.08		
CORTEVA INC	57,731	58.58	3,381,881.98		
CRH PLC	55,795	92.50	5,161,037.50		
CROWN HOLDINGS INC	9,940	94.74	941,715.60		
DOW INC	56,967	55.08	3,137,742.36		

DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	89.54	3,055,015.26
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	112.38	992,540.16
ECOLAB INC	20,345	254.59	5,179,633.55
FREEMONT-MCMORAN INC	110,698	51.34	5,683,235.32
INT'L PAPER CO	25,191	49.04	1,235,366.64
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	105.12	2,029,551.84
LINDE PLC	38,142	479.51	18,289,470.42
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	96.43	1,904,010.35
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	539.11	2,704,714.87
MOSAIC CO/THE	27,732	27.02	749,318.64
NEWMONT CORPORATION	92,555	53.90	4,988,714.50
NUCOR CORP	18,727	150.13	2,811,484.51
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,847	215.70	1,692,597.90
PPG INDUSTRIES INC	17,495	134.56	2,354,127.20
RELIANCE INC	4,126	289.62	1,194,972.12
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	122.93	1,285,356.08
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,348	382.73	7,405,060.04
SMURFIT WESTROCK PLC	40,860	50.09	2,046,677.40
STEEL DYNAMICS INC	11,618	125.98	1,463,635.64
VULCAN MATERIALS CO	10,153	250.24	2,540,686.72
WESTLAKE CORP	2,222	150.09	333,499.98
3 M COMPANY	43,663	137.30	5,994,929.90
AECOM	10,456	103.23	1,079,372.88
AERCAP HOLDINGS NV	14,679	94.93	1,393,477.47
ALLEGION PLC	7,721	143.77	1,110,048.17
AMETEK INC	17,753	172.07	3,054,758.71
AXON ENTERPRISE INC	5,367	395.34	2,121,789.78
BOEING CO	46,725	156.32	7,304,052.00
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,522	194.25	1,849,648.50
CARLISLE COS INC	3,456	444.59	1,536,503.04
CARRIER GLOBAL CORP	66,700	80.52	5,370,684.00
CATERPILLAR	38,627	391.08	15,106,247.16
CNH INDUSTRIAL NV	54,445	11.33	616,861.85
CUMMINS INC	10,453	326.40	3,411,859.20
DEERE&CO	20,534	418.00	8,583,212.00
DOVER CORP	10,657	192.78	2,054,456.46
EATON CORP	32,052	328.45	10,527,479.40
EMCOR GROUP INC	3,640	427.09	1,554,607.60
EMERSON ELECTRIC CO	44,010	109.22	4,806,772.20
FASTENAL CO	44,011	71.52	3,147,666.72
FERGUSON ENTERPRISES INC	16,260	201.86	3,282,243.60
FORTIVE CORP	25,894	79.20	2,050,804.80

FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	88.60	913,466.00
GE AEROSPACE	87,134	185.38	16,152,900.92
GE VERNOVA INC	20,868	249.86	5,214,078.48
GENERAL DYNAMICS CORP	18,159	300.13	5,450,060.67
GRACO INC	13,378	87.64	1,172,447.92
GRAINGER (WW) INC	3,363	1,035.94	3,483,866.22
HEICO CORP	3,640	259.32	943,924.80
HEICO CORP-CLASS A	5,700	202.15	1,152,255.00
HONEYWELL INTL INC	51,027	207.63	10,594,736.01
HOWMET AEROSPACE INC	31,648	99.21	3,139,798.08
HUBBELL INC	4,458	428.48	1,910,163.84
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,433	263.07	903,119.31
IDEX CORP	5,916	214.98	1,271,821.68
ILLINOIS TOOL WORKS	24,149	263.97	6,374,611.53
INGERSOLL-RAND INC	31,562	98.08	3,095,600.96
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	38.45	488,315.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	54,141	77.21	4,180,226.61
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	234.99	3,450,123.18
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	604.87	1,527,901.62
LOCKHEED MARTIN CORP	17,339	582.36	10,097,540.04
MASCO CORP	18,934	83.57	1,582,314.38
NORDSON CORP	4,121	261.66	1,078,300.86
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,345	526.79	5,976,432.55
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	104.43	3,207,776.31
OWENS CORNING	6,460	174.30	1,125,978.00
PACCAR INC	40,380	98.13	3,962,489.40
PARKER HANNIFIN CORP	10,443	632.77	6,608,017.11
PENTAIR PLC	14,383	96.99	1,395,007.17
QUANTA SERVICES INC	11,573	296.74	3,434,172.02
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	270.61	2,290,984.26
RTX CORP	105,649	120.39	12,719,083.11
SMITH (A.O.) CORP	9,016	90.59	816,759.44
SNAP-ON INC	4,000	288.51	1,154,040.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	109.72	1,382,252.56
TEXTRON	13,876	87.75	1,217,619.00
TORO CO	8,812	86.65	763,559.80
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,000	383.95	6,911,100.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,495	1,402.88	6,305,945.60
UNITED RENTALS INC	5,364	814.10	4,366,832.40
VERTIV HOLDINGS CO-A	29,005	98.41	2,854,382.05
WABTEC CORP	13,304	182.27	2,424,920.08
WATSCO INC	2,656	495.98	1,317,322.88

XYLEM INC	19,668	134.51	2,645,542.68
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,919	272.88	8,710,056.72
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	162.05	1,497,342.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,640	212.03	2,043,969.20
CINTAS CORP	29,848	202.35	6,039,742.80
COPART INC	69,100	52.06	3,597,346.00
DAYFORCE INC	10,668	60.20	642,213.60
EQUIFAX INC	10,261	290.39	2,979,691.79
JACOBS SOLUTIONS INC	11,026	155.53	1,714,873.78
LEIDOS HOLDINGS	9,314	159.72	1,487,632.08
PAYCHEX INC	26,671	132.99	3,546,976.29
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	167.80	710,633.00
REPUBLIC SERVICES INC	18,062	199.38	3,601,201.56
ROLLINS INC	25,466	49.95	1,272,026.70
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,884	73.92	1,469,825.28
TRANSUNION	15,741	103.92	1,635,804.72
VERALTO CORP	20,685	110.30	2,281,555.50
VERISK ANALYTICS INC	10,738	264.25	2,837,516.50
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	177.34	3,506,898.50
WASTE MANAGEMENT INC	32,252	205.51	6,628,108.52
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	108.34	906,480.78
CSX CORP	152,551	34.53	5,267,586.03
DELTA AIR LINES INC	15,193	51.54	783,047.22
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	128.93	1,583,260.40
FEDEX CORP	18,843	267.55	5,041,444.65
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	190,364	3.85	732,901.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	172.35	990,667.80
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	54.05	736,323.15
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,982	246.47	4,432,023.54
OLD DOMINION FREIGHT LINE	16,382	196.71	3,222,503.22
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	29.53	399,629.49
U-HAUL HOLDING CO	6,606	72.32	477,745.92
UBER TECHNOLOGIES INC	149,157	75.75	11,298,642.75
UNION PACIFIC CORP	48,392	244.22	11,818,294.24
UNITED PARCEL SERVICE B	58,139	134.26	7,805,742.14
APTIV PLC	21,896	74.24	1,625,559.04
FORD MOTOR COMPANY	320,913	10.78	3,459,442.14
GENERAL MOTORS CO	89,296	46.48	4,150,478.08
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	11.60	595,497.60
TESLA INC	227,655	260.46	59,295,021.30
DECKERS OUTDOOR CORP	12,618	159.42	2,011,561.56
DR HORTON INC	22,973	190.35	4,372,910.55

GARMIN LTD	13,022	173.99	2,265,697.78
LENNAR CORP-CL A	18,864	187.03	3,528,133.92
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	280.01	2,413,406.19
NIKE B	94,445	89.44	8,447,160.80
NVR INC	247	9,734.55	2,404,433.85
PULTE GROUP INC	16,747	143.17	2,397,667.99
AIRBNB INC-CLASS A	34,827	128.25	4,466,562.75
BOOKING HOLDINGS INC	2,707	4,248.10	11,499,606.70
CARNIVAL CORPORATION	71,810	18.54	1,331,357.40
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	110,522	57.34	6,337,331.48
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	166.71	1,534,898.97
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	429.03	1,221,877.44
DOORDASH INC - A	24,442	142.23	3,476,385.66
DRAFTKINGS INC	32,654	40.36	1,317,915.44
EXPEDIA GROUP INC	9,628	149.09	1,435,438.52
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,042	238.33	3,108,299.86
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	234.36	4,601,658.60
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	158.35	599,671.45
LAS VEGAS SANDS CORP	30,565	51.12	1,562,482.80
MARRIOTT INTL A	19,516	253.04	4,938,328.64
MCDONALD'S CORP	57,161	303.69	17,359,224.09
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,462	39.62	612,604.44
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,480	177.54	3,636,019.20
STARBUCKS CORP	88,273	97.36	8,594,259.28
WYNN RESORTS LTD	6,702	97.62	654,249.24
YUM BRANDS INC	22,162	139.92	3,100,907.04
ALPHABET INC-CL A	465,895	163.95	76,383,485.25
ALPHABET INC-CL C	400,960	165.29	66,274,678.40
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	326.22	2,346,174.24
COMCAST CORP-CL A	309,993	41.64	12,908,108.52
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	144.65	2,854,378.45
FOX CORP - CLASS A	21,544	42.27	910,664.88
FOX CORP- CLASS B	10,345	38.84	401,799.80
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	31.62	901,517.82
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	78.15	1,201,868.85
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	108.74	1,262,797.62
MATCH GROUP INC	22,730	37.81	859,421.30
META PLATFORMS INC-CLASS A	173,814	567.36	98,615,111.04
NETFLIX INC	34,177	707.35	24,175,100.95
NEWS CORP-CLASS A	33,479	26.50	887,193.50
OMNICOM GROUP	14,048	102.67	1,442,308.16
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	61,829	10.79	667,134.91

PINTEREST INC- CLASS A	45,767	32.48	1,486,512.16
ROBLOX CORP -CLASS A	35,113	44.18	1,551,292.34
ROKU INC	9,122	74.41	678,768.02
SEA LTD-ADR	28,338	94.31	2,672,556.78
SNAP INC - A	72,602	10.87	789,183.74
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	153.05	1,969,294.35
THE WALT DISNEY CO	146,237	96.01	14,040,214.37
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,780	109.45	4,025,571.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	8.38	1,486,720.94
AMAZON.COM	742,859	187.97	139,635,206.23
AUTOZONE INC	1,368	3,196.61	4,372,962.48
BATH & BODY WORKS INC	13,452	32.39	435,710.28
BEST BUY COMPANY INC	15,285	102.26	1,563,044.10
BURLINGTON STORES INC	5,108	265.15	1,354,386.20
CARMAX INC	10,695	77.32	826,937.40
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	209.14	1,035,243.00
EBAY	41,952	64.00	2,684,928.00
GENUINE PARTS CO	12,194	141.24	1,722,280.56
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	38.07	266,490.00
HOME DEPOT	78,650	399.53	31,423,034.50
LKQ CORP	19,286	40.37	778,575.82
LOWES COMPANIES	45,655	267.14	12,196,276.70
MERCADOLIBRE INC	3,573	2,064.71	7,377,208.83
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	1,146.03	5,245,379.31
POOL CORP	2,664	372.54	992,446.56
ROSS STORES INC	27,581	151.56	4,180,176.36
TJX COMPANIES INC	88,680	117.50	10,419,900.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,065	286.14	2,593,859.10
ULTA BEAUTY INC	3,920	404.01	1,583,719.20
WILLIAMS-SONOMA INC	11,384	154.35	1,757,120.40
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	18.49	462,250.00
COSTCO WHOLESALE CORP	35,163	885.62	31,141,056.06
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	87.32	1,422,180.84
DOLLAR TREE INC	16,318	73.12	1,193,172.16
KROGER CO	56,964	56.52	3,219,605.28
SYSCO CORP	40,090	77.66	3,113,389.40
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,356	155.18	5,796,904.08
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	9.06	467,197.02
WALMART INC	350,884	79.78	27,993,525.52
ALTRIA GROUP INC	139,180	51.05	7,105,139.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	60.00	2,437,080.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,082	48.34	680,723.88

BUNGE GLOBAL SA	11,604	97.73	1,134,058.92
CAMPBELL SOUP CO	15,869	49.36	783,293.84
CELSIUS HOLDINGS INC	13,069	32.53	425,134.57
COCA-COLA CO	324,600	71.79	23,303,034.00
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	79.18	1,218,896.92
CONAGRA BRANDS INC	33,324	32.47	1,082,030.28
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	258.40	3,391,758.40
GENERAL MILLS INC	43,531	74.38	3,237,835.78
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	193.36	2,115,745.12
HORMEL FOODS CORP	23,338	31.72	740,281.36
JM SMUCKER CO	7,850	121.15	951,027.50
KELLANOVA	23,448	80.78	1,894,129.44
KEURIG DR PEPPER INC	90,354	37.42	3,381,046.68
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	35.37	2,439,256.68
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	66.80	793,316.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	83.24	1,505,978.08
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	56.83	833,639.27
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,431	74.20	7,822,980.20
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	52.46	3,060,936.08
PEPSICO INC	108,994	170.00	18,528,980.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,299	120.62	14,872,325.38
TYSON FOODS INC	23,306	59.69	1,391,135.14
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	104.39	2,019,528.94
CLOROX COMPANY	9,570	163.42	1,563,929.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	103.66	6,420,493.08
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	99.87	1,877,556.00
KENVUE INC	148,093	23.26	3,444,643.18
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	142.54	3,831,047.58
PROCTER & GAMBLE CO	187,206	173.55	32,489,601.30
ABBOTT LABORATORIES	137,979	112.43	15,512,978.97
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	254.81	1,338,516.93
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	38.91	1,617,722.16
BECTON DICKINSON & CO	23,549	241.51	5,687,318.99
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,607	83.35	9,719,193.45
CARDINAL HEALTH	19,151	109.79	2,102,588.29
CENCORA INC	14,462	224.92	3,252,793.04
CENTENE CORP	40,934	74.58	3,052,857.72
COOPER COS INC/THE	16,443	109.78	1,805,112.54
CVS HEALTH CORP	99,034	61.38	6,078,706.92
DAVITA INC	4,627	163.08	754,571.16
DEXCOM INC	33,285	67.29	2,239,747.65
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,765	66.58	3,313,353.70

ELEVANCE HEALTH INC	18,232	523.95	9,552,656.40
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	32,998	91.99	3,035,486.02
HCA HEALTHCARE INC	15,457	403.28	6,233,498.96
HENRY SCHEIN INC	8,755	73.22	641,041.10
HOLOGIC INC	18,875	80.82	1,525,477.50
HUMANA INC	9,955	319.57	3,181,319.35
IDEXX LABORATORIES INC	6,644	511.78	3,400,266.32
INSULET CORP	5,246	232.03	1,217,229.38
INTUITIVE SURGICAL INC	28,412	479.18	13,614,462.16
LABCORP HOLDINGS INC	6,548	222.10	1,454,310.80
MCKESSON CORP	10,179	488.25	4,969,896.75
MEDTRONIC PLC	102,632	89.32	9,167,090.24
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	341.86	1,553,753.70
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	154.80	1,343,509.20
RESMED INC	10,920	239.00	2,609,880.00
SOLVENTUM CORP	10,915	67.57	737,526.55
STERIS PLC	8,172	239.05	1,953,516.60
STRYKER CORP	27,317	360.27	9,841,495.59
TELEFLEX INC	3,934	246.83	971,029.22
THE CIGNA GROUP	22,885	347.70	7,957,114.50
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,000	581.85	42,475,050.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	229.92	1,074,186.24
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	210.85	2,633,727.35
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	108.22	1,650,787.88
ABBVIE INC	140,059	194.79	27,282,092.61
AGILENT TECHNOLOGIES	24,157	148.06	3,576,685.42
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	274.91	2,650,957.13
AMGEN	42,902	322.67	13,843,188.34
AVANTOR INC	49,647	25.83	1,282,382.01
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	331.77	614,769.81
BIO-TECHNE CORP	12,980	78.72	1,021,785.60
BIOGEN INC	12,520	194.67	2,437,268.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	70.58	1,043,384.14
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	162,165	50.91	8,255,820.15
CATALENT INC	13,739	60.33	828,873.87
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	198.31	833,695.24
DANAHER CORP	52,873	275.44	14,563,339.12
ELI LILLY & CO	64,074	877.79	56,243,516.46
EXACT SCIENCES CORP	12,208	65.96	805,239.68
GILEAD SCIENCES INC	100,590	83.61	8,410,329.90
ILLUMINA INC	11,423	130.12	1,486,360.76
INCYTE CORP	15,212	65.83	1,001,405.96

IQVIA HOLDINGS INC	13,836	234.79	3,248,554.44
JOHNSON & JOHNSON	190,885	161.40	30,808,839.00
MERCK & CO	200,889	113.69	22,839,070.41
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,478.92	2,406,202.84
MODERNA INC	25,884	65.75	1,701,873.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,925	115.06	1,026,910.50
PFIZER	449,444	29.09	13,074,325.96
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,604	1,042.69	8,971,304.76
REVVITY INC	8,524	126.06	1,074,535.44
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	28.21	848,641.43
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	17.46	1,608,781.86
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,276	614.42	18,602,179.92
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	358.53	1,297,161.54
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,565	462.88	9,519,127.20
VIATRIS INC	89,720	11.55	1,036,266.00
WATERS CORP	4,749	357.33	1,696,960.17
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	311.00	1,793,537.00
ZOETIS INC	35,994	194.81	7,011,991.14
BANK OF AMERICA CORP	558,243	39.40	21,994,774.20
CITIGROUP	152,078	61.87	9,409,065.86
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	40.80	1,612,497.60
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	42.94	2,336,794.80
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,845.53	1,413,675.98
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	14.64	1,670,599.68
JPMORGAN CHASE & CO	227,765	210.50	47,944,532.50
KEY CORP	71,223	16.61	1,183,014.03
M & T BANK CORP	13,791	175.42	2,419,217.22
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,533	183.07	5,772,746.31
REGIONS FINL CORP	70,810	23.03	1,630,754.30
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	42.52	4,521,661.84
US BANCORP	124,604	45.48	5,666,989.92
WELLS FARGO & CO	273,850	55.90	15,308,215.00
ALLY FINANCIAL INC	21,529	34.97	752,869.13
AMERICAN EXPRESS	45,006	271.06	12,199,326.36
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	468.62	3,662,733.92
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	32,488	125.81	4,087,315.28
ARES MANAGEMENT CORP - A	14,741	156.91	2,313,010.31
BANK NEW YORK CO	56,329	71.70	4,038,789.30
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,044	457.47	48,054,478.68
BLACKROCK INC	11,959	945.21	11,303,766.39
BLACKSTONE INC	57,676	154.94	8,936,319.44
BLOCK INC	42,352	66.97	2,836,313.44

