

S B I 資産設計オープン（資産成長型）

愛称：スゴ6

追加型投信／内外／資産複合

投資信託説明書

（請求目論見書）

2025年2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

※本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

SBI資産設計オープン（資産成長型）の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2025年2月10日に関東財務局長に提出しており、2025年2月11日にその届出の効力が生じております。

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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	:	該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行(売出)価額の総額】	1
(4)【発行(売出)価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	1
(7)【申込期間】	2
(8)【申込取扱場所】	2
(9)【払込期日】	2
(10)【払込取扱場所】	2
(11)【振替機関に関する事項】	2
(12)【その他】	3
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
1【ファンドの性格】	4
2【投資方針】	14
3【投資リスク】	24
4【手数料等及び税金】	27
5【運用状況】	31
第2【管理及び運営】	52
1【申込(販売)手続等】	52
2【換金(解約)手続等】	54
3【資産管理等の概要】	56
4【受益者の権利等】	60
第3【ファンドの経理状況】	61
1【財務諸表】	64
2【ファンドの現況】	262
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	265
第三部【委託会社等の情報】	266
第1【委託会社等の概況】	266
1【委託会社等の概況】	266
2【事業の内容及び営業の概況】	267
3【委託会社等の経理状況】	268
4【利害関係人との取引制限】	302
5【その他】	302
約款	

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

SBI 資産設計オープン（資産成長型）

愛称として「スゴ6」という名称を用いることがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- ①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
- ②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」といいます。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
- ③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）とします。

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

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

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

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。また、確定拠出年金によるお申込みについては1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

2025年2月11日から2025年8月8日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

<振替受益権について>

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

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

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、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>

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

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

<受益権の取得申込みの受付の中止等>

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

<受付不可日>

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 5,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

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ぬファンドをいう。
- (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

- ①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- ③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2) 債券

- ①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

- ①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
- ②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

- (1) 年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- (2) 年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- (3) 年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- (4) 年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- (5) 年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6) 日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- (7) その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1) グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2) 日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

- (3) 北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) 欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

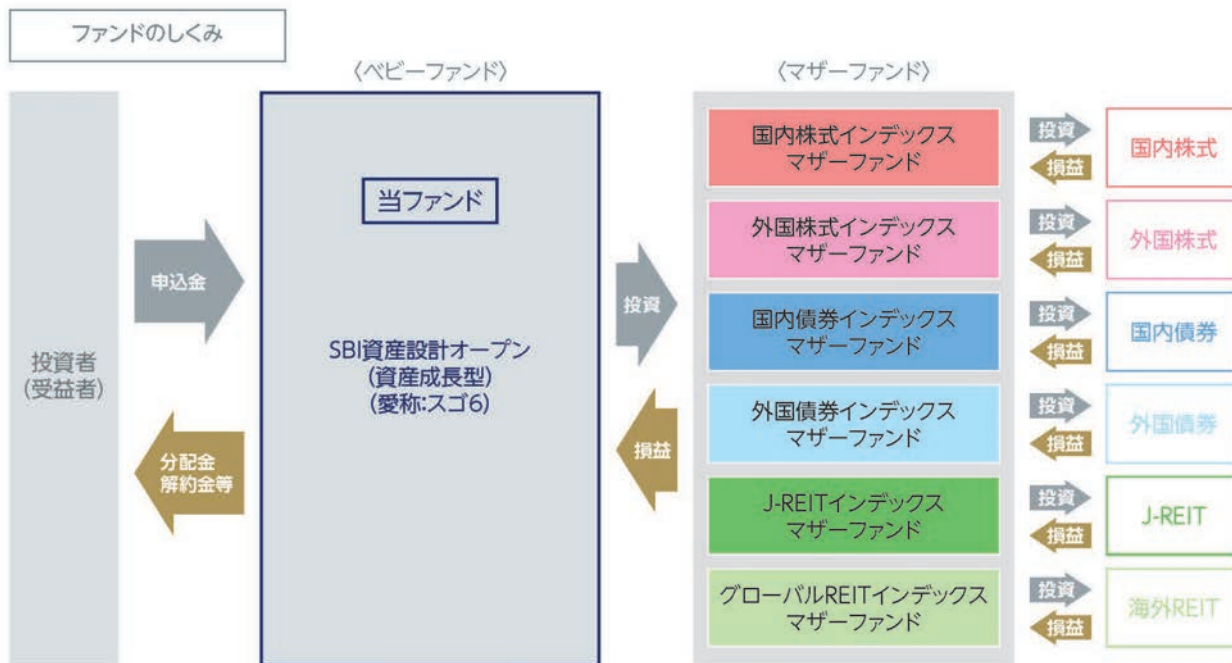
- (1) ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型/絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市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

◆ESG 分類：当ファンドは ESG 投信ではありません。

<ファンドの特色>

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
外国株式	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
国内債券	NOMURA-BPI総合
外国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
J - R E I T	東証REIT指数(配当込み)
海外REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)

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

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

「TOPIX (東証株価指数)」とは、株式会社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。

「MSCI コクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCI コクサイ・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCI コクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

「NOMURA-BPI 総合」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

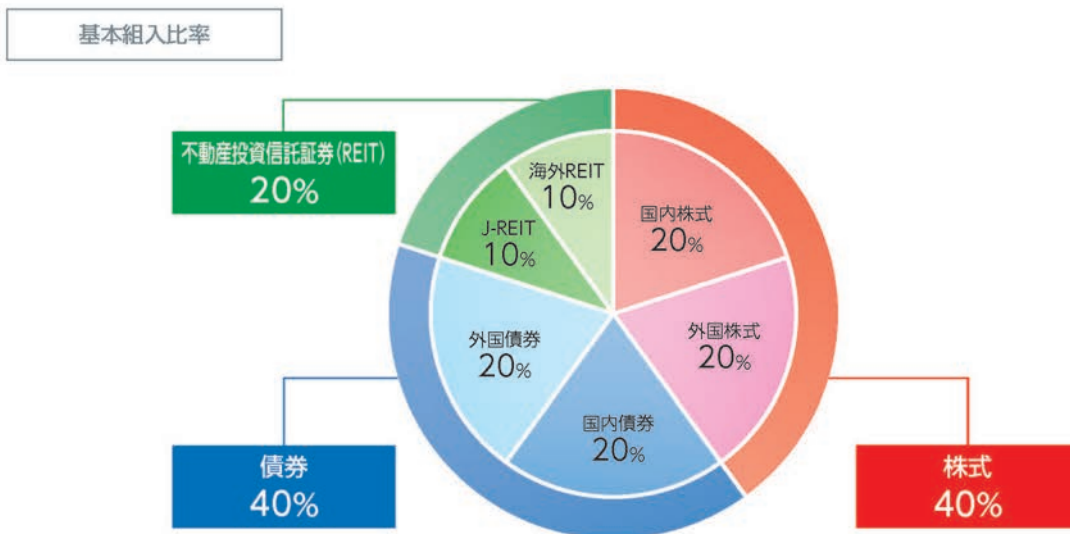
「FTSE 世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

「東証REIT指数」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株

株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

「S&P 先進国 REIT 指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場する REIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P 先進国 REIT 指数（以下「当インデックス」）は、S&P Global の一部門である SPDJI の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's^(R) 及び S&P^(R) は、S&P Global の一部門である Standard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones^(R) は Dow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが SPDJI に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P 又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。

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



- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。

4. ノーロードファンドです。

- 購入時手数料が無料のノーロードファンドです。
(運用管理費用(信託報酬)は純資産総額に対して年率0.748%(税抜0.68%)です。)

分配方針

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

主な投資制限

- 株式への直接投資は行いません。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。

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

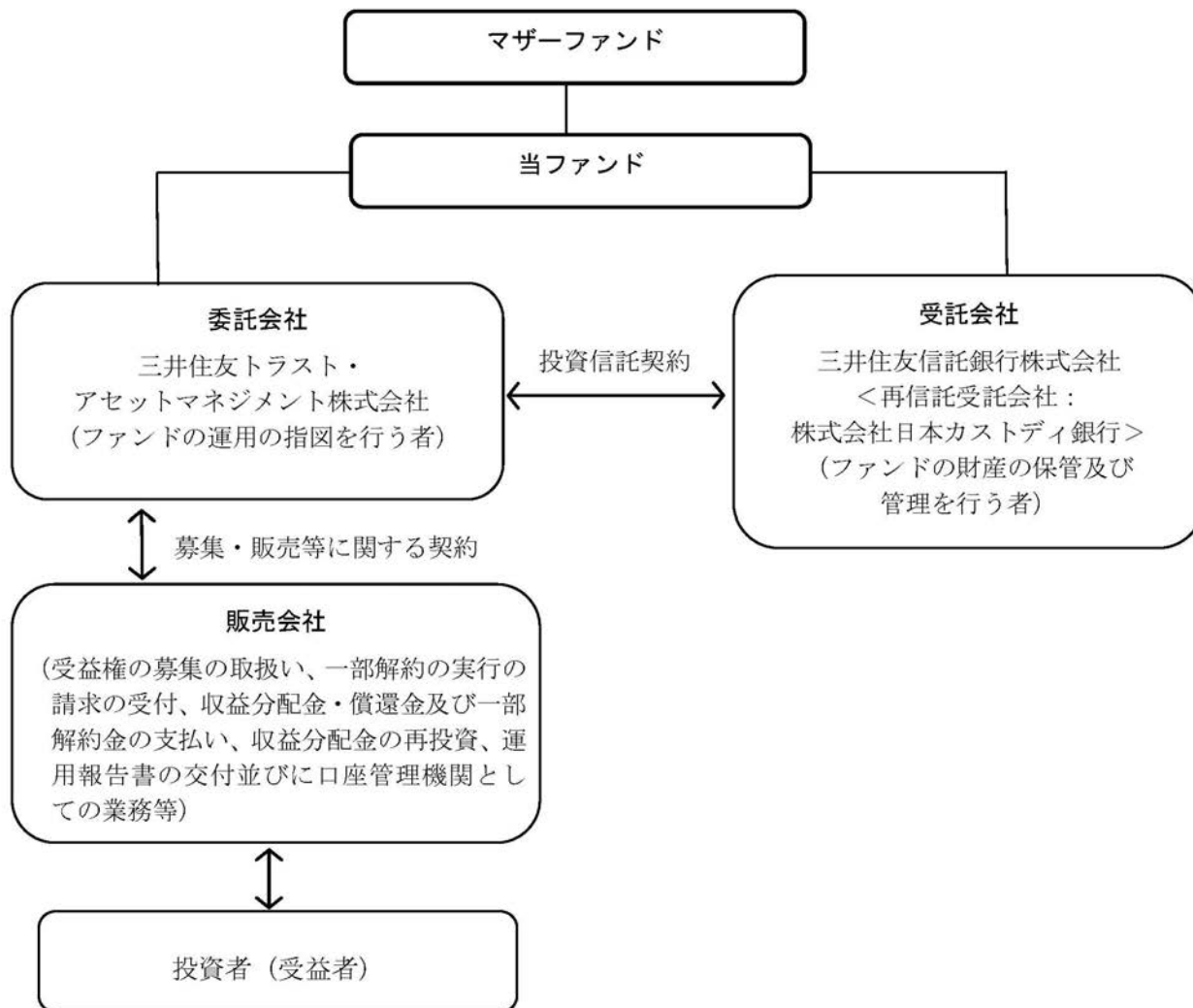
(2) 【ファンドの沿革】

2008年1月9日
2012年4月1日

本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
本ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「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 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、「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 J-REIT インデックス マザーファンド」の名称を「J-REIT インデックス マザーファンド」に、「住信 グローバル REIT インデックス マザーファンド」の名称を「グローバル REIT 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】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況 (2024年11月29日現在)

イ. 資本金の額：20億円

ロ. 委託会社の沿革

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

ハ. 大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラストグループ株式会社	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、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REIT インデックス マザーファンド」および「グローバル REIT インデックス マザーファンド」（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

(ロ) 運用方法

①投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、主要投資対象の見直しおよび追加が行われる場合があります。

②投資態度

1) 主として、各マザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

2) 各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。

マザーファンド受益証券	基本組入比率
国内債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
国内株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
外国債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
外国株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
J-REIT インデックス マザーファンド受益証券	10%
グローバル REIT インデックス マザーファンド受益証券	10%

3) 前記 2) に定める各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

4) 各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年 1 回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。

5) 実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。

6) 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として投資信託財産総額の 70%以下とします。

7) ただし、資金動向および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。

(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（本邦通貨表示のものに限ります。）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. 金銭債権

ハ. 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 6 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 7 号から第 11 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くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド

2. 国内株式インデックス マザーファンド

3. 外国債券インデックス マザーファンド

4. 外国株式インデックス マザーファンド

5. J-REIT インデックス マザーファンド

6. グローバル REIT インデックス マザーファンド

7. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 7 号の証券の性質を有するもの

9. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

10. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

11. 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。）

なお、第 9 号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

(ハ) 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

(ニ) 前記（ロ）の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託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（ハ）に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ①NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

- ①同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ③外貨建資産への投資は、行いません。
- ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「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

- ①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。

- ②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。
- ③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。
- ④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。
- ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③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。
- ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑤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。
- ⑥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。
- ⑦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。
- ⑧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。
- ⑨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

- ①FTSE 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。
- ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

- ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ④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。
- ⑤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。
- ⑥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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことができます。

3. 運用制限

- ①同一銘柄の転換社債ならびに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。
- ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引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

- ①原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②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。
- ③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。
- ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

- ⑤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。
- ⑥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。
- ⑦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。
- ⑧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

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③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。
- ④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。
- ⑤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。
- ⑥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。
- ⑦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。
- ⑧一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。
- ⑨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。

「J-REIT インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証 REIT 指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。
- ③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに東証 REIT 指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対

象とする先物取引および外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下当マザーファンドにおいて「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④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。

3. 運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。ただし、東証 REIT 指数（配当込み）における時価の構成割合が 10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証 REIT 指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証券、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）および不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

④外貨建資産への投資は行いません。

⑤投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、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、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引および外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

⑥一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。

⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「グローバル REIT インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

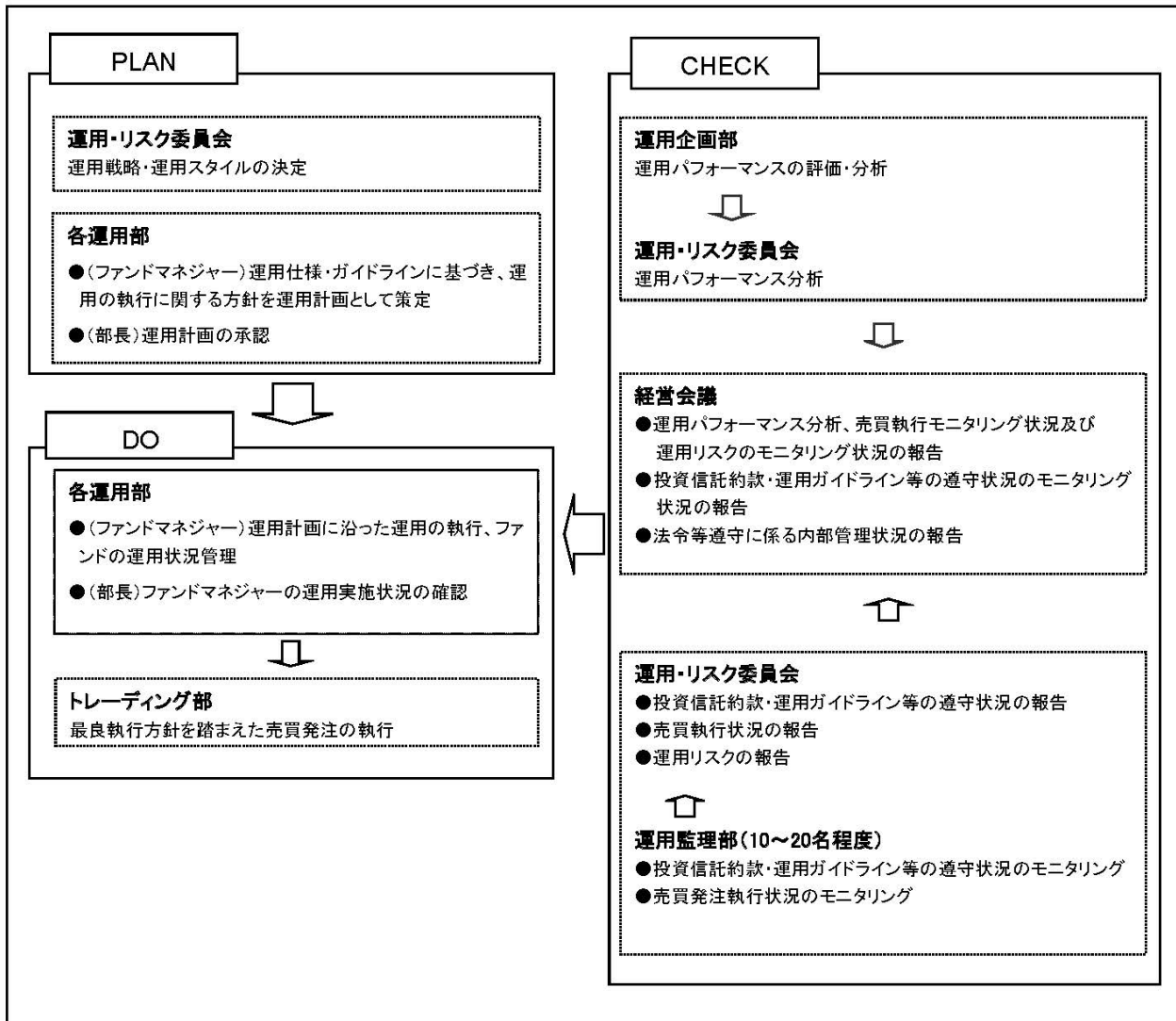
- ③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ④投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）のうち不動産投信指数を対象とする先物取引ならびに外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下当マザーファンドにおいて「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ⑤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。

3. 運用制限

- ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。ただし、S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円ベース）における時価の構成割合が 10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。
- ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。
- ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑥デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(3) 【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5)【投資制限】

<約款に定める投資制限>

- ①株式への直接投資は行いません。(投資信託約款の「運用の基本方針」)
- ②外貨建資産への直接投資は行いません。(投資信託約款の「運用の基本方針」)
- ③デリバティブへの直接投資は行いません。(投資信託約款の「運用の基本方針」)
- ④外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 65%以下とします。(投資信託約款の「運用の基本方針」)
- ⑤委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。(投資信託約款第 19 条)
- ⑥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償還金の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 26 条)
- ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(投資信託約款の「運用の基本方針」)

※前記④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マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建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割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<その他の投資制限>

イ. 当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、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。

① 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。

② リートの価格変動リスク

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

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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。

⑧ 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>

- ①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。
- ②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。
- ③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。
- ④ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。
これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ⑤確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

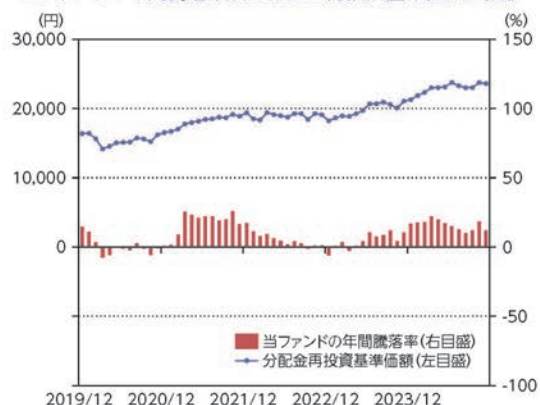
(ロ) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

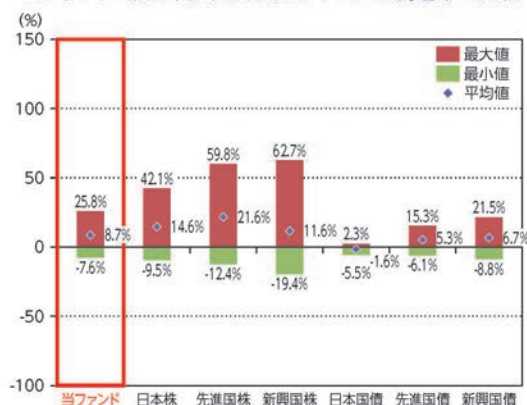
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2019年12月～2024年11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、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権限又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る権限又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Market インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Market インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募定期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・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売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。
新興国債 JPELガン・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に 0.15% の率を乗じて得た額を信託財産留保額（※）として当該基準価額から控除します。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、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 0.748%（税抜 0.68%）

（※）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。

支払先		100 億円以下の部分	100 億円超 300 億円以下の部分	300 億円超の部分	主な役務
配分	委託会社	年率 0.418% (税抜 0.38%)	年率 0.352% (税抜 0.32%)	年率 0.286% (税抜 0.26%)	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 0.286% (税抜 0.26%)	年率 0.352% (税抜 0.32%)	年率 0.418% (税抜 0.38%)	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 0.044% (税抜 0.04%)	年率 0.044% (税抜 0.04%)	年率 0.044% (税抜 0.04%)	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 2 月 10 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。）

- ②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
- ③信託報酬に係る消費税等に相当する額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(4) 【その他の手数料等】

- ①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。
- ②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
- ③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、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。）。
- ④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
- ⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

(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。

①個人の受益者に対する課税

イ. 収益分配金に対する課税

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

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

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

(2037 年 12 月 31 日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

ロ. 一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

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

ニ. 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

(2037 年 12 月 31 日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

③個別元本について

イ. 追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

ロ. 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ. ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ. 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照

ください。)

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

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

⑤確定拠出年金の場合

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。

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

※上記は、2024年11月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.77%	0.75%	0.02%

※対象期間は2023年11月11日～2024年11月11日です。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5 【運用状況】

以下は、2024年11月29日現在の状況について記載してあります。

【SBI資産設計オープン（資産成長型）】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	42,554,967,065	98.56
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	623,759,237	1.44
合計（純資産総額）		43,178,726,302	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,334,157,775	7.1795	9,578,585,746	7.0815	9,447,838,283	21.88
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	3,247,495,257	2.8759	9,339,697,368	2.8147	9,140,724,899	21.17
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	2,367,579,603	3.6493	8,640,232,605	3.6014	8,526,601,182	19.75
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	5,131,675,030	1.3078	6,711,689,915	1.3042	6,692,730,574	15.50
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	1,512,835,113	3.3233	5,027,610,288	3.3411	5,054,533,396	11.71
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,837,541,046	2.0207	3,713,128,611	2.0095	3,692,538,731	8.55

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.56
合計	98.56

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

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

		純資産総額 (円)		1 万口当たりの純資産額 (円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 8 期計算期間末	(2015 年 11 月 10 日)	20,717,882,420	20,717,882,420	13,952	13,952
第 9 期計算期間末	(2016 年 11 月 10 日)	23,607,510,913	23,607,510,913	12,934	12,934
第 10 期計算期間末	(2017 年 11 月 10 日)	27,121,536,141	27,121,536,141	14,990	14,990
第 11 期計算期間末	(2018 年 11 月 12 日)	28,791,451,233	28,791,451,233	15,040	15,040
第 12 期計算期間末	(2019 年 11 月 11 日)	31,489,407,387	31,489,407,387	16,058	16,058
第 13 期計算期間末	(2020 年 11 月 10 日)	30,935,776,510	30,935,776,510	15,922	15,922
第 14 期計算期間末	(2021 年 11 月 10 日)	36,212,394,728	36,212,394,728	19,104	19,104
第 15 期計算期間末	(2022 年 11 月 10 日)	37,026,185,282	37,026,185,282	18,922	18,922
第 16 期計算期間末	(2023 年 11 月 10 日)	40,692,815,617	40,692,815,617	20,655	20,655
第 17 期計算期間末	(2024 年 11 月 11 日)	43,753,374,644	43,753,374,644	23,768	23,768
	2023 年 11 月末日	41,140,106,562	—	20,984	—
	12 月末日	40,860,577,294	—	21,192	—
	2024 年 1 月末日	41,418,033,293	—	21,809	—
	2 月末日	41,968,229,976	—	22,256	—
	3 月末日	42,876,936,849	—	22,913	—
	4 月末日	42,814,938,372	—	22,945	—
	5 月末日	42,873,501,016	—	23,037	—
	6 月末日	43,997,919,061	—	23,678	—
	7 月末日	43,009,360,880	—	23,208	—
	8 月末日	42,389,385,069	—	22,929	—
	9 月末日	42,432,102,358	—	22,946	—
	10 月末日	43,643,386,507	—	23,662	—
	11 月末日	43,178,726,302	—	23,511	—

② 【分配の推移】

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

第16期計算期間	2022年11月11日～2023年11月10日	0
第17期計算期間	2023年11月11日～2024年11月11日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第8期計算期間	2014年11月11日～2015年11月10日	6.8
第9期計算期間	2015年11月11日～2016年11月10日	△7.3
第10期計算期間	2016年11月11日～2017年11月10日	15.9
第11期計算期間	2017年11月11日～2018年11月12日	0.3
第12期計算期間	2018年11月13日～2019年11月11日	6.8
第13期計算期間	2019年11月12日～2020年11月10日	△0.8
第14期計算期間	2020年11月11日～2021年11月10日	20.0
第15期計算期間	2021年11月11日～2022年11月10日	△1.0
第16期計算期間	2022年11月11日～2023年11月10日	9.2
第17期計算期間	2023年11月11日～2024年11月11日	15.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第8期計算期間	2014年11月11日～2015年11月10日	7,846,529,569	2,590,666,593	14,848,925,687
第9期計算期間	2015年11月11日～2016年11月10日	5,479,073,321	2,075,827,603	18,252,171,405
第10期計算期間	2016年11月11日～2017年11月10日	4,118,820,314	4,278,001,562	18,092,990,157
第11期計算期間	2017年11月11日～2018年11月12日	3,341,067,362	2,290,283,079	19,143,774,440
第12期計算期間	2018年11月13日～2019年11月11日	3,005,808,834	2,540,093,265	19,609,490,009
第13期計算期間	2019年11月12日～2020年11月10日	2,721,021,122	2,900,335,059	19,430,176,072
第14期計算期間	2020年11月11日～2021年11月10日	2,155,351,244	2,630,620,467	18,954,906,849
第15期計算期間	2021年11月11日～2022年11月10日	2,025,496,885	1,412,117,223	19,568,286,511
第16期計算期間	2022年11月11日～2023年11月10日	1,616,111,020	1,483,546,213	19,700,851,318
第17期計算期間	2023年11月11日～2024年11月11日	1,283,497,854	2,576,214,104	18,408,135,068

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

(参考)

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	601,783,154,490	84.95
地方債証券	日本	36,015,529,227	5.08
特殊債券	日本	36,878,562,886	5.21
	国際機関	297,516,000	0.04
	小計	37,176,078,886	5.25
社債券	日本	30,623,700,000	4.32
	フランス	1,389,726,000	0.20
	オーストラリア	99,418,000	0.01
	韓国	99,251,000	0.01
	小計	32,212,095,000	4.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,185,134,928	0.17
合計(純資産総額)		708,371,992,531	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350回利付国債(10年)	6,570,000,000	98.46	6,469,413,300	98.30	6,458,572,800	0.100	2028/3/20	0.91
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	6,660,000,000	95.31	6,348,310,100	95.87	6,385,541,400	0.400	2033/6/20	0.90
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	98.83	6,266,139,000	0.005	2026/12/20	0.88
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	6,170,000,000	96.65	5,963,836,000	97.25	6,000,510,100	0.500	2032/12/20	0.85
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	6,100,000,000	96.24	5,870,931,600	96.98	5,916,207,000	0.500	2033/3/20	0.84
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	99.31	5,859,467,000	99.14	5,849,496,000	0.100	2026/9/20	0.83
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	6,060,000,000	95.66	5,797,405,400	95.91	5,812,327,800	0.100	2031/6/20	0.82
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	5,830,000,000	99.42	5,796,186,000	99.33	5,790,939,000	0.005	2026/3/20	0.82
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,027,000,000	94.86	5,717,546,900	95.39	5,749,275,840	0.100	2031/12/20	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	98.90	5,686,807,500	0.100	2027/3/20	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	96.64	5,667,936,000	0.100	2030/6/20	0.80

日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	5,890,000,000	95.03	5,597,294,500	95.49	5,624,419,900	0.200	2032/6/20	0.79
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	5,660,000,000	98.27	5,562,256,700	98.94	5,600,117,200	0.800	2033/9/20	0.79
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	5,810,000,000	95.90	5,572,117,400	96.15	5,586,315,000	0.100	2031/3/20	0.79
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	5,730,000,000	96.26	5,516,019,400	96.96	5,555,922,600	0.600	2033/12/20	0.78
日本	国債証券	第375回利付国債(10年)	5,500,000,000	101.82	5,600,435,000	100.78	5,543,065,000	1.100	2034/6/20	0.78
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	5,740,000,000	94.75	5,438,650,000	95.21	5,465,054,000	0.200	2032/9/20	0.77
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	5,580,000,000	96.07	5,360,970,000	96.32	5,374,767,600	0.100	2030/12/20	0.76
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,450,000,000	98.75	5,382,211,400	98.51	5,369,285,500	0.005	2027/6/20	0.76
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,400,000,000	98.90	5,340,984,000	98.60	5,324,886,000	0.100	2027/9/20	0.75
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,510,000,000	95.22	5,246,987,400	95.79	5,278,414,700	0.200	2032/3/20	0.75
日本	国債証券	第374回利付国債(10年)	5,320,000,000	97.65	5,195,287,100	98.38	5,233,922,400	0.800	2034/3/20	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	98.12	5,225,209,500	0.100	2028/6/20	0.74
日本	国債証券	第151回利付国債(5年)	5,250,000,000	98.77	5,185,502,500	98.68	5,181,015,000	0.005	2027/3/20	0.73
日本	国債証券	第158回利付国債(5年)	5,260,000,000	98.39	5,175,586,600	98.30	5,170,790,400	0.100	2028/3/20	0.73
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	5,290,000,000	96.34	5,096,386,000	96.46	5,103,104,300	0.100	2030/9/20	0.72
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	98.65	5,090,494,800	98.45	5,080,432,800	0.100	2027/12/20	0.72
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,070,000,000	95.08	4,820,901,000	95.67	4,850,469,000	0.100	2031/9/20	0.68
日本	国債証券	第376回利付国債(10年)	4,900,000,000	99.01	4,851,712,400	98.66	4,834,683,000	0.900	2034/9/20	0.68
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	99.02	4,832,517,600	0.100	2026/12/20	0.68

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、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	5.08
特殊債券	5.25
社債券	4.55
合計	99.83

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	686,413,204,800	98.23
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	12,344,620,422	1.77
合計（純資産総額）		698,757,825,222	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	12,376,980,000	1.77

（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	9,499,700	3,329.46	31,628,911,362	2,551.50	24,238,484,550	3.47
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,542,700	1,629.93	18,813,889,376	1,792.00	20,684,518,400	2.96
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,258,000	2,515.43	15,741,573,940	3,007.00	18,817,806,000	2.69
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,647,700	3,241.69	15,066,420,897	3,751.00	17,433,522,700	2.49
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,433,300	7,936.96	11,376,047,575	10,385.00	14,884,820,500	2.13
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,671,700	3,336.47	12,250,524,202	3,686.00	13,533,886,200	1.94
日本	株式	キーエンス	電気機器	178,800	69,546.08	12,434,840,790	64,720.00	11,571,936,000	1.66
日本	株式	任天堂	その他製品	1,128,200	8,253.06	9,311,108,271	8,810.00	9,939,442,000	1.42
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,718,400	5,354.36	9,200,939,005	5,564.00	9,561,177,600	1.37
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,270,900	7,269.11	9,238,323,842	7,384.00	9,384,325,600	1.34
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,375,600	3,130.04	7,435,731,183	3,784.00	8,989,270,400	1.29
日本	株式	信越化学工業	化学	1,605,200	5,887.69	9,450,921,447	5,554.00	8,915,280,800	1.28
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,494,400	3,325.05	11,619,054,720	2,525.50	8,825,107,200	1.26
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	378,200	34,652.96	13,105,749,555	23,310.00	8,815,842,000	1.26

日本	株式	三井物産	卸売業	2,778,000	3,966.45	11,018,812,173	3,136.00	8,711,808,000	1.25
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	53,311,900	151.88	8,097,264,497	153.40	8,178,045,460	1.17
日本	株式	第一三共	医薬品	1,691,500	5,409.48	9,150,141,560	4,749.00	8,032,933,500	1.15
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	884,100	8,916.67	7,883,234,772	8,936.00	7,900,317,600	1.13
日本	株式	三菱重工業	機械	3,156,300	1,351.17	4,264,716,666	2,197.50	6,935,969,250	0.99
日本	株式	HOYA	精密機器	349,200	18,660.43	6,516,225,334	19,260.00	6,725,592,000	0.96
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,318,300	4,301.96	5,671,283,478	4,950.00	6,525,585,000	0.93
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,594,700	4,110.08	6,554,348,048	4,083.00	6,511,160,100	0.93
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	28,679,600	187.60	5,380,416,880	193.10	5,538,030,760	0.79
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,234,100	1,715.62	7,264,131,118	1,291.50	5,468,340,150	0.78
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,088,600	2,038.52	4,257,664,052	2,604.00	5,438,714,400	0.78
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	106,300	40,629.70	4,318,937,314	51,110.00	5,432,993,000	0.78
日本	株式	富士通	電気機器	1,660,900	2,277.55	3,782,788,050	2,866.00	4,760,139,400	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,835,800	2,667.05	4,896,178,765	2,547.00	4,675,782,600	0.67
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	563,200	5,963.22	3,358,489,790	8,240.00	4,640,768,000	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,069,200	4,382.03	4,685,273,067	4,219.00	4,510,954,800	0.65

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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	0.25
		建設業	2.14
		食料品	3.12
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.13
		化学	5.24
		医薬品	4.50
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.57
		ガラス・土石製品	0.66
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.81
		金属製品	0.49
		機械	5.45
		電気機器	17.01
		輸送用機器	6.82
精密機器	2.39		

	その他製品	2.57
	電気・ガス業	1.27
	陸運業	2.34
	海運業	0.64
	空運業	0.35
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.53
	卸売業	6.62
	小売業	4.57
	銀行業	8.62
	証券、商品先物取引業	0.87
	保険業	3.24
	その他金融業	1.21
	不動産業	1.78
	サービス業	5.06
	小計	98.23
合計		98.23

(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	462	円	12,178,131,100	12,376,980,000	1.77

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	168,578,096,037	45.27
	中国	40,364,642,252	10.84
	フランス	26,762,103,522	7.19
	イタリア	25,074,722,796	6.73
	ドイツ	20,956,262,590	5.63
	イギリス	18,618,569,860	5.00

	スペイン	16,214,552,043	4.35
	カナダ	6,983,090,654	1.88
	ベルギー	5,661,678,451	1.52
	オランダ	4,788,303,324	1.29
	オーストラリア	4,607,196,347	1.24
	オーストリア	3,993,205,905	1.07
	メキシコ	2,599,630,985	0.70
	ポルトガル	2,121,502,306	0.57
	ポーランド	1,835,858,734	0.49
	マレーシア	1,809,257,317	0.49
	フィンランド	1,794,753,888	0.48
	アイルランド	1,718,822,278	0.46
	シンガポール	1,479,328,109	0.40
	イスラエル	1,151,045,713	0.31
	ニュージーランド	1,002,089,206	0.27
	デンマーク	952,072,216	0.26
	スウェーデン	595,909,649	0.16
	ノルウェー	558,919,873	0.15
	小計	360,221,614,055	96.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	12,160,478,732	3.27
合計(純資産総額)		372,382,092,787	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	3,218,485,100	0.86
	買建	ドイツ	2,970,624,240	0.80

(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	—	7,762,018,908	2.08

(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 1.5% 08/15/26	15,500,000	14,007.63	2,171,182,994	14,392.13	2,230,781,228	1.500	2026/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	16,100,000	13,402.11	2,157,740,936	13,637.25	2,195,598,760	0.375	2027/7/31	0.59
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/31/28	14,150,000	14,924.14	2,111,766,260	15,177.33	2,147,593,519	4.375	2028/8/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/29	15,200,000	14,186.04	2,156,279,172	14,107.43	2,144,330,680	2.625	2029/7/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 4.375% 12/15/26	13,000,000	15,316.32	1,991,122,106	15,114.62	1,964,901,783	4.375	2026/12/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	13,779.46	1,878,140,576	14,164.26	1,930,588,717	3.375	2033/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	13,220,000	14,085.15	1,862,057,894	14,411.27	1,905,170,422	2.875	2028/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/26	12,300,000	14,281.22	1,756,591,143	14,357.39	1,765,959,733	1.625	2026/10/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 1% 07/31/28	13,000,000	13,087.89	1,701,426,463	13,462.08	1,750,070,798	1.000	2028/7/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 4% 02/15/34	11,600,000	14,870.84	1,725,017,829	14,788.71	1,715,490,683	4.000	2034/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,094.77	1,647,679,640	14,437.47	1,687,741,041	2.375	2027/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	11,070,000	14,373.65	1,591,163,362	14,679.19	1,624,986,409	3.875	2033/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	12,030,000	13,051.08	1,570,045,037	13,492.99	1,623,207,481	1.125	2028/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	13,939.32	1,561,204,754	14,324.12	1,604,302,273	3.500	2033/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,068.62	1,518,232,553	12,533.20	1,576,677,389	1.375	2031/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	14,143.06	1,523,207,859	14,508.72	1,562,589,682	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/15/54	10,550,000	14,294.34	1,508,053,179	14,590.86	1,539,336,420	4.250	2054/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/31/26	10,800,000	13,757.96	1,485,860,662	14,194.87	1,533,047,002	0.625	2026/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,467.55	1,461,197,123	12,910.93	1,513,162,160	1.875	2032/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,945.92	1,494,592,994	15,125.52	1,512,552,248	4.500	2026/7/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	10,410,000	14,171.91	1,475,296,384	14,513.43	1,510,848,648	3.125	2028/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,887.85	1,420,598,191	12,384.23	1,479,915,858	0.625	2030/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 4.875% 11/30/25	9,700,000	15,241.12	1,478,389,095	15,142.88	1,468,860,211	4.875	2025/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	9,520,000	14,994.21	1,427,449,150	15,175.27	1,444,686,507	4.625	2026/10/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	9,270,000	15,018.65	1,392,228,862	15,364.29	1,424,269,888	4.500	2033/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	10,980,000	12,554.74	1,378,511,070	12,912.70	1,417,815,152	1.625	2031/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/29	10,200,000	13,583.73	1,385,541,162	13,696.43	1,397,036,531	1.750	2029/1/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,394.36	1,352,831,146	13,799.48	1,393,747,635	2.875	2032/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	12,002.96	1,338,330,808	12,499.34	1,393,677,418	0.875	2030/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 4.5% 04/15/27	9,150,000	15,162.18	1,387,340,316	15,172.62	1,388,295,528	4.500	2027/4/15	0.37

(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	96.73
合計	96.73

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	82	アメリカドル	8,805,011.26	1,327,267,397	8,811,797.08	1,328,290,292	0.36
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	52	アメリカドル	5,763,552.07	868,797,839	5,767,125	869,336,422	0.23
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	57	アメリカドル	6,764,409.6	1,019,667,103	6,772,312.5	1,020,858,386	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	33	ユーロ	3,527,819.3	561,628,832	3,530,010	561,977,592	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	40	ユーロ	4,769,524	759,308,221	4,783,200	761,485,440	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	77	ユーロ	10,289,551.7	1,638,096,631	10,346,490	1,647,161,208	0.44

(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	25,100,000.00	3,823,016,875	3,776,433,050	1.01
	カナダドル	買建	2,590,000.00	281,780,089	278,168,590	0.07
	ユーロ	買建	15,080,000.00	2,424,258,212	2,397,534,516	0.64
	イギリスポンド	買建	2,160,000.00	416,788,465	412,808,832	0.11
	オフショア人民元	買建	43,200,000.00	908,543,403	897,073,920	0.24

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

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	601,752,396,499	72.05
	イギリス	28,823,398,575	3.45
	カナダ	27,340,069,951	3.27
	スイス	21,517,512,353	2.58
	フランス	19,512,945,074	2.34
	ドイツ	17,841,667,430	2.14
	アイルランド	15,636,852,982	1.87
	オーストラリア	14,104,009,557	1.69

	オランダ	12,629,011,105	1.51
	デンマーク	6,431,768,420	0.77
	スウェーデン	6,246,200,297	0.75
	スペイン	5,272,096,470	0.63
	イタリア	4,254,853,899	0.51
	香港	2,884,678,914	0.35
	シンガポール	2,465,838,896	0.30
	フィンランド	1,949,342,728	0.23
	イスラエル	1,775,647,218	0.21
	ベルギー	1,495,938,217	0.18
	ルクセンブルク	1,251,403,519	0.15
	ケイマン	1,209,018,095	0.14
	ノルウェー	1,179,846,623	0.14
	ジャージー	1,166,687,303	0.14
	バミューダ	930,515,981	0.11
	キュラソー	726,721,236	0.09
	リベリア	695,692,779	0.08
	ニュージーランド	623,987,592	0.07
	オーストリア	360,928,924	0.04
	パナマ	329,157,389	0.04
	ポルトガル	291,887,271	0.03
	マン島	76,257,277	0.01
	小計	800,776,332,574	95.88
新株予約権証券	カナダ	—	—
投資信託受益証券	オーストラリア	59,283,356	0.01
	香港	57,964,725	0.01
	小計	117,248,081	0.01
投資証券	アメリカ	13,645,900,296	1.63
	オーストラリア	954,293,909	0.11
	フランス	296,340,618	0.04
	イギリス	214,123,325	0.03
	シンガポール	204,844,412	0.02
	香港	154,898,016	0.02
	ベルギー	42,433,958	0.01
	カナダ	23,972,472	0.00
	小計	15,536,807,006	1.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	18,768,951,820	2.25
合計(純資産総額)		835,199,339,481	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	14,053,867,050	1.68
	買建	カナダ	462,189,672	0.06
	買建	ドイツ	2,475,304,577	0.30
	買建	イギリス	1,096,663,230	0.13
	買建	オーストラリア	540,141,576	0.06

(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	—	5,070,023,226	0.61

(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	1,217,224	29,063.31	35,376,560,788	35,413.34	43,105,977,349	5.16
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,963,841	17,213.00	33,803,596,311	20,401.15	40,064,617,959	4.80
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	565,406	64,803.12	36,640,076,259	63,761.51	36,051,141,793	4.32
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	756,235	27,457.02	20,763,959,969	31,013.24	23,453,303,299	2.81
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	174,791	72,641.60	12,697,098,955	85,801.20	14,997,278,948	1.80
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	469,065	26,521.19	12,440,164,614	25,509.73	11,965,721,596	1.43
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	230,394	26,867.03	6,190,002,676	50,179.83	11,561,133,734	1.38
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	402,416	26,780.46	10,776,888,972	25,749.40	10,361,973,287	1.24
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	227,781	30,202.26	6,879,502,443	37,653.34	8,576,716,486	1.03

アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	354,961	21,446.10	7,612,530,098	24,068.65	8,543,434,131	1.02
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	106,308	61,368.67	6,523,981,436	72,819.47	7,741,293,195	0.93
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	64,845	122,486.93	7,942,665,226	118,811.76	7,704,348,616	0.92
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,878	76,316.65	5,638,121,485	91,707.20	6,775,144,610	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	133,734	41,236.98	5,514,786,488	47,437.87	6,344,057,176	0.76
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	355,687	17,335.10	6,165,869,714	17,736.06	6,308,488,961	0.76
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	66,022	67,353.64	4,446,822,469	80,250.96	5,298,328,960	0.63
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	35,586	123,042.80	4,378,601,320	144,944.04	5,157,978,857	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	79,596	49,794.92	3,963,476,469	64,394.62	5,125,554,221	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	187,519	24,636.94	4,619,895,402	27,036.72	5,069,899,898	0.61
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	355,106	9,878.64	3,507,967,288	13,849.99	4,918,214,975	0.59
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	193,182	21,866.98	4,224,308,246	23,424.99	4,525,287,577	0.54
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	34,199	98,139.27	3,356,265,134	132,250.23	4,522,825,670	0.54
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	258,516	19,515.90	5,045,172,473	15,953.78	4,124,308,424	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	558,868	5,936.14	3,317,519,360	7,200.84	4,024,324,526	0.48
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	141,776	23,639.52	3,351,517,937	27,597.47	3,912,660,211	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	76,537	40,633.47	3,109,964,230	49,745.70	3,807,387,207	0.46
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	133,133	18,957.12	2,523,818,748	27,540.19	3,666,509,180	0.44
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	137,468	23,916.40	3,287,740,830	24,436.46	3,359,231,476	0.40
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,142	141,742.00	4,555,871,484	102,349.68	3,289,723,415	0.39

アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	329,211	9,369.53	3,084,552,883	9,712.17	3,197,355,897	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	4.03
		素材	3.30
		資本財	6.98
		商業・専門サービス	1.60
		運輸	1.52
		自動車・自動車部品	1.90
		耐久消費財・アパレル	1.11
		消費者サービス	1.99
		メディア・娯楽	6.44
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.95
		生活必需品流通・小売り	1.81
		食品・飲料・タバコ	2.80
		家庭用品・パーソナル用品	1.47
		ヘルスケア機器・サービス	3.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.77
		銀行	5.67
		金融サービス	7.28
		保険	3.06
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.04
		ソフトウェア・サービス	9.98
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.67
電気通信サービス	1.16		
公益事業	2.62		
半導体・半導体製造装置	8.55		
不動産管理・開発	0.29		
	小計	95.88	
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.01
投資証券	—	—	1.86
合計			97.75

(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	310	アメリカドル	90,897,218.5	13,701,846,717	93,232,500	14,053,867,050	1.68
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	14	カナダドル	4,173,639	448,874,874	4,297,440	462,189,672	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	41	スイスフラン	4,903,057	838,324,686	4,799,050	820,541,569	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	218	ユーロ	10,631,000.1	1,692,455,216	10,394,240	1,654,763,008	0.20
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	26	オーストラリアドル	5,399,057	529,323,548	5,509,400	540,141,576	0.06
	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	69	イギリスポンド	5,740,853.75	1,099,316,085	5,727,000	1,096,663,230	0.13

(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	28,100,000.00	4,262,322,800	4,234,071,171	0.51
	カナダドル	買建	1,300,000.00	140,715,900	139,773,530	0.02
	ユーロ	買建	2,600,000.00	416,273,000	413,801,700	0.05
	イギリスポンド	買建	850,000.00	163,425,250	162,698,245	0.02
	スイスフラン	買建	700,000.00	120,274,700	119,678,580	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を用いております。

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

J-REITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	91,791,462,700	96.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,612,786,162	3.79
合計(純資産総額)		95,404,248,862	100.00

