

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年11月21日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCバランスファンド30 DCバランスファンド50 DCバランスファンド70
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	DCバランスファンド30 10兆円を上限とします。 DCバランスファンド50 10兆円を上限とします。 DCバランスファンド70 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DCバランスファンド30

DCバランスファンド50

DCバランスファンド70

（以下、上記ファンドを総称して「当ファンド」又は「DCバランスファンド」といいます。また、DCバランスファンド30を「DCバランス30」、DCバランスファンド50を「DCバランス50」、DCバランスファンド70を「DCバランス70」ということがあります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

2019年11月22日から2020年 5月21日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引所（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での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う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、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

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、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

- (1)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。

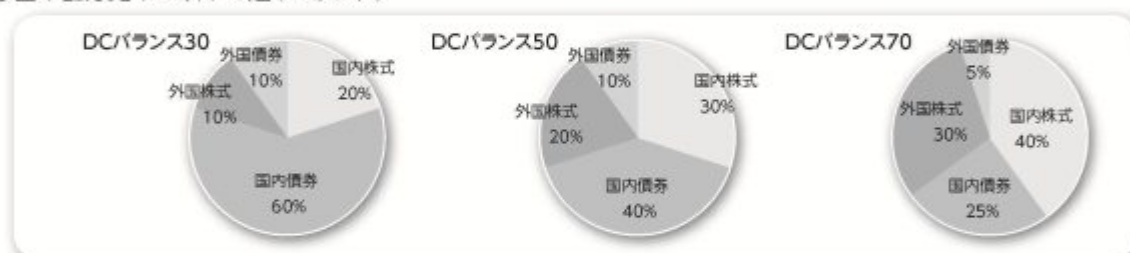
< ファンドの特色 >

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

- 資産配分の異なる3つのファンドから、皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じてご選択いただけます。
DCバランスファンド30(以下「DCバランス30」という場合があります。)
DCバランスファンド50(以下「DCバランス50」という場合があります。)
DCバランスファンド70(以下「DCバランス70」という場合があります。)

国内外の株式・公社債へ分散投資します。

- 日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド(以下これらを「マザーファンド」という場合があります。)への投資を通じて、国内外の株式・公社債へ分散投資します。
- 各マザーファンドは、それぞれの資産の市場全体の動きと連動することを目指すインデックス運用を行います。
- 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
- 基本配分比率は以下の通りとします。



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

<投資対象とするマザーファンド>

国内株式	日本株式マザーファンド	「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」に連動する投資成果を目標とします。
国内債券	日本債券マザーファンド	「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果を目標とします。
外国株式	外国株式マザーファンド	「MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)」に連動する投資成果を目標とします。
外国債券	外国債券マザーファンド	「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」に連動する投資成果を目標とします。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは各ファンドの基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

なお、各マザーファンドの運用プロセスは次の通りです。ただし、今後変更となる場合があります。

日本株式マザーファンド

原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、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。日次でベンチマークとの収益率乖離をチェックした上で、ポートフォリオとベンチマークの諸属性の乖離状況を把握し、個別銘柄構成比をベンチマークの市場構成比に極力合致させます。また、キャッシュポジションは株式先物を用いてヘッジし、ベンチマークとの連動性を高めます。

日本債券マザーファンド

わが国の公社債に分散投資を行い、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。日次でベンチマークとの収益率乖離をチェックした上で、ポートフォリオとベンチマークの諸属性の乖離を極小化します。また、キャッシュポジションは債券先物を用いてヘッジし、ベンチマークとの連動性を高めます。

外国株式マザーファンド

MSCIコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス(配当込み、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。日次でベンチマークとの収益率乖離をチェックした上で、ポートフォリオとベンチマークの諸属性の乖離状況を把握し、個別銘柄構成比をベンチマークの市場構成比に極力合致させます。また、キャッシュポジションは株式先物・為替予約・外貨預金を用いてヘッジし、ベンチマークとの連動性を高めます。

外国債券マザーファンド

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。日次でベンチマークとの収益率乖離をチェックした上で、ポートフォリオとベンチマークの諸属性の乖離を極小化します。また、キャッシュポジションは債券先物・為替予約・外貨預金を用いてヘッジし、ベンチマークとの連動性を高めます。

●複合指数について

ファンドにはベンチマークはありませんが、各マザーファンドのベンチマークを指数化したものに、基本配分比率を乗じて指数化した複合指数(当社にて計算したものです。)を参考指数として用いることがあります。
各マザーファンドを基本配分比率(資産毎に一定の変動許容幅を設けます。)に基づいて組入れることで、参考指数の動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。

ファンドのしくみ

ファミリーファンド方式で運用します。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。



分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
 - 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入及び売買益(評価益を含みます。)等の合計額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
 - 収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、取得時において以下の通りとします。

DCバランス30	信託財産の純資産総額の40%以下
DCバランス50	信託財産の純資産総額の60%以下
DCバランス70	信託財産の純資産総額の80%以下

- 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下の通りとします。

DCバランス30	信託財産の純資産総額の30%以下
DCバランス50	信託財産の純資産総額の40%以下
DCバランス70	信託財産の純資産総額の45%以下

◆各マザーファンドが対象とする指数は次の通りです。

日本株式マザーファンド「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」

TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

「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。

同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。

なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」

NOMURA-BPI総合とは、野村證券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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。

外国株式マザーファンド「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。

外国債券マザーファンド「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、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および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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。

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

(2)【ファンドの沿革】

2006年9月29日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

2012年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

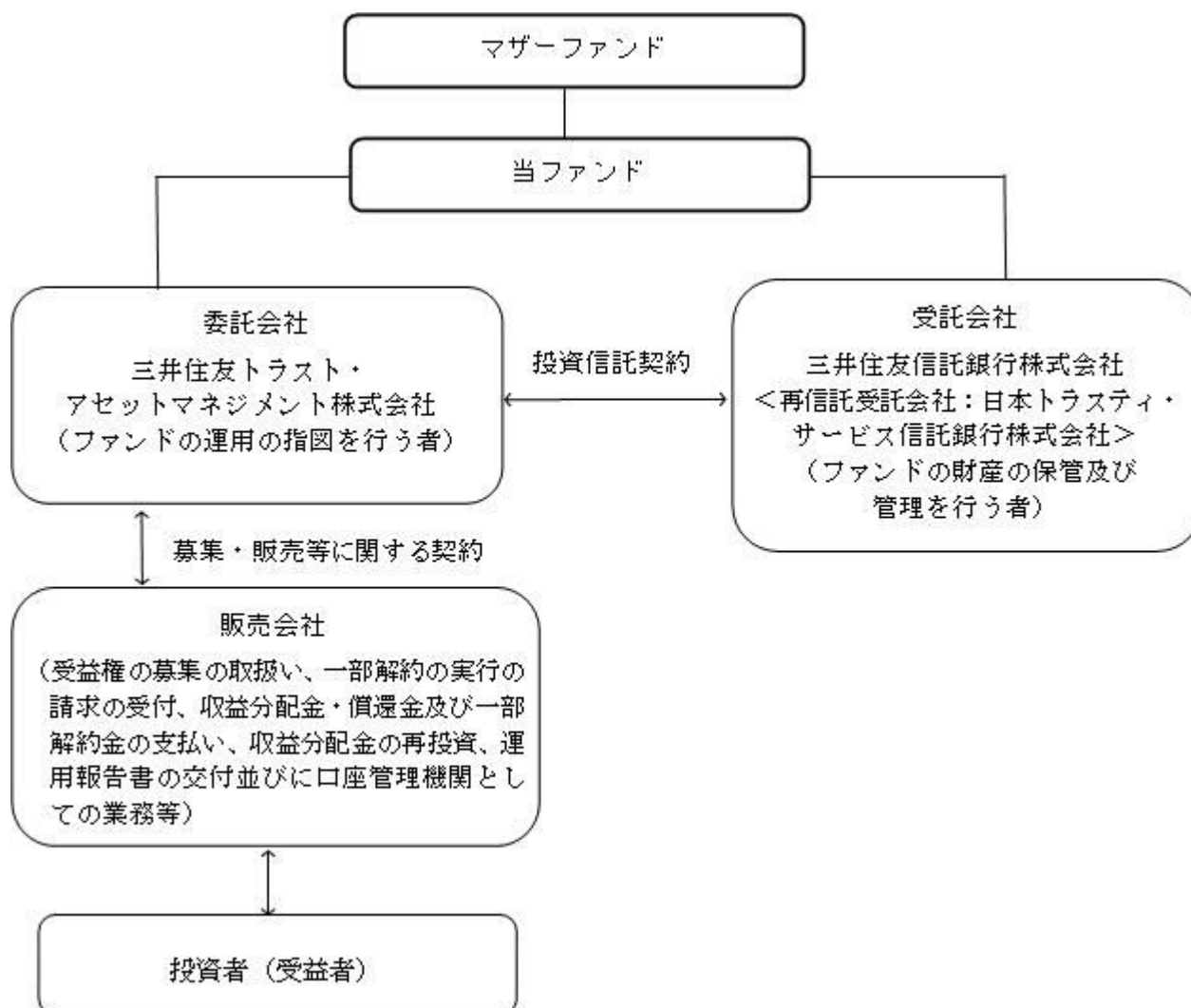
ファンドの名称を中央三井DCバランスファンド30からDCバランスファンド30、中央三井DCバランスファンド50からDCバランスファンド50、中央三井DCバランスファンド70からDCバランスファンド70に変更

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザー

ファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、
中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

（３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2019年 9月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
-----	----	-----	------

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

当ファンドは、日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド」という場合があります。）を主要投資対象とし、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。このほか、国内外の株式・公社債等に直接投資することもあります。

投資態度

A．主として、マザーファンド受益証券に投資し、実質的に国内外の株式・公社債へ分散投資を行うことにより、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

B．各資産への基本配分比率は以下のとおりです。資産配分の異なる3つのファンドから、皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じてご選択いただけます。

	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券
DCバランス30	20%	60%	10%	10%
DCバランス50	30%	40%	20%	10%
DCバランス70	40%	25%	30%	5%

C．上記B．の基本配分比率には資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては原則為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。

E．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

F．ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。

G．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、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。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」という場合があります。）を行うことができます。

I．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定

めるものをいいます。以下同じ。)

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第24条、第25条及び第26条に定めるものに限りません。）
3. 金銭債権（上記1.、2.及び下記4.に掲げるものに該当するものを除きます。）
4. 約束手形（上記1.に掲げるものに該当するものを除きます。）

B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、
「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」及び「外国債券マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券
9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証券で、上記1.から11.までの証券又は証券の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
14. 投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券又は証券（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受

益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの

なお、上記1. の証券又は証書並びに上記12. 及び17. の証券又は証書のうち上記1. の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2. から6. までの証券並びに上記12. 及び17. の証券又は証書のうち上記2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13. の証券及び上記14. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

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

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所（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での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

（2）投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、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。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

運用の効率化を図るため、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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取

引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の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。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「日本債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指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

わが国の公社債に投資を行い、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。

運用の効率化をはかるため、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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

MSCIコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、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。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化を図るため、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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価

証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「外国債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指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

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化をはかるため、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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）を行使したものに限り、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、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回の毎決算時（決算日は2月21日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

- ・分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入及び売買益（評価益を含みます。）等の合計額とします。
- ・分配金額については、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。
- ・収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

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 >

A．株式への投資割合

委託会社は、株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

DCバランスファンド30.....信託財産の純資産総額の40%以下

DCバランスファンド50.....信託財産の純資産総額の60%以下

DCバランスファンド70.....信託財産の純資産総額の80%以下

B．外貨建資産の投資割合

委託会社は、外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

DCバランスファンド30.....信託財産の純資産総額の30%以下

DCバランスファンド50.....信託財産の純資産総額の40%以下

DCバランスファンド70.....信託財産の純資産総額の45%以下

C．新株引受権証券等への投資割合

委託会社は、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

D．投資信託証券への投資割合

委託会社は、投資信託証券（マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

E．同一銘柄の株式への投資制限

委託会社は、同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

委託会社は、同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

G．同一銘柄の転換社債等への投資制限

委託会社は、同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

H．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引所及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

I．信用取引の指図範囲

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

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（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信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

Ｊ．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

Ｋ．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

Ｌ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

Ｍ．有価証券の貸付の指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の

a．及びb．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

- ハ．委託会社は、有価証券の貸付にあたり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしてします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- O．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- P．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- Q．外国為替予約取引の指図
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（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。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- R．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- S．再投資の指図
- 委託会社は、上記R．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

T．資金の借入れ

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から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、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、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。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及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りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

V．受託会社の自己又は利害関係人等との取引

イ．受託会社は、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並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社及び受託会社の利害関係人（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。以下イ．において同じ。）、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、上記（2）に定める資産への投資等を行うことができます。

ロ．上記イ．の取扱いは、上記I．からO．まで、及びQ．からS．までにおける委託会社の指図による取引についても同様とします。

W．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。

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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。

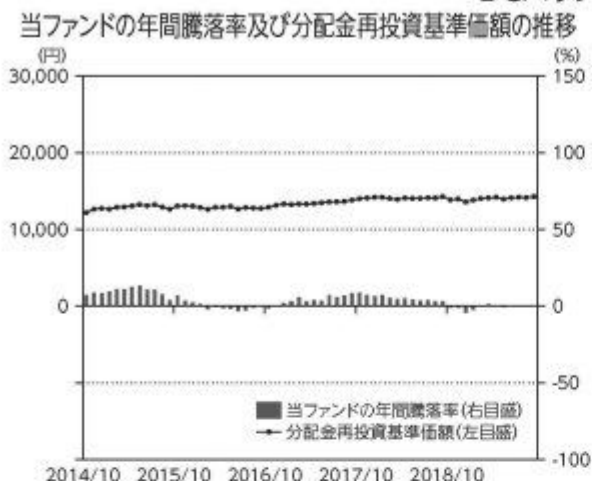
（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