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	149.09	4,487,161.73
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	43.59	683,011.71
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	202.60	1,783,487.80
CME GROUP INC	27,997	218.30	6,111,745.10
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	14,368	191.23	2,747,592.64
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	28.90	556,296.10
CORPAY INC	4,988	311.24	1,552,465.12
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	139.25	2,643,939.75
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	41.98	1,174,726.34
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	458.49	1,443,326.52
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	45,470	83.13	3,779,921.10
FISERV INC	46,319	178.38	8,262,383.22
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	20.79	541,995.30
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	85.68	369,794.88
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	101.02	2,096,063.98
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,667	498.51	12,795,256.17
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,196	158.62	7,327,609.52
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	175.99	917,435.87
KKR & CO INC	47,919	132.14	6,332,016.66
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,490	230.86	1,267,421.40
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	254.84	817,271.88
MASTERCARD INC-CLASS A	65,849	493.64	32,505,700.36
MOODY'S CORP	13,270	473.49	6,283,212.30
MORGAN STANLEY	97,076	104.11	10,106,582.36
MSCI INC	6,530	576.15	3,762,259.50
NASDAQ INC	34,296	72.60	2,489,889.60
NORTHERN TRUST CORP	15,902	90.07	1,432,293.14
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	77.88	6,174,793.68
PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	109.51	2,001,295.25
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	122.46	1,896,415.56
ROBINHOOD MARKETS INC - A	46,668	23.89	1,114,898.52
S&P GLOBAL INC	25,389	512.72	13,017,448.08
SCHWAB (CHARLES) CORP	122,251	64.42	7,875,409.42
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	69.28	661,624.00
STATE STREET CORP	22,335	88.20	1,969,947.00
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	49.65	1,449,581.40
TOAST INC-CLASS A	31,526	28.00	882,728.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	121.75	1,103,176.75
VISA INC-CLASS A SHARES	124,853	275.17	34,355,800.01
AFLAC	43,196	110.59	4,777,045.64
ALLSTATE CORP	20,722	188.36	3,903,195.92
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	135.12	853,823.28

AMERICAN INT'L GROUP	50,875	73.34	3,731,172.50
AON PLC	15,249	347.67	5,301,619.83
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	113.41	3,372,473.17
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,453	279.45	4,877,240.85
ASSURANT INC	4,726	199.95	944,963.70
BROWN & BROWN INC	20,155	102.65	2,068,910.75
CHUBB LTD	30,987	289.57	8,972,905.59
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,618	135.64	1,847,145.52
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	539.00	1,167,474.00
EVEREST GROUP LTD	3,288	395.14	1,299,220.32
FNF GROUP	20,461	61.12	1,250,576.32
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,814	116.78	2,897,778.92
LOEWS CORP	16,402	78.90	1,294,117.80
MARKEL GROUP INC	1,007	1,569.08	1,580,063.56
MARSH & MCLENNAN COS	39,706	223.94	8,891,761.64
METLIFE INC	48,925	82.48	4,035,334.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	86.09	1,595,764.24
PROGRESSIVE CORP	46,607	251.10	11,703,017.70
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,466	120.81	3,559,787.46
TRAVELERS COS INC/THE	18,639	236.11	4,400,854.29
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	293.01	2,267,057.05
WR BERKLEY CORP	21,540	56.51	1,217,225.40
WEYERHAEUSER CO	63,311	33.75	2,136,746.25
ACCENTURE PLC-CL A	49,681	349.70	17,373,445.70
ADOBE INC	35,487	515.48	18,292,838.76
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	101.57	1,166,429.88
ANSYS INC	6,794	325.15	2,209,069.10
APPLOVIN CORP-CLASS A	16,202	127.75	2,069,805.50
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	237.22	567,904.68
ATLASSIAN CORP-CL A	13,451	161.22	2,168,570.22
AUTODESK INC	17,030	271.90	4,630,457.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	50.84	753,092.92
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,140	274.13	5,795,108.20
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	193.04	1,362,476.32
CLOUDFLARE INC - CLASS A	23,067	81.59	1,882,036.53
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	41,334	76.89	3,178,171.26
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	18,728	285.86	5,353,586.08
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	282.89	876,959.00
DATADOG INC - CLASS A	20,780	114.20	2,373,076.00
DOCUSIGN INC	14,969	61.67	923,138.23
DYNATRACE INC	22,028	52.99	1,167,263.72
EPAM SYSTEMS INC	4,768	199.46	951,025.28

FAIR ISAAC CORP	2,026	1,919.65	3,889,210.90
FORTINET INC	53,692	77.45	4,158,445.40
GARTNER INC	5,859	508.94	2,981,879.46
GEN DIGITAL INC	43,555	27.47	1,196,455.85
GODADDY INC - CLASS A	11,388	156.00	1,776,528.00
HUBSPOT INC	3,646	536.00	1,954,256.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,859	220.84	16,090,181.56
INTUIT INC	22,172	619.03	13,725,133.16
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	280.25	1,315,493.50
MICROSOFT CORP	560,017	428.02	239,698,476.34
MICROSTRATEGY INC-CL A	12,190	176.22	2,148,121.80
MONDAY.COM LTD	2,838	271.97	771,850.86
MONGODB INC	5,325	269.53	1,435,247.25
OKTA INC	11,505	73.99	851,254.95
ORACLE CORP	131,290	168.74	22,153,874.60
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	160,620	36.84	5,917,240.80
PALO ALTO NETWORKS INC	25,444	335.75	8,542,823.00
PTC INC	9,741	182.18	1,774,615.38
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	553.80	4,682,932.80
SALESFORCE INC	76,856	276.64	21,261,443.84
SAMSARA INC-CL A	13,283	47.52	631,208.16
SERVICENOW INC	16,388	881.79	14,450,774.52
SNOWFLAKE INC-CLASS A	23,538	113.92	2,681,448.96
SYNOPSIS INC	11,896	513.31	6,106,335.76
TWILIO INC - A	12,842	64.66	830,363.72
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	577.52	1,928,339.28
VERISIGN INC	6,723	190.64	1,281,672.72
WIX.COM LTD	5,010	168.30	843,183.00
WORKDAY INC-CLASS A	16,432	243.62	4,003,163.84
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,869	69.55	1,451,438.95
ZSCALER INC	7,204	171.77	1,237,431.08
AMPHENOL CORPORATION	96,707	65.02	6,287,889.14
APPLE INC	1,155,407	227.79	263,190,160.53
ARISTA NETWORKS INC	20,702	380.26	7,872,142.52
CDW CORP/DE	11,273	226.55	2,553,898.15
CISCO SYSTEMS	319,544	53.02	16,942,222.88
CORNING	66,604	44.87	2,988,521.48
DELL TECHNOLOGIES -C	23,308	120.22	2,802,087.76
F5 INC	4,851	219.00	1,062,369.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	20.14	1,962,280.48
HP INC	77,024	35.41	2,727,419.84
JABIL INC	9,340	122.34	1,142,655.60

JUNIPER NETWORKS INC	25,321	38.95	986,252.95
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	158.70	2,196,090.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	446.36	5,873,651.24
NETAPP INC	15,191	121.24	1,841,756.84
PURE STORAGE INC - CLASS A	23,875	49.44	1,180,380.00
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,548	108.74	1,581,949.52
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,216	419.74	1,769,623.84
TE CONNECTIVITY LTD	25,340	151.22	3,831,914.80
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,107	435.74	1,789,584.18
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	61.65	1,092,314.70
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	69.42	1,790,341.80
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	368.60	1,534,113.20
AT&T INC	568,700	21.90	12,454,530.00
T-MOBILE US INC	41,896	205.18	8,596,221.28
VERIZON COMMUNICATIONS	333,856	44.89	14,986,795.84
AES CORP	54,375	20.07	1,091,306.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	60.74	1,262,055.72
AMEREN CORPORATION	20,898	86.49	1,807,468.02
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	101.84	4,146,924.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	144.93	2,096,847.24
ATMOS ENERGY CORP	11,302	137.78	1,557,189.56
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	29.10	1,381,260.60
CMS ENERGY CORP	23,697	70.43	1,668,979.71
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	104.05	2,879,583.75
CONSTELLATION ENERGY	25,537	257.00	6,563,009.00
DOMINION ENERGY INC	70,231	57.16	4,014,403.96
DTE ENERGY COMPANY	15,851	127.38	2,019,100.38
DUKE ENERGY CORP	60,351	115.97	6,998,905.47
EDISON INTL	30,900	86.81	2,682,429.00
ENERGY CORP	16,181	131.13	2,121,814.53
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	38.40	783,321.60
EVERGY INC	18,475	61.94	1,144,341.50
EVERSOURCE ENERGY	27,450	67.52	1,853,424.00
EXELON CORP	81,573	40.38	3,293,917.74
FIRSTENERGY CORP	47,081	44.05	2,073,918.05
NEXTERA ENERGY INC	164,785	84.54	13,930,923.90
NISOURCE INC	32,351	34.38	1,112,227.38
NRG ENERGY INC	17,078	91.22	1,557,855.16
PG&E CORP	164,187	19.82	3,254,186.34
PPL CORPORATION	58,459	32.88	1,922,131.92
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	88.25	3,553,474.50
SEMPRA	49,744	83.25	4,141,188.00

	SOUTHERN CO	86,109	90.10	7,758,420.90	
	VISTRA CORP	28,511	117.72	3,356,314.92	
	WEC ENERGY GROUP INC	23,447	95.26	2,233,561.22	
	XCEL ENERGY INC	41,562	64.57	2,683,658.34	
	ADVANCED MICRO DEVICES	128,197	164.35	21,069,176.95	
	ANALOG DEVICES	39,357	232.05	9,132,791.85	
	APPLIED MATERIALS	66,508	204.92	13,628,819.36	
	BROADCOM INC	350,741	172.69	60,569,463.29	
	ENPHASE ENERGY INC	9,617	115.00	1,105,955.00	
	ENTEGRIS INC	12,389	114.86	1,423,000.54	
	FIRST SOLAR INC	7,921	255.75	2,025,795.75	
	INTEL CORP	344,792	23.91	8,243,976.72	
	KLA CORP	10,710	782.40	8,379,504.00	
	LAM RESEARCH CORP	10,237	827.12	8,467,227.44	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	67,749	70.99	4,809,501.51	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	80.59	3,281,463.62	
	MICRON TECHNOLOGY	88,663	107.50	9,531,272.50	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,911	924.99	3,617,635.89	
	NVIDIA CORP	1,951,142	121.40	236,868,638.80	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,641	244.93	5,055,600.13	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	36,454	74.39	2,711,813.06	
	QORVO INC	8,678	103.60	899,040.80	
	QUALCOMM	88,515	170.13	15,059,056.95	
	SKYWORX SOLUTIONS INC	14,336	98.85	1,417,113.60	
	TERADYNE INC	12,318	134.64	1,658,495.52	
	TEXAS INSTRUMENTS	72,611	209.14	15,185,864.54	
	CBRE GROUP INC-A	22,995	123.17	2,832,294.15	
	COSTAR GROUP INC	33,027	75.01	2,477,355.27	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.69	364,203.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	65.48	773,253.32	
	アメリカドル 小計	29,099,497		3,893,858,349.56 (555,770,402,232)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	55,750	22.54	1,256,605.00	
	CAMECO CORP	31,793	64.87	2,062,411.91	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	165,204	44.89	7,416,007.56	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	22.49	2,502,979.57	
	ENBRIDGE	175,303	55.03	9,646,924.09	
	IMPERIAL OIL	16,202	94.82	1,536,273.64	
	KEYERA CORP	18,607	42.06	782,610.42	
	MEG ENERGY CORP	13,934	24.91	347,095.94	
	PARKLAND CORP	7,149	34.85	249,142.65	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,941	55.69	2,558,454.29	

SUNCOR ENERGY	98,973	49.78	4,926,875.94
TC ENERGY CORP	82,559	63.18	5,216,077.62
TOURMALINE OIL CORP	25,009	61.41	1,535,802.69
AGNICO EAGLE MINES	40,306	110.63	4,459,052.78
BARRICK GOLD CORP	133,727	27.36	3,658,770.72
CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,322	81.72	761,793.84
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,267	18.95	1,236,809.65
FRANCO-NEVADA CORP	15,641	169.64	2,653,339.24
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	20.56	1,065,974.32
KINROSS GOLD CORP	108,451	12.79	1,387,088.29
LUNDIN MINING CORP	38,990	14.50	565,355.00
NUTRIEN LTD	37,152	65.22	2,423,053.44
PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	28.98	649,615.68
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	70.89	2,508,513.54
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	130.23	456,456.15
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,991	84.45	3,123,889.95
CAE INC	25,999	24.99	649,715.01
STANTEC INC	9,001	108.55	977,058.55
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	130.66	681,130.58
WSP GLOBAL INC	9,951	237.67	2,365,054.17
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	28.49	928,175.71
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	20,393	53.12	1,083,276.16
RB GLOBAL INC	14,445	108.51	1,567,426.95
THOMSON REUTERS CORP	13,471	229.61	3,093,076.31
AIR CANADA	13,805	16.52	228,058.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	157.34	6,645,569.58
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	115.54	8,448,862.50
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	186.03	1,085,857.11
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	57.75	1,169,668.50
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	82.29	252,630.30
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	63.33	621,900.60
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	96.40	2,224,237.20
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	161.20	727,495.60
DOLLARAMA INC	22,000	136.85	3,010,700.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	63,541	75.32	4,785,908.12
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	40.87	283,229.10
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	177.74	2,295,156.62
METRO INC	18,840	84.84	1,598,385.60
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	225.16	1,176,686.16
SAPUTO INC	20,898	28.93	604,579.14
BANK MONTREAL	56,278	122.19	6,876,608.82
BANK NOVA SCOTIA	97,216	73.54	7,149,264.64

	CANADIAN IMPERIAL BANK	77,158	82.78	6,387,139.24	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,646	126.71	3,503,024.66	
	ROYAL BANK OF CANADA	112,236	167.84	18,837,690.24	
	TORONTO-DOMINION BANK	136,393	85.68	11,686,152.24	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	63.81	1,850,553.81	
	BROOKFIELD CORP	111,490	72.16	8,045,118.40	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	40.23	309,167.55	
	ONEX CORP	6,603	95.06	627,681.18	
	TMX GROUP LTD	23,425	42.27	990,174.75	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,772	1,683.82	2,983,729.04	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	45.85	1,090,679.80	
	IA FINANCIAL CORP INC	6,977	111.30	776,540.10	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,255	261.13	3,461,278.15	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	149,878	39.93	5,984,628.54	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	42.43	1,848,972.11	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	78.17	3,409,306.38	
	CGI INC - CL A	16,084	154.40	2,483,369.60	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,553	4,338.85	6,738,234.05	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	137.99	963,722.16	
	OPEN TEXT CORP	20,463	44.73	915,309.99	
	SHOPIFY INC - CLASS A	94,130	107.11	10,082,264.30	
	BCE INC	6,203	47.54	294,890.62	
	QUEBECOR INC -CL B	15,200	34.92	530,784.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	54.42	1,517,284.02	
	TELUS CORP	32,908	22.66	745,695.28	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	33.31	812,597.45	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	44.46	502,175.70	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	36.01	371,767.24	
	EMERA INC	25,484	53.64	1,366,961.76	
	FORTIS INC	45,064	61.57	2,774,590.48	
	HYDRO ONE LTD	29,579	46.91	1,387,550.89	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	243.73	655,633.70	
	カナダドル 小計	3,262,081		229,451,352.98 (24,223,179,334)	
ユーロ	ENI	182,356	13.67	2,492,806.52	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	16.55	656,406.10	
	NESTE OIL OYJ	32,766	17.19	563,411.37	
	OMV AG	12,549	37.22	467,073.78	
	REPSOL SA	89,536	11.75	1,052,495.68	
	TENARIS SA	40,648	14.16	575,778.92	
	TOTALENERGIES SE	172,328	59.15	10,193,201.20	
	AIR LIQUIDE	46,418	176.18	8,177,923.24	

AKZO NOBEL	12,357	64.40	795,790.80
ARCELORMITTAL	43,366	23.43	1,016,065.38
ARKEMA	4,369	88.10	384,908.90
BASF SE	70,406	48.28	3,399,201.68
COVESTRO AG	14,454	54.92	793,813.68
DSM-FIRMENICH AG	16,194	121.85	1,973,238.90
EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	21.18	339,663.66
HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	98.90	1,064,658.50
OCI NV	7,248	25.66	185,983.68
STORA ENSO OYJ R	42,169	11.43	482,202.51
SYENQO SA	5,356	79.61	426,391.16
SYMRISE AG	10,018	123.25	1,234,718.50
UPM KYMMENE OYJ	42,324	29.89	1,265,064.36
VOESTALPINE AG	7,152	23.44	167,642.88
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	17,256	42.18	727,858.08
AIRBUS SE	48,168	133.82	6,445,841.76
ALSTOM	24,388	18.93	461,664.84
BOUYGUES ORD	16,606	30.98	514,453.88
BRENTAG SE	9,500	67.78	643,910.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	34.42	1,351,948.76
DASSAULT AVIATION SA	2,130	191.80	408,534.00
EIFFAGE	5,924	91.74	543,467.76
FERROVIAL SE	45,136	38.82	1,752,179.52
GEA GROUP AG	13,382	44.30	592,822.60
IMCD NV	4,641	158.00	733,278.00
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	85.60	1,061,268.80
KNORR-BREMSE AG	5,022	80.15	402,513.30
KONE OYJ-B	26,369	53.70	1,416,015.30
LEGRAND SA	19,340	104.70	2,024,898.00
LEONARDO SPA	31,340	20.41	639,649.40
METSO CORPORATION	51,970	9.55	496,729.26
MTU AERO ENGINES AG	3,962	281.10	1,113,718.20
PRYSMIAN SPA	21,155	64.84	1,371,690.20
RATIONAL AG	483	917.00	442,911.00
REXEL SA	17,411	26.78	466,266.58
RHEINMETALL AG	3,759	482.30	1,812,965.70
SAFRAN SA	26,619	213.40	5,680,494.60
SAINT-GOBAIN	36,177	83.18	3,009,202.86
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,466	240.35	10,447,053.10
SIEMENS	60,279	182.86	11,022,617.94
SIEMENS ENERGY AG	47,513	32.90	1,563,177.70
THALES SA	6,657	144.65	962,935.05