(注 1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,572,712,500	3.74

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	55,560	129,884.95	7,216,408,055	125,500	6,972,780,000	7.31
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,784	563,962.41	5,517,808,306	554,000	5,420,336,000	5.68
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	49,392	92,292.44	4,558,508,488	91,300	4,509,489,600	4.73
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	30,491	141,110.09	4,302,587,881	141,700	4,320,574,700	4.53
日本	投資証券	GLP投資法人	31,995	129,196.38	4,133,638,459	127,300	4,072,963,500	4.27
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	26,649	146,713.61	3,909,771,051	147,300	3,925,397,700	4.11
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,594	245,711.85	4,077,342,502	236,100	3,917,843,400	4.11
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	52,481	63,305.2	3,322,320,249	63,600	3,337,791,600	3.50
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,285	232,115.3	3,315,767,190	233,000	3,328,405,000	3.49
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	18,979	160,348.3	3,043,250,522	166,700	3,163,799,300	3.32
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	21,308	138,900.48	2,959,691,493	136,500	2,908,542,000	3.05
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	9,361	303,463.53	2,840,722,152	295,000	2,761,495,000	2.89
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,994	68,496.41	2,396,963,701	68,200	2,386,590,800	2.50
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,514	336,962.37	2,194,972,897	330,500	2,152,877,000	2.26
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	20,763	99,411.54	2,064,081,937	101,200	2,101,215,600	2.20
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	28,623	73,498.95	2,103,760,595	73,100	2,092,341,300	2.19
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	17,440	114,505.43	1,996,974,813	114,600	1,998,624,000	2.09
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,289	590,969.93	1,943,700,117	581,000	1,910,909,000	2.00
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,195	144,202.25	1,758,546,450	143,900	1,754,860,500	1.84
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,400	274,241.14	1,755,143,334	263,800	1,688,320,000	1.77
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	4,630	324,509.48	1,502,478,906	321,000	1,486,230,000	1.56
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,684	126,602.07	1,479,218,623	126,100	1,473,352,400	1.54
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,201	127,481.86	1,427,924,378	124,900	1,399,004,900	1.47
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,534	404,951.19	1,431,097,512	395,000	1,395,930,000	1.46
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,823	290,229.06	1,399,774,803	288,300	1,390,470,900	1.46
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	14,068	91,502.73	1,287,260,429	90,900	1,278,781,200	1.34
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	3,947	305,980.04	1,207,703,221	300,000	1,184,100,000	1.24
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,289	354,458.77	1,165,814,921	348,000	1,144,572,000	1.20

日本	投資証券	森トラストリート投資法人	18,360	61,399.55	1,127,295,773	60,900	1,118,124,000	1.17
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,417	131,807.23	1,109,421,462	132,800	1,117,777,600	1.17

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	96.21
合計	96.21

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,149	円	3,593,173,500	3,572,712,500	3.74

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	112,964,873,976	80.03
	オーストラリア	10,007,545,647	7.09
	イギリス	5,724,112,608	4.06
	シンガポール	3,971,849,062	2.81
	フランス	2,384,537,298	1.69
	カナダ	1,766,271,139	1.25
	ベルギー	1,176,900,884	0.83
	香港	1,094,710,918	0.78
	スペイン	600,694,827	0.43
	ガンジー	241,133,474	0.17
	韓国	227,121,864	0.16
	オランダ	183,292,270	0.13
	イスラエル	166,945,036	0.12
	ニュージーランド	115,418,427	0.08

	アイルランド	52,211,660	0.04
	ドイツ	38,228,696	0.03
	イタリア	12,749,102	0.01
	小計	140,728,596,888	99.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	422,707,210	0.30
合計(純資産総額)		141,151,304,098	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建	—	10,547,530	△0.01

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	557,253	17,457.19	9,728,076,738	17,757.17	9,895,237,369	7.01
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	57,073	138,828.52	7,923,360,419	147,589.53	8,423,377,474	5.97
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	348,101	20,830.76	7,251,208,595	20,998.08	7,309,453,342	5.18
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	185,097	27,433.17	5,077,797,949	29,436.50	5,448,609,173	3.86
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	184,786	26,986.56	4,986,739,930	27,698.47	5,118,290,401	3.63
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	94,728	51,153.61	4,845,680,020	52,964.00	5,017,174,398	3.55
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	523,689	8,667.55	4,539,100,592	8,791.15	4,603,832,113	3.26
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,053,189	3,500.30	3,686,479,104	3,748.06	3,947,425,253	2.80
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	127,454	25,271.56	3,220,961,536	26,029.78	3,317,599,988	2.35
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	176,423	18,036.04	3,181,972,461	18,727.93	3,304,038,935	2.34
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	632,711	4,732.24	2,994,146,351	4,914.12	3,109,220,310	2.20
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	85,466	35,232.56	3,011,186,222	35,847.47	3,063,740,674	2.17
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	249,054	9,820.03	2,445,719,338	9,728.75	2,422,986,493	1.72
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	205,851	11,083.40	2,281,529,133	11,679.33	2,404,202,830	1.70
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	38,581	45,924.44	1,771,811,143	47,157.50	1,819,383,569	1.29
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	342,336	5,079.93	1,739,045,655	5,217.11	1,786,005,048	1.27
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	70,252	23,988.76	1,685,258,620	24,902.24	1,749,432,726	1.24
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	405,746	3,757.94	1,524,772,451	3,886.07	1,576,760,280	1.12
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	93,595	17,190.38	1,608,934,514	16,659.78	1,559,272,558	1.10
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	423,798	3,430.84	1,453,984,147	3,352.45	1,420,764,826	1.01

アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	70,579	18,890.73	1,333,289,313	19,379.13	1,367,759,927	0.97
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	165,632	7,501.11	1,242,423,952	7,787.22	1,289,814,214	0.91
アメリカ	投資証券	UDR INC	181,213	6,704.50	1,214,942,633	6,983.78	1,265,552,486	0.90
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	64,413	18,349.15	1,181,923,815	19,148.50	1,233,412,472	0.87
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	112,607	10,769.01	1,212,666,741	10,866.84	1,223,682,995	0.87
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	815,755	1,493.29	1,218,159,613	1,494.38	1,219,054,450	0.86
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	424,510	2,714.79	1,152,455,573	2,778.13	1,179,347,447	0.84
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	132,300	8,548.14	1,130,919,203	8,669.05	1,146,916,294	0.81
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,142,176	337.26	1,059,756,148	364.70	1,145,979,238	0.81
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	98,816	11,189.24	1,105,676,709	11,442.67	1,130,719,215	0.80

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.70
合計	99.70

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	70,000.00	10,619,000	10,547,530	△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。

運用実績

当初設定日：2008年1月9日
作成基準日：2024年11月29日



※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	21.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/おび機器	-	-	1.1%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.0%
国内株式インデックスマザーファンド	21.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	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	19.7%	T 1.5% 08/15/26	アメリカ	国債	-	1.500%	2026/08/15	0.1%
		T 0.375% 07/31/27	アメリカ	国債	-	0.375%	2027/07/31	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	15.5%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.1%
		第371回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.400%	2033/06/20	0.1%
グローバルREITインデックスマザーファンド	11.7%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.7%
J-REITインデックスマザーファンド	8.6%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.6%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<申込手続>

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

<申込コース>

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

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

<申込みの受付>

お申込みの受付は、原則として、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>

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

ただし、確定拠出年金によるお申込みは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>

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

<申込受付の中止等>

収益分配金を再投資する場合を除き、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>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください（ただし、確定拠出年金による一部解約は1口単位）。

<解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

<一部解約代金の支払い>

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

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

<受付不可日>

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

①本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

・株式および不動産投資信託証券

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。(2008年1月9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11月11日から翌年11月10日(第1計算期間は2008年1月9日から2008年11月10日)までとします。なお、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

<投資信託契約の終了(償還)と手続き>

(1) 投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)

- ① 委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了(繰上償還)させることができます。
 - ・ 受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
 - ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
 - ・ やむを得ない事情が発生した場合
- ② 委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。
- ③ 委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。
- ④ 委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2) 投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)に係る書面決議の手続き

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

- ① 委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ② 受益者(委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③ 上記①の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ④ 上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、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等に係る書面決議の手続き

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

- ①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場を除外。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③上記①の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

<受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

- ①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行われる場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- ②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

<運用報告書>

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

<関係法人との契約の更改手続き>

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

<公告>

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

<混蔵寄託>

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

<投資信託財産の登記等及び記載等の留保等>

- ①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。
- ②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。
- ③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

- ① 受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。
- ② 収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③ 上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。
- ④ 上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。
- ⑤ 受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2) 償還金に対する請求権

- ① 受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。
- ② 償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③ 償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。
- ④ 受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(2023年11月11日から2024年11月11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。

独立監査人の監査報告書

2025年1月22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 中島紀子
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SBI資産設計オープン（資産成長型）の2023年11月11日から2024年11月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SBI資産設計オープン（資産成長型）の2024年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【SBI 資産設計オープン（資産成長型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 16 期 (2023 年 11 月 10 日現在)	第 17 期 (2024 年 11 月 11 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	707,455,712	667,350,393
親投資信託受益証券	40,002,485,884	43,115,708,836
未収入金	179,600,000	161,470,000
未収利息	-	3,964
流動資産合計	40,889,541,596	43,944,533,193
資産合計	40,889,541,596	43,944,533,193
負債の部		
流動負債		
未払解約金	44,007,678	27,079,719
未払受託者報酬	8,883,609	9,550,393
未払委託者報酬	142,137,697	152,806,325
未払利息	434	-
その他未払費用	1,696,561	1,722,112
流動負債合計	196,725,979	191,158,549
負債合計	196,725,979	191,158,549
純資産の部		
元本等		
元本	19,700,851,318	18,408,135,068
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	20,991,964,299	25,345,239,576
(分配準備積立金)	11,257,971,085	15,335,062,943
元本等合計	40,692,815,617	43,753,374,644
純資産合計	40,692,815,617	43,753,374,644
負債純資産合計	40,889,541,596	43,944,533,193

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 16 期		第 17 期	
	自 2022 年 11 月 11 日	至 2023 年 11 月 10 日	自 2023 年 11 月 11 日	至 2024 年 11 月 11 日
営業収益				
受取利息		3,146		580,878
有価証券売買等損益		3,712,281,631		6,196,812,952
営業収益合計		3,712,284,777		6,197,393,830
営業費用				
支払利息		332,385		43,090
受託者報酬		16,943,576		18,659,865
委託者報酬		271,097,075		298,557,832
その他費用		1,696,561		1,722,112
営業費用合計		290,069,597		318,982,899
営業利益又は営業損失 (△)		3,422,215,180		5,878,410,931
経常利益又は経常損失 (△)		3,422,215,180		5,878,410,931
当期純利益又は当期純損失 (△)		3,422,215,180		5,878,410,931
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 (△)		106,348,034		374,988,122
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		17,457,898,771		20,991,964,299
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,539,249,956		1,597,403,558
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,539,249,956		1,597,403,558
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,321,051,574		2,747,551,090
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,321,051,574		2,747,551,090
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		20,991,964,299		25,345,239,576

(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11月11日から翌年11月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第17期計算期間は2023年11月11日から2024年11月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2023年11月10日現在)	第17期 (2024年11月11日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	19,700,851,318口	18,408,135,068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) 2.0655円 (20,655円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3768円 (23,768円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自2022年11月11日 至2023年11月10日			第17期 自2023年11月11日 至2024年11月11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	823,608,326円	費用控除後の配当等収益額	A	910,169,351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	1,735,948,217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	4,593,253,458円
収益調整金額	C	11,852,517,200円	収益調整金額	C	11,770,903,527円
分配準備積立金額	D	8,698,414,542円	分配準備積立金額	D	9,831,640,134円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	23,110,488,285円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	27,105,966,470円
当ファンドの期末残存口数	F	19,700,851,318口	当ファンドの期末残存口数	F	18,408,135,068口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	11,730円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,724円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第17期 自2023年11月11日 至2024年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監視部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 17 期 (2024 年 11 月 11 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第 16 期 自 2022 年 11 月 11 日 至 2023 年 11 月 10 日	第 17 期 自 2023 年 11 月 11 日 至 2024 年 11 月 11 日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	19,568,286,511 円	19,700,851,318 円
期中追加設定元本額	1,616,111,020 円	1,283,497,854 円
期中一部解約元本額	1,483,546,213 円	2,576,214,104 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 16 期 (2023 年 11 月 10 日現在)	第 17 期 (2024 年 11 月 11 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	3,258,294,802	5,855,392,610
合計	3,258,294,802	5,855,392,610

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,836,129,439	3,710,450,370	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	1,511,969,707	5,024,880,124	
	国内株式インデックス マザーファンド	3,245,461,960	9,334,273,143	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,351,629,243	9,704,022,150	
	国内債券インデックス マザーファンド	5,127,950,685	6,707,359,495	
	外国債券インデックス マザーファンド	2,366,001,796	8,634,723,554	
合計		15,439,142,830	43,115,708,836	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	536,380,448
国債証券	569,993,601,890
地方債証券	33,928,213,246
特殊債券	36,294,173,822
社債券	31,283,707,000
未収利息	1,328,642,122
前払費用	67,447,943
流動資産合計	673,432,166,471
資産合計	673,432,166,471
負債の部	
流動負債	

未払金	1,527,977,700
未払解約金	244,651,453
流動負債合計	1,772,629,153
負債合計	1,772,629,153
純資産の部	
元本等	
元本	513,487,147,600
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	158,172,389,718
元本等合計	671,659,537,318
純資産合計	671,659,537,318
負債純資産合計	673,432,166,471

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年11月11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11月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	513,487,147,600 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 98,568,000 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 1.3080 円 (1万口当たり純資産額) (13,080 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11月11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・

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、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。</p> <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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年11月11日
期首元本額	484,301,702,116円
期中追加設定元本額	82,779,443,782円
期中一部解約元本額	53,593,998,298円
期末元本額	513,487,147,600円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	5,127,950,685円
SBI資産設計オープン(分配型)	19,683,426円
SMT 国内債券インデックス・オープン	15,573,121,391円
世界経済インデックスファンド	9,351,671,246円
DCマイセレクション25	29,670,119,667円
DCマイセレクション50	37,865,014,793円
DCマイセレクション75	12,853,461,758円

DC日本債券インデックス・オープン	399,576,030円
DC日本債券インデックス・オープンS	86,494,267,483円
DC日本債券インデックス・オープンP	60,027,060,249円
DCマイセレクションS25	18,830,337,919円
DCマイセレクションS50	23,082,683,526円
DCマイセレクションS75	6,375,139,390円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	232,790,915円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	3,200,426,131円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,338,437,298円
DC世界経済インデックスファンド	6,866,368,364円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	2,482,142円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	23,394,506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)	45,995,508円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	74,679,435円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	27,252,803円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	24,888,465円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	1,557,174,321円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	735,738,631円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	3,211,424,675円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	66,704,696円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	39,425,625円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	878,949,463円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	953,216,440円
バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)	1,318,460,445円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	91,511,789円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,151,363,178円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,518,741,587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)	357,474,011円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,270,254,973円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	91,244,986円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	50,189,793円
SMT インデックスバランス・オープン	65,579,485円
SMT 世界経済インデックス・オープン	68,858,815円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	172,917,282円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	257,888,515円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	23,597,143円
グローバル経済コア	449,120,096円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	59,200,527円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	42,825,244円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	219,498,225円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	133,340,278円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	40,539,115円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	33,347,551円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	1,407,849,175円
10資産分散投資ファンド	476,423,529円
グローバル10資産バランスファンド	715,913,094円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	1,157,920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	167,532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	931,250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	230,045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	529,368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	466,536円

DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	71,363,672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）	109,708,393,472円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	55,971,639円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	22,566,696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）	660,328,857円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,469,701,890
地方債証券	90,480,511
特殊債券	23,711,653
社債券	61,486,000
合計	1,645,380,054

（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455回利付国債（2年）	1,490,000,000	1,484,293,300	
	第456回利付国債（2年）	1,070,000,000	1,066,543,900	
	第457回利付国債（2年）	2,720,000,000	2,710,072,000	
	第458回利付国債（2年）	1,490,000,000	1,485,857,800	
	第459回利付国債（2年）	1,030,000,000	1,026,734,900	
	第460回利付国債（2年）	2,300,000,000	2,295,308,000	
	第461回利付国債（2年）	2,850,000,000	2,847,805,500	
	第462回利付国債（2年）	1,580,000,000	1,578,451,600	
	第463回利付国債（2年）	2,870,000,000	2,866,556,000	
	第464回利付国債（2年）	1,940,000,000	1,937,225,800	
	第465回利付国債（2年）	970,000,000	968,360,700	
	第466回利付国債（2年）	2,100,000,000	2,100,189,000	
	第146回利付国債（5年）	5,160,000,000	5,143,797,600	

第1 4 7回利付国債（5年）	5,830,000,000	5,797,468,600	
第1 4 8回利付国債（5年）	4,960,000,000	4,924,436,800	
第1 4 9回利付国債（5年）	4,580,000,000	4,540,383,000	
第1 5 0回利付国債（5年）	4,340,000,000	4,296,600,000	
第1 5 1回利付国債（5年）	3,250,000,000	3,213,340,000	
第1 5 2回利付国債（5年）	730,000,000	723,378,900	
第1 5 3回利付国債（5年）	5,850,000,000	5,777,050,500	
第1 5 4回利付国債（5年）	5,200,000,000	5,140,720,000	
第1 5 5回利付国債（5年）	2,770,000,000	2,751,357,900	
第1 5 6回利付国債（5年）	3,370,000,000	3,337,041,400	
第1 5 7回利付国債（5年）	2,610,000,000	2,581,211,700	
第1 5 8回利付国債（5年）	2,760,000,000	2,720,476,800	
第1 5 9回利付国債（5年）	1,750,000,000	1,721,860,000	
第1 6 0回利付国債（5年）	1,730,000,000	1,708,305,800	
第1 6 1回利付国債（5年）	2,840,000,000	2,814,411,600	
第1 6 2回利付国債（5年）	1,710,000,000	1,692,575,100	
第1 6 3回利付国債（5年）	4,240,000,000	4,212,779,200	
第1 6 4回利付国債（5年）	1,750,000,000	1,722,980,000	
第1 6 5回利付国債（5年）	2,510,000,000	2,481,310,700	
第1 6 6回利付国債（5年）	1,540,000,000	1,528,573,200	
第1 6 7回利付国債（5年）	1,160,000,000	1,150,151,600	
第1 6 8回利付国債（5年）	2,330,000,000	2,330,000,000	
第1 6 9回利付国債（5年）	1,780,000,000	1,772,435,000	
第1 7 0回利付国債（5年）	2,580,000,000	2,577,678,000	
第1 7 1回利付国債（5年）	3,070,000,000	3,039,760,500	
第1 7 2回利付国債（5年）	650,000,000	646,503,000	
第1 7 3回利付国債（5年）	960,000,000	958,185,600	
第1回利付国債（40年）	740,000,000	793,428,000	
第2回利付国債（40年）	1,030,000,000	1,059,396,200	
第3回利付国債（40年）	730,000,000	745,154,800	
第4回利付国債（40年）	1,030,000,000	1,044,811,400	
第5回利付国債（40年）	1,050,000,000	1,015,875,000	
第6回利付国債（40年）	1,630,000,000	1,531,238,300	
第7回利付国債（40年）	1,460,000,000	1,300,801,600	
第8回利付国債（40年）	1,480,000,000	1,211,602,000	
第9回利付国債（40年）	2,260,000,000	1,327,840,400	

第10回利付国債（40年）	2,140,000,000	1,476,107,800	
第11回利付国債（40年）	1,915,000,000	1,256,642,150	
第12回利付国債（40年）	1,430,000,000	820,348,100	
第13回利付国債（40年）	2,360,000,000	1,321,694,400	
第14回利付国債（40年）	2,270,000,000	1,348,084,900	
第15回利付国債（40年）	2,950,000,000	1,929,447,500	
第16回利付国債（40年）	2,680,000,000	1,917,084,400	
第17回利付国債（40年）	1,560,000,000	1,449,895,200	
第341回利付国債（10年）	5,030,000,000	5,025,271,800	
第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	4,739,532,000	
第343回利付国債（10年）	3,670,000,000	3,649,264,500	
第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	5,859,290,000	
第345回利付国債（10年）	4,880,000,000	4,840,862,400	
第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,697,847,500	
第347回利付国債（10年）	3,840,000,000	3,801,484,800	
第348回利付国債（10年）	4,340,000,000	4,290,524,000	
第349回利付国債（10年）	5,160,000,000	5,093,745,600	
第350回利付国債（10年）	6,570,000,000	6,475,917,600	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	5,325,000,000	5,239,374,000	
第352回利付国債（10年）	4,230,000,000	4,155,002,100	
第353回利付国債（10年）	4,415,000,000	4,329,172,400	
第354回利付国債（10年）	4,420,000,000	4,325,367,800	
第355回利付国債（10年）	4,170,000,000	4,072,922,400	
第356回利付国債（10年）	4,800,000,000	4,677,936,000	
第357回利付国債（10年）	4,670,000,000	4,545,311,000	
第358回利付国債（10年）	3,370,000,000	3,275,842,200	
第359回利付国債（10年）	4,565,000,000	4,430,469,450	
第360回利付国債（10年）	5,290,000,000	5,125,851,300	
第361回利付国債（10年）	5,580,000,000	5,396,641,200	
第362回利付国債（10年）	4,710,000,000	4,545,055,800	
第363回利付国債（10年）	5,260,000,000	5,064,012,400	
第364回利付国債（10年）	5,120,000,000	4,917,452,800	
第365回利付国債（10年）	4,767,000,000	4,565,689,590	
第366回利付国債（10年）	5,510,000,000	5,302,548,500	
第367回利付国債（10年）	4,760,000,000	4,566,744,000	

第368回利付国債（10年）	6,120,000,000	5,855,065,200	
第369回利付国債（10年）	5,170,000,000	5,051,917,200	
第370回利付国債（10年）	5,880,000,000	5,730,648,000	
第371回利付国債（10年）	5,660,000,000	5,453,579,800	
第372回利付国債（10年）	5,580,000,000	5,547,859,200	
第373回利付国債（10年）	6,130,000,000	5,970,190,900	
第374回利付国債（10年）	5,320,000,000	5,258,234,800	
第375回利付国債（10年）	5,600,000,000	5,671,400,000	
第376回利付国債（10年）	1,860,000,000	1,844,134,200	
第1回利付国債（30年）	110,000,000	121,330,000	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	174,633,600	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	130,825,200	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	124,631,100	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	54,863,000	
第6回利付国債（30年）	580,000,000	647,071,200	
第7回利付国債（30年）	880,000,000	979,853,600	
第8回利付国債（30年）	850,000,000	916,878,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	251,436,000	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	163,692,800	
第11回利付国債（30年）	260,000,000	278,496,400	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	209,902,500	
第13回利付国債（30年）	400,000,000	438,312,000	
第14回利付国債（30年）	750,000,000	848,490,000	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	387,909,400	
第16回利付国債（30年）	400,000,000	456,484,000	
第17回利付国債（30年）	1,130,000,000	1,279,284,300	
第18回利付国債（30年）	505,000,000	566,842,300	
第19回利付国債（30年）	630,000,000	707,156,100	
第20回利付国債（30年）	660,000,000	754,353,600	
第21回利付国債（30年）	960,000,000	1,077,724,800	
第22回利付国債（30年）	300,000,000	343,071,000	
第23回利付国債（30年）	430,000,000	491,434,100	
第24回利付国債（30年）	780,000,000	891,711,600	
第25回利付国債（30年）	1,000,000,000	1,120,990,000	
第26回利付国債（30年）	1,610,000,000	1,821,731,100	
第27回利付国債（30年）	1,480,000,000	1,691,432,800	

第 2 8 回利付国債 (30年)	1,610,000,000	1,839,199,600	
第 2 9 回利付国債 (30年)	1,770,000,000	1,996,223,700	
第 3 0 回利付国債 (30年)	1,970,000,000	2,192,334,200	
第 3 1 回利付国債 (30年)	1,610,000,000	1,765,123,500	
第 3 2 回利付国債 (30年)	1,950,000,000	2,158,104,000	
第 3 3 回利付国債 (30年)	2,410,000,000	2,557,781,200	
第 3 4 回利付国債 (30年)	2,085,000,000	2,263,246,650	
第 3 5 回利付国債 (30年)	2,480,000,000	2,613,399,200	
第 3 6 回利付国債 (30年)	2,310,000,000	2,423,952,300	
第 3 7 回利付国債 (30年)	2,705,000,000	2,786,718,050	
第 3 8 回利付国債 (30年)	1,390,000,000	1,404,525,500	
第 3 9 回利付国債 (30年)	1,800,000,000	1,843,056,000	
第 4 0 回利付国債 (30年)	1,190,000,000	1,196,735,400	
第 4 1 回利付国債 (30年)	1,310,000,000	1,293,205,800	
第 4 2 回利付国債 (30年)	1,560,000,000	1,535,398,800	
第 4 3 回利付国債 (30年)	1,390,000,000	1,363,923,600	
第 4 4 回利付国債 (30年)	1,610,000,000	1,574,918,100	
第 4 5 回利付国債 (30年)	1,680,000,000	1,582,240,800	
第 4 6 回利付国債 (30年)	1,890,000,000	1,775,125,800	
第 4 7 回利付国債 (30年)	1,820,000,000	1,735,297,200	
第 4 8 回利付国債 (30年)	1,750,000,000	1,603,735,000	
第 4 9 回利付国債 (30年)	1,820,000,000	1,661,641,800	
第 5 0 回利付国債 (30年)	1,570,000,000	1,264,462,300	
第 5 1 回利付国債 (30年)	2,020,000,000	1,441,088,200	
第 5 2 回利付国債 (30年)	1,830,000,000	1,361,794,500	
第 5 3 回利付国債 (30年)	1,550,000,000	1,175,055,000	
第 5 4 回利付国債 (30年)	1,880,000,000	1,485,632,400	
第 5 5 回利付国債 (30年)	1,600,000,000	1,258,992,000	
第 5 6 回利付国債 (30年)	1,780,000,000	1,393,579,800	
第 5 7 回利付国債 (30年)	1,700,000,000	1,325,269,000	
第 5 8 回利付国債 (30年)	2,090,000,000	1,621,108,500	
第 5 9 回利付国債 (30年)	1,450,000,000	1,092,575,000	
第 6 0 回利付国債 (30年)	1,610,000,000	1,267,681,800	
第 6 1 回利付国債 (30年)	1,330,000,000	992,313,000	
第 6 2 回利付国債 (30年)	1,335,000,000	940,107,000	
第 6 3 回利付国債 (30年)	1,460,000,000	994,449,800	

第 6 4 回利付国債 (30 年)	1,650,000,000	1,117,116,000	
第 6 5 回利付国債 (30 年)	1,235,000,000	831,130,300	
第 6 6 回利付国債 (30 年)	1,475,000,000	985,949,000	
第 6 7 回利付国債 (30 年)	1,705,000,000	1,200,217,700	
第 6 8 回利付国債 (30 年)	1,670,000,000	1,169,868,400	
第 6 9 回利付国債 (30 年)	1,720,000,000	1,232,896,000	
第 7 0 回利付国債 (30 年)	1,940,000,000	1,384,170,600	
第 7 1 回利付国債 (30 年)	1,470,000,000	1,043,905,800	
第 7 2 回利付国債 (30 年)	1,810,000,000	1,279,308,000	
第 7 3 回利付国債 (30 年)	1,840,000,000	1,294,440,000	
第 7 4 回利付国債 (30 年)	2,100,000,000	1,600,011,000	
第 7 5 回利付国債 (30 年)	1,760,000,000	1,444,537,600	
第 7 6 回利付国債 (30 年)	1,810,000,000	1,519,241,600	
第 7 7 回利付国債 (30 年)	1,890,000,000	1,661,310,000	
第 7 8 回利付国債 (30 年)	1,460,000,000	1,218,808,000	
第 7 9 回利付国債 (30 年)	950,000,000	750,918,000	
第 8 0 回利付国債 (30 年)	2,270,000,000	2,078,548,200	
第 8 1 回利付国債 (30 年)	1,910,000,000	1,663,839,200	
第 8 2 回利付国債 (30 年)	1,670,000,000	1,523,674,600	
第 8 3 回利付国債 (30 年)	1,910,000,000	1,903,162,200	
第 8 4 回利付国債 (30 年)	360,000,000	350,668,800	
第 8 3 回利付国債 (20 年)	290,000,000	295,466,500	
第 8 4 回利付国債 (20 年)	470,000,000	478,342,500	
第 8 5 回利付国債 (20 年)	290,000,000	296,562,700	
第 8 6 回利付国債 (20 年)	510,000,000	522,908,100	
第 8 7 回利付国債 (20 年)	1,790,000,000	1,832,906,300	
第 8 8 回利付国債 (20 年)	420,000,000	432,360,600	
第 8 9 回利付国債 (20 年)	350,000,000	359,744,000	
第 9 0 回利付国債 (20 年)	630,000,000	650,040,300	
第 9 1 回利付国債 (20 年)	450,000,000	465,138,000	
第 9 2 回利付国債 (20 年)	880,000,000	909,691,200	
第 9 3 回利付国債 (20 年)	120,000,000	124,239,600	
第 9 4 回利付国債 (20 年)	610,000,000	632,966,500	
第 9 5 回利付国債 (20 年)	830,000,000	868,827,400	
第 9 6 回利付国債 (20 年)	1,590,000,000	1,656,207,600	
第 9 7 回利付国債 (20 年)	900,000,000	943,191,000	

第98回利付国債（20年）	440,000,000	459,879,200	
第99回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,478,497,800	
第100回利付国債（20年）	480,000,000	506,553,600	
第101回利付国債（20年）	715,000,000	759,265,650	
第102回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,257,561,400	
第103回利付国債（20年）	400,000,000	424,876,000	
第104回利付国債（20年）	160,000,000	168,820,800	
第105回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,248,794,000	
第106回利付国債（20年）	680,000,000	722,214,400	
第107回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,167,485,000	
第108回利付国債（20年）	840,000,000	884,797,200	
第109回利付国債（20年）	920,000,000	971,326,800	
第110回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,170,697,000	
第111回利付国債（20年）	970,000,000	1,039,510,200	
第112回利付国債（20年）	990,000,000	1,056,508,200	
第113回利付国債（20年）	2,020,000,000	2,160,895,000	
第114回利付国債（20年）	1,830,000,000	1,964,468,400	
第115回利付国債（20年）	700,000,000	754,901,000	
第116回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,796,750,800	
第117回利付国債（20年）	1,980,000,000	2,133,410,400	
第118回利付国債（20年）	660,000,000	709,506,600	
第119回利付国債（20年）	460,000,000	489,389,400	
第120回利付国債（20年）	1,070,000,000	1,126,774,200	
第121回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,737,142,200	
第122回利付国債（20年）	750,000,000	799,995,000	
第123回利付国債（20年）	1,800,000,000	1,956,096,000	
第124回利付国債（20年）	760,000,000	821,438,400	
第125回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,358,457,200	
第126回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,180,459,100	
第127回利付国債（20年）	1,020,000,000	1,098,427,800	
第128回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,747,639,800	
第129回利付国債（20年）	740,000,000	793,620,400	
第130回利付国債（20年）	2,055,000,000	2,207,172,750	
第131回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,377,075,000	
第132回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,314,119,700	
第133回利付国債（20年）	1,810,000,000	1,946,057,700	

第134回利付国債（20年）	1,140,000,000	1,227,232,800	
第135回利付国債（20年）	220,000,000	235,296,600	
第136回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,317,090,800	
第137回利付国債（20年）	1,390,000,000	1,487,647,500	
第138回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,403,761,800	
第139回利付国債（20年）	480,000,000	510,076,800	
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,666,441,400	
第141回利付国債（20年）	1,700,000,000	1,820,598,000	
第142回利付国債（20年）	1,315,000,000	1,418,858,700	
第143回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,722,789,000	
第144回利付国債（20年）	1,160,000,000	1,224,032,000	
第145回利付国債（20年）	2,275,000,000	2,436,843,500	
第146回利付国債（20年）	2,670,000,000	2,859,222,900	
第147回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,907,496,200	
第148回利付国債（20年）	2,360,000,000	2,479,982,400	
第149回利付国債（20年）	2,950,000,000	3,095,494,000	
第150回利付国債（20年）	2,390,000,000	2,481,321,900	
第151回利付国債（20年）	2,205,000,000	2,243,411,100	
第152回利付国債（20年）	2,510,000,000	2,547,524,500	
第153回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,535,502,400	
第154回利付国債（20年）	2,735,000,000	2,762,842,300	
第155回利付国債（20年）	2,140,000,000	2,112,543,800	
第156回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,522,279,600	
第157回利付国債（20年）	2,910,000,000	2,602,995,000	
第158回利付国債（20年）	2,790,000,000	2,575,281,600	
第159回利付国債（20年）	2,250,000,000	2,092,927,500	
第160回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,259,712,400	
第161回利付国債（20年）	2,520,000,000	2,323,944,000	
第162回利付国債（20年）	1,820,000,000	1,671,378,800	
第163回利付国債（20年）	2,570,000,000	2,350,136,500	
第164回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,128,876,200	
第165回利付国債（20年）	2,600,000,000	2,323,308,000	
第166回利付国債（20年）	1,940,000,000	1,773,140,600	
第167回利付国債（20年）	2,340,000,000	2,068,794,000	
第168回利付国債（20年）	1,760,000,000	1,525,972,800	
第169回利付国債（20年）	2,170,000,000	1,842,612,100	

	第170回利付国債(20年)	2,370,000,000	2,000,208,900	
	第171回利付国債(20年)	2,020,000,000	1,694,376,000	
	第172回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,457,545,200	
	第173回利付国債(20年)	2,200,000,000	1,853,016,000	
	第174回利付国債(20年)	2,360,000,000	1,975,603,200	
	第175回利付国債(20年)	2,370,000,000	2,006,607,900	
	第176回利付国債(20年)	2,380,000,000	2,004,317,000	
	第177回利付国債(20年)	2,230,000,000	1,835,602,200	
	第178回利付国債(20年)	2,460,000,000	2,050,410,000	
	第179回利付国債(20年)	2,825,000,000	2,341,642,500	
	第180回利付国債(20年)	2,310,000,000	2,008,545,000	
	第181回利付国債(20年)	2,560,000,000	2,255,027,200	
	第182回利付国債(20年)	2,240,000,000	2,033,606,400	
	第183回利付国債(20年)	2,490,000,000	2,366,919,300	
	第184回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,279,403,500	
	第185回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,225,651,200	
	第186回利付国債(20年)	2,500,000,000	2,394,400,000	
	第187回利付国債(20年)	2,030,000,000	1,873,710,300	
	第188回利付国債(20年)	1,980,000,000	1,916,283,600	
	第189回利付国債(20年)	1,400,000,000	1,419,250,000	
	第190回利付国債(20年)	610,000,000	606,889,000	
	国債証券合計	595,217,000,000	569,993,601,890	
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	99,003,000	
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	69,637,000	
	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	99,029,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	110,784,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	107,259,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	102,532,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	98,524,000	
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	210,702,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,713,000	
	第19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(30年)	100,000,000	70,685,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	213,010,000	

第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	212,268,000	
第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	198,988,000	
第38回東京都公募公債（20年）	200,000,000	163,194,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	99,130,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	98,962,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	294,822,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	193,600,000	
第830回東京都公募公債	300,000,000	287,280,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	99,640,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,358,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,232,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	196,094,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	194,688,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	98,637,000	
第39回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	97,065,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	228,706,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	106,303,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	214,038,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,738,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	106,262,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	102,825,000	
第43回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	83,460,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,095,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	98,962,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	193,550,000	
第260回神奈川県公募公債	208,000,000	205,566,400	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	214,172,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	300,000,000	320,946,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	106,416,000	
第211回大阪府公募公債（5年）	110,000,000	108,584,300	
第213回大阪府公募公債（5年）	172,000,000	170,876,840	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,010,960	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,104,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	196,080,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	97,999,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	96,450,000	

第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	153,755,200	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	174,516,160	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	191,548,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	106,974,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	106,666,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	89,552,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	91,364,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	135,263,565	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	105,002,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	102,546,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	101,799,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	203,436,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	430,108,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	89,366,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	291,261,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	92,398,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	76,209,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	106,279,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,709,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	98,988,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,039,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	98,921,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	299,946,700	
令和5年度第7回静岡県公募公債	165,000,000	162,297,300	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	107,121,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,873,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,654,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,216,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	198,026,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	271,821,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,477,000	

平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	74,988,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	193,514,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	96,696,000	
令和2年度第13回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	82,996,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	139,064,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,651,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	106,403,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	213,436,000	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	98,976,000	
令和2年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	164,528,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	376,740,000	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	96,354,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	98,147,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	104,739,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	106,102,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	80,376,000	
第7回埼玉県公募公債(15年)	600,000,000	548,718,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	214,346,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	181,064,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	214,038,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	179,790,000	
第23回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	88,905,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	400,000,000	399,992,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,095,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,252,000	
第28回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	164,334,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	98,984,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	96,426,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	96,271,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	143,121,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,911,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	105,574,000	

平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	107,827,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	101,849,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	104,819,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	101,005,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	74,988,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	89,707,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	290,463,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,047,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	89,368,000	
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	97,905,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	97,659,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	212,204,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	106,830,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	106,279,000	
第20回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	91,110,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,100,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	118,953,600	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	289,920,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	96,627,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	126,549,800	
令和6年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	98,454,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	289,158,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	288,327,000	
令和6年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	299,691,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	97,809,000	
令和6年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	99,809,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	212,758,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	97,616,000	
第30回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	100,141,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	98,835,000	
第153回共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,990,000	
第154回共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,520,000	

第156回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,886,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,355,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,442,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,282,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	396,420,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,941,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,128,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,242,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	197,936,000	
第174回共同発行市場公募地方債	594,300,000	586,675,131	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,868,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	295,389,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	95,915,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	190,976,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	191,698,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,812,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,986,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,444,000	
第255回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,423,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	96,428,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	97,544,790	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	98,837,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	97,782,000	
令和2年度第1回静岡市公募公債	200,000,000	192,922,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	214,728,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	69,260,000	
第19回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	99,793,000	
第19回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	99,389,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	600,000,000	540,684,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	92,149,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	192,184,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	113,449,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	112,340,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	105,654,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	97,415,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	99,158,000	

第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	290,397,000	
第528回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,141,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	198,252,000	
令和2年度第1回京都市公募公債	200,000,000	193,160,000	
令和5年度第7回京都市公募公債	100,000,000	99,099,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	123,802,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	212,144,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	107,741,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	106,362,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	70,006,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	69,454,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	320,013,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,121,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,090,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	98,523,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	98,558,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	205,120,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	290,433,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	96,089,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	102,043,000	
平成26年度第10回札幌市公募公債（20年）	100,000,000	101,131,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	194,420,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	106,373,000	
第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	174,628,000	
第17回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	104,855,000	
第27回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	89,329,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,127,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,382,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,372,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	106,733,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	104,335,000	
2023年度第8回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	98,264,000	

	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,086,500	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	167,834,200	
	令和元年度第2回広島市公募公債(20年)	200,000,000	164,288,000	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	532,774,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	193,378,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	286,671,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	95,935,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	97,115,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	97,663,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	105,023,000	
	地方債証券合計	34,633,800,000	33,928,213,246	
特殊債券	第37回新関西国際空港株式会社社債	100,000,000	90,432,000	
	第1回国立大学法人東京大学債券	100,000,000	58,748,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,038,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	98,999,000	
	第109回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	59,698,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	50,369,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,924,000	
	第21回道路債券	100,000,000	114,309,000	
	第28回道路債券	200,000,000	230,162,000	
	第33回道路債券	200,000,000	231,546,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,627,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,604,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,104,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,153,000	
	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	104,879,000	
	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	213,370,000	
	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	214,824,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,283,000	

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	107,931,000	
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	108,254,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,820,000	
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	107,027,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	88,923,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,946,000	
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	105,388,000	
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	106,001,000	
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	106,117,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	540,654,000	
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	107,053,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	69,347,000	
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	208,240,000	
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	103,412,000	
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	205,904,000	
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	100,325,000	
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	201,600,000	
第247回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	163,940,000	
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	199,672,000	
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	99,581,000	
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	71,805,000	
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	244,290,410	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,231,000	
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	110,903,520	
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	203,046,350	

第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,782,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,790,000	
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	99,035,000	
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	197,980,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	282,612,000	
第314回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	88,632,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,712,000	
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	98,868,000	
第331回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,496,000	
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	118,447,200	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	196,734,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	269,052,000	
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	210,507,520	
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	96,946,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,617,000	
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	266,696,000	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	115,652,400	
第474回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	291,480,000	
第477回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	297,060,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	334,944,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	101,851,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	343,821,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	228,496,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	112,544,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	213,794,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	210,878,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	136,114,000	

年)			
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,167,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	500,000,000	533,605,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	105,699,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	105,901,000	
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	500,000,000	524,765,000	
第43回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	99,498,000	
第45回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	100,025,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,462,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,597,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	201,000,000	199,785,960	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,614,000	
第86回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	247,035,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,004,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,038,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	248,505,060	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	359,000,000	355,104,850	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,945,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,901,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	108,608,500	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	153,616,320	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,404,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,622,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,283,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,878,000	
F143回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,946,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	194,766,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,141,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,072,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,258,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,406,000	

F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,751,000	
F 2 2 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,508,000	
F 2 4 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,270,000	
F 4 4 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,760,000	
第 2 9 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	98,911,000	
第 3 3 回首都高速道路株式会社社債	200,000,000	198,064,000	
第 2 7 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,108,000	
第 2 8 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,499,000	
第 3 0 回阪神高速道路株式会社社債	300,000,000	297,621,000	
第 3 1 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,584,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	106,671,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	108,268,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,238,960	
第 4 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	117,000,000	115,900,200	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,940,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	207,154,500	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	184,045,400	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	199,876,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	102,188,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	56,901,000	
第 1 7 1 回都市再生債券	200,000,000	117,358,000	
第 1 9 1 回都市再生債券	100,000,000	80,140,000	
第 1 7 回政府保証民間都市開発債券	300,000,000	298,746,000	
第 6 2 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	96,596,000	
第 2 3 回政府保証中部国際空港債券	104,000,000	103,371,840	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	75,066,000	73,999,312	
第 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,775,000	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	52,874,000	52,206,201	
第 4 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	103,691,000	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	92,118,000	90,651,481	
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	105,603,000	103,426,522	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	37,598,000	36,906,572	
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	133,836,000	130,958,526	

第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	91,524,000	89,655,079	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,978,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,526,000	12,827,500	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,010,000	12,278,663	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,659,000	14,066,038	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,750,000	16,224,232	
第29回政府保証住宅金融支援機構債券	600,000,000	588,354,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,609,000	17,161,249	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,942,000	17,473,131	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,462,000	36,557,066	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,819,000	16,250,542	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,401,000	16,842,678	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,982,000	16,423,582	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,146,000	15,556,759	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,932,000	32,675,696	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,904,000	17,302,596	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,636,000	23,092,341	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,576,000	22,011,619	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,715,000	22,170,146	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,620,000	47,404,148	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,502,000	58,780,469	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,397,000	30,463,873	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,272,000	95,205,292	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,899,000	32,240,319	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,599,000	27,930,739	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,321,000	26,443,392	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,216,000	31,598,083	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	161,676,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,099,000	81,475,299	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,140,000	110,499,056	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,970,000	31,888,156	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,552,000	33,439,600	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,499,000	34,231,287	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,687,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,793,000	106,777,589	

第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,189,000	36,691,039	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,984,000	77,118,397	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,870,000	43,836,195	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,713,000	46,334,571	
第 9 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	306,585,000	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,957,000	45,844,588	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,804,000	144,595,175	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,522,000	97,128,495	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,649,000	47,372,936	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,306,000	50,802,202	
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,476,000	54,742,892	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,915,000	59,949,074	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,039,000	58,928,226	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,775,000	59,796,077	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,127,000	60,371,722	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,473,000	60,520,160	
第 1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	129,080,000	121,216,446	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,612,000	62,262,902	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	266,692,000	249,375,688	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,138,000	61,643,922	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,061,000	61,565,548	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,014,000	62,430,912	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,850,000	127,066,593	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	133,572,000	124,376,903	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,722,000	128,337,622	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,724,000	63,884,455	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,692,000	126,684,778	

第1 3 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,998,000	64,032,903	
第1 3 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,474,000	128,949,291	
第1 3 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,146,000	128,619,605	
第1 3 5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,211,000	
第1 3 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,842,000	65,831,345	
第1 3 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,260,000	65,471,781	
第1 4 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,148,000	64,704,515	
第1 4 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,608,000	133,489,046	
第1 4 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,026,000	66,807,105	
第1 4 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,011,000	66,005,282	
第1 4 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,820,000	135,091,219	
第1 4 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,569,000	67,572,936	
第1 4 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	226,848,000	204,233,522	
第1 4 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,424,000	138,017,161	
第1 5 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,950,000	71,211,222	
第1 5 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,962,000	71,889,373	
第1 5 8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,769,000	
第1 6 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,760,000	147,402,182	
第1 6 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,716,000	74,442,458	
第1 6 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,822,000	150,004,502	
第1 6 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,964,000	151,559,901	
第1 6 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,619,000	75,241,949	
第1 6 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,186,000	151,998,701	
第1 6 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,458,000	151,039,989	
第1 6 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,469,000	76,973,220	
第1 7 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,326,000	77,376,176	

券			
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	255,117,000	231,289,072	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,358,000	77,436,777	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,164,000	79,315,753	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,805,000	79,825,878	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,306,000	81,255,648	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,824,000	81,809,568	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,908,000	165,218,511	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,286,000	85,824,358	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,084,000	174,412,865	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,679,000	88,140,190	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	87,368,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,490,000	88,146,040	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,608,000	89,057,409	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,830,000	182,878,078	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,961,000	92,365,715	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,868,000	92,649,986	
第206回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,282,000	97,867,249	
第208回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	197,866,000	
第299回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	57,431,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	68,495,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	278,715,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	95,144,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,453,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,544,000	
い第876号商工債	400,000,000	394,032,000	
い第878号商工債	100,000,000	98,331,000	
い第888号商工債	200,000,000	199,086,000	
第376回信中金債（5年）	100,000,000	99,271,000	

第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,060,000	
第384回信金中金債（5年）	200,000,000	197,438,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	394,728,000	
第394回信金中金債（5年）	100,000,000	98,476,000	
第411回信金中金債（5年）	200,000,000	197,388,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	99,846,000	
第20回アングス開発公社円貨債券（2023）	300,000,000	297,957,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	105,843,000	
第64回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	96,645,000	
第67回東日本高速道路株式会社債	200,000,000	193,798,000	
第73回東日本高速道路株式会社債	500,000,000	482,705,000	
第86回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	98,735,000	
第106回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	98,679,000	
第111回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,212,000	
第114回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,733,000	
第98回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	198,712,000	
第100回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	98,817,000	
第101回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	98,879,000	
第103回中日本高速道路株式会社債	400,000,000	397,300,000	
第104回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	98,978,000	
第105回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	198,408,000	
第107回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,692,000	
第71回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	98,979,000	
第74回西日本高速道路株式会社債	200,000,000	198,838,000	
第77回西日本高速道路株式会社債	200,000,000	197,656,000	
第78回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	98,643,000	
第80回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,016,000	
第82回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,249,000	
第85回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	98,882,000	
第91回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,044,000	
第93回西日本高速道路株式会社債	300,000,000	297,867,000	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,009,000	
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	184,924,000	
特殊債券合計	37,446,499,000	36,294,173,822	

社債券	第41回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	200,000,000	199,378,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,114,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	198,998,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,877,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	398,212,000	
	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	99,347,000	
	第8回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債（2023）	400,000,000	397,480,000	
	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	99,633,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	96,150,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,502,000	
	第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,902,000	
	第9回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,908,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,063,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,157,000	
	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	99,615,000	
	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	99,536,000	
	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	198,134,000	
	第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	96,759,000	
	第27回株式会社ニチレイ無担保社債	200,000,000	198,574,000	
	第7回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,959,000	
	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	98,730,000	
	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	99,147,000	
	第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	97,922,000	
	第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,347,000	
	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	98,144,000	
	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	97,325,000	
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	99,467,000		
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	99,328,000		

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	199,026,000	
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	99,327,000	
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	99,037,000	
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	98,077,000	
第9回株式会社クレハ無担保社債	100,000,000	99,394,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	97,988,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,530,000	
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	98,216,000	
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	197,232,000	
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	78,437,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,241,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,102,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	194,372,000	
第2回株式会社ADEKA無担保社債	100,000,000	98,943,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	283,752,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,636,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	198,558,000	
第10回テルモ株式会社無担保社債	300,000,000	298,551,000	
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	99,433,000	
第10回関西ペイント株式会社無担保社債	200,000,000	199,648,000	
第23回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,271,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,261,000	
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	100,041,000	
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	199,336,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	96,515,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,779,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,306,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	97,562,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	96,147,000	
第20回住友大阪セメント株式会社無担保社債	100,000,000	99,869,000	