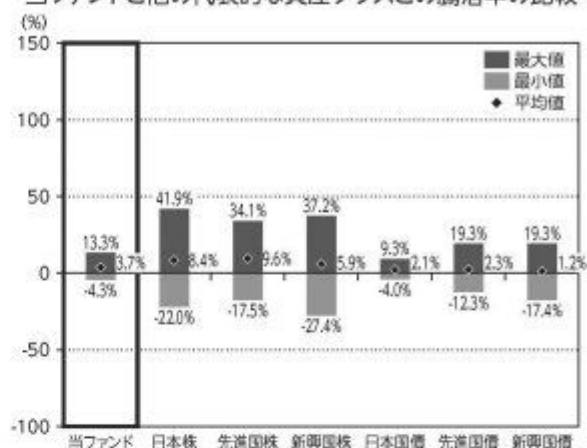
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

〔参考情報〕

DCバランスファンド30



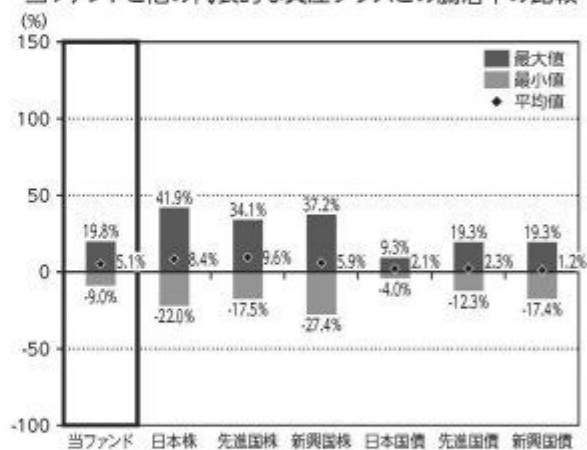
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



DCバランスファンド50



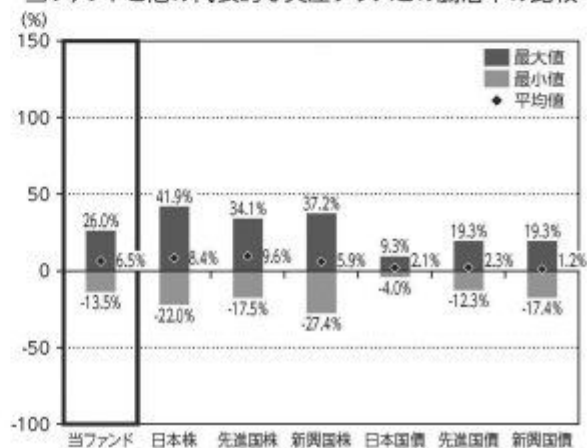
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



DCバランスファンド70



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



【参考情報】

- *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。

- *2014年10月～2019年9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、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「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。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIロクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公算固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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 JPMorgan Global Bond Index - Emerging Markets Global Bond Index (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、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ていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に下記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。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

	信託財産留保率
DCバランス30	0.13%
DCバランス50	0.15%
DCバランス70	0.17%

「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

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

DCバランスファンド30：年率 0.231%（税抜 0.21%）（ ）

DCバランスファンド50：年率 0.242%（税抜 0.22%）

DCバランスファンド70：年率 0.253%（税抜 0.23%）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	DCバランスファンド30：年率 0.121%（税抜 0.11%） DCバランスファンド50：年率 0.132%（税抜 0.12%） DCバランスファンド70：年率 0.143%（税抜 0.13%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	DCバランスファンド30：年率 0.066%（税抜 0.06%） DCバランスファンド50：年率 0.066%（税抜 0.06%） DCバランスファンド70：年率 0.066%（税抜 0.06%）	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	DCバランスファンド30：年率 0.044%（税抜 0.04%） DCバランスファンド50：年率 0.044%（税抜 0.04%） DCバランスファンド70：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。

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2019年 9月30日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2019年9月30日現在の状況について記載してあります。

【DCバランスファンド30】

（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	19,381,328,462	99.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		59,902,751	0.31
合計(純資産総額)		19,441,231,213	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	8,243,498,878	1.3783	11,362,026,106	1.4026	11,562,331,526	59.47

日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,312,674,481	1.6969	3,924,463,522	1.7126	3,960,686,316	20.37
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	731,872,415	2.6694	1,953,721,017	2.7622	2,021,577,984	10.40
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	756,479,669	2.3554	1,781,835,688	2.4280	1,836,732,636	9.45

(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	99.69
合計	99.69

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第4期計算期間末	(2010年 2月22日)	764,881,499	764,881,499	9,240	9,240
第5期計算期間末	(2011年 2月21日)	1,240,531,245	1,240,531,245	9,542	9,542
第6期計算期間末	(2012年 2月21日)	1,662,222,385	1,662,222,385	9,432	9,432
第7期計算期間末	(2013年 2月21日)	2,268,392,887	2,268,392,887	10,435	10,435
第8期計算期間末	(2014年 2月21日)	4,826,567,334	4,826,567,334	11,618	11,618
第9期計算期間末	(2015年 2月23日)	9,609,384,153	9,609,384,153	12,811	12,811
第10期計算期間末	(2016年 2月22日)	12,153,839,606	12,153,839,606	12,527	12,527
第11期計算期間末	(2017年 2月21日)	14,214,751,693	14,214,751,693	13,306	13,306
第12期計算期間末	(2018年 2月21日)	16,338,867,196	16,338,867,196	13,983	13,983
第13期計算期間末	(2019年 2月21日)	18,205,085,029	18,205,085,029	14,025	14,025
	2018年 9月末日	18,146,088,618		14,269	
	10月末日	17,719,592,440		13,845	
	11月末日	17,932,712,303		13,959	
	12月末日	17,392,618,849		13,571	

2019年 1月末日	17,960,921,145		13,817
2月末日	18,346,955,634		14,010
3月末日	18,535,310,312		14,096
4月末日	18,585,469,925		14,177
5月末日	18,535,741,880		13,930
6月末日	18,896,296,067		14,121
7月末日	19,115,375,950		14,198
8月末日	19,147,351,240		14,147
9月末日	19,441,231,213		14,271

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第4期計算期間	2009年 2月24日～2010年 2月22日	0
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	0
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	0
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第4期計算期間	2009年 2月24日～2010年 2月22日	11.1
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	3.3
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	1.2
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	10.6
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	11.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	10.3
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2.2
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	6.2
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	5.1
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.3
第14期中間計算期間	2019年 2月22日～2019年 8月21日	0.4

(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4期計算期間	2009年 2月24日～2010年 2月22日	276,339,898	37,469,243	827,811,795
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	528,536,037	56,221,849	1,300,125,983
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	544,218,204	82,011,582	1,762,332,605
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	548,368,354	136,959,287	2,173,741,672
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	2,244,075,796	263,589,279	4,154,228,189
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	3,774,064,767	427,446,160	7,500,846,796
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2,707,951,316	506,368,389	9,702,429,723
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	1,522,635,571	541,752,943	10,683,312,351
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	1,622,030,510	620,753,783	11,684,589,078
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	1,853,591,536	558,077,052	12,980,103,562
第14期中間計算期間	2019年 2月22日～2019年 8月21日	814,594,525	368,477,991	13,426,220,096

(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。

【DCバランスファンド50】

(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	19,287,960,549	99.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		59,479,865	0.31
合計(純資産総額)		19,347,440,414	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	5,450,111,594	1.3779	7,509,957,592	1.4026	7,644,326,521	39.51
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,469,915,002	1.6950	5,881,776,975	1.7126	5,942,576,432	30.72
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,419,268,170	2.6681	3,786,760,911	2.7622	3,920,302,539	20.26
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	733,424,653	2.3548	1,727,136,229	2.4280	1,780,755,057	9.20

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.69
合計	99.69

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第4期計算期間末 (2010年 2月22日)	1,314,047,176	1,314,047,176	8,403	8,403
第5期計算期間末 (2011年 2月21日)	1,976,927,724	1,976,927,724	8,829	8,829
第6期計算期間末 (2012年 2月21日)	2,507,016,786	2,507,016,786	8,507	8,507
第7期計算期間末 (2013年 2月21日)	3,400,936,257	3,400,936,257	9,831	9,831
第8期計算期間末 (2014年 2月21日)	4,833,869,383	4,833,869,383	11,529	11,529
第9期計算期間末 (2015年 2月23日)	10,264,606,984	10,264,606,984	13,252	13,252
第10期計算期間末 (2016年 2月22日)	12,016,092,940	12,016,092,940	12,499	12,499
第11期計算期間末 (2017年 2月21日)	14,533,410,562	14,533,410,562	13,835	13,835
第12期計算期間末 (2018年 2月21日)	16,857,871,211	16,857,871,211	14,889	14,889
第13期計算期間末 (2019年 2月21日)	18,131,125,571	18,131,125,571	14,866	14,866
2018年 9月末日	18,374,566,491		15,443	
10月末日	17,608,115,166		14,701	
11月末日	17,910,635,025		14,862	
12月末日	16,997,616,579		14,130	
2019年 1月末日	17,748,631,258		14,538	
2月末日	18,272,154,207		14,861	
3月末日	18,440,709,729		14,943	
4月末日	18,695,975,362		15,132	

5月末日	18,333,116,289		14,657
6月末日	18,808,604,995		14,932
7月末日	19,082,215,754		15,064
8月末日	18,911,020,365		14,845
9月末日	19,347,440,414		15,145

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第4期計算期間	2009年 2月24日～2010年 2月22日	0
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	0
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	0
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第4期計算期間	2009年 2月24日～2010年 2月22日	18.2
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	5.1
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	3.6
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	15.6
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	17.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	14.9
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	5.7
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	10.7
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	7.6
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.2
第14期中間計算期間	2019年 2月22日～2019年 8月21日	0.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第4期計算期間	2009年 2月24日～2010年 2月22日	484,735,806	46,513,105	1,563,843,690
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	738,290,364	62,969,453	2,239,164,601
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	858,899,500	150,985,019	2,947,079,082
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	737,283,783	225,124,733	3,459,238,132
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	1,127,761,819	394,119,618	4,192,880,333
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	3,890,146,207	337,276,922	7,745,749,618
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2,389,338,964	521,486,140	9,613,602,442
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	1,427,316,438	535,903,642	10,505,015,238
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	1,604,824,267	787,711,888	11,322,127,617
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	1,487,203,756	613,284,585	12,196,046,788
第14期中間計算期間	2019年 2月22日～2019年 8月21日	794,711,323	338,121,268	12,652,636,843

(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。

【DCバランスファンド70】

(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	7,493,077,296	99.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		21,436,594	0.29
合計(純資産総額)		7,514,513,890	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,772,044,664	1.6961	3,005,634,406	1.7126	3,034,803,691	40.39
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	822,583,074	2.6685	2,195,140,298	2.7622	2,272,138,967	30.24
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	1,312,199,174	1.3778	1,807,948,117	1.4026	1,840,490,561	24.49
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	142,357,528	2.3558	335,370,003	2.4280	345,644,077	4.60

(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	99.71
合計	99.71

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第4期計算期間末 (2010年 2月22日)	618,239,337	618,239,337	7,617	7,617
第5期計算期間末 (2011年 2月21日)	887,132,636	887,132,636	8,169	8,169
第6期計算期間末 (2012年 2月21日)	1,010,509,539	1,010,509,539	7,652	7,652
第7期計算期間末 (2013年 2月21日)	1,396,043,467	1,396,043,467	9,146	9,146
第8期計算期間末 (2014年 2月21日)	2,259,670,200	2,259,670,200	11,186	11,186
第9期計算期間末 (2015年 2月23日)	4,376,661,860	4,376,661,860	13,325	13,325
第10期計算期間末 (2016年 2月22日)	4,382,407,791	4,382,407,791	12,156	12,156
第11期計算期間末 (2017年 2月21日)	5,465,018,584	5,465,018,584	14,000	14,000
第12期計算期間末 (2018年 2月21日)	6,554,623,946	6,554,623,946	15,405	15,405
第13期計算期間末 (2019年 2月21日)	7,105,425,421	7,105,425,421	15,276	15,276
2018年 9月末日	7,357,779,074		16,216	
10月末日	6,920,780,426		15,152	
11月末日	7,075,879,412		15,356	
12月末日	6,560,026,392		14,270	
2019年 1月末日	6,905,788,071		14,838	
2月末日	7,143,169,230		15,278	
3月末日	7,213,111,970		15,349	
4月末日	7,323,240,562		15,646	
5月末日	7,070,293,774		14,947	
6月末日	7,298,466,193		15,300	
7月末日	7,426,691,571		15,486	
8月末日	7,284,419,282		15,095	

9月末日	7,514,513,890		15,559	
------	---------------	--	--------	--

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第4期計算期間	2009年 2月24日～2010年 2月22日	0
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	0
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	0
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第4期計算期間	2009年 2月24日～2010年 2月22日	25.3
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	7.2
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	6.3
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	19.5
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	22.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	19.1
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	8.8
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	15.2
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	10.0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.8
第14期中間計算期間	2019年 2月22日～2019年 8月21日	1.9

(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4期計算期間	2009年 2月24日～2010年 2月22日	274,430,106	49,090,538	811,685,638
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	339,859,039	65,511,771	1,086,032,906
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	324,628,476	90,057,030	1,320,604,352

第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	336,941,132	131,115,473	1,526,430,011
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	749,827,425	256,234,473	2,020,022,963
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	1,564,258,884	299,743,427	3,284,538,420
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	721,489,462	400,760,508	3,605,267,374
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	578,597,748	280,214,854	3,903,650,268
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	820,305,427	469,118,909	4,254,836,786
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	752,735,309	356,104,678	4,651,467,417
第14期中間計算期間	2019年 2月22日～2019年 8月21日	363,310,171	232,873,162	4,781,904,426

(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)

日本株式マザーファンド

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	220,397,422,720	97.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,829,737,057	2.14
合計(純資産総額)		225,227,159,777	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	4,748,120,000	2.11

(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	1,080,600	6,780.53	7,327,040,718	7,216.00	7,797,609,600	3.46