VINCI S.A.	39,327	110.60	4,349,566.20
WARTSILA OYJ	41,917	20.16	845,046.72
BUREAU VERITAS SA	25,073	30.16	756,201.68
RANDSTAD NV	10,680	44.90	479,532.00
TELEPERFORMANCE	4,734	97.48	461,470.32
WOLTERS KLUWER	19,155	154.80	2,965,194.00
ADP	2,382	120.00	285,840.00
AENA SME SA	5,508	201.00	1,107,108.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.67	302,709.86
DHL GROUP	82,579	40.20	3,319,675.80
GETLINK	21,115	16.16	341,323.97
INPOST SA	15,470	16.70	258,349.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,617	81.14	1,997,423.38
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	75.50	376,820.50
CONTINENTAL AG	8,168	59.80	488,446.40
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	74.72	766,178.88
FERRARI NV	10,026	424.80	4,259,044.80
MERCEDES-BENZ GROUP AG	58,663	59.49	3,489,861.87
MICHELIN	57,385	37.19	2,134,148.15
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	42.29	496,696.05
RENAULT SA	17,081	41.29	705,274.49
STELLANTIS NV	166,407	14.55	2,421,221.85
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	97.12	1,488,655.36
ADIDAS AG	12,783	240.30	3,071,754.90
HERMES INTERNATIONAL	2,556	2,232.00	5,704,992.00
KERING	5,534	266.85	1,476,747.90
LVMH	21,865	703.40	15,379,841.00
MONCLER SPA	18,908	57.74	1,091,747.92
PUMA SE	9,220	38.62	356,076.40
SEB SA	2,282	104.70	238,925.40
ACCOR	14,436	40.78	588,700.08
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	67.10	2,467,401.20
DELIVERY HERO SE	13,414	35.75	479,550.50
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	38.60	312,968.80
SODEXO	6,173	76.20	470,382.60
BOLLORE SE	31,761	6.16	195,647.76
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,827	92.45	446,256.15
PUBLICIS GROUPE	17,217	101.00	1,738,917.00
SCOUT24 SE	7,536	77.70	585,547.20
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	23.86	1,570,608.36
VIVENDI SE	61,243	10.61	650,094.44
D' IETEREN GROUP	2,217	196.90	436,527.30

INDITEX	87,257	53.32	4,652,543.24
PROSUS	112,590	39.66	4,465,882.35
ZALANDO SE	17,664	29.70	524,620.80
CARREFOUR	39,746	16.02	636,929.65
JERONIMO MARTINS	21,861	18.03	394,153.83
KESKO OYJ-B SHS	20,083	19.00	381,577.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	31.13	2,207,117.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	73,503	59.62	4,382,248.86
DANONE (GROUPE)	51,810	65.56	3,396,663.60
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	78,177	7.66	599,461.23
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	68.85	654,901.20
HEINEKEN NV	23,160	80.88	1,873,180.80
JDE PEET'S BV	7,000	19.00	133,000.00
KERRY GROUP PLC-A	10,913	93.50	1,020,365.50
LOTUS BAKERIES	38	12,000.00	456,000.00
PERNOD-RICARD	15,339	139.70	2,142,858.30
BEIERSDORF AG	7,430	134.85	1,001,935.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	75.45	662,451.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,880	83.22	988,653.60
LOREAL	19,298	405.95	7,834,023.10
AMPLIFON SPA	11,650	26.72	311,288.00
BIOMERIEUX	3,044	109.10	332,100.40
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	70.85	243,015.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	106.35	220,144.50
ESSILORLUXOTTICA	22,901	213.40	4,887,073.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	38.27	650,015.95
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	33.60	1,131,950.40
KONINKLIJKE PHILIPS	66,646	29.46	1,963,391.16
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	53.92	1,162,892.64
ARGENX SE	4,935	478.70	2,362,384.50
BAYER	78,462	30.38	2,384,067.87
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	57.90	591,738.00
GRIFOLS SA	27,685	10.15	281,002.75
IPSEN	3,532	111.50	393,818.00
MERCK KGAA	10,703	160.55	1,718,366.65
ORION OYJ-CLASS B	10,139	48.93	496,101.27
QIAGEN N.V.	16,526	41.01	677,813.89
RECORDATI SPA	6,099	50.75	309,524.25
SANOFI	90,135	102.98	9,282,102.30
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	253.30	462,019.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	191.80	495,227.60
UCB (GROUPE)	9,389	161.35	1,514,915.15

ABN AMRO BANK NV-CVA	45,808	16.37	749,876.96
AIB GROUP PLC	145,826	5.30	772,877.80
BANCO BILBAO VIZCAYA	448,899	9.93	4,460,260.46
BANCO BPM SPA	118,197	6.23	736,367.31
BANCO DE SABADELL SA	420,800	1.91	805,200.80
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	4.65	5,693,209.30
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	10.48	926,643.33
BNP PARIBAS	81,615	63.30	5,166,229.50
CAIXABANK	275,085	5.43	1,495,362.06
COMMERZBANK AG	81,889	16.47	1,348,711.83
CREDIT AGRICOLE SA	87,162	13.96	1,216,781.52
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	49.04	1,244,439.04
FINECOBANK SPA	41,585	15.43	641,864.47
ING GROEP NV-CVA	256,546	16.53	4,240,705.38
INTESA SANPAOLO	1,145,097	3.87	4,432,097.93
KBC GROEP NV	18,057	71.82	1,296,853.74
MEDIOBANCA	33,860	15.44	522,967.70
NORDEA BANK ABP	276,242	10.66	2,944,739.72
SOCIETE GENERALE	53,019	22.89	1,213,870.00
UNICREDIT SPA	116,219	39.98	4,646,435.62
ADYEN NV	1,835	1,408.60	2,584,781.00
AMUNDI SA	4,626	69.25	320,350.50
DEUTSCHE BANK NAMEN	140,740	15.55	2,189,069.96
DEUTSCHE BOERSE	15,625	210.20	3,284,375.00
EDENRED	20,131	35.90	722,702.90
EURAZEO SA	3,357	75.60	253,789.20
EURONEXT NV	6,480	98.35	637,308.00
EXOR NV	7,825	100.00	782,500.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	70.90	603,713.50
NEXI SPA	48,458	6.24	302,765.58
SOFINA	1,238	254.00	314,452.00
AEGON LTD	101,846	5.78	589,484.64
AGEAS	11,086	48.14	533,680.04
ALLIANZ SE-REG	31,198	296.50	9,250,207.00
ASR NEDERLAND NV	11,959	44.31	529,903.29
AXA SA	145,111	35.53	5,155,793.83
GENERALI	84,111	26.13	2,197,820.43
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	254.70	1,134,688.50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	495.00	5,154,930.00
NN GROUP NV	22,941	44.94	1,030,968.54
POSTE ITALIANE SPA	24,923	12.65	315,400.56
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	42.11	1,395,188.52

TALANX AG	5,053	75.60	382,006.80	
BECHTLE AG	7,659	40.76	312,180.84	
CAPGEMINI SA	12,235	199.90	2,445,776.50	
DASSAULT SYSTEMES SA	49,547	36.65	1,815,897.55	
NEMETSCHKE SE	5,455	95.15	519,043.25	
SAP SE	82,823	205.70	17,036,691.10	
NOKIA OYJ	396,129	3.94	1,562,134.71	
CELLNEX TELECOM SA	42,906	36.58	1,569,501.48	
DEUTSCHE TELEKOM	276,850	26.24	7,264,544.00	
ELISA A	10,227	47.92	490,077.84	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.13	338,073.75	
KPN (KON.)	290,883	3.67	1,067,540.61	
ORANGE	153,281	10.43	1,598,720.83	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.24	211,091.87	
TELEFONICA	297,657	4.42	1,317,727.53	
ACCIONA SA	2,181	127.80	278,731.80	
E.ON SE	192,389	13.47	2,591,479.83	
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	15.68	341,071.36	
ELIA GROUP SA/NV	987	103.10	101,759.70	
ENDESA	25,972	19.77	513,596.30	
ENEL	640,374	7.21	4,619,017.66	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,657	4.12	972,085.12	
ENGIE	146,393	15.63	2,288,122.59	
FORTUM OYJ	32,550	14.82	482,553.75	
IBERDROLA SA	484,413	13.71	6,643,724.29	
REDEIA CORP SA	30,678	17.59	539,626.02	
RWE STAMM	52,507	33.22	1,744,282.54	
SNAM SPA	147,559	4.59	677,590.92	
TERNA SPA	95,819	8.12	778,433.55	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	59,881	30.06	1,800,022.86	
VERBUND AG	6,430	74.85	481,285.50	
ASM INTERNATIONAL NV	3,856	585.40	2,257,302.40	
ASML HOLDING NV	31,693	757.30	24,001,108.90	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	113.95	724,380.15	
INFINEON TECHNOLOGIES	105,817	32.69	3,459,686.81	
STMICROELECTRONICS NV	50,286	27.47	1,381,607.85	
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	94.88	500,492.00	
VONOVIA SE	61,810	33.02	2,040,966.20	
ユーロ 小計	14,417,552		418,445,807.94 (66,712,815,159)	
イギリスポンド				
BP PLC	1,315,261	3.88	5,105,185.57	
SHELL PLC-NEW	500,920	24.24	12,142,300.80	

ANGLO AMERICAN PLC	101,769	24.38	2,481,128.22
ANTOFAGASTA PLC	29,856	20.41	609,360.96
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	43.21	472,026.04
ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	18.26	321,449.04
GLENCORE PLC	854,615	4.27	3,649,633.35
MONDI PLC	37,918	14.31	542,796.17
RIO TINTO PLC REG	88,047	53.09	4,674,415.23
ASHTED GROUP PLC	33,317	58.72	1,956,374.24
BAE SYSTEMS PLC	240,047	12.40	2,976,582.80
BUNZL PLC	29,337	35.56	1,043,223.72
DCC PLC	6,622	52.20	345,668.40
MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	4.71	476,458.59
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	686,376	5.25	3,603,474.00
SMITHS GROUP PLC	26,476	17.61	466,242.36
SPIRAX GROUP PLC	5,514	76.45	421,545.30
EXPERIAN PLC	77,628	39.30	3,050,780.40
INTERTEK GROUP PLC	13,890	52.40	727,836.00
RELX PLC	145,542	35.68	5,192,938.56
RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	3.77	685,877.84
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	118,831	4.82	573,240.74
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,707	48.33	324,149.31
PERSIMMON PLC	25,686	16.62	427,029.75
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.65	437,092.12
COMPASS GROUP PLC	140,293	24.40	3,423,149.20
ENTAIN PLC	49,630	7.88	391,382.18
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,833	83.44	1,154,225.52
PEARSON	55,305	10.25	567,152.77
WHITBREAD PLC	17,434	32.06	558,934.04
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	8.73	633,028.03
INFORMA PLC	110,598	8.39	928,802.00
WPP PLC	85,821	7.80	669,403.80
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.55	321,716.28
KINGFISHER PLC	153,717	3.25	499,580.25
NEXT PLC	8,464	97.42	824,562.88
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.99	444,708.33
TESCO PLC	525,585	3.60	1,895,785.09
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	23.23	597,940.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,980	27.74	4,382,365.20
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	27.10	486,716.00
DIAGEO	174,682	26.53	4,634,313.46
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	21.82	1,494,189.96
HALEON PLC	598,336	3.96	2,373,000.57

	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	46.93	2,657,223.53
	UNILEVER PLC	198,540	48.94	9,716,547.60
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.65	799,131.75
	ASTRAZENECA	122,959	116.54	14,329,641.86
	GSK PLC	335,128	15.37	5,150,917.36
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	18.96	339,573.60
	BARCLAYS	1,129,529	2.29	2,589,445.23
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,052	6.80	10,111,719.06
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.59	2,868,114.74
	NATWEST GROUP PLC	506,122	3.46	1,753,206.60
	STANDARD CHARTERED PLC	161,358	8.07	1,302,804.49
	3I GROUP PLC	74,757	33.89	2,533,514.73
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	11.10	367,176.90
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	37,924	102.65	3,892,898.60
	M&G PLC	131,539	2.10	276,231.90
	SCHRODERS PLC	39,932	3.54	141,359.28
	WISE PLC - A	49,048	6.62	324,697.76
	ADMIRAL GROUP PLC	25,873	28.08	726,513.84
	AVIVA PLC	193,334	4.89	946,563.26
	LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.29	1,143,369.00
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.66	288,665.66
	PRUDENTIAL	212,226	7.00	1,485,582.00
	SAGE GROUP PLC	76,660	10.36	794,580.90
	HALMA PLC	31,069	26.55	824,881.95
	BT GROUP PLC	464,863	1.50	699,851.24
	VODAFONE GROUP PLC	1,645,717	0.75	1,244,491.19
	CENTRICA PLC	453,631	1.17	531,655.53
	NATIONAL GRID PLC	371,439	10.35	3,844,393.65
	SEVERN TRENT PLC	17,468	26.61	464,823.48
	SSE PLC	81,692	19.12	1,561,951.04
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.53	532,607.40
	イギリスボンド 小計	21,001,741		153,231,900.40 (29,271,889,933)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	12.85	223,564.30
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	705.50	404,957.00
	GIVAUDAN-REG	742	4,610.00	3,420,620.00
	HOLCIM LTD	42,259	83.18	3,515,103.62
	SIG GROUP AG	26,203	18.51	485,017.53
	SIKA AG-BR	12,257	281.60	3,451,571.20
	ABB LTD	124,889	49.37	6,165,769.93
	GEBERIT AG-REG	2,530	561.00	1,419,330.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	241.50	494,592.00

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	251.40	777,328.80
	VAT GROUP AG	1,956	430.10	841,275.60
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	29.34	435,875.04
	SGS SA	12,959	95.18	1,233,437.62
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	231.90	876,813.90
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,028	134.65	5,793,720.20
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	180.15	447,312.45
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	35.90	141,374.20
	AVOLTA AG	7,820	35.86	280,425.20
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,564.00	437,920.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	107,600.00	860,800.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	11,000.00	902,000.00
	NESTLE SA - REGISTERED	208,575	85.20	17,770,590.00
	ALCON INC	38,399	84.66	3,250,859.34
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	302.80	1,176,983.60
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	138.90	1,186,206.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	72.90	134,865.00
	GALDERMA GROUP AG	3,774	80.00	301,920.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	538.40	2,980,582.40
	NOVARTIS	156,324	97.93	15,308,809.32
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	292.00	646,780.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,724	272.20	15,168,072.80
	SANDOZ GROUP AG	30,458	35.21	1,072,426.18
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	88.25	219,477.75
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	51.66	789,829.74
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,269.00	2,315,925.00
	UBS GROUP AG	261,649	26.25	6,868,286.25
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	172.60	735,966.40
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	146.90	434,089.50
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	711.40	1,507,456.60
	SWISS RE LTD	24,330	117.50	2,858,775.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,440	512.80	5,866,432.00
	TEMENOS AG - REG	5,150	59.40	305,910.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	75.08	901,410.48
	SWISSCOM	2,539	552.50	1,402,797.50
	BKW AG	1,744	153.60	267,878.40
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	95.35	541,492.65
	スイスフラン 小計	1,191,941		116,622,630.50 (19,792,026,622)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	344.10	7,656,913.20
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	439.20	2,364,213.60
	SCA SV CELLULOSA B	59,490	147.95	8,801,545.50

ADDECH AB-B SHARES	20,615	302.80	6,242,222.00
ALFA LAVAL AB	25,134	487.60	12,255,338.40
ASSA ABLOY AB-B	75,977	341.60	25,953,743.20
ATLAS COPCO A	207,097	198.05	41,015,560.85
ATLAS COPCO B	114,624	173.95	19,938,844.80
BEIJER REF AB	26,868	169.25	4,547,409.00
EPIROC AB-A	53,479	219.10	11,717,248.90
EPIROC AB-B	28,804	192.80	5,553,411.20
HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	71.28	2,759,391.36
INDUTRADE AB	22,644	316.20	7,160,032.80
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	314.30	4,400,828.60
LIFCO AB-B SHS	17,970	336.80	6,052,296.00
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	56.18	6,901,600.64
SAAB AB-B	25,552	217.25	5,551,172.00
SANDVIK AB	87,594	228.60	20,023,988.40
SKANSKA B	25,507	212.50	5,420,237.50
SKF AB-B	21,050	204.70	4,308,935.00
TRELLEBORG AB-B SHS	16,653	403.00	6,711,159.00
VOLVO AB-A SHS	13,514	275.60	3,724,458.40
VOLVO B	124,872	272.50	34,027,620.00
SECURITAS B	28,375	129.20	3,666,050.00
VOLVO CAR AB-B	49,839	28.94	1,442,589.85
EVOLUTION AB	13,186	1,018.50	13,429,941.00
HENNES & MAURITZ B	40,961	171.40	7,020,715.40
ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	312.30	15,450,730.20
GETINGE AB-B SHS	17,796	217.70	3,874,189.20
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	326.20	4,676,077.00
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	114,218	155.70	17,783,742.60
SVENSKA HANDELSBK A	120,736	104.75	12,647,096.00
SWEDBANK AB-A	71,421	217.40	15,526,925.40
EQT AB	31,471	348.30	10,961,349.30
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	375.80	4,441,204.40
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	374.60	4,183,532.80
INVESTOR AB-B SHS	139,947	311.85	43,642,471.95
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	578.00	4,207,840.00
ERICSSON (LM) B	214,689	77.82	16,707,097.98
HEXAGON AB-B SHS	172,099	110.55	19,025,544.45
TELE2 AB-B SHS	46,762	114.20	5,340,220.40
TELIA CO AB	253,410	32.62	8,266,234.20
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	88.42	5,013,414.00
SAGAX AB-B	17,402	285.60	4,970,011.20
	2,653,728		475,365,147.68