第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,153,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,407,000	
第17回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	99,803,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,208,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	97,603,000	
第59回日本精工株式会社無担保社債	100,000,000	99,397,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,953,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,431,000	
第23回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,778,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,023,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,085,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,419,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	95,707,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,983,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,294,000	
第39回ソニーグループ株式会社無担保社債	500,000,000	495,905,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,387,000	
第35回三菱重工株式会社無担保社債	100,000,000	98,703,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,784,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,069,000	
第28回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,432,000	
第29回J A三井リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,196,000	
第31回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,396,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,297,000	
第32回いすゞ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,440,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	191,240,000	
第32回マツダ株式会社無担保社債	100,000,000	100,021,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	99,145,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,184,000	
第4回オリックス銀行株式会社無担保社債	200,000,000	198,788,000	
第9回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	91,026,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	82,539,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	98,776,000	
第119回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,377,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	106,438,000	

第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	194,182,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,627,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,043,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	200,000,000	191,422,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	97,775,000	
第43回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	197,908,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	100,000,000	98,374,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,406,000	
第106回株式会社クレディセゾン無担保社債	200,000,000	199,422,000	
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	96,105,000	
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	98,673,000	
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	107,248,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,633,000	
第41回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,311,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,344,000	
第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,916,000	
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	386,792,000	
第25回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	98,360,000	
第26回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	193,534,000	
第30回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	298,659,000	
第34回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,351,000	
第38回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,569,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,368,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,121,000	
第86回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	300,000,000	299,376,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,123,000	
第44回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,638,000	
第47回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,113,000	
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	98,885,000	

第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,022,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,674,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,458,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,945,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,196,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,227,000	
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	198,396,000	
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	198,802,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,318,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,564,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,053,000	
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	98,346,000	
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	99,175,000	
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	98,699,000	
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	197,934,000	
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	198,752,000	
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	197,414,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	198,942,000	
第84回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	196,238,000	
第86回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	187,692,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,224,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	82,936,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,972,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,241,000	
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	86,388,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	95,912,000	
第135回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,392,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	76,101,000	
第89回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,193,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,007,000	

第 8 4 回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,857,000	
第 8 6 回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	69,491,000	
第 4 2 回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,969,000	
第 5 1 回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,158,000	
第 4 7 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,225,000	
第 5 7 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	212,292,000	
第 1 0 9 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,999,000	
第 1 1 5 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,934,000	
第 1 2 5 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	79,567,000	
第 1 3 3 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	67,945,000	
第 1 4 7 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,580,000	
第 1 5 9 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	68,883,000	
第 1 6 5 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	81,682,000	
第 1 7 2 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	59,102,000	
第 1 7 回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,403,000	
第 4 6 回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	64,866,000	
第 5 0 回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	77,809,000	
第 7 5 回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	81,445,000	
第 4 7 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,582,000	
第 7 1 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,412,000	
第 7 2 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,328,000	
第 3 1 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	67,683,000	
第 3 7 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	56,522,000	
第 4 0 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	46,299,000	
第 5 4 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	60,017,000	
第 5 6 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	71,788,000	
第 5 3 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	139,510,000	
第 5 6 回名古屋鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	87,240,000	
第 1 3 回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	99,881,000	

第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	97,739,000	
第32回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,684,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,481,000	
第26回ソフトバンク株式会社無担保社債	200,000,000	199,326,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	167,822,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	92,039,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,869,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	90,664,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	81,127,000	
第545回中部電力株式会社社債	100,000,000	95,188,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,184,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,364,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,886,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,525,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,308,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,849,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,993,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,010,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,682,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	194,784,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,394,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	290,442,000	
第457回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,717,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,935,000	
第323回北陸電力株式会社社債	100,000,000	89,527,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	194,654,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	178,052,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,724,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,949,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	193,880,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,325,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,562,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,830,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,009,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,248,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,225,000	

第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,369,000	
第476回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,739,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,660,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,887,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	94,957,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,628,000	
第332回北海道電力株式会社社債	100,000,000	91,782,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,196,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	86,764,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	97,620,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	88,739,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,963,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,113,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,000,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,730,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	96,869,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	197,574,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,727,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,942,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,395,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	263,574,000	
第64回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,596,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	92,690,000	
第69回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,426,000	
第75回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,003,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	95,311,000	
第22回株式会社JERA無担保社債	200,000,000	198,404,000	
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	99,293,000	
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	97,929,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	68,659,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	192,146,000	

	第4 1回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	190,518,000	
	第4 2回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	81,175,000	
	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	196,690,000	
	社債券合計	32,600,000,000	31,283,707,000	
	合計		671,499,695,958	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,731,973,319
株式	685,842,024,520
派生商品評価勘定	460,890,950
未収入金	13,476,400
未収配当金	6,704,748,007
未収利息	28,111
差入委託証拠金	691,192,523
流動資産合計	698,444,333,830
資産合計	698,444,333,830
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,712,100
前受金	459,392,800
未払金	608,066
未払解約金	318,491,813
流動負債合計	780,204,779
負債合計	780,204,779
純資産の部	
元本等	
元本	242,571,751,996
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	455,092,377,055

元本等合計	697,664,129,051
純資産合計	697,664,129,051
負債純資産合計	698,444,333,830

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年11月11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11月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,571,751,996口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.8761円 (1万口当たり純資産額) (28,761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11月11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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年11月11日
期首元本額	243,386,208,471円
期中追加設定元本額	33,608,218,208円
期中一部解約元本額	34,422,674,683円
期末元本額	242,571,751,996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)	266,133,355円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,245,461,960円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,059,354円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,367,244,172円
世界経済インデックスファンド	6,763,051,290円
日本株式インデックス・オープン	2,717,825,462円
DCマイセレクション25	4,769,520,014円
DCマイセレクション50	16,237,830,469円
DCマイセレクション75	18,528,461,607円
DC日本株式インデックス・オープン	5,968,523,121円
DCマイセレクションS25	3,043,496,356円

DCマイセレクションS50	9,704,501,968円
DCマイセレクションS75	9,200,941,925円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,626,138,832円
DCターゲット・イヤーフンド2025	36,585,333円
DCターゲット・イヤーフンド2035	546,181,779円
DCターゲット・イヤーフンド2045	453,462,394円
DC世界経済インデックスファンド	3,687,611,737円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	368,171,824円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	3,614,247円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	9,377,843円
マイセレクション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)	94,694,369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)	10,958,717円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	43,601,788円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	13,119,749円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	41,080,928円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	317,668,287円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	277,749,993円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,881,328,790円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	25,690,546円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	8,295,524円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	281,788,373円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	152,327,844円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	210,018,427円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	15,736,416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)	357,736,373円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,288,351,923円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,860,333,717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)	699,609,492円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	423,445,980円
コア投資戦略ファンド(切替型)	531,895,567円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	188,420,095円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,649,392円
SMTインデックスバランス・オープン	46,307,621円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	17,217,067,833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	57,936,871円
SMT世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	271,802,690円
SMT世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	43,922,101円
SMT8資産インデックスバランス・オープン	13,033,716円
グローバル経済コア	301,271,980円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	35,864,860円
MySMTTOPIXインデックス(ノーロード)	3,105,539,614円
DCターゲット・イヤーフンド2055	29,386,315円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	399,701,359円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	131,503,154円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	66,871,550円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	70,789,075円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	32,390,877円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	42,145,099円
10資産分散投資ファンド	113,811,836円
グローバル10資産バランスファンド	49,947,880円

DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	2,019,940 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2035	224,169 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2040	38,003 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2045	257,119 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2050	61,505 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2055	124,141 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2060	22,495 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2065	36,380 円
DCマイセクションS50（2024-2026リスク抑制型）	3,715,383 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）	43,724,335,053 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）	232,995,570 円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	305,308,363 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,962,419 円
SMTAM日本株式インデックスファンドVLP（適格機関投資家専用）	51,018,603,816 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,281,489 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）	227,703,315 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		2,787,731,496
合計		2,787,731,496

（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11月11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	10,203,097,200	—	10,662,490,000	459,392,800
合計		10,203,097,200	—	10,662,490,000	459,392,800

（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	3,975.00	40,942,500	

ニッセイ	249,100	952.00	237,143,200
マルハニチロ	37,000	2,880.00	106,560,000
雪国まいたけ	21,200	1,037.00	21,984,400
カネコ種苗	7,000	1,371.00	9,597,000
サカタのタネ	28,300	3,455.00	97,776,500
ホクト	19,900	1,776.00	35,342,400
ホクリョウ	900	1,060.00	954,000
住石ホールディングス	26,900	949.00	25,528,100
日鉄鉱業	10,000	4,235.00	42,350,000
I N P E X	739,100	2,008.00	1,484,112,800
石油資源開発	134,100	1,103.00	147,912,300
K&Oエナジーグループ	11,300	3,060.00	34,578,000
ショーボンドホールディングス	32,100	5,341.00	171,446,100
ミライト・ワン	80,000	2,221.00	177,680,000
タマホーム	15,700	3,795.00	59,581,500
サンヨーホームズ	600	707.00	424,200
日本アクア	2,700	799.00	2,157,300
ファーストコーポレーション	1,500	820.00	1,230,000
ベステラ	1,300	936.00	1,216,800
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	1,255.00	1,380,500
第一カッター興業	7,200	1,456.00	10,483,200
安藤・間	144,300	1,161.00	167,532,300
東急建設	78,000	683.00	53,274,000
コムシスホールディングス	86,700	3,172.00	275,012,400
ビーアールホールディングス	36,500	347.00	12,665,500
高松コンストラクショングループ	18,500	2,912.00	53,872,000
東建コーポレーション	6,300	10,500.00	66,150,000
ソネック	600	851.00	510,600
ヤマウラ	12,600	1,192.00	15,019,200
オリエンタル白石	92,200	377.00	34,759,400
大成建設	155,300	6,973.00	1,082,906,900
大林組	564,700	2,038.00	1,150,858,600
清水建設	485,000	1,034.00	501,490,000
長谷工コーポレーション	159,900	1,831.00	292,776,900
松井建設	16,300	836.00	13,626,800

錢高組	600	3,420.00	2,052,000	
鹿島建設	379,300	2,735.50	1,037,575,150	
不動テトラ	12,100	2,062.00	24,950,200	
大末建設	1,500	1,648.00	2,472,000	
鉄建建設	12,500	2,360.00	29,500,000	
西松建設	27,300	5,223.00	142,587,900	
三井住友建設	129,700	388.00	50,323,600	
大豊建設	6,000	3,370.00	20,220,000	
佐田建設	2,400	852.00	2,044,800	
ナカノフドー建設	2,700	500.00	1,350,000	
奥村組	30,300	4,335.00	131,350,500	
東鉄工業	18,800	3,160.00	59,408,000	
イチケン	900	2,583.00	2,324,700	
富士ピー・エス	1,700	407.00	691,900	
浅沼組	64,400	664.00	42,761,600	
戸田建設	210,400	935.00	196,724,000	
熊谷組	28,800	3,530.00	101,664,000	
北野建設	700	4,120.00	2,884,000	
植木組	1,100	1,568.00	1,724,800	
矢作建設工業	23,700	1,479.00	35,052,300	
ピーエス・コンストラクション	12,400	1,053.00	13,057,200	
日本ハウスホールディングス	37,200	323.00	12,015,600	
新日本建設	24,500	1,540.00	37,730,000	
東亜道路工業	33,500	1,247.00	41,774,500	
日本道路	20,400	1,683.00	34,333,200	
東亜建設工業	52,600	975.00	51,285,000	
日本国土開発	49,600	517.00	25,643,200	
若築建設	6,000	3,560.00	21,360,000	
東洋建設	49,200	1,296.00	63,763,200	
五洋建設	223,800	617.60	138,218,880	
世紀東急工業	22,400	1,563.00	35,011,200	
福田組	6,600	5,650.00	37,290,000	
住友林業	147,800	5,819.00	860,048,200	
日本基礎技術	2,300	683.00	1,570,900	
巴コーポレーション	4,700	865.00	4,065,500	
大和ハウス工業	516,100	4,506.00	2,325,546,600	

ライト工業	32,100	2,145.00	68,854,500	
積水ハウス	518,900	3,660.00	1,899,174,000	
日特建設	16,600	995.00	16,517,000	
北陸電気工事	11,900	1,123.00	13,363,700	
ユアテック	33,000	1,426.00	47,058,000	
日本リーテック	13,600	1,099.00	14,946,400	
四電工	21,900	1,515.00	33,178,500	
中電工	27,000	3,475.00	93,825,000	
関電工	93,700	2,144.00	200,892,800	
きんでん	118,900	3,066.00	364,547,400	
東京エネシス	16,300	1,044.00	17,017,200	
トーエネック	29,000	913.00	26,477,000	
住友電設	13,900	5,030.00	69,917,000	
日本電設工業	32,700	1,855.00	60,658,500	
エクシオグループ	181,100	1,578.50	285,866,350	
新日本空調	11,300	3,910.00	44,183,000	
九電工	37,700	5,538.00	208,782,600	
三機工業	37,600	2,884.00	108,438,400	
日揮ホールディングス	172,400	1,401.00	241,532,400	
中外炉工業	5,700	2,808.00	16,005,600	
ヤマト	3,100	998.00	3,093,800	
太平電業	11,000	5,070.00	55,770,000	
高砂熱学工業	41,200	5,637.00	232,244,400	
三晃金属工業	500	4,235.00	2,117,500	
朝日工業社	16,300	1,357.00	22,119,100	
明星工業	33,700	1,339.00	45,124,300	
大気社	21,900	4,945.00	108,295,500	
ダイダン	22,900	3,655.00	83,699,500	
日比谷総合設備	12,600	3,840.00	48,384,000	
飛島ホールディングス	18,000	1,547.00	27,846,000	
フィル・カンパニー	3,400	882.00	2,998,800	
テスホールディングス	37,500	261.00	9,787,500	
インフロニア・ホールディングス	179,300	1,135.00	203,505,500	
東洋エンジニアリング	25,600	749.00	19,174,400	
レイズネクスト	25,200	1,442.00	36,338,400	
ニッポン	56,500	2,180.00	123,170,000	

日清製粉グループ本社	178,700	1,806.00	322,732,200	
日東富士製粉	3,100	6,910.00	21,421,000	
昭和産業	16,400	2,746.00	45,034,400	
鳥越製粉	3,300	677.00	2,234,100	
中部飼料	24,200	1,352.00	32,718,400	
フィード・ワン	25,600	814.00	20,838,400	
東洋精糖	700	1,393.00	975,100	
日本甜菜製糖	10,200	2,306.00	23,521,200	
DM三井製糖ホールディングス	17,300	3,230.00	55,879,000	
塩水港精糖	4,900	289.00	1,416,100	
ウェルネオシュガー	8,700	2,228.00	19,383,600	
森永製菓	73,200	2,749.00	201,226,800	
中村屋	4,400	3,220.00	14,168,000	
江崎グリコ	50,000	4,265.00	213,250,000	
名糖産業	6,900	1,917.00	13,227,300	
井村屋グループ	10,400	2,418.00	25,147,200	
不二家	12,000	2,642.00	31,704,000	
山崎製パン	117,100	2,892.50	338,711,750	
第一屋製パン	800	614.00	491,200	
モロゾフ	5,700	4,630.00	26,391,000	
亀田製菓	10,000	4,280.00	42,800,000	
寿スピリッツ	101,500	2,196.00	222,894,000	
カルビー	80,100	3,231.00	258,803,100	
森永乳業	66,000	3,011.00	198,726,000	
六甲バター	12,800	1,395.00	17,856,000	
ヤクルト本社	245,400	3,230.00	792,642,000	
明治ホールディングス	229,700	3,347.00	768,805,900	
雪印メグミルク	46,100	2,531.00	116,679,100	
プリマハム	23,500	2,201.00	51,723,500	
日本ハム	73,900	4,939.00	364,992,100	
林兼産業	1,300	460.00	598,000	
丸大食品	17,600	1,744.00	30,694,400	
S Foods	19,300	2,717.00	52,438,100	
柿安本店	6,800	2,746.00	18,672,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	26,700	3,790.00	101,193,000	
サッポロホールディングス	56,500	7,225.00	408,212,500	

アサヒグループホールディングス	1,289,600	1,768.50	2,280,657,600	
キリンホールディングス	715,300	2,138.00	1,529,311,400	
シマダヤ	5,700	1,469.00	8,373,300	
宝ホールディングス	118,000	1,223.00	144,314,000	
オエノンホールディングス	56,600	427.00	24,168,200	
養命酒製造	5,800	2,482.00	14,395,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	123,300	2,304.50	284,144,850	
ライフドリンク カンパニー	37,500	1,945.00	72,937,500	
サントリー食品インターナショナル	120,900	4,999.00	604,379,100	
ダイドーグループホールディングス	19,800	3,040.00	60,192,000	
伊藤園	59,100	3,268.00	193,138,800	
キーコーヒー	19,600	2,020.00	39,592,000	
ユニカフェ	1,200	938.00	1,125,600	
日清オイリオグループ	24,600	5,060.00	124,476,000	
不二製油グループ本社	34,300	3,064.00	105,095,200	
かどや製油	500	3,580.00	1,790,000	
J-オイルミルズ	20,000	2,100.00	42,000,000	
キッコーマン	569,000	1,753.00	997,457,000	
味の素	403,600	6,171.00	2,490,615,600	
ブルドックソース	9,300	1,788.00	16,628,400	
キューピー	94,000	3,626.00	340,844,000	
ハウス食品グループ本社	57,800	2,843.50	164,354,300	
カゴメ	75,000	3,026.00	226,950,000	
アリアケジャパン	17,400	5,450.00	94,830,000	
ピエトロ	500	1,765.00	882,500	
エバラ食品工業	4,200	2,984.00	12,532,800	
やまみ	500	3,725.00	1,862,500	
ニチレイ	70,000	4,124.00	288,680,000	
東洋水産	79,500	9,647.00	766,936,500	
イートアンドホールディングス	8,300	2,122.00	17,612,600	
大冷	500	1,903.00	951,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	1,392.00	11,136,000	
日清食品ホールディングス	221,400	3,800.00	841,320,000	
一正蒲鉾	1,600	735.00	1,176,000	
フジッコ	18,000	1,704.00	30,672,000	

ロック・フィールド	21,400	1,450.00	31,030,000	
日本たばこ産業	1,043,500	4,203.00	4,385,830,500	
ケンコーマヨネーズ	12,000	2,200.00	26,400,000	
わらべや日洋ホールディングス	11,700	2,016.00	23,587,200	
なとり	11,000	2,131.00	23,441,000	
イフジ産業	700	1,485.00	1,039,500	
ファーマフーズ	23,200	1,020.00	23,664,000	
ユウグレナ	108,700	428.00	46,523,600	
紀文食品	15,200	1,092.00	16,598,400	
ピクルスホールディングス	10,300	1,050.00	10,815,000	
ミヨシ油脂	1,500	1,468.00	2,202,000	
理研ビタミン	15,100	2,725.00	41,147,500	
片倉工業	16,600	2,045.00	33,947,000	
グンゼ	12,700	5,200.00	66,040,000	
東洋紡	77,300	943.00	72,893,900	
ユニチカ	58,900	251.00	14,783,900	
富士紡ホールディングス	7,900	4,850.00	38,315,000	
倉敷紡績	12,700	5,690.00	72,263,000	
シキボウ	12,800	1,000.00	12,800,000	
日本毛織	45,900	1,281.00	58,797,900	
トーア紡コーポレーション	1,600	398.00	636,800	
帝国繊維	20,300	2,759.00	56,007,700	
帝人	171,300	1,398.50	239,563,050	
東レ	1,277,000	931.60	1,189,653,200	
住江織物	800	2,020.00	1,616,000	
日本フェルト	2,900	472.00	1,368,800	
イチカワ	700	1,562.00	1,093,400	
日東製網	400	1,443.00	577,200	
アツギ	2,700	922.00	2,489,400	
ダイニック	1,200	740.00	888,000	
セーレン	34,500	2,638.00	91,011,000	
ソトー	1,300	674.00	876,200	
東海染工	400	687.00	274,800	
小松マテーレ	25,900	763.00	19,761,700	
ワコールホールディングス	36,200	4,609.00	166,845,800	
ホギメディカル	23,400	4,540.00	106,236,000	

T S I ホールディングス	53,400	880.00	46,992,000
マツオカコーポレーション	1,200	1,810.00	2,172,000
ワールド	25,200	1,918.00	48,333,600
三陽商会	8,400	2,610.00	21,924,000
ナイガイ	1,500	239.00	358,500
オンワードホールディングス	105,000	524.00	55,020,000
ルックホールディングス	5,700	2,530.00	14,421,000
ゴールドウイン	31,500	8,796.00	277,074,000
キング	1,500	736.00	1,104,000
ヤマトインターナショナル	3,100	323.00	1,001,300
特種東海製紙	9,500	3,640.00	34,580,000
王子ホールディングス	661,600	547.40	362,159,840
日本製紙	91,000	860.00	78,260,000
三菱製紙	5,200	475.00	2,470,000
北越コーポレーション	98,100	1,545.00	151,564,500
中越パルプ工業	1,500	1,206.00	1,809,000
大王製紙	88,200	831.00	73,294,200
阿波製紙	1,000	446.00	446,000
レンゴー	162,100	901.00	146,052,100
トーモク	10,300	2,297.00	23,659,100
ザ・パック	13,200	3,645.00	48,114,000
北の達人コーポレーション	75,000	156.00	11,700,000
クラレ	254,600	2,103.50	535,551,100
旭化成	1,181,800	1,147.00	1,355,524,600
共和レザー	2,200	632.00	1,390,400
巴川コーポレーション	1,100	731.00	804,100
レゾナック・ホールディングス	156,800	3,831.00	600,700,800
住友化学	1,405,100	394.50	554,311,950
住友精化	8,400	5,040.00	42,336,000
日産化学	89,900	5,299.00	476,380,100
ラサ工業	6,900	2,805.00	19,354,500
クレハ	36,800	2,857.00	105,137,600
多木化学	6,900	3,670.00	25,323,000
テイカ	14,600	1,596.00	23,301,600
石原産業	29,500	1,399.00	41,270,500
片倉コープアグリ	900	965.00	868,500

日本曹達	37,000	2,466.00	91,242,000	
東ソー	233,200	2,046.00	477,127,200	
トクヤマ	57,500	2,705.50	155,566,250	
セントラル硝子	22,000	3,470.00	76,340,000	
東亜合成	85,600	1,541.00	131,909,600	
大阪ソーダ	62,000	1,595.00	98,890,000	
関東電化工業	34,400	910.00	31,304,000	
デンカ	64,700	2,045.50	132,343,850	
信越化学工業	1,566,600	5,788.00	9,067,480,800	
日本カーバイド工業	9,400	1,699.00	15,970,600	
堺化学工業	13,600	2,628.00	35,740,800	
第一稀元素化学工業	19,500	727.00	14,176,500	
エア・ウォーター	167,900	1,904.50	319,765,550	
日本酸素ホールディングス	169,500	4,860.00	823,770,000	
日本化学工業	6,500	2,638.00	17,147,000	
東邦アセチレン	4,000	349.00	1,396,000	
日本パーカライジング	79,300	1,284.00	101,821,200	
高压ガス工業	25,800	934.00	24,097,200	
チタン工業	500	869.00	434,500	
四国化成ホールディングス	20,100	2,117.00	42,551,700	
戸田工業	4,100	1,685.00	6,908,500	
ステラ ケミファ	9,700	4,155.00	40,303,500	
保土谷化学工業	5,600	4,315.00	24,164,000	
日本触媒	111,900	1,870.00	209,253,000	
大日精化工業	12,400	2,873.00	35,625,200	
カネカ	43,900	3,724.00	163,483,600	
三菱瓦斯化学	141,700	2,734.00	387,407,800	
三井化学	157,200	3,538.00	556,173,600	
東京応化工業	84,900	3,676.00	312,092,400	
大阪有機化学工業	14,900	2,870.00	42,763,000	
三菱ケミカルグループ	1,277,100	836.70	1,068,549,570	
KHネオケム	32,100	2,050.00	65,805,000	
ダイセル	198,700	1,374.00	273,013,800	
住友ベークライト	55,000	4,156.00	228,580,000	
積水化学工業	347,900	2,350.50	817,738,950	
日本ゼオン	134,700	1,461.50	196,864,050	

アイカ工業	44,900	3,371.00	151,357,900	
UBE	90,000	2,337.50	210,375,000	
積水樹脂	26,600	2,187.00	58,174,200	
旭有機材	11,800	4,195.00	49,501,000	
ニチバン	9,600	1,950.00	18,720,000	
リケンテクノス	33,400	1,096.00	36,606,400	
大倉工業	8,200	2,719.00	22,295,800	
積水化成工業	25,000	363.00	9,075,000	
群栄化学工業	4,200	2,768.00	11,625,600	
タイガースポリマー	1,700	715.00	1,215,500	
ミライアル	1,300	1,480.00	1,924,000	
ダイキアクシス	1,600	717.00	1,147,200	
ダイキョーニシカワ	39,300	606.00	23,815,800	
竹本容器	1,400	864.00	1,209,600	
森六ホールディングス	9,200	2,249.00	20,690,800	
恵和	11,500	1,042.00	11,983,000	
日本化薬	122,300	1,191.00	145,659,300	
カーリット	19,200	1,264.00	24,268,800	
日本精化	11,800	2,425.00	28,615,000	
扶桑化学工業	16,200	3,585.00	58,077,000	
トリケミカル研究所	19,100	3,000.00	57,300,000	
ADEKA	62,100	2,794.00	173,507,400	
日油	205,600	2,461.50	506,084,400	
新日本理化	5,300	203.00	1,075,900	
ハリマ化成グループ	13,900	871.00	12,106,900	
花王	425,400	6,411.00	2,727,239,400	
第一工業製薬	7,100	3,910.00	27,761,000	
石原ケミカル	8,000	2,338.00	18,704,000	
日華化学	1,500	1,125.00	1,687,500	
ニイタカ	800	1,936.00	1,548,800	
三洋化成工業	10,900	4,085.00	44,526,500	
有機合成薬品工業	3,100	268.00	830,800	
大日本塗料	19,700	1,141.00	22,477,700	
日本ペイントホールディングス	773,000	1,070.00	827,110,000	
関西ペイント	146,300	2,208.00	323,030,400	
神東塗料	3,200	132.00	422,400	

中国塗料	36,500	2,622.00	95,703,000
日本特殊塗料	2,700	1,168.00	3,153,600
藤倉化成	20,500	507.00	10,393,500
太陽ホールディングス	31,000	4,195.00	130,045,000
D I C	63,200	3,277.00	207,106,400
サカタインクス	39,600	1,509.00	59,756,400
a r t i e n c e	31,900	3,055.00	97,454,500
富士フイルムホールディングス	1,054,600	3,474.00	3,663,680,400
資生堂	365,200	2,854.00	1,042,280,800
ライオン	222,600	1,743.50	388,103,100
高砂香料工業	11,900	6,080.00	72,352,000
マンダム	38,500	1,219.00	46,931,500
ミルボン	28,600	3,070.00	87,802,000
コーセー	36,200	7,699.00	278,703,800
コタ	18,100	1,622.00	29,358,200
シーボン	500	1,183.00	591,500
ポーラ・オルビスホールディングス	91,300	1,446.50	132,065,450
ノエビアホールディングス	15,900	4,990.00	79,341,000
アジュバンホールディングス	900	821.00	738,900
新日本製薬	10,200	1,708.00	17,421,600
I - n e	5,900	1,880.00	11,092,000
アクシージア	11,700	566.00	6,622,200
エステー	13,800	1,496.00	20,644,800
アグロ カネショウ	6,200	1,347.00	8,351,400
コニシ	51,500	1,382.00	71,173,000
長谷川香料	34,100	3,285.00	112,018,500
小林製薬	46,700	5,366.00	250,592,200
荒川化学工業	15,100	1,147.00	17,319,700
メック	14,700	3,775.00	55,492,500
日本高純度化学	4,000	3,285.00	13,140,000
タカラバイオ	55,000	1,092.00	60,060,000
J C U	19,700	3,850.00	75,845,000
新田ゼラチン	2,600	872.00	2,267,200
O A T アグリオ	7,400	2,038.00	15,081,200
デクセリアルズ	153,200	2,532.00	387,902,400
アース製薬	16,200	5,160.00	83,592,000

北興化学工業	15,900	1,299.00	20,654,100
大成ラミック	5,200	2,575.00	13,390,000
クミアイ化学工業	70,800	803.00	56,852,400
日本農薬	32,700	678.00	22,170,600
アキレス	11,200	1,514.00	16,956,800
有沢製作所	26,300	1,525.00	40,107,500
日東電工	553,100	2,620.00	1,449,122,000
レック	22,800	1,211.00	27,610,800
三光合成	22,400	618.00	13,843,200
きもと	6,300	320.00	2,016,000
ZACROS	14,100	4,390.00	61,899,000
前澤化成工業	11,500	1,845.00	21,217,500
未来工業	6,400	3,660.00	23,424,000
ウェーブロックホールディングス	1,400	609.00	852,600
JSP	12,500	1,995.00	24,937,500
エフピコ	38,600	2,659.00	102,637,400
天馬	14,600	3,020.00	44,092,000
信越ポリマー	38,400	1,672.00	64,204,800
東リ	8,500	447.00	3,799,500
ニフコ	65,400	3,691.00	241,391,400
バルカー	14,900	3,260.00	48,574,000
ユニ・チャーム	364,400	4,100.00	1,494,040,000
ショーエイコーポレーション	1,200	578.00	693,600
協和キリン	211,300	2,625.00	554,662,500
武田薬品工業	1,556,400	4,192.00	6,524,428,800
アステラス製薬	1,534,300	1,729.50	2,653,571,850
住友ファーマ	155,700	603.00	93,887,100
塩野義製薬	580,200	2,134.50	1,238,436,900
わかもと製薬	4,000	236.00	944,000
日本新薬	46,700	3,971.00	185,445,700
中外製薬	547,500	7,425.00	4,065,187,500
科研製薬	30,500	4,042.00	123,281,000
エーザイ	232,100	5,062.00	1,174,890,200
ロート製薬	184,800	3,411.00	630,352,800
小野薬品工業	357,800	1,873.50	670,338,300
久光製薬	39,600	4,375.00	173,250,000

持田製薬	22,000	3,330.00	73,260,000
参天製薬	332,400	1,700.50	565,246,200
扶桑薬品工業	6,300	2,652.00	16,707,600
日本ケミファ	400	1,491.00	596,400
ツムラ	60,100	4,865.00	292,386,500
キッセイ薬品工業	29,500	3,650.00	107,675,000
生化学工業	30,200	818.00	24,703,600
栄研化学	27,700	2,148.00	59,499,600
鳥居薬品	9,600	4,270.00	40,992,000
JCRファーマ	60,300	668.00	40,280,400
東和薬品	23,500	3,085.00	72,497,500
富士製薬工業	13,200	1,292.00	17,054,400
ゼリア新薬工業	27,700	2,221.00	61,521,700
ネクセラファーマ	83,600	1,194.00	99,818,400
第一三共	1,650,800	4,906.00	8,098,824,800
杏林製薬	38,600	1,477.00	57,012,200
大幸薬品	40,400	362.00	14,624,800
ダイト	13,500	2,169.00	29,281,500
大塚ホールディングス	436,600	9,445.00	4,123,687,000
ペプチドリーム	86,400	2,810.00	242,784,000
セルソース	11,800	1,164.00	13,735,200
あすか製薬ホールディングス	18,300	2,121.00	38,814,300
サワイグループホールディングス	102,900	2,028.50	208,732,650
日本コークス工業	180,800	93.00	16,814,400
ニチレキグループ	18,600	2,408.00	44,788,800
ユシロ化学工業	9,200	1,947.00	17,912,400
ビーピー・カストロール	1,800	881.00	1,585,800
富士石油	51,900	294.00	15,258,600
MORESCO	1,400	1,240.00	1,736,000
出光興産	817,400	1,015.50	830,069,700
ENEOSホールディングス	2,967,000	762.40	2,262,040,800
コスモエネルギーホールディングス	57,600	7,220.00	415,872,000
横浜ゴム	90,100	3,144.00	283,274,400
TOYO TIRE	102,400	2,146.00	219,750,400
ブリヂストン	512,000	5,449.00	2,789,888,000
住友ゴム工業	174,800	1,708.00	298,558,400

藤倉コンポジット	17,100	1,406.00	24,042,600	
オカモト	8,300	5,370.00	44,571,000	
フコク	9,400	1,826.00	17,164,400	
ニッタ	18,100	3,705.00	67,060,500	
住友理工	33,900	1,645.00	55,765,500	
三ツ星ベルト	24,300	4,145.00	100,723,500	
バンドー化学	26,400	1,760.00	46,464,000	
日東紡績	19,700	6,610.00	130,217,000	
A G C	170,200	4,725.00	804,195,000	
日本板硝子	85,000	349.00	29,665,000	
石塚硝子	700	2,433.00	1,703,100	
日本山村硝子	1,400	1,586.00	2,220,400	
日本電気硝子	66,100	3,362.00	222,228,200	
オハラ	8,500	1,296.00	11,016,000	
住友大阪セメント	29,700	3,540.00	105,138,000	
太平洋セメント	107,900	3,467.00	374,089,300	
日本ヒューム	15,600	1,234.00	19,250,400	
日本コンクリート工業	34,600	328.00	11,348,800	
三谷セキサン	7,500	6,480.00	48,600,000	
アジアパイルホールディングス	25,300	758.00	19,177,400	
東海カーボン	164,400	965.00	158,646,000	
日本カーボン	10,200	4,455.00	45,441,000	
東洋炭素	12,600	4,960.00	62,496,000	
ノリタケ	19,700	3,965.00	78,110,500	
T O T O	127,000	4,217.00	535,559,000	
日本碍子	203,500	2,036.50	414,427,750	
日本特殊陶業	142,900	4,850.00	693,065,000	
MARUWA	7,300	48,100.00	351,130,000	
品川リフラクトリーズ	21,900	1,641.00	35,937,900	
黒崎播磨	14,500	2,431.00	35,249,500	
ヨータイ	10,400	1,553.00	16,151,200	
東京窯業	4,100	417.00	1,709,700	
ニッカトー	1,700	495.00	841,500	
フジインコーポレーテッド	47,900	2,487.00	119,127,300	
クニミネ工業	1,100	1,008.00	1,108,800	
エーアンドエーマテリアル	800	1,172.00	937,600	

ニチアス	45,100	6,020.00	271,502,000
ニチハ	22,300	2,993.00	66,743,900
日本製鉄	911,200	3,170.00	2,888,504,000
神戸製鋼所	361,900	1,663.50	602,020,650
中山製鋼所	41,900	740.00	31,006,000
合同製鐵	10,300	3,930.00	40,479,000
J F E ホールディングス	542,200	1,802.00	977,044,400
東京製鐵	51,500	1,512.00	77,868,000
共英製鋼	20,900	1,705.00	35,634,500
大和工業	34,600	7,965.00	275,589,000
東京鐵鋼	8,100	6,400.00	51,840,000
大阪製鐵	8,400	3,125.00	26,250,000
淀川製鋼所	16,600	5,230.00	86,818,000
中部鋼板	12,000	2,234.00	26,808,000
丸一鋼管	55,800	3,220.00	179,676,000
モリ工業	4,600	4,980.00	22,908,000
大同特殊鋼	115,500	1,186.00	136,983,000
日本高周波鋼業	1,600	388.00	620,800
日本冶金工業	13,400	4,060.00	54,404,000
山陽特殊製鋼	18,100	1,880.00	34,028,000
愛知製鋼	10,600	4,825.00	51,145,000
日本金属	1,000	640.00	640,000
大平洋金属	15,600	1,353.00	21,106,800
新日本電工	109,500	291.00	31,864,500
栗本鐵工所	8,500	4,045.00	34,382,500
虹技	500	1,143.00	571,500
三菱製鋼	13,600	1,370.00	18,632,000
日垂鋼業	4,100	305.00	1,250,500
日本精線	14,600	1,281.00	18,702,600
エンビプロ・ホールディングス	18,100	495.00	8,959,500
シンニッタン	5,000	202.00	1,010,000
新家工業	900	4,260.00	3,834,000
大紀アルミニウム工業所	23,700	1,085.00	25,714,500
日本軽金属ホールディングス	53,900	1,515.00	81,658,500
三井金属鉱業	45,100	4,859.00	219,140,900
三菱マテリアル	131,300	2,457.00	322,604,100

住友金属鉱山	227,800	4,330.00	986,374,000
DOWAホールディングス	48,700	5,270.00	256,649,000
古河機械金属	24,500	1,668.00	40,866,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	32,000	1,989.00	63,648,000
東邦チタニウム	38,400	1,019.00	39,129,600
UACJ	25,800	5,120.00	132,096,000
CKサンエツ	4,600	3,600.00	16,560,000
古河電気工業	61,200	5,431.00	332,377,200
住友電気工業	621,700	2,702.50	1,680,144,250
フジクラ	193,100	5,908.00	1,140,834,800
SWCC	24,300	5,900.00	143,370,000
カナレ電気	1,000	1,444.00	1,444,000
平河ビューテック	12,100	1,592.00	19,263,200
リョービ	19,800	1,800.00	35,640,000
アーレスティ	4,900	558.00	2,734,200
AREホールディングス	73,200	1,871.00	136,957,200
稲葉製作所	10,200	1,799.00	18,349,800
宮地エンジニアリンググループ	18,400	1,930.00	35,512,000
トーカロ	52,900	1,929.00	102,044,100
アルファC o	1,400	1,068.00	1,495,200
SUMCO	342,600	1,408.50	482,552,100
川田テクノロジーズ	13,000	2,429.00	31,577,000
RS Technologies	14,000	3,870.00	54,180,000
ジェイテックコーポレーション	700	1,697.00	1,187,900
信和	2,500	751.00	1,877,500
東洋製罐グループホールディングス	114,700	2,200.00	252,340,000
ホッカンホールディングス	8,900	1,722.00	15,325,800
コロナ	10,200	955.00	9,741,000
横河ブリッジホールディングス	28,700	2,783.00	79,872,100
駒井ハルテック	700	1,597.00	1,117,900
高田機工	900	1,055.00	949,500
三和ホールディングス	179,200	4,496.00	805,683,200
文化シャッター	48,000	1,860.00	89,280,000
三協立山	23,100	740.00	17,094,000
アルインコ	14,000	965.00	13,510,000
東洋シャッター	900	792.00	712,800

L I X I L	262,400	1,727.50	453,296,000	
日本ファイルコン	2,600	541.00	1,406,600	
ノーリツ	25,800	1,785.00	46,053,000	
長府製作所	20,500	1,962.00	40,221,000	
リンナイ	95,700	3,328.00	318,489,600	
ダイニチ工業	2,000	610.00	1,220,000	
日東精工	26,600	600.00	15,960,000	
三洋工業	500	3,030.00	1,515,000	
岡部	32,700	793.00	25,931,100	
ジーテクト	23,400	1,505.00	35,217,000	
東プレ	32,300	1,712.00	55,297,600	
高周波熱錬	27,100	989.00	26,801,900	
東京製綱	11,900	1,160.00	13,804,000	
サンコール	20,400	357.00	7,282,800	
モリテック スチール	3,500	172.00	602,000	
パイオラックス	22,200	2,517.00	55,877,400	
エイチワン	18,900	903.00	17,066,700	
日本発條	162,200	1,897.00	307,693,400	
中央発條	13,600	1,257.00	17,095,200	
アドバネクス	500	840.00	420,000	
立川ブラインド工業	8,300	1,362.00	11,304,600	
日本ドライケミカル	900	3,495.00	3,145,500	
日本製鋼所	53,400	5,832.00	311,428,800	
三浦工業	81,700	3,635.00	296,979,500	
タクマ	60,700	1,669.00	101,308,300	
ツガミ	38,300	1,375.00	52,662,500	
オークマ	31,400	3,125.00	98,125,000	
芝浦機械	23,200	3,725.00	86,420,000	
アマダ	244,700	1,532.00	374,880,400	
アイダエンジニアリング	41,500	782.00	32,453,000	
F U J I	76,600	2,270.00	173,882,000	
牧野フライス製作所	19,900	6,820.00	135,718,000	
オーエスジー	79,100	1,794.50	141,944,950	
ダイジェット工業	400	721.00	288,400	
旭ダイヤモンド工業	41,400	829.00	34,320,600	
DMG森精機	113,200	2,696.00	305,187,200	

ソディック	47,400	711.00	33,701,400
ディスコ	84,800	44,700.00	3,790,560,000
日東工器	8,300	2,698.00	22,393,400
日進工具	16,700	746.00	12,458,200
パンチ工業	3,900	433.00	1,688,700
富士ダイス	13,300	785.00	10,440,500
豊和工業	2,100	1,164.00	2,444,400
リケンNPR	19,500	2,356.00	45,942,000
東洋機械金属	3,200	622.00	1,990,400
エンシュウ	1,000	619.00	619,000
島精機製作所	28,600	1,072.00	30,659,200
オプトラン	29,500	1,897.00	55,961,500
イワキポンプ	12,000	3,050.00	36,600,000
フリー	16,900	1,089.00	18,404,100
ヤマシンフィルタ	42,700	632.00	26,986,400
日阪製作所	19,600	956.00	18,737,600
やまびこ	29,300	2,479.00	72,634,700
野村マイクロ・サイエンス	29,100	2,020.00	58,782,000
平田機工	8,600	5,400.00	46,440,000
PEGASUS	19,800	443.00	8,771,400
マルマエ	7,800	1,671.00	13,033,800
タツモ	12,800	3,530.00	45,184,000
ナブテスコ	112,600	2,404.50	270,746,700
三井海洋開発	22,700	3,540.00	80,358,000
レオン自動機	20,800	1,454.00	30,243,200
SMC	52,700	66,830.00	3,521,941,000
ホソカワミクロン	12,500	3,750.00	46,875,000
ユニオンツール	7,900	5,820.00	45,978,000
瑞光	12,900	1,251.00	16,137,900
オイレス工業	24,300	2,180.00	52,974,000
日精エー・エス・ビー機械	6,100	4,730.00	28,853,000
サトーホールディングス	24,600	2,107.00	51,832,200
技研製作所	16,900	1,727.00	29,186,300
日本エアテック	8,400	1,222.00	10,264,800
カワタ	1,200	800.00	960,000
日精樹脂工業	13,400	923.00	12,368,200

オカダアイヨン	1,300	2,122.00	2,758,600	
ワイエイシイホールディングス	8,400	2,175.00	18,270,000	
小松製作所	889,200	4,204.00	3,738,196,800	
住友重機械工業	104,200	3,319.00	345,839,800	
日立建機	71,500	3,420.00	244,530,000	
日工	26,600	703.00	18,699,800	
巴工業	7,000	3,885.00	27,195,000	
井関農機	16,800	1,002.00	16,833,600	
TOWA	53,900	1,860.00	100,254,000	
丸山製作所	700	2,208.00	1,545,600	
北川鉄工所	7,100	1,239.00	8,796,900	
ローツェ	93,800	2,205.00	206,829,000	
タカキタ	1,300	397.00	516,100	
クボタ	920,900	1,946.00	1,792,071,400	
荏原実業	8,600	4,630.00	39,818,000	
三菱化工機	6,300	3,255.00	20,506,500	
月島ホールディングス	24,300	1,472.00	35,769,600	
帝国電機製作所	12,300	2,933.00	36,075,900	
新東工業	36,300	973.00	35,319,900	
澁谷工業	16,800	4,050.00	68,040,000	
アイチ コーポレーション	24,800	1,186.00	29,412,800	
小森コーポレーション	44,200	1,112.00	49,150,400	
鶴見製作所	13,700	4,005.00	54,868,500	
日本ギア工業	1,500	467.00	700,500	
酒井重工業	7,000	2,533.00	17,731,000	
荏原製作所	361,600	2,565.00	927,504,000	
西島製作所	15,500	2,888.00	44,764,000	
北越工業	18,100	1,716.00	31,059,600	
ダイキン工業	229,400	19,000.00	4,358,600,000	
オルガノ	27,200	8,980.00	244,256,000	
トーヨーカネツ	6,100	4,510.00	27,511,000	
栗田工業	98,500	6,563.00	646,455,500	
椿本チエイン	79,800	1,902.00	151,779,600	
大同工業	1,700	806.00	1,370,200	
木村化工機	13,700	950.00	13,015,000	
アネスト岩田	27,800	1,440.00	40,032,000	

ダイフク	297,300	3,300.00	981,090,000	
サムコ	4,300	3,190.00	13,717,000	
加藤製作所	2,000	1,266.00	2,532,000	
油研工業	700	2,466.00	1,726,200	
タダノ	103,300	1,077.00	111,254,100	
フジテック	56,600	5,610.00	317,526,000	
C K D	49,600	2,673.00	132,580,800	
平和	58,600	2,110.00	123,646,000	
理想科学工業	14,400	3,765.00	54,216,000	
SANKYO	203,500	2,118.00	431,013,000	
日本金銭機械	21,700	965.00	20,940,500	
マースグループホールディングス	11,900	3,170.00	37,723,000	
フクシマガリレイ	13,000	5,570.00	72,410,000	
オーイズミ	1,500	369.00	553,500	
ダイコク電機	8,800	3,335.00	29,348,000	
竹内製作所	32,600	5,030.00	163,978,000	
アマノ	50,900	4,377.00	222,789,300	
JUKI	27,900	395.00	11,020,500	
ジャノメ	18,200	961.00	17,490,200	
マックス	21,700	3,425.00	74,322,500	
グローリー	46,100	2,581.00	118,984,100	
新晃工業	18,100	4,445.00	80,454,500	
大和冷機工業	27,500	1,491.00	41,002,500	
セガサミーホールディングス	157,300	2,813.00	442,484,900	
T P R	22,800	2,352.00	53,625,600	
ツバキ・ナカシマ	44,300	632.00	27,997,600	
ホシザキ	113,400	5,079.00	575,958,600	
大豊工業	15,500	604.00	9,362,000	
日本精工	332,200	677.10	224,932,620	
NTN	416,800	244.00	101,699,200	
ジェイテクト	159,700	1,085.00	173,274,500	
不二越	13,300	3,275.00	43,557,500	
日本トムソン	48,900	487.00	23,814,300	
THK	103,500	2,625.50	271,739,250	
ユーシン精機	14,200	672.00	9,542,400	
前澤給装工業	12,900	1,293.00	16,679,700	

イーグル工業	19,800	1,990.00	39,402,000
前澤工業	2,400	1,208.00	2,899,200
P I L L A R	16,600	4,810.00	79,846,000
キット	60,100	1,124.00	67,552,400
マキタ	219,200	4,672.00	1,024,102,400
三井E&S	89,100	1,230.00	109,593,000
カナデビア	144,300	951.00	137,229,300
三菱重工業	3,080,400	2,326.00	7,165,010,400
I H I	141,200	9,175.00	1,295,510,000
スター精密	30,300	1,963.00	59,478,900
日清紡ホールディングス	134,900	914.50	123,366,050
イビデン	101,100	5,342.00	540,076,200
コニカミノルタ	401,300	686.90	275,652,970
ブラザー工業	235,400	2,791.00	657,001,400
ミネベアミツミ	306,500	2,591.00	794,141,500
日立製作所	4,535,900	4,095.00	18,574,510,500
三菱電機	1,791,700	2,721.50	4,876,111,550
富士電機	107,100	8,766.00	938,838,600
東洋電機製造	1,400	1,127.00	1,577,800
安川電機	191,300	4,367.00	835,407,100
シンフォニアテクノロジー	17,500	6,440.00	112,700,000
明電舎	29,700	4,200.00	124,740,000
オリジン	900	1,182.00	1,063,800
山洋電気	7,800	8,650.00	67,470,000
デンヨー	13,700	2,610.00	35,757,000
PHCホールディングス	33,800	984.00	33,259,200
KOKUSAI ELECTRIC	123,200	2,953.00	363,809,600
ソシオネクスト	175,600	2,560.00	449,536,000
東芝テック	26,300	3,640.00	95,732,000
芝浦メカトロニクス	12,800	10,310.00	131,968,000
マブチモーター	78,900	2,299.50	181,430,550
ニデック	777,900	2,910.00	2,263,689,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,900	373.00	4,438,700
トレックス・セミコンダクター	9,400	1,529.00	14,372,600
東光高岳	10,900	1,989.00	21,680,100
ダブル・スコープ	51,400	359.00	18,452,600