日本	株式	ソニー	電気機器	650,800	5,355.63	3,485,444,004	6,347.00	4,130,627,600	1.83
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,583,800	575.04	3,785,948,352	548.40	3,610,555,920	1.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	650,900	4,562.00	2,969,405,800	5,156.00	3,356,040,400	1.49
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	755,000	3,958.29	2,988,508,950	4,240.00	3,201,200,000	1.42
日本	株式	キーエンス	電気機器	47,600	54,132.57	2,576,710,332	66,900.00	3,184,440,000	1.41
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	846,600	4,461.85	3,777,402,210	3,690.00	3,123,954,000	1.39
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	674,100	3,923.43	2,644,784,163	3,695.00	2,490,799,500	1.11
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	818,000	3,223.95	2,637,191,100	2,798.50	2,289,173,000	1.02
日本	株式	任天堂	その他製品	55,500	33,863.92	1,879,447,560	40,020.00	2,221,110,000	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	780,100	2,701.91	2,107,759,991	2,825.00	2,203,782,500	0.98
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	663,800	2,876.09	1,909,148,542	3,286.00	2,181,246,800	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	12,996,100	176.23	2,290,302,703	165.60	2,152,154,160	0.96
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	342,000	5,326.53	1,821,673,260	5,779.00	1,976,418,000	0.88
日本	株式	信越化学工業	化学	167,400	8,573.97	1,435,282,578	11,560.00	1,935,144,000	0.86
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	86,800	23,375.15	2,028,963,020	22,220.00	1,928,696,000	0.86
日本	株式	第一三共	医薬品	277,500	3,826.17	1,061,762,175	6,804.00	1,888,110,000	0.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	132,400	11,843.55	1,568,086,020	14,180.00	1,877,432,000	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	92,100	18,222.80	1,678,319,880	20,340.00	1,873,314,000	0.83
日本	株式	花王	化学	232,200	7,624.55	1,770,420,510	7,984.00	1,853,884,800	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	109,500	11,150.62	1,220,992,890	16,440.00	1,800,180,000	0.80
日本	株式	三菱商事	卸売業	670,200	3,117.29	2,089,207,758	2,651.00	1,776,700,200	0.79
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	170,700	10,062.75	1,717,711,425	10,310.00	1,759,917,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	436,600	3,463.07	1,511,976,362	4,023.00	1,756,441,800	0.78
日本	株式	HOYA	精密機器	195,200	6,334.47	1,236,488,544	8,819.00	1,721,468,800	0.76
日本	株式	日本電産	電気機器	116,700	12,480.30	1,456,451,010	14,520.00	1,694,484,000	0.75
日本	株式	資生堂	化学	192,700	6,300.89	1,214,181,503	8,629.00	1,662,808,300	0.74
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	602,500	2,577.29	1,552,817,225	2,753.00	1,658,682,500	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	400,300	4,768.66	1,908,894,598	4,132.00	1,654,039,600	0.73
日本	株式	村田製作所	電気機器	305,300	4,685.07	1,430,351,871	5,185.00	1,582,980,500	0.70

(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	0.10
		鉱業	0.27
		建設業	2.83
		食料品	3.98
		繊維製品	0.64

パルプ・紙	0.24
化学	7.11
医薬品	5.41
石油・石炭製品	0.55
ゴム製品	0.74
ガラス・土石製品	0.80
鉄鋼	0.75
非鉄金属	0.73
金属製品	0.55
機械	4.94
電気機器	13.74
輸送用機器	7.69
精密機器	2.20
その他製品	2.21
電気・ガス業	1.61
陸運業	4.62
海運業	0.16
空運業	0.51
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	8.36
卸売業	4.75
小売業	4.70
銀行業	5.75
証券、商品先物取引業	0.77
保険業	2.27
その他金融業	1.10
不動産業	2.49
サービス業	5.09
小計	97.86
合計	97.86

(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	TOPIX先物	買建	299円		4,760,367,000	4,748,120,000	2.11

(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。

日本債券マザーファンド

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	262,181,933,220	83.39
地方債証券	日本	16,971,898,109	5.40
特殊債証券	日本	21,126,792,776	6.72
社債券	日本	11,483,523,000	3.65
	フランス	1,103,103,000	0.35
	オーストラリア	302,074,000	0.10
	イギリス	100,668,000	0.03
	スペイン	100,522,000	0.03
	小計	13,089,890,000	4.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,036,093,713	0.33
合計(純資産総額)		314,406,607,818	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	日本	310,040,000	0.10

(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	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	4,120,000,000	101.29	4,173,464,200	101.94	4,200,257,600	0.100	2023/12/20	1.34

日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	3,650,000,000	100.58	3,671,170,000	100.60	3,672,009,500	0.100	2021/3/20	1.17
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,415,000,000	103.77	3,543,990,700	104.43	3,566,489,400	0.400	2025/6/20	1.13
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,190,000,000	103.94	3,315,716,700	104.63	3,337,888,400	0.400	2025/9/20	1.06
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	3,050,000,000	101.52	3,096,548,700	102.08	3,113,653,500	0.100	2024/3/20	0.99
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	2,970,000,000	103.26	3,066,955,300	103.22	3,065,871,600	0.100	2029/6/20	0.98
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	2,870,000,000	100.52	2,885,096,200	100.49	2,884,206,500	0.100	2020/12/20	0.92
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	2,690,000,000	102.04	2,744,929,700	103.34	2,779,926,700	0.100	2029/3/20	0.88
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	2,605,000,000	101.47	2,643,501,900	103.67	2,700,759,800	0.100	2027/12/20	0.86
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	2,500,000,000	101.56	2,539,000,000	103.64	2,591,150,000	0.100	2027/9/20	0.82
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	2,480,000,000	103.44	2,565,312,000	104.23	2,585,077,600	0.400	2025/3/20	0.82
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	2,470,000,000	103.92	2,566,824,000	104.33	2,577,025,100	0.600	2024/3/20	0.82
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,465,000,000	103.73	2,557,141,700	104.35	2,572,252,150	0.500	2024/9/20	0.82
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,420,000,000	104.11	2,519,462,000	104.60	2,531,489,400	0.600	2024/6/20	0.81
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	2,420,000,000	101.33	2,452,234,400	103.65	2,508,426,800	0.100	2028/3/20	0.80
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	2,380,000,000	101.40	2,413,374,500	103.44	2,462,086,200	0.100	2028/12/20	0.78
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	2,370,000,000	101.77	2,412,073,500	103.40	2,450,793,300	0.100	2026/12/20	0.78
日本	国債証券	第337回利付国債(10年)	2,350,000,000	102.71	2,413,732,000	103.51	2,432,485,000	0.300	2024/12/20	0.77
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	2,315,000,000	101.65	2,353,197,500	103.61	2,398,571,500	0.100	2027/6/20	0.76
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	2,340,000,000	101.10	2,365,927,200	101.63	2,378,188,800	0.100	2023/3/20	0.76
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,270,000,000	103.75	2,355,125,000	104.06	2,362,343,600	0.600	2023/12/20	0.75
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	2,320,000,000	101.04	2,344,174,400	101.49	2,354,753,600	0.100	2022/12/20	0.75
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	2,330,000,000	100.63	2,344,888,700	100.71	2,346,682,800	0.100	2021/6/20	0.75
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	2,255,000,000	101.72	2,293,943,850	103.52	2,334,578,950	0.100	2027/3/20	0.74
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,245,000,000	103.52	2,324,243,350	103.45	2,322,474,950	0.800	2022/9/20	0.74
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	2,150,000,000	103.20	2,218,985,000	104.23	2,240,966,500	0.300	2025/12/20	0.71
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	2,130,000,000	101.22	2,156,113,800	103.62	2,207,255,100	0.100	2028/6/20	0.70
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	2,070,000,000	101.16	2,094,012,000	103.54	2,143,340,100	0.100	2028/9/20	0.68
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,035,000,000	104.25	2,121,670,650	104.39	2,124,336,500	0.800	2023/6/20	0.68
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	2,055,000,000	101.79	2,091,784,500	103.20	2,120,801,100	0.100	2026/6/20	0.67

(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	83.39
地方債証券	5.40
特殊債券	6.72
社債券	4.16
合計	99.67

(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 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	2円		310,380,648	310,040,000	0.10

(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。

外国株式マザーファンド

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	116,039,003,217	60.90
	イギリス	10,882,329,273	5.71
	カナダ	7,062,370,346	3.71
	スイス	6,915,163,033	3.63
	フランス	6,858,892,213	3.60
	ドイツ	5,665,826,240	2.97
	オーストラリア	4,230,922,130	2.22
	オランダ	3,460,002,280	1.82
	アイルランド	3,370,958,887	1.77
	スペイン	1,920,971,840	1.01
	スウェーデン	1,598,939,272	0.84
	香港	1,583,903,691	0.83

	イタリア	1,315,252,172	0.69
	デンマーク	1,204,794,598	0.63
	シンガポール	779,946,128	0.41
	フィンランド	762,081,344	0.40
	バミューダ	750,157,389	0.39
	ベルギー	681,085,477	0.36
	ジャージー	502,763,536	0.26
	ノルウェー	433,676,071	0.23
	ケイマン	418,193,835	0.22
	イスラエル	389,428,507	0.20
	キュラソー	230,507,365	0.12
	ルクセンブルク	181,543,256	0.10
	ニュージーランド	164,772,867	0.09
	オーストリア	152,477,846	0.08
	ポルトガル	111,876,491	0.06
	リベリア	86,780,241	0.05
	パナマ	86,147,664	0.05
	パプアニューギニア	28,254,880	0.01
	英ヴァージン諸島	23,836,293	0.01
	マン島	20,183,476	0.01
	モーリシャス	8,740,712	0.00
	小計	177,921,782,570	93.38
投資信託受益証券	オーストラリア	113,819,716	0.06
	香港	44,874,112	0.02
	小計	158,693,828	0.08
投資証券	アメリカ	4,172,692,863	2.19
	オーストラリア	332,454,415	0.17
	フランス	200,400,179	0.11
	イギリス	120,419,804	0.06
	香港	113,074,176	0.06
	シンガポール	88,169,107	0.05
	カナダ	41,761,462	0.02
	小計	5,068,972,006	2.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,382,128,884	3.87
合計(純資産総額)		190,531,577,288	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	4,989,711,417	2.62
	買建	カナダ	292,425,235	0.15
	買建	ドイツ	1,194,807,187	0.63
	買建	イギリス	490,190,032	0.26
	買建	オーストラリア	304,957,250	0.16

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,004,376,834	0.53
	売建		115,857,550	0.06

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	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	207,231	18,803.98	3,896,767,745	23,615.05	4,893,771,338	2.57

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	327,570	11,496.26	3,765,832,964	14,863.82	4,868,942,042	2.56
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	18,833	177,306.13	3,339,206,397	186,210.56	3,506,903,552	1.84
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	108,163	18,429.86	1,993,429,814	19,112.63	2,067,279,615	1.09
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	14,113	120,449.44	1,699,902,959	132,211.71	1,865,903,903	0.98
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	146,376	11,198.30	1,639,162,552	12,704.34	1,859,610,823	0.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	13,483	121,284.43	1,635,278,058	132,304.52	1,783,861,897	0.94
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	119,559	14,347.41	1,715,363,022	13,878.51	1,659,301,016	0.87
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	138,380	9,528.95	1,318,617,240	11,726.37	1,622,695,911	0.85
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	113,472	10,632.81	1,206,527,217	13,443.59	1,525,471,544	0.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	191,067	8,103.89	1,548,387,176	7,714.12	1,473,914,072	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	78,317	15,322.93	1,200,046,379	18,778.07	1,470,642,891	0.77
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	328,760	3,202.18	1,052,749,348	4,039.44	1,328,008,135	0.70
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	58,854	22,215.49	1,307,470,729	22,388.00	1,317,623,587	0.69
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	405,160	3,100.54	1,256,215,434	3,167.45	1,283,324,852	0.67
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	49,691	19,934.98	990,589,210	24,806.49	1,232,659,354	0.65
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	186,333	5,812.60	1,083,080,789	6,507.57	1,212,576,159	0.64
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	40,944	23,338.50	955,571,869	29,044.50	1,189,198,401	0.62
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	81,079	11,998.08	972,792,781	14,025.28	1,137,155,937	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	201,750	5,378.08	1,085,028,806	5,480.17	1,105,625,831	0.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	86,132	12,820.92	1,104,292,252	12,799.31	1,102,430,341	0.58
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	182,617	5,326.88	972,779,180	5,861.13	1,070,342,927	0.56
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	190,876	5,311.82	1,013,899,413	5,472.62	1,044,592,426	0.55
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	116,010	8,367.56	970,720,710	8,947.64	1,038,016,552	0.54
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	194,349	5,124.04	995,852,361	5,270.81	1,024,377,197	0.54
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	24,191	44,241.76	1,070,252,552	41,318.25	999,529,815	0.52
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	42,822	29,030.22	1,243,132,399	23,230.85	994,791,853	0.52
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,603	29,225.96	923,628,034	31,422.76	993,053,737	0.52
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	204,130	4,027.58	822,150,370	4,835.89	987,151,287	0.52

アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	250,220	4,550.56	1,138,642,227	3,908.86	978,075,550	0.51
------	----	--------	------------------------	---------	----------	---------------	----------	-------------	------

(注1)国ノ地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.39
		素材	4.14
		資本財	6.76
		商業・専門サービス	1.21
		運輸	1.84
		自動車・自動車部品	1.04
		耐久消費財・アパレル	1.86
		消費者サービス	1.82
		メディア・娯楽	5.69
		小売	4.68
		食品・生活必需品小売り	1.53
		食品・飲料・タバコ	4.84
		家庭用品・パーソナル用品	2.16
		ヘルスケア機器・サービス	4.53
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.67
		銀行	7.56
		各種金融	4.15
		保険	3.81
		不動産	0.54
		ソフトウェア・サービス	9.04
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.18		
電気通信サービス	2.40		
公益事業	3.59		
半導体・半導体製造装置	2.94		
		小計	93.38
投資信託受益証券			0.08
投資証券			2.66
合計			96.13

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	312	アメリカドル	46,825,584	5,053,417,025	46,235,280	4,989,711,417	2.62
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	18	カナダドル	3,594,825	292,942,289	3,588,480	292,425,235	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	24	スイスフラン	2,394,408	260,703,143	2,402,640	261,599,443	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	224	ユーロ	7,852,208	926,717,588	7,907,200	933,207,744	0.49
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	25	オーストラリアドル	4,174,550	304,241,204	4,184,375	304,957,250	0.16
	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	50	イギリスポンド	3,640,937.5	483,115,996	3,694,250	490,190,032	0.26