スウェーデンクローナ 小計				(6,731,170,491)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	29,320	224.50	6,582,340.00
	EQUINOR ASA	66,436	263.00	17,472,668.00
	NORSK HYDRO	100,517	68.30	6,865,311.10
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	333.10	4,163,083.80
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,516	1,030.00	8,771,480.00
	MOWI ASA	31,968	187.70	6,000,393.60
	ORKLA	39,191	98.75	3,870,111.25
	SALMAR ASA	5,423	540.00	2,928,420.00
	DNB BANK ASA	71,795	216.10	15,514,899.50
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	196.20	3,644,218.80
	TELENOR ASA	51,193	134.80	6,900,816.40
ノルウェークローネ 小計		435,431		82,713,742.45 (1,124,906,897)
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	476.80	14,357,401.60
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	3,162.00	2,387,310.00
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	83,415	150.40	12,545,616.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	10,470.00	2,292,930.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	10,825.00	3,312,450.00
	DSV A/S	14,193	1,395.00	19,799,235.00
	PANDORA A/S	6,512	1,099.50	7,159,944.00
	CARLSBERG AS-B	6,810	818.80	5,576,028.00
	COLOPLAST-B	9,737	879.60	8,564,665.20
	DEMANT A/S	8,512	266.60	2,269,299.20
	GENMAB A/S	4,878	1,622.00	7,912,116.00
	NOVO NORDISK A/S-B	255,486	796.50	203,494,599.00
	ZEALAND PHARMA A/S	5,068	817.00	4,140,556.00
	DANSKE BANK A/S	53,617	202.00	10,830,634.00
	TRYG A/S	29,772	159.50	4,748,634.00
ORSTED A/S	12,910	450.10	5,810,791.00	
デンマーククローネ 小計		522,302		315,202,209.00 (6,739,023,228)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	30.06	620,107.74
	SANTOS	292,069	6.84	1,997,751.96
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	159,719	24.36	3,890,754.84
	BHP GROUP LTD	402,247	44.74	17,996,530.78
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	21.90	761,463.00
	FORTESCUE LTD	137,312	20.10	2,759,971.20
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,778	56.49	2,247,059.22
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	49.14	708,058.26
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	88,682	16.23	1,439,308.86
	ORICA LTD	38,288	18.42	705,264.96

PILBARA MINERALS LTD	209,485	3.16	661,972.60
RIO TINTO LTD	28,272	127.45	3,603,266.40
SOUTH32 LTD	346,773	3.70	1,283,060.10
REECE LTD	16,814	28.52	479,535.28
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	12,630	42.69	539,174.70
BRAMBLES LTD	108,007	18.64	2,013,250.48
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	25.00	1,109,400.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	7.42	630,700.00
TRANSURBAN GROUP	261,181	13.11	3,424,082.91
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	58.17	2,688,035.70
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.14	935,546.82
CAR GROUP LTD	29,334	36.87	1,081,544.58
REA GROUP LTD	3,586	200.00	717,200.00
SEEK LTD	28,001	24.87	696,384.87
WESFARMERS LTD	90,005	70.68	6,361,553.40
COLES GROUP LTD	108,486	18.12	1,965,766.32
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	4.99	548,405.99
WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	33.43	3,077,933.53
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.97	765,601.20
COCHLEAR LIMITED	4,783	281.41	1,345,984.03
PRO MEDICUS LTD	3,708	174.04	645,340.32
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	41.56	503,166.92
SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	26.69	1,116,416.01
CSL LIMITED	37,640	285.10	10,731,164.00
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	30.44	7,257,596.12
COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,560	134.16	18,052,569.60
NATIONAL AUSTRALIA BANK	240,813	36.94	8,895,632.22
WESTPAC BANKING	276,117	31.80	8,780,520.60
ASX LTD	14,549	63.93	930,117.57
MACQUARIE GROUP LIMITED	28,241	233.49	6,593,991.09
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	34.87	481,624.44
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	7.36	1,226,632.32
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.66	849,789.78
QBE INSURANCE GROUP	127,819	16.39	2,094,953.41
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	18.01	1,708,500.64
WISETECH GLOBAL LTD	13,801	135.15	1,865,205.15
XERO LTD	11,340	148.72	1,686,484.80
TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.92	1,209,190.64
ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	9.95	1,547,573.25
オーストラリアドル 小計	5,251,261		143,231,138.61 (14,141,210,314)
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.49	617,632.89

ニュージーランドドル	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,904	35.50	1,949,092.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,957	3.09	410,837.13
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.30	407,061.90
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.98	661,053.12
ニュージーランドドル 小計		445,479		4,045,677.04 (367,145,191)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	237,496	44.85	10,651,695.60
	SWIRE PACIFIC A	44,500	65.05	2,894,725.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	120.90	12,936,300.00
	MTR CORP	125,000	29.85	3,731,250.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	21.10	2,532,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	37.80	6,577,200.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	19.16	3,793,680.00
	WH GROUP LTD	658,301	6.15	4,048,551.15
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	25.00	7,037,500.00
	HANG SENG BANK	59,400	98.80	5,868,720.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,300	308.60	29,718,180.00
	AIA GROUP LTD	864,200	68.35	59,068,070.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	54.50	2,043,750.00
	CLP HOLDINGS	136,500	70.20	9,582,300.00
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.60	5,970,736.20
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	51.10	5,723,200.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	34.25	4,178,363.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	25.70	3,218,359.60
	SINO LAND CO	315,400	8.47	2,671,438.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	86.55	9,087,750.00
WHARF HOLDINGS	84,000	20.95	1,759,800.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	26.55	3,265,650.00	
香港ドル 小計		5,030,978		196,359,218.55 (3,607,118,844)
シンガポールドル	KEPPEL LTD	112,800	6.62	746,736.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.62	680,988.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.65	720,407.80
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.86	253,272.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.36	600,096.00
	DBS GROUP	155,760	37.60	5,856,576.00
	OCBC BANK	257,100	15.11	3,884,781.00
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	32.22	3,028,680.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	11.27	743,820.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	3.21	1,997,079.03
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.60	470,960.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	3.08	801,108.00

シンガポールドル 小計		2,379,135		19,784,503.83 (2,205,378,641)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	15.95	947,860.65
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	736.00	1,579,456.00
	BANK HAPOALIM BM	98,310	37.10	3,647,301.00
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	35.85	4,033,555.20
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	20.68	2,057,660.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	144.10	1,801,682.30
	NICE LTD	4,991	642.90	3,208,713.90
	AZRIELI GROUP	1,537	259.50	398,851.50
イスラエルシェケル 小計		390,926		17,675,080.55 (676,922,002)
合 計		86,082,052		731,363,188,888 (731,363,188,888)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,490.00	-	
	カナダドル 小計		1,490.00	- (-)	
新株予約権証券合計				- (-)	
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	646,330.40	
	オーストラリアドル 小計		83,290	646,330.40 (63,812,200)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,168,900.00	
	香港ドル 小計		315,000	3,168,900.00 (58,212,693)	
投資信託受益証券合計			398,290	122,024,893 (122,024,893)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,513,113.06	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	955,754.98	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,765	8,698,034.80	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	772,725.32	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,629,109.79	
		BXP INC	11,259	909,389.43	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	958,628.79	
		CROWN CASTLE INC	33,735	3,933,838.35	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,738	4,147,936.08	
		EQUINIX INC	7,333	6,472,765.77	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	997,008.40	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,914,713.45	

	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,533,393.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	17,564	3,112,867.72	
	GAMING AND LEISURE PROPRTIE	24,610	1,248,957.50	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,765	1,237,689.00	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,029,294.49	
	INVITATION HOMES INC	45,008	1,575,280.00	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	2,722,843.98	
	KIMCO REALTY CORP	47,897	1,099,715.12	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,450,695.15	
	PROLOGIS INC	73,867	9,276,956.53	
	PUBLIC STORAGE	12,826	4,574,264.64	
	REALTY INCOME CORP	69,450	4,356,598.50	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	893,910.95	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	2,131,771.12	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,979	4,356,938.09	
	SUN COMMUNITIES INC	10,890	1,480,822.20	
	UDR INC	23,815	1,071,436.85	
	VENTAS INC	31,565	2,015,109.60	
	VICI PROPERTIES INC	83,762	2,774,197.44	
	WELLTOWER INC	47,424	6,032,332.80	
	WP CAREY INC	16,024	1,005,345.76	
	アメリカドル 小計	951,495	88,883,438.66 (12,686,333,199)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	264,288.96	
	カナダドル 小計	4,887	264,288.96 (27,900,985)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	275,639.10	
	GECINA SA	3,139	330,536.70	
	KLEPIERRE	17,225	509,860.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	825,945.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	314,585.04	
	ユーロ 小計	48,695	2,256,565.84 (359,764,291)	
イギリスポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	371,507.40	
	SEGREO PLC	103,047	907,225.78	
	イギリスポンド 小計	159,336	1,278,733.18 (244,276,399)	
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	714,143.10	
	GOODMAN GROUP	135,303	4,861,436.79	
	GPT GROUP	167,884	847,814.20	
	MIRVAC GROUP	266,683	586,702.60	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,399,308.61	
	STOCKLAND	207,412	1,097,209.48	

	VICINITY CENTERS	305,149	692,688.23	
	オーストラリアドル 小計	1,557,804	10,199,303.01 (1,006,977,186)	
香港ドル	LINK REIT	238,000	9,484,300.00	
	香港ドル 小計	238,000	9,484,300.00 (174,226,591)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	818,317.44	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	541,829	1,164,932.35	
	シンガポールドル 小計	825,967	1,983,249.79 (221,072,854)	
	投資証券合計	3,786,184	14,720,551,505 (14,720,551,505)	
	合計		14,842,576,398 (14,842,576,398)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 573銘柄	97.8%				74.5%
	投資証券 33銘柄				2.2%	1.7%
カナダドル	株式 84銘柄	99.9%				3.2%
	新株予約権 証券 1銘柄					
	投資証券 1銘柄				0.1%	0.0%
ユーロ	株式 214銘柄	99.5%				8.9%
	投資証券 5銘柄				0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 75銘柄	99.2%				3.9%
	投資証券 2銘柄				0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 46銘柄	100.0%				2.7%
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 11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 49銘柄	93.0%				1.9%
	投資信託受 益証券 1銘柄				0.4%	0.0%
	投資証券 7銘柄				6.6%	0.1%

ニュージ ランドドル	株式	5銘柄	100.0%				0.0%
香港ドル	株式	22銘柄	93.9%				0.5%
	投資信託受 益証券	1銘柄			1.5%		0.0%
	投資証券	1銘柄				4.5%	0.0%
シンガポ ールドル	株式	12銘柄	90.9%				0.3%
	投資証券	2銘柄				9.1%	0.0%
イスラエル シケル	株式	8銘柄	100.0%				0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	672,711,385
コール・ローン	4,195,806,414
国債証券	350,212,730,237
派生商品評価勘定	43,469,872
未収入金	416,665,014
未収利息	2,668,852,087
前払費用	281,185,272
差入委託証拠金	274,111,210
流動資産合計	358,765,531,491
資産合計	358,765,531,491
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,181,990
前受金	3,222,903
未払金	149,712,507
未払解約金	166,457,739
流動負債合計	351,575,139
負債合計	351,575,139
純資産の部	
元本等	
元本	101,514,169,946
剰余金	
剰余金又は欠損金()	256,899,786,406
元本等合計	358,413,956,352
純資産合計	358,413,956,352
負債純資産合計	358,765,531,491

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年 9月30日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2024年 9月30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	101,514,169,946口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.5307円 (1万口当たり純資産額) (35,307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

2024年 9月30日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 9月30日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>

2024年 9月30日現在	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月 3日
期首元本額	88,123,684,086円
期中追加設定元本額	20,138,995,592円
期中一部解約元本額	6,748,509,732円
期末元本額	101,514,169,946円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,071,420,403円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	452,358,519円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	309,732,561円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,365,675,659円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,948,036円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,687,830,797円
世界経済インデックスファンド	25,333,520,464円
D C マイセクション 2 5	1,826,642,397円
D C マイセクション 5 0	1,714,314,782円
D C マイセクション 7 5	1,363,969,652円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,233,515,206円
D C マイセクション S 2 5	1,153,422,993円
D C マイセクション S 5 0	1,024,713,739円
D C マイセクション S 7 5	672,024,120円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	7,221,340円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	101,194,414円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	56,961,913円
D C 世界経済インデックスファンド	16,168,208,034円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	809,023,418円
マイセクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	853,506円
マイセクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	896,753円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	7,656,771円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	19,369,052円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	33,407,728円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	48,891,546円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	50,766,246円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	591,357,763円
バランス B（3 7. 5）V A 1（適格機関投資家専用）	342,594,847円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,430,201,293円

区分	2024年 9月30日現在
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	50,409,381円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	25,518,542円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	315,973,374円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	116,121,780円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	160,460,126円
F O F s用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	616,536,441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）	1,465,307,140円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	591,994,936円
外国債券ファンド・シリーズ1	757,633,144円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円
分散投資コア戦略ファンドS	1,606,006,912円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	828,119,605円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,573,100,640円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,795,739円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,543,406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）	1,311,312,070円
SMT インデックスバランス・オープン	163,275,830円
SMT 世界経済インデックス・オープン	463,260,485円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	698,428,897円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,046,321,823円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,427,996円
グローバル経済コア	1,248,517,616円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	25,005,884円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	3,026,255円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	66,478,952円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	109,352,505円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	56,026,191円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	79,281,571円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	945,450,550円
10資産分散投資ファンド	35,877,631円
グローバル10資産バランスファンド	33,931,387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	109,829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	22,194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	117,856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	36,333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	27,812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	21,345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	37,014円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	2,140,704円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	14,143,264,231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）	239,551,215円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	524,603,806円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	139,451,956円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	12,861,793,599	
合計	12,861,793,599	

(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

（2024年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益 (円)
			(円)	
			うち1年超	

市場取引	債券先物取引 買建				
		3,196,303,791	-	3,199,526,694	3,222,903
合計		3,196,303,791	-	3,199,526,694	3,222,903

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2024年 9月30日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,881,111,523	-	3,889,176,502	8,064,979
	アメリカドル	1,859,249,985	-	1,855,797,750	3,452,235
	カナダドル	149,437,921	-	149,646,700	208,779
	ユーロ	1,192,962,684	-	1,197,033,600	4,070,916
	イギリスポンド	224,355,016	-	226,837,800	2,482,784
	オフショア人民元	455,105,917	-	459,860,652	4,754,735
	合計	3,881,111,523	-	3,889,176,502	8,064,979

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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% 08/31/25	5,250,000.00	5,075,770.66	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,893,080.42	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,463,734.38	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,654,531.28	
		T 0.375% 07/31/27	16,100,000.00	14,757,599.54	
		T 0.375% 09/30/27	2,440,000.00	2,225,260.94	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,883,984.36	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,836,562.48	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,303,476.54	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,723,806.62	

T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,234,902.33	
T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,417,473.42	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,276,642.21	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,847,851.60	
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,987,304.65	
T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,752,773.39	
T 0.625% 07/31/26	10,800,000.00	10,236,375.00	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	10,104,518.59	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,286,474.60	
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,761,125.02	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,770,195.27	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,747,109.36	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	9,080,292.94	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,815,703.12	
T 0.75% 08/31/26	9,630,000.00	9,130,631.82	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,632,968.72	
T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,751,658.21	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,518,441.46	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,520,912.50	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,392,656.24	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,135,246.29	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,422,453.11	
T 1.125% 08/31/28	12,030,000.00	10,986,538.49	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,855,925.00	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,397,500.00	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,987,894.55	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,536,640.64	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	8,291,074.23	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,909,316.77	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,703,447.23	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,669,140.66	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,783,805.06	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	3,158,712.91	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,235,993.76	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,813,640.18	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,090,781.28	
T 1.375% 12/31/28	8,680,000.00	7,956,101.54	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,729,531.28	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,827,422.82	
T 1.5% 08/15/26	15,500,000.00	14,919,960.86	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,920,068.35	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,444,578.10	

T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	10,430,071.87
T 1.625% 05/15/31	10,980,000.00	9,712,153.12
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,192,597.69
T 1.625% 10/31/26	12,300,000.00	11,827,699.18
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,080,568.36
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,589,920.33
T 1.75% 01/31/29	10,200,000.00	9,483,011.70
T 1.75% 08/15/41	7,080,000.00	5,043,670.29
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,756,367.18
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	10,385,476.53
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,821,621.07
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,157,484.40
T 1.875% 02/28/27	6,500,000.00	6,255,234.37
T 1.875% 02/28/29	8,470,000.00	7,909,027.91
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,033,083.56
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	2,066,689.44
T 1% 07/31/28	13,000,000.00	11,837,363.33
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,513,375.00
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,390,220.71
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,948,103.52
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,345,605.45
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,030,725.00
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	7,274,685.93
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,180,607.80
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,830,126.96
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,325,148.43
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,368,952.15
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,303,750.00
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,668,876.94
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,549,015.61
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,359,163.88
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,721,003.50
T 2.375% 05/15/51	7,450,000.00	5,282,224.62
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,929,017.57
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,159,089.85
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,862,095.69
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,932,484.37
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,098,601.56
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,624,230.06
T 2.625% 02/15/29	7,740,000.00	7,463,204.28
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,346,562.51
T 2.625% 07/31/29	15,200,000.00	14,597,640.56
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,739,747.67