ダイヘン	17,000	7,240.00	123,080,000	
ヤーマン	35,200	800.00	28,160,000	
JVCケンウッド	141,800	1,476.50	209,367,700	
ミマキエンジニアリング	17,200	1,565.00	26,918,000	
I-P-E-X	10,100	2,399.00	24,229,900	
大崎電気工業	38,500	764.00	29,414,000	
オムロン	161,400	5,449.00	879,468,600	
日東工業	24,200	2,945.00	71,269,000	
I D E C	26,500	2,641.00	69,986,500	
正興電機製作所	1,400	1,264.00	1,769,600	
不二電機工業	900	1,108.00	997,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	78,700	2,715.00	213,670,500	
サクサ	900	2,439.00	2,195,100	
メルコホールディングス	5,700	2,307.00	13,149,900	
テクノメディカ	4,500	1,840.00	8,280,000	
日本電気	249,100	13,330.00	3,320,503,000	
富士通	1,620,900	2,846.50	4,613,891,850	
沖電気工業	81,100	976.00	79,153,600	
電気興業	7,200	1,831.00	13,183,200	
サンケン電気	18,000	5,728.00	103,104,000	
ナカヨ	600	1,131.00	678,600	
アイホン	9,700	2,858.00	27,722,600	
ルネサスエレクトロニクス	1,342,100	1,993.00	2,674,805,300	
セイコーエプソン	226,000	2,719.00	614,494,000	
ワコム	126,500	711.00	89,941,500	
アルバック	39,400	7,357.00	289,865,800	
アクセル	9,100	1,369.00	12,457,900	
E I Z O	22,900	2,256.00	51,662,400	
日本信号	40,900	917.00	37,505,300	
京三製作所	37,600	558.00	20,980,800	
能美防災	24,300	3,005.00	73,021,500	
ホーチキ	13,500	2,348.00	31,698,000	
星和電機	2,000	527.00	1,054,000	
エレコム	43,100	1,462.00	63,012,200	
パナソニック ホールディングス	2,081,000	1,424.50	2,964,384,500	
シャープ	254,500	872.80	222,127,600	

アンリツ	126,400	1,170.00	147,888,000	
富士通ゼネラル	50,900	1,938.00	98,644,200	
ソニーグループ	6,107,600	2,975.00	18,170,110,000	
TDK	1,521,500	2,028.00	3,085,602,000	
帝国通信工業	8,000	2,778.00	22,224,000	
タムラ製作所	71,500	523.00	37,394,500	
アルプスアルパイン	143,200	1,594.00	228,260,800	
池上通信機	1,200	641.00	769,200	
日本電波工業	21,700	971.00	21,070,700	
鈴木	9,700	1,861.00	18,051,700	
メイコー	17,900	8,290.00	148,391,000	
日本トリム	4,100	3,610.00	14,801,000	
フォスター電機	17,900	1,872.00	33,508,800	
SMK	4,800	2,359.00	11,323,200	
ヨコオ	16,000	1,533.00	24,528,000	
ホシデン	44,200	2,250.00	99,450,000	
ヒロセ電機	25,600	18,900.00	483,840,000	
日本航空電子工業	45,900	2,829.00	129,851,100	
TOA	20,400	913.00	18,625,200	
マクセル	35,800	1,771.00	63,401,800	
古野電気	23,500	2,675.00	62,862,500	
スミダコーポレーション	24,400	954.00	23,277,600	
アイコム	6,900	2,851.00	19,671,900	
リオン	7,500	2,445.00	18,337,500	
横河電機	192,700	3,616.00	696,803,200	
新電元工業	6,900	2,434.00	16,794,600	
アズビル	479,900	1,291.50	619,790,850	
東亜ディーケーケー	2,000	749.00	1,498,000	
日本光電工業	156,200	2,226.50	347,779,300	
チノー	7,400	2,185.00	16,169,000	
共和電業	3,900	420.00	1,638,000	
日本電子材料	10,900	2,214.00	24,132,600	
堀場製作所	33,700	9,524.00	320,958,800	
アドバンテスト	549,600	9,824.00	5,399,270,400	
小野測器	2,100	537.00	1,127,700	
エスベック	14,300	2,671.00	38,195,300	

キーエンス	174,500	67,680.00	11,810,160,000	
日置電機	9,300	8,150.00	75,795,000	
シスメックス	451,600	3,160.00	1,427,056,000	
日本マイクロニクス	29,300	3,675.00	107,677,500	
メガチップス	13,800	5,740.00	79,212,000	
OBARA GROUP	11,200	4,245.00	47,544,000	
澤藤電機	600	976.00	585,600	
原田工業	2,000	544.00	1,088,000	
コーセル	19,200	1,247.00	23,942,400	
イリソ電子工業	16,400	2,806.00	46,018,400	
オブテックスグループ	32,700	1,753.00	57,323,100	
千代田インテグレ	6,200	3,335.00	20,677,000	
レーザーテック	80,000	20,050.00	1,604,000,000	
スタンレー電気	109,300	2,599.00	284,070,700	
ウシオ電機	78,700	2,184.50	171,920,150	
岡谷電機産業	3,700	226.00	836,200	
ヘリオス テクノ ホールディング	4,100	955.00	3,915,500	
エノモト	1,200	1,533.00	1,839,600	
日本セラミック	16,400	2,656.00	43,558,400	
遠藤照明	1,800	1,351.00	2,431,800	
古河電池	13,200	1,375.00	18,150,000	
山一電機	16,100	2,594.00	41,763,400	
図研	14,900	3,720.00	55,428,000	
日本電子	40,400	5,890.00	237,956,000	
カシオ計算機	139,500	1,080.50	150,729,750	
ファナック	844,000	4,230.00	3,570,120,000	
日本シイエムケイ	42,300	432.00	18,273,600	
エンプラス	5,200	5,700.00	29,640,000	
大真空	26,900	539.00	14,499,100	
ローム	316,100	1,545.50	488,532,550	
浜松ホトニクス	280,000	1,765.00	494,200,000	
三井ハイテック	78,900	801.00	63,198,900	
新光電気工業	62,900	5,420.00	340,918,000	
京セラ	1,083,800	1,533.00	1,661,465,400	
太陽誘電	76,500	2,362.00	180,693,000	
村田製作所	1,558,000	2,691.50	4,193,357,000	

双葉電子工業	34,300	504.00	17,287,200	
北陸電気工業	1,600	1,558.00	2,492,800	
ニチコン	46,900	1,111.00	52,105,900	
日本ケミコン	19,100	1,144.00	21,850,400	
KOA	27,100	1,026.00	27,804,600	
市光工業	32,600	452.00	14,735,200	
小糸製作所	180,800	1,947.00	352,017,600	
ミツバ	33,300	823.00	27,405,900	
S C R E E Nホールディングス	72,900	9,922.00	723,313,800	
キャノン電子	16,900	2,490.00	42,081,000	
キャノン	869,900	5,044.00	4,387,775,600	
リコー	459,400	1,631.00	749,281,400	
象印マホービン	53,200	1,611.00	85,705,200	
M U T O Hホールディングス	600	2,377.00	1,426,200	
東京エレクトロン	369,100	23,260.00	8,585,266,000	
イノテック	12,000	1,389.00	16,668,000	
トヨタ紡織	74,800	1,983.50	148,365,800	
芦森工業	800	2,440.00	1,952,000	
ユニプレス	31,900	995.00	31,740,500	
豊田自動織機	148,800	10,980.00	1,633,824,000	
モリタホールディングス	27,500	2,110.00	58,025,000	
三櫻工業	27,200	708.00	19,257,600	
デンソー	1,850,000	2,325.00	4,301,250,000	
東海理化電機製作所	50,100	2,116.00	106,011,600	
川崎重工業	131,400	6,669.00	876,306,600	
名村造船所	49,800	1,830.00	91,134,000	
日本車輛製造	5,900	2,230.00	13,157,000	
三菱ロジスネクスト	28,400	1,263.00	35,869,200	
近畿車輛	500	1,425.00	712,500	
日産自動車	2,294,800	368.60	845,863,280	
いすゞ自動車	538,700	1,860.50	1,002,251,350	
トヨタ自動車	9,271,300	2,653.50	24,601,394,550	
日野自動車	267,200	371.80	99,344,960	
三菱自動車工業	693,100	457.00	316,746,700	
エフテック	2,700	511.00	1,379,700	
レシップホールディングス	1,800	529.00	952,200	

GMB	800	1,132.00	905,600
ファルテック	800	442.00	353,600
武蔵精密工業	43,400	2,316.00	100,514,400
日産車体	26,500	952.00	25,228,000
新明和工業	51,200	1,369.00	70,092,800
極東開発工業	23,600	2,497.00	58,929,200
トピー工業	14,400	1,845.00	26,568,000
ティラド	3,900	3,500.00	13,650,000
曙ブレーキ工業	108,400	114.00	12,357,600
タチエス	32,800	1,728.00	56,678,400
NOK	69,000	2,272.50	156,802,500
フタバ産業	47,700	642.00	30,623,400
カヤバ	14,800	4,715.00	69,782,000
大同メタル工業	34,800	478.00	16,634,400
プレス工業	71,000	546.00	38,766,000
ミクニ	4,900	334.00	1,636,600
太平洋工業	40,800	1,350.00	55,080,000
アイシン	369,400	1,608.00	593,995,200
マツダ	535,700	1,002.50	537,039,250
今仙電機製作所	2,500	519.00	1,297,500
本田技研工業	4,132,300	1,379.50	5,700,507,850
スズキ	1,409,400	1,642.50	2,314,939,500
S U B A R U	540,900	2,390.50	1,293,021,450
安永	1,700	524.00	890,800
ヤマハ発動機	736,300	1,389.00	1,022,720,700
T B K	4,300	276.00	1,186,800
エクセディ	29,100	3,995.00	116,254,500
豊田合成	50,900	2,569.50	130,787,550
愛三工業	29,500	1,410.00	41,595,000
盟和産業	600	1,210.00	726,000
日本プラスト	3,300	359.00	1,184,700
ヨロズ	16,700	1,170.00	19,539,000
エフ・シー・シー	31,400	2,870.00	90,118,000
シマノ	75,800	21,475.00	1,627,805,000
テイ・エス テック	71,000	1,692.50	120,167,500
ジャムコ	10,700	1,281.00	13,706,700

テルモ	1,166,700	3,160.00	3,686,772,000	
クリエートメディック	1,200	903.00	1,083,600	
日機装	46,000	1,037.00	47,702,000	
日本エム・ディ・エム	14,100	625.00	8,812,500	
島津製作所	251,000	4,648.00	1,166,648,000	
JMS	16,400	442.00	7,248,800	
長野計器	12,900	2,480.00	31,992,000	
ブイ・テクノロジー	9,400	2,433.00	22,870,200	
東京計器	13,600	3,635.00	49,436,000	
愛知時計電機	7,700	2,010.00	15,477,000	
インターアクション	10,700	1,040.00	11,128,000	
オーバル	3,400	379.00	1,288,600	
東京精密	36,400	8,433.00	306,961,200	
マニー	71,100	1,818.50	129,295,350	
ニコン	275,100	1,965.00	540,571,500	
トプコン	99,000	1,580.50	156,469,500	
オリンパス	998,500	2,550.00	2,546,175,000	
理研計器	25,200	4,015.00	101,178,000	
タムロン	24,500	4,335.00	106,207,500	
HOYA	343,300	20,885.00	7,169,820,500	
シード	2,300	499.00	1,147,700	
ノーリツ鋼機	16,800	3,935.00	66,108,000	
A&Dホロンホールディングス	21,800	2,144.00	46,739,200	
朝日インテック	212,600	2,485.00	528,311,000	
シチズン時計	163,500	913.00	149,275,500	
リズム	900	4,115.00	3,703,500	
大研医器	3,300	505.00	1,666,500	
メニコン	61,100	1,676.00	102,403,600	
シンシア	400	477.00	190,800	
松風	16,000	2,120.00	33,920,000	
セイコーグループ	27,000	3,840.00	103,680,000	
ニプロ	148,100	1,371.00	203,045,100	
三井松島ホールディングス	11,900	3,805.00	45,279,500	
KYORITSU	5,700	146.00	832,200	
中本パックス	1,300	1,670.00	2,171,000	
パラマウントベッドホールディングス	40,300	2,556.00	103,006,800	

トランザクション	11,700	2,281.00	26,687,700	
粧美堂	1,000	483.00	483,000	
ニホンフラッシュ	16,700	891.00	14,879,700	
前田工織	31,700	1,746.00	55,348,200	
永大産業	4,500	215.00	967,500	
アートネイチャー	16,000	865.00	13,840,000	
フルヤ金属	16,900	3,605.00	60,924,500	
バンダイナムコホールディングス	473,500	3,400.00	1,609,900,000	
アイフィスジャパン	1,100	567.00	623,700	
SHOEI	50,000	2,309.00	115,450,000	
フランスベッドホールディングス	23,000	1,237.00	28,451,000	
パイロットコーポレーション	27,800	5,031.00	139,861,800	
萩原工業	11,900	1,438.00	17,112,200	
フジシールインターナショナル	39,200	2,535.00	99,372,000	
タカラトミー	73,300	4,380.00	321,054,000	
広済堂ホールディングス	57,500	501.00	28,807,500	
エステールホールディングス	900	603.00	542,700	
タカノ	1,400	713.00	998,200	
プロネクサス	18,400	1,290.00	23,736,000	
ホクシン	2,900	102.00	295,800	
ウッドワン	1,400	800.00	1,120,000	
TOPPANホールディングス	228,600	4,732.00	1,081,735,200	
大日本印刷	361,600	2,757.00	996,931,200	
共同印刷	5,000	4,040.00	20,200,000	
NISSHA	30,400	1,802.00	54,780,800	
光村印刷	300	1,473.00	441,900	
TAKARA & COMPANY	10,500	2,703.00	28,381,500	
アシックス	643,900	2,718.50	1,750,442,150	
ツツミ	4,200	2,142.00	8,996,400	
ローランド	13,100	3,990.00	52,269,000	
小松ウオール工業	14,400	1,524.00	21,945,600	
ヤマハ	318,700	1,107.50	352,960,250	
河合楽器製作所	5,400	2,759.00	14,898,600	
クリナップ	17,400	707.00	12,301,800	
ピジョン	113,200	1,445.50	163,630,600	
キングジム	15,700	861.00	13,517,700	

リンテック	35,700	3,230.00	115,311,000
イトーキ	35,500	1,627.00	57,758,500
任天堂	1,101,100	8,250.00	9,084,075,000
三菱鉛筆	24,600	2,666.00	65,583,600
タカラスタンダード	36,300	1,633.00	59,277,900
コクヨ	88,800	2,766.50	245,665,200
ナカバヤシ	19,100	522.00	9,970,200
グローブライト	15,900	1,969.00	31,307,100
オカムラ	53,500	2,007.00	107,374,500
美津濃	17,700	7,470.00	132,219,000
グリムス	7,900	2,590.00	20,461,000
東京電力ホールディングス	1,467,300	604.10	886,395,930
中部電力	642,700	1,682.00	1,081,021,400
関西電力	734,700	2,458.00	1,805,892,600
中国電力	308,700	1,090.50	336,637,350
北陸電力	181,700	1,009.50	183,426,150
東北電力	459,200	1,303.00	598,337,600
四国電力	165,500	1,351.50	223,673,250
九州電力	402,000	1,650.00	663,300,000
北海道電力	182,500	964.10	175,948,250
沖縄電力	45,400	993.00	45,082,200
電源開発	131,300	2,689.50	353,131,350
エフオン	12,900	375.00	4,837,500
イーレックス	31,600	683.00	21,582,800
レノバ	47,400	890.00	42,186,000
東京瓦斯	339,500	3,730.00	1,266,335,000
大阪瓦斯	347,500	3,285.00	1,141,537,500
東邦瓦斯	68,600	3,780.00	259,308,000
北海道瓦斯	53,000	540.00	28,620,000
広島ガス	37,500	380.00	14,250,000
西部ガスホールディングス	18,500	1,793.00	33,170,500
静岡ガス	40,500	996.00	40,338,000
メタウォーター	21,300	1,792.00	38,169,600
SBSホールディングス	15,800	2,450.00	38,710,000
東武鉄道	183,700	2,639.00	484,784,300
相鉄ホールディングス	57,600	2,527.00	145,555,200

東急	489,000	2,011.50	983,623,500	
京浜急行電鉄	219,900	1,228.00	270,037,200	
小田急電鉄	288,400	1,631.50	470,524,600	
京王電鉄	92,200	4,140.00	381,708,000	
京成電鉄	101,200	4,317.00	436,880,400	
富士急行	21,900	2,494.00	54,618,600	
東日本旅客鉄道	961,800	3,011.00	2,895,979,800	
西日本旅客鉄道	445,600	2,719.00	1,211,586,400	
東海旅客鉄道	671,800	3,193.00	2,145,057,400	
西武ホールディングス	189,900	3,539.00	672,056,100	
鴻池運輸	30,300	2,575.00	78,022,500	
西日本鉄道	47,500	2,215.50	105,236,250	
ハマキョウレックス	60,800	1,250.00	76,000,000	
サカイ引越センター	19,700	2,426.00	47,792,200	
近鉄グループホールディングス	186,500	3,537.00	659,650,500	
阪急阪神ホールディングス	232,200	3,990.00	926,478,000	
南海電気鉄道	79,100	2,503.00	197,987,300	
京阪ホールディングス	97,800	3,367.00	329,292,600	
神戸電鉄	4,800	2,335.00	11,208,000	
名古屋鉄道	192,400	1,770.00	340,548,000	
山陽電気鉄道	13,400	2,034.00	27,255,600	
ヤマトホールディングス	215,600	1,616.50	348,517,400	
山九	42,800	5,295.00	226,626,000	
丸運	2,200	457.00	1,005,400	
丸全昭和運輸	11,000	6,030.00	66,330,000	
センコーグループホールディングス	102,400	1,461.00	149,606,400	
トナミホールディングス	3,900	5,800.00	22,620,000	
ニッコンホールディングス	99,000	1,919.00	189,981,000	
日本石油輸送	400	2,779.00	1,111,600	
福山通運	18,600	3,730.00	69,378,000	
セイノーホールディングス	85,700	2,362.50	202,466,250	
神奈川中央交通	5,000	3,485.00	17,425,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	54,000	1,060.00	57,240,000	
九州旅客鉄道	133,400	3,967.00	529,197,800	
SGホールディングス	292,400	1,492.00	436,260,800	
NIPPON EXPRESSホールディング	62,400	7,411.00	462,446,400	

ス				
日本郵船	360,800	4,873.00	1,758,178,400	
商船三井	331,100	5,288.00	1,750,856,800	
川崎汽船	396,400	2,160.00	856,224,000	
NSユニテッド海運	9,700	4,050.00	39,285,000	
飯野海運	65,500	1,122.00	73,491,000	
共栄タンカー	1,000	1,196.00	1,196,000	
乾汽船	21,200	1,424.00	30,188,800	
日本航空	399,100	2,431.00	970,212,100	
ANAホールディングス	473,800	2,851.50	1,351,040,700	
日新	11,900	4,280.00	50,932,000	
三菱倉庫	181,500	1,025.50	186,128,250	
三井倉庫ホールディングス	17,900	7,910.00	141,589,000	
住友倉庫	51,700	2,709.00	140,055,300	
澁澤倉庫	8,100	3,145.00	25,474,500	
東陽倉庫	1,000	1,452.00	1,452,000	
日本トランスシティ	35,700	959.00	34,236,300	
ケイヒン	700	1,959.00	1,371,300	
中央倉庫	9,500	1,568.00	14,896,000	
川西倉庫	700	1,052.00	736,400	
安田倉庫	12,100	1,629.00	19,710,900	
ファイズホールディングス	600	915.00	549,000	
東洋埠頭	1,100	1,240.00	1,364,000	
上組	81,900	3,107.00	254,463,300	
サンリツ	900	780.00	702,000	
キムラユニティー	1,800	1,448.00	2,606,400	
キューソー流通システム	11,800	1,999.00	23,588,200	
東海運	2,200	316.00	695,200	
エーアイテイー	11,100	1,762.00	19,558,200	
内外トランスライン	7,100	2,816.00	19,993,600	
日本コンセプト	6,500	1,799.00	11,693,500	
NEC ネットエスアイ	69,500	3,310.00	230,045,000	
クロスキャット	11,300	1,136.00	12,836,800	
システナ	250,000	351.00	87,750,000	
デジタルアーツ	11,300	6,020.00	68,026,000	
日鉄ソリューションズ	60,800	4,251.00	258,460,800	

キューブシステム	9,400	1,009.00	9,484,600	
コア	7,900	1,874.00	14,804,600	
手間いらず	3,000	3,280.00	9,840,000	
ラクーンホールディングス	13,300	716.00	9,522,800	
ソリトンシステムズ	9,200	1,279.00	11,766,800	
ソフトクリエイトホールディングス	14,700	2,106.00	30,958,200	
T I S	184,900	3,891.00	719,445,900	
テクミラホールディングス	1,800	324.00	583,200	
グリー	59,700	408.00	24,357,600	
GMOペパボ	2,200	1,463.00	3,218,600	
コーエーテクモホールディングス	131,500	1,632.00	214,608,000	
三菱総合研究所	8,700	4,310.00	37,497,000	
電算	500	1,423.00	711,500	
A G S	1,600	819.00	1,310,400	
ファインデックス	14,200	849.00	12,055,800	
ブレインパッド	14,800	815.00	12,062,000	
K L a b	43,300	185.00	8,010,500	
ポルトゥウィンホールディングス	30,400	447.00	13,588,800	
ネクソン	384,300	2,565.50	985,921,650	
アイスタイル	59,600	457.00	27,237,200	
エムアップホールディングス	21,800	1,371.00	29,887,800	
エイチーム	11,900	630.00	7,497,000	
セルシス	24,900	1,328.00	33,067,200	
エニグモ	22,700	300.00	6,810,000	
テクノスジャパン	3,400	723.00	2,458,200	
コロプラ	60,500	469.00	28,374,500	
ブロードリーフ	71,600	572.00	40,955,200	
クロス・マーケティンググループ	1,800	691.00	1,243,800	
デジタルハーツホールディングス	11,100	810.00	8,991,000	
メディアドゥ	8,100	1,318.00	10,675,800	
じげん	52,000	526.00	27,352,000	
ブイキューブ	24,600	265.00	6,519,000	
エンカレッジ・テクノロジ	900	570.00	513,000	
サイバーリンクス	1,500	759.00	1,138,500	
フィクスターズ	17,900	1,486.00	26,599,400	
CARTA HOLDINGS	10,100	1,455.00	14,695,500	

オブティム	18,400	614.00	11,297,600
セレス	8,000	2,200.00	17,600,000
S H I F T	11,800	16,535.00	195,113,000
ティーガイア	14,600	2,668.00	38,952,800
セック	2,700	4,290.00	11,583,000
テクマトリックス	37,700	2,520.00	95,004,000
プロシップ	8,600	1,464.00	12,590,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,200	3,332.00	147,274,400
GMOペイメントゲートウェイ	39,900	8,850.00	353,115,000
ザッパラス	900	369.00	332,100
システムリサーチ	12,200	1,495.00	18,239,000
インターネットイニシアティブ	95,600	3,065.00	293,014,000
さくらインターネット	27,300	5,450.00	148,785,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,400	2,980.00	16,092,000
S R Aホールディングス	9,100	4,290.00	39,039,000
システムインテグレータ	1,200	320.00	384,000
朝日ネット	19,200	642.00	12,326,400
e B A S E	25,100	683.00	17,143,300
アバントグループ	22,500	1,963.00	44,167,500
アドソル日進	7,500	1,964.00	14,730,000
ODKソリューションズ	800	561.00	448,800
フリービット	7,800	1,360.00	10,608,000
コムチュア	25,700	2,217.00	56,976,900
アステリア	14,000	508.00	7,112,000
アイル	10,000	3,140.00	31,400,000
マークライNZ	10,500	2,651.00	27,835,500
メディカル・データ・ビジョン	21,300	503.00	10,713,900
g u m i	29,000	327.00	9,483,000
ショーケース	900	334.00	300,600
モバイルファクトリー	800	975.00	780,000
テラスカイ	7,700	1,893.00	14,576,100
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,300	2,037.00	18,944,100
P C Iホールディングス	100	973.00	97,300
アイビーシー	600	508.00	304,800
ネオジャパン	5,900	1,864.00	10,997,600
P R T I M E S	3,600	1,593.00	5,734,800

ラクス	84,300	2,078.00	175,175,400
ランドコンピュータ	1,900	739.00	1,404,100
ダブルスタンダード	5,400	1,637.00	8,839,800
オープンドア	10,400	633.00	6,583,200
アカツキ	8,700	2,215.00	19,270,500
ベネフィットジャパン	200	1,094.00	218,800
Ubicomホールディングス	5,700	1,228.00	6,999,600
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	119.00	511,700
チェンジホールディングス	39,300	1,311.00	51,522,300
シンクロ・フード	2,500	477.00	1,192,500
オークネット	8,200	2,324.00	19,056,800
キャピタル・アセット・プランニング	800	744.00	595,200
セグエグループ	3,500	595.00	2,082,500
エイトレッド	600	1,576.00	945,600
マクロミル	35,000	826.00	28,910,000
ビーグリー	700	1,358.00	950,600
オロ	7,500	2,456.00	18,420,000
ユーザーローカル	7,500	1,904.00	14,280,000
テモナ	900	197.00	177,300
ニーズウェル	4,200	296.00	1,243,200
PKSHA Technology	14,100	3,785.00	53,368,500
マネーフォワード	43,600	5,009.00	218,392,400
サインポスト	1,500	485.00	727,500
Sun Asterisk	12,700	548.00	6,959,600
プラスアルファ・コンサルティング	22,500	1,733.00	38,992,500
電算システムホールディングス	7,900	2,555.00	20,184,500
Appier Group	54,300	1,700.00	92,310,000
ビジョナル	21,100	8,261.00	174,307,100
ソルクシーズ	3,100	295.00	914,500
フェイス	1,100	382.00	420,200
ハイマックス	5,600	1,385.00	7,756,000
野村総合研究所	379,100	4,694.00	1,779,495,400
CEホールディングス	1,800	520.00	936,000
日本システム技術	16,500	1,852.00	30,558,000
インテージホールディングス	20,200	1,590.00	32,118,000

東邦システムサイエンス	8,300	1,462.00	12,134,600	
ソースネクスト	81,600	240.00	19,584,000	
シンプレクス・ホールディングス	34,300	2,593.00	88,939,900	
HEROZ	7,000	1,089.00	7,623,000	
ラクスル	43,100	1,265.00	54,521,500	
メルカリ	87,000	1,848.00	160,776,000	
I P S	5,100	2,767.00	14,111,700	
F I G	4,500	313.00	1,408,500	
システムサポート	6,900	1,786.00	12,323,400	
イーソル	12,000	720.00	8,640,000	
東海ソフト	600	1,235.00	741,000	
ウイングアーク 1 s t	18,500	3,385.00	62,622,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	6,000	831.00	4,986,000	
サーバーワークス	3,700	2,490.00	9,213,000	
東名	800	2,344.00	1,875,200	
ヴィッツ	400	799.00	319,600	
トビラシステムズ	1,100	748.00	822,800	
S a n s a n	58,600	2,278.00	133,490,800	
L i n k-Uグループ	800	474.00	379,200	
ギフトィ	15,700	938.00	14,726,600	
メドレー	19,600	3,720.00	72,912,000	
ベース	8,700	3,035.00	26,404,500	
J M D C	21,300	4,481.00	95,445,300	
フォーカスシステムズ	11,900	1,097.00	13,054,300	
クレスコ	29,200	1,190.00	34,748,000	
フジ・メディア・ホールディングス	171,200	1,648.50	282,223,200	
オービック	324,800	5,283.00	1,715,918,400	
ジャストシステム	25,600	3,335.00	85,376,000	
T D C ソフト	33,400	1,254.00	41,883,600	
L I N E ヤフー	2,797,800	405.00	1,133,109,000	
トレンドマイクロ	91,900	8,250.00	758,175,000	
I Dホールディングス	12,000	1,560.00	18,720,000	
日本オラクル	33,500	15,785.00	528,797,500	
アルファシステムズ	4,700	3,415.00	16,050,500	
フューチャー	44,300	2,096.00	92,852,800	

CAC Holdings	10,900	1,771.00	19,303,900	
トーセ	1,100	626.00	688,600	
オービックビジネスコンサルタント	29,500	7,205.00	212,547,500	
アイティフォー	22,800	1,374.00	31,327,200	
東計電算	5,000	4,725.00	23,625,000	
エクスネット	500	1,403.00	701,500	
大塚商会	198,300	3,643.00	722,406,900	
サイボウズ	24,500	2,193.00	53,728,500	
電通総研	17,300	5,410.00	93,593,000	
ACCESS	18,500	1,270.00	23,495,000	
デジタルガレージ	28,500	3,420.00	97,470,000	
EMシステムズ	29,700	549.00	16,305,300	
ウェザーニューズ	5,500	6,240.00	34,320,000	
C I J	44,400	429.00	19,047,600	
ビジネスエンジニアリング	4,200	4,065.00	17,073,000	
日本エンタープライズ	4,100	108.00	442,800	
WOWOW	13,400	993.00	13,306,200	
スカラ	16,500	460.00	7,590,000	
インテリジェント ウェイブ	2,000	985.00	1,970,000	
ANYCOLOR	25,400	2,250.00	57,150,000	
IMAGICA GROUP	17,900	477.00	8,538,300	
ネットワンシステムズ	73,300	4,540.00	332,782,000	
システムソフト	62,200	60.00	3,732,000	
アルゴグラフィックス	16,300	4,910.00	80,033,000	
マーベラス	29,000	553.00	16,037,000	
エイベックス	30,300	1,437.00	43,541,100	
B I P R O G Y	59,100	4,628.00	273,514,800	
都築電気	9,400	2,435.00	22,889,000	
TBSホールディングス	89,600	3,844.00	344,422,400	
日本テレビホールディングス	154,900	2,278.50	352,939,650	
朝日放送グループホールディングス	16,700	616.00	10,287,200	
テレビ朝日ホールディングス	43,300	2,007.00	86,903,100	
スカパーJ S A Tホールディングス	138,400	852.00	117,916,800	
テレビ東京ホールディングス	10,800	3,025.00	32,670,000	
日本BS放送	1,400	873.00	1,222,200	
ビジョン	26,700	1,007.00	26,886,900	

スマートバリュー	1,100	291.00	320,100	
U-NEXT HOLDINGS	20,000	4,875.00	97,500,000	
ワイヤレスゲート	1,900	242.00	459,800	
日本通信	175,500	146.00	25,623,000	
クロップス	500	987.00	493,500	
日本電信電話	52,030,100	151.20	7,866,951,120	
KDDI	1,286,600	4,898.00	6,301,766,800	
ソフトバンク	27,986,600	190.60	5,334,245,960	
光通信	20,200	31,870.00	643,774,000	
エムティーアイ	12,200	1,066.00	13,005,200	
GMOインターネットグループ	58,000	2,683.50	155,643,000	
ファイバーゲート	9,600	1,023.00	9,820,800	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,100	211.00	232,100	
KADOKAWA	94,200	3,000.00	282,600,000	
学研ホールディングス	32,600	988.00	32,208,800	
ゼンリン	30,500	821.00	25,040,500	
昭文社ホールディングス	1,700	396.00	673,200	
インプレスホールディングス	3,900	138.00	538,200	
アイネット	10,800	1,653.00	17,852,400	
松竹	10,000	11,070.00	110,700,000	
東宝	109,500	6,103.00	668,278,500	
東映	29,400	5,160.00	151,704,000	
NTTデータグループ	457,400	2,667.00	1,219,885,800	
ピー・シー・エー	10,200	1,958.00	19,971,600	
ビジネスブレイン太田昭和	7,000	1,920.00	13,440,000	
DTS	31,700	4,030.00	127,751,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	87,900	5,542.00	487,141,800	
シーイーシー	22,500	1,956.00	44,010,000	
カプコン	347,600	3,307.00	1,149,513,200	
アイ・エス・ビー	8,400	1,369.00	11,499,600	
SCSK	142,800	3,031.00	432,826,800	
NSW	7,900	2,915.00	23,028,500	
アイネス	13,900	1,686.00	23,435,400	
TKC	31,800	3,915.00	124,497,000	
富士ソフト	48,400	9,044.00	437,729,600	
NSD	67,300	3,450.00	232,185,000	

コナミグループ	65,500	14,880.00	974,640,000	
福井コンピュータホールディングス	11,000	2,795.00	30,745,000	
J B C Cホールディングス	11,800	4,590.00	54,162,000	
ミロク情報サービス	16,200	1,890.00	30,618,000	
ソフトバンクグループ	862,900	9,513.00	8,208,767,700	
リョーサン菱洋ホールディングス	31,200	2,353.00	73,413,600	
高千穂交易	7,400	3,920.00	29,008,000	
オルパヘルスケアホールディングス	700	2,011.00	1,407,700	
伊藤忠食品	4,200	6,740.00	28,308,000	
エレマテック	16,900	2,396.00	40,492,400	
あらた	28,800	3,470.00	99,936,000	
トーメンデバイス	2,700	6,710.00	18,117,000	
東京エレクトロン デバイス	18,700	3,155.00	58,998,500	
円谷フィールズホールディングス	30,400	1,920.00	58,368,000	
双日	205,400	3,159.00	648,858,600	
アルフレッサ ホールディングス	172,000	2,194.50	377,454,000	
横浜冷凍	47,300	870.00	41,151,000	
ラサ商事	9,600	1,408.00	13,516,800	
アルコニックス	24,800	1,440.00	35,712,000	
神戸物産	142,800	3,675.00	524,790,000	
ハイパー	900	321.00	288,900	
あい ホールディングス	31,100	2,329.00	72,431,900	
ディーブイエックス	1,100	911.00	1,002,100	
ダイワボウホールディングス	83,200	3,157.00	262,662,400	
マクニカホールディングス	142,900	1,805.00	257,934,500	
ラクト・ジャパン	8,000	2,784.00	22,272,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,500	1,133.00	32,290,500	
八洲電機	15,200	1,632.00	24,806,400	
メディアスホールディングス	10,900	820.00	8,938,000	
レスター	16,000	2,604.00	41,664,000	
ジオリーヴグループ	900	1,055.00	949,500	
大光	2,100	627.00	1,316,700	
O C H Iホールディングス	900	1,290.00	1,161,000	
T O K A Iホールディングス	102,100	913.00	93,217,300	
黒谷	1,100	545.00	599,500	
C o m i n i x	800	846.00	676,800	

三洋貿易	19,300	1,458.00	28,139,400
ビューティガレージ	5,900	1,492.00	8,802,800
ウイン・パートナーズ	12,200	1,273.00	15,530,600
ミタチ産業	1,100	1,140.00	1,254,000
シップヘルスケアホールディングス	72,900	2,152.00	156,880,800
明治電機工業	7,000	1,410.00	9,870,000
デリカフーズホールディングス	1,800	505.00	909,000
スターティアホールディングス	1,100	2,220.00	2,442,000
コメダホールディングス	46,100	2,913.00	134,289,300
ピーバンドットコム	500	352.00	176,000
アセンテック	7,200	611.00	4,399,200
富士興産	1,100	1,420.00	1,562,000
協栄産業	400	2,231.00	892,400
フルサト・マルカホールディングス	15,100	2,246.00	33,914,600
ヤマエグループホールディングス	16,600	2,137.00	35,474,200
小野建	18,900	1,444.00	27,291,600
南陽	1,700	1,112.00	1,890,400
佐鳥電機	13,100	1,914.00	25,073,400
エコートレーディング	800	912.00	729,600
伯東	10,800	4,540.00	49,032,000
コンドーテック	14,500	1,352.00	19,604,000
中山福	2,200	362.00	796,400
ナガイレーベン	23,700	2,265.00	53,680,500
三菱食品	17,400	4,785.00	83,259,000
松田産業	14,300	3,180.00	45,474,000
第一興商	72,700	1,866.00	135,658,200
メディパルホールディングス	200,200	2,467.50	493,993,500
S P K	8,300	2,021.00	16,774,300
萩原電気ホールディングス	8,100	3,225.00	26,122,500
アズワン	58,300	2,881.00	167,962,300
スズデン	6,600	1,788.00	11,800,800
尾家産業	1,000	2,013.00	2,013,000
シモジマ	12,600	1,302.00	16,405,200
ドウシシャ	17,400	2,068.00	35,983,200
小津産業	900	1,648.00	1,483,200
高速	11,200	2,514.00	28,156,800

たけびし	7,200	2,072.00	14,918,400	
リックス	4,700	2,662.00	12,511,400	
丸文	16,800	1,078.00	18,110,400	
ハビネット	14,100	4,090.00	57,669,000	
橋本総業ホールディングス	7,400	1,179.00	8,724,600	
日本ライフライン	50,300	1,311.00	65,943,300	
タカショー	16,400	484.00	7,937,600	
I DOM	62,700	1,032.00	64,706,400	
進和	11,500	2,746.00	31,579,000	
エスケイジャパン	1,000	663.00	663,000	
ダイترون	8,200	2,790.00	22,878,000	
シークス	26,800	1,140.00	30,552,000	
田中商事	1,200	680.00	816,000	
オーハシテクニカ	9,900	1,710.00	16,929,000	
白銅	5,300	2,436.00	12,910,800	
ダイコー通産	400	1,238.00	495,200	
伊藤忠商事	1,240,400	7,923.00	9,827,689,200	
丸紅	1,530,700	2,468.50	3,778,532,950	
高島	2,700	1,180.00	3,186,000	
長瀬産業	84,000	3,309.00	277,956,000	
蝶理	9,900	3,865.00	38,263,500	
豊田通商	554,200	2,721.50	1,508,255,300	
三共生興	26,100	590.00	15,399,000	
兼松	78,600	2,622.50	206,128,500	
ツカモトコーポレーション	600	1,093.00	655,800	
三井物産	2,764,200	3,223.00	8,909,016,600	
日本紙パルプ商事	90,000	647.00	58,230,000	
カメイ	20,000	1,907.00	38,140,000	
東都水産	300	5,580.00	1,674,000	
OUGホールディングス	600	2,524.00	1,514,400	
スターゼン	13,000	2,919.00	37,947,000	
山善	62,200	1,307.00	81,295,400	
椿本興業	11,700	1,925.00	22,522,500	
住友商事	1,105,800	3,290.00	3,638,082,000	
内田洋行	7,600	6,540.00	49,704,000	
三菱商事	3,543,200	2,721.50	9,642,818,800	

第一実業	17,700	2,718.00	48,108,600
キヤノンマーケティングジャパン	36,200	4,722.00	170,936,400
西華産業	7,400	4,055.00	30,007,000
佐藤商事	13,000	1,405.00	18,265,000
東京産業	17,200	706.00	12,143,200
ユアサ商事	14,700	4,710.00	69,237,000
神鋼商事	4,700	6,110.00	28,717,000
トルク	2,900	221.00	640,900
阪和興業	30,400	4,945.00	150,328,000
正栄食品工業	12,500	4,450.00	55,625,000
カナデン	14,100	1,450.00	20,445,000
RYODEN	15,200	2,343.00	35,613,600
岩谷産業	183,300	1,987.00	364,217,100
ナイス	1,300	1,646.00	2,139,800
ニチモウ	1,300	1,850.00	2,405,000
極東貿易	11,200	1,575.00	17,640,000
アステナホールディングス	35,400	511.00	18,089,400
三愛オブリ	43,900	1,918.00	84,200,200
稲畑産業	50,000	3,465.00	173,250,000
G S I クレオス	10,100	2,098.00	21,189,800
明和産業	22,200	641.00	14,230,200
クワザワホールディングス	1,500	590.00	885,000
ワキタ	31,100	1,553.00	48,298,300
東邦ホールディングス	50,800	4,366.00	221,792,800
サンゲツ	46,300	2,817.00	130,427,100
ミツウロコグループホールディングス	24,000	1,711.00	41,064,000
シナネンホールディングス	5,200	6,380.00	33,176,000
伊藤忠エネクス	46,600	1,633.00	76,097,800
サンリオ	149,900	4,726.00	708,427,400
サンワテクノス	9,600	2,184.00	20,966,400
新光商事	25,300	975.00	24,667,500
トーヨー	7,300	2,724.00	19,885,200
三信電気	7,600	1,971.00	14,979,600
東陽テクニカ	17,300	1,566.00	27,091,800
モスフードサービス	27,700	3,610.00	99,997,000
加賀電子	37,400	2,745.00	102,663,000

ソーダニッカ	19,900	1,144.00	22,765,600	
立花エレテック	12,500	2,515.00	31,437,500	
フォーバル	7,400	1,399.00	10,352,600	
PALTAC	28,800	4,256.00	122,572,800	
三谷産業	32,900	322.00	10,593,800	
西本Wismettacホールディングス	11,500	1,353.00	15,559,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	2,158.00	647,400	
コア商事ホールディングス	13,900	607.00	8,437,300	
KPPグループホールディングス	38,200	649.00	24,791,800	
ヤマタネ	8,300	3,120.00	25,896,000	
丸紅建材リース	300	2,933.00	879,900	
泉州電業	13,000	5,540.00	72,020,000	
トラスコ中山	39,500	2,272.00	89,744,000	
オートバックスセブン	65,400	1,410.00	92,214,000	
モリト	15,000	1,446.00	21,690,000	
加藤産業	23,300	4,145.00	96,578,500	
北恵	1,000	940.00	940,000	
イエローハット	29,900	2,460.00	73,554,000	
JKホールディングス	14,500	1,017.00	14,746,500	
日伝	12,300	2,985.00	36,715,500	
北沢産業	2,500	362.00	905,000	
杉本商事	18,200	1,336.00	24,315,200	
因幡電機産業	51,500	3,867.00	199,150,500	
東テック	18,800	2,866.00	53,880,800	
ミスミグループ本社	278,800	2,501.50	697,418,200	
アルテック	2,200	213.00	468,600	
タキヒヨー	900	1,270.00	1,143,000	
蔵王産業	700	2,461.00	1,722,700	
スズケン	60,800	4,877.00	296,521,600	
ジェコス	11,200	986.00	11,043,200	
サンエー	31,400	2,823.00	88,642,200	
カワチ薬品	14,800	2,456.00	36,348,800	
エービーシー・マート	82,400	3,017.00	248,600,800	
ハードオフコーポレーション	8,500	1,870.00	15,895,000	
アスクル	45,600	1,917.00	87,415,200	
ゲオホールディングス	21,300	1,438.00	30,629,400	

アダストリア	25,600	3,540.00	90,624,000
くら寿司	22,100	3,960.00	87,516,000
キャンドウ	6,800	3,270.00	22,236,000
I Kホールディングス	2,200	372.00	818,400
パルグループホールディングス	42,400	3,030.00	128,472,000
エディオン	80,600	1,783.00	143,709,800
サーラコーポレーション	39,900	837.00	33,396,300
ワッツ	2,200	684.00	1,504,800
ハローズ	8,600	4,175.00	35,905,000
あみやき亭	13,800	1,657.00	22,866,600
大黒天物産	5,800	10,700.00	62,060,000
ハニーズホールディングス	16,900	1,620.00	27,378,000
ファーマライズホールディングス	1,500	619.00	928,500
アルペン	15,700	2,027.00	31,823,900
ハブ	1,700	738.00	1,254,600
クオールホールディングス	26,100	1,379.00	35,991,900
ジーンズホールディングス	14,400	6,450.00	92,880,000
ビックカメラ	112,700	1,664.50	187,589,150
DCMホールディングス	97,600	1,398.00	136,444,800
MonotaRO	261,700	2,805.00	734,068,500
東京一番フーズ	1,800	496.00	892,800
きちりホールディングス	1,100	901.00	991,100
J. フロント リテイリング	216,000	1,702.00	367,632,000
ドトール・日レスホールディングス	33,500	2,237.00	74,939,500
マツキョココカラ&カンパニー	325,500	2,113.50	687,944,250
ブロンコビリー	11,100	3,765.00	41,791,500
ZOZO	137,200	5,200.00	713,440,000
トレジャー・ファクトリー	13,200	1,313.00	17,331,600
物語コーポレーション	31,500	3,450.00	108,675,000
三越伊勢丹ホールディングス	280,200	2,277.00	638,015,400
Hamee	7,900	1,086.00	8,579,400
マーケットエンタープライズ	700	990.00	693,000
ウエルシアホールディングス	97,700	1,903.00	185,923,100
クリエイトSDホールディングス	26,800	2,959.00	79,301,200
丸善CHIホールディングス	5,800	318.00	1,844,400
ミサワ	1,400	687.00	961,800

ティーライフ	800	1,199.00	959,200	
チムニー	1,200	1,233.00	1,479,600	
シュッピン	17,300	969.00	16,763,700	
オイシックス・ラ・大地	25,500	1,250.00	31,875,000	
ネクステージ	43,200	1,561.00	67,435,200	
ジョイフル本田	52,300	2,000.00	104,600,000	
エターナルホスピタリティグループ	7,100	3,475.00	24,672,500	
ホットランド	14,600	2,380.00	34,748,000	
すかいらくホールディングス	252,400	2,374.50	599,323,800	
SFPホールディングス	9,100	1,961.00	17,845,100	
綿半ホールディングス	14,800	1,625.00	24,050,000	
ヨシックスホールディングス	4,900	3,250.00	15,925,000	
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	817.00	43,219,300	
B E E N O S	11,300	2,711.00	30,634,300	
あさひ	17,700	1,487.00	26,319,900	
日本調剤	12,700	1,346.00	17,094,200	
コスモス薬品	31,900	7,149.00	228,053,100	
トーエル	2,200	777.00	1,709,400	
セブン&アイ・ホールディングス	2,038,400	2,211.00	4,506,902,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	138,800	1,185.00	164,478,000	
ツルハホールディングス	39,500	8,500.00	335,750,000	
サンマルクホールディングス	15,300	2,311.00	35,358,300	
フェリシモ	1,300	845.00	1,098,500	
トリドールホールディングス	52,800	4,018.00	212,150,400	
TOKYO BASE	21,600	273.00	5,896,800	
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,067.00	1,173,700	
JMホールディングス	14,300	2,812.00	40,211,600	
サツドラホールディングス	2,000	790.00	1,580,000	
アレンザホールディングス	14,400	1,074.00	15,465,600	
串カツ田中ホールディングス	5,900	1,583.00	9,339,700	
バロックジャパンリミテッド	15,100	782.00	11,808,200	
クスリのアオキホールディングス	63,000	3,280.00	206,640,000	
力の源ホールディングス	12,100	1,083.00	13,104,300	
FOOD & LIFE COMPANIES	100,400	3,138.00	315,055,200	
メディカルシステムネットワーク	21,200	407.00	8,628,400	