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	7,221,400.00	775,437,542	778,539,134	0.41
	ユーロ	買建	1,200,000.00	142,748,760	141,624,000	0.07
	イギリスポンド	買建	635,000.00	84,370,227	84,213,700	0.04
	アメリカドル	売建	679,000.00	73,244,010	73,266,190	0.04
	カナダドル	売建	262,000.00	21,276,234	21,347,760	0.01
	ユーロ	売建	180,000.00	21,244,140	21,243,600	0.01

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

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

外国債券マザーファンド

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	61,352,986,769	46.53
	フランス	12,691,700,089	9.63
	イタリア	11,756,933,449	8.92

イギリス	8,224,232,046	6.24
ドイツ	8,211,672,645	6.23
スペイン	7,192,072,637	5.45
ベルギー	3,209,653,391	2.43
オーストラリア	2,542,525,244	1.93
カナダ	2,472,671,124	1.88
オランダ	2,375,338,588	1.80
オーストリア	1,786,465,362	1.35
メキシコ	1,008,616,914	0.76
アイルランド	928,329,339	0.70
フィンランド	737,384,433	0.56
ポーランド	733,310,193	0.56
南アフリカ	694,585,815	0.53
デンマーク	669,993,532	0.51
マレーシア	599,821,192	0.45
シンガポール	524,839,299	0.40
スウェーデン	434,442,888	0.33
ノルウェー	305,183,049	0.23
小計	128,452,757,998	97.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	3,407,320,169	2.58
合計(純資産総額)	131,860,078,167	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	787,362,400	0.60
	買建	ドイツ	958,815,723	0.73

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		2,113,713,900	1.60

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	8,900,000	10,933.75	973,104,103	11,324.43	1,007,874,578	2.750	2024/2/15	0.76
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/21	8,500,000	10,512.39	893,553,284	10,713.58	910,655,101	1.250	2021/3/31	0.69
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	8,100,000	10,660.45	863,497,205	11,093.41	898,566,793	2.250	2024/1/31	0.68
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	8,300,000	9,970.67	827,565,833	10,702.62	888,318,186	1.500	2026/8/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 2% 04/30/24	8,000,000	10,818.33	865,466,598	10,992.66	879,413,100	2.000	2024/4/30	0.67
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	7,060,000	11,433.37	807,196,001	12,108.11	854,833,143	3.125	2028/11/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	6,830,000	10,499.53	717,118,364	12,419.23	848,233,494	2.875	2045/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	7,450,000	9,211.88	686,285,408	11,051.68	823,350,346	2.250	2046/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	7,250,000	10,511.27	762,067,785	11,093.83	804,303,309	2.125	2025/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	6,850,000	9,734.38	666,805,304	11,602.24	794,753,658	2.500	2046/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	7,050,000	11,026.09	777,339,400	11,065.17	780,094,661	3.625	2021/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	5,950,000	10,766.12	640,584,414	12,816.34	762,572,419	3.000	2048/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/23	7,100,000	10,259.74	728,441,728	10,708.95	760,335,606	1.375	2023/9/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	10,702.39	717,060,305	11,190.37	749,755,228	2.375	2024/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	6,500,000	10,564.50	686,692,752	11,187.84	727,210,068	2.250	2025/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	6,330,000	10,457.69	661,971,910	11,277.64	713,874,612	2.250	2027/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	10,585.95	688,087,351	10,935.75	710,823,931	2.000	2023/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 3% 10/31/25	5,950,000	11,066.47	658,455,480	11,655.36	693,493,920	3.000	2025/10/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/21	6,250,000	10,936.54	683,534,118	11,032.92	689,557,686	3.125	2021/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	10,453.01	632,407,699	11,014.16	666,356,889	2.000	2025/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.625% 05/15/21	6,000,000	10,817.90	649,074,048	10,945.87	656,752,217	2.625	2021/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.125% 01/31/21	6,000,000	10,711.38	642,683,026	10,840.90	650,454,075	2.125	2021/1/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.375% 10/31/20	6,000,000	10,577.57	634,654,205	10,741.83	644,510,042	1.375	2020/10/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	5,390,000	11,221.07	604,816,185	11,673.06	629,178,239	2.625	2029/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	5,800,000	10,412.12	603,903,053	10,803.80	626,620,618	1.625	2023/4/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	10,118.81	581,831,961	10,792.84	620,588,482	1.625	2026/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/45	5,350,000	9,769.08	522,646,285	11,598.87	620,539,581	2.500	2045/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/22	5,500,000	10,597.83	582,880,983	10,925.21	600,886,756	2.000	2022/11/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 2% 05/31/21	5,500,000	10,667.67	586,722,189	10,841.11	596,261,161	2.000	2021/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	10,439.10	549,096,745	11,283.54	593,514,305	2.250	2027/11/15	0.45

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.42
合計	97.42

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

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	26	アメリカドル	3,092,447.82	333,736,968	3,099,078.06	334,452,504	0.25
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	16	アメリカドル	2,078,220.28	224,281,533	2,086,250.08	225,148,109	0.17
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	13	アメリカドル	2,099,270.75	226,553,299	2,110,468.75	227,761,787	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	12	ユーロ	1,347,468	159,028,173	1,347,900	159,079,158	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	14	ユーロ	1,896,326	223,804,395	1,898,400	224,049,168	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	28	ユーロ	4,868,062	574,528,677	4,877,880	575,687,397	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	10,210,000.00	1,103,132,770	1,100,740,100	0.83
	カナダドル	買建	1,130,000.00	91,882,780	92,004,600	0.07
	ユーロ	買建	6,500,000.00	772,781,197	767,130,000	0.58
	イギリスポンド	買建	1,160,000.00	155,683,078	153,839,200	0.12

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2019年9月30日

DCバランスファンド30

基準価額・純資産の推移



※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。

基準価額 14,271円

純資産総額 194.41億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年2月	0円
2016年2月	0円
2017年2月	0円
2018年2月	0円
2019年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

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
日本債券 マザーファンド	59.5%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.8%
		第127回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2021/03/20	0.7%
		第339回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.4%	2025/06/20	0.7%
日本株式 マザーファンド	20.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.3%
外国株式 マザーファンド	10.4%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ウェアラブル機器	-	-	0.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.3%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.2%
外国債券 マザーファンド	9.4%	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.1%
		T 1.25% 03/31/21	アメリカ	国債	-	1.250%	2021/03/31	0.1%
		T 2.25% 01/31/24	アメリカ	国債	-	2.250%	2024/01/31	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)




※2019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。

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


運用実績

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2019年9月30日

DCバランスファンド50**基準価額・純資産の推移**

基準価額 15,145円

純資産総額 193.47億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年2月	0円
2016年2月	0円
2017年2月	0円
2018年2月	0円
2019年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

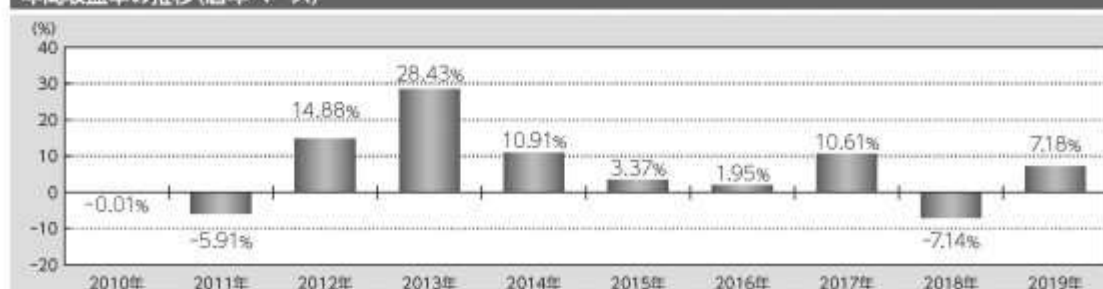
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位紹介銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	39.5%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.5%
		第127回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2021/03/20	0.5%
		第339回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.4%	2025/06/20	0.4%
日本株式 マザーファンド	30.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
外国株式 マザーファンド	20.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.4%
外国債券 マザーファンド	9.2%	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.1%
		T 1.25% 03/31/21	アメリカ	国債	-	1.250%	2021/03/31	0.1%
		T 2.25% 01/31/24	アメリカ	国債	-	2.250%	2024/01/31	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2019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。

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

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2019年9月30日

DCバランスファンド70

基準価額・純資産の推移



※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。

基準価額 15,559円

純資産総額 75.15億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年2月	0円
2016年2月	0円
2017年2月	0円
2018年2月	0円
2019年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

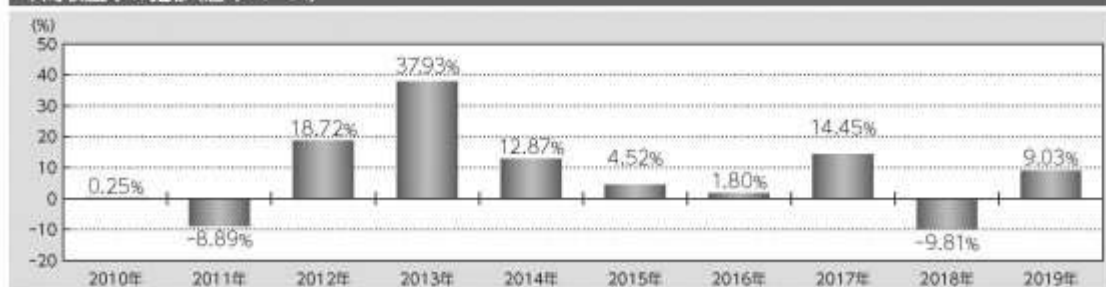
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

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
日本株式 マザーファンド	40.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.4%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.6%
外国株式 マザーファンド	30.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/ハードウェア	-	-	0.8%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.8%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.6%
日本債券 マザーファンド	24.5%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.3%
		第127回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2021/03/20	0.3%
		第339回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.4%	2025/06/20	0.3%
外国債券 マザーファンド	4.6%	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.0%
		T 1.25% 03/31/21	アメリカ	国債	-	1.250%	2021/03/31	0.0%
		T 2.25% 01/31/24	アメリカ	国債	-	2.250%	2024/01/31	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2019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。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委

託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に下記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。

	信託財産留保率
DCバランス30	0.13%
DCバランス50	0.15%
DCバランス70	0.17%

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ませんとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。

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

< 一部解約の制限 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3 【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総

額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みません。）

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

公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2006年9月29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】

当ファンドの計算期間は、毎年2月22日から翌年2月21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2006年9月29日から2007年2月21日までとします。

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

(5)【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうち、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が30億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

【DCバランスファンド30】

(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13期計算期間(2018年2月22日から2019年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2018年2月21日現在)	第13期 (2019年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	51,968,930	81,939,255
親投資信託受益証券	16,291,116,725	18,144,450,639
未収入金	19,424,121	3,734,152
流動資産合計	16,362,509,776	18,230,124,046
資産合計	16,362,509,776	18,230,124,046
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,850,712	4,268,556
未払受託者報酬	3,496,168	3,864,260
未払委託者報酬	14,858,632	16,423,036
未払利息	103	196
その他未払費用	436,965	482,969
流動負債合計	23,642,580	25,039,017
負債合計	23,642,580	25,039,017
純資産の部		
元本等		
元本	11,684,589,078	12,980,103,562
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,654,278,118	5,224,981,467
(分配準備積立金)	2,195,402,940	2,310,477,990
元本等合計	16,338,867,196	18,205,085,029
純資産合計	16,338,867,196	18,205,085,029
負債純資産合計	16,362,509,776	18,230,124,046

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 2017年 2月22日	至 2018年 2月21日	自 2018年 2月22日	至 2019年 2月21日
営業収益				
受取利息		32		14
有価証券売買等損益		786,580,652		95,487,599
営業収益合計		786,580,684		95,487,613
営業費用				
支払利息		34,484		46,956
受託者報酬		6,667,203		7,496,151
委託者報酬		28,335,475		31,858,494
その他費用		833,590		941,229
営業費用合計		35,870,752		40,342,830
営業利益又は営業損失（ ）		750,709,932		55,144,783
経常利益又は経常損失（ ）		750,709,932		55,144,783
当期純利益又は当期純損失（ ）		750,709,932		55,144,783
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（ ）		26,932,929		2,045,815
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,531,439,342		4,654,278,118
剰余金増加額又は欠損金減少額		604,626,358		734,974,413
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		604,626,358		734,974,413
剰余金減少額又は欠損金増加額		205,564,585		221,461,662
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		205,564,585		221,461,662
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,654,278,118		5,224,981,467

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2018年 2月21日現在)	第13期 (2019年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,684,589,078口	12,980,103,562口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3983円 (13,983円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4025円 (14,025円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2017年 2月22日 至 2018年 2月21日			第13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21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	213,077,987円	費用控除後の配当等収益額	A	210,323,287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	510,699,016円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	3,048,945,462円	収益調整金額	C	3,728,732,322円
分配準備積立金額	D	1,471,625,937円	分配準備積立金額	D	2,100,154,703円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,244,348,402円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,039,210,312円
当ファンドの期末残存口数	F	11,684,589,078口	当ファンドの期末残存口数	F	12,980,103,562口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,488円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,652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13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第13期 (2019年 2月21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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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12期	第13期
	自 2017年 2月22日 至 2018年 2月21日	自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	10,683,312,351円	11,684,589,078円
期中追加設定元本額	1,622,030,510円	1,853,591,536円
期中一部解約元本額	620,753,783円	558,077,052円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第12期 (2018年 2月21日現在)	第13期 (2019年 2月21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	752,835,377	114,834,059
合計	752,835,377	114,834,059

（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	日本株式マザーファンド	2,271,978,107	3,863,498,770	
	日本債券マザーファンド	7,710,520,319	10,622,783,843	
	外国株式マザーファンド	717,892,665	1,914,835,105	
	外国債券マザーファンド	740,646,156	1,743,332,921	
合計		11,441,037,247	18,144,450,639	