T 2.75% 02/15/28	8,550,000.00	8,345,935.52
T 2.75% 04/30/27	5,450,000.00	5,349,302.74
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,512,189.44
T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	12,095,513.68
T 2.75% 08/15/42	7,100,000.00	5,874,972.67
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,176,481.46
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,824,980.09
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,956,623.46
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,386,267.57
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,211,054.70
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,843,474.19
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,579,613.25
T 2.875% 05/15/43	5,050,000.00	4,212,015.62
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,823,268.74
T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	8,499,937.50
T 2.875% 08/15/28	13,220,000.00	12,916,869.49
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,879,890.62
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	759,710.93
T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,906,132.79
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,802,216.79
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	5,085,021.50
T 2% 11/15/26	6,320,000.00	6,121,018.71
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,580,128.91
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	928,429.68
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	3,301,250.00
T 3.125% 05/15/48	4,780,000.00	3,988,779.31
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,576,937.50
T 3.125% 08/31/27	6,150,000.00	6,087,298.84
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	7,021,383.79
T 3.125% 11/15/28	10,410,000.00	10,256,086.47
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,705,090.82
T 3.25% 06/30/29	6,500,000.00	6,424,208.96
T 3.375% 05/15/33	13,630,000.00	13,298,301.13
T 3.375% 05/15/44	3,910,000.00	3,491,507.80
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	2,084,644.53
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,614,416.00
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,992,500.00
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	11,042,281.26
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	738,448.04
T 3.5% 04/30/30	3,500,000.00	3,491,660.16
T 3.5% 09/15/25	2,900,000.00	2,888,148.33
T 3.625% 02/15/44	4,890,000.00	4,534,519.93

T 3.625% 02/15/53	9,550,000.00	8,725,566.45
T 3.625% 05/15/53	2,300,000.00	2,103,332.03
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	4,372,468.75
T 3.75% 04/15/26	6,570,000.00	6,579,495.68
T 3.75% 06/30/30	3,000,000.00	3,029,414.07
T 3.75% 11/15/43	6,130,000.00	5,794,765.62
T 3.75% 12/31/30	6,160,000.00	6,215,825.00
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,511,679.72
T 3.875% 02/15/43	2,500,000.00	2,422,558.60
T 3.875% 08/15/33	11,070,000.00	11,198,861.66
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,435,471.68
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,595,381.63
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	8,260,842.18
T 3% 02/15/47	3,920,000.00	3,227,875.00
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	817,148.44
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	813,476.56
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	2,114,369.13
T 3% 05/15/45	700,000.00	585,210.93
T 3% 05/15/47	1,710,000.00	1,406,074.21
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,646,909.16
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,200,218.77
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,162,408.32
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,955,664.05
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,348,281.26
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,917,625.00
T 4.125% 03/31/29	3,350,000.00	3,435,712.89
T 4.125% 07/31/31	3,500,000.00	3,609,921.87
T 4.125% 08/15/53	4,300,000.00	4,302,351.58
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,469,531.29
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,156,792.96
T 4.125% 11/15/32	8,000,000.00	8,256,718.72
T 4.25% 02/15/54	10,550,000.00	10,797,265.62
T 4.25% 02/28/31	9,000,000.00	9,337,851.54
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	934,417.97
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,926,736.39
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	765,264.05
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,057,968.75
T 4.375% 05/15/34	3,310,000.00	3,478,344.54
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,995,148.42
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	681,255.86
T 4.375% 07/15/27	800,000.00	818,531.24
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	6,085,078.14
T 4.375% 08/15/43	1,500,000.00	1,549,130.86

T 4.375% 08/31/28	14,150,000.00	14,596,885.72	
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	1,008,581.25	
T 4.375% 11/30/30	4,500,000.00	4,695,468.75	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,172,771.87	
T 4.5% 04/15/27	9,150,000.00	9,368,563.48	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	588,435.54	
T 4.5% 07/15/26	10,000,000.00	10,154,492.20	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,810,898.44	
T 4.5% 11/15/33	9,270,000.00	9,821,854.68	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,488,944.52	
T 4.625% 04/30/31	7,070,000.00	7,492,681.07	
T 4.625% 05/15/54	3,900,000.00	4,248,562.50	
T 4.625% 09/30/30	3,010,000.00	3,179,959.16	
T 4.625% 10/15/26	9,520,000.00	9,717,093.70	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	820,869.14	
T 4.75% 11/15/53	3,880,000.00	4,305,511.71	
T 4.875% 05/31/26	3,400,000.00	3,467,734.39	
T 4.875% 10/31/30	4,960,000.00	5,310,493.73	
T 4% 01/15/27	7,200,000.00	7,273,265.61	
T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,525,898.47	
T 4% 02/15/34	11,600,000.00	11,838,343.80	
T 4% 02/28/30	1,350,000.00	1,380,005.85	
T 4% 07/31/30	3,980,000.00	4,070,638.29	
T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,691,490.21	
T 4% 11/15/52	7,400,000.00	7,233,789.04	
T 5.0% 05/15/37	400,000.00	448,718.75	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,388,257.80	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,154,978.52	
T 5% 08/31/25	6,750,000.00	6,812,147.99	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,756,810.54	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,563,904.30	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,194,292.97	
アメリカドル 小計	1,226,690,000.00	1,138,175,694.23 (162,451,816,837)	
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	1,340,000.00	1,289,218.78	
CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	2,023,355.89	
CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,813,663.48	
CAN 1.25% 06/01/30	3,950,000.00	3,638,098.91	
CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	889,357.66	
CAN 1.5% 06/01/31	3,300,000.00	3,038,172.34	
CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,308,059.38	
CAN 1.75% 12/01/53	2,920,000.00	2,152,051.38	

	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	775,534.11
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,477,971.06
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	236,046.38
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,237,464.17
	CAN 2.75% 06/01/33	1,200,000.00	1,186,875.21
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,599,770.51
	CAN 2.75% 12/01/48	980,000.00	917,279.02
	CAN 2.75% 12/01/55	1,990,000.00	1,839,446.27
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	576,620.49
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	400,451.75
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,430,373.33
	CAN 2% 12/01/51	3,750,000.00	2,968,955.32
	CAN 3.25% 09/01/28	1,890,000.00	1,927,265.86
	CAN 3.25% 12/01/33	2,370,000.00	2,432,089.84
	CAN 3.25% 12/01/34	1,140,000.00	1,166,936.34
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,189,466.40
	CAN 3.5% 09/01/29	2,360,000.00	2,443,215.55
	CAN 3.5% 12/01/45	960,000.00	1,017,020.64
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,339,253.33
	CAN 3% 06/01/34	2,620,000.00	2,631,190.88
	CAN 3% 10/01/25	3,290,000.00	3,282,095.93
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	827,934.41
	CAN 4.5% 02/01/26	300,000.00	305,428.59
	CAN 4.5% 11/01/25	1,580,000.00	1,601,159.32
	CAN 4% 03/01/29	2,180,000.00	2,295,626.06
	CAN 4% 05/01/26	2,250,000.00	2,283,594.02
	CAN 4% 08/01/26	1,490,000.00	1,518,853.13
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,691,155.00
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,967,066.12
	CAN 5% 06/01/37	490,000.00	591,155.69
	カナダドル 小計	66,460,000.00	64,309,272.55 (6,789,129,903)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,005,237.73
	MBONO 5.5% 03/04/27	33,260,000.00	30,707,125.04
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	44,500,806.07
	MBONO 7.5% 05/26/33	30,430,000.00	27,355,352.80
	MBONO 7.5% 06/03/27	33,800,000.00	32,544,624.05
	MBONO 7.75% 05/29/31	38,870,000.00	36,248,673.66
	MBONO 7.75% 11/13/42	32,960,000.00	27,771,560.39
	MBONO 7.75% 11/23/34	18,410,000.00	16,584,981.89
	MBONO 7% 09/03/26	14,580,000.00	13,966,619.40
	MBONO 8.5% 03/01/29	25,020,000.00	24,440,536.80
	MBONO 8.5% 05/31/29	32,230,000.00	31,486,084.86

	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,872,719.40
	MBONO 8% 07/31/53	25,920,000.00	21,936,697.60
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	21,003,654.41
	メキシコペソ 小計	386,910,000.00	357,424,674.10 (2,590,006,415)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,420,000.00	1,249,130.60
	BGB 0.35% 06/22/32	1,220,000.00	1,030,541.32
	BGB 0.4% 06/22/40	660,000.00	437,369.46
	BGB 0.65% 06/22/71	530,000.00	224,243.00
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,455,280.24
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,519,027.60
	BGB 0.9% 06/22/29	1,790,000.00	1,678,941.68
	BGB 0% 10/22/27	900,000.00	841,654.34
	BGB 0% 10/22/31	1,460,000.00	1,226,243.63
	BGB 1.25% 04/22/33	1,310,000.00	1,178,100.35
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	670,417.65
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	672,600.33
	BGB 1.6% 06/22/47	950,000.00	694,288.50
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	789,957.57
	BGB 1.9% 06/22/38	1,020,000.00	891,115.16
	BGB 1% 06/22/26	1,560,000.00	1,528,339.41
	BGB 1% 06/22/31	1,770,000.00	1,610,681.41
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	654,529.14
	BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	518,219.54
	BGB 2.7% 10/22/29	610,000.00	620,259.59
	BGB 2.75% 04/22/39	730,000.00	703,392.92
	BGB 2.85% 10/22/34	1,110,000.00	1,118,190.13
	BGB 3.3% 06/22/54	1,020,000.00	995,320.08
	BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	453,340.80
	BGB 3.5% 06/22/55	690,000.00	695,185.35
	BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	996,667.14
	BGB 3% 06/22/33	1,450,000.00	1,489,867.75
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,054,494.63
	BGB 4.25% 03/28/41	1,680,000.00	1,913,540.16
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,176,804.90
	BGB 4% 03/28/32	880,000.00	964,363.84
	BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,261,100.30
	BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,164,054.10
	BKO 2.5% 03/19/26	1,110,000.00	1,114,488.50
	BKO 2.7% 09/17/26	2,650,000.00	2,680,872.50
	BKO 2.9% 06/18/26	730,000.00	739,125.00
	BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,368,119.20

BKO 3.1% 12/12/25	1,820,000.00	1,836,324.49
BTPS 0.25% 03/15/28	2,030,000.00	1,880,386.50
BTPS 0.45% 02/15/29	1,640,000.00	1,493,548.00
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,860,246.88
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,205,475.34
BTPS 0.6% 08/01/31	1,960,000.00	1,674,589.26
BTPS 0.85% 01/15/27	2,340,000.00	2,261,192.40
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,570,067.20
BTPS 0.95% 03/01/37	1,320,000.00	978,884.28
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,987,755.12
BTPS 0.95% 08/01/30	1,180,000.00	1,059,989.57
BTPS 0.95% 09/15/27	1,640,000.00	1,571,732.54
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,858,503.33
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,160,446.01
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	3,093,126.10
BTPS 1.1% 04/01/27	2,350,000.00	2,276,083.10
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,631,495.62
BTPS 1.35% 04/01/30	2,250,000.00	2,085,674.62
BTPS 1.45% 03/01/36	1,730,000.00	1,403,479.80
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	837,887.50
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,066,192.25
BTPS 1.65% 03/01/32	2,430,000.00	2,210,340.15
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,359,736.20
BTPS 1.7% 09/01/51	1,520,000.00	969,503.50
BTPS 1.8% 03/01/41	960,000.00	726,961.20
BTPS 2.05% 08/01/27	1,280,000.00	1,267,550.72
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,432,762.20
BTPS 2.15% 03/01/72	690,000.00	436,826.92
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	709,524.24
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,269,295.40
BTPS 2.25% 09/01/36	1,650,000.00	1,451,003.40
BTPS 2.45% 09/01/33	1,510,000.00	1,424,547.59
BTPS 2.45% 09/01/50	1,380,000.00	1,048,023.75
BTPS 2.5% 11/15/25	1,660,000.00	1,659,985.89
BTPS 2.5% 12/01/32	2,520,000.00	2,409,929.55
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,771,092.75
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	913,522.78
BTPS 2.8% 03/01/67	950,000.00	726,824.64
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,622,098.65
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,432,988.31
BTPS 2.95% 02/15/27	860,000.00	870,073.34
BTPS 2.95% 09/01/38	1,380,000.00	1,273,336.35
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,226,870.09

BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,201,626.68
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,309,738.42
BTPS 3.2% 01/28/26	2,000,000.00	2,015,923.00
BTPS 3.25% 03/01/38	2,080,000.00	1,990,060.80
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	2,053,476.05
BTPS 3.35% 03/01/35	2,330,000.00	2,321,454.72
BTPS 3.35% 07/01/29	1,600,000.00	1,643,833.12
BTPS 3.4% 04/01/28	2,000,000.00	2,058,020.40
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,688,151.92
BTPS 3.5% 01/15/26	1,840,000.00	1,861,398.28
BTPS 3.5% 02/15/31	2,440,000.00	2,514,229.92
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,449,809.80
BTPS 3.7% 06/15/30	1,730,000.00	1,804,050.92
BTPS 3.8% 04/15/26	1,870,000.00	1,906,671.63
BTPS 3.8% 08/01/28	1,760,000.00	1,837,473.79
BTPS 3.85% 07/01/34	1,480,000.00	1,541,207.17
BTPS 3.85% 09/01/49	1,580,000.00	1,550,206.09
BTPS 3.85% 09/15/26	860,000.00	883,055.31
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	3,007,933.50
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,166,017.77
BTPS 4.1% 02/01/29	1,140,000.00	1,206,406.36
BTPS 4.15% 10/01/39	1,010,000.00	1,053,794.00
BTPS 4.2% 03/01/34	1,920,000.00	2,058,744.96
BTPS 4.35% 11/01/33	2,090,000.00	2,269,221.68
BTPS 4.4% 05/01/33	1,060,000.00	1,156,760.29
BTPS 4.45% 09/01/43	1,560,000.00	1,669,182.99
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,137,878.08
BTPS 4.5% 10/01/53	1,510,000.00	1,616,045.79
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,841,452.00
BTPS 4.75% 09/01/44	1,850,000.00	2,064,742.45
BTPS 4% 02/01/37	3,070,000.00	3,228,495.50
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	929,009.84
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,331,631.25
BTPS 4% 11/15/30	2,310,000.00	2,447,185.12
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	3,056,769.14
BTPS 5.25% 11/01/29	3,350,000.00	3,753,675.00
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,703,666.63
BTPS 5% 08/01/34	2,830,000.00	3,226,553.75
BTPS 5% 09/01/40	2,740,000.00	3,125,376.89
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	3,025,690.74
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,349,465.53
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,538,513.90

DBR 0.25% 02/15/27	2,490,000.00	2,393,869.18
DBR 0.25% 02/15/29	1,970,000.00	1,837,522.42
DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,964,991.87
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,933,591.25
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,299,601.04
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	336,637.52
DBR 0% 02/15/30	1,260,000.00	1,138,201.90
DBR 0% 02/15/31	1,660,000.00	1,470,217.18
DBR 0% 02/15/32	3,100,000.00	2,684,645.25
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,890,011.86
DBR 0% 05/15/36	2,430,000.00	1,875,576.06
DBR 0% 08/15/26	2,920,000.00	2,813,184.93
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,691,793.13
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	2,103,327.86
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,324,933.00
DBR 0% 08/15/31	3,990,000.00	3,494,905.63
DBR 0% 08/15/50	5,040,000.00	2,699,184.69
DBR 0% 08/15/52	3,020,000.00	1,541,585.40
DBR 0% 11/15/27	2,820,000.00	2,658,143.28
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,843,327.05
DBR 1.25% 08/15/48	3,520,000.00	2,754,523.20
DBR 1.7% 08/15/32	2,600,000.00	2,545,383.15
DBR 1.8% 08/15/53	3,700,000.00	3,195,199.75
DBR 1% 05/15/38	2,360,000.00	1,991,414.93
DBR 2.1% 11/15/29	3,430,000.00	3,453,365.84
DBR 2.2% 02/15/34	2,900,000.00	2,923,503.89
DBR 2.3% 02/15/33	4,320,000.00	4,408,629.98
DBR 2.4% 11/15/30	2,000,000.00	2,046,853.58
DBR 2.5% 07/04/44	2,930,000.00	2,941,075.98
DBR 2.5% 08/15/46	3,010,000.00	3,020,994.02
DBR 2.5% 08/15/54	1,540,000.00	1,549,966.10
DBR 2.6% 05/15/41	300,000.00	306,273.66
DBR 2.6% 08/15/33	2,890,000.00	3,013,817.42
DBR 2.6% 08/15/34	1,350,000.00	1,404,959.31
DBR 3.25% 07/04/42	2,030,000.00	2,261,230.19
DBR 4.0% 01/04/37	2,570,000.00	3,033,531.62
DBR 4.25% 07/04/39	1,810,000.00	2,222,501.17
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,575,804.23
DBR 4.75% 07/04/34	2,500,000.00	3,073,961.24
DBR 4.75% 07/04/40	2,060,000.00	2,685,081.65
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,732,818.50
DBR 5.625% 01/04/28	2,810,000.00	3,135,473.02
DBR 6.25% 01/04/30	1,570,000.00	1,901,924.69

DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	3,013,517.69
FRTR 0.25% 11/25/26	3,700,000.00	3,542,227.37
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,369,825.93
FRTR 0.5% 05/25/29	4,260,000.00	3,896,000.04
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,791,700.56
FRTR 0.5% 05/25/72	1,290,000.00	469,264.09
FRTR 0.5% 06/25/44	2,030,000.00	1,207,546.51
FRTR 0.75% 02/25/28	5,200,000.00	4,929,377.69
FRTR 0.75% 05/25/28	6,860,000.00	6,475,754.24
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,539,767.67
FRTR 0.75% 05/25/53	3,040,000.00	1,551,899.48
FRTR 0.75% 11/25/28	4,550,000.00	4,253,192.12
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,890,867.55
FRTR 0% 02/25/27	4,000,000.00	3,786,574.98
FRTR 0% 05/25/32	3,780,000.00	3,084,026.40
FRTR 0% 11/25/29	4,820,000.00	4,245,789.77
FRTR 0% 11/25/30	6,120,000.00	5,237,032.37
FRTR 0% 11/25/31	5,340,000.00	4,429,433.88
FRTR 1.25% 05/25/34	5,510,000.00	4,761,314.97
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,681,607.37
FRTR 1.25% 05/25/38	2,920,000.00	2,304,931.20
FRTR 1.5% 05/25/31	5,280,000.00	4,932,212.41
FRTR 1.5% 05/25/50	3,050,000.00	2,045,297.97
FRTR 1.75% 05/25/66	1,680,000.00	1,064,444.64
FRTR 1.75% 06/25/39	3,570,000.00	2,977,942.27
FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,803,637.94
FRTR 1% 11/25/25	4,200,000.00	4,131,466.50
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,563,744.05
FRTR 2.5% 05/25/43	1,910,000.00	1,686,847.06
FRTR 2.5% 09/24/26	3,690,000.00	3,702,905.77
FRTR 2.5% 09/24/27	1,100,000.00	1,105,023.92
FRTR 2.75% 02/25/29	4,840,000.00	4,896,027.84
FRTR 2.75% 02/25/30	2,170,000.00	2,191,721.26
FRTR 2.75% 10/25/27	5,460,000.00	5,526,557.40
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,206,830.34
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,742,786.12
FRTR 3.25% 05/25/45	2,860,000.00	2,811,135.47
FRTR 3.25% 05/25/55	870,000.00	819,078.37
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,813,862.90
FRTR 3.5% 11/25/33	4,100,000.00	4,314,694.45
FRTR 3% 05/25/33	4,210,000.00	4,274,554.87
FRTR 3% 05/25/54	2,450,000.00	2,208,028.20

FRTR 3% 06/25/49	770,000.00	714,791.00
FRTR 3% 11/25/34	250,000.00	251,552.50
FRTR 4.5% 04/25/41	3,490,000.00	4,037,389.05
FRTR 4.75% 04/25/35	3,460,000.00	4,026,229.00
FRTR 4% 04/25/55	2,540,000.00	2,751,232.75
FRTR 4% 04/25/60	1,970,000.00	2,152,353.05
FRTR 4% 10/25/38	2,140,000.00	2,341,712.12
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,681,037.31
FRTR 5.75% 10/25/32	4,370,000.00	5,311,263.04
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	1,969,039.73
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	638,488.22
IRISH 0.2% 10/18/30	910,000.00	807,788.90
IRISH 0.35% 10/18/32	450,000.00	385,402.50
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	552,966.00
IRISH 0.55% 04/22/41	410,000.00	290,789.42
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	738,987.09
IRISH 0% 10/18/31	1,120,000.00	955,167.36
IRISH 1.1% 05/15/29	980,000.00	934,474.83
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	394,673.67
IRISH 1.35% 03/18/31	370,000.00	349,986.23
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	609,694.80
IRISH 1.7% 05/15/37	740,000.00	664,708.70
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	981,387.50
IRISH 2.4% 05/15/30	930,000.00	939,035.88
IRISH 2.6% 10/18/34	200,000.00	201,836.24
IRISH 2% 02/18/45	1,010,000.00	879,760.50
IRISH 3% 10/18/43	370,000.00	381,563.61
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	869,432.40
NETHER 0.5% 01/15/40	1,470,000.00	1,077,433.56
NETHER 0.5% 07/15/26	1,750,000.00	1,701,201.95
NETHER 0.5% 07/15/32	1,300,000.00	1,135,352.97
NETHER 0.75% 07/15/27	1,060,000.00	1,022,665.47
NETHER 0.75% 07/15/28	960,000.00	913,355.52
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,156,352.75
NETHER 0% 01/15/27	1,730,000.00	1,650,895.75
NETHER 0% 01/15/29	1,770,000.00	1,617,647.25
NETHER 0% 01/15/38	1,390,000.00	983,543.15
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	860,132.00
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,190,793.15
NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,178,764.65
NETHER 2.5% 01/15/30	1,210,000.00	1,228,966.75
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,569,649.04
NETHER 2.5% 07/15/33	1,170,000.00	1,181,999.75

NETHER 2.5% 07/15/34	1,090,000.00	1,096,993.44	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,900,000.00	1,921,021.02	
NETHER 2% 01/15/54	1,160,000.00	1,000,375.59	
NETHER 3.25% 01/15/44	840,000.00	909,691.09	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,948,854.50	
NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,906,561.79	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,600,000.00	1,771,236.47	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,974,403.08	
OBL 0% 04/16/27	1,830,000.00	1,742,551.15	
OBL 0% 10/09/26	2,680,000.00	2,573,995.69	
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,905,953.06	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,487,545.73	
OBL 2.1% 04/12/29	2,780,000.00	2,797,019.71	
OBL 2.2% 04/13/28	870,000.00	877,913.52	
OBL 2.4% 10/19/28	4,270,000.00	4,346,360.41	
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	532,862.10	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,800,000.00	1,669,403.24	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,490,000.00	1,430,396.27	
RAGB 0.7% 04/20/71	420,000.00	195,932.10	
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	838,869.68	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	464,154.99	
RAGB 0.75% 10/20/26	1,480,000.00	1,439,300.00	
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	106,783.82	
RAGB 0.9% 02/20/32	1,120,000.00	999,565.34	
RAGB 0% 02/20/30	1,480,000.00	1,305,330.40	
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,431,458.20	
RAGB 0% 10/20/28	880,000.00	804,576.51	
RAGB 0% 10/20/40	650,000.00	407,774.25	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,174,780.49	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	814,922.10	
RAGB 1.5% 11/02/86	400,000.00	247,374.99	
RAGB 1.85% 05/23/49	660,000.00	526,945.32	
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	509,363.76	
RAGB 2.4% 05/23/34	930,000.00	910,623.83	
RAGB 2.9% 02/20/33	1,510,000.00	1,544,878.73	
RAGB 2.9% 02/20/34	1,060,000.00	1,082,494.02	
RAGB 2.9% 05/23/29	350,000.00	359,757.30	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	846,560.57	
RAGB 3.15% 10/20/53	440,000.00	446,664.01	
RAGB 3.2% 07/15/39	330,000.00	340,772.85	
RAGB 3.45% 10/20/30	330,000.00	349,042.71	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	490,912.80	

RAGB 4.15% 03/15/37	1,550,000.00	1,762,517.70
RAGB 4.85% 03/15/26	1,170,000.00	1,212,529.50
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,309,940.42
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	325,328.30
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	220,561.37
RFGB 0.125% 09/15/31	710,000.00	605,665.50
RFGB 0.25% 09/15/40	350,000.00	231,572.33
RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	555,260.13
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	319,369.75
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	514,804.24
RFGB 0.5% 09/15/28	780,000.00	728,932.90
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	485,469.06
RFGB 0.75% 04/15/31	510,000.00	458,710.32
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	433,312.40
RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	440,747.27
RFGB 0% 09/15/30	720,000.00	625,443.84
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	559,129.27
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	343,086.45
RFGB 1.375% 04/15/47	570,000.00	423,353.25
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	527,888.77
RFGB 2.5% 04/15/30	460,000.00	463,553.27
RFGB 2.625% 07/04/42	470,000.00	449,279.46
RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	393,865.80
RFGB 2.75% 07/04/28	680,000.00	693,389.60
RFGB 2.875% 04/15/29	320,000.00	327,770.88
RFGB 2.95% 04/15/55	350,000.00	345,007.25
RFGB 3% 09/15/33	480,000.00	495,141.60
RFGB 3% 09/15/34	430,000.00	442,589.32
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,875,843.75
SPGB 0.5% 04/30/30	3,210,000.00	2,884,241.17
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,224,245.05
SPGB 0.6% 10/31/29	1,970,000.00	1,799,084.77
SPGB 0.7% 04/30/32	2,500,000.00	2,168,771.25
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,341,485.00
SPGB 0.8% 07/30/29	2,210,000.00	2,046,979.35
SPGB 0.85% 07/30/37	1,760,000.00	1,331,642.40
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,576,112.90
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,759,027.73
SPGB 0% 01/31/28	3,050,000.00	2,824,564.57
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,547,271.44
SPGB 1.25% 10/31/30	3,370,000.00	3,130,682.82
SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	2,029,626.32
SPGB 1.4% 04/30/28	2,230,000.00	2,160,335.15

SPGB 1.4% 07/30/28	2,400,000.00	2,318,287.80	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,581,030.57	
SPGB 1.45% 10/31/27	1,960,000.00	1,911,175.41	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	340,259.70	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,470,945.00	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,190,000.00	1,963,344.85	
SPGB 1.9% 10/31/52	1,890,000.00	1,323,150.71	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,286,010.52	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,962,329.00	
SPGB 1% 07/30/42	1,350,000.00	921,791.47	
SPGB 1% 10/31/50	2,000,000.00	1,140,980.00	
SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,564,237.50	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,190,000.00	2,116,538.64	
SPGB 2.5% 05/31/27	2,330,000.00	2,340,601.50	
SPGB 2.55% 10/31/32	2,500,000.00	2,471,162.50	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,477,910.25	
SPGB 2.8% 05/31/26	2,220,000.00	2,235,076.02	
SPGB 2.9% 10/31/46	1,780,000.00	1,615,475.48	
SPGB 3.15% 04/30/33	2,170,000.00	2,232,463.45	
SPGB 3.25% 04/30/34	2,150,000.00	2,215,241.75	
SPGB 3.45% 07/30/43	1,290,000.00	1,281,997.16	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,530,000.00	1,443,760.02	
SPGB 3.45% 10/31/34	1,610,000.00	1,682,033.01	
SPGB 3.5% 05/31/29	1,980,000.00	2,072,550.14	
SPGB 3.55% 10/31/33	2,270,000.00	2,399,189.32	
SPGB 3.9% 07/30/39	1,660,000.00	1,773,855.58	
SPGB 4.2% 01/31/37	1,800,000.00	2,000,865.60	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,780,000.00	2,079,710.17	
SPGB 4.9% 07/30/40	1,880,000.00	2,234,524.76	
SPGB 4% 10/31/54	770,000.00	810,398.05	
SPGB 5.15% 10/31/28	3,710,000.00	4,107,580.29	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,640,000.00	2,033,895.20	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,735,005.50	
SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,455,995.92	
SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,045,221.45	
ユーロ 小計	702,120,000.00	669,286,537.43 (106,704,352,662)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,202,587.34
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,345,976.85
	UKT 0.25% 07/31/31	2,490,000.00	1,966,821.12
	UKT 0.375% 10/22/26	2,980,000.00	2,783,435.62
	UKT 0.375% 10/22/30	2,180,000.00	1,788,425.99

UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,902,464.20
UKT 0.5% 10/22/61	2,420,000.00	738,342.00
UKT 0.625% 07/31/35	2,250,000.00	1,584,900.00
UKT 0.625% 10/22/50	1,450,000.00	596,530.00
UKT 0.875% 01/31/46	1,530,000.00	775,557.00
UKT 0.875% 07/31/33	3,400,000.00	2,633,939.84
UKT 0.875% 10/22/29	1,460,000.00	1,272,941.72
UKT 1.125% 01/31/39	2,130,000.00	1,425,127.62
UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	390,285.00
UKT 1.25% 07/22/27	1,250,000.00	1,168,975.00
UKT 1.25% 07/31/51	2,610,000.00	1,288,035.00
UKT 1.25% 10/22/41	2,030,000.00	1,273,825.00
UKT 1.5% 07/22/26	1,990,000.00	1,910,095.13
UKT 1.5% 07/22/47	1,540,000.00	881,804.00
UKT 1.5% 07/31/53	1,680,000.00	863,184.00
UKT 1.625% 10/22/28	1,460,000.00	1,350,202.29
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	704,833.30
UKT 1.625% 10/22/71	1,790,000.00	826,622.00
UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	640,440.00
UKT 1.75% 07/22/57	1,900,000.00	1,011,907.70
UKT 1.75% 09/07/37	2,500,000.00	1,907,375.00
UKT 1% 01/31/32	3,700,000.00	3,036,231.10
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	899,142.84
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,331,930.85
UKT 3.25% 01/22/44	2,310,000.00	1,942,248.00
UKT 3.25% 01/31/33	3,960,000.00	3,776,283.32
UKT 3.5% 01/22/45	2,000,000.00	1,733,559.54
UKT 3.5% 07/22/68	1,470,000.00	1,198,785.00
UKT 3.5% 10/22/25	2,350,000.00	2,330,777.00
UKT 3.75% 01/29/38	2,430,000.00	2,325,795.52
UKT 3.75% 03/07/27	1,970,000.00	1,962,000.29
UKT 3.75% 07/22/52	1,150,000.00	1,002,800.00
UKT 3.75% 10/22/53	3,060,000.00	2,654,550.00
UKT 4.125% 01/29/27	3,540,000.00	3,554,082.12
UKT 4.125% 07/22/29	1,210,000.00	1,225,639.25
UKT 4.25% 03/07/36	1,730,000.00	1,758,095.02
UKT 4.25% 06/07/32	1,320,000.00	1,357,815.36
UKT 4.25% 07/31/34	1,250,000.00	1,276,476.37
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,264,158.00
UKT 4.25% 12/07/27	1,800,000.00	1,827,817.20
UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,431,585.00
UKT 4.25% 12/07/46	1,930,000.00	1,852,670.10
UKT 4.25% 12/07/49	1,440,000.00	1,373,971.96

	UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,610,240.00
	UKT 4.375% 07/31/54	1,390,000.00	1,342,323.00
	UKT 4.5% 06/07/28	3,370,000.00	3,445,864.42
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,449,376.63
	UKT 4.5% 12/07/42	2,290,000.00	2,308,549.00
	UKT 4.625% 01/31/34	2,230,000.00	2,343,930.70
	UKT 4.75% 10/22/43	1,830,000.00	1,893,318.00
	UKT 4.75% 12/07/30	1,910,000.00	2,013,192.71
	UKT 4.75% 12/07/38	1,800,000.00	1,901,448.00
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,133,625.00
	UKT 4% 10/22/31	1,140,000.00	1,148,424.60
	UKT 4% 10/22/63	1,440,000.00	1,299,664.07
	UKT 6.0% 12/07/28	2,010,000.00	2,190,263.03
	イギリスポンド 小計	118,350,000.00	100,431,265.72 (19,185,384,690)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,280,000.00	4,733,995.20
	SGB 0.75% 05/12/28	6,780,000.00	6,573,153.45
	SGB 0.75% 11/12/29	6,770,000.00	6,453,536.35
	SGB 1.75% 11/11/33	4,610,000.00	4,549,861.61
	SGB 1% 11/12/26	7,570,000.00	7,487,559.51
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,446,224.35
	SGB 3.5% 03/30/39	3,970,000.00	4,634,498.60
	スウェーデンクローナ 小計	40,280,000.00	39,878,829.07 (564,684,219)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,780,000.00	4,188,823.94
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,682,186.60
	NGB 1.5% 02/19/26	5,320,000.00	5,172,137.23
	NGB 1.75% 02/17/27	4,630,000.00	4,464,153.40
	NGB 1.75% 09/06/29	4,100,000.00	3,822,246.11
	NGB 2.125% 05/18/32	3,730,000.00	3,443,722.50
	NGB 2% 04/26/28	4,150,000.00	3,973,189.25
	NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,899,715.65
	NGB 3.625% 04/13/34	3,540,000.00	3,625,260.53
	NGB 3% 08/15/33	5,180,000.00	5,063,964.47
	ノルウェークローネ 小計	42,490,000.00	40,335,399.68 (548,561,435)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,940,000.00	3,423,165.55
	DGB 0.5% 11/15/27	4,990,000.00	4,792,580.12
	DGB 0.5% 11/15/29	5,600,000.00	5,233,594.79
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,715,364.86
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,534,993.73
	DGB 2.25% 11/15/26	1,920,000.00	1,935,009.60

	DGB 2.25% 11/15/33	3,880,000.00	3,949,517.96
	DGB 4.5% 11/15/39	9,470,000.00	12,095,738.37
デンマーククローネ 小計		44,900,000.00	43,679,964.98 (933,877,651)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	4,500,000.00	4,118,163.75
	POLGB 0% 10/25/25	1,480,000.00	1,414,329.80
	POLGB 1.25% 10/25/30	3,900,000.00	3,163,852.57
	POLGB 1.75% 04/25/32	4,610,000.00	3,663,789.42
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,722,388.72
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,530,000.00	4,274,173.91
	POLGB 2.75% 04/25/28	4,250,000.00	3,981,091.87
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,436,789.00
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,110,000.00	2,059,823.14
	POLGB 4.75% 07/25/29	1,650,000.00	1,637,983.37
	POLGB 5.75% 04/25/29	5,940,000.00	6,151,226.40
	POLGB 5% 10/25/34	780,000.00	765,687.39
	POLGB 6% 10/25/33	4,350,000.00	4,607,241.60
	POLGB 7.5% 07/25/28	3,970,000.00	4,341,490.76
ポーランドズロチ 小計		52,970,000.00	50,338,031.70 (1,876,405,503)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	1,980,000.00	1,902,661.20
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,390,000.00	2,251,164.90
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,770,000.00	2,295,803.70
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,250,000.00	2,815,410.00
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,860,000.00	1,055,847.60
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,000,000.00	1,702,680.00
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,294,806.60
	ACGB 1% 12/21/30	1,500,000.00	1,275,030.00
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,040,000.00	1,952,586.00
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,202,618.60
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,081,622.50
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,950,000.00	1,737,216.00
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,530,000.00	1,495,483.20
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,610,615.00
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,780,000.00	1,708,906.80
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,110,000.00	2,082,274.60
	ACGB 3.25% 06/21/39	940,000.00	841,732.40
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,690,000.00	1,621,977.50
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,440,000.00	1,394,020.80
	ACGB 3.75% 05/21/34	2,340,000.00	2,301,436.80
ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,062,558.00	
ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,707,943.20	
ACGB 4.25% 04/21/26	1,770,000.00	1,786,407.90	