はるやまホールディングス	2,500	522.00	1,305,000	
ノジマ	60,400	2,330.00	140,732,000	
カップ・クリエイト	29,500	1,566.00	46,197,000	
良品計画	219,900	2,710.00	595,929,000	
パリミキホールディングス	5,900	331.00	1,952,900	
アドヴァングループ	16,500	969.00	15,988,500	
アルビス	6,300	2,672.00	16,833,600	
コナカ	4,800	220.00	1,056,000	
ハウス オブ ローゼ	700	1,459.00	1,021,300	
G-7ホールディングス	20,700	1,456.00	30,139,200	
イオン北海道	45,500	876.00	39,858,000	
コジマ	36,600	1,035.00	37,881,000	
ヒマラヤ	1,800	858.00	1,544,400	
コーナン商事	20,500	3,580.00	73,390,000	
エコス	7,100	2,054.00	14,583,400	
ワタミ	19,900	1,126.00	22,407,400	
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	372,800	3,718.00	1,386,070,400	
西松屋チェーン	41,000	2,228.00	91,348,000	
ゼンショーホールディングス	104,900	7,948.00	833,745,200	
幸楽苑	13,900	1,284.00	17,847,600	
ハークスレイ	1,700	718.00	1,220,600	
サイゼリヤ	27,900	5,600.00	156,240,000	
V Tホールディングス	74,100	452.00	33,493,200	
魚力	6,700	2,411.00	16,153,700	
フジ・コーポレーション	9,100	1,904.00	17,326,400	
ユナイテッドアローズ	22,200	2,383.00	52,902,600	
ハイデイ日高	28,000	2,752.00	77,056,000	
京都きもの友禅ホールディングス	4,900	69.00	338,100	
コロワイド	104,100	1,700.00	176,970,000	
壺番屋	74,600	1,028.00	76,688,800	
P L A N T	1,100	1,515.00	1,666,500	
スギホールディングス	99,300	2,608.50	259,024,050	
薬王堂ホールディングス	9,300	2,100.00	19,530,000	
スクロール	28,400	1,027.00	29,166,800	
ヨンドシーホールディングス	18,000	1,828.00	32,904,000	

木曾路	28,600	2,172.00	62,119,200
S R S ホールディングス	31,300	1,150.00	35,995,000
千趣会	38,000	312.00	11,856,000
リテールパートナーズ	28,200	1,236.00	34,855,200
上新電機	18,700	2,410.00	45,067,000
日本瓦斯	88,500	2,056.00	181,956,000
ロイヤルホールディングス	33,100	2,510.00	83,081,000
いなげや	18,300	1,149.00	21,026,700
チョダ	18,400	1,380.00	25,392,000
ライフコーポレーション	19,700	3,345.00	65,896,500
リンガーハット	24,200	2,286.00	55,321,200
Mr M a x HD	24,200	660.00	15,972,000
A O K I ホールディングス	40,600	1,168.00	47,420,800
オークワ	27,100	900.00	24,390,000
コメリ	24,900	3,255.00	81,049,500
青山商事	40,500	1,326.00	53,703,000
しまむら	44,200	7,822.00	345,732,400
はせがわ	2,900	307.00	890,300
高島屋	256,500	1,218.00	312,417,000
松屋	31,900	859.00	27,402,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	89,800	2,061.00	185,077,800
近鉄百貨店	8,200	2,111.00	17,310,200
丸井グループ	124,800	2,398.00	299,270,400
アクシアル リテイリング	51,700	895.00	46,271,500
イオン	682,400	3,869.00	2,640,205,600
イズミ	28,100	3,171.00	89,105,100
平和堂	31,400	2,183.00	68,546,200
フジ	34,000	2,044.00	69,496,000
ヤオコー	22,300	9,071.00	202,283,300
ゼビオホールディングス	25,800	1,092.00	28,173,600
ケーズホールディングス	126,500	1,402.50	177,416,250
O l y m p i c グループ	2,400	462.00	1,108,800
日産東京販売ホールディングス	6,700	409.00	2,740,300
シルバーライフ	5,500	727.00	3,998,500
G e n k y D r u g S t o r e s	16,600	3,015.00	50,049,000
ナルミヤ・インターナショナル	900	1,226.00	1,103,400

ブックオフグループホールディングス	13,900	1,394.00	19,376,600
ギフトホールディングス	9,400	3,620.00	34,028,000
アインホールディングス	26,000	4,850.00	126,100,000
Genki Global Dining	10,700	4,220.00	45,154,000
ヤマダホールディングス	579,000	454.60	263,213,400
アークランズ	56,100	1,668.00	93,574,800
ニトリホールディングス	67,200	17,510.00	1,176,672,000
グルメ杵屋	15,600	1,045.00	16,302,000
愛眼	3,000	145.00	435,000
ケーユーホールディングス	9,100	1,061.00	9,655,100
吉野家ホールディングス	72,300	3,240.00	234,252,000
松屋フーズホールディングス	8,900	6,260.00	55,714,000
サガミホールディングス	28,400	1,825.00	51,830,000
王将フードサービス	36,600	3,105.00	113,643,000
ミニストップ	13,700	1,746.00	23,920,200
アークス	31,200	2,477.00	77,282,400
バローホールディングス	36,000	2,103.00	75,708,000
ベルク	9,400	6,660.00	62,604,000
大庄	11,600	1,045.00	12,122,000
ファーストリテイリング	103,800	49,480.00	5,136,024,000
サンドラッグ	63,500	3,692.00	234,442,000
サックスパーホールディングス	16,300	945.00	15,403,500
ヤマザワ	1,100	1,162.00	1,278,200
やまや	900	2,851.00	2,565,900
ベルーナ	45,700	731.00	33,406,700
いよぎんホールディングス	224,800	1,633.50	367,210,800
しずおかフィナンシャルグループ	378,400	1,349.00	510,461,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	147,300	1,593.50	234,722,550
楽天銀行	81,200	3,598.00	292,157,600
京都フィナンシャルグループ	216,200	2,374.50	513,366,900
島根銀行	1,100	505.00	555,500
じもとホールディングス	3,300	301.00	993,300
めぶきフィナンシャルグループ	862,300	651.40	561,702,220
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,400	4,155.00	93,072,000
九州フィナンシャルグループ	302,200	774.90	234,174,780
ゆうちょ銀行	1,415,600	1,431.00	2,025,723,600

富山第一銀行	55,500	1,130.00	62,715,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	913,800	851.60	778,192,080
西日本フィナンシャルホールディングス	105,700	1,871.00	197,764,700
三十三フィナンシャルグループ	15,600	1,938.00	30,232,800
第四北越フィナンシャルグループ	55,000	2,733.00	150,315,000
ひろぎんホールディングス	241,700	1,156.50	279,526,050
おきなわフィナンシャルグループ	14,900	2,429.00	36,192,100
十六フィナンシャルグループ	22,700	4,400.00	99,880,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,100	4,660.00	79,686,000
プロクレアホールディングス	20,000	1,727.00	34,540,000
あいちフィナンシャルグループ	32,000	2,408.00	77,056,000
あおぞら銀行	118,500	2,649.00	313,906,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,265,200	1,763.00	19,860,547,600
りそなホールディングス	2,121,400	1,169.50	2,480,977,300
三井住友トラストグループ	612,600	3,593.00	2,201,071,800
三井住友フィナンシャルグループ	3,583,400	3,547.00	12,710,319,800
千葉銀行	531,900	1,258.50	669,396,150
群馬銀行	305,500	972.00	296,946,000
武蔵野銀行	24,400	2,929.00	71,467,600
千葉興業銀行	41,300	1,220.00	50,386,000
筑波銀行	76,800	232.00	17,817,600
七十七銀行	55,000	4,395.00	241,725,000
秋田銀行	11,700	2,135.00	24,979,500
山形銀行	19,400	1,009.00	19,574,600
岩手銀行	11,100	2,436.00	27,039,600
東邦銀行	138,400	267.00	36,952,800
東北銀行	1,800	1,066.00	1,918,800
ふくおかフィナンシャルグループ	149,600	3,843.00	574,912,800
スルガ銀行	115,700	1,069.00	123,683,300
八十二銀行	402,100	948.80	381,512,480
山梨中央銀行	19,600	1,779.00	34,868,400
大垣共立銀行	33,400	1,873.00	62,558,200
福井銀行	15,600	1,896.00	29,577,600
清水銀行	7,000	1,511.00	10,577,000
富山銀行	600	1,544.00	926,400
滋賀銀行	26,000	3,570.00	92,820,000

南都銀行	26,300	3,155.00	82,976,500	
百五銀行	164,600	606.00	99,747,600	
紀陽銀行	62,600	1,987.00	124,386,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	96,600	1,764.50	170,450,700	
山陰合同銀行	109,500	1,251.00	136,984,500	
鳥取銀行	1,300	1,222.00	1,588,600	
百十四銀行	17,200	2,820.00	48,504,000	
四国銀行	25,700	1,044.00	26,830,800	
阿波銀行	24,500	2,790.00	68,355,000	
大分銀行	10,500	3,240.00	34,020,000	
宮崎銀行	10,500	2,925.00	30,712,500	
佐賀銀行	10,200	2,149.00	21,919,800	
琉球銀行	37,200	1,045.00	38,874,000	
セブン銀行	615,300	324.50	199,664,850	
みずほフィナンシャルグループ	2,318,500	3,421.00	7,931,588,500	
高知銀行	1,300	883.00	1,147,900	
山口フィナンシャルグループ	171,600	1,561.00	267,867,600	
名古屋銀行	11,100	6,600.00	73,260,000	
北洋銀行	234,200	428.00	100,237,600	
大光銀行	1,200	1,415.00	1,698,000	
愛媛銀行	23,600	1,023.00	24,142,800	
トマト銀行	1,300	1,141.00	1,483,300	
京葉銀行	72,000	755.00	54,360,000	
栃木銀行	87,400	262.00	22,898,800	
北日本銀行	5,700	2,678.00	15,264,600	
東和銀行	32,100	602.00	19,324,200	
福島銀行	3,900	228.00	889,200	
大東銀行	1,600	710.00	1,136,000	
トモニホールディングス	165,600	428.00	70,876,800	
フィデアホールディングス	18,100	1,403.00	25,394,300	
池田泉州ホールディングス	242,700	361.00	87,614,700	
F P G	62,400	2,939.00	183,393,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	28,400	1,145.00	32,518,000	
マーキュリアホールディングス	1,700	899.00	1,528,300	
S B I ホールディングス	276,400	3,535.00	977,074,000	
ジャフコ グループ	52,200	2,050.00	107,010,000	

大和証券グループ本社	1, 228, 300	1, 046. 00	1, 284, 801, 800	
野村ホールディングス	2, 888, 600	906. 30	2, 617, 938, 180	
岡三証券グループ	135, 800	614. 00	83, 381, 200	
丸三証券	58, 300	974. 00	56, 784, 200	
東洋証券	46, 600	566. 00	26, 375, 600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	207, 900	472. 00	98, 128, 800	
光世証券	1, 000	407. 00	407, 000	
水戸証券	48, 100	524. 00	25, 204, 400	
いちよし証券	32, 800	864. 00	28, 339, 200	
松井証券	118, 400	840. 00	99, 456, 000	
マネックスグループ	171, 500	874. 00	149, 891, 000	
極東証券	24, 000	1, 307. 00	31, 368, 000	
岩井コスモホールディングス	20, 000	2, 222. 00	44, 440, 000	
アイザワ証券グループ	25, 300	1, 724. 00	43, 617, 200	
マネーパートナーズグループ	4, 100	474. 00	1, 943, 400	
スパークス・グループ	19, 500	1, 324. 00	25, 818, 000	
かんぽ生命保険	199, 900	2, 655. 50	530, 834, 450	
F P パートナー	7, 700	3, 055. 00	23, 523, 500	
S O M P O ホールディングス	839, 800	3, 473. 00	2, 916, 625, 400	
アニコム ホールディングス	59, 400	638. 00	37, 897, 200	
MS & AD インシュアランスグループホールディングス	1, 258, 800	3, 631. 00	4, 570, 702, 800	
第一生命ホールディングス	807, 800	4, 198. 00	3, 391, 144, 400	
東京海上ホールディングス	1, 677, 100	5, 963. 00	10, 000, 547, 300	
T & D ホールディングス	461, 200	2, 581. 50	1, 190, 587, 800	
アドバンスクリエイト	13, 600	768. 00	10, 444, 800	
N E X Y Z . G r o u p	2, 000	769. 00	1, 538, 000	
全国保証	45, 900	5, 459. 00	250, 568, 100	
あんしん保証	4, 300	175. 00	752, 500	
イントラスト	2, 200	763. 00	1, 678, 600	
日本モーゲージサービス	3, 400	420. 00	1, 428, 000	
C a s a	2, 100	844. 00	1, 772, 400	
S B I アルヒ	17, 500	829. 00	14, 507, 500	
プレミアグループ	29, 900	2, 357. 00	70, 474, 300	
ネットプロテクションズホールディングス	60, 400	355. 00	21, 442, 000	
クレディセゾン	109, 000	3, 525. 00	384, 225, 000	

芙蓉総合リース	16,200	11,205.00	181,521,000
みずほリース	129,700	1,035.00	134,239,500
東京センチュリー	131,100	1,527.00	200,189,700
日本証券金融	64,700	2,054.00	132,893,800
アイフル	286,600	314.00	89,992,400
リコーリース	16,700	5,150.00	86,005,000
イオンフィナンシャルサービス	101,000	1,241.00	125,341,000
アコム	410,600	366.10	150,320,660
ジャックス	20,800	3,885.00	80,808,000
オリエントコーポレーション	57,800	833.00	48,147,400
オリックス	1,030,300	3,402.00	3,505,080,600
三菱HCキャピタル	861,700	1,053.50	907,800,950
九州リースサービス	2,100	1,101.00	2,312,100
日本取引所グループ	1,022,300	1,918.50	1,961,282,550
イー・ギャランティ	29,000	1,547.00	44,863,000
アサックス	2,400	737.00	1,768,800
NECキャピタルソリューション	8,800	3,760.00	33,088,000
r o b o t h o m e	52,600	140.00	7,364,000
大東建託	58,500	17,115.00	1,001,227,500
サムティホールディングス	34,300	3,295.00	113,018,500
いちご	146,500	399.00	58,453,500
日本駐車場開発	211,100	227.00	47,919,700
スター・マイカ・ホールディングス	19,100	664.00	12,682,400
SREホールディングス	7,700	3,730.00	28,721,000
ADワークスグループ	9,500	204.00	1,938,000
ヒューリック	401,000	1,457.50	584,457,500
野村不動産ホールディングス	107,800	3,805.00	410,179,000
三重交通グループホールディングス	38,700	498.00	19,272,600
ディア・ライフ	30,500	879.00	26,809,500
地主	15,800	2,111.00	33,353,800
プレサンスコーポレーション	23,500	1,959.00	46,036,500
ハウスコム	1,200	1,360.00	1,632,000
JPMC	10,600	1,150.00	12,190,000
サンセイランディック	1,800	957.00	1,722,600
フージャースホールディングス	27,000	1,035.00	27,945,000
オープンハウスグループ	64,200	5,751.00	369,214,200

東急不動産ホールディングス	516,900	961.80	497,154,420
飯田グループホールディングス	164,800	2,174.00	358,275,200
イーグランド	1,000	1,354.00	1,354,000
ムゲンエステート	3,300	1,845.00	6,088,500
A n d D oホールディングス	10,600	1,046.00	11,087,600
シーアールイー	8,200	1,180.00	9,676,000
ケイアイスター不動産	8,600	3,810.00	32,766,000
グッドコムアセット	15,000	821.00	12,315,000
ジェイ・エス・ビー	7,500	2,686.00	20,145,000
ロードスターキャピタル	10,200	2,384.00	24,316,800
イノベーションホールディングス	1,800	935.00	1,683,000
フェイスネットワーク	1,400	1,584.00	2,217,600
霞ヶ関キャピタル	7,200	14,150.00	101,880,000
パーク24	136,700	1,900.00	259,730,000
パラカ	5,800	1,783.00	10,341,400
三井不動産	2,384,300	1,317.50	3,141,315,250
三菱地所	995,200	2,193.00	2,182,473,600
平和不動産	28,600	4,220.00	120,692,000
東京建物	150,300	2,645.00	397,543,500
京阪神ビルディング	33,100	1,523.00	50,411,300
住友不動産	279,600	4,865.00	1,360,254,000
テーオーシー	32,200	592.00	19,062,400
レオパレス21	150,400	513.00	77,155,200
スターツコーポレーション	28,300	3,720.00	105,276,000
フジ住宅	22,900	753.00	17,243,700
空港施設	25,700	581.00	14,931,700
明和地所	13,100	993.00	13,008,300
ゴールドクレスト	11,800	3,020.00	35,636,000
エスリード	8,400	4,510.00	37,884,000
日神グループホールディングス	29,300	510.00	14,943,000
日本エスコン	45,000	1,002.00	45,090,000
M I R A R T Hホールディングス	91,000	493.00	44,863,000
A V A N T I A	2,800	770.00	2,156,000
イオンモール	104,100	2,028.50	211,166,850
毎日コムネット	2,100	728.00	1,528,800
ファースト住建	2,100	1,001.00	2,102,100

カチタス	47,400	2,111.00	100,061,400	
トーセイ	29,400	2,513.00	73,882,200	
穴吹興産	1,200	1,994.00	2,392,800	
サンフロンティア不動産	26,300	1,841.00	48,418,300	
F J ネクストホールディングス	18,900	1,099.00	20,771,100	
インテリックス	900	756.00	680,400	
ランドビジネス	1,400	190.00	266,000	
サンネクスタグループ	1,800	1,009.00	1,816,200	
グランディハウス	17,500	567.00	9,922,500	
日本空港ビルデング	62,000	5,607.00	347,634,000	
明豊ファシリティワークス	2,200	892.00	1,962,400	
L I F U L L	45,900	151.00	6,930,900	
M I X I	33,700	2,684.00	90,450,800	
ジェイエイシーリクルートメント	66,200	733.00	48,524,600	
日本M&Aセンターホールディングス	263,900	676.00	178,396,400	
メンバーズ	6,400	1,085.00	6,944,000	
中広	900	444.00	399,600	
UTグループ	23,900	2,650.00	63,335,000	
アイティメディア	7,100	1,589.00	11,281,900	
ケアネット	37,700	660.00	24,882,000	
E・Jホールディングス	10,800	1,703.00	18,392,400	
オープンアップグループ	55,000	1,896.00	104,280,000	
コシダカホールディングス	54,900	1,210.00	66,429,000	
アルトナー	1,700	1,800.00	3,060,000	
パソナグループ	22,200	1,961.00	43,534,200	
C D S	1,300	1,840.00	2,392,000	
リンクアンドモチベーション	45,100	546.00	24,624,600	
エス・エム・エス	68,600	1,672.00	114,699,200	
サニーサイドアップグループ	1,600	528.00	844,800	
パーソルホールディングス	1,673,600	255.10	426,935,360	
リニカル	3,000	368.00	1,104,000	
クックパッド	50,900	164.00	8,347,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,900	738.00	2,140,200	
学情	9,400	1,714.00	16,111,600	
スタジオアリス	9,200	2,052.00	18,878,400	
エプコ	1,300	765.00	994,500	

N J S	4,600	3,765.00	17,319,000
総合警備保障	305,300	1,101.50	336,287,950
カカコム	129,300	2,615.50	338,184,150
アイロムグループ	7,400	2,583.00	19,114,200
セントケア・ホールディング	13,500	720.00	9,720,000
サイネックス	900	757.00	681,300
ルネサンス	14,400	991.00	14,270,400
ディップ	31,400	2,635.00	82,739,000
デジタルホールディングス	9,500	1,221.00	11,599,500
新日本科学	16,800	1,490.00	25,032,000
キャリアデザインセンター	800	1,824.00	1,459,200
エムスリー	354,400	1,392.50	493,502,000
ツカダ・グローバルホールディング	3,100	393.00	1,218,300
ウエルネット	3,700	900.00	3,330,000
ワールドホールディングス	7,300	2,050.00	14,965,000
ディー・エヌ・エー	71,800	2,467.00	177,130,600
博報堂DYホールディングス	203,400	1,221.50	248,453,100
ぐるなび	34,500	314.00	10,833,000
タカミヤ	25,200	447.00	11,264,400
ファンコミュニケーションズ	26,000	412.00	10,712,000
ライク	6,900	1,391.00	9,597,900
A o b a - B B T	2,000	320.00	640,000
エスプール	58,300	362.00	21,104,600
WDBホールディングス	9,400	1,692.00	15,904,800
ティア	3,000	427.00	1,281,000
アドウェイズ	22,800	329.00	7,501,200
バリューコマース	16,200	1,118.00	18,111,600
インフォマート	172,900	300.00	51,870,000
J Pホールディングス	47,000	675.00	31,725,000
エコナックホールディングス	4,800	120.00	576,000
C Lホールディングス	4,500	834.00	3,753,000
プレステージ・インターナショナル	85,700	675.00	57,847,500
プロトコーポレーション	19,500	1,432.00	27,924,000
アミューズ	11,300	1,326.00	14,983,800
ドリームインキュベータ	5,800	2,977.00	17,266,600
クイック	12,800	2,027.00	25,945,600

T A C	2,900	210.00	609,000	
電通グループ	193,900	4,861.00	942,547,900	
テイクアンドギヴ・ニーズ	9,000	844.00	7,596,000	
イオンファンタジー	6,700	2,911.00	19,503,700	
シーティーエス	22,800	917.00	20,907,600	
H. U. グループホールディングス	53,500	2,528.50	135,274,750	
アルプス技研	16,000	2,840.00	45,440,000	
日本空調サービス	19,800	1,044.00	20,671,200	
オリエンタルランド	1,067,400	3,904.00	4,167,129,600	
ダスキン	39,900	3,835.00	153,016,500	
明光ネットワークジャパン	22,400	694.00	15,545,600	
ファルコホールディングス	8,200	2,323.00	19,048,600	
ラウンドワン	172,500	1,067.00	184,057,500	
リゾートトラスト	70,800	2,805.50	198,629,400	
ビー・エム・エル	22,500	2,770.00	62,325,000	
リソー教育	94,100	286.00	26,912,600	
早稲田アカデミー	10,200	1,788.00	18,237,600	
ユー・エス・エス	368,900	1,315.50	485,287,950	
東京個別指導学院	22,100	394.00	8,707,400	
サイバーエージェント	396,400	1,039.50	412,057,800	
楽天グループ	1,263,100	923.60	1,166,599,160	
クリーク・アンド・リバー社	9,300	1,594.00	14,824,200	
S B I グローバルアセットマネジメント	36,100	629.00	22,706,900	
テー・オー・ダブリュー	36,400	321.00	11,684,400	
山田コンサルティンググループ	8,000	2,108.00	16,864,000	
セントラルスポーツ	6,900	2,413.00	16,649,700	
フルキャストホールディングス	15,100	1,438.00	21,713,800	
エン・ジャパン	29,800	2,354.00	70,149,200	
リソルホールディングス	400	5,100.00	2,040,000	
テクノプロ・ホールディングス	106,100	2,915.00	309,281,500	
アトラグループ	1,500	134.00	201,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,700	863.00	8,371,100	
K e e P e r 技研	11,300	3,900.00	44,070,000	
楽待	1,500	695.00	1,042,500	
三機サービス	800	923.00	738,400	
G u n o s y	14,700	719.00	10,569,300	

デザインワン・ジャパン	2,500	112.00	280,000	
イー・ガーディアン	8,800	1,817.00	15,989,600	
リブセンス	3,000	162.00	486,000	
ジャパンマテリアル	56,000	1,800.00	100,800,000	
ベクトル	22,000	962.00	21,164,000	
ウチヤマホールディングス	2,200	307.00	675,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,300	1,207.00	18,467,100	
キャリアリンク	6,800	2,529.00	17,197,200	
I B J	14,200	639.00	9,073,800	
アサンテ	9,100	1,680.00	15,288,000	
バリューHR	16,500	1,826.00	30,129,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	14,900	2,553.00	38,039,700	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,400	999.00	7,392,600	
ERIホールディングス	1,200	1,890.00	2,268,000	
アビスト	700	3,040.00	2,128,000	
シグマクシス・ホールディングス	24,000	1,951.00	46,824,000	
ウィルグループ	15,500	995.00	15,422,500	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	6,000	145.00	870,000	
メドピア	14,900	578.00	8,612,200	
レアジョブ	1,200	397.00	476,400	
リクルートホールディングス	1,398,800	9,936.00	13,898,476,800	
エラン	24,400	768.00	18,739,200	
土木管理総合試験所	2,400	306.00	734,400	
日本郵政	2,008,100	1,487.50	2,987,048,750	
ベルシステム24ホールディングス	19,700	1,289.00	25,393,300	
鎌倉新書	16,000	544.00	8,704,000	
SMN	1,400	293.00	410,200	
グローバルキッズCOMPANY	1,000	665.00	665,000	
エアトリ	13,500	1,011.00	13,648,500	
アトラエ	13,500	817.00	11,029,500	
ストライク	9,000	3,930.00	35,370,000	
ソラスト	50,700	483.00	24,488,100	
セラク	5,700	1,364.00	7,774,800	
インソース	39,800	1,078.00	42,904,400	
ベイカレント	131,800	5,418.00	714,092,400	
Orchestra Holdings	4,200	865.00	3,633,000	

アイモバイル	23,600	524.00	12,366,400	
ディスラプターズ	2,300	171.00	393,300	
MS-Japan	8,500	1,064.00	9,044,000	
船場	1,000	1,246.00	1,246,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	69,800	2,934.00	204,793,200	
フルテック	700	1,158.00	810,600	
GameWith	2,400	231.00	554,400	
MS&Consulting	800	471.00	376,800	
エル・ティー・エス	2,500	1,812.00	4,530,000	
ミダックホールディングス	11,200	1,895.00	21,224,000	
キュービーネットホールディングス	10,600	1,004.00	10,642,400	
オープングループ	25,700	198.00	5,088,600	
スプリックス	1,400	797.00	1,115,800	
マネジメントソリューションズ	9,100	1,866.00	16,980,600	
プロレド・パートナーズ	4,800	477.00	2,289,600	
テノ.ホールディングス	900	510.00	459,000	
フロンティア・マネジメント	5,600	1,177.00	6,591,200	
コプロ・ホールディングス	1,400	1,430.00	2,002,000	
ギークス	900	437.00	393,300	
アンビスホールディングス	39,200	1,114.00	43,668,800	
カープスホールディングス	50,100	789.00	39,528,900	
フォーラムエンジニアリング	25,000	966.00	24,150,000	
Fast Fitness Japan	6,400	1,315.00	8,416,000	
Macbee Planet	5,200	2,764.00	14,372,800	
ダイレクトマーケティングミックス	22,900	232.00	5,312,800	
ポピンズ	3,500	1,354.00	4,739,000	
LITALICO	14,400	1,043.00	15,019,200	
コンフィデンス・インターワークス	400	1,657.00	662,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	2,300	583.00	1,340,900	
リログループ	99,900	1,745.00	174,325,500	
東祥	13,000	660.00	8,580,000	
ID&Eホールディングス	11,100	4,255.00	47,230,500	
ビーウィズ	3,800	1,587.00	6,030,600	
サンウェルズ	7,100	1,228.00	8,718,800	
TREホールディングス	41,300	1,793.00	74,050,900	

人・夢・技術グループ	7,600	1,651.00	12,547,600	
NISSOホールディングス	16,100	780.00	12,558,000	
大栄環境	39,100	3,070.00	120,037,000	
GENOVA	6,200	1,778.00	11,023,600	
日本管財ホールディングス	19,200	2,591.00	49,747,200	
M&A総研ホールディングス	19,800	2,278.00	45,104,400	
エイチ・アイ・エス	58,500	1,808.00	105,768,000	
ラックランド	8,300	1,982.00	16,450,600	
共立メンテナンス	57,400	2,557.50	146,800,500	
イチネンホールディングス	19,500	1,955.00	38,122,500	
建設技術研究所	9,400	4,780.00	44,932,000	
スペース	13,400	1,172.00	15,704,800	
燦ホールディングス	17,000	1,158.00	19,686,000	
スバル興業	7,100	3,140.00	22,294,000	
東京テアトル	1,400	1,099.00	1,538,600	
タナベコンサルティンググループ	8,000	1,193.00	9,544,000	
ナガワ	5,700	6,680.00	38,076,000	
東京都競馬	13,400	4,205.00	56,347,000	
カナモト	28,400	2,737.00	77,730,800	
ニシオホールディングス	15,100	3,580.00	54,058,000	
トランス・コスモス	22,900	3,475.00	79,577,500	
乃村工藝社	79,900	772.00	61,682,800	
藤田観光	8,100	8,630.00	69,903,000	
KNT-CTホールディングス	10,900	1,339.00	14,595,100	
トーカイ	16,200	2,194.00	35,542,800	
セコム	365,200	5,258.00	1,920,221,600	
セントラル警備保障	9,900	2,802.00	27,739,800	
丹青社	35,600	796.00	28,337,600	
メイテックグループホールディングス	66,200	2,930.00	193,966,000	
応用地質	17,100	2,584.00	44,186,400	
船井総研ホールディングス	36,600	2,435.00	89,121,000	
進学会ホールディングス	1,800	212.00	381,600	
オオバ	2,800	1,028.00	2,878,400	
いであ	1,100	2,426.00	2,668,600	
学究社	7,400	1,929.00	14,274,600	
イオンディライト	19,600	4,360.00	85,456,000	

ナック	15,800	570.00	9,006,000	
ダイセキ	43,300	3,885.00	168,220,500	
ステップ	6,700	2,009.00	13,460,300	
合 計	328,557,400		685,842,024,520	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	507,391,398
コール・ローン	2,089,128,523
国債証券	366,931,042,465
派生商品評価勘定	8,010,927
未収入金	27,231,505
未収利息	3,002,245,114
前払金	10,990,804
前払費用	326,432,144
差入委託証拠金	218,581,013
流動資産合計	373,121,053,893
資産合計	373,121,053,893
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,277,266
前受収益	69,109
未払金	710,775,034
未払解約金	112,540,257
流動負債合計	837,661,666
負債合計	837,661,666
純資産の部	
元本等	
元本	102,008,428,341

剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	270,274,963,886
元本等合計	372,283,392,227
純資産合計	372,283,392,227
負債純資産合計	373,121,053,893

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月11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> <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11月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	102,008,428,341 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 3.6495 円 (1万口当たり純資産額) (36,495 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11月11日現在

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年11月11日
期首元本額	88,991,964,839円

期中追加設定元本額	19,472,589,861円
期中一部解約元本額	6,456,126,359円
期末元本額	102,008,428,341円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,063,747,228円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	450,547,250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）	2,366,001,796円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,889,824円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,604,780,674円
世界経済インデックスファンド	25,800,475,401円
DCマイセクション25	1,807,882,868円
DCマイセクション50	1,709,851,998円
DCマイセクション75	1,366,501,160円
DC外国債券インデックス・オープン	2,223,929,359円
DCマイセクションS25	1,144,197,971円
DCマイセクションS50	1,022,644,525円
DCマイセクションS75	678,577,825円
DCターゲット・イヤーフンド2025	7,171,521円
DCターゲット・イヤーフンド2035	101,470,366円
DCターゲット・イヤーフンド2045	57,070,823円
DC世界経済インデックスファンド	16,209,848,692円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	808,849,600円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,064,607円
マイセクション75VA1（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VA1（適格機関投資家専用）	7,650,551円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	19,445,053円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	33,083,521円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	48,676,880円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	50,803,795円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	552,714,078円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	340,023,436円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,422,854,853円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	49,643,903円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	22,409,359円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	313,092,800円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	113,910,831円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	158,144,952円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	614,041,354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）	1,464,774,079円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	603,986,386円
外国債券ファンド・シリーズ1	757,382,973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）	840,005,175円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,604,092,942円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,182,624円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,741,730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）	1,280,981,707円
SMT インデックスバランス・オープン	162,803,147円
SMT 世界経済インデックス・オープン	475,170,280円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	713,257,098円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,065,056,349円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,622,140円
グローバル経済コア	1,270,648,605円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	25,611,105円

DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,790,927 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	67,414,826 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	110,980,263 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	57,474,731 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	82,887,024 円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	976,856,543 円
10資産分散投資ファンド	35,954,841 円
グローバル10資産バランスファンド	34,829,757 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	154,827 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	24,098 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	151,381 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	36,630 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	76,806 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	43,000 円
DCマイセレクトS50（2024-2026リスク抑制型）	4,319,605 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）	14,261,136,157 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	234,502,479 円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	452,698,381 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	141,528,410 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	6,142,464,611	
合計	6,142,464,611	

（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11月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,204,398,159	—	1,193,407,355	△10,990,804
合計		1,204,398,159	—	1,193,407,355	△10,990,804

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2024年11月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引 買建	1,796,683,626	—	1,801,408,091	4,724,465
	アメリカドル	868,881,816	—	874,049,777	5,167,961
	カナダドル	70,054,359	—	70,419,940	365,581
	ユーロ	524,607,251	—	523,134,720	△1,472,531
	イギリスポンド	104,417,488	—	104,759,140	341,652
	オフショア人民 元	228,722,712	—	229,044,514	321,802
	合計	1,796,683,626	—	1,801,408,091	4,724,465

(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。

- ①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。
- ②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% 10/31/25	3,600,000.00	3,461,143.68	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,627,343.76	
		T 0.375% 07/31/27	16,100,000.00	14,528,048.80	
		T 0.375% 09/30/27	2,440,000.00	2,188,089.05	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,878,478.82	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,825,937.52	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,284,228.51	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,686,080.46	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,187,460.92	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,320,821.85	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,207,652.35	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,730,371.07	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,895,898.40	

T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,508,566.42	
T 0.625% 07/31/26	10,800,000.00	10,152,843.69	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,770,525.42	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,245,166.02	
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,596,500.00	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,620,615.24	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,714,882.82	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	9,024,628.93	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,789,062.48	
T 0.75% 08/31/26	9,630,000.00	9,048,062.08	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,573,437.52	
T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,723,960.95	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,200,927.70	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,398,353.13	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,245,624.96	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,069,518.16	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,222,578.11	
T 1.125% 08/31/28	12,030,000.00	10,733,485.51	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,694,109.38	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,242,343.76	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,795,378.93	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,419,335.96	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	8,110,019.52	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,620,158.22	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,497,861.34	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,592,031.25	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,700,807.43	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,956,207.01	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,157,618.74	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,402,824.56	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,860,390.64	
T 1.375% 12/31/28	8,680,000.00	7,755,207.02	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,656,406.28	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,648,360.53	
T 1.5% 08/15/26	15,500,000.00	14,781,914.14	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,747,363.30	

T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,416,906.26	
T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	10,354,765.98	
T 1.625% 05/15/31	10,980,000.00	9,360,021.11	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,015,937.50	
T 1.625% 10/31/26	12,300,000.00	11,698,933.56	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,822,761.73	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,537,265.62	
T 1.75% 01/31/29	10,200,000.00	9,234,386.70	
T 1.75% 08/15/41	7,080,000.00	4,766,278.08	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,676,562.50	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,986,264.03	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,499,449.19	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,899,800.80	
T 1.875% 02/28/27	6,500,000.00	6,167,890.62	
T 1.875% 02/28/29	8,470,000.00	7,697,608.75	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,985,846.47	
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,936,558.60	
T 1% 07/31/28	13,000,000.00	11,574,316.39	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,484,546.88	
T 2.25% 02/15/27	7,250,000.00	6,943,290.99	
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,768,712.89	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,294,335.90	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,763,997.67	
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	7,147,911.30	
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,109,370.30	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,597,021.50	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,309,260.29	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,229,250.00	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,067,636.70	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,542,166.03	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,529,617.19	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,182,215.62	
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,564,766.99	
T 2.375% 05/15/51	7,450,000.00	4,962,980.50	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,750,042.97	
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,032,091.00	

T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,751,462.88	
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,828,480.45	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,033,436.51	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,596,566.38	
T 2.625% 02/15/29	7,740,000.00	7,265,471.51	
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,308,593.74	
T 2.625% 07/31/29	15,200,000.00	14,180,234.43	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,711,102.32	
T 2.75% 02/15/28	8,550,000.00	8,172,430.63	
T 2.75% 04/30/27	5,450,000.00	5,264,146.49	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,357,777.35	
T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	11,615,038.99	
T 2.75% 08/15/42	7,100,000.00	5,540,496.07	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	2,987,112.28	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,678,668.75	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,245,979.49	
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,122,109.37	
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,624,394.15	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,202,638.63	
T 2.875% 05/15/43	5,050,000.00	3,973,718.75	
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,537,081.25	
T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	7,997,062.50	
T 2.875% 08/15/28	13,220,000.00	12,607,800.44	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,770,460.92	
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	714,767.18	
T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,864,321.22	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,688,779.29	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,768,261.75	
T 2% 11/15/26	6,320,000.00	6,051,153.13	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,329,222.66	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	875,355.47	
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	3,120,601.57	
T 3.125% 05/15/48	4,780,000.00	3,760,795.68	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,488,207.80	
T 3.125% 08/31/27	6,150,000.00	5,975,589.81	
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,816,100.57	

T 3.125% 11/15/28	10,410,000.00	9,998,276.37	
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,503,669.91	
T 3.25% 06/30/29	6,500,000.00	6,238,984.37	
T 3.375% 05/15/33	13,630,000.00	12,751,237.64	
T 3.375% 05/15/44	7,110,000.00	6,000,173.43	
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,972,025.38	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,346,414.03	
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,867,421.88	
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,597,343.79	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	699,496.87	
T 3.5% 04/30/30	3,500,000.00	3,379,824.21	
T 3.625% 02/15/44	4,890,000.00	4,289,064.86	
T 3.625% 02/15/53	9,550,000.00	8,213,373.02	
T 3.625% 05/15/53	2,300,000.00	1,979,392.58	
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	4,138,570.33	
T 3.75% 04/15/26	6,570,000.00	6,519,698.43	
T 3.75% 06/30/30	3,000,000.00	2,930,566.41	
T 3.75% 11/15/43	6,130,000.00	5,485,392.18	
T 3.75% 12/31/30	6,160,000.00	6,000,465.60	
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,466,738.26	
T 3.875% 02/15/43	2,500,000.00	2,292,382.80	
T 3.875% 08/15/33	11,070,000.00	10,733,143.33	
T 3.875% 08/15/34	5,000,000.00	4,831,640.60	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,356,542.97	
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,488,213.65	
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	8,007,573.66	
T 3% 02/15/47	3,920,000.00	3,042,210.94	
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	770,000.00	
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	765,039.06	
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,993,783.19	
T 3% 05/15/45	700,000.00	551,496.09	
T 3% 05/15/47	1,710,000.00	1,324,181.25	
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,493,105.48	
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	3,952,406.22	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,936,987.45	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,214,351.55	

T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,805,769.53	
T 4.125% 03/31/29	3,350,000.00	3,338,811.53	
T 4.125% 07/31/31	3,500,000.00	3,475,527.33	
T 4.125% 08/15/53	4,300,000.00	4,049,474.60	
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,152,203.14	
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,093,521.49	
T 4.125% 11/15/32	8,000,000.00	7,929,531.28	
T 4.25% 02/15/54	10,550,000.00	10,167,356.45	
T 4.25% 02/28/31	9,000,000.00	9,006,855.48	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	885,761.72	
T 4.25% 06/30/31	7,830,000.00	7,832,293.95	
T 4.25% 08/15/54	1,800,000.00	1,736,437.50	
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	723,508.98	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,004,453.12	
T 4.375% 05/15/34	6,310,000.00	6,346,972.68	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,888,273.42	
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	643,957.02	
T 4.375% 07/15/27	800,000.00	803,218.75	
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	6,010,195.32	
T 4.375% 08/15/43	1,500,000.00	1,467,128.91	
T 4.375% 08/31/28	14,150,000.00	14,225,724.57	
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	955,293.75	
T 4.375% 11/30/30	4,500,000.00	4,535,507.79	
T 4.375% 12/15/26	13,000,000.00	13,033,007.78	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,117,633.20	
T 4.5% 04/15/27	9,150,000.00	9,207,902.29	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	558,744.14	
T 4.5% 07/15/26	10,000,000.00	10,033,789.10	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,716,070.30	
T 4.5% 11/15/33	9,270,000.00	9,409,593.12	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,410,187.50	
T 4.625% 04/30/31	7,070,000.00	7,222,584.95	
T 4.625% 05/15/54	5,150,000.00	5,283,578.12	
T 4.625% 09/15/26	4,000,000.00	4,024,843.76	
T 4.625% 09/30/30	3,010,000.00	3,072,081.25	
T 4.625% 10/15/26	9,520,000.00	9,583,404.72	

	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	776,513.67	
	T 4.75% 11/15/53	3,880,000.00	4,055,054.69	
	T 4.875% 05/31/26	3,400,000.00	3,428,687.50	
	T 4.875% 10/31/30	4,960,000.00	5,128,465.60	
	T 4.875% 11/30/25	9,700,000.00	9,750,435.82	
	T 4% 01/15/27	7,200,000.00	7,164,843.76	
	T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,475,371.11	
	T 4% 02/15/34	11,600,000.00	11,336,734.40	
	T 4% 02/28/30	1,350,000.00	1,336,605.46	
	T 4% 07/31/30	3,980,000.00	3,936,313.29	
	T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,489,105.43	
	T 4% 11/15/52	7,400,000.00	6,813,636.72	
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	426,960.93	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,350,527.34	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,077,435.54	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,737,718.75	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,529,410.14	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,154,876.95	
	アメリカドル 小計	1,241,270,000.00	1,119,685,904.79 (171,468,699,459)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	1,340,000.00	1,291,293.22	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,992,948.25	
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,806,079.58	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,950,000.00	3,587,714.24	
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	888,914.63	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,500,000.00	3,167,612.87	
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,252,249.59	
	CAN 1.75% 12/01/53	2,920,000.00	2,125,943.63	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	771,828.71	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,475,532.10	
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	233,235.55	
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,194,491.15	
	CAN 2.75% 06/01/33	1,200,000.00	1,163,713.26	
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,588,434.30	
	CAN 2.75% 12/01/48	980,000.00	904,656.66	
	CAN 2.75% 12/01/55	2,080,000.00	1,898,440.58	

	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	568,938.40	
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	396,922.37	
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,404,409.47	
	CAN 2% 12/01/51	3,750,000.00	2,929,525.79	
	CAN 3.25% 09/01/28	1,890,000.00	1,907,168.09	
	CAN 3.25% 12/01/33	2,370,000.00	2,384,430.75	
	CAN 3.25% 12/01/34	2,520,000.00	2,533,576.44	
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,178,301.52	
	CAN 3.5% 09/01/29	2,360,000.00	2,410,755.54	
	CAN 3.5% 12/01/45	960,000.00	1,002,996.39	
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,337,515.31	
	CAN 3% 06/01/34	2,620,000.00	2,581,276.96	
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	815,981.91	
	CAN 4.5% 02/01/26	3,400,000.00	3,453,643.39	
	CAN 4.5% 11/01/25	1,940,000.00	1,963,081.53	
	CAN 4% 03/01/29	2,180,000.00	2,267,214.19	
	CAN 4% 05/01/26	2,250,000.00	2,277,396.83	
	CAN 4% 08/01/26	1,490,000.00	1,511,573.19	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,666,713.86	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,928,053.75	
	CAN 5% 06/01/37	490,000.00	579,772.02	
	カナダドル 小計	68,300,000.00	65,442,336.02 (7,203,237,925)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,637,396.04	
	MBONO 5.5% 03/04/27	33,260,000.00	30,343,522.73	
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	44,412,656.86	
	MBONO 7.5% 05/26/33	30,430,000.00	26,369,116.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	35,800,000.00	34,031,708.03	
	MBONO 7.75% 05/29/31	41,670,000.00	37,808,504.43	
	MBONO 7.75% 11/13/42	33,360,000.00	26,908,592.32	
	MBONO 7.75% 11/23/34	18,410,000.00	15,991,710.26	
	MBONO 7% 09/03/26	14,580,000.00	13,883,950.80	
	MBONO 8.5% 03/01/29	25,020,000.00	23,898,603.60	
	MBONO 8.5% 05/31/29	32,230,000.00	30,787,747.78	
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,138,023.99	
	MBONO 8% 07/31/53	28,240,000.00	22,788,980.76	

	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	20,065,887.40	
	メキシコペソ 小計	394,430,000.00	355,066,401.50 (2,702,090,822)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,420,000.00	1,236,473.52	
	BGB 0.35% 06/22/32	1,220,000.00	1,016,565.30	
	BGB 0.4% 06/22/40	660,000.00	431,299.27	
	BGB 0.65% 06/22/71	530,000.00	220,267.73	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,450,841.97	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,509,934.80	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,790,000.00	1,663,514.12	
	BGB 0% 10/22/27	900,000.00	839,326.50	
	BGB 0% 10/22/31	1,460,000.00	1,210,823.42	
	BGB 1.25% 04/22/33	1,310,000.00	1,160,568.30	
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	659,387.40	
	BGB 1.45% 06/22/37	630,000.00	522,050.60	
	BGB 1.6% 06/22/47	950,000.00	683,909.03	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	776,861.52	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,020,000.00	879,076.80	
	BGB 1% 06/22/26	1,560,000.00	1,527,146.40	
	BGB 1% 06/22/31	1,770,000.00	1,590,580.41	
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	644,762.80	
	BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	507,978.25	
	BGB 2.7% 10/22/29	610,000.00	613,692.94	
	BGB 2.75% 04/22/39	730,000.00	693,968.29	
	BGB 2.85% 10/22/34	1,270,000.00	1,258,371.88	
	BGB 3.3% 06/22/54	1,020,000.00	979,536.60	
	BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	446,684.26	
	BGB 3.5% 06/22/55	690,000.00	684,565.56	
	BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	982,047.45	
	BGB 3% 06/22/33	1,450,000.00	1,466,236.37	
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,037,726.54	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,680,000.00	1,886,371.20	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,110,000.00	1,141,529.21	
BGB 4% 03/28/32	880,000.00	950,574.15		
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,238,344.10		
BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,128,567.60		

BKO 2.5% 03/19/26	2,100,000.00	2,106,259.04	
BKO 2.7% 09/17/26	2,650,000.00	2,673,187.50	
BKO 2.9% 06/18/26	730,000.00	737,366.06	
BKO 3.1% 12/12/25	1,620,000.00	1,632,566.34	
BTPS 0.25% 03/15/28	2,030,000.00	1,869,173.25	
BTPS 0.45% 02/15/29	1,640,000.00	1,481,824.46	
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,860,584.48	
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,197,144.00	
BTPS 0.6% 08/01/31	1,960,000.00	1,652,946.40	
BTPS 0.85% 01/15/27	2,340,000.00	2,253,714.48	
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,536,756.16	
BTPS 0.95% 03/01/37	2,420,000.00	1,763,458.84	
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,959,356.00	
BTPS 0.95% 08/01/30	1,180,000.00	1,047,368.00	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,640,000.00	1,563,211.10	
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,833,087.08	
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,161,326.16	
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	3,091,053.47	
BTPS 1.1% 04/01/27	2,350,000.00	2,267,916.85	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,625,912.00	
BTPS 1.35% 04/01/30	2,250,000.00	2,062,923.86	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,730,000.00	1,378,867.95	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	821,219.06	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,064,124.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,670,000.00	2,393,655.00	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,330,542.07	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,520,000.00	952,637.20	
BTPS 1.8% 03/01/41	960,000.00	712,931.04	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,280,000.00	1,259,545.60	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,428,609.60	
BTPS 2.15% 03/01/72	690,000.00	432,794.22	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	697,036.89	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,256,573.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,650,000.00	1,426,000.53	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,310,000.00	2,143,249.18	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,380,000.00	1,027,288.56	