(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。

【DCバランスファンド50】

(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13期計算期間(2018年2月22日から2019年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2018年2月21日現在)	第13期 (2019年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	49,054,349	85,990,106
親投資信託受益証券	16,809,868,007	18,070,303,107
未収入金	25,270,337	-
流動資産合計	16,884,192,693	18,156,293,213
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,954,934	3,539,754
未払受託者報酬	3,620,721	3,844,947
未払委託者報酬	16,293,203	17,302,182
未払利息	97	205
その他未払費用	452,527	480,554
流動負債合計	26,321,482	25,167,642
負債合計	26,321,482	25,167,642
純資産の部		
元本等		
元本	11,322,127,617	12,196,046,788
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,535,743,594	5,935,078,783
(分配準備積立金)	3,393,095,276	3,475,385,814
元本等合計	16,857,871,211	18,131,125,571
純資産合計	16,857,871,211	18,131,125,571
負債純資産合計	16,884,192,693	18,156,293,213

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 2017年 2月22日	至 2018年 2月21日	自 2018年 2月22日	至 2019年 2月21日
営業収益				
受取利息		34		15
有価証券売買等損益		1,186,144,506		20,797,325
営業収益合計		1,186,144,540		20,797,340
営業費用				
支払利息		34,868		46,998
受託者報酬		6,868,533		7,557,887
委託者報酬		30,908,319		34,010,324
その他費用		858,764		948,966
営業費用合計		38,670,484		42,564,175
営業利益又は営業損失（ ）		1,147,474,056		21,766,835
経常利益又は経常損失（ ）		1,147,474,056		21,766,835
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,147,474,056		21,766,835
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（ ）		55,942,677		2,104,540
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,028,395,324		5,535,743,594
剰余金増加額又は欠損金減少額		718,888,994		717,693,906
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		718,888,994		717,693,906
剰余金減少額又は欠損金増加額		303,072,103		298,696,422
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		303,072,103		298,696,422
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,535,743,594		5,935,078,783

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2018年 2月21日現在)	第13期 (2019年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,322,127,617口	12,196,046,788口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4889円 (14,889円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4866円 (14,866円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2017年 2月22日 至 2018年 2月21日			第13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21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	255,721,332円	費用控除後の配当等収益額	A	253,194,379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	835,810,047円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	4,013,269,188円	収益調整金額	C	4,759,437,585円
分配準備積立金額	D	2,301,563,897円	分配準備積立金額	D	3,222,191,435円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,406,364,464円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,234,823,399円
当ファンドの期末残存口数	F	11,322,127,617口	当ファンドの期末残存口数	F	12,196,046,788口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,541円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,752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13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第13期 (2019年 2月21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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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12期	第13期
	自 2017年 2月22日 至 2018年 2月21日	自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	10,505,015,238円	11,322,127,617円
期中追加設定元本額	1,604,824,267円	1,487,203,756円
期中一部解約元本額	787,711,888円	613,284,585円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第12期 (2018年 2月21日現在)	第13期 (2019年 2月21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	1,140,162,683	28,229,137
合計	1,140,162,683	28,229,137

（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	日本株式マザーファンド	3,309,082,583	5,627,094,932	
	日本債券マザーファンド	5,035,728,525	6,937,723,188	
	外国株式マザーファンド	1,431,644,147	3,818,624,433	
	外国債券マザーファンド	716,654,157	1,686,860,554	
合計		10,493,109,412	18,070,303,107	

(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。

【DCバランスファンド70】

(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13期計算期間(2018年2月22日から2019年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2018年2月21日現在)	第13期 (2019年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	22,318,242	32,012,170
親投資信託受益証券	6,536,275,789	7,082,997,095
未収入金	7,749,091	-
流動資産合計	6,566,343,122	7,115,009,265
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,526,504	709,824
未払受託者報酬	1,394,507	1,510,477
未払委託者報酬	6,623,875	7,174,725
未払利息	44	76
その他未払費用	174,246	188,742
流動負債合計	11,719,176	9,583,844
負債合計	11,719,176	9,583,844
純資産の部		
元本等		
元本	4,254,836,786	4,651,467,417
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,299,787,160	2,453,958,004
(分配準備積立金)	1,514,216,078	1,509,587,011
元本等合計	6,554,623,946	7,105,425,421
純資産合計	6,554,623,946	7,105,425,421
負債純資産合計	6,566,343,122	7,115,009,265

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 2017年 2月22日	至 2018年 2月21日	自 2018年 2月22日	至 2019年 2月21日
営業収益				
受取利息		13		4
有価証券売買等損益		579,114,425		40,785,938
その他収益		141		-
営業収益合計		579,114,579		40,785,934
営業費用				
支払利息		13,782		18,996
受託者報酬		2,613,419		2,963,504
委託者報酬		12,413,659		14,076,508
その他費用		326,663		371,975
営業費用合計		15,367,523		17,430,983
営業利益又は営業損失（ ）		563,747,056		58,216,917
経常利益又は経常損失（ ）		563,747,056		58,216,917
当期純利益又は当期純損失（ ）		563,747,056		58,216,917
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（ ）		42,841,431		2,129,183
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,561,368,316		2,299,787,160
剰余金増加額又は欠損金減少額		406,907,055		402,045,238
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		406,907,055		402,045,238
剰余金減少額又は欠損金増加額		189,393,836		191,786,660
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		189,393,836		191,786,660
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,299,787,160		2,453,958,004

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2018年 2月21日現在)	第13期 (2019年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,254,836,786口	4,651,467,417口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5405円 (15,405円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5276円 (15,276円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2017年 2月22日 至 2018年 2月21日	第13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日																																																												
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>105,710,517円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>415,195,108円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,669,896,739円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>993,310,453円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,184,112,817円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>4,254,836,786口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>7,483円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	105,710,517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	415,195,108円	収益調整金額	C	1,669,896,739円	分配準備積立金額	D	993,310,453円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,184,112,817円	当ファンドの期末残存口数	F	4,254,836,786口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,483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	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>110,432,013円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,084,113,328円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,399,154,998円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,593,700,339円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>4,651,467,417口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>7,725円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	110,432,013円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	2,084,113,328円	分配準備積立金額	D	1,399,154,998円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,593,700,339円	当ファンドの期末残存口数	F	4,651,467,417口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,725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
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	105,710,517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	415,195,108円																																																											
収益調整金額	C	1,669,896,739円																																																											
分配準備積立金額	D	993,310,453円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,184,112,817円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	4,254,836,786口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,483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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	110,432,013円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	2,084,113,328円																																																											
分配準備積立金額	D	1,399,154,998円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,593,700,339円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	4,651,467,417口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,725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																																																											

(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13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第13期 (2019年 2月21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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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12期	第13期
	自 2017年 2月22日 至 2018年 2月21日	自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,903,650,268円	4,254,836,786円
期中追加設定元本額	820,305,427円	752,735,309円
期中一部解約元本額	469,118,909円	356,104,678円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第12期 (2018年 2月21日現在)	第13期 (2019年 2月21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	554,543,886	37,594,382
合計	554,543,886	37,594,382

（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	日本株式マザーファンド	1,691,941,364	2,877,146,289	
	日本債券マザーファンド	1,223,207,931	1,685,213,566	
	外国株式マザーファンド	824,740,751	2,199,831,005	
	外国債券マザーファンド	136,292,903	320,806,235	
合計		3,876,182,949	7,082,997,095	

(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。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年 2月21日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,789,887,761
株式	221,273,746,740
派生商品評価勘定	126,044,480
未収入金	2,006,650,058
未収配当金	357,576,837
差入委託証拠金	49,514,310
流動資産合計	225,603,420,186
資産合計	225,603,420,186
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,744,690
前受金	123,309,510
未払解約金	194,603,727
未払利息	4,286
その他未払費用	43
流動負債合計	320,662,256
負債合計	320,662,256
純資産の部	
元本等	
元本	132,482,711,953
剰余金	
剰余金又は欠損金()	92,800,045,977

	2019年 2月21日現在
項目	金額（円）
元本等合計	225,282,757,930
純資産合計	225,282,757,930
負債純資産合計	225,603,420,186

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 2月21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)

	2019年 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	132,482,711,953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 1.7005円 (1万口当たり純資産額) (17,005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

	2019年 2月21日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2019年 2月21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。

	2019年 2月21日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 2月22日
期首元本額	129,416,349,434円
期中追加設定元本額	14,613,496,774円
期中一部解約元本額	11,547,134,255円
期末元本額	132,482,711,953円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	766,723,678円
D C 日本株式インデックスファンド	336,325,827円
D C 日本株式インデックスファンド L	54,259,320,494円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,163,880,888円
D C バランスファンド 3 0	2,271,978,107円
D C バランスファンド 5 0	3,309,082,583円
D C バランスファンド 7 0	1,691,941,364円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	612,080,505円
日本株式インデックス e	1,872,509,956円
インデックスコレクション（国内株式）	11,198,918,349円

区分	2019年 2月21日現在
インデックスコレクション(バランス株式30)	6,571,649,051円
インデックスコレクション(バランス株式50)	1,638,636,195円
インデックスコレクション(バランス株式70)	1,302,049,612円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	7,368,043,250円
日本株式パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	2,322,500,841円
日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,809,359,258円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	154,731,009円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	1,486,537,280円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	138,644,659円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	782,910,801円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	7,064,931円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	883,143,937円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,497,405,172円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	689,484,474円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	11,587,088,883円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	946,958,860円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	178,022,395円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	1,835,972,493円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	49,599,494円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	235,117,376円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,789,637,661円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	87,988,681円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	88,050,118円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	37,634,889円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	1,299,801,088円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	973,149,943円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	32,107,838円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	496,020,300円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	7,295,140,373円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	132,238,722円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	71,641,322円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	13,000,012円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	194,631,346円
私募日本株式インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	3,987,938円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,869,824,093
合計	7,869,824,093

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式マザーファンド」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

(2019年 2月21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	3,807,530,490	-	3,930,840,000	123,309,510
合計		3,807,530,490	-	3,930,840,000	123,309,510

(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	4,200	2,998.00	12,591,600	
日本水産	130,400	716.00	93,366,400	
マルハニチロ	18,800	3,710.00	69,748,000	
カネコ種苗	4,000	1,334.00	5,336,000	
サカタのタネ	15,900	3,795.00	60,340,500	
ホクト	10,900	1,953.00	21,287,700	
ホクリヨウ	1,800	628.00	1,130,400	
住石ホールディングス	28,300	101.00	2,858,300	
日鉄鉱業	3,000	4,645.00	13,935,000	
三井松島ホールディングス	5,500	1,538.00	8,459,000	
国際石油開発帝石	523,000	1,146.00	599,358,000	
石油資源開発	18,700	2,335.00	43,664,500	
K&Oエナジーグループ	6,400	1,506.00	9,638,400	
ヒノキヤグループ	2,700	2,286.00	6,172,200	
ショーボンドホールディングス	9,300	7,800.00	72,540,000	
ミライト・ホールディングス	36,700	1,671.00	61,325,700	
タマホーム	6,300	1,119.00	7,049,700	

サンヨーホームズ	1,900	867.00	1,647,300
日本アクア	3,100	524.00	1,624,400
ファーストコーポレーション	4,000	742.00	2,968,000
ベストテラ	2,500	1,357.00	3,392,500
TATERU	15,200	276.00	4,195,200
スペースバリューホールディングス	16,000	892.00	14,272,000
ダイセキ環境ソリューション	2,500	634.00	1,585,000
第一カッター興業	1,600	1,741.00	2,785,600
安藤・間	84,000	752.00	63,168,000
東急建設	38,700	954.00	36,919,800
コムシスホールディングス	46,200	2,945.00	136,059,000
ミサワホーム	11,100	743.00	8,247,300
ピーアールホールディングス	10,700	353.00	3,777,100
高松コンストラクショングループ	8,300	2,714.00	22,526,200
東建コーポレーション	4,100	6,770.00	27,757,000
ソネック	1,400	723.00	1,012,200
ヤマウラ	5,600	975.00	5,460,000
大成建設	107,200	5,040.00	540,288,000
大林組	323,000	1,042.00	336,566,000
清水建設	329,500	948.00	312,366,000
飛鳥建設	9,500	1,484.00	14,098,000
長谷工コーポレーション	134,800	1,355.00	182,654,000
松井建設	12,700	752.00	9,550,400
銭高組	1,300	5,370.00	6,981,000
鹿島建設	252,400	1,574.00	397,277,600
不動テトラ	7,800	1,593.00	12,425,400
大末建設	4,400	940.00	4,136,000
鉄建建設	6,700	2,710.00	18,157,000
西松建設	23,400	2,511.00	58,757,400
三井住友建設	74,400	702.00	52,228,800
大豊建設	7,400	3,130.00	23,162,000
前田建設工業	77,100	1,149.00	88,587,900
佐田建設	8,400	379.00	3,183,600
ナカノフドー建設	9,400	511.00	4,803,400
奥村組	17,800	3,410.00	60,698,000
東鉄工業	12,900	3,010.00	38,829,000
イチケン	2,200	1,939.00	4,265,800
富士ピー・エス	3,400	494.00	1,679,600
浅沼組	4,000	2,656.00	10,624,000
戸田建設	125,700	706.00	88,744,200
熊谷組	15,500	3,270.00	50,685,000
青木あすなろ建設	5,900	1,017.00	6,000,300

北野建設	2,400	3,130.00	7,512,000	
植木組	1,500	2,351.00	3,526,500	
矢作建設工業	14,800	761.00	11,262,800	
ピーエス三菱	12,100	617.00	7,465,700	
日本ハウスホールディングス	20,700	435.00	9,004,500	
大東建託	38,300	15,725.00	602,267,500	
新日本建設	13,400	1,010.00	13,534,000	
N I P P O	28,500	2,096.00	59,736,000	
東亜道路工業	2,000	3,055.00	6,110,000	
前田道路	33,700	2,090.00	70,433,000	
日本道路	2,900	6,540.00	18,966,000	
東亜建設工業	8,400	1,637.00	13,750,800	
若築建設	5,500	1,482.00	8,151,000	
東洋建設	39,700	421.00	16,713,700	
五洋建設	127,900	542.00	69,321,800	
世紀東急工業	15,800	625.00	9,875,000	
福田組	3,600	4,360.00	15,696,000	
住友林業	76,600	1,432.00	109,691,200	
日本基礎技術	11,100	374.00	4,151,400	
巴コーポレーション	14,900	383.00	5,706,700	
大和ハウス工業	298,000	3,426.00	1,020,948,000	
ライト工業	20,700	1,516.00	31,381,200	
積水ハウス	329,600	1,633.00	538,236,800	
日特建設	9,200	613.00	5,639,600	
北陸電気工事	5,300	933.00	4,944,900	
ユアテック	17,400	887.00	15,433,800	
四電工	1,600	2,650.00	4,240,000	
中電工	13,900	2,332.00	32,414,800	
関電工	48,900	1,023.00	50,024,700	
きんでん	71,500	1,791.00	128,056,500	
東京エネシス	11,200	990.00	11,088,000	
トーエネック	3,000	3,230.00	9,690,000	
住友電設	7,400	1,850.00	13,690,000	
日本電設工業	18,300	2,282.00	41,760,600	
協和エクシオ	42,100	2,875.00	121,037,500	
新日本空調	9,300	1,889.00	17,567,700	
九電工	21,200	3,845.00	81,514,000	
三機工業	24,700	1,187.00	29,318,900	
日揮	92,900	1,674.00	155,514,600	
中外炉工業	3,300	1,754.00	5,788,200	
ヤマト	10,800	468.00	5,054,400	
太平電業	7,300	2,589.00	18,899,700	