	ACGB 4.25% 06/21/34	750,000.00	767,565.00	
	ACGB 4.25% 12/21/35	940,000.00	959,241.80	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,720,000.00	2,836,171.20	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,160,000.00	2,224,022.40	
	ACGB 4.75% 06/21/54	720,000.00	742,334.40	
	オーストラリアドル 小計	51,930,000.00	47,710,138.10 (4,710,421,934)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	1,340,000.00	1,186,084.28	
	NZGB 0.5% 05/15/26	730,000.00	692,266.67	
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	856,008.44	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	304,140.30	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	524,955.29	
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	415,515.46	
	NZGB 2% 05/15/32	900,000.00	777,461.74	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,320,000.00	1,256,556.84	
	NZGB 3% 04/20/29	940,000.00	910,832.76	
	NZGB 4.25% 05/15/34	750,000.00	751,291.87	
	NZGB 4.25% 05/15/36	610,000.00	600,986.14	
	NZGB 4.5% 04/15/27	930,000.00	949,049.46	
	NZGB 4.5% 05/15/30	570,000.00	587,893.38	
	NZGB 4.5% 05/15/35	440,000.00	446,858.10	
NZGB 5% 05/15/54	380,000.00	389,494.33		
	ニュージーランドドル 小計	11,600,000.00	10,649,395.06 (966,432,601)	
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	772,066.90	
	SIGB 1.25% 11/01/26	870,000.00	849,484.52	
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	527,520.19	
	SIGB 1.875% 03/01/50	730,000.00	627,077.70	
	SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	356,955.91	
	SIGB 2.125% 06/01/26	830,000.00	826,098.84	
	SIGB 2.25% 08/01/36	760,000.00	728,991.91	
	SIGB 2.375% 07/01/39	560,000.00	539,620.64	
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	724,535.49	
	SIGB 2.625% 08/01/32	460,000.00	460,460.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	820,000.00	831,978.23	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	637,560.56	
	SIGB 2.875% 07/01/29	900,000.00	915,522.56	
	SIGB 2.875% 08/01/28	140,000.00	142,132.80	
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	425,249.74	
	SIGB 2.875% 09/01/30	840,000.00	856,378.40	
	SIGB 3.25% 06/01/54	210,000.00	237,181.01	
	SIGB 3.375% 05/01/34	160,000.00	170,110.16	
	SIGB 3.375% 09/01/33	880,000.00	931,920.17	

	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	758,721.48	
	SIGB 3% 04/01/29	150,000.00	153,374.88	
	SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	541,499.14	
シンガポールドル 小計		13,080,000.00	13,014,441.23 (1,450,719,763)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,549,585.17	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,516,423.08	
	MGS 3.519% 04/20/28	710,000.00	711,743.82	
	MGS 3.582% 07/15/32	1,310,000.00	1,296,947.13	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,956,461.41	
	MGS 3.757% 05/22/40	2,950,000.00	2,883,924.77	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,785,093.49	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,830,000.00	1,841,114.87	
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,195,451.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,146,228.94	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,000,455.60	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,502,685.75	
	MGS 3.906% 07/15/26	1,210,000.00	1,224,293.24	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,702,054.60	
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	3,024,065.73	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,569,841.10	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,815,955.75	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,340,000.00	2,379,751.92	
	MGS 4.457% 03/31/53	1,740,000.00	1,821,331.94	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,930,000.00	3,062,513.64	
	MGS 4.504% 04/30/29	720,000.00	750,026.80	
	MGS 4.642% 11/07/33	2,010,000.00	2,144,670.79	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,970,000.00	2,142,311.56	
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,073,733.47	
MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	3,024,328.64		
MGS 4.893% 06/08/38	2,130,000.00	2,352,129.38		
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,888,070.85		
MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,153,719.17		
マレーシアリンギット 小計		52,910,000.00	54,514,913.61 (1,893,221,177)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,510,000.00	1,432,564.93	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	2,970,000.00	2,332,788.57	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,880,000.00	1,945,256.53	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	3,450,000.00	3,375,009.76	
	ILGOV 1% 03/31/30	3,530,000.00	2,928,263.13	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,485,755.00	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	1,520,000.00	950,080.08	

	ILGOV 2% 03/31/27	2,530,000.00	2,390,527.67	
	ILGOV 3.75% 02/28/29	2,690,000.00	2,612,968.33	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,570,000.00	2,047,515.40	
	ILGOV 3.75% 09/30/27	970,000.00	953,946.50	
	ILGOV 4% 03/30/35	1,490,000.00	1,386,139.84	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	1,952,443.16	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,390,634.58	
	イスラエルシェケル 小計	32,030,000.00	28,183,893.48 (1,079,389,570)	
オフショア 人民元	CGB 1.67% 06/15/26	34,680,000.00	34,835,897.00	
	CGB 1.85% 05/15/27	42,700,000.00	43,013,832.19	
	CGB 1.99% 03/15/26	25,520,000.00	25,739,066.22	
	CGB 2.04% 02/25/27	41,310,000.00	41,797,342.33	
	CGB 2.05% 04/15/29	36,880,000.00	37,307,874.38	
	CGB 2.12% 06/25/31	14,000,000.00	14,056,285.60	
	CGB 2.18% 08/15/26	35,600,000.00	36,064,302.32	
	CGB 2.22% 09/25/25	32,270,000.00	32,493,547.19	
	CGB 2.27% 05/25/34	38,000,000.00	38,456,254.60	
	CGB 2.28% 03/25/31	50,700,000.00	51,480,232.44	
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,504,207.01	
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,703,567.66	
	CGB 2.33% 12/15/25	35,250,000.00	35,596,405.27	
	CGB 2.35% 02/25/34	25,200,000.00	25,686,458.27	
	CGB 2.37% 01/15/29	34,560,000.00	35,449,242.62	
	CGB 2.37% 01/20/27	43,880,000.00	44,690,735.65	
	CGB 2.39% 11/15/26	42,750,000.00	43,519,688.10	
	CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	43,659,782.57	
	CGB 2.44% 10/15/27	17,700,000.00	18,109,880.67	
	CGB 2.46% 02/15/26	29,300,000.00	29,667,433.72	
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,454,038.00	
	CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	27,260,756.70	
	CGB 2.5% 07/25/27	26,760,000.00	27,413,540.74	
	CGB 2.52% 08/25/33	58,370,000.00	60,176,277.16	
	CGB 2.54% 12/25/30	30,500,000.00	31,520,767.90	
	CGB 2.55% 10/15/28	27,250,000.00	28,111,470.60	
	CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	33,203,251.94	
	CGB 2.6% 09/15/30	30,500,000.00	31,589,441.70	
	CGB 2.62% 04/15/28	34,000,000.00	35,057,869.20	
	CGB 2.62% 06/25/30	36,400,000.00	37,753,049.88	
	CGB 2.62% 09/25/29	20,940,000.00	21,791,338.73	
	CGB 2.64% 01/15/28	38,220,000.00	39,361,214.80	
CGB 2.67% 05/25/33	34,280,000.00	35,722,725.22		
CGB 2.67% 11/25/33	23,400,000.00	24,425,783.46		

CGB 2.68% 05/21/30	30,700,000.00	31,936,402.59	
CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,616,884.42	
CGB 2.69% 08/15/32	19,420,000.00	20,233,721.30	
CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	15,189,128.45	
CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	26,563,893.70	
CGB 2.76% 05/15/32	13,150,000.00	13,782,909.50	
CGB 2.79% 12/15/29	30,300,000.00	31,679,189.34	
CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	24,109,598.80	
CGB 2.8% 03/25/30	39,490,000.00	41,363,480.63	
CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,839,079.48	
CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	32,041,202.53	
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,986,978.98	
CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	25,581,281.03	
CGB 2.91% 10/14/28	24,320,000.00	25,428,838.78	
CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	13,168,150.42	
CGB 3.02% 05/27/31	27,560,000.00	29,333,629.30	
CGB 3.02% 10/22/25	49,870,000.00	50,727,404.93	
CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,228,147.44	
CGB 3.12% 10/25/52	12,970,000.00	15,190,549.60	
CGB 3.19% 04/15/53	18,360,000.00	21,790,417.28	
CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,408,391.45	
CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,863,128.30	
CGB 3.29% 05/23/29	35,000,000.00	37,497,124.00	
CGB 3.32% 04/15/52	18,600,000.00	22,371,934.92	
CGB 3.39% 03/16/50	20,930,000.00	25,340,817.50	
CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	10,421,495.55	
CGB 3.72% 04/12/51	15,140,000.00	19,335,525.64	
CGB 3.81% 09/14/50	21,220,000.00	27,447,980.87	
CGB 3.86% 07/22/49	18,180,000.00	23,552,859.02	
CGB 3% 10/15/53	13,770,000.00	15,917,650.43	
CGB 4.08% 10/22/48	19,370,000.00	25,755,568.43	
オフショア人民元 小計	1,795,560,000.00	1,881,376,926.45 (38,468,325,877)	
合計		350,212,730,237 (350,212,730,237)	

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 212銘柄	100.0%	46.4%

カナダドル	国債証券	38銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券	370銘柄	100.0%	30.5%
イギリスポンド	国債証券	61銘柄	100.0%	5.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券	10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	28銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券	15銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券	22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	14銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券	65銘柄	100.0%	11.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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24期中間計算期間(2024年10月1日から2025年3月31日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DCマイセレクション25】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第23期 (2024年 9月30日現在)	第24期中間計算期間 (2025年 3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,351,381,206	3,353,508,503
親投資信託受益証券	62,188,074,653	61,164,523,774
未収入金	57,390,000	11,110,000
未収利息	19,698	42,725
流動資産合計	65,596,865,557	64,529,185,002
資産合計	65,596,865,557	64,529,185,002
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,937,807	30,111,284
未払受託者報酬	10,715,628	10,830,563
未払委託者報酬	82,153,019	82,773,124
その他未払費用	1,833,555	920,140
流動負債合計	132,640,009	124,635,111
負債合計	132,640,009	124,635,111
純資産の部		
元本等		
元本	33,836,375,825	33,819,521,174
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	31,627,849,723	30,585,028,717
(分配準備積立金)	11,197,996,924	10,681,732,284
元本等合計	65,464,225,548	64,404,549,891
純資産合計	65,464,225,548	64,404,549,891
負債純資産合計	65,596,865,557	64,529,185,002

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第23期中間計算期間 自 2023年10月 3日 至 2024年 4月 2日	第24期中間計算期間 自 2024年10月 1日 至 2025年 3月31日
営業収益		
受取利息	89,744	5,024,703
有価証券売買等損益	3,611,992,831	937,820,879
営業収益合計	3,612,082,575	932,796,176
営業費用		
支払利息	273,031	-
受託者報酬	10,696,011	10,830,563
委託者報酬	82,002,682	82,773,124
その他費用	920,783	920,140
営業費用合計	93,892,507	94,523,827
営業利益又は営業損失（ ）	3,518,190,068	1,027,320,003
経常利益又は経常損失（ ）	3,518,190,068	1,027,320,003
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,518,190,068	1,027,320,003
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（ ）	90,535,228	7,153,168
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	29,083,231,429	31,627,849,723
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,445,134,665	1,483,704,889
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,445,134,665	1,483,704,889
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,568,633,821	1,492,052,724
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,568,633,821	1,492,052,724
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	32,387,387,113	30,585,028,717

(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23期 (2024年 9月30日現在)	第24期中間計算期間 (2025年 3月31日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	33,836,375,825口	33,819,521,174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) 1.9347円 (19,347円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9044円 (19,044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24期中間計算期間 (2025年 3月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第23期 自 2023年10月 3日 至 2024年 9月30日	第24期中間計算期間 自 2024年10月 1日 至 2025年 3月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	34,553,244,307円	33,836,375,825円
期中追加設定元本額	3,187,828,498円	1,578,985,866円
期中一部解約元本額	3,904,696,980円	1,595,840,517円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	53,068,705,263
株式	684,712,360,205
派生商品評価勘定	27,559,350
未収入金	454,947,870
未収配当金	8,096,243,401
未収利息	676,124
前払金	539,637,100
その他未収収益	119,378,504
差入委託証拠金	331,252,876
流動資産合計	747,350,760,693
資産合計	747,350,760,693
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	567,504,450
未払解約金	171,781,220
未払利息	13,092,907
受入担保金	46,185,177,083
流動負債合計	46,937,555,660
負債合計	46,937,555,660
純資産の部	
元本等	
元本	247,775,454,975
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	452,637,750,058
元本等合計	700,413,205,033
純資産合計	700,413,205,033
負債純資産合計	747,350,760,693

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 3月31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）

	2025年 3月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	247,775,454,975口
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	

	2025年 3月31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	株式 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	42,175,972,970円 2.8268円 (28,268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

	2025年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年10月 1日
期首元本額	242,341,869,199円
期中追加設定元本額	14,969,334,527円
期中一部解約元本額	9,535,748,751円
期末元本額	247,775,454,975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)	253,014,173円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,165,132,866円
SBI資産設計オープン(分配型)	11,793,184円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,103,325,580円
世界経済インデックスファンド	7,243,339,883円
日本株式インデックス・オープン	2,663,551,548円
DCマイセレクション25	4,618,071,161円
DCマイセレクション50	15,862,209,398円
DCマイセレクション75	17,832,060,247円
DC日本株式インデックス・オープン	5,929,093,543円
DCマイセレクションS25	3,642,891,010円
DCマイセレクションS50	11,175,971,742円
DCマイセレクションS75	11,197,619,038円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,702,918,331円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	17,517,651円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	520,745,912円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	445,684,983円
DC世界経済インデックスファンド	3,750,053,873円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	310,310,359円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,539,688円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	9,869,842円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	12,692,252円

区分	2025年 3月31日現在
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	87,859,793円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,803,222円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	9,015,618円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	38,378,358円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	11,273,984円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	37,061,559円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	261,057,386円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	256,564,737円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,771,440,798円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,022,538円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	7,917,990円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	249,446,568円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	143,426,043円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	191,095,464円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	13,455,483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）	356,587,567円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,522,484,632円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,072,155,209円
コア投資戦略ファンド（安定型）	503,870,105円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,266,388,442円
分散投資コア戦略ファンドA	1,605,334,318円
分散投資コア戦略ファンドS	5,896,051,461円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	743,455,323円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	431,637,620円
コア投資戦略ファンド（切替型）	433,561,385円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	189,958,587円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,495,809円
SMT インデックスバランス・オープン	44,700,866円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	17,777,633,690円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	179,837,990円
SMT 世界経済インデックス・オープン	63,746,852円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	305,139,919円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	46,699,609円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,954,509円
グローバル経済コア	329,929,297円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	37,353,113円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	3,509,062,813円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	31,841,792円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	469,962,790円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	135,052,904円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	72,679,373円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	76,377,781円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	36,791,031円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	49,793,111円
10資産分散投資ファンド	115,967,217円
グローバル10資産バランスファンド	56,476,202円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	7,273,667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	8,530,094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	7,070,672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	4,645,776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	3,579,774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	1,967,629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	602,525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	468,639円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	988,997,768円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,135,154,142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）	203,345,773円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	311,978,032円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	27,944,723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）	50,850,175,346円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,320,751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）	248,034,396円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	18,669円

区分	2025年 3月31日現在
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	25,215円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	27,890円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	30,176円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	24,738円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	31,458円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 3月31日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	15,446,837,100	-	14,907,200,000	539,637,100
合計		15,446,837,100	-	14,907,200,000	539,637,100

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,398,503,057
国債証券	598,825,690,760
地方債証券	35,397,459,061
特殊債券	37,864,347,405
社債券	33,263,939,000
未収入金	3,056,432,300
未収利息	873,246,622
前払費用	43,955,108
流動資産合計	712,723,573,313
資産合計	712,723,573,313
負債の部	
流動負債	
未払金	6,125,196,800
未払解約金	112,722,253
流動負債合計	6,237,919,053
負債合計	6,237,919,053
純資産の部	
元本等	
元本	555,501,384,573
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	150,984,269,687
元本等合計	706,485,654,260
純資産合計	706,485,654,260
負債純資産合計	712,723,573,313

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 3月31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、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
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）

	2025年 3月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	555,501,384,573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 97,730,000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 1.2718円 (1万口当たり純資産額) (12,718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

	2025年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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	2025年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年10月 1日
期首元本額	509,858,434,543円
期中追加設定元本額	62,327,264,011円
期中一部解約元本額	16,684,313,981円
期末元本額	555,501,384,573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）	5,016,318,975円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,153,170円
S M T 国内債券インデックス・オープン	16,142,253,651円
世界経済インデックスファンド	10,349,017,422円
D C マイセレクション 2 5	30,200,554,236円

区分	2025年 3月31日現在
DCマイセレクション50	38,953,981,371円
DCマイセレクション75	14,128,320,948円
DC日本債券インデックス・オープン	407,512,910円
DC日本債券インデックス・オープンS	86,278,951,152円
DC日本債券インデックス・オープンP	61,723,199,584円
DCマイセレクションS25	23,796,920,847円
DCマイセレクションS50	27,806,654,460円
DCマイセレクションS75	8,337,370,551円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	116,889,099円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	3,347,257,744円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,438,163,402円
DC世界経済インデックスファンド	6,978,947,531円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	1,741,162円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	24,756,592円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	9,434,268円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,352,237円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	40,660,407円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	70,879,714円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	24,307,785円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	23,290,619円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,348,842,667円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	722,202,670円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,193,067,144円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	67,356,165円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	39,072,397円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	854,366,641円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	935,199,742円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,271,165,396円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	86,979,133円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,870,589,820円
日本債券ファンド・シリーズ1	18,012,925,031円
分散投資コア戦略ファンドA	18,834,927,309円
分散投資コア戦略ファンドS	27,359,195,173円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	388,777,928円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,325,210,722円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	92,405,613円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	49,158,831円
SMT インデックスバランス・オープン	62,913,940円
SMT 世界経済インデックス・オープン	84,296,229円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	196,692,974円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	310,468,192円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	25,476,520円
グローバル経済コア	494,802,544円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	62,019,030円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	51,179,406円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	239,548,501円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	144,442,497円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	46,341,207円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	39,727,624円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	1,635,387,569円
10資産分散投資ファンド	502,332,719円
グローバル10資産バランスファンド	833,170,954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	45,543,906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	31,299,967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	17,654,554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	13,682,687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	8,659,999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	5,685,147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	6,142,111円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	14,349,447,632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）	117,769,053,949円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	78,139,971円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	22,619,851円