	BTPS 2.5% 11/15/25	860,000.00	859,060.40	
	BTPS 2.5% 12/01/32	2,520,000.00	2,371,532.94	
	BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,756,722.14	
	BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	893,857.47	
	BTPS 2.8% 03/01/67	950,000.00	717,973.90	
	BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,593,093.72	
	BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,419,718.78	
	BTPS 2.95% 02/15/27	1,380,000.00	1,388,093.70	
	BTPS 2.95% 09/01/38	1,380,000.00	1,251,903.57	
	BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,210,650.64	
	BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,199,297.71	
	BTPS 3.1% 03/01/40	1,220,000.00	1,105,029.94	
	BTPS 3.2% 01/28/26	2,000,000.00	2,011,250.00	
	BTPS 3.25% 03/01/38	2,080,000.00	1,955,240.56	
	BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	2,009,913.04	
	BTPS 3.35% 03/01/35	2,330,000.00	2,286,108.62	
	BTPS 3.35% 07/01/29	2,400,000.00	2,437,814.40	
	BTPS 3.4% 04/01/28	1,550,000.00	1,580,810.12	
	BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,649,809.98	
	BTPS 3.45% 07/15/31	340,000.00	343,911.70	
	BTPS 3.5% 01/15/26	1,840,000.00	1,856,596.42	
	BTPS 3.5% 02/15/31	2,440,000.00	2,479,298.15	
	BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,419,695.72	
	BTPS 3.7% 06/15/30	1,730,000.00	1,781,372.35	
	BTPS 3.8% 04/15/26	1,870,000.00	1,899,286.07	
	BTPS 3.8% 08/01/28	1,760,000.00	1,819,334.00	
	BTPS 3.85% 07/01/34	1,480,000.00	1,515,340.18	
	BTPS 3.85% 09/01/49	1,580,000.00	1,518,097.56	
	BTPS 3.85% 09/15/26	860,000.00	878,192.44	
	BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,970,785.81	
	BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,153,588.69	
	BTPS 4.1% 02/01/29	1,540,000.00	1,611,469.70	
	BTPS 4.15% 10/01/39	1,010,000.00	1,034,523.81	
	BTPS 4.2% 03/01/34	1,920,000.00	2,023,958.40	
	BTPS 4.3% 10/01/54	900,000.00	907,206.75	
	BTPS 4.35% 11/01/33	2,090,000.00	2,231,075.00	

	BTPS 4.4% 05/01/33	1,060,000.00	1,138,032.11	
	BTPS 4.45% 09/01/43	1,560,000.00	1,637,604.54	
	BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,128,389.12	
	BTPS 4.5% 10/01/53	1,510,000.00	1,588,445.55	
	BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,812,311.60	
	BTPS 4.75% 09/01/44	1,850,000.00	2,025,861.00	
	BTPS 4% 02/01/37	3,070,000.00	3,170,927.78	
	BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	914,727.88	
	BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,311,795.62	
	BTPS 4% 11/15/30	2,310,000.00	2,413,714.84	
	BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	3,004,946.51	
	BTPS 5.25% 11/01/29	3,350,000.00	3,707,577.32	
	BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,661,067.80	
	BTPS 5% 08/01/34	2,830,000.00	3,168,705.72	
	BTPS 5% 09/01/40	2,640,000.00	2,957,684.40	
	BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,993,071.50	
	BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,329,326.07	
	BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,525,383.30	
	DBR 0.25% 02/15/27	2,490,000.00	2,390,881.81	
	DBR 0.25% 02/15/29	1,970,000.00	1,825,205.00	
	DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,954,941.58	
	DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,936,283.75	
	DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,294,319.88	
	DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	335,633.72	
	DBR 0% 02/15/30	1,260,000.00	1,127,682.03	
	DBR 0% 02/15/31	1,660,000.00	1,452,832.40	
	DBR 0% 02/15/32	3,100,000.00	2,644,492.20	
	DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,853,234.60	
	DBR 0% 05/15/36	2,430,000.00	1,837,592.73	
	DBR 0% 08/15/26	2,920,000.00	2,812,852.05	
	DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,671,545.07	
	DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	2,081,324.50	
	DBR 0% 08/15/30	1,980,000.00	1,753,947.36	
	DBR 0% 08/15/31	3,990,000.00	3,450,029.31	
	DBR 0% 08/15/50	5,040,000.00	2,632,829.20	
	DBR 0% 08/15/52	3,020,000.00	1,500,018.90	

	DBR 0% 11/15/27	2,820,000.00	2,649,471.78	
	DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,832,698.46	
	DBR 1.25% 08/15/48	3,430,000.00	2,629,197.90	
	DBR 1.7% 08/15/32	2,600,000.00	2,501,100.55	
	DBR 1.8% 08/15/53	3,700,000.00	3,114,253.00	
	DBR 1% 05/15/38	2,360,000.00	1,948,138.69	
	DBR 2.1% 11/15/29	2,430,000.00	2,418,919.20	
	DBR 2.2% 02/15/34	2,900,000.00	2,867,104.55	
	DBR 2.3% 02/15/33	4,320,000.00	4,325,220.72	
	DBR 2.4% 11/15/30	2,000,000.00	2,019,494.99	
	DBR 2.5% 07/04/44	2,930,000.00	2,888,065.84	
	DBR 2.5% 08/15/46	3,010,000.00	2,965,642.38	
	DBR 2.5% 08/15/54	1,760,000.00	1,725,322.72	
	DBR 2.6% 05/15/41	300,000.00	299,902.50	
	DBR 2.6% 08/15/33	2,890,000.00	2,955,788.53	
	DBR 2.6% 08/15/34	2,280,000.00	2,326,277.16	
	DBR 3.25% 07/04/42	2,030,000.00	2,218,084.57	
	DBR 4.0% 01/04/37	2,570,000.00	2,973,875.50	
	DBR 4.25% 07/04/39	1,810,000.00	2,179,925.99	
	DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,561,138.15	
	DBR 4.75% 07/04/34	2,500,000.00	3,012,468.74	
	DBR 4.75% 07/04/40	2,060,000.00	2,633,215.60	
	DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,676,643.40	
	DBR 5.625% 01/04/28	1,810,000.00	2,002,576.03	
	DBR 6.25% 01/04/30	1,570,000.00	1,875,043.61	
	DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	2,988,927.86	
	FRTR 0.25% 11/25/26	3,700,000.00	3,544,049.66	
	FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,376,047.50	
	FRTR 0.5% 05/25/29	4,260,000.00	3,871,392.15	
	FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,769,013.94	
	FRTR 0.5% 05/25/72	1,290,000.00	466,328.55	
	FRTR 0.5% 06/25/44	2,030,000.00	1,197,098.61	
	FRTR 0.75% 02/25/28	5,200,000.00	4,909,509.74	
	FRTR 0.75% 05/25/28	5,660,000.00	5,316,890.80	
	FRTR 0.75% 05/25/52	3,250,000.00	1,686,243.00	
	FRTR 0.75% 05/25/53	3,040,000.00	1,537,419.20	

	FRTR 0.75% 11/25/28	4,550,000.00	4,229,259.12	
	FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,900,993.93	
	FRTR 0% 02/25/27	4,000,000.00	3,787,186.63	
	FRTR 0% 05/25/32	3,780,000.00	3,047,953.86	
	FRTR 0% 11/25/29	4,820,000.00	4,215,709.40	
	FRTR 0% 11/25/30	6,120,000.00	5,190,968.68	
	FRTR 0% 11/25/31	5,340,000.00	4,382,144.16	
	FRTR 1.25% 05/25/34	5,510,000.00	4,691,555.62	
	FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,625,581.87	
	FRTR 1.25% 05/25/38	2,920,000.00	2,269,820.38	
	FRTR 1.5% 05/25/31	5,280,000.00	4,874,416.80	
	FRTR 1.5% 05/25/50	3,050,000.00	2,023,037.55	
	FRTR 1.75% 05/25/66	1,680,000.00	1,052,220.96	
	FRTR 1.75% 06/25/39	3,570,000.00	2,941,221.25	
	FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,796,014.11	
	FRTR 1% 11/25/25	3,870,000.00	3,812,603.06	
	FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,505,874.20	
	FRTR 2.5% 05/25/43	1,910,000.00	1,665,992.72	
	FRTR 2.5% 09/24/26	3,690,000.00	3,696,448.27	
	FRTR 2.5% 09/24/27	2,490,000.00	2,490,027.39	
	FRTR 2.75% 02/25/29	4,840,000.00	4,856,495.19	
	FRTR 2.75% 02/25/30	2,170,000.00	2,170,081.36	
	FRTR 2.75% 10/25/27	5,460,000.00	5,499,625.95	
	FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,181,885.42	
	FRTR 2% 11/25/32	3,160,000.00	2,946,858.00	
	FRTR 3.25% 05/25/45	2,860,000.00	2,779,719.80	
	FRTR 3.25% 05/25/55	920,000.00	857,242.41	
	FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,804,897.18	
	FRTR 3.5% 11/25/33	4,100,000.00	4,247,483.96	
	FRTR 3% 05/25/33	4,210,000.00	4,209,766.34	
	FRTR 3% 05/25/54	2,450,000.00	2,185,049.65	
	FRTR 3% 06/25/49	1,000,000.00	920,231.49	
	FRTR 3% 11/25/34	1,500,000.00	1,485,106.50	
	FRTR 4.5% 04/25/41	3,490,000.00	3,984,421.32	
	FRTR 4.75% 04/25/35	3,460,000.00	3,957,437.28	
	FRTR 4% 04/25/55	2,540,000.00	2,724,570.87	

	FRTR 4% 04/25/60	1,970,000.00	2,125,996.42	
	FRTR 4% 10/25/38	2,140,000.00	2,310,074.36	
	FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,613,297.12	
	FRTR 5.75% 10/25/32	4,370,000.00	5,235,150.75	
	IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	637,423.26	
	IRISH 0.2% 10/18/30	910,000.00	799,858.02	
	IRISH 0.35% 10/18/32	450,000.00	380,204.32	
	IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	544,511.60	
	IRISH 0.55% 04/22/41	410,000.00	286,066.22	
	IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	735,426.77	
	IRISH 0% 10/18/31	1,120,000.00	943,320.66	
	IRISH 1.1% 05/15/29	980,000.00	927,358.56	
	IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	388,808.79	
	IRISH 1.35% 03/18/31	370,000.00	345,919.47	
	IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	605,072.20	
	IRISH 1.7% 05/15/37	740,000.00	652,589.35	
	IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	981,314.00	
	IRISH 2.4% 05/15/30	930,000.00	929,616.84	
	IRISH 2.6% 10/18/34	200,000.00	198,926.60	
	IRISH 2% 02/18/45	1,010,000.00	872,058.24	
	IRISH 3% 10/18/43	370,000.00	376,056.34	
	NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	863,499.65	
	NETHER 0.5% 01/15/40	1,470,000.00	1,060,666.37	
	NETHER 0.5% 07/15/26	1,750,000.00	1,701,584.93	
	NETHER 0.5% 07/15/32	1,300,000.00	1,121,758.14	
	NETHER 0.75% 07/15/27	1,060,000.00	1,020,117.50	
	NETHER 0.75% 07/15/28	1,080,000.00	1,022,857.20	
	NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,159,074.57	
	NETHER 0% 01/15/27	1,730,000.00	1,650,813.57	
	NETHER 0% 01/15/29	1,770,000.00	1,609,485.78	
	NETHER 0% 01/15/38	1,390,000.00	968,989.85	
	NETHER 0% 01/15/52	1,810,000.00	880,578.55	
	NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,180,662.75	
	NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,167,146.56	
	NETHER 2.5% 01/15/30	1,210,000.00	1,217,339.12	
	NETHER 2.5% 01/15/33	1,210,000.00	1,207,835.31	

	NETHER 2.5% 07/15/33	1,170,000.00	1,163,938.23	
	NETHER 2.5% 07/15/34	1,220,000.00	1,208,097.06	
	NETHER 2.75% 01/15/47	1,900,000.00	1,896,559.10	
	NETHER 2% 01/15/54	1,300,000.00	1,105,840.45	
	NETHER 3.25% 01/15/44	840,000.00	898,804.60	
	NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,922,317.50	
	NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,878,397.90	
	NETHER 5.5% 01/15/28	1,600,000.00	1,758,166.71	
	OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,977,427.22	
	OBL 0% 04/16/27	2,920,000.00	2,775,865.13	
	OBL 0% 10/09/26	2,680,000.00	2,574,160.09	
	OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,472,254.11	
	OBL 2.1% 04/12/29	2,780,000.00	2,770,889.94	
	OBL 2.2% 04/13/28	870,000.00	872,445.57	
	OBL 2.4% 10/19/28	4,270,000.00	4,310,746.47	
	OBL 2.5% 10/11/29	1,900,000.00	1,926,191.50	
	PGB 0.3% 10/17/31	840,000.00	722,486.16	
	PGB 0.475% 10/18/30	1,000,000.00	892,975.00	
	PGB 0.7% 10/15/27	700,000.00	671,035.40	
	PGB 0.9% 10/12/35	640,000.00	519,848.96	
	PGB 1.15% 04/11/42	470,000.00	339,691.10	
	PGB 1.65% 07/16/32	710,000.00	662,181.50	
	PGB 1.95% 06/15/29	1,250,000.00	1,228,213.05	
	PGB 1% 04/12/52	590,000.00	345,202.65	
	PGB 2.125% 10/17/28	1,400,000.00	1,392,756.40	
	PGB 2.25% 04/18/34	790,000.00	754,513.20	
	PGB 2.875% 07/21/26	950,000.00	960,191.60	
	PGB 2.875% 10/20/34	500,000.00	500,463.10	
	PGB 3.5% 06/18/38	440,000.00	457,628.38	
	PGB 3.625% 06/12/54	290,000.00	297,491.42	
	PGB 3.875% 02/15/30	700,000.00	750,246.00	
	PGB 4.1% 02/15/45	590,000.00	655,622.75	
	PGB 4.1% 04/15/37	980,000.00	1,086,722.00	
	PGB 4.125% 04/14/27	800,000.00	837,154.64	
	RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	525,561.12	
	RAGB 0.5% 02/20/29	1,800,000.00	1,659,736.86	

RAGB 0.5% 04/20/27	1,490,000.00	1,427,047.50	
RAGB 0.7% 04/20/71	420,000.00	191,037.72	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,010,000.00	958,757.14	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	458,223.67	
RAGB 0.75% 10/20/26	1,480,000.00	1,437,398.24	
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	101,519.70	
RAGB 0.9% 02/20/32	1,120,000.00	988,682.80	
RAGB 0% 02/20/30	1,790,000.00	1,567,543.26	
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,418,990.65	
RAGB 0% 10/20/28	880,000.00	801,089.29	
RAGB 0% 10/20/40	650,000.00	404,883.51	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	813,033.45	
RAGB 1.5% 11/02/86	440,000.00	267,104.53	
RAGB 1.85% 05/23/49	660,000.00	526,246.05	
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	495,815.45	
RAGB 2.4% 05/23/34	930,000.00	898,413.94	
RAGB 2.9% 02/20/33	1,510,000.00	1,525,495.15	
RAGB 2.9% 02/20/34	1,060,000.00	1,067,193.68	
RAGB 2.9% 05/23/29	350,000.00	356,271.47	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	839,525.08	
RAGB 3.15% 10/20/53	500,000.00	501,240.09	
RAGB 3.2% 07/15/39	330,000.00	337,197.46	
RAGB 3.45% 10/20/30	330,000.00	345,294.84	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	483,783.80	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,550,000.00	1,740,529.87	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,090,000.00	1,124,960.66	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,299,306.85	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	320,777.16	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	217,051.92	
RFGB 0.125% 09/15/31	710,000.00	599,188.88	
RFGB 0.25% 09/15/40	350,000.00	228,709.33	
RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	555,447.33	
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	314,560.40	
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	513,728.46	
RFGB 0.5% 09/15/28	780,000.00	725,602.80	
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	481,796.50	

	RFGB 0.75% 04/15/31	510,000.00	453,965.28	
	RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	440,952.78	
	RFGB 0% 09/15/30	720,000.00	620,270.64	
	RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	550,875.19	
	RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	342,316.88	
	RFGB 1.375% 04/15/47	570,000.00	417,620.47	
	RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	520,925.45	
	RFGB 2.5% 04/15/30	460,000.00	458,828.95	
	RFGB 2.625% 07/04/42	470,000.00	443,061.48	
	RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	388,817.20	
	RFGB 2.75% 07/04/28	680,000.00	689,166.73	
	RFGB 2.875% 04/15/29	340,000.00	345,468.90	
	RFGB 2.95% 04/15/55	350,000.00	341,284.81	
	RFGB 3% 09/15/33	650,000.00	660,580.05	
	RFGB 3% 09/15/34	430,000.00	435,605.60	
	SPGB 0.1% 04/30/31	2,460,000.00	2,076,535.20	
	SPGB 0.5% 04/30/30	2,930,000.00	2,608,747.47	
	SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,199,318.62	
	SPGB 0.6% 10/31/29	1,970,000.00	1,783,387.31	
	SPGB 0.7% 04/30/32	2,500,000.00	2,142,937.50	
	SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,333,567.20	
	SPGB 0.8% 07/30/29	2,210,000.00	2,030,871.76	
	SPGB 0.85% 07/30/37	1,760,000.00	1,313,768.72	
	SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,581,097.27	
	SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,757,734.25	
	SPGB 0% 01/31/28	3,050,000.00	2,814,646.75	
	SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,526,605.04	
	SPGB 1.25% 10/31/30	3,370,000.00	3,097,022.14	
	SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	2,026,859.13	
	SPGB 1.4% 04/30/28	2,230,000.00	2,148,297.26	
	SPGB 1.4% 07/30/28	2,400,000.00	2,304,553.60	
	SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,560,460.36	
	SPGB 1.45% 10/31/27	2,100,000.00	2,038,528.80	
	SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	332,463.12	
	SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,466,620.50	
	SPGB 1.85% 07/30/35	2,190,000.00	1,935,426.18	

		SPGB 1.9% 10/31/52	1,890,000.00	1,305,870.45	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,285,336.35	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,940,451.12	
		SPGB 1% 07/30/42	1,350,000.00	908,830.80	
		SPGB 1% 10/31/50	2,000,000.00	1,126,228.00	
		SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,564,815.73	
		SPGB 2.35% 07/30/33	1,890,000.00	1,801,229.06	
		SPGB 2.5% 05/31/27	2,330,000.00	2,329,910.65	
		SPGB 2.55% 10/31/32	2,500,000.00	2,437,783.75	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,860,000.00	1,587,241.69	
		SPGB 2.8% 05/31/26	2,430,000.00	2,441,921.80	
		SPGB 2.9% 10/31/46	1,780,000.00	1,594,870.21	
		SPGB 3.15% 04/30/33	2,170,000.00	2,200,873.67	
		SPGB 3.25% 04/30/34	2,150,000.00	2,183,435.07	
		SPGB 3.45% 07/30/43	1,290,000.00	1,265,693.17	
		SPGB 3.45% 07/30/66	1,530,000.00	1,421,196.34	
		SPGB 3.45% 10/31/34	2,340,000.00	2,409,123.60	
		SPGB 3.5% 05/31/29	2,120,000.00	2,197,252.80	
		SPGB 3.55% 10/31/33	2,270,000.00	2,364,655.59	
		SPGB 3.9% 07/30/39	1,660,000.00	1,749,540.40	
		SPGB 4.2% 01/31/37	1,800,000.00	1,971,864.89	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,780,000.00	2,051,770.40	
		SPGB 4.9% 07/30/40	1,880,000.00	2,204,857.79	
		SPGB 4% 10/31/54	770,000.00	802,128.63	
		SPGB 5.15% 10/31/28	3,710,000.00	4,067,357.58	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,640,000.00	2,006,685.96	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,694,951.45	
		SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,443,339.43	
		SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,033,748.62	
		ユーロ 小計	717,500,000.00	676,609,905.93 (110,991,088,968)	
	イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	870,000.00	830,510.70	
		UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,331,782.25	
		UKT 0.25% 07/31/31	2,490,000.00	1,919,690.40	
		UKT 0.375% 10/22/26	2,980,000.00	2,769,722.26	
		UKT 0.375% 10/22/30	2,180,000.00	1,750,602.13	

	UKT 0.5% 01/31/29	2,880,000.00	2,475,878.40	
	UKT 0.5% 10/22/61	2,420,000.00	689,700.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,250,000.00	1,523,925.00	
	UKT 0.625% 10/22/50	1,450,000.00	558,809.48	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,530,000.00	731,601.04	
	UKT 0.875% 07/31/33	3,400,000.00	2,547,756.00	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,460,000.00	1,250,293.63	
	UKT 1.125% 01/31/39	2,130,000.00	1,361,990.16	
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	363,495.30	
	UKT 1.25% 07/22/27	1,250,000.00	1,156,787.50	
	UKT 1.25% 07/31/51	2,810,000.00	1,303,840.00	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,190,000.00	1,309,303.87	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,800,000.00	2,673,958.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	1,450,000.00	785,351.90	
	UKT 1.5% 07/31/53	1,680,000.00	812,078.40	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,460,000.00	1,327,797.00	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,640,000.00	812,587.20	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,790,000.00	772,027.00	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	605,806.56	
	UKT 1.75% 07/22/57	1,900,000.00	952,090.00	
	UKT 1.75% 09/07/37	2,400,000.00	1,752,992.64	
	UKT 1% 01/31/32	3,700,000.00	2,953,747.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	845,375.84	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,310,000.00	1,850,541.00	
	UKT 3.25% 01/31/33	3,960,000.00	3,656,823.39	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,000,000.00	1,649,534.18	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,470,000.00	1,130,956.26	
	UKT 3.75% 01/29/38	2,430,000.00	2,227,945.50	
	UKT 3.75% 03/07/27	1,970,000.00	1,940,659.41	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,150,000.00	952,200.00	
	UKT 3.75% 10/22/53	3,060,000.00	2,518,686.00	
	UKT 4.125% 01/29/27	3,780,000.00	3,756,473.28	
	UKT 4.125% 07/22/29	1,510,000.00	1,497,618.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,730,000.00	1,691,782.57	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,320,000.00	1,317,585.66	
	UKT 4.25% 07/31/34	2,180,000.00	2,147,954.64	

	UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,211,322.19	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,800,000.00	1,800,558.72	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,370,261.60	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,930,000.00	1,763,769.10	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,440,000.00	1,306,293.12	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,530,130.05	
	UKT 4.375% 01/31/40	500,000.00	481,343.25	
	UKT 4.375% 07/31/54	1,390,000.00	1,275,844.86	
	UKT 4.5% 06/07/28	3,370,000.00	3,385,478.41	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,398,940.48	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,290,000.00	2,205,706.26	
	UKT 4.625% 01/31/34	2,230,000.00	2,264,063.25	
	UKT 4.75% 10/22/43	2,080,000.00	2,055,029.60	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,910,000.00	1,962,797.36	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,800,000.00	1,821,087.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,073,595.93	
	UKT 4% 10/22/31	1,540,000.00	1,509,511.08	
	UKT 4% 10/22/63	1,440,000.00	1,228,464.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	2,010,000.00	2,145,275.01	
	イギリスポンド 小計	117,830,000.00	96,297,730.82 (19,042,876,269)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,280,000.00	4,664,246.40	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,780,000.00	6,516,156.30	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,250,000.00	6,828,920.00	
	SGB 1.75% 11/11/33	4,610,000.00	4,468,426.90	
	SGB 1% 11/12/26	7,940,000.00	7,808,910.60	
	SGB 2.25% 05/11/35	2,470,000.00	2,481,998.76	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,355,927.19	
	SGB 3.5% 03/30/39	3,970,000.00	4,528,320.95	
	スウェーデンクローナ 小計	43,600,000.00	42,652,907.10 (603,538,635)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,780,000.00	4,061,981.86	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,560,977.20	
	NGB 1.5% 02/19/26	5,320,000.00	5,152,985.23	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,970,000.00	4,744,691.25	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,100,000.00	3,740,891.25	

		NGB 2.125% 05/18/32	3,730,000.00	3,330,267.09	
		NGB 2% 04/26/28	4,150,000.00	3,912,611.70	
		NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,798,554.90	
		NGB 3.625% 04/13/34	4,210,000.00	4,139,903.50	
		NGB 3% 08/15/33	5,180,000.00	4,872,230.30	
	ノルウェークローネ 小計		43,500,000.00	40,315,094.28 (560,782,961)	
デンマーク クローネ		DGB 0.25% 11/15/52	5,870,000.00	3,397,736.47	
		DGB 0.5% 11/15/27	4,990,000.00	4,797,660.23	
		DGB 0.5% 11/15/29	5,490,000.00	5,122,332.33	
		DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,699,659.21	
		DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,545,783.49	
		DGB 2.25% 11/15/26	2,040,000.00	2,056,773.90	
		DGB 2.25% 11/15/33	4,120,000.00	4,168,916.76	
		DGB 4.5% 11/15/39	9,470,000.00	12,074,152.45	
	デンマーククローネ 小計		45,080,000.00	43,863,014.84 (964,986,326)	
ポーランド ズロチ		POLGB 0.25% 10/25/26	4,500,000.00	4,119,286.50	
		POLGB 1.25% 10/25/30	3,900,000.00	3,088,392.45	
		POLGB 1.75% 04/25/32	4,610,000.00	3,562,923.77	
		POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,711,193.20	
		POLGB 2.5% 07/25/27	4,530,000.00	4,253,660.94	
		POLGB 2.75% 04/25/28	3,190,000.00	2,956,069.32	
		POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,345,430.00	
		POLGB 3.75% 05/25/27	2,110,000.00	2,050,530.17	
		POLGB 4.75% 07/25/29	1,650,000.00	1,609,115.47	
		POLGB 5.75% 04/25/29	6,600,000.00	6,714,125.19	
		POLGB 5% 10/25/34	2,410,000.00	2,288,844.48	
		POLGB 6% 10/25/33	4,350,000.00	4,461,141.19	
		POLGB 7.5% 07/25/28	3,970,000.00	4,274,096.04	
	ポーランドズロチ 小計		52,720,000.00	49,434,808.72 (1,873,426,002)	
オーストラ リアドル		ACGB 0.25% 11/21/25	1,960,000.00	1,883,344.40	
		ACGB 0.5% 09/21/26	2,390,000.00	2,238,928.10	
		ACGB 1.25% 05/21/32	2,770,000.00	2,209,075.00	
		ACGB 1.5% 06/21/31	3,250,000.00	2,721,452.50	

	ACGB 1.75% 06/21/51	1,860,000.00	970,659.60	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,000,000.00	1,634,700.00	
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,213,630.60	
	ACGB 1% 12/21/30	1,500,000.00	1,236,360.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,040,000.00	1,917,844.80	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,141,544.60	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,014,404.30	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,950,000.00	1,648,900.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,530,000.00	1,472,625.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,740,000.00	1,653,139.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,780,000.00	1,665,243.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,110,000.00	2,034,272.10	
	ACGB 3.25% 06/21/39	940,000.00	791,348.40	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,690,000.00	1,544,136.10	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,440,000.00	1,316,232.00	
	ACGB 3.75% 05/21/34	2,340,000.00	2,196,324.00	
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	990,535.50	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,632,043.20	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,770,000.00	1,773,823.20	
	ACGB 4.25% 06/21/34	960,000.00	937,526.40	
	ACGB 4.25% 12/21/35	1,090,000.00	1,055,643.20	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,720,000.00	2,721,006.40	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,160,000.00	2,193,350.40	
	ACGB 4.75% 06/21/54	720,000.00	691,264.80	
	オーストラリアドル 小計	52,350,000.00	46,499,357.70 (4,691,785,191)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	1,340,000.00	1,178,411.02	
	NZGB 0.5% 05/15/26	730,000.00	693,412.47	
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	840,979.53	
	NZGB 1.75% 05/15/41	560,000.00	357,029.49	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	509,548.56	
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	394,496.76	
	NZGB 2% 05/15/32	900,000.00	761,629.91	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,320,000.00	1,227,501.31	
	NZGB 3% 04/20/29	940,000.00	899,149.32	
	NZGB 4.25% 05/15/34	750,000.00	731,184.09	

		NZGB 4.25% 05/15/36	610,000.00	583,407.08	
		NZGB 4.5% 04/15/27	930,000.00	942,583.83	
		NZGB 4.5% 05/15/30	1,210,000.00	1,227,086.28	
		NZGB 4.5% 05/15/35	440,000.00	434,190.43	
		NZGB 5% 05/15/54	380,000.00	371,435.53	
		ニュージーランドドル 小計	12,340,000.00	11,152,045.61 (1,018,850,886)	
シンガポ ールドル		SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	773,252.00	
		SIGB 1.25% 11/01/26	870,000.00	844,996.20	
		SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	520,240.00	
		SIGB 1.875% 03/01/50	730,000.00	611,740.00	
		SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	349,230.00	
		SIGB 2.125% 06/01/26	1,030,000.00	1,021,348.00	
		SIGB 2.25% 08/01/36	760,000.00	715,920.00	
		SIGB 2.375% 07/01/39	560,000.00	526,083.60	
		SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	718,200.00	
		SIGB 2.625% 08/01/32	460,000.00	453,560.00	
		SIGB 2.75% 03/01/46	820,000.00	808,901.30	
		SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	619,646.27	
		SIGB 2.875% 07/01/29	900,000.00	904,950.00	
		SIGB 2.875% 08/01/28	140,000.00	140,840.00	
		SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	421,806.00	
		SIGB 2.875% 09/01/30	840,000.00	845,460.00	
		SIGB 3.25% 06/01/54	210,000.00	229,915.35	
		SIGB 3.375% 05/01/34	160,000.00	167,098.40	
		SIGB 3.375% 09/01/33	880,000.00	917,400.00	
		SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	752,432.00	
	SIGB 3% 04/01/29	150,000.00	151,725.00		
	SIGB 3% 08/01/72	620,000.00	655,650.00		
		シンガポールドル 小計	13,410,000.00	13,150,394.12 (1,517,292,473)	
マレーシア リンギット		MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,538,540.98	
		MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,510,230.72	
		MGS 3.519% 04/20/28	710,000.00	708,958.10	
		MGS 3.582% 07/15/32	1,310,000.00	1,284,390.20	
		MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,945,903.45	

	MGS 3.757% 05/22/40	2,950,000.00	2,844,328.96	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,761,524.76	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,830,000.00	1,821,529.03	
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,185,431.40	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,140,599.73	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,991,733.63	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,492,717.57	
	MGS 3.906% 07/15/26	1,210,000.00	1,219,478.89	
	MGS 4.054% 04/18/39	460,000.00	461,440.44	
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,999,450.57	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,547,954.50	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,794,094.05	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,750,000.00	1,774,885.00	
	MGS 4.457% 03/31/53	1,740,000.00	1,809,258.43	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,930,000.00	3,044,526.66	
	MGS 4.504% 04/30/29	720,000.00	746,442.93	
	MGS 4.642% 11/07/33	2,780,000.00	2,936,717.77	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,970,000.00	2,113,108.87	
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,056,068.28	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	2,984,678.33	
	MGS 4.893% 06/08/38	2,130,000.00	2,320,862.05	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,860,258.79	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,137,079.41	
	マレーシアリングット 小計	51,860,000.00	53,032,193.50 (1,847,344,641)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	3,260,000.00	3,101,618.27	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	2,970,000.00	2,354,229.77	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,880,000.00	1,993,951.09	
	ILGOV 1% 03/31/30	3,530,000.00	2,937,924.00	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,486,541.96	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	1,520,000.00	1,006,765.75	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,530,000.00	2,390,627.86	
	ILGOV 3.75% 02/28/29	2,940,000.00	2,851,865.15	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,570,000.00	2,140,535.29	
	ILGOV 3.75% 09/30/27	970,000.00	950,135.45	
	ILGOV 4% 03/30/35	1,730,000.00	1,628,269.28	

	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,190,000.00	2,341,406.52	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,384,983.80	
	イスラエルシエケル 小計	31,130,000.00	27,568,854.19 (1,125,647,344)	
オフショア 人民元	CGB 1.35% 09/25/26	32,400,000.00	32,352,501.27	
	CGB 1.62% 08/15/27	21,000,000.00	21,075,944.40	
	CGB 1.67% 06/15/26	34,680,000.00	34,869,859.12	
	CGB 1.85% 05/15/27	42,700,000.00	43,087,707.46	
	CGB 1.87% 09/15/31	10,120,000.00	10,059,613.96	
	CGB 1.91% 07/15/29	23,000,000.00	23,173,744.30	
	CGB 1.99% 03/15/26	25,520,000.00	25,715,860.89	
	CGB 2.04% 02/25/27	41,310,000.00	41,817,989.07	
	CGB 2.05% 04/15/29	36,880,000.00	37,348,342.80	
	CGB 2.11% 08/25/34	22,200,000.00	22,221,156.60	
	CGB 2.12% 06/25/31	32,000,000.00	32,319,952.00	
	CGB 2.18% 08/15/26	35,600,000.00	36,043,821.64	
	CGB 2.27% 05/25/34	38,000,000.00	38,519,737.40	
	CGB 2.28% 03/25/31	50,700,000.00	51,650,315.73	
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,493,110.22	
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,688,274.29	
	CGB 2.33% 12/15/25	35,250,000.00	35,593,109.40	
	CGB 2.35% 02/25/34	25,200,000.00	25,697,684.87	
	CGB 2.37% 01/15/29	34,560,000.00	35,444,366.20	
	CGB 2.37% 01/20/27	43,880,000.00	44,702,341.91	
	CGB 2.39% 11/15/26	42,750,000.00	43,509,496.50	
	CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	43,651,716.49	
	CGB 2.44% 10/15/27	17,700,000.00	18,141,632.70	
	CGB 2.46% 02/15/26	29,300,000.00	29,672,622.75	
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,466,824.00	
	CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	27,252,176.00	
	CGB 2.5% 07/25/27	26,760,000.00	27,405,643.87	
	CGB 2.52% 08/25/33	58,370,000.00	60,251,428.53	
	CGB 2.54% 12/25/30	30,500,000.00	31,575,701.45	
	CGB 2.55% 10/15/28	27,250,000.00	28,100,265.40	
CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	33,310,189.97		
CGB 2.6% 09/15/30	30,500,000.00	31,670,159.95		

	CGB 2.62% 04/15/28	34,000,000.00	35,084,664.59	
	CGB 2.62% 06/25/30	36,400,000.00	37,860,877.60	
	CGB 2.62% 09/25/29	20,940,000.00	21,767,460.85	
	CGB 2.64% 01/15/28	38,220,000.00	39,430,794.31	
	CGB 2.67% 05/25/33	34,280,000.00	35,803,245.51	
	CGB 2.67% 11/25/33	23,400,000.00	24,455,857.14	
	CGB 2.68% 05/21/30	30,700,000.00	32,081,008.80	
	CGB 2.69% 08/12/26	39,900,000.00	40,752,323.85	
	CGB 2.69% 08/15/32	19,420,000.00	20,337,406.62	
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	15,232,257.25	
	CGB 2.75% 06/15/29	28,340,000.00	29,566,985.96	
	CGB 2.76% 05/15/32	13,150,000.00	13,814,990.24	
	CGB 2.79% 12/15/29	30,300,000.00	31,763,486.97	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	24,085,452.50	
	CGB 2.8% 03/25/30	39,490,000.00	41,438,578.76	
	CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,851,124.58	
	CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	32,082,534.49	
	CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	12,024,452.04	
	CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	25,683,684.48	
	CGB 2.91% 10/14/28	24,320,000.00	25,444,663.80	
	CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	13,183,704.11	
	CGB 3.02% 05/27/31	27,560,000.00	29,453,603.49	
	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,212,494.56	
	CGB 3.12% 10/25/52	12,970,000.00	15,121,991.47	
	CGB 3.19% 04/15/53	18,360,000.00	21,778,092.21	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,421,077.65	
	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,870,489.49	
	CGB 3.29% 05/23/29	35,000,000.00	37,544,923.50	
	CGB 3.32% 04/15/52	18,600,000.00	22,401,116.46	
	CGB 3.39% 03/16/50	20,930,000.00	25,276,614.72	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	10,379,655.37	
	CGB 3.72% 04/12/51	15,140,000.00	19,355,557.37	
	CGB 3.81% 09/14/50	24,020,000.00	31,042,861.91	
	CGB 3.86% 07/22/49	19,660,000.00	25,421,769.95	
	CGB 3% 10/15/53	13,770,000.00	15,865,192.25	
	CGB 4.08% 10/22/48	19,370,000.00	25,665,955.06	

	オフショア人民元 小計	1,854,270,000.00	1,942,440,241.05 (41,319,394,563)	
	合計		366,931,042,465 (366,931,042,465)	

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 211 銘柄	100.0%	46.7%
カナダドル	国債証券 37 銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14 銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 386 銘柄	100.0%	30.2%
イギリスポンド	国債証券 60 銘柄	100.0%	5.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8 銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 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 13 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%
マレーシアリンギット	国債証券 28 銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 68 銘柄	100.0%	11.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	

流動資産	
預金	6,901,090,588
コール・ローン	304,545,609
株式	812,746,979,765
投資信託受益証券	116,967,954
投資証券	15,481,280,800
派生商品評価勘定	472,121,849
未収入金	17,239,950
未収配当金	504,596,433
未収利息	1,809
差入委託証拠金	8,535,540,956
流動資産合計	845,080,365,713
資産合計	845,080,365,713
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	79,289,790
前受金	392,590,501
未払解約金	593,661,853
流動負債合計	1,065,542,144
負債合計	1,065,542,144
純資産の部	
元本等	
元本	117,559,333,497
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	726,455,490,072
元本等合計	844,014,823,569
純資産合計	844,014,823,569
負債純資産合計	845,080,365,713

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年11月11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</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

	2024年11月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		117,559,333,497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)	7.1795円 (71,795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11月11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・	

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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> <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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年11月11日
期首元本額	116,434,985,318円
期中追加設定元本額	12,831,041,652円
期中一部解約元本額	11,706,693,473円
期末元本額	117,559,333,497円
期末元本額の内訳	

SBI 資産設計オープン (資産成長型)	1,351,629,243 円
SBI 資産設計オープン (分配型)	5,078,511 円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,442,526,495 円
世界経済インデックスファンド	15,192,223,927 円
外国株式インデックス・オープン	861,182,531 円
DCマイセクション25	513,048,811 円
DCマイセクション50	2,931,213,615 円
DCマイセクション75	3,903,921,539 円
DC外国株式インデックス・オープン	13,460,271,533 円
DCマイセクションS25	324,531,670 円
DCマイセクションS50	1,769,535,658 円
DCマイセクションS75	1,931,524,973 円
DCターゲット・イヤーフンド2025	7,875,088 円
DCターゲット・イヤーフンド2035	116,854,340 円
DCターゲット・イヤーフンド2045	97,012,724 円
DC世界経済インデックスファンド	8,642,101,180 円
外国株式インデックス・オープン (SMA専用)	879,020,788 円
マイセクション50VA1 (適格機関投資家専用)	1,693,083 円
マイセクション75VA1 (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VA1 (適格機関投資家専用)	12,051,435 円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	4,688,963 円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	18,639,142 円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	5,276,097 円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	16,520,878 円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	88,449,414 円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	100,454,127 円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	787,649,927 円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	52,016,097 円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	10,070,336 円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	85,951,188 円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	27,056,458 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	627,958,922 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)	649,592,372 円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,144,886,358 円
コア投資戦略ファンド (安定型)	125,404,541 円
コア投資戦略ファンド (成長型)	310,144,127 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)	1,558,653,486 円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	961,976,586 円
コア投資戦略ファンド (切替型)	125,546,804 円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	417,686,970 円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	21,982,487 円
SMT インデックスバランス・オープン	100,516,018 円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	69,966,699 円
外国株式SMTBセクション (SMA専用)	6,205,772,915 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	258,472,542 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	1,309,385,444 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	211,771,319 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,603,655 円
My SMT グローバル株式インデックス (ノーロード)	3,087,174,177 円
グローバル経済コア	697,238,813 円
SBI 資産設計オープン (つみたてNISA対応型)	15,299,636 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,288,993 円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	102,817,011 円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	35,310,017 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2030	172,378,136 円

DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	182,441,059円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	83,010,716円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	109,052,312円
10資産分散投資ファンド	58,526,299円
グローバル10資産バランスファンド	20,199,543円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	4,661,851円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2035	142,030円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2040	24,811円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2045	164,541円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2050	40,072円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2055	77,009円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2060	14,732円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2065	23,444円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	387,599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）	67,412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）	50,744,462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）	474,545,293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）	684,072,518円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,475,651,429円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	107,451,616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）	54,550,137円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	75,230,870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）	92,075,871円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	153,127,006円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	160,396,345円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	159,803,351円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	150,009,176円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	148,763,609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）	43,648,234円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	101,697,279円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	72,004,316,686	
投資信託受益証券	△12,326,857	
投資証券	1,966,870,871	
合計	73,958,860,700	

（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11月11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	14,499,859,607	—	14,892,450,108	392,590,501

合計	14,499,859,607	—	14,892,450,108	392,590,501
----	----------------	---	----------------	-------------

(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11月11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				
	売建	917,952,760	—	917,711,202	241,558
	アメリカドル	722,540,000	—	722,673,832	△133,832
	ユーロ	85,661,660	—	85,289,320	372,340
	イギリスポンド	59,304,600	—	59,309,400	△4,800
	オーストラリア ドル	50,446,500	—	50,438,650	7,850
合計		917,952,760	—	917,711,202	241,558

(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。

- ①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。
- ②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	21.77	718,605.93	
	BAKER HUGHES CO	77,332	43.01	3,326,435.98	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	205.67	3,722,421.33	
	CHEVRON CORP	140,988	156.93	22,125,246.84	
	CHORD ENERGY CORP	4,800	132.01	633,648.00	
	CONOCOPHILLIPS	93,272	111.59	10,408,222.48	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	24.58	1,340,740.68	

DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	38.87	1,953,450.72
DIAMONDBACK ENERGY INC	15,274	181.88	2,778,035.12
EOG RESOURCES INC	45,763	134.12	6,137,733.56
EQT CORPORATION	43,539	41.22	1,794,677.58
EXPAND ENERGY CORP	16,182	92.49	1,496,673.18
EXXON MOBIL	360,081	121.11	43,609,409.91
HALLIBURTON CO	70,302	29.23	2,054,927.46
HESS CORP	21,602	142.18	3,071,372.36
HF SINCLAIR CORP	13,429	41.81	561,466.49
KINDER MORGAN INC	160,038	26.88	4,301,821.44
MARATHON OIL CORP	51,405	28.50	1,465,042.50
MARATHON PETROLEUM CORP	27,588	153.75	4,241,655.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	55,201	50.53	2,789,306.53
ONEOK INC	47,287	107.16	5,067,274.92
OVINTIV INC	20,398	43.17	880,581.66
PHILLIPS 66	34,702	126.45	4,388,067.90
SCHLUMBERGER	117,834	43.18	5,088,072.12
TARGA RESOURCES CORP	17,298	192.28	3,326,059.44
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,599	1,374.06	2,197,121.94
VALERO ENERGY CORP	26,282	136.69	3,592,486.58
WILLIAMS COS	97,655	56.31	5,498,953.05
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	312.99	5,470,752.21
ALBEMARLE CORP	8,403	100.84	847,358.52
AMCOR PLC	110,292	10.22	1,127,184.24
AVERY DENNISON CORP	6,638	205.11	1,361,520.18
BALL CORP	25,896	60.26	1,560,492.96
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	84.80	727,753.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,676	83.71	1,395,947.96
CORTEVA INC	57,731	58.33	3,367,449.23
CRH PLC	55,795	100.67	5,616,882.65
CROWN HOLDINGS INC	9,940	93.40	928,396.00
DOW INC	56,967	46.49	2,648,395.83
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	84.17	2,871,796.23
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	101.47	896,183.04
ECOLAB INC	20,345	250.04	5,087,063.80
FREEPORT-MCMORAN INC	117,378	46.36	5,441,644.08

INT'L PAPER CO	25,191	57.38	1,445,459.58	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	92.28	1,781,649.96	
LINDE PLC	38,804	459.48	17,829,661.92	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	85.30	1,684,248.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	619.58	3,108,432.86	
MOSAIC CO/THE	27,732	27.73	769,008.36	
NEWMONT CORPORATION	92,555	45.04	4,168,677.20	
NUCOR CORP	18,727	158.84	2,974,596.68	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,847	240.59	1,887,909.73	
PPG INDUSTRIES INC	19,981	125.52	2,508,015.12	
RELIANCE INC	4,126	320.62	1,322,878.12	
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	134.77	1,409,155.12	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,348	386.67	7,481,291.16	
SMURFIT WESTROCK PLC	40,860	52.39	2,140,655.40	
STEEL DYNAMICS INC	11,618	148.55	1,725,853.90	
VULCAN MATERIALS CO	10,153	292.31	2,967,823.43	
WESTLAKE CORP	2,222	132.15	293,637.30	
3 M COMPANY	43,663	134.34	5,865,687.42	
AECOM	10,456	110.39	1,154,237.84	
AERCAP HOLDINGS NV	14,679	97.52	1,431,496.08	
ALLEGION PLC	7,721	143.78	1,110,125.38	
AMETEK INC	17,753	190.92	3,389,402.76	
AXON ENTERPRISE INC	6,088	603.18	3,672,159.84	
BOEING CO	58,425	151.68	8,861,904.00	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,522	178.35	1,698,248.70	
CARLISLE COS INC	3,456	450.85	1,558,137.60	
CARRIER GLOBAL CORP	66,700	76.68	5,114,556.00	
CATERPILLAR	39,447	393.37	15,517,266.39	
CNH INDUSTRIAL NV	83,635	10.66	891,549.10	
CUMMINS INC	11,413	356.46	4,068,277.98	
DEERE&CO	21,321	394.06	8,401,753.26	
DOVER CORP	10,657	201.50	2,147,385.50	
EATON CORP	32,052	366.67	11,752,506.84	
EMCOR GROUP INC	3,640	514.15	1,871,506.00	
EMERSON ELECTRIC CO	46,910	127.26	5,969,766.60	
FASTENAL CO	44,011	83.33	3,667,436.63	

FERGUSON ENTERPRISES INC	16,260	207.46	3,373,299.60
FORTIVE CORP	30,046	75.20	2,259,459.20
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	79.05	815,005.50
GE AEROSPACE	87,134	184.81	16,103,234.54
GE VERNOVA INC	22,026	341.18	7,514,830.68
GENERAL DYNAMICS CORP	19,198	309.47	5,941,205.06
GRACO INC	13,378	87.81	1,174,722.18
GRAINGER (WW) INC	3,649	1,202.35	4,387,375.15
HEICO CORP	3,640	259.47	944,470.80
HEICO CORP-CLASS A	5,700	202.69	1,155,333.00
HONEYWELL INTL INC	52,473	219.49	11,517,298.77
HOWMET AEROSPACE INC	31,648	113.65	3,596,795.20
HUBBELL INC	4,458	467.93	2,086,031.94
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,433	202.66	695,731.78
IDEX CORP	5,916	228.51	1,351,865.16
ILLINOIS TOOL WORKS	24,149	271.95	6,567,320.55
INGERSOLL-RAND INC	31,562	102.61	3,238,576.82
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	40.81	518,287.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	54,141	84.62	4,581,411.42
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	260.60	3,826,129.20
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	630.95	1,593,779.70
LOCKHEED MARTIN CORP	17,339	564.56	9,788,905.84
MASCO CORP	18,934	80.95	1,532,707.30
NORDSON CORP	4,121	261.44	1,077,394.24
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,345	528.99	6,001,391.55
OTIS WORLDWIDE CORP	33,752	100.03	3,376,212.56
OWENS CORNING	6,460	190.44	1,230,242.40
PACCAR INC	43,301	114.38	4,952,768.38
PARKER HANNIFIN CORP	10,443	695.58	7,263,941.94
PENTAIR PLC	14,383	104.35	1,500,866.05
QUANTA SERVICES INC	11,573	330.98	3,830,431.54
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,652	272.14	2,626,695.28
RTX CORP	105,649	123.55	13,052,933.95
SMITH (A. O.) CORP	9,016	74.86	674,937.76
SNAP-ON INC	4,000	359.27	1,437,080.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	90.17	1,135,961.66