高砂熱学工業	27,400	1,810.00	49,594,000
三晃金属工業	1,500	2,999.00	4,498,500
朝日工業社	2,400	2,971.00	7,130,400
明星工業	19,600	734.00	14,386,400
大気社	14,800	3,235.00	47,878,000
ダイダン	7,400	2,476.00	18,322,400
日比谷総合設備	10,300	1,875.00	19,312,500
東芝プラントシステム	23,500	2,037.00	47,869,500
OSJBホールディングス	47,900	282.00	13,507,800
東洋エンジニアリング	12,200	789.00	9,625,800
新興プランテック	19,300	1,238.00	23,893,400
日本製粉	32,000	1,904.00	60,928,000
日清製粉グループ本社	108,800	2,380.00	258,944,000
日東富士製粉	700	6,450.00	4,515,000
昭和産業	8,800	3,020.00	26,576,000
鳥越製粉	8,600	793.00	6,819,800
中部飼料	11,900	1,081.00	12,863,900
フィード・ワン	65,300	179.00	11,688,700
東洋精糖	1,500	1,040.00	1,560,000
日本甜菜製糖	5,500	1,821.00	10,015,500
三井製糖	7,600	2,825.00	21,470,000
塩水港精糖	10,500	226.00	2,373,000
日新製糖	4,600	2,070.00	9,522,000
森永製菓	24,200	4,865.00	117,733,000
中村屋	2,500	4,270.00	10,675,000
江崎グリコ	29,000	5,710.00	165,590,000
名糖産業	4,700	1,399.00	6,575,300
井村屋グループ	4,100	2,440.00	10,004,000
不二家	5,400	2,250.00	12,150,000
山崎製パン	78,800	1,933.00	152,320,400
第一屋製パン	1,700	1,029.00	1,749,300
モロゾフ	1,600	5,040.00	8,064,000
亀田製菓	6,000	5,360.00	32,160,000
寿スピリッツ	10,200	4,385.00	44,727,000
カルビー	43,900	3,080.00	135,212,000
森永乳業	19,300	3,450.00	66,585,000
六甲バター	7,000	2,007.00	14,049,000
ヤクルト本社	71,400	7,490.00	534,786,000
明治ホールディングス	68,300	8,720.00	595,576,000
雪印メグミルク	23,200	2,718.00	63,057,600
プリマハム	13,600	2,158.00	29,348,800
日本ハム	41,600	4,330.00	180,128,000

林兼産業	3,200	616.00	1,971,200	
丸大食品	10,300	1,901.00	19,580,300	
S Foods	8,700	4,155.00	36,148,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	62,000	676.00	41,912,000	
サッポロホールディングス	35,200	2,451.00	86,275,200	
アサヒグループホールディングス	201,800	4,823.00	973,281,400	
キリンホールディングス	435,800	2,540.00	1,106,932,000	
宝ホールディングス	72,100	1,255.00	90,485,500	
オエノンホールディングス	27,600	382.00	10,543,200	
養命酒製造	3,000	2,139.00	6,417,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	73,800	2,975.00	219,555,000	
サントリー食品インターナショナル	64,500	5,020.00	323,790,000	
ダイトーグループホールディングス	5,400	5,480.00	29,592,000	
伊藤園	29,200	5,190.00	151,548,000	
キーコーヒー	9,500	2,054.00	19,513,000	
ユニカフェ	2,900	1,013.00	2,937,700	
ジャパンフーズ	1,400	1,252.00	1,752,800	
日清オイリオグループ	12,400	3,425.00	42,470,000	
不二製油グループ本社	23,500	3,850.00	90,475,000	
かどや製油	1,100	5,050.00	5,555,000	
J - オイルミルズ	5,000	4,035.00	20,175,000	
キッコーマン	63,600	5,670.00	360,612,000	
味の素	212,800	1,689.00	359,419,200	
キューピー	53,600	2,576.00	138,073,600	
ハウス食品グループ本社	36,700	4,390.00	161,113,000	
カゴメ	38,600	2,938.00	113,406,800	
焼津水産化学工業	4,700	1,198.00	5,630,600	
アリアケジャパン	8,800	5,980.00	52,624,000	
ピエトロ	1,300	1,646.00	2,139,800	
エバラ食品工業	2,300	2,157.00	4,961,100	
ニチレイ	50,000	2,795.00	139,750,000	
東洋水産	49,600	4,185.00	207,576,000	
イートアンド	3,400	1,703.00	5,790,200	
大冷	1,100	1,743.00	1,917,300	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,600	637.00	1,656,200	
日清食品ホールディングス	41,000	7,630.00	312,830,000	
永谷園ホールディングス	5,100	2,406.00	12,270,600	
一正蒲鉾	3,800	1,092.00	4,149,600	
フジッコ	10,400	2,277.00	23,680,800	
ロック・フィールド	10,500	1,606.00	16,863,000	
日本たばこ産業	556,300	2,891.50	1,608,541,450	
ケンコーマヨネーズ	5,400	2,246.00	12,128,400	

わらべや日洋ホールディングス	6,300	1,973.00	12,429,900
なとり	5,400	1,691.00	9,131,400
イフジ産業	1,700	712.00	1,210,400
ピクルスコーポレーション	2,300	1,878.00	4,319,400
北の達人コーポレーション	38,200	447.00	17,075,400
ユーグレナ	41,000	755.00	30,955,000
ミヨシ油脂	3,700	1,065.00	3,940,500
理研ビタミン	4,500	3,610.00	16,245,000
片倉工業	11,700	1,235.00	14,449,500
ゲンゼ	6,300	5,060.00	31,878,000
東洋紡	39,900	1,583.00	63,161,700
ユニチカ	28,000	486.00	13,608,000
富士紡ホールディングス	4,900	2,837.00	13,901,300
倉敷紡績	9,000	2,269.00	20,421,000
シキボウ	5,000	1,034.00	5,170,000
日本毛織	31,000	897.00	27,807,000
トーア紡コーポレーション	4,000	462.00	1,848,000
ダイドーリミテッド	11,600	351.00	4,071,600
帝国繊維	10,600	2,425.00	25,705,000
帝人	76,700	1,877.00	143,965,900
東レ	729,400	785.60	573,016,640
サカイオーベックス	2,300	1,827.00	4,202,100
住江織物	2,700	2,702.00	7,295,400
日本フェルト	5,600	459.00	2,570,400
イチカワ	1,400	1,398.00	1,957,200
日東製網	1,100	1,342.00	1,476,200
アツギ	7,900	976.00	7,710,400
ダイニック	3,800	763.00	2,899,400
セーレン	23,200	1,874.00	43,476,800
ソトー	3,800	979.00	3,720,200
東海染工	1,400	1,064.00	1,489,600
小松マテーレ	15,700	814.00	12,779,800
ワコールホールディングス	27,400	2,785.00	76,309,000
ホギメディカル	11,700	3,765.00	44,050,500
レナウン	27,400	99.00	2,712,600
クラウディアホールディングス	2,500	477.00	1,192,500
T S Iホールディングス	34,800	716.00	24,916,800
マツオカコーポレーション	3,000	3,275.00	9,825,000
ワールド	9,300	2,041.00	18,981,300
三陽商会	5,700	1,685.00	9,604,500
ナイガイ	3,600	540.00	1,944,000
オンワードホールディングス	56,600	665.00	37,639,000

ルックホールディングス	3,500	1,369.00	4,791,500	
ゴールドウイン	8,500	13,690.00	116,365,000	
デサント	23,200	2,428.00	56,329,600	
キング	5,200	579.00	3,010,800	
ヤマトインターナショナル	6,400	429.00	2,745,600	
特種東海製紙	6,000	3,985.00	23,910,000	
王子ホールディングス	423,200	671.00	283,967,200	
日本製紙	45,000	2,052.00	92,340,000	
三菱製紙	15,500	573.00	8,881,500	
北越コーポレーション	62,400	630.00	39,312,000	
中越パルプ工業	4,000	1,383.00	5,532,000	
巴川製紙所	3,100	1,053.00	3,264,300	
大王製紙	45,800	1,307.00	59,860,600	
阿波製紙	2,400	466.00	1,118,400	
レンゴー	96,900	942.00	91,279,800	
トモク	5,800	1,653.00	9,587,400	
ザ・パック	7,100	3,225.00	22,897,500	
クラレ	158,600	1,539.00	244,085,400	
旭化成	668,800	1,201.00	803,228,800	
共和レザー	6,000	789.00	4,734,000	
昭和電工	62,500	3,985.00	249,062,500	
住友化学	740,000	560.00	414,400,000	
住友精化	4,600	4,335.00	19,941,000	
日産化学	57,700	5,900.00	340,430,000	
ラサ工業	3,300	1,520.00	5,016,000	
クレハ	8,700	6,810.00	59,247,000	
多木化学	2,800	5,550.00	15,540,000	
テイカ	7,700	2,145.00	16,516,500	
石原産業	18,200	1,181.00	21,494,200	
片倉コープアグリ	2,800	1,155.00	3,234,000	
日東エフシー	6,000	775.00	4,650,000	
日本曹達	14,800	2,945.00	43,586,000	
東ソー	145,300	1,651.00	239,890,300	
トクヤマ	27,100	2,794.00	75,717,400	
セントラル硝子	20,500	2,538.00	52,029,000	
東亜合成	59,000	1,272.00	75,048,000	
大阪ソーダ	10,100	2,835.00	28,633,500	
関東電化工業	22,500	883.00	19,867,500	
デンカ	36,900	3,375.00	124,537,500	
信越化学工業	165,700	9,552.00	1,582,766,400	
日本カーバイド工業	3,200	1,522.00	4,870,400	
堺化学工業	6,300	2,381.00	15,000,300	

第一稀元素化学工業	7,800	909.00	7,090,200	
エア・ウォーター	77,000	1,828.00	140,756,000	
大陽日酸	77,400	1,577.00	122,059,800	
日本化学工業	3,200	2,386.00	7,635,200	
東邦アセチレン	1,500	1,367.00	2,050,500	
日本パーカラライジング	51,400	1,454.00	74,735,600	
高压ガス工業	15,000	820.00	12,300,000	
チタン工業	1,200	2,342.00	2,810,400	
四国化成工業	15,800	1,307.00	20,650,600	
戸田工業	2,000	2,201.00	4,402,000	
ステラ ケミファ	5,500	3,250.00	17,875,000	
保土谷化学工業	3,300	2,838.00	9,365,400	
日本触媒	15,800	7,530.00	118,974,000	
大日精化工業	7,800	3,110.00	24,258,000	
カネカ	25,000	4,445.00	111,125,000	
三菱瓦斯化学	96,700	1,769.00	171,062,300	
三井化学	85,300	2,804.00	239,181,200	
J S R	94,300	1,838.00	173,323,400	
東京応化工業	16,100	3,435.00	55,303,500	
大阪有機化学工業	8,800	1,218.00	10,718,400	
三菱ケミカルホールディングス	628,500	832.90	523,477,650	
K Hネオケム	14,300	2,971.00	42,485,300	
ダイセル	146,000	1,155.00	168,630,000	
住友ベークライト	16,300	4,450.00	72,535,000	
積水化学工業	205,500	1,758.00	361,269,000	
日本ゼオン	84,800	1,158.00	98,198,400	
アイカ工業	28,200	3,890.00	109,698,000	
宇部興産	47,500	2,589.00	122,977,500	
積水樹脂	15,500	2,112.00	32,736,000	
タキロンシーアイ	20,500	616.00	12,628,000	
旭有機材	6,600	1,681.00	11,094,600	
日立化成	43,500	2,053.00	89,305,500	
ニチバン	5,000	2,207.00	11,035,000	
リケンテクノス	25,800	473.00	12,203,400	
大倉工業	4,900	1,784.00	8,741,600	
積水化成品工業	14,100	975.00	13,747,500	
群栄化学工業	2,400	2,817.00	6,760,800	
タイガースポリマー	5,100	626.00	3,192,600	
ミライアル	2,800	1,190.00	3,332,000	
ダイキアクシス	3,400	1,034.00	3,515,600	
ダイキョーニシカワ	20,000	1,272.00	25,440,000	
竹本容器	3,400	1,421.00	4,831,400	