区分	2025年 3月31日現在
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	732,523,126円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	153,645円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	98,819円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	81,388円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	55,247円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	111,057円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	72,152円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	18,263,177,432
コール・ローン	1,583,996,883
株式	759,719,427,822
投資信託受益証券	124,660,309
投資証券	14,327,548,996
派生商品評価勘定	135,754,004
未収入金	107,921,704
未収配当金	1,106,561,380
未収利息	20,180
前払金	153,487,039
差入委託証拠金	3,638,048,203
流動資産合計	799,160,603,952
資産合計	799,160,603,952
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	157,679,618
未払解約金	15,016,010,391
流動負債合計	15,173,690,009
負債合計	15,173,690,009
純資産の部	
元本等	
元本	116,307,348,409
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	667,679,565,534
元本等合計	783,986,913,943
純資産合計	783,986,913,943
負債純資産合計	799,160,603,952

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 3月31日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券</p>

2025年 3月31日現在	
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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)

2025年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	116,307,348,409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 6.7406円 (1万口当たり純資産額) (67,406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

2025年 3月31日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	2025年 3月31日現在
	「(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	2025年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年10月 1日
期首元本額	117,167,283,618円
期中追加設定元本額	6,319,461,716円
期中一部解約元本額	7,179,396,925円
期末元本額	116,307,348,409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）	1,259,540,243円
S B I 資産設計オープン（分配型）	4,761,905円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,982,402,693円
世界経済インデックスファンド	15,472,269,686円
外国株式インデックス・オープン	844,858,535円
D Cマイセクション2 5	500,008,737円
D Cマイセクション5 0	2,792,770,279円
D Cマイセクション7 5	3,838,682,194円
D C外国株式インデックス・オープン	13,832,711,769円
D CマイセクションS 2 5	384,888,527円
D CマイセクションS 5 0	1,971,786,403円
D CマイセクションS 7 5	2,294,051,791円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5	3,549,873円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5	105,469,982円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5	90,280,901円
D C世界経済インデックスファンド	8,781,701,896円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	661,079,943円
マイセクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,753,918円
マイセクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,500,900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）	11,627,577円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,503,824円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	15,320,470円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	4,594,676円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	15,111,331円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	70,961,928円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	90,842,524円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	722,845,320円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	50,600,768円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	9,605,510円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	78,854,215円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	25,552,435円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	685,718,517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）	590,338,778円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,070,845,420円

区分	2025年 3月31日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	114,577,469円
コア投資戦略ファンド（成長型）	285,322,451円
分散投資コア戦略ファンドA	1,161,665,477円
分散投資コア戦略ファンドS	5,811,655,450円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,569,857,506円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	935,381,480円
コア投資戦略ファンド（切替型）	107,398,629円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	393,535,495円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	20,058,964円
SMT インデックスバランス・オープン	90,332,832円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	68,200,972円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	3,945,001,309円
SMT 世界経済インデックス・オープン	274,153,989円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,395,564,491円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	200,370,609円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,753,652円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	3,783,689,438円
グローバル経済コア	760,521,841円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,231,180円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,453,400円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	128,510,023円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,864,422円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	186,392,534円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	195,908,232円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	93,587,685円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	127,451,180円
10資産分散投資ファンド	57,475,217円
グローバル10資産バランスファンド	22,654,464円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	16,252,143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	5,136,560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	4,267,424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	2,795,177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	2,187,979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	1,185,688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	362,224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	282,462円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	105,533,134円
DC全世界株式インデックスファンド（オール・カンントリー）	17,691,683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）	50,024,141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）	583,975,098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）	801,274,383円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,496,314,008円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	122,360,625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）	40,702,328円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	75,432,093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）	96,516,516円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	10,768円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	12,624円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	15,358円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	16,596円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	13,757円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	13,155円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	141,959,661円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	140,996,114円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	140,479,419円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	139,089,349円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	137,907,114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）	32,532,176円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	89,044,793円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2025年 3月31日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,859,998,049	-	9,706,511,010	153,487,039
合計		9,859,998,049	-	9,706,511,010	153,487,039

(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

(2025年 3月31日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	332,055,400	-	332,171,630	116,230
	アメリカドル	251,126,400	-	251,136,480	10,080
	ユーロ	80,929,000	-	81,035,150	106,150
	売建	13,736,949,850	-	13,605,504,655	131,445,195
	アメリカドル	10,723,840,000	-	10,614,713,000	109,127,000
	カナダドル	453,817,700	-	449,405,900	4,411,800
	ユーロ	1,377,375,350	-	1,369,494,035	7,881,315
	イギリスポンド	410,657,100	-	406,974,330	3,682,770
	スイスフラン	342,416,000	-	340,082,600	2,333,400
	スウェーデンクローナ	116,208,400	-	115,263,610	944,790
	デンマーククローネ	98,302,500	-	97,735,500	567,000
	オーストラリアドル	152,176,000	-	150,337,120	1,838,880
	香港ドル	62,156,800	-	61,498,560	658,240
	合計	14,069,005,250	-	13,937,676,285	131,561,425

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	665,234,736
コール・ローン	4,052,200,363
国債証券	377,895,783,292
派生商品評価勘定	28,846,121
未収入金	9,466,733
未収利息	3,168,228,694
前払費用	310,338,057
差入委託証拠金	227,622,083
流動資産合計	386,357,720,079
資産合計	386,357,720,079
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,106,930
前受金	33,438
未払金	29,240,041
未払解約金	71,664,997
流動負債合計	115,045,406
負債合計	115,045,406
純資産の部	
元本等	
元本	107,180,057,327
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	279,062,617,346
元本等合計	386,242,674,673
純資産合計	386,242,674,673
負債純資産合計	386,357,720,079

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 3月31日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

	2025年 3月31日現在
	(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)

	2025年 3月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	107,180,057,327口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 3.6037円 (1万口当たり純資産額) (36,037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

	2025年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額 によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引におけ る名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引 のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年10月 1日
期首元本額	101,514,169,946円
期中追加設定元本額	9,106,024,926円
期中一部解約元本額	3,440,137,545円
期末元本額	107,180,057,327円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,038,668,411円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	444,381,096円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	309,732,561円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,322,677,315円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,662,956円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	7,986,733,764円
世界経済インデックスファンド	28,080,054,467円
DCマイセレクション25	1,756,732,372円
DCマイセレクション50	1,702,724,280円
DCマイセレクション75	1,449,681,692円
DC外国債券インデックス・オープン	2,220,301,233円
DCマイセレクションS25	1,382,871,497円
DCマイセレクションS50	1,187,970,154円
DCマイセレクションS75	842,430,037円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	3,511,123円

区分	2025年 3月31日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,853,886円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	58,591,046円
DC世界経済インデックスファンド	16,491,262,129円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	739,817,357円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,123,887円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	986,557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）	6,764,410円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	16,118,394円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	30,145,764円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	43,682,459円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	47,850,253円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	464,419,032円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	327,531,309円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,403,669,929円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	50,429,938円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	22,337,386円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	295,481,062円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	106,925,000円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	146,115,296円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	584,047,534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）	1,086,620,603円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	671,794,175円
外国債券ファンド・シリーズ1	818,817,728円
分散投資コア戦略ファンドA	838,576,134円
分散投資コア戦略ファンドS	1,685,946,645円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	900,878,783円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,716,612,955円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	226,390,894円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,844,306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）	1,315,871,346円
SMT インデックスバランス・オープン	156,021,317円
SMT 世界経済インデックス・オープン	539,811,432円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	800,049,828円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,208,320,299円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,349,867円
グローバル経済コア	1,386,026,901円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	26,795,868円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	3,153,256円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	73,261,345円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	119,543,182円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	64,977,801円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	97,245,021円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	1,163,354,020円
10資産分散投資ファンド	36,673,972円
グローバル10資産バランスファンド	40,104,943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	5,933,210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	4,523,039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	2,773,327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	2,151,975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	1,257,362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	579,257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	560,655円
DCマイセクションS50（2024-2026リスク抑制型）	839,127,273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）	15,147,328,590円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	302,609,909円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	965,339,171円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	141,469,691円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	7,687円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	22,489円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	17,037円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	10,397円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	3,464円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	14,587円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2025年 3月31日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	3,118,339,979	-	3,118,373,417	33,438
合計		3,118,339,979	-	3,118,373,417	33,438

(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

(2025年 3月31日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,890,648,536	-	3,905,327,690	14,679,154
	アメリカドル	1,897,808,156	-	1,906,114,050	8,305,894
	カナダドル	141,757,315	-	143,048,550	1,291,235
	ユーロ	1,174,383,289	-	1,177,267,450	2,884,161
	イギリスポンド	215,086,662	-	216,697,600	1,610,938
	オフショア人民元	461,613,114	-	462,200,040	586,926
	売建	2,687,777	-	2,661,178	26,599
	マレーシアリンギット	2,687,777	-	2,661,178	26,599
	合計		3,893,336,313	-	3,907,988,868

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DCマイセレクション25】

【純資産額計算書】

(2025年 4月30日現在)

資産総額	64,253,018,846円
負債総額	55,226,467円
純資産総額(-)	64,197,792,379円
発行済口数	33,637,361,395口
1口当たり純資産額(/)	1.9085円
(1万口当たり純資産額)	(19,085円)

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2025年 4月30日現在)

資産総額	732,080,036,866円
負債総額	17,614,838,475円
純資産総額(-)	714,465,198,391円
発行済口数	251,846,012,488口
1口当たり純資産額(/)	2.8369円
(1万口当たり純資産額)	(28,369円)

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2025年 4月30日現在)

資産総額	716,886,905,471円
負債総額	7,499,145,917円
純資産総額(-)	709,387,759,554円
発行済口数	554,563,174,186口
1口当たり純資産額(/)	1.2792円
(1万口当たり純資産額)	(12,792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

(2025年 4月30日現在)

資産総額	750,373,131,231円
負債総額	770,460,760円
純資産総額(-)	749,602,670,471円
発行済口数	116,101,621,343口

1口当たり純資産額（ / ）	6.4564円
（1万口当たり純資産額）	（64,564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

（2025年 4月30日現在）

資産総額	378,598,546,505円
負債総額	136,177,009円
純資産総額（ - ）	378,462,369,496円
発行済口数	106,882,237,123口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5409円
（1万口当たり純資産額）	（35,409円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2025年 4月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外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。

各運用部の部長は、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・リスク委員会に報告されます。なお、運用・リスク委員会での報告のうち重要なものについては、経営会議（議長は社長）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2025年 6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2025年4月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	522	15,497,222
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	50	148,394
単位型公社債投資信託	52	165,181
合計	624	15,810,797

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財務諸表等規則並びに同規則第2条、第282条及び第306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38期事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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39期事業年度の間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）の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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,067	14,909
金銭の信託	14,693	18,596
前払費用	198	429
未収委託者報酬	9,147	10,943
未収運用受託報酬	5,815	5,967
未収収益	176	185
短期差入証拠金	3,541	3,660
その他	1,566	4,074
流動資産合計	58,207	58,767
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 255	1 219
器具備品	1 560	1 436
有形固定資産合計	816	655
無形固定資産		
ソフトウェア	7,203	7,463
その他	40	61
無形固定資産合計	7,244	7,524
投資その他の資産		
投資有価証券	4,063	5,753
関係会社株式	5,636	6,077
繰延税金資産	1,181	1,196
その他	31	31
投資その他の資産合計	10,911	13,058
固定資産合計	18,972	21,238
資産合計	77,179	80,005

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
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	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077
その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	-	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取利息	57	138

収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	-	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	-
その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	-
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	-	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	-	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	560	250	250
当期変動額合計	310	560	250	968
当期末残高	360	1,071	710	67,103

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。

(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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建 物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	"	823	"
計	866	"	1,044	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

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23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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
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
2024年6月20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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。
これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

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（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)				
株式関連取引	(10)	-	-	(10)
通貨関連取引	-	(136)	-	(136)
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。

当事業年度（2024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)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(*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1,017百万円）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18,596百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）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、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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(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(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

当事業年度(2024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	14,909	-	-	-
未収委託者報酬	10,943	-	-	-
未収運用受託報酬	5,967	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,829	807	-

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

2. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(2024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	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	185	1	33

(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（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)
店頭	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。

当事業年度（2024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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3
合計	8,231	-	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）株式関連

前事業年度（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。

当事業年度（2024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	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

（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（2023年3月31日）

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		1,729	-	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

当事業年度（2024年3月31日）

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		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	1
合計			7,337	-	10

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	57	85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	6	17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	-	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024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109百万円、当事業年度122百万円であります。

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		

	58	百万円	63	百万円
未払事業税	58	百万円	63	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187	"	220	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	277	"	298	"
税務上の費用認識差額	412	"	256	"
繰延ヘッジ損益	225	"	472	"
その他	75	"	78	"
繰延税金資産 合計	1,236	"	1,390	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	21	"	159	"
その他	32	"	35	"
繰延税金負債 合計	54	"	194	"
繰延税金資産の純額	1,181	"	1,196	"

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、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 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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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	10,223百万円

[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 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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

（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（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）

当事業年度（2024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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭

1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02銭
--------------	---------------	---------------

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
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39期中間会計期間末

(2024年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		15,957
金銭の信託		18,219
未収委託者報酬		11,990
未収運用受託報酬		6,429
短期差入証拠金		2,431
その他		4,238
流動資産合計		59,268

固定資産

有形固定資産	1	592
無形固定資産		
ソフトウェア		6,988
その他		59
無形固定資産合計		7,047

投資その他の資産

投資有価証券		6,615
関係会社株式		6,077
繰延税金資産		1,127
その他		30
投資その他の資産合計		13,850

固定資産合計

固定資産合計		21,491
--------	--	--------

資産合計

80,759

負債の部

流動負債

未払金		8,431
未払法人税等		1,202
賞与引当金		424
その他	2	2,306
流動負債合計		12,364

固定負債

退職給付引当金		1,035
資産除去債務		154

その他	53
固定負債合計	1,244
負債合計	13,608

(単位：百万円)

第39期中間会計期間末

(2024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	45,816
利益剰余金合計	48,416
株主資本合計	67,655
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	453
繰延ヘッジ損益	958
評価・換算差額等合計	504
純資産合計	67,150
負債・純資産合計	80,759

中間損益計算書

(単位：百万円)

第39期中間会計期間

(自 2024年4月1日

至 2024年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		24,956
運用受託報酬		6,026
その他営業収益		187
営業収益合計		31,169
営業費用		18,985
一般管理費	1	7,504
営業利益		4,678
営業外収益	2	193
営業外費用	3	976
経常利益		3,896
特別損失		61
税引前中間純利益		3,835
法人税、住民税及び事業税		1,202
法人税等還付税額		129
法人税等調整額		22
法人税等合計		1,050
中間純利益		2,785

中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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	45,974	48,574	67,813
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,943	2,943	2,943
中間純利益			2,785	2,785	2,785
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	-	-	157	157	157
当中間期末残高	500	2,100	45,816	48,416	67,655

	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	360	1,071	710	67,103
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,943
中間純利益				2,785
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	92	112	205	205
当中間期変動額合計	92	112	205	47
当中間期末残高	453	958	504	67,150

注記事項

（重要な会計方針）

第39期中間会計期間
（自 2024年4月1日
至 2024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。

(中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間末
(2024年9月30日)

1	有形固定資産の減価償却累計額	1,128百万円
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39期中間会計期間
(自 2024年4月1日
至 2024年9月30日)

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	83百万円
	無形固定資産	1,211百万円

2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益	149百万円
3	営業外費用の主要項目 金銭の信託運用損 投資有価証券償還損 為替差損 デリバティブ費用	263百万円 239百万円 146百万円 138百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）
第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	981,032	2024年3月31日	2024年6月21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39期中間会計期間末（2024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、市場価格のない株式等、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定適用指針」という。）第24-3項を適用した投資信託及び第24-16項を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2及び（注2）、（注3）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	2,561	15,657	-	18,219
投資有価証券(*2) 其他有価証券	-	3,269	-	3,269
資産計	2,561	18,927	-	21,488
デリバティブ取引(*3) 株式関連取引 通貨関連取引 デリバティブ取引計	(281) - (281)	(230) (286) (517)	- - -	(511) (286) (798)

(*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、非上場株式（中間貸借対照表計上額876百万円）、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（中間貸借対照表計上額1,991百万円）及び第24-16項を適用した組合出資金等（中間貸借対照表計上額478百万円）は上記に含めておりません。

(*3)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。時価算定適用指針第24-3項の取り扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付していません。

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	876
関係会社株式	6,077

(注3) 時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報

第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

(単位：百万円)

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券(その他有価証券)	-	-	8	2,000	1,991	-	1,991	-

(注) 決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,991百万円であります。

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末（2024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	6,077

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	3,010	2,306	704
小計	3,010	2,306	704
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,249	2,306	57
小計	2,249	2,306	57
合計	5,260	4,613	647

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額478百万円）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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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	5,053	-	83	83
	英ポンド	173	-	5	5
	カナダドル	130	-	2	2
	スイスフラン	74	-	1	1
	香港ドル	120	-	1	1
	ユーロ	461	-	9	9
	買建				
	米ドル	42	-	0	0
	ユーロ	11	-	0	0
合計		6,068	-	104	104

(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	10,399	-	281	281
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	5,524	-	230	230
合計		15,923	-	511	511

(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		1,833	-	30
	英ポンド		4,463	-	137
	スイスフラン		49	-	0
	香港ドル		95	-	1
	ユーロ		31	-	0
	シンガポールドル		433	-	11
	合計			6,906	-

(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39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024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	5,620百万円

[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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1株当たり純資産額	22,383,579円15銭
1株当たり中間純利益	928,397円37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39期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
中間純利益	2,785百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,785百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

4 【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

と。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2025年6月30日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2024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） （2024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。
株式会社愛媛銀行	21,367	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
第一生命保険株式会社	60,000	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
アイザワ証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2024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

2024年6月3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**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2024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

2024年12月10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 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCマイセレクション25の2023年10月3日から2024年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCマイセレクション25の2024年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年12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

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2024年4月1日から2025年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024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2024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（2024年4月1日から2024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

2025年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 百瀬和政

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCマイセレクション25の2024年10月1日から2025年3月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCマイセレクション25の2025年3月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年10月1日から2025年3月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。