TEXTRON	13,876	87.56	1,214,982.56
TORO CO	8,812	84.81	747,345.72
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,000	410.58	7,390,440.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,495	1,350.98	6,072,655.10
UNITED RENTALS INC	5,364	875.01	4,693,553.64
VERTIV HOLDINGS CO-A	29,005	125.75	3,647,378.75
WABTEC CORP	13,304	200.69	2,669,979.76
WATSCO INC	2,656	528.50	1,403,696.00
XYLEM INC	19,668	124.37	2,446,109.16
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,020	304.73	10,062,184.60
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,202	183.50	2,055,567.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,640	225.21	2,171,024.40
CINTAS CORP	29,848	225.72	6,737,290.56
COPART INC	69,100	56.12	3,877,892.00
DAYFORCE INC	10,668	81.14	865,601.52
EQUIFAX INC	10,261	270.93	2,780,012.73
JACOBS SOLUTIONS INC	11,026	146.43	1,614,537.18
LEIDOS HOLDINGS	9,314	198.42	1,848,083.88
PAYCHEX INC	26,671	148.57	3,962,510.47
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	228.75	968,756.25
REPUBLIC SERVICES INC	18,062	211.59	3,821,738.58
ROLLINS INC	25,466	50.18	1,277,883.88
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,884	74.78	1,486,925.52
TRANSUNION	15,741	106.62	1,678,305.42
VERALTO CORP	20,685	105.55	2,183,301.75
VERISK ANALYTICS INC	11,932	284.98	3,400,381.36
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	184.04	3,639,391.00
WASTE MANAGEMENT INC	32,252	224.12	7,228,318.24
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	108.56	908,321.52
CSX CORP	152,551	36.00	5,491,836.00
DELTA AIR LINES INC	15,193	61.05	927,532.65
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	120.06	1,474,336.80
FEDEX CORP	18,843	286.28	5,394,374.04
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	190,364	4.23	805,239.72
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	192.13	1,104,363.24
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	59.60	811,930.80

NORFOLK SOUTHERN CORP	17,982	271.67	4,885,169.94
OLD DOMINION FREIGHT LINE	16,382	226.11	3,704,134.02
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	31.78	430,078.74
U-HAUL HOLDING CO	6,606	67.30	444,583.80
UBER TECHNOLOGIES INC	149,157	72.04	10,745,270.28
UNION PACIFIC CORP	48,392	241.49	11,686,184.08
UNITED PARCEL SERVICE B	58,139	132.44	7,699,929.16
APTIV PLC	21,896	56.25	1,231,650.00
FORD MOTOR COMPANY	320,913	10.97	3,520,415.61
GENERAL MOTORS CO	89,296	55.58	4,963,071.68
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	10.59	543,648.24
TESLA INC	230,394	321.22	74,007,160.68
DECKERS OUTDOOR CORP	12,618	175.61	2,215,846.98
DR HORTON INC	24,692	168.79	4,167,762.68
GARMIN LTD	13,022	212.72	2,770,039.84
LENNAR CORP-CL A	18,864	172.58	3,255,549.12
LULULEMON ATHLETICA INC	9,694	308.53	2,990,889.82
NIKE B	98,375	75.88	7,464,695.00
NVR INC	247	9,306.94	2,298,814.18
PULTE GROUP INC	16,747	132.70	2,222,326.90
AIRBNB INC-CLASS A	34,827	134.61	4,688,062.47
BOOKING HOLDINGS INC	2,707	4,943.27	13,381,431.89
CARNIVAL CORPORATION	86,858	24.07	2,090,672.06
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	110,522	58.81	6,499,798.82
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	168.44	1,550,827.08
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	459.73	1,309,311.04
DOORDASH INC - A	24,442	171.40	4,189,358.80
DRAFTKINGS INC	32,654	40.13	1,310,405.02
EXPEDIA GROUP INC	9,628	180.76	1,740,357.28
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	14,432	248.04	3,579,713.28
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	247.65	4,862,607.75
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	155.17	587,628.79
LAS VEGAS SANDS CORP	30,565	50.38	1,539,864.70
MARRIOTT INTL A	19,516	280.80	5,480,092.80
MCDONALD'S CORP	58,178	298.97	17,393,476.66
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,462	36.69	567,300.78

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,480	225.27	4,613,529.60
STARBUCKS CORP	91,593	97.55	8,934,897.15
WYNN RESORTS LTD	6,702	84.30	564,978.60
YUM BRANDS INC	22,162	137.21	3,040,848.02
ALPHABET INC-CL A	471,500	178.35	84,092,025.00
ALPHABET INC-CL C	405,784	179.86	72,984,310.24
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	393.71	2,831,562.32
COMCAST CORP-CL A	317,894	43.91	13,958,725.54
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	157.91	3,116,038.03
FOX CORP - CLASS A	21,544	44.60	960,862.40
FOX CORP- CLASS B	10,345	41.56	429,938.20
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	29.83	850,483.13
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	81.45	1,252,619.55
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	123.00	1,428,399.00
MATCH GROUP INC	22,730	30.56	694,628.80
META PLATFORMS INC-CLASS A	175,905	589.34	103,667,852.70
NETFLIX INC	34,588	795.04	27,498,843.52
NEWS CORP-CLASS A	33,479	29.52	988,300.08
OMNICOM GROUP	17,139	104.46	1,790,339.94
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	61,829	11.07	684,447.03
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	29.18	1,335,481.06
ROBLOX CORP -CLASS A	35,113	52.40	1,839,921.20
ROKU INC	9,122	73.82	673,386.04
SEA LTD-ADR	28,338	93.56	2,651,303.28
SNAP INC - A	72,602	12.01	871,950.02
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	177.90	2,289,039.30
THE WALT DISNEY CO	146,237	99.02	14,480,387.74
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,780	125.13	4,602,281.40
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	9.18	1,628,651.34
AMAZON.COM	751,797	208.18	156,509,099.46
AUTOZONE INC	1,368	3,110.12	4,254,644.16
BATH & BODY WORKS INC	13,452	30.00	403,560.00
BEST BUY COMPANY INC	15,285	89.20	1,363,422.00
BURLINGTON STORES INC	5,108	263.29	1,344,885.32
CARMAX INC	10,695	75.54	807,900.30
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	202.94	1,004,553.00

EBAY	41,952	61.89	2,596,409.28
GENUINE PARTS CO	12,194	122.41	1,492,667.54
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	40.05	280,350.00
HOME DEPOT	79,596	405.90	32,308,016.40
LKQ CORP	19,286	38.37	740,003.82
LOWES COMPANIES	45,655	271.10	12,377,070.50
MERCADOLIBRE INC	3,725	1,872.01	6,973,237.25
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,840	1,217.70	5,893,668.00
POOL CORP	2,664	372.58	992,553.12
ROSS STORES INC	27,581	143.40	3,955,115.40
TJX COMPANIES INC	91,449	117.83	10,775,435.67
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,065	288.56	2,615,796.40
ULTA BEAUTY INC	3,920	385.26	1,510,219.20
WILLIAMS-SONOMA INC	11,384	129.80	1,477,643.20
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	19.26	481,500.00
COSTCO WHOLESALE CORP	35,586	943.80	33,586,066.80
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	76.95	1,253,284.65
DOLLAR TREE INC	16,318	61.41	1,002,088.38
KROGER CO	56,964	59.91	3,412,713.24
SYSCO CORP	40,090	77.39	3,102,565.10
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,356	149.78	5,595,181.68
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	9.07	467,712.69
WALMART INC	355,106	84.83	30,123,641.98
ALTRIA GROUP INC	139,180	54.05	7,522,679.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	52.13	2,117,416.34
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,082	40.77	574,123.14
BUNGE GLOBAL SA	11,604	87.12	1,010,940.48
CAMPBELL SOUP CO	15,869	45.59	723,467.71
CELSIUS HOLDINGS INC	13,069	28.90	377,694.10
COCA-COLA CO	329,211	63.92	21,043,167.12
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	77.89	1,199,038.66
CONAGRA BRANDS INC	33,324	28.44	947,734.56
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	234.38	3,076,471.88
GENERAL MILLS INC	43,531	65.52	2,852,151.12
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,676	175.67	2,226,792.92
HORMEL FOODS CORP	23,338	30.32	707,608.16

JM SMUCKER CO	7,850	115.45	906,282.50
KELLANOVA	23,448	81.00	1,899,288.00
KEURIG DR PEPPER INC	90,354	32.88	2,970,839.52
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	33.00	2,275,812.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	81.20	964,331.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	22,194	77.49	1,719,813.06
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	59.56	873,685.64
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	109,908	66.20	7,275,909.60
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	54.14	3,158,960.72
PEPSICO INC	110,824	165.11	18,298,150.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,991	126.24	15,905,103.84
TYSON FOODS INC	23,306	59.59	1,388,804.54
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	106.45	2,059,381.70
CLOROX COMPANY	9,570	165.16	1,580,581.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	92.57	5,733,600.66
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	63.90	1,201,320.00
KENVUE INC	148,093	23.68	3,506,842.24
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	133.61	3,591,035.97
PROCTER & GAMBLE CO	189,458	167.71	31,774,001.18
ABBOTT LABORATORIES	140,716	116.59	16,406,078.44
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	220.51	1,158,339.03
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	34.64	1,440,192.64
BECTON DICKINSON & CO	23,549	231.64	5,454,890.36
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,607	88.25	10,290,567.75
CARDINAL HEALTH	19,151	120.56	2,308,844.56
CENCORA INC	14,462	248.41	3,592,505.42
CENTENE CORP	40,934	60.15	2,462,180.10
COOPER COS INC/THE	16,443	103.75	1,705,961.25
CVS HEALTH CORP	99,034	55.54	5,500,348.36
DAVITA INC	4,627	149.66	692,476.82
DEXCOM INC	33,285	69.96	2,328,618.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,765	66.23	3,295,935.95
ELEVANCE HEALTH INC	18,990	422.62	8,025,553.80
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	32,998	85.94	2,835,848.12
HCA HEALTHCARE INC	15,457	354.16	5,474,251.12
HENRY SCHEIN INC	8,755	68.00	595,340.00

HOLOGIC INC	18,875	78.76	1,486,595.00
HUMANA INC	9,955	288.12	2,868,234.60
IDEXX LABORATORIES INC	6,644	433.28	2,878,712.32
INSULET CORP	5,246	268.00	1,405,928.00
INTUITIVE SURGICAL INC	28,412	536.45	15,241,617.40
LABCORP HOLDINGS INC	6,548	242.39	1,587,169.72
MCKESSON CORP	10,179	613.00	6,239,727.00
MEDTRONIC PLC	102,632	87.72	9,002,879.04
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	329.65	1,498,259.25
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	159.37	1,383,172.23
RESMED INC	12,254	252.38	3,092,664.52
SOLVENTUM CORP	10,915	72.43	790,573.45
STERIS PLC	8,172	219.19	1,791,220.68
STRYKER CORP	27,317	375.96	10,270,099.32
TELEFLEX INC	3,934	195.55	769,293.70
THE CIGNA GROUP	22,885	319.77	7,317,936.45
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,878	615.81	45,494,811.18
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	207.50	969,440.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	235.00	2,935,385.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	108.18	1,650,177.72
ABBVIE INC	141,776	199.50	28,284,312.00
AGILENT TECHNOLOGIES	24,157	136.68	3,301,778.76
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	277.43	2,675,257.49
AMGEN	42,902	325.28	13,955,162.56
AVANTOR INC	49,647	22.59	1,121,525.73
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	369.25	684,220.25
BIO-TECHNE CORP	12,980	75.96	985,960.80
BIOGEN INC	12,520	173.04	2,166,460.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	67.07	991,495.81
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	162,165	54.14	8,779,613.10
CATALENT INC	13,739	59.41	816,233.99
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	215.39	905,499.56
DANAHER CORP	54,050	245.39	13,263,329.50
ELI LILLY & CO	64,845	831.54	53,921,211.30
EXACT SCIENCES CORP	16,817	51.48	865,739.16
GILEAD SCIENCES INC	100,590	96.56	9,713,473.35

ILLUMINA INC	13,628	151.09	2,059,054.52
INCYTE CORP	15,212	83.38	1,268,376.56
IQVIA HOLDINGS INC	15,221	219.23	3,336,899.83
JOHNSON & JOHNSON	193,182	155.47	30,034,005.54
MERCK & CO	203,900	102.92	20,985,388.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,310.03	2,131,418.81
MODERNA INC	25,884	46.83	1,212,147.72
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,925	125.74	1,122,229.50
PFIZER	449,444	26.72	12,009,143.68
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,604	828.42	7,127,725.68
REVVITY INC	8,524	122.47	1,043,934.28
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	26.21	788,475.43
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	17.11	1,576,532.51
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,814	551.74	17,001,316.36
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	410.00	1,483,380.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,565	516.74	10,626,758.10
VIATRIS INC	89,720	12.96	1,162,771.20
WATERS CORP	4,749	384.51	1,826,037.99
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	324.10	1,869,084.70
ZOETIS INC	35,994	176.82	6,364,459.08
BANK OF AMERICA CORP	565,911	45.13	25,539,563.43
CITIGROUP	152,078	68.63	10,437,113.14
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	45.81	1,810,502.82
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	46.26	2,517,469.20
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	2,165.65	1,658,887.90
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	17.29	1,972,996.48
JPMORGAN CHASE & CO	230,506	236.98	54,625,311.88
KEY CORP	71,223	18.97	1,351,100.31
M & T BANK CORP	13,791	209.41	2,887,973.31
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,533	203.97	6,431,786.01
REGIONS FINL CORP	70,810	25.62	1,814,152.20
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	45.22	4,808,785.24
US BANCORP	124,604	50.21	6,256,366.84
WELLS FARGO & CO	279,843	70.04	19,600,203.72
ALLY FINANCIAL INC	21,529	37.56	808,629.24
AMERICAN EXPRESS	46,206	287.60	13,288,845.60

AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	551.99	4,314,353.84
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	32,488	162.00	5,263,056.00
ARES MANAGEMENT CORP - A	14,741	170.38	2,511,571.58
BANK NEW YORK CO	60,549	77.06	4,665,905.94
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	106,308	463.41	49,264,190.28
BLACKROCK INC	11,959	1,039.28	12,428,749.52
BLACKSTONE INC	57,676	177.46	10,235,182.96
BLOCK INC	46,685	74.56	3,480,833.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	185.21	5,574,265.37
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	52.33	819,958.77
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	196.86	1,732,958.58
CME GROUP INC	29,407	225.66	6,635,983.62
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	15,866	270.74	4,295,560.84
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	30.82	593,254.18
CORPAY INC	4,988	366.01	1,825,657.88
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	175.15	3,325,573.05
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	47.36	1,325,274.88
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	477.46	1,503,044.08
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	45,470	88.07	4,004,542.90
FISERV INC	46,319	210.70	9,759,413.30
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	21.04	548,512.80
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	94.51	407,905.16
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	110.88	2,300,649.12
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,667	589.26	15,124,536.42
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,196	156.42	7,225,978.32
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	179.77	937,141.01
KKR & CO INC	50,197	152.20	7,639,983.40
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,490	312.25	1,714,252.50
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	274.68	880,898.76
MASTERCARD INC-CLASS A	66,641	524.76	34,970,531.16
MOODY' S CORP	13,270	477.18	6,332,178.60
MORGAN STANLEY	97,076	129.53	12,574,254.28
MSCI INC	6,530	594.00	3,878,820.00
NASDAQ INC	34,296	78.69	2,698,752.24
NORTHERN TRUST CORP	15,902	105.18	1,672,572.36
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	83.01	6,581,530.86

PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	117.62	2,149,505.50
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	158.73	2,458,092.78
ROBINHOOD MARKETS INC - A	46,668	30.54	1,425,240.72
S&P GLOBAL INC	25,389	502.82	12,766,096.98
SCHWAB (CHARLES) CORP	122,251	73.90	9,034,348.90
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	80.11	765,050.50
STATE STREET CORP	22,335	94.78	2,116,911.30
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	63.79	1,862,412.84
TOAST INC-CLASS A	31,526	37.48	1,181,594.48
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	131.93	1,195,417.73
VISA INC-CLASS A SHARES	126,356	307.87	38,901,221.72
AFLAC	43,196	108.27	4,676,830.92
ALLSTATE CORP	20,722	196.90	4,080,161.80
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	138.77	876,887.63
AMERICAN INT'L GROUP	55,004	75.58	4,157,202.32
AON PLC	15,249	383.78	5,852,261.22
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	101.85	3,028,713.45
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,453	294.77	5,144,620.81
ASSURANT INC	4,726	209.39	989,577.14
BROWN & BROWN INC	20,155	112.43	2,266,026.65
CHUBB LTD	30,987	281.36	8,718,502.32
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,618	148.69	2,024,860.42
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	427.42	925,791.72
EVEREST GROUP LTD	3,288	368.29	1,210,937.52
FNF GROUP	20,461	60.23	1,232,366.03
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,814	117.43	2,913,908.02
LOEWS CORP	16,402	83.11	1,363,170.22
MARKEL GROUP INC	1,007	1,650.74	1,662,295.18
MARSH & MCLENNAN COS	39,706	225.36	8,948,144.16
METLIFE INC	48,925	81.02	3,963,903.50
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	85.45	1,583,901.20
PROGRESSIVE CORP	46,607	261.52	12,188,662.64
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,466	121.89	3,591,610.74
TRAVELERS COS INC/THE	18,639	256.89	4,788,172.71
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	316.30	2,447,213.10
WR BERKLEY CORP	26,787	60.55	1,621,952.85

WEYERHAEUSER CO	63,311	31.89	2,018,987.79
ACCENTURE PLC-CL A	50,533	355.53	17,965,997.49
ADOBE INC	35,487	494.68	17,554,709.16
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	89.37	1,026,325.08
ANSYS INC	6,794	342.18	2,324,770.92
APPROVIN CORP-CLASS A	16,202	290.01	4,698,742.02
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	245.00	586,530.00
ATLASSIAN CORP-CL A	13,451	237.80	3,198,647.80
AUTODESK INC	17,030	305.56	5,203,686.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	48.58	719,615.54
CADENCE DESIGN SYSTEMS	22,405	301.25	6,749,506.25
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	176.03	1,242,419.74
CLOUDFLARE INC - CLASS A	23,067	91.25	2,104,863.75
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	41,334	80.31	3,319,533.54
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	18,728	330.03	6,180,801.84
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	294.61	913,291.00
DATADOG INC - CLASS A	23,325	124.45	2,902,796.25
DOCUSIGN INC	14,969	79.38	1,188,239.22
DYNATRACE INC	22,028	52.89	1,165,060.92
EPAM SYSTEMS INC	4,768	233.45	1,113,089.60
FAIR ISAAC CORP	2,026	2,332.29	4,725,219.54
FORTINET INC	53,692	92.04	4,941,811.68
GARTNER INC	6,462	547.40	3,537,298.80
GEN DIGITAL INC	43,555	29.53	1,286,179.15
GODADDY INC - CLASS A	11,388	177.84	2,025,241.92
HUBSPOT INC	3,646	656.56	2,393,817.76
INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,241	213.72	15,866,786.52
INTUIT INC	22,172	684.22	15,170,525.84
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	283.48	1,330,655.12
MICROSOFT CORP	566,563	422.54	239,395,530.02
MICROSTRATEGY INC-CL A	12,190	270.42	3,296,419.80
MONDAY.COM LTD	2,838	324.31	920,391.78
MONGODB INC	5,325	290.04	1,544,463.00
OKTA INC	11,505	76.75	883,008.75
ORACLE CORP	133,133	189.25	25,195,420.25
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	160,620	58.39	9,378,601.80

PALO ALTO NETWORKS INC	26,290	391.40	10,289,906.00
PTC INC	9,741	192.83	1,878,357.03
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	567.62	4,799,794.72
SALESFORCE INC	77,955	321.95	25,097,612.25
SAMSARA INC-CL A	13,283	52.72	700,279.76
SERVICENOW INC	16,388	1,008.08	16,520,415.04
SNOWFLAKE INC-CLASS A	23,538	120.89	2,845,508.82
SYNOPSYS INC	12,529	561.55	7,035,659.95
TWILIO INC - A	12,842	92.29	1,185,188.18
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	623.22	2,080,931.58
VERISIGN INC	6,723	183.56	1,234,073.88
WIX.COM LTD	5,010	172.50	864,225.00
WORKDAY INC-CLASS A	16,432	256.54	4,215,465.28
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,869	81.46	1,699,988.74
ZSCALER INC	7,204	195.73	1,410,038.92
AMPHENOL CORPORATION	96,707	73.87	7,143,746.09
APPLE INC	1,169,310	226.96	265,386,597.60
ARISTA NETWORKS INC	21,491	400.45	8,606,070.95
CDW CORP/DE	11,273	199.87	2,253,134.51
CISCO SYSTEMS	325,203	58.06	18,881,286.18
CORNING	66,604	48.72	3,244,946.88
DELL TECHNOLOGIES -C	23,308	134.23	3,128,632.84
F5 INC	4,851	241.31	1,170,594.81
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	22.04	2,147,401.28
HP INC	77,024	36.82	2,836,023.68
JABIL INC	9,340	135.75	1,267,905.00
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	38.91	985,240.11
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	165.42	2,289,081.96
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	504.60	6,640,031.40
NETAPP INC	17,746	124.01	2,200,681.46
PURE STORAGE INC - CLASS A	23,875	52.91	1,263,226.25
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,548	104.78	1,524,339.44
SUPER MICRO COMPUTER INC	42,160	24.52	1,033,763.20
TE CONNECTIVITY PLC	25,340	155.06	3,929,220.40
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,107	489.24	2,009,308.68
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	72.65	1,287,212.70

WESTERN DIGITAL CORP	25,790	69.61	1,795,241.90
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	399.31	1,661,928.22
AT&T INC	568,700	22.34	12,704,758.00
T-MOBILE US INC	41,896	235.31	9,858,547.76
VERIZON COMMUNICATIONS	341,184	40.48	13,811,128.32
AES CORP	54,375	13.60	739,500.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	57.75	1,199,929.50
AMEREN CORPORATION	20,898	90.19	1,884,790.62
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	96.40	3,925,408.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	136.09	1,968,950.12
ATMOS ENERGY CORP	11,302	144.19	1,629,635.38
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	30.39	1,442,491.74
CMS ENERGY CORP	23,697	67.25	1,593,623.25
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	98.13	2,715,747.75
CONSTELLATION ENERGY	25,537	239.37	6,112,791.69
DOMINION ENERGY INC	70,231	57.79	4,058,649.49
DTE ENERGY COMPANY	15,851	117.80	1,867,247.80
DUKE ENERGY CORP	63,022	113.23	7,135,981.06
EDISON INTL	30,900	83.10	2,567,790.00
ENERGY CORP	16,181	148.98	2,410,645.38
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	39.67	809,228.33
EVERGY INC	18,475	62.51	1,154,872.25
EVERSOURCE ENERGY	27,450	61.40	1,685,430.00
EXELON CORP	81,573	38.11	3,108,747.03
FIRSTENERGY CORP	47,081	41.54	1,955,744.74
NEXTERA ENERGY INC	164,785	76.97	12,683,501.45
NISOURCE INC	32,351	35.97	1,163,665.47
NRG ENERGY INC	17,078	96.14	1,641,878.92
PG&E CORP	164,187	20.60	3,382,252.20
PPL CORPORATION	58,459	33.06	1,932,654.54
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	85.82	3,455,628.12
SEMPRA	49,744	91.25	4,539,140.00
SOUTHERN CO	86,109	88.64	7,632,701.76
VISTRA CORP	28,511	141.90	4,045,710.90
WEC ENERGY GROUP INC	26,668	97.59	2,602,530.12
XCEL ENERGY INC	46,610	67.37	3,140,115.70

	ADVANCED MICRO DEVICES	130,225	147.95	19,266,788.75	
	ANALOG DEVICES	39,357	225.80	8,886,810.60	
	APPLIED MATERIALS	66,508	192.03	12,771,531.24	
	BROADCOM INC	354,961	183.64	65,185,038.04	
	ENPHASE ENERGY INC	9,617	66.90	643,377.30	
	ENTEGRIS INC	12,389	105.03	1,301,216.67	
	FIRST SOLAR INC	7,921	193.93	1,536,119.53	
	INTEL CORP	344,792	26.20	9,033,550.40	
	KLA CORP	10,710	687.41	7,362,161.10	
	LAM RESEARCH CORP	106,766	78.20	8,349,101.20	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	67,749	93.80	6,354,856.20	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,977	72.87	3,277,473.99	
	MICRON TECHNOLOGY	88,663	111.90	9,921,389.70	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,911	761.30	2,977,444.30	
	NVIDIA CORP	1,974,619	147.63	291,513,002.97	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,641	233.89	4,827,723.49	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	36,454	70.41	2,566,726.14	
	QORVO INC	8,678	70.35	610,497.30	
	QUALCOMM	90,410	170.91	15,451,973.10	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,336	89.16	1,278,197.76	
	TERADYNE INC	12,318	110.89	1,365,943.02	
	TEXAS INSTRUMENTS	72,611	220.29	15,995,477.19	
	CBRE GROUP INC-A	25,587	136.08	3,481,878.96	
	COSTAR GROUP INC	33,027	77.39	2,555,959.53	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.63	456,981.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	73.89	872,567.01	
	アメリカドル 小計	29,610,840		4,137,777,875.89 (633,659,303,913)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	55,750	24.86	1,385,945.00	
	CAMECO CORP	31,793	73.12	2,324,704.16	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	174,171	47.57	8,285,314.47	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	22.43	2,496,301.99	
	ENBRIDGE	175,303	58.93	10,330,605.79	
	IMPERIAL OIL	16,202	101.86	1,650,335.72	
	KEYERA CORP	18,607	43.69	812,939.83	
	MEG ENERGY CORP	13,934	26.13	364,095.42	

PARKLAND CORP	7,149	32.98	235,774.02
PEMBINA PIPELINE CORP	45,941	57.00	2,618,637.00
SUNCOR ENERGY	98,973	54.48	5,392,049.04
TC ENERGY CORP	82,559	67.82	5,599,151.38
TOURMALINE OIL CORP	25,009	62.29	1,557,810.61
AGNICO EAGLE MINES	40,306	116.67	4,702,501.02
BARRICK GOLD CORP	133,727	25.62	3,426,085.74
CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,322	81.19	756,853.18
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,267	19.09	1,245,947.03
FRANCO-NEVADA CORP	15,641	170.39	2,665,069.99
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	18.59	963,835.73
KINROSS GOLD CORP	108,451	14.55	1,577,962.05
LUNDIN MINING CORP	38,990	13.89	541,571.10
NUTRIEN LTD	37,152	67.21	2,496,985.92
PAN AMERICAN SILVER CORP	35,316	31.49	1,112,100.84
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	67.78	2,398,463.08
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	125.62	440,298.10
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,991	90.23	3,337,697.93
CAE INC	25,999	26.24	682,213.76
STANTEC INC	9,001	112.16	1,009,552.16
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	118.65	618,522.45
WSP GLOBAL INC	9,951	241.25	2,400,678.75
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	29.12	948,700.48
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	20,393	62.80	1,280,680.40
RB GLOBAL INC	14,445	127.82	1,846,359.90
THOMSON REUTERS CORP	13,471	234.03	3,152,618.13
AIR CANADA	13,805	22.54	311,164.70
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	154.15	6,510,833.55
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	108.04	7,900,425.00
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	202.68	1,183,043.16
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	60.38	1,222,936.52
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	68.81	211,246.70
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	68.53	672,964.60
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	94.67	2,184,320.91
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	154.00	695,002.00
DOLLARAMA INC	22,000	151.00	3,322,000.00

ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	63,541	77.03	4,894,563.23
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	41.14	285,100.20
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	185.51	2,395,490.63
METRO INC	18,840	85.74	1,615,341.60
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	233.11	1,218,232.86
SAPUTO INC	20,898	26.71	558,185.58
BANK MONTREAL	59,727	129.30	7,722,701.10
BANK NOVA SCOTIA	97,216	75.05	7,296,060.80
CANADIAN IMPERIAL BANK	77,158	89.55	6,909,498.90
NATIONAL BANK OF CANADA	27,646	133.91	3,702,075.86
ROYAL BANK OF CANADA	112,236	172.04	19,309,081.44
TORONTO-DOMINION BANK	142,040	78.91	11,208,376.40
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	78.49	2,276,288.49
BROOKFIELD CORP	111,490	79.44	8,856,765.60
IGM FINANCIAL INC	7,685	44.38	341,060.30
ONEX CORP	6,603	111.12	733,725.36
TMX GROUP LTD	23,425	45.04	1,055,062.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,772	1,835.68	3,252,824.96
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	49.09	1,167,752.92
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	127.99	892,986.23
INTACT FINANCIAL CORP	14,911	266.23	3,969,755.53
MANULIFE FINANCIAL CORP	149,878	44.24	6,630,602.72
POWER CORP OF CANADA	43,577	46.57	2,029,380.89
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	82.46	3,596,410.44
CGI INC - CL A	16,084	154.81	2,489,964.04
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,654	4,357.00	7,206,478.00
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	159.98	1,117,300.32
OPEN TEXT CORP	20,463	40.69	832,639.47
SHOPIFY INC - CLASS A	98,004	121.25	11,882,985.00
BCE INC	6,203	39.49	244,956.47
QUEBECOR INC -CL B	15,200	32.78	498,256.00
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	50.55	1,409,384.55
TELUS CORP	32,908	21.81	717,723.48
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	33.49	816,988.55
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	43.58	492,236.10
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.64	357,623.36

	EMERA INC	25,484	50.19	1,279,041.96
	FORTIS INC	45,064	61.47	2,770,084.08
	HYDRO ONE LTD	29,579	44.61	1,319,519.19
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	261.67	703,892.30
	カナダドル 小計	3,298,675		240,928,696.22 (26,519,021,592)
ユーロ	ENI	182,356	13.93	2,540,219.08
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	15.78	626,064.67
	NESTE OIL OYJ	32,766	12.83	420,387.78
	OMV AG	12,549	37.62	472,093.38
	REPSOL SA	89,536	11.49	1,028,768.64
	TENARIS SA	40,648	17.23	700,568.28
	TOTALENERGIES SE	172,328	56.84	9,795,123.52
	AIR LIQUIDE	46,418	161.50	7,496,507.00
	AKZO NOBEL	12,357	58.82	726,838.74
	ARCELORMITTAL	43,366	24.14	1,046,855.24
	ARKEMA	4,369	79.75	348,427.75
	BASF SE	70,406	43.38	3,054,564.31
	COVESTRO AG	14,454	57.48	830,815.92
	DSM-FIRMENICH AG	16,194	104.80	1,697,131.20
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	18.31	293,717.65
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	116.25	1,251,431.25
	STORA ENSO OYJ R	42,169	10.14	427,804.50
	SYENSCO SA	5,356	77.38	414,447.28
	SYMRISE AG	10,018	107.65	1,078,437.70
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	26.24	1,110,581.76
	VOESTALPINE AG	7,152	19.67	140,679.84
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	17,256	42.98	741,662.88
	AIRBUS SE	48,168	142.30	6,854,306.40
	ALSTOM	24,388	20.20	492,637.60
	BOUYGUES ORD	16,606	29.91	496,685.46
	BRENTAG SE	9,500	61.00	579,500.00
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	37.57	1,475,674.46
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	198.70	423,231.00
	EIFFAGE	5,924	83.72	495,957.28
	FERROVIAL SE	45,136	36.00	1,624,896.00

GEA GROUP AG	13,382	46.00	615,572.00	
IMCD NV	4,641	152.90	709,608.90	
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	77.65	962,704.70	
KNORR-BREMSE AG	5,022	73.65	369,870.30	
KONE OYJ-B	26,369	49.63	1,308,693.47	
LEGRAND SA	22,132	98.48	2,179,559.36	
LEONARDO SPA	31,340	24.71	774,411.40	
METSO CORPORATION	51,970	8.81	457,959.64	
MTU AERO ENGINES AG	3,962	314.50	1,246,049.00	
PRYSMIAN SPA	21,155	62.16	1,314,994.80	
RATIONAL AG	483	872.50	421,417.50	
REXEL SA	17,411	27.00	470,097.00	
RHEINMETALL AG	3,759	546.00	2,052,414.00	
SAFRAN SA	28,003	219.80	6,155,059.40	
SAINT-GOBAIN	36,177	86.10	3,114,839.70	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,466	240.75	10,464,439.50	
SIEMENS	60,279	183.08	11,035,879.32	
SIEMENS ENERGY AG	55,583	39.52	2,196,640.16	
THALES SA	6,657	161.10	1,072,442.70	
VINCI S. A.	39,327	100.25	3,942,531.75	
WARTSILA OYJ	41,917	18.56	777,979.52	
BUREAU VERITAS SA	25,073	29.00	727,117.00	
RANDSTAD NV	10,680	42.00	448,560.00	
TELEPERFORMANCE	4,734	94.68	448,215.12	
WOLTERS KLUWER	19,155	161.85	3,100,236.75	
ADP	2,382	105.40	251,062.80	
AENA SME SA	5,508	199.30	1,097,744.40	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.31	286,114.33	
DHL GROUP	82,579	35.43	2,925,773.97	
GETLINK	21,115	15.39	324,959.85	
INPOST SA	15,470	17.48	270,415.60	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,617	67.58	1,663,616.86	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	63.15	315,181.65	
CONTINENTAL AG	8,168	56.50	461,492.00	
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	64.60	662,408.40	
FERRARI NV	10,026	421.70	4,227,964.20	

MERCEDES-BENZ GROUP AG	58,663	52.36	3,071,594.68
MICHELIN	57,385	31.39	1,801,315.15
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	36.98	434,330.10
RENAULT SA	17,081	40.69	695,025.89
STELLANTIS NV	166,407	12.53	2,086,410.96
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	84.14	1,289,697.92
ADIDAS AG	12,783	219.00	2,799,477.00
HERMES INTERNATIONAL	2,556	2,068.00	5,285,808.00
KERING	5,534	221.00	1,223,014.00
LVMH	22,349	598.40	13,373,641.60
MONCLER SPA	18,908	48.79	922,521.32
PUMA SE	9,220	45.74	421,722.80
SEB SA	2,282	95.45	217,816.90
ACCOR	14,436	44.01	635,328.36
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	68.00	2,500,496.00
DELIVERY HERO SE	13,414	37.15	498,330.10
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	39.64	321,401.12
SODEXO	6,173	83.20	513,593.60
BOLLORE SE	81,810	5.79	474,088.95
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,827	87.70	423,327.90
PUBLICIS GROUPE	17,217	103.10	1,775,072.70
SCOUT24 SE	7,536	83.55	629,632.80
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	23.71	1,560,734.46
VIVENDI SE	61,243	9.30	569,804.87
D' IETEREN GROUP	2,217	199.80	442,956.60
INDITEX	87,257	52.00	4,537,364.00
PROSUS	112,590	38.44	4,327,959.60
ZALANDO SE	17,664	27.20	480,460.80
CARREFOUR	39,746	15.08	599,369.68
JERONIMO MARTINS	21,861	18.68	408,363.48
KESKO OYJ-B SHS	20,083	19.73	396,237.59
KONINKLIJKE AHOLD NV	80,571	32.39	2,609,694.69
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	73,503	53.30	3,917,709.90
DANONE (GROUPE)	51,810	65.52	3,394,591.20
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	78,177	6.02	470,938.24
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	61.85	588,317.20

HEINEKEN NV	23,160	72.58	1,680,952.80
JDE PEET' S BV	7,000	18.85	131,950.00
KERRY GROUP PLC-A	10,913	87.90	959,252.70
LOTUS BAKERIES	38	12,280.00	466,640.00
PERNOD-RICARD	15,339	112.65	1,727,938.35
BEIERSDORF AG	7,430	124.85	927,635.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	70.20	616,356.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,404	77.96	1,200,895.84
LOREAL	19,298	334.70	6,459,040.60
AMPLIFON SPA	11,650	24.37	283,910.50
BIOMERIEUX	3,044	102.30	311,401.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	58.05	199,111.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	109.50	226,665.00
ESSILORLUXOTTICA	24,259	227.70	5,523,774.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	39.70	674,304.50
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	33.85	1,140,372.65
KONINKLIJKE PHILIPS	66,646	24.87	1,657,486.02
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	52.20	1,125,797.40
ARGENX SE	4,935	554.40	2,735,964.00
BAYER	78,462	24.08	1,889,364.96
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	45.58	465,827.60
GRIFOLS SA	27,685	11.13	308,134.05
IPSEN	3,532	110.30	389,579.60
MERCK KGAA	10,703	150.85	1,614,547.55
ORION OYJ-CLASS B	10,139	45.11	457,370.29
QIAGEN N. V.	16,526	40.75	673,434.50
RECORDATI SPA	11,597	51.50	597,245.50
SANOFI	90,135	95.74	8,629,524.90
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	228.30	416,419.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	181.70	469,149.40
UCB (GROUPE)	9,389	184.40	1,731,331.60
ABN AMRO BANK NV-CVA	45,808	15.22	697,197.76
AIB GROUP PLC	145,826	5.34	778,710.84
BANCO BILBAO VIZCAYA	488,597	9.10	4,447,209.89
BANCO BPM SPA	118,197	6.71	793,811.05
BANCO DE SABADELL SA	420,800	1.76	742,712.00

BANCO SANTANDER SA	1, 223, 031	4. 43	5, 423, 530. 96
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88, 378	8. 69	768, 004. 82
BNP PARIBAS	81, 615	59. 76	4, 877, 312. 40
CAIXABANK	275, 085	5. 50	1, 514, 067. 84
COMMERZBANK AG	81, 889	15. 80	1, 294, 255. 64
CREDIT AGRICOLE SA	87, 162	13. 19	1, 149, 666. 78
ERSTE GROUP BANK AG	25, 376	53. 48	1, 357, 108. 48
FINECOBANK SPA	41, 585	14. 84	617, 121. 40
ING GROEP NV-CVA	256, 546	14. 99	3, 845, 624. 54
INTESA SANPAOLO	1, 145, 097	3. 83	4, 392, 019. 54
KBC GROEP NV	18, 057	68. 84	1, 243, 043. 88
MEDIOBANCA	33, 860	15. 34	519, 581. 70
NORDEA BANK ABP	276, 242	10. 68	2, 951, 645. 77
SOCIETE GENERALE	53, 019	26. 55	1, 407, 654. 45
UNICREDIT SPA	116, 219	39. 98	4, 647, 016. 71
ADYEN NV	1, 835	1, 272. 60	2, 335, 221. 00
AMUNDI SA	4, 626	67. 45	312, 023. 70
DEUTSCHE BANK NAMEN	159, 078	15. 52	2, 469, 208. 71
DEUTSCHE BOERSE	15, 625	212. 20	3, 315, 625. 00
EDENRED	20, 131	29. 81	600, 105. 11
EURAZEO SA	3, 357	69. 35	232, 807. 95
EURONEXT NV	6, 480	99. 85	647, 028. 00
EXOR NV	7, 825	94. 65	740, 636. 25
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8, 515	66. 05	562, 415. 75
NEXI SPA	48, 458	5. 72	277, 567. 42
SOFINA	1, 238	222. 60	275, 578. 80
AEGON LTD	101, 846	6. 14	625, 741. 82
AGEAS	11, 086	48. 04	532, 571. 44
ALLIANZ SE-REG	31, 198	287. 00	8, 953, 826. 00
ASR NEDERLAND NV	11, 959	44. 87	536, 600. 33
AXA SA	145, 111	33. 86	4, 913, 458. 46
GENERALI	84, 111	25. 21	2, 120, 438. 31
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4, 455	238. 60	1, 062, 963. 00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11, 017	470. 00	5, 177, 990. 00
NN GROUP NV	22, 941	45. 13	1, 035, 327. 33
POSTE ITALIANE SPA	47, 094	13. 29	625, 879. 26

SAMPO OYJ-A SHS	40,316	40.05	1,614,655.80
TALANX AG	5,053	73.05	369,121.65
BECHTLE AG	7,659	32.84	251,521.56
CAPGEMINI SA	12,235	162.10	1,983,293.50
DASSAULT SYSTEMES SA	49,547	32.66	1,618,205.02
NEMETSCHEK SE	5,455	104.40	569,502.00
SAP SE	84,225	221.40	18,647,415.00
NOKIA OYJ	396,129	4.21	1,670,079.86
CELLNEX TELECOM SA	42,906	33.05	1,418,043.30
DEUTSCHE TELEKOM	276,850	28.52	7,895,762.00
ELISA A	10,227	43.76	447,533.52
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.75	296,308.12
KPN (KON.)	290,883	3.61	1,052,414.69
ORANGE	153,281	9.88	1,514,722.84
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.22	190,545.37
TELEFONICA	297,657	4.20	1,251,647.68
ACCIONA SA	2,181	112.20	244,708.20
E. ON SE	192,389	11.91	2,291,352.99
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	10.83	235,574.16
ELIA GROUP SA/NV	987	86.80	85,671.60
ENDESA	25,972	19.30	501,259.60
ENEL	640,374	6.67	4,276,417.57
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,657	3.41	804,532.99
ENGIE	146,393	15.18	2,222,977.70
FORTUM OYJ	32,550	13.68	445,284.00
IBERDROLA SA	484,413	13.21	6,399,095.73
REDEIA CORP SA	30,678	16.44	504,346.32
RWE STAMM	52,507	30.15	1,583,086.05
SNAM SPA	147,559	4.21	622,403.86
TERNA SPA	95,819	7.73	741,447.42
VEOLIA ENVIRONNEMENT	59,881	28.42	1,701,818.02
VERBUND AG	6,430	71.80	461,674.00
ASM INTERNATIONAL NV	3,856	508.80	1,961,932.80
ASML HOLDING NV	32,142	621.50	19,976,253.00
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	109.50	696,091.50
INFINEON TECHNOLOGIES	105,817	28.78	3,045,942.34

	STMICROELECTRONICS NV	50,286	24.66	1,240,052.76
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	86.82	457,975.50
	VONOVIA SE	61,810	30.17	1,864,807.70
	ユーロ 小計	14,582,979		402,905,359.60 (66,092,595,188)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	3.73	4,909,869.31
	SHELL PLC-NEW	510,575	25.64	13,093,695.87
	ANGLO AMERICAN PLC	101,769	23.72	2,413,960.68
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	16.89	504,267.84
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	36.04	393,700.96
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	16.69	293,810.76
	GLENCORE PLC	854,615	3.94	3,374,020.02
	MONDI PLC	37,918	12.03	456,343.13
	RIO TINTO PLC REG	93,010	49.46	4,600,274.60
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	62.86	2,094,306.62
	BAE SYSTEMS PLC	240,047	13.77	3,306,647.42
	BUNZL PLC	29,337	34.76	1,019,754.12
	DCC PLC	6,622	48.48	321,034.56
	MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	5.06	511,849.19
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	686,376	5.53	3,797,032.03
	SMITHS GROUP PLC	26,476	15.34	406,141.84
	SPIRAX GROUP PLC	5,514	65.25	359,788.50
	EXPERIAN PLC	77,628	38.79	3,011,190.12
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	46.10	640,329.00
	RELX PLC	152,296	36.93	5,624,291.28
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	4.03	733,882.02
	BARRATT REDROW PLC	118,831	4.22	502,417.46
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,707	42.82	287,193.74
	PERSIMMON PLC	25,686	13.14	337,514.04
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.37	363,275.05
	COMPASS GROUP PLC	140,293	26.11	3,663,050.23
	ENTAIN PLC	49,630	7.48	371,232.40
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,833	92.58	1,280,659.14	
PEARSON	55,305	12.04	665,872.20	
WHITBREAD PLC	17,434	30.29	528,075.86	
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	7.77	563,464.51	

INFORMA PLC	110,598	8.28	915,972.63
WPP PLC	85,821	8.46	726,217.30
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.20	249,741.18
KINGFISHER PLC	153,717	2.89	445,471.86
NEXT PLC	8,464	98.62	834,719.68
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.49	369,650.82
TESCO PLC	525,585	3.45	1,814,319.42
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	22.64	582,753.60
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,980	27.33	4,317,593.40
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	28.06	503,957.60
DIAGEO	174,682	23.20	4,052,622.40
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	23.67	1,620,874.26
HALEON PLC	598,336	3.63	2,173,754.68
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	47.66	2,698,556.86
UNILEVER PLC	198,540	45.37	9,007,759.80
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	9.17	629,427.72
ASTRAZENECA	125,024	99.03	12,381,126.72
GSK PLC	335,128	13.81	4,628,117.68
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	18.31	327,932.10
BARCLAYS	1,232,261	2.51	3,099,136.41
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,052	6.90	10,246,858.80
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.53	2,562,955.06
NATWEST GROUP PLC	506,122	3.80	1,927,312.57
STANDARD CHARTERED PLC	161,358	9.24	1,490,947.92
3I GROUP PLC	74,757	33.87	2,532,019.59
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	10.90	360,561.10
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	37,924	107.45	4,074,933.80
M&G PLC	131,539	1.94	255,448.73
SCHRODERS PLC	39,932	3.02	120,754.36
WISE PLC - A	49,048	8.21	402,684.08
ADMIRAL GROUP PLC	25,873	25.15	650,705.95
AVIVA PLC	193,334	4.56	881,989.70
LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.16	1,080,595.80
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	4.90	250,108.90
PRUDENTIAL	212,226	6.42	1,363,764.27
SAGE GROUP PLC	76,660	10.41	798,413.90

	HALMA PLC	31,069	25.38	788,531.22	
	BT GROUP PLC	464,863	1.40	650,808.20	
	VODAFONE GROUP PLC	1,976,322	0.72	1,423,742.36	
	CENTRICA PLC	453,631	1.14	521,222.01	
	NATIONAL GRID PLC	397,706	9.75	3,880,815.14	
	SEVERN TRENT PLC	17,468	26.25	458,535.00	
	SSE PLC	81,692	17.19	1,404,285.48	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.46	529,066.80	
	イギリスポンド 小計	21,484,782		150,465,711.36 (29,754,594,421)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	11.62	202,164.76	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	650.00	373,100.00	
	GIVAUDAN-REG	742	3,904.00	2,896,768.00	
	HOLCIM LTD	42,259	90.72	3,833,736.48	
	SIG GROUP AG	26,203	18.48	484,231.44	
	SIKA AG-BR	12,257	240.10	2,942,905.70	
	ABB LTD	124,889	50.00	6,244,450.00	
	GEBERIT AG-REG	2,530	519.80	1,315,094.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	251.50	515,072.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	256.60	793,407.20	
	VAT GROUP AG	1,956	360.50	705,138.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	24.80	368,428.80	
	SGS SA	12,959	88.78	1,150,500.02	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	208.70	789,094.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,028	119.30	5,133,240.40	
	SWATCH GROUP AG (BEARER)	2,483	161.90	401,997.70	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	32.05	126,212.90	
	AVOLTA AG	7,820	34.80	272,136.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,413.00	395,640.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	101,400.00	811,200.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,310.00	845,420.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	211,783	78.98	16,726,621.34	
	ALCON INC	38,399	81.02	3,111,086.98	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	323.60	1,257,833.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	112.90	964,166.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	75.80	140,230.00	