森六ホールディングス	5,100	2,622.00	13,372,200
日本化薬	59,800	1,324.00	79,175,200
カーリットホールディングス	10,200	833.00	8,496,600
日本精化	7,600	1,256.00	9,545,600
扶桑化学工業	9,500	2,185.00	20,757,500
トリケミカル研究所	2,100	5,060.00	10,626,000
A D E K A	46,300	1,714.00	79,358,200
日油	36,200	3,815.00	138,103,000
ハリマ化成グループ	7,900	1,074.00	8,484,600
花王	233,000	8,407.00	1,958,831,000
第一工業製薬	3,500	3,135.00	10,972,500
石原ケミカル	2,400	1,847.00	4,432,800
日華化学	3,200	954.00	3,052,800
ニイタカ	1,500	1,476.00	2,214,000
三洋化成工業	6,300	5,490.00	34,587,000
有機合成薬品工業	7,500	198.00	1,485,000
大日本塗料	10,700	1,140.00	12,198,000
日本ペイントホールディングス	77,600	4,140.00	321,264,000
関西ペイント	105,600	2,089.00	220,598,400
神東塗料	7,700	174.00	1,339,800
中国塗料	30,900	1,015.00	31,363,500
日本特殊塗料	7,100	1,344.00	9,542,400
藤倉化成	12,800	627.00	8,025,600
太陽ホールディングス	7,700	3,750.00	28,875,000
D I C	42,500	3,595.00	152,787,500
サカタインクス	20,500	1,210.00	24,805,000
東洋インキＳＣホールディングス	19,900	2,629.00	52,317,100
T & K T O K A	7,400	1,045.00	7,733,000
富士フイルムホールディングス	199,400	4,980.00	993,012,000
資生堂	190,700	7,174.00	1,368,081,800
ライオン	133,700	2,230.00	298,151,000
高砂香料工業	6,600	3,600.00	23,760,000
マンダム	21,600	2,737.00	59,119,200
ミルボン	11,900	4,925.00	58,607,500
ファンケル	42,800	2,531.00	108,326,800
コーセー	16,300	18,390.00	299,757,000
コタ	4,600	1,491.00	6,858,600
シーボン	1,200	2,679.00	3,214,800
ポーラ・オルビスホールディングス	41,000	3,215.00	131,815,000
ノエビアホールディングス	6,100	5,290.00	32,269,000
アジュバンコスメジャパン	2,200	982.00	2,160,400
エステー	6,900	1,947.00	13,434,300

アグロ カネショウ	3,900	2,078.00	8,104,200
コニシ	17,100	1,670.00	28,557,000
長谷川香料	11,600	1,737.00	20,149,200
星光PMC	6,500	816.00	5,304,000
小林製薬	26,900	8,990.00	241,831,000
荒川化学工業	8,700	1,440.00	12,528,000
メック	6,700	1,204.00	8,066,800
日本高純度化学	2,700	2,346.00	6,334,200
タカラバイオ	25,100	2,454.00	61,595,400
JCU	12,500	1,850.00	23,125,000
新田ゼラチン	6,100	716.00	4,367,600
OATアグリオ	1,400	1,707.00	2,389,800
デクセリアルズ	25,000	829.00	20,725,000
アース製薬	7,200	5,040.00	36,288,000
北興化学工業	9,900	555.00	5,494,500
大成ラミック	3,200	2,827.00	9,046,400
クミアイ化学工業	39,700	708.00	28,107,600
日本農薬	23,200	485.00	11,252,000
アキレス	7,000	2,041.00	14,287,000
有沢製作所	15,200	821.00	12,479,200
日東電工	72,500	5,943.00	430,867,500
レック	10,400	1,664.00	17,305,600
三光合成	8,400	368.00	3,091,200
きもと	16,700	187.00	3,122,900
藤森工業	8,600	3,090.00	26,574,000
前澤化成工業	6,600	1,025.00	6,765,000
未来工業	5,200	2,427.00	12,620,400
ウェーブロックホールディングス	2,100	830.00	1,743,000
JSP	5,600	2,426.00	13,585,600
エフピコ	7,900	6,640.00	52,456,000
天馬	6,700	2,042.00	13,681,400
信越ポリマー	17,400	827.00	14,389,800
東リ	24,300	278.00	6,755,400
ニフコ	38,500	2,804.00	107,954,000
バルカー	7,800	2,300.00	17,940,000
ユニ・チャーム	203,500	3,551.00	722,628,500
協和発酵キリン	120,300	2,141.00	257,562,300
武田薬品工業	608,500	4,440.00	2,701,740,000
アステラス製薬	885,000	1,688.50	1,494,322,500
大日本住友製薬	71,100	2,761.00	196,307,100
塩野義製薬	125,600	7,012.00	880,707,200
田辺三菱製薬	100,400	1,559.00	156,523,600

わかもと製薬	11,500	282.00	3,243,000
あすか製薬	11,900	1,279.00	15,220,100
日本新薬	25,100	6,860.00	172,186,000
ピオフェルミン製薬	1,600	2,385.00	3,816,000
中外製薬	100,100	7,450.00	745,745,000
科研製薬	17,300	5,290.00	91,517,000
エーザイ	114,900	9,035.00	1,038,121,500
ロート製薬	49,200	2,998.00	147,501,600
小野薬品工業	226,700	2,280.00	516,876,000
久光製薬	28,400	5,520.00	156,768,000
持田製薬	7,300	11,420.00	83,366,000
参天製薬	182,000	1,648.00	299,936,000
扶桑薬品工業	3,400	2,612.00	8,880,800
日本ケミファ	1,300	2,930.00	3,809,000
ツムラ	29,700	3,515.00	104,395,500
日医工	24,700	1,602.00	39,569,400
キッセイ薬品工業	17,000	2,900.00	49,300,000
生化学工業	18,600	1,374.00	25,556,400
栄研化学	16,900	2,571.00	43,449,900
日水製薬	4,100	1,192.00	4,887,200
鳥居薬品	5,100	2,392.00	12,199,200
JCRファーマ	6,800	5,990.00	40,732,000
東和薬品	4,600	8,790.00	40,434,000
富士製薬工業	6,500	1,856.00	12,064,000
沢井製薬	19,700	6,020.00	118,594,000
ゼリア新薬工業	19,000	1,908.00	36,252,000
第一三共	274,700	3,909.00	1,073,802,300
キョーリン製薬ホールディングス	21,200	2,235.00	47,382,000
大幸薬品	4,300	1,829.00	7,864,700
ダイト	5,600	2,800.00	15,680,000
大塚ホールディングス	182,900	4,569.00	835,670,100
大正製薬ホールディングス	21,500	11,310.00	243,165,000
ペプチドリーム	47,900	5,080.00	243,332,000
日本コークス工業	81,800	101.00	8,261,800
昭和シェル石油	88,800	1,716.00	152,380,800
ニチレキ	12,400	1,130.00	14,012,000
ユシロ化学工業	5,000	1,320.00	6,600,000
ビーピー・カストロール	3,500	1,350.00	4,725,000
富士石油	23,500	290.00	6,815,000
MORESCO	3,500	1,609.00	5,631,500
出光興産	74,400	4,065.00	302,436,000
JXTGホールディングス	1,614,500	552.60	892,172,700

コスモエネルギーホールディングス	27,800	2,385.00	66,303,000
横浜ゴム	55,600	2,283.00	126,934,800
TOYO TIRE	49,300	1,396.00	68,822,800
ブリヂストン	295,000	4,414.00	1,302,130,000
住友ゴム工業	86,200	1,402.00	120,852,400
藤倉ゴム工業	8,500	435.00	3,697,500
オカモト	6,700	5,800.00	38,860,000
フコク	4,200	874.00	3,670,800
ニッタ	10,800	3,840.00	41,472,000
住友理工	18,600	1,039.00	19,325,400
三ツ星ベルト	12,600	2,185.00	27,531,000
バンドー化学	18,300	1,176.00	21,520,800
日東紡績	14,300	1,972.00	28,199,600
A G C	94,900	3,870.00	367,263,000
日本板硝子	44,700	985.00	44,029,500
石塚硝子	1,400	1,747.00	2,445,800
日本山村硝子	4,000	1,511.00	6,044,000
日本電気硝子	41,500	3,025.00	125,537,500
オハラ	3,800	1,812.00	6,885,600
住友大阪セメント	19,400	4,725.00	91,665,000
太平洋セメント	60,600	3,730.00	226,038,000
日本ヒューム	9,700	814.00	7,895,800
日本コンクリート工業	21,000	286.00	6,006,000
三谷セキサン	4,500	2,818.00	12,681,000
アジアパイルホールディングス	13,800	623.00	8,597,400
東海カーボン	87,200	1,564.00	136,380,800
日本カーボン	4,600	5,240.00	24,104,000
東洋炭素	5,600	2,094.00	11,726,400
ノリタケカンパニーリミテド	5,800	5,320.00	30,856,000
T O T O	73,800	4,340.00	320,292,000
日本碍子	117,200	1,699.00	199,122,800
日本特殊陶業	81,000	2,344.00	189,864,000
M A R U W A	3,300	6,210.00	20,493,000
品川リフラクトリーズ	2,500	3,415.00	8,537,500
黒崎播磨	1,900	5,800.00	11,020,000
ヨータイ	8,500	601.00	5,108,500
イソライト工業	5,000	582.00	2,910,000
東京窯業	12,400	397.00	4,922,800
ニッカトー	4,400	1,019.00	4,483,600
フジミインコーポレーテッド	8,600	2,327.00	20,012,200
クニミネ工業	3,300	832.00	2,745,600
エーアンドエーマテリアル	1,900	1,125.00	2,137,500

ニチアス	26,300	2,066.00	54,335,800
ニチハ	13,400	3,110.00	41,674,000
新日鐵住金	441,100	2,023.50	892,565,850
神戸製鋼所	173,800	883.00	153,465,400
中山製鋼所	13,300	496.00	6,596,800
合同製鐵	4,600	1,736.00	7,985,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	256,400	1,945.50	498,826,200
東京製鐵	50,900	891.00	45,351,900
共英製鋼	10,800	1,756.00	18,964,800
大和工業	20,200	3,025.00	61,105,000
東京鐵鋼	3,900	1,192.00	4,648,800
大阪製鐵	6,300	1,862.00	11,730,600
淀川製鋼所	12,800	2,210.00	28,288,000
丸一鋼管	33,600	3,325.00	111,720,000
モリ工業	2,900	2,605.00	7,554,500
大同特殊鋼	15,500	4,665.00	72,307,500
日本高周波鋼業	3,500	540.00	1,890,000
日本冶金工業	79,200	245.00	19,404,000
山陽特殊製鋼	12,000	2,525.00	30,300,000
愛知製鋼	5,300	3,525.00	18,682,500
日立金属	102,300	1,125.00	115,087,500
日本金属	2,200	1,302.00	2,864,400
大平洋金属	6,400	2,956.00	18,918,400
新日本電工	57,400	238.00	13,661,200
栗本鐵工所	4,800	1,499.00	7,195,200
虹技	1,400	1,395.00	1,953,000
三菱製鋼	7,100	1,679.00	11,920,900
日亜鋼業	14,000	349.00	4,886,000
日本精線	1,400	3,385.00	4,739,000
エンビプロ・ホールディングス	2,700	567.00	1,530,900
シンニッタン	14,900	350.00	5,215,000
新家工業	2,200	1,664.00	3,660,800
大紀アルミニウム工業所	15,900	624.00	9,921,600
日本軽金属ホールディングス	259,100	247.00	63,997,700
三井金属鉱業	25,700	2,718.00	69,852,600
東邦亜鉛	5,300	3,295.00	17,463,500
三菱マテリアル	62,700	3,125.00	195,937,500
住友金属鉱山	130,000	3,301.00	429,130,000
D O W A ホールディングス	22,200	3,575.00	79,365,000
古河機械金属	15,700	1,458.00	22,890,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,000	1,837.00	20,207,000
東邦チタニウム	17,100	976.00	16,689,600

U A C J	14,500	2,219.00	32,175,500
C Kサンエツ	1,800	3,655.00	6,579,000
古河電気工業	27,400	3,520.00	96,448,000
住友電気工業	355,000	1,534.50	544,747,500
フジクラ	114,800	487.00	55,907,600
昭和電線ホールディングス	11,100	712.00	7,903,200
東京特殊電線	1,300	2,130.00	2,769,000
タツタ電線	19,200	517.00	9,926,400
カナレ電気	1,600	1,880.00	3,008,000
平河ヒューテック	4,100	1,617.00	6,629,700
リヨービ	11,700	2,804.00	32,806,800
アーレスティ	11,900	697.00	8,294,300
アサヒホールディングス	17,900	2,189.00	39,183,100
稲葉製作所	5,400	1,267.00	6,841,800
宮地エンジニアリンググループ	2,900	2,088.00	6,055,200
トーカロ	24,500	922.00	22,589,000
アルファC o	3,400	1,383.00	4,702,200
S U M C O	104,900	1,539.00	161,441,100
川田テクノロジーズ	2,100	6,840.00	14,364,000
R S Technologies	1,900	3,175.00	6,032,500
東洋製罐グループホールディングス	60,500	2,308.00	139,634,000
ホッカンホールディングス	4,900	1,752.00	8,584,800
コロナ	5,300	1,036.00	5,490,800
横河ブリッジホールディングス	17,700	1,974.00	34,939,800
駒井ハルテック	1,800	1,942.00	3,495,600
高田機工	900	2,650.00	2,385,000
三和ホールディングス	98,100	1,288.00	126,352,800
文化シャッター	28,000	849.00	23,772,000
三協立山	13,300	1,475.00	19,617,500
アルインコ	7,600	991.00	7,531,600
東洋シャッター	2,300	720.00	1,656,000
L I X I Lグループ	140,100	1,545.00	216,454,500
日本フィルコン	7,400	552.00	4,084,800
ノーリツ	21,200	1,652.00	35,022,400
長府製作所	9,700	2,230.00	21,631,000
リンナイ	16,900	7,340.00	124,046,000
ダイニチ工業	5,200	737.00	3,832,400
日東精工	13,300	546.00	7,261,800
三洋工業	1,300	1,880.00	2,444,000
岡部	19,400	969.00	18,798,600
ジーテクト	10,600	1,779.00	18,857,400
東プレ	17,700	2,429.00	42,993,300