	GALDERMA GROUP AG	3,774	83.38	314,676.12	
	LONZA GROUP AG-REG	6,172	549.20	3,389,662.40	
	NOVARTIS	159,082	92.86	14,772,354.52	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	285.00	631,275.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	56,739	263.10	14,928,030.90	
	SANDOZ GROUP AG	30,458	40.14	1,222,584.12	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	87.20	216,866.40	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	55.44	847,622.16	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,235.00	2,253,875.00	
	UBS GROUP AG	261,649	28.21	7,381,118.29	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	169.20	721,468.80	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	149.10	440,590.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	725.60	1,537,546.40	
	SWISS RE LTD	24,330	118.35	2,879,455.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,966	516.80	6,184,028.80	
	TEMENOS AG - REG	5,150	59.50	306,425.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	69.56	835,137.36	
	SWISSCOM	2,539	519.00	1,317,741.00	
	BKW AG	1,744	150.00	261,600.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	94.75	538,085.25	
	スイスフラン 小計	1,200,084		113,780,019.14 (19,884,196,144)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	22,252	332.80	7,405,465.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	415.00	2,233,945.00	
	SCA SV CELLULOZA B	59,490	139.55	8,301,829.50	
	ADDTECH AB-B SHARES	20,615	304.00	6,266,960.00	
	ALFA LAVAL AB	25,134	475.60	11,953,730.40	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	332.50	25,262,352.50	
	ATLAS COPCO A	207,097	181.20	37,525,976.40	
	ATLAS COPCO B	135,444	158.55	21,474,646.20	
	BEIJER REF AB	26,868	170.30	4,575,620.40	
	EPIROC AB-A	53,479	211.60	11,316,156.40	
	EPIROC AB-B	28,804	189.10	5,446,836.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	66.92	2,590,607.04	
	INDUTRADE AB	22,644	292.20	6,616,576.80	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	285.20	3,993,370.40	

	LIFCO AB-B SHS	17,970	324.60	5,833,062.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	49.12	6,034,293.76	
	SAAB AB-B	25,552	233.00	5,953,616.00	
	SANDVIK AB	87,594	211.80	18,552,409.20	
	SKANSKA B	25,507	226.90	5,787,538.30	
	SKF AB-B	21,050	211.20	4,445,760.00	
	TRELLEBORG AB-B SHS	16,653	371.00	6,178,263.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	286.20	3,867,706.80	
	VOLVO B	124,872	283.60	35,413,699.20	
	SECURITAS B	28,375	141.75	4,022,156.25	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	22.83	1,138,073.56	
	EVOLUTION AB	13,186	977.20	12,885,359.20	
	HENNES & MAURITZ B	40,961	158.80	6,504,606.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	295.50	14,619,567.00	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	194.30	3,457,762.80	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	325.40	4,664,609.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	136,139	153.75	20,931,371.25	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	111.30	13,437,916.80	
	SWEDBANK AB-A	71,421	216.70	15,476,930.70	
	EQT AB	31,471	310.40	9,768,598.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	370.60	4,379,750.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	370.00	4,132,160.00	
	INVESTOR AB-B SHS	139,947	302.75	42,368,954.25	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	537.00	3,909,360.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	88.40	18,978,507.60	
	HEXAGON AB-B SHS	172,099	101.65	17,493,863.35	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	111.25	5,202,272.50	
	TELIA CO AB	253,410	30.74	7,789,823.40	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	87.02	4,934,034.00	
	SAGAX AB-B	17,402	252.20	4,388,784.40	
	スウェーデンクローナ 小計	2,696,469		467,514,883.36 (6,615,335,599)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	29,320	223.70	6,558,884.00	
	EQUINOR ASA	66,436	250.65	16,652,183.40	
	NORSK HYDRO	100,517	69.34	6,969,848.78	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	321.30	4,015,607.40	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,516	1,130.00	9,623,080.00	
	MOWI ASA	31,968	195.45	6,248,145.60	
	ORKLA	73,335	101.70	7,458,169.50	
	SALMAR ASA	5,423	543.50	2,947,400.50	
	DNB BANK ASA	71,795	228.90	16,433,875.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	194.90	3,620,072.60	
	TELENOR ASA	51,193	131.30	6,721,640.90	
	ノルウェークローネ 小計	469,575		87,248,908.18 (1,213,632,312)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	423.70	12,758,454.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	3,054.00	2,305,770.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	83,415	104.50	8,716,867.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	10,770.00	2,358,630.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	11,215.00	3,431,790.00	
	DSV A/S	16,193	1,482.50	24,006,122.50	
	PANDORA A/S	6,512	1,064.50	6,932,024.00	
	CARLSBERG AS-B	6,810	737.00	5,018,970.00	
	COLOPLAST-B	9,737	912.00	8,880,144.00	
	DEMANT A/S	8,512	262.20	2,231,846.40	
	GENMAB A/S	4,878	1,592.00	7,765,776.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	258,516	745.70	192,775,381.20	
	ZEALAND PHARMA A/S	5,068	847.00	4,292,596.00	
	DANSKE BANK A/S	53,617	205.00	10,991,485.00	
	TRYG A/S	29,772	159.90	4,760,542.80	
	ORSTED A/S	17,917	378.80	6,786,959.60	
	デンマーククローネ 小計	532,339		304,013,359.40 (6,688,293,906)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	28.30	583,800.70	
	SANTOS	292,069	6.79	1,983,148.51	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	159,719	24.07	3,844,436.33	
	BHP GROUP LTD	413,863	43.40	17,961,654.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	22.26	773,980.20	
	FORTESCUE LTD	137,312	19.55	2,684,449.60	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,778	48.47	1,928,039.66	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	38.47	554,314.23	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	88,682	16.79	1,488,970.78	

ORICA LTD	38,288	17.64	675,400.32
PILBARA MINERALS LTD	209,485	2.98	624,265.30
RIO TINTO LTD	28,272	123.31	3,486,220.32
SOUTH32 LTD	346,773	3.80	1,317,737.40
REECE LTD	16,814	23.80	400,173.20
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	12,630	44.51	562,161.30
BRAMBLES LTD	108,007	19.15	2,068,334.05
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	28.81	1,278,472.56
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	8.44	717,400.00
TRANSURBAN GROUP	261,181	12.79	3,340,504.99
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	64.41	2,976,386.10
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.99	908,244.87
CAR GROUP LTD	29,334	39.59	1,161,333.06
REA GROUP LTD	3,586	234.19	839,805.34
SEEK LTD	28,001	25.11	703,105.11
WESFARMERS LTD	90,005	68.42	6,158,142.10
COLES GROUP LTD	108,486	17.77	1,927,796.22
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	4.73	519,831.73
WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	29.85	2,748,319.35
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.48	734,260.80
COCHLEAR LIMITED	4,783	292.92	1,401,036.36
PRO MEDICUS LTD	3,708	203.99	756,394.92
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	38.72	468,783.04
SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	27.17	1,136,493.93
CSL LIMITED	39,224	285.29	11,190,214.96
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	32.13	7,660,530.99
COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,560	149.32	20,092,499.20
NATIONAL AUSTRALIA BANK	252,987	39.65	10,030,934.55
WESTPAC BANKING	276,117	32.14	8,874,400.38
ASX LTD	14,549	65.57	953,977.93
MACQUARIE GROUP LIMITED	30,302	228.53	6,924,916.06
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	33.53	463,116.36
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	7.78	1,296,630.36
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.72	863,720.76
QBE INSURANCE GROUP	127,819	18.25	2,332,696.75
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	18.65	1,769,213.60

	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	127.09	1,753,969.09	
	XERO LTD	11,340	157.00	1,780,380.00	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.88	1,196,851.96	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	9.91	1,541,351.85	
	オーストラリアドル 小計	5,278,696		147,438,801.38 (14,876,575,059)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.40	610,211.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,904	37.63	2,066,037.52	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,957	3.04	404,189.28	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.65	429,676.45	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.88	649,998.72	
	ニュージーランドドル 小計	445,479		4,160,113.37 (380,067,957)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	237,496	41.25	9,796,710.00	
	SWIRE PACIFIC A	44,500	65.95	2,934,775.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	109.60	11,727,200.00	
	MTR CORP	125,000	28.20	3,525,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	22.00	2,640,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	36.30	6,316,200.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	20.80	4,118,400.00	
	WH GROUP LTD	658,301	6.22	4,094,632.22	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	26.05	7,333,075.00	
	HANG SENG BANK	59,400	95.65	5,681,610.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,300	339.40	32,684,220.00	
	AIA GROUP LTD	904,400	61.95	56,027,580.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	53.80	2,017,500.00	
	CLP HOLDINGS	136,500	66.30	9,049,950.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.08	5,500,314.56	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	50.60	5,667,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	33.10	4,038,067.60	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	26.05	3,262,189.40	
	SINO LAND CO	315,400	7.93	2,501,122.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	83.25	8,741,250.00	
WHARF HOLDINGS	84,000	23.25	1,953,000.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	22.65	2,785,950.00		
	香港ドル 小計	5,071,178		192,395,945.78	

				(3,790,200,131)
シンガポールドル	KEPPEL LTD	112,800	6.41	723,048.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.68	689,832.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.45	698,741.40
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.79	231,312.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.14	560,804.00
	DBS GROUP	155,760	42.40	6,604,224.00
	OCBC BANK	257,100	16.06	4,129,026.00
	UNITED OVERSEAS BANK	107,000	35.69	3,818,830.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	11.45	755,700.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	3.25	2,021,964.75
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.01	421,341.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	2.79	725,679.00
	シンガポールドル 小計		2,392,135	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	15.55	924,089.85
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	868.60	1,864,015.60
	BANK HAPOLIM BM	98,310	41.77	4,106,408.70
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	39.70	4,466,726.40
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	23.50	2,338,250.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	162.60	2,032,987.80
	NICE LTD	4,991	715.00	3,568,565.00
	AZRIELI GROUP	1,537	290.20	446,037.40
イスラエルシェケル 小計		390,926		19,747,080.75 (806,281,205)
合 計		87,454,157		812,746,979,765 (812,746,979,765)

(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	566,372.00	

		オーストラリアドル 小計	83,290	566,372.00 (57,146,934)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,036,600.00	
		香港ドル 小計	315,000	3,036,600.00 (59,821,020)	
投資信託受益証券合計			398,290	116,967,954 (116,967,954)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,425,842.12	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	923,039.04	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,765	7,620,977.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	741,681.66	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,728,563.75	
		BXP INC	11,259	933,371.10	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	943,363.26	
		CROWN CASTLE INC	33,735	3,570,849.75	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,738	4,683,801.24	
		EQUINIX INC	7,697	7,089,398.82	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,006,448.70	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,903,324.05	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,585,755.30	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,564	2,945,482.80	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	24,610	1,224,839.70	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,765	1,246,451.40	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,022,481.73	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,516,769.60	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	2,792,355.46	
		KIMCO REALTY CORP	61,206	1,525,865.58	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,463,292.30	
		PROLOGIS INC	73,867	8,556,014.61	
		PUBLIC STORAGE	12,826	4,353,400.92	
		REALTY INCOME CORP	69,450	3,994,069.50	
REGENCY CENTERS CORP	12,511	928,816.64			
SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	2,000,277.36			
SIMON PROPERTY GROUP	25,979	4,650,760.58			
SUN COMMUNITIES INC	10,890	1,364,734.80			

	UDR INC	23,815	1,059,291.20	
	VENTAS INC	31,565	2,056,459.75	
	VICI PROPERTIES INC	83,762	2,629,289.18	
	WELLTOWER INC	47,424	6,553,996.80	
	WP CAREY INC	16,024	909,041.52	
	アメリカドル 小計	965,168	87,950,107.22 (13,468,679,419)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	221,381.10	
	カナダドル 小計	4,887	221,381.10 (24,367,417)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	262,737.90	
	GECINA SA	3,139	306,052.50	
	KLEPIERRE	17,225	494,702.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	773,042.70	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	273,776.80	
	ユーロ 小計	48,695	2,110,311.90 (346,175,564)	
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	96,289	570,993.77	
	SEGRO PLC	103,047	803,766.60	
	イギリスポンド 小計	199,336	1,374,760.37 (271,858,863)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	668,039.00	
	GOODMAN GROUP	135,303	4,830,317.10	
	GPT GROUP	167,884	760,514.52	
	MIRVAC GROUP	266,683	560,034.30	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,311,613.52	
	STOCKLAND	207,412	1,045,356.48	
	VICINITY CENTERS	305,149	643,864.39	
	オーストラリアドル 小計	1,557,804	9,819,739.31 (990,811,696)	
香港ドル	LINK REIT	238,000	8,663,200.00	
	香港ドル 小計	238,000	8,663,200.00 (170,665,040)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	741,600.18	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	541,829	1,067,403.13	

	シンガポールドル 小計	825,967	1,809,003.31 (208,722,801)	
	投資証券合計	3,839,857	15,481,280,800 (15,481,280,800)	
	合計		15,598,248,754 (15,598,248,754)	

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	97.9%	—	—	—	76.5%
	投資証券 33 銘柄	—	—	—	2.1%	1.6%
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 213 銘柄	99.5%	—	—	—	8.0%
	投資証券 5 銘柄	—	—	—	0.5%	0.0%
イギリス ポンド	株式 75 銘柄	99.1%	—	—	—	3.6%
	投資証券 2 銘柄	—	—	—	0.9%	0.0%
スイスフ ラン	株式 46 銘柄	100.0%	—	—	—	2.4%
スウェー デンクロ ーナ	株式 44 銘柄	100.0%	—	—	—	0.8%
ノルウェ ークロー ネ	株式 11 銘柄	100.0%	—	—	—	0.1%
デンマー ククロー ネ	株式 16 銘柄	100.0%	—	—	—	0.8%
オースト ラリアド ル	株式 49 銘柄	93.4%	—	—	—	1.8%
	投資信託受 益証券 1 銘柄	—	—	0.4%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	—	6.2%	0.1%
ニュージ ーランド ドル	株式 5 銘柄	100.0%	—	—	—	0.0%
香港ドル	株式 22 銘柄	94.3%	—	—	—	0.5%

	投資信託受 1 銘柄 益証券	—	—	1.5%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	—	4.2%	0.0%
シンガポ ールドル	株式 12 銘柄	92.2%	—	—	—	0.3%
	投資証券 2 銘柄	—	—	—	7.8%	0.0%
イスラエ ルシェケ ル	株式 8 銘柄	100.0%	—	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,850,841,483
投資証券	92,220,379,400
未収入金	20,134,570
未収配当金	1,384,817,826
未収利息	10,995
前払金	147,374,610
差入委託証拠金	185,782,085
流動資産合計	95,809,340,969
資産合計	95,809,340,969
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	147,814,170
未払解約金	83,152,432
流動負債合計	230,966,602
負債合計	230,966,602
純資産の部	
元本等	
元本	47,297,337,435
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	48,281,036,932
元本等合計	95,578,374,367
純資産合計	95,578,374,367

負債純資産合計	95,809,340,969
---------	----------------

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年11月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2024年11月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,297,337,435 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.0208 円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (20,208 円)</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年11月11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。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、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、不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</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視部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年11月11日
期首元本額	55,015,213,467円
期中追加設定元本額	14,117,769,021円
期中一部解約元本額	21,835,645,053円
期末元本額	47,297,337,435円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,836,129,439円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,928,334円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,019,221,579円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	20,352,115,500円
コア投資戦略ファンド(安定型)	602,448,365円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,042,334,487円
分散投資コア戦略ファンドA	1,017,119,866円
分散投資コア戦略ファンドS	2,029,781,182円
コア投資戦略ファンド(切替型)	459,626,988円
SMT インデックスバランス・オープン	21,839,154円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	137,260,651円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	16,415,100円
グローバル経済コア	568,800,724円

SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	20,364,472 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	299,327,569 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,105,958 円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	1,168,575,439 円
10資産分散投資ファンド	33,361,250 円
グローバル10資産バランスファンド	58,980,345 円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	212,576,628 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	12,612,123 円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	751,658,647 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）	63,117,783 円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	486,635,852 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		△6,787,109,094
合計		△6,787,109,094

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2024年11月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	3,488,030,610	—	3,340,656,000	△147,374,610
合計		3,488,030,610	—	3,340,656,000	△147,374,610

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,099	238,026,600	

サンケイリアルエステート投資法人	3,039	239,169,300	
S O S i L A 物流リート投資法人	4,733	514,003,800	
東海道リート投資法人	1,621	171,663,900	
日本アコモデーションファンド投資法人	3,276	1,936,116,000	
森ヒルズリート投資法人	11,155	1,422,262,500	
産業ファンド投資法人	17,369	1,988,750,500	
アドバンス・レジデンス投資法人	9,323	2,829,530,500	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,611	1,496,269,500	
G L P 投資法人	31,864	4,116,828,800	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,803	1,393,830,600	
日本プロロジスリート投資法人	16,526	4,060,438,200	
星野リゾート・リート投資法人	4,012	911,125,200	
O n e リート投資法人	1,655	376,512,500	
イオンリート投資法人	11,636	1,473,117,600	
ヒューリックリート投資法人	8,382	1,104,747,600	
日本リート投資法人	3,081	976,677,000	
積水ハウス・リート投資法人	28,506	2,095,191,000	
トーセイ・リート投資法人	2,062	256,100,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,339	247,466,200	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,585	236,010,500	
野村不動産マスターファンド投資法人	30,366	4,284,642,600	
いちごホテルリート投資法人	1,570	209,281,000	
ラサールロジポート投資法人	12,145	1,751,309,000	
スターアジア不動産投資法人	17,481	879,294,300	
マリモ地方創生リート投資法人	1,722	187,870,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	20,678	2,055,393,200	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	1,531	108,547,900	
投資法人みらい	13,063	514,682,200	
三菱地所物流リート投資法人	3,276	1,161,342,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	4,084	567,676,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,624	177,016,000	
タカラレーベン不動産投資法人	6,195	522,858,000	
日本ビルファンド投資法人	55,333	7,187,756,700	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,744	5,495,616,000	
日本都市ファンド投資法人	49,189	4,540,144,700	
オリックス不動産投資法人	18,901	3,029,830,300	

日本プライムリアルティ投資法人	6,488	2,186,456,000	
N T T都市開発リート投資法人	9,642	1,051,942,200	
東急リアル・エステート投資法人	6,360	986,436,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,870	684,939,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	21,220	2,947,458,000	
森トラストリート投資法人	18,285	1,122,699,000	
インヴィンシブル投資法人	52,266	3,308,437,800	
フロンティア不動産投資法人	3,520	1,425,600,000	
平和不動産リート投資法人	6,956	838,198,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,374	1,748,388,200	
福岡リート投資法人	5,353	760,661,300	
K D X不動産投資法人	26,540	3,893,418,000	
いちごオフィスリート投資法人	6,922	544,069,200	
大和証券オフィス投資法人	3,930	1,202,580,000	
阪急阪神リート投資法人	4,523	544,569,200	
スタートプロシード投資法人	1,644	282,439,200	
大和ハウスリート投資法人	14,227	3,302,086,700	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,850	2,387,225,000	
大和証券リビング投資法人	14,011	1,282,006,500	
ジャパンエクセレント投資法人	8,146	963,671,800	
合計	679,706	92,220,379,400	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	96,479,472
コール・ローン	470,814,323

投資証券	139,372,717,531
派生商品評価勘定	89,459
未収入金	3,294,360
未収配当金	117,023,913
未収利息	2,797
流動資産合計	140,060,421,855
資産合計	140,060,421,855
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,253,899
未払金	21,539,730
未払解約金	138,561,580
流動負債合計	161,355,209
負債合計	161,355,209
純資産の部	
元本等	
元本	42,094,997,837
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	97,804,068,809
元本等合計	139,899,066,646
純資産合計	139,899,066,646
負債純資産合計	140,060,421,855

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年11月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>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 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。
--	--------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	2024年11月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		42,094,997,837口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3234円 (33,234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11月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年11月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年11月11日
期首元本額	42,440,513,111円
期中追加設定元本額	8,621,922,117円
期中一部解約元本額	8,967,437,391円
期末元本額	42,094,997,837円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	45,207,252円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	70,730,034円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,511,969,707円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,628,001円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,869,376,737円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	19,292,894,203円
コア投資戦略ファンド(安定型)	381,863,011円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,091,049,272円
分散投資コア戦略ファンドA	1,289,822,691円
分散投資コア戦略ファンドS	3,459,827,749円
コア投資戦略ファンド(切替型)	425,894,435円
SMT インデックスバランス・オープン	103,062,842円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	140,109,442円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,707,638円
グローバル経済コア	384,633,358円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	16,703,310円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	303,695,306円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	99,132,517円
My SMT グローバルREITインデックス(ノーロード)	357,264,702円
10資産分散投資ファンド	17,681,623円
グローバル10資産バランスファンド	42,795,738円
グローバルリートインデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,297,154,140円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	183,157,415円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	98,660,073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)	49,167,129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)	48,300,455円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	80,202,667円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	84,204,527円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	83,893,688円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	78,584,761円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	77,918,065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)	39,317,488円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	53,387,861円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年11月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		25,501,504,257
合計		25,501,504,257

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

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2024年11月11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	372,046,275	—	370,881,835	△1,164,440
	アメリカドル	360,101,300	—	359,062,415	△1,038,885
	オーストラリアドル	10,207,000	—	10,088,870	△118,130
	シンガポールドル	1,737,975	—	1,730,550	△7,425
合計		372,046,275	—	370,881,835	△1,164,440

(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。

- ①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。
- ②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
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	61,245	1,531,125.00	
		AGREE REALTY CORP	59,950	4,544,809.50	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	43,493	857,681.96	
		ALEXANDER'S INC	1,336	307,533.84	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	93,595	10,673,573.80	

	ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	102,486.00	
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	28,846	805,957.24	
	AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	89,479	2,333,612.32	
	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	187,472	6,928,965.12	
	AMERICOLD REALTY TRUST	156,107	3,552,995.32	
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	80,107	684,113.78	
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	134,633	2,144,703.69	
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES	44,991	503,899.20	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	84,995	19,867,581.25	
	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	97,293.00	
	BRANDYWINE REALTY TRUST	107,083	580,389.86	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	179,847	5,168,802.78	
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	115,076	2,029,940.64	
	BRT APARTMENTS CORP	5,000	94,250.00	
	BXP INC	86,581	7,177,564.90	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	63,515	7,732,316.10	
	CARETRUST REIT INC	100,293	3,103,065.42	
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,284	201,038.40	
	CENTERSPACE	8,999	670,065.54	
	CHATHAM LODGING TRUST	25,562	229,546.76	
	CITY OFFICE REIT INC	35,915	191,786.10	
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,980	281,474.20	
	COPT DEFENSE PROPERTIES	67,181	2,159,197.34	
	COUSINS PROPERTIES INC	91,208	2,886,733.20	
	CTO REALTY GROWTH INC	12,400	254,696.00	
	CUBESMART	134,181	6,558,767.28	
	CURLINE PROPERTIES CORP	55,764	1,357,295.76	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	123,244	1,141,239.44	
	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	508,800	295,104.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	184,184	33,517,804.32	
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	307,184.00	
	DOUGLAS EMMETT INC-W/I	100,867	1,944,715.76	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	57,918	784,209.72	
	EASTGROUP PROPERTIES, INC	29,020	5,107,520.00	
	ELME COMMUNITIES	50,407	890,187.62	

EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	85,931	934,069.97	
EPR PROPERTIES	45,488	2,060,151.52	
EQUINIX INC	56,838	52,351,208.28	
EQUITY COMMONWEALTH	64,832	1,304,419.84	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	111,097	7,935,658.71	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	204,362	15,026,737.86	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	104,848	3,469,420.32	
ESSEX PROPERTY TRUST	38,581	11,754,087.46	
EXTRA SPACE STORAGE INC	126,626	21,235,180.20	
FARMLAND PARTNERS INC	28,000	344,400.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	44,889	5,133,057.15	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	79,030	4,232,056.50	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	55,891	1,567,742.55	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	90,107.08	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	163,409	8,132,865.93	
GETTY REALTY CORP	30,825	986,091.75	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	27,780	477,816.00	
GLADSTONE LAND CORP	24,504	316,346.64	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	37,791	338,607.36	
GLOBAL NET LEASE INC	122,132	963,621.48	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	216,948	3,857,335.44	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	423,798	9,645,642.48	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	63,725	2,153,267.75	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	418,449	7,536,266.49	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	86,787	395,748.72	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	134,676	2,814,728.40	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	124,040.84	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	17,011	1,809,460.07	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	47,425	1,467,329.50	
INVITATION HOMES INC	342,336	11,536,723.20	
IRON MOUNTAIN INC	175,253	20,979,536.63	
JBG SMITH PROPERTIES	53,757	935,371.80	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	77,107.50	
KILROY REALTY CORPORATION	63,383	2,632,929.82	
KIMCO REALTY CORP	405,746	10,115,247.78	

	KITE REALTY GROUP TRUST	131,391	3,606,682.95	
	LAMAR ADVERTISING CO-A	52,367	6,733,348.86	
	LINEAGE INC	35,589	2,395,851.48	
	LTC PROPERTIES INC	25,175	988,874.00	
	LXP INDUSTRIAL TRUST	171,218	1,660,814.60	
	MACERICH CO/THE	129,674	2,531,236.48	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	81,010.90	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	360,602	1,770,555.82	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	70,252	11,179,903.28	
	MODIV INDUSTRIAL INC	6,921	115,995.96	
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	43,451	1,897,939.68	
	NATL HEALTH INVESTORS INC	26,103	2,119,563.60	
	NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,552	274,433.68	
	NETSTREIT CORP	47,896	773,041.44	
	NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	16,812	102,048.84	
	NEXPOINT RESIDENTIAL	13,856	638,761.60	
	NNN REIT INC	109,572	4,696,255.92	
	OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	31,425.06	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	153,715	6,356,115.25	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	248,597.09	
	ORION OFFICE REIT INC	34,844	141,815.08	
	OUTFRONT MEDIA INC	83,040	1,467,316.80	
	PARAMOUNT GROUP INC	100,128	524,670.72	
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	127,373	1,873,656.83	
	PEAKSTONE REALTY TRUST	19,000	263,910.00	
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,170	921,651.50	
	PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	73,421	2,861,216.37	
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,983	720,125.07	
	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	21,712	453,780.80	
	POSTAL REALTY TRUST INC- A	13,280	192,427.20	
	PRIME US REIT	324,500	53,218.00	
	PROLOGIS INC	553,943	64,163,217.69	
	PUBLIC STORAGE	94,240	31,986,940.80	
	REALTY INCOME CORP	521,555	29,994,628.05	
	REGENCY CENTERS CORP	97,337	7,226,298.88	

	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	74,747	1,295,365.51	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	130,561	5,628,484.71	
	RLJ LODGING TRUST	98,213	954,630.36	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	35,798	4,027,275.00	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	140,484	2,746,462.20	
	SAFEHOLD INC	27,407	581,028.40	
	SAUL CENTERS INC	6,846	286,368.18	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	89,989	286,165.02	
	SIMON PROPERTY GROUP	183,367	32,826,360.34	
	SITE CENTERS CORP	27,882	442,208.52	
	SL GREEN REALTY CORP	38,851	3,136,441.23	
	STAG INDUSTRIAL INC	108,775	4,066,009.50	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	67,952	445,085.60	
	SUN COMMUNITIES INC	70,579	8,844,960.28	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	125,287	1,354,352.47	
	TANGER INC	65,707	2,334,569.71	
	TERRENO REALTY CORP	57,912	3,590,544.00	
	UDR INC	178,761	7,951,289.28	
	UMH PROPERTIES INC	38,966	753,602.44	
	UNITI GROUP INC	142,514	840,832.60	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,811	332,358.05	
	URBAN EDGE PROPERTIES	70,777	1,662,551.73	
	VENTAS INC	247,366	16,115,894.90	
	VERIS RESIDENTIAL INC	47,792	864,557.28	
	VICI PROPERTIES INC	625,816	19,644,364.24	
	VORNADO REALTY TRUST	99,051	4,532,573.76	
	WELLTOWER INC	346,320	47,861,424.00	
	WHITESTONE REIT	25,954	374,775.76	
	WP CAREY INC	130,336	7,393,961.28	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,467	957,717.03	
	アメリカドル 小計	15,852,406	727,515,152.86 (111,411,670,508)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	37,679	692,540.02	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	236,877.30	

	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,841	1,059,202.17	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	49,417	2,238,590.10	
	CHOICE PROPERTIES REIT	98,063	1,369,940.11	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	391,213.44	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	422,882.50	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	82,960	1,076,820.80	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,669	54,714.50	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	62,299	1,116,398.08	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,753	1,426,165.65	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	76,841	822,198.70	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	42,842	464,407.28	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,557	654,248.80	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	155,622.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,956	235,669.64	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	131,002.70	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	299,658.48	
	PRIMARIS REIT	30,375	484,177.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	89,268	1,690,735.92	
	SLATE GROCERY REIT	16,578	230,268.42	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	43,580	1,089,935.80	
	カナダドル 小計	885,302	16,343,269.91 (1,798,903,718)	
ユーロ	AEDIFICA	28,671	1,684,421.25	
	ALTAREA	2,775	288,600.00	
	CARE PROPERTY INVEST	22,887	282,883.32	
	CARMILA	32,392	544,185.60	
	COFINIMMO	22,512	1,310,198.40	
	COVIVIO(FP)	32,109	1,700,171.55	
	CROMWELL REIT EUR	233,500	378,270.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	25,490	597,740.50	
	GECINA SA	31,111	3,033,322.50	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	238,280.00	
	ICADE	21,791	512,088.50	

	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	75,858.55	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	205,464	1,126,970.04	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	363,595	314,873.27	
	KLEPIERRE	131,702	3,782,481.44	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	22,979	188,887.38	
	MERCIALYS	53,414	557,108.02	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	236,880	2,409,069.60	
	MONTEA NV	12,266	802,196.40	
	NSI NV	11,864	234,195.36	
	RETAIL ESTATES	6,645	404,680.50	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	17,995	735,095.75	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	59,784	4,420,428.96	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	106,191	2,251,249.20	
	WERELDHAVE NV	22,533	319,517.94	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	21,700	651,000.00	
	ユーロ 小計	1,797,040	28,843,774.03 (4,731,532,691)	
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	233,848	144,050.36	
	AEW UK REIT PLC	68,000	65,960.00	
	ASSURA PLC	1,814,839	703,431.59	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	362,128.80	
	BIG YELLOW GROUP PLC	118,103	1,424,322.18	
	BRITISH LAND CO PLC	591,977	2,288,583.08	
	CARE REIT PLC	242,293	204,495.29	
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	66,937.86	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	182,501.00	
	DERWENT LONDON PLC	67,447	1,456,855.20	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	316,908	288,386.28	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	233,105	727,287.60	
	HAMMERSON PLC	283,307	818,190.61	
	HELICAL PLC	65,400	127,268.40	
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	444,935	2,638,464.55	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	76,083.34	

	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1, 221, 233	2, 334, 997. 49	
	NEWRIVER REIT PL	196, 000	156, 016. 00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	348, 000	240, 816. 00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	812, 946	774, 737. 53	
	PRS REIT PLC/THE	340, 013	362, 453. 85	
	REGIONAL REIT LTD	91, 200	113, 452. 80	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	131, 866	1, 054, 268. 67	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	345, 000	169, 050. 00	
	SEGRO PLC	804, 437	6, 274, 608. 60	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1, 172, 248	1, 577, 845. 80	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	840, 629	585, 918. 41	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	347, 000	306, 401. 00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203, 286	130, 712. 89	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1, 484, 144	2, 054, 055. 29	
	UNITE GROUP PLC	248, 532	2, 148, 559. 14	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	261, 651	292, 525. 81	
	WAREHOUSE REIT PLC	237, 876	200, 291. 59	
	WORKSPACE GROUP PLC	75, 057	420, 319. 20	
	イギリスポンド 小計	15, 402, 726	30, 923, 643. 00 (6, 115, 150, 403)	
オーストラ リアドル	ABACUS GROUP	224, 474	271, 613. 54	
	ABACUS STORAGE KING	347, 779	413, 857. 01	
	ARENA REIT	230, 160	918, 338. 40	
	BWP TRUST	354, 985	1, 206, 949. 00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	491, 955	883, 059. 22	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	316, 821	956, 799. 42	
	CENTURIA OFFICE REIT	203, 929	241, 655. 86	
	CHARTER HALL GROUP	283, 470	4, 249, 215. 30	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	406, 059	1, 563, 327. 15	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	307, 930	1, 034, 644. 80	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	210, 134	548, 449. 74	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669, 440	264, 428. 80	
	DEXUS	644, 157	4, 573, 514. 70	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113, 000	297, 190. 00	
	GOODMAN GROUP	1, 048, 636	37, 436, 305. 20	
	GPT GROUP	1, 145, 526	5, 189, 232. 78	

	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	351,189.30	
	HEALTHCO REIT	300,321	334,857.91	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	1,115,956	1,394,945.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	365,633.36	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	241,409	1,170,833.65	
	MIRVAC GROUP	2,361,833	4,959,849.30	
	NATIONAL STORAGE REIT	831,282	2,053,266.54	
	REGION RE GROUP	676,974	1,462,263.84	
	RURAL FUNDS GROUP	222,079	413,066.94	
	SCENTRE GROUP	3,094,291	10,644,361.04	
	STOCKLAND	1,424,840	7,181,193.60	
	VICINITY CENTERS	2,315,843	4,886,428.73	
	WAYPOINT REIT LTD	398,821	989,076.08	
	オーストラリアドル 小計	20,223,620	96,255,546.21 (9,712,184,612)	
ニュージーランドドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	630,524	1,314,642.54	
	ニュージーランドドル 小計	630,524	1,314,642.54 (120,105,742)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,167,000	2,123,940.00	
	FORTUNE REIT	875,000	3,640,000.00	
	LINK REIT	1,529,600	55,677,440.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,065,900.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,398,126.20	
	香港ドル 小計	5,439,260	63,905,406.20 (1,258,936,502)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	379,900	478,674.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,104,718	5,493,313.98	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,530,877	1,370,134.91	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	469,551.33	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	3,231,596	6,366,244.12	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	346,173.00	
	EC WORLD REIT	180,000	46,704.60	
	ESR-LOGOS REIT	3,505,364	946,448.28	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	329,400.00	

		FRASERS CENTREPOINT TRUST	715,662	1,510,046.82	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,773,996	1,773,996.00	
		KEPPEL DC REIT	815,803	1,762,134.48	
		KEPPEL REIT	1,450,200	1,276,176.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	917,650	518,472.25	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,245,863	2,828,109.01	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,030,385	2,598,892.80	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,400,673	1,736,834.52	
		QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,250,000	362,500.00	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	233,000	836,470.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	295,800	201,144.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	863,000	427,185.00	
		SUNTEC REIT	1,328,400	1,487,808.00	
		シンガポールドル 小計	26,834,008	33,166,413.10 (3,826,740,743)	
	韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	86,720	408,017,600.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	31,000	154,845,000.00	
		JR REIT XXVII	134,877	404,631,000.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	27,961	126,104,110.00	
		LOTTE REIT CO LTD	86,202	281,449,530.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	62,917	357,997,730.00	
		SK REITS CO LTD	106,701	484,422,540.00	
		韓国ウォン 小計	536,378	2,217,467,510.00 (243,256,185)	
	イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	709,200.00	
		REIT 1 LTD	103,500	1,805,040.00	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	155,000	1,263,250.00	
		イスラエルシェケル 小計	618,500	3,777,490.00 (154,236,427)	
		合計	88,219,764	139,372,717,531 (139,372,717,531)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 141 銘柄	100.0%	79.9%
カナダドル	投資証券 22 銘柄	100.0%	1.3%
ユーロ	投資証券 26 銘柄	100.0%	3.4%
イギリスポンド	投資証券 36 銘柄	100.0%	4.4%
オーストラリアドル	投資証券 29 銘柄	100.0%	7.0%
ニュージーランドドル	投資証券 1 銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	投資証券 5 銘柄	100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券 22 銘柄	100.0%	2.7%
韓国ウォン	投資証券 7 銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3 銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2 【ファンドの現況】

【SBI 資産設計オープン（資産成長型）】

【純資産額計算書】

(2024年11月29日現在)

I 資産総額	43,224,118,586円
II 負債総額	45,392,284円
III 純資産総額（I－II）	43,178,726,302円
IV 発行済口数	18,365,120,381口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.3511円
（1万口当たり純資産額）	（23,511円）

(参考)

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年11月29日現在)

I 資産総額	759,141,455,051円
II 負債総額	50,769,462,520円
III 純資産総額（I－II）	708,371,992,531円
IV 発行済口数	543,152,783,629口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3042円
（1万口当たり純資産額）	（13,042円）

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年11月29日現在)

I 資産総額	712,490,342,364円
II 負債総額	13,732,517,142円
III 純資産総額（I－II）	698,757,825,222円
IV 発行済口数	248,249,603,332口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.8147円
（1万口当たり純資産額）	（28,147円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年11月29日現在)

I 資産総額	372,541,353,804円
II 負債総額	159,261,017円
III 純資産総額 (I - II)	372,382,092,787円
IV 発行済口数	103,400,040,239口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	3.6014円
(1万口当たり純資産額)	(36,014円)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年11月29日現在)

I 資産総額	836,982,299,578円
II 負債総額	1,782,960,097円
III 純資産総額 (I - II)	835,199,339,481円
IV 発行済口数	117,940,956,832口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	7.0815円
(1万口当たり純資産額)	(70,815円)

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年11月29日現在)

I 資産総額	95,901,876,740円
II 負債総額	497,627,878円
III 純資産総額 (I - II)	95,404,248,862円
IV 発行済口数	47,475,543,274口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.0095円
(1万口当たり純資産額)	(20,095円)

純資産額計算書

(2024年11月29日現在)

I 資産総額	141,397,835,848円
II 負債総額	246,531,750円
III 純資産総額 (I - II)	141,151,304,098円
IV 発行済口数	42,247,495,774口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	3.3411円
(1万口当たり純資産額)	(33,411円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

(2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限

該当事項はありません。

(4) 振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

① 受益証券の不発行

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

② 受益権の譲渡

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

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

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

③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

④ 受益権の再分割

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

⑤ 償還金

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

⑥ 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2024年11月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

① 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、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

② 投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネージャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定しま

す。

[DO (実行)]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK (検証・評価)]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN-DO-CHECK の PDC サイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は 2025 年 2 月 10 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2024 年 11 月 29 日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	532	15,942,848
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	58	202,419
単位型公社債投資信託	52	172,709
合計	642	16,317,975

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 期事業年度の中間会計期間（自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

(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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	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、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. グループ通算制度の適用
グループ通算制度を適用しております。

(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

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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)				
その他有価証券	—	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)				
その他有価証券	—	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				
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

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 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

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（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いません。

2. 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

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		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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	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	263 百万円
投資有価証券償還損	239 百万円
為替差損	146 百万円
デリバティブ費用	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)				
その他有価証券	—	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	(281)	(230)	—	(511)
通貨関連取引	—	(286)	—	(286)
デリバティブ取引計	(281)	(517)	—	(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ズワップの時価は、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)

	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	—	△182

(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おりません。	

(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) 通常の実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

通常の実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2月10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。

追加型証券投資信託
SBI 資産設計オープン（資産成長型）
約款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

約款第 18 条にもとづき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、主要投資対象の見直しおよび追加が行われる場合があります。

(2) 投資態度

- ①主として、各マザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。
- ②各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。

マザーファンド 受益証券	基本組入 比率
国内債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
国内株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
外国債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
外国株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
J-REIT インデックス マザーファンド受益証券	10%
グローバル REIT インデックス マザーファンド受益証券	10%

- ③前項に定める各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ④各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年 1 回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。
- ⑤実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。
- ⑥株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として投資信託財産総額の 70%以下とします。

⑦ただし、資金動向および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。

(3)運用制限

- ①株式への直接投資は行いません。
- ②外貨建資産への直接投資は行いません。
- ③デリバティブへの直接投資は行いません。
- ④外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。
- ⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。

(1)分配対象額の範囲

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

(2)分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

(3)留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託 SBI 資産設計オープン（資産成長型） 約款

（信託の種類、委託者および受託者）

第1条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

②この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第2条 受託者は、信託法第28条第1号にもとづく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第17条第1項、第17条第2項および第21条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②第1項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的、金額および限度額）

第3条 委託者は、金472,660,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託を行ったときは、受託者はその引受を証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第4条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第40条第1項、第40条第2項、第41条第1項、第42条第1項および第44条第2項の規定による信託終了の日または投資信託契約解約の日までとします。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第5条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第6条 この投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割および再分割）

第7条 委託者は、第3条第1項による受益権については472,660,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行され

た場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

(追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法)

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た金額とします。

- ②この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第19条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令およ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口数で除した金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託のすべての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）およ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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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。）。

- ②委託者は、この信託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また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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③委託者は、第7条の規定により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または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第11条 受託者は、投資信託契約締結日に生じた受益権については投資信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

(受益権の申込単位および価額)

第12条 指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第7条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、指定販売会社が委託者の承認を得て定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることがで

きるものとし、ただし、指定販売会社と別に定める自動けいぞく投資契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益者に係る収益分配金の再投資の場合は、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとし、なお、ニューヨークまたはロンドンの銀行もしくは取引所（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。）の休業日においては、取得の申込みは受け付けられないものとし、

- ②第1項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第3項または第4項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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または記録を行うことができます。
- ③第1項の受益権の価額は、この投資信託契約締結日以降は、原則として、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込みに係る当該価額は、1口につき1円とします。
- ④第3項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約にもとづいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第29条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑤第1項から第4項の規定にかかわらず、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、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第13条 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また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、

- ②第1項の申請のある場合には、第1項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとし、ただし、第1項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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとし、
- ③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載また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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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）

第14条 受益権の譲渡は、第13条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類）

第15条 この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとし、

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. 金銭債権
 - ハ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

（運用の指図範囲）

第 16 条 委託者は、信託金を主として次に掲げる第 1 号から第 6 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親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）ならびに第 7 号から第 11 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くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. J-REIT インデックス マザーファンド
6. グローバル REIT インデックス マザーファンド
7. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 7 号の証券の性質を有するもの
9. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
10. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
11. 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。）

なお、第 9 号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

②委託者は、信託金を、第 1 項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

③第 1 項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託

者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を第 2 項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。

(利害関係人等との取引等)

第 17 条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第 21 条第 1 項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第 15 条ならびに第 16 条第 1 項および第 2 項に掲げる資産への投資等ならびに第 19 条、第 24 条、第 25 条および第 26 条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限にもとづいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第 31 条の 4 第 3 項および同条第 4 項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、第 15 条ならびに第 16 条第 1 項および第 2 項に掲げる資産への投資等ならびに第 19 条、第 24 条、第 25 条および第 26 条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④第 1 項から第 3 項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第 31 条第 3 項および同法第 32 条第 3 項の通知は行いません。

(運用の基本方針)

第 18 条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

(公社債の借入れ)

第 19 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ②第 1 項の指図は、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。
- ③投資信託財産の一部解約等の事由により、第 2 項の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④第 1 項の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

(実質組入外貨建資産への投資制限)

第 20 条 委託者は、マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 65 を超えることとなる投資の指図をしません。有価証券の値上がり等により 100 分の 65 を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

- ②第 1 項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(信託業務の委託等)

第 21 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、第 1 項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が第 1 項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③第 1 項および第 2 項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存に係る業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(混蔵寄託)

第 22 条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第 2 条第 9 項に規定するものをいいます。

本条においては、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含みます。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

(投資信託財産の登記等および記載等の留保等)

第 23 条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②第 1 項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算

を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)

第 24 条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第 25 条 委託者は、第 24 条の規定によるマザーファンド受益証券の一部解約代金、有価証券の売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

(資金の借入れ)

第 26 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借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。

②一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。

③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。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第 27 条 委託者の指図にもとづく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第 28 条 投資信託財産に属する有価証券について、借替えがある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②投資信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③第 1 項および第 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第 29 条 この信託の計算期間は、毎年 11 月 11 日から翌年 11 月 10 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は平成 20 年 1 月 9 日から平成 20 年 11 月 10 日までとします。

②第 1 項の規定にかかわらず、第 1 項の原則により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、第 4 条に定める信託期間の終了日とします。

(投資信託財産に関する報告等)

第 30 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、第 1 項および第 2 項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第 37 条第 3 項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第 37 条第 2 項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第 38 条第 1 項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(他の受益者の氏名等の開示の請求の制限)

第 31 条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

(信託事務の諸費用)

第 32 条 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および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産に係る会計監査費用（消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）を含みます。）は、第 29 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額および支弁の方法)

第 33 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、次の各号により計算された額の合計額とします。

1. 第 29 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 68 の率を乗じて得た額
2. マザーファンド（第 16 条に定める親投資信託をいいます。以下本項において同じ。）において有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料（貸付有価証券の利子又は配当金等相当額を含まないものとします。また、有価証券の貸付にあたって担保として金銭を受け入れた場合には、当該品貸料に、当該金銭の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付の相手方に支払う当該金銭に対する利息額を控除して得た額（ただし、この額が負の場合は、零とします。）とすることができます。以下同じ。）のうち投資信託財産に属するとみなした額に 100 分の 50 未満の率を乗じて得た額
3. 前号において、投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属する当該マザーファンドの受益証券の時価総額に当該マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める品貸料の割合を乗じて得た額とします。

②第 1 項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ケ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

- ③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第 34 条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 投資信託財産に属する配当等収益（配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減して得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ②第 1 項第 1 号におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの投資信託財産に係る配当等収益の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投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- ③毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第 35 条 収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末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計算期間の末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指定販売会社の名義で記載また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します。）に支払います。

- ②第 1 項の規定にかかわらず、別に定める契約にもとづいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

- ③償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了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、当該信託終了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指定販売会社の名義で記載また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します。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と口口

数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

- ④一部解約金は、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 営業日目から受益者に支払います。
- ⑤第 1 項、第 3 項および第 4 項に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとし、
- ⑥収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、
- ⑦第 6 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、また、第 6 項に規定する「各受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第 36 条 受託者は、収益分配金については、第 35 条第 1 項に規定する支払開始日および第 35 条第 2 項に規定する交付開始前までに、償還金については第 35 条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 35 条第 4 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ②受託者は、第 1 項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金および償還金の時効)

第 37 条 受益者が、収益分配金については第 35 条第 1 項に規定する支払開始日から 5 年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第 35 条第 3 項に規定する支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(投資信託契約の一部解約)

第 38 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に指定販売会社が委託者の承認を得て定める解約単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、ニューヨークまたはロンドンの銀行もしくは取引所の休業日に該当する場合には、指定販売会社は一部解約の請求の受付を行いません。

- ②投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとし、
- ③委託者は、第 1 項の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。なお、第 1 項の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者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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。
- ④第 3 項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に 0.15%の率を乗じて得た信託財産留保金を控除した価額とします。
- ⑤委託者は、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、第 1 項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およ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。

- ⑥第 5 項により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、第 4 項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第 39 条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしがって取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

第 40 条 委託者は、信託期間中において、この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とき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 5 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ③委託者は、第 1 項および第 2 項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- ④第 3 項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- ⑤第 3 項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上に当たる多数をもって行います。

- ⑥第 3 項から第 5 項までの規定は、委託者が投資信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第 3 項から第 5 項までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

(投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第 41 条 委託者は、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、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第 45 条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第 42 条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②第 1 項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 45 条第 2 項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第 43 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第 44 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第 45 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(投資信託約款の変更等)

第 45 条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第 16 条第 2 号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この投資信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ②委託者は、第 1 項の事項（第 1 項の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

- ③第 2 項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- ④第 2 項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上に当たる多数をもって行います。

- ⑤書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第2項から第5項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦第1項から第6項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(反対者の買取請求権)

第46条 (削除)

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第46条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。

この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(公告)

第47条 委託者が受益者に対して行う公告は、日本経済新聞に掲載します。

(投資信託約款に関する疑義の取扱い)

第48条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めま

す。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成20年1月9日

委託者 住信アセットマネジメント株式会社

受託者 住友信託銀行株式会社