高周波熱錬	18,500	889.00	16,446,500
東京製綱	5,900	1,032.00	6,088,800
サンコール	5,400	690.00	3,726,000
モリテック スチール	7,500	441.00	3,307,500
パイオラックス	15,200	2,348.00	35,689,600
エイチワン	9,400	1,124.00	10,565,600
日本発條	94,600	1,056.00	99,897,600
中央発條	1,100	2,954.00	3,249,400
アドバネクス	1,300	1,750.00	2,275,000
立川ブラインド工業	4,200	1,208.00	5,073,600
三益半導体工業	8,600	1,488.00	12,796,800
日本ドライケミカル	2,600	1,204.00	3,130,400
日本製鋼所	28,900	2,020.00	58,378,000
三浦工業	41,100	2,557.00	105,092,700
タクマ	34,700	1,474.00	51,147,800
ツガミ	21,500	762.00	16,383,000
オークマ	12,100	6,070.00	73,447,000
東芝機械	10,800	2,292.00	24,753,600
アマダホールディングス	146,600	1,148.00	168,296,800
アイダエンジニアリング	26,500	831.00	22,021,500
滝澤鉄工所	3,000	1,732.00	5,196,000
F U J I	28,400	1,573.00	44,673,200
牧野フライス製作所	11,200	4,650.00	52,080,000
オーエスジー	46,800	2,237.00	104,691,600
ダイジェット工業	1,200	1,662.00	1,994,400
旭ダイヤモンド工業	25,100	819.00	20,556,900
D M G 森精機	60,200	1,474.00	88,734,800
ソディック	20,900	827.00	17,284,300
ディスコ	12,800	16,380.00	209,664,000
日東工器	5,200	2,331.00	12,121,200
日進工具	2,800	2,474.00	6,927,200
パンチ工業	6,700	635.00	4,254,500
富士ダイス	4,200	725.00	3,045,000
豊和工業	5,500	888.00	4,884,000
O K K	4,200	860.00	3,612,000
東洋機械金属	6,800	609.00	4,141,200
津田駒工業	2,100	1,987.00	4,172,700
島精機製作所	13,100	3,815.00	49,976,500
オプトラン	9,300	2,226.00	20,701,800
N C ホールディングス	3,100	486.00	1,506,600
フリュー	7,700	1,060.00	8,162,000
ヤマシンフィルタ	16,600	712.00	11,819,200

日阪製作所	11,800	911.00	10,749,800
やまびこ	18,400	1,062.00	19,540,800
平田機工	4,500	6,650.00	29,925,000
ペガサスマシン製造	9,000	688.00	6,192,000
マルマエ	2,600	706.00	1,835,600
タツモ	3,000	818.00	2,454,000
ナプテスコ	52,300	2,984.00	156,063,200
三井海洋開発	10,100	3,020.00	30,502,000
レオン自動機	9,400	1,618.00	15,209,200
S M C	28,100	38,990.00	1,095,619,000
新川	7,000	551.00	3,857,000
ホソカワミクロン	3,300	4,930.00	16,269,000
ユニオンツール	4,100	3,050.00	12,505,000
オイレス工業	13,300	1,949.00	25,921,700
日精エー・エス・ピー機械	2,700	3,990.00	10,773,000
サトーホールディングス	11,400	2,743.00	31,270,200
技研製作所	6,600	3,335.00	22,011,000
日本エアーテック	3,000	593.00	1,779,000
カワタ	2,000	1,365.00	2,730,000
日精樹脂工業	8,100	925.00	7,492,500
オカダアイヨン	3,300	1,469.00	4,847,700
ワイエイシイホールディングス	3,800	806.00	3,062,800
小松製作所	434,700	2,836.50	1,233,026,550
住友重機械工業	55,000	3,915.00	215,325,000
日立建機	38,500	2,932.00	112,882,000
日工	2,700	2,174.00	5,869,800
巴工業	4,100	2,391.00	9,803,100
井関農機	9,800	1,644.00	16,111,200
T O W A	8,300	692.00	5,743,600
丸山製作所	2,300	1,295.00	2,978,500
北川鉄工所	4,400	2,445.00	10,758,000
ローツェ	4,200	1,719.00	7,219,800
タカキタ	3,400	607.00	2,063,800
クボタ	514,300	1,569.50	807,193,850
荏原実業	2,900	2,211.00	6,411,900
三菱化工機	3,500	1,548.00	5,418,000
月島機械	19,100	1,383.00	26,415,300
帝国電機製作所	6,800	1,222.00	8,309,600
新東工業	22,900	1,014.00	23,220,600
澁谷工業	8,400	3,350.00	28,140,000
アイチ コーポレーション	16,800	730.00	12,264,000
小森コーポレーション	26,100	1,213.00	31,659,300

鶴見製作所	7,600	1,814.00	13,786,400
住友精密工業	1,600	2,873.00	4,596,800
酒井重工業	1,800	2,379.00	4,282,200
荏原製作所	42,600	3,170.00	135,042,000
石井鐵工所	1,500	1,781.00	2,671,500
西島製作所	9,900	946.00	9,365,400
北越工業	10,000	1,170.00	11,700,000
ダイキン工業	131,000	12,250.00	1,604,750,000
オルガノ	3,500	3,050.00	10,675,000
トーヨーカネツ	3,700	2,297.00	8,498,900
栗田工業	52,000	2,952.00	153,504,000
椿本チエイン	12,600	4,090.00	51,534,000
大同工業	4,800	901.00	4,324,800
木村化工機	8,600	379.00	3,259,400
アネスト岩田	14,900	1,004.00	14,959,600
ダイフク	52,800	5,610.00	296,208,000
サムコ	2,700	947.00	2,556,900
加藤製作所	5,000	2,752.00	13,760,000
油研工業	1,700	1,889.00	3,211,300
タダノ	46,400	1,176.00	54,566,400
フジテック	34,900	1,240.00	43,276,000
C K D	26,700	1,065.00	28,435,500
キトー	7,300	1,803.00	13,161,900
平和	26,800	2,216.00	59,388,800
理想科学工業	8,500	1,928.00	16,388,000
S A N K Y O	24,000	4,075.00	97,800,000
日本金銭機械	10,700	1,085.00	11,609,500
マースグループホールディングス	6,100	2,152.00	13,127,200
福島工業	5,900	3,875.00	22,862,500
オーイズミ	4,100	368.00	1,508,800
ダイコク電機	4,400	1,472.00	6,476,800
竹内製作所	16,100	2,038.00	32,811,800
アマノ	27,400	2,375.00	65,075,000
J U K I	13,500	1,320.00	17,820,000
サンデンホールディングス	11,800	828.00	9,770,400
蛇の目マシン工業	8,800	489.00	4,303,200
マックス	14,900	1,488.00	22,171,200
グローリー	26,600	2,629.00	69,931,400
新晃工業	9,000	1,576.00	14,184,000
大和冷機工業	14,000	1,270.00	17,780,000
セガサミーホールディングス	95,200	1,312.00	124,902,400
日本ピストンリング	3,500	1,693.00	5,925,500

リケン	4,400	5,360.00	23,584,000
T P R	12,900	2,434.00	31,398,600
ツバキ・ナカシマ	14,500	2,012.00	29,174,000
ホシザキ	28,100	7,700.00	216,370,000
大豊工業	7,900	1,019.00	8,050,100
日本精工	197,100	1,059.00	208,728,900
N T N	206,300	357.00	73,649,100
ジェイテクト	92,100	1,412.00	130,045,200
不二越	8,900	4,535.00	40,361,500
日本トムソン	28,700	559.00	16,043,300
T H K	59,800	2,818.00	168,516,400
ユーシン精機	7,500	1,074.00	8,055,000
前澤給装工業	3,800	1,866.00	7,090,800
イーグル工業	12,000	1,312.00	15,744,000
前澤工業	6,400	362.00	2,316,800
日本ピラー工業	9,800	1,397.00	13,690,600
キッツ	38,900	847.00	32,948,300
マキタ	116,800	4,045.00	472,456,000
日立造船	76,500	351.00	26,851,500
三菱重工業	160,900	4,437.00	713,913,300
I H I	73,800	3,080.00	227,304,000
スター精密	16,500	1,674.00	27,621,000
日清紡ホールディングス	53,600	959.00	51,402,400
イビデン	58,900	1,572.00	92,590,800
コニカミノルタ	210,000	1,076.00	225,960,000
ブラザー工業	125,200	2,084.00	260,916,800
ミネベアミツミ	178,300	1,786.00	318,443,800
日立製作所	432,200	3,479.00	1,503,623,800
三菱電機	960,100	1,428.00	1,371,022,800
富士電機	62,400	3,510.00	219,024,000
東洋電機製造	4,000	1,331.00	5,324,000
安川電機	111,400	3,270.00	364,278,000
シンフォニアテクノロジー	13,500	1,370.00	18,495,000
明電舎	19,200	1,621.00	31,123,200
オリジン電気	2,700	2,237.00	6,039,900
山洋電気	4,700	4,105.00	19,293,500
デンヨー	9,100	1,432.00	13,031,200
東芝テック	12,100	2,984.00	36,106,400
芝浦メカトロニクス	1,800	3,520.00	6,336,000
マブチモーター	26,600	3,860.00	102,676,000
日本電産	115,500	13,480.00	1,556,940,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,300	1,833.00	9,714,900

トレックス・セミコンダクター	3,500	1,136.00	3,976,000
東光高岳	5,100	1,415.00	7,216,500
ダブル・スコープ	14,200	1,384.00	19,652,800
ダイヘン	10,600	2,769.00	29,351,400
ヤーマン	14,200	1,352.00	19,198,400
JVCケンウッド	74,300	268.00	19,912,400
ミマキエンジニアリング	9,000	764.00	6,876,000
第一精工	4,200	1,045.00	4,389,000
日新電機	22,800	1,014.00	23,119,200
大崎電気工業	19,700	690.00	13,593,000
オムロン	102,100	4,940.00	504,374,000
日東工業	15,500	2,258.00	34,999,000
I D E C	13,000	2,112.00	27,456,000
正興電機製作所	2,000	812.00	1,624,000
不二電機工業	1,300	1,293.00	1,680,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	34,600	2,304.00	79,718,400
サクサホールディングス	2,600	1,858.00	4,830,800
メルコホールディングス	4,000	3,960.00	15,840,000
テクノメディカ	2,100	2,093.00	4,395,300
日本電気	124,300	3,705.00	460,531,500
富士通	92,600	7,501.00	694,592,600
沖電気工業	41,800	1,307.00	54,632,600
岩崎通信機	4,500	823.00	3,703,500
電気興業	5,200	2,629.00	13,670,800
サンケン電気	11,400	2,276.00	25,946,400
ナカヨ	2,100	1,398.00	2,935,800
アイホン	5,700	1,718.00	9,792,600
ルネサスエレクトロニクス	99,800	690.00	68,862,000
セイコーエプソン	119,300	1,674.00	199,708,200
ワコム	70,000	463.00	32,410,000
アルバック	19,200	3,215.00	61,728,000
アクセル	4,600	523.00	2,405,800
E I Z O	8,900	4,695.00	41,785,500
日本信号	24,800	985.00	24,428,000
京三製作所	21,500	404.00	8,686,000
能美防災	12,800	2,000.00	25,600,000
ホーチキ	6,400	1,152.00	7,372,800
星和電機	4,600	442.00	2,033,200
エレコム	8,900	3,355.00	29,859,500
パナソニック	1,096,900	1,043.50	1,144,615,150
シャープ	95,200	1,365.00	129,948,000
アンリツ	61,900	2,142.00	132,589,800

富士通ゼネラル	29,500	1,485.00	43,807,500
ソニー	643,800	5,340.00	3,437,892,000
T D K	50,200	8,890.00	446,278,000
帝国通信工業	4,500	1,187.00	5,341,500
タムラ製作所	37,800	594.00	22,453,200
アルプスアルパイン	100,000	2,307.00	230,700,000
池上通信機	3,100	1,174.00	3,639,400
日本電波工業	8,400	369.00	3,099,600
鈴木	5,600	675.00	3,780,000
日本トリム	1,900	5,500.00	10,450,000
ローランド ディー . ジー .	5,000	2,212.00	11,060,000
フォスター電機	11,500	1,574.00	18,101,000
クラリオン	9,900	2,498.00	24,730,200
S M K	2,800	2,621.00	7,338,800
ヨコオ	7,100	1,627.00	11,551,700
ホシデン	28,500	908.00	25,878,000
ヒロセ電機	13,800	11,680.00	161,184,000
日本航空電子工業	22,200	1,484.00	32,944,800
T O A	10,700	1,021.00	10,924,700
マクセルホールディングス	20,800	1,664.00	34,611,200
古野電気	12,600	960.00	12,096,000
ユニデンホールディングス	3,000	2,283.00	6,849,000
スミダコーポレーション	8,300	1,472.00	12,217,600
アイコム	5,400	2,208.00	11,923,200
リオン	4,500	1,903.00	8,563,500
本多通信工業	8,800	555.00	4,884,000
横河電機	96,200	2,157.00	207,503,400
新電元工業	3,500	4,395.00	15,382,500
アズビル	62,100	2,449.00	152,082,900
東亜ディーケーケー	5,100	854.00	4,355,400
日本光電工業	42,400	3,355.00	142,252,000
チノー	3,600	1,266.00	4,557,600
共和電業	10,900	379.00	4,131,100
日本電子材料	4,200	720.00	3,024,000
堀場製作所	19,100	5,840.00	111,544,000
アドバンテスト	65,500	2,645.00	173,247,500
小野測器	4,900	614.00	3,008,600
エスベック	8,600	2,086.00	17,939,600
キーエンス	47,100	63,210.00	2,977,191,000
日置電機	5,100	4,455.00	22,720,500
シスメックス	74,800	6,730.00	503,404,000
日本マイクロニクス	16,000	811.00	12,976,000

メガチップス	7,700	2,179.00	16,778,300
O B A R A G R O U P	5,700	3,925.00	22,372,500
澤藤電機	1,300	1,592.00	2,069,600
原田工業	3,300	952.00	3,141,600
コーセル	12,400	1,174.00	14,557,600
イリソ電子工業	8,800	4,825.00	42,460,000
オブテックスグループ	17,000	2,078.00	35,326,000
千代田インテグレ	4,200	2,143.00	9,000,600
アイ・オー・データ機器	3,800	1,193.00	4,533,400
レーザーテック	19,700	4,075.00	80,277,500
スタンレー電気	68,000	3,200.00	217,600,000
岩崎電気	4,000	1,381.00	5,524,000
ウシオ電機	58,500	1,311.00	76,693,500
岡谷電機産業	7,600	385.00	2,926,000
ハリオス テクノ ホールディング	9,300	705.00	6,556,500
エノモト	2,400	883.00	2,119,200
日本セラミック	9,800	2,786.00	27,302,800
遠藤照明	5,300	717.00	3,800,100
古河電池	7,300	734.00	5,358,200
双信電機	5,400	424.00	2,289,600
山一電機	7,200	1,187.00	8,546,400
図研	6,500	1,585.00	10,302,500
日本電子	19,100	1,880.00	35,908,000
カシオ計算機	85,100	1,525.00	129,777,500
ファナック	91,200	19,415.00	1,770,648,000
日本シイエムケイ	24,500	650.00	15,925,000
エンプラス	4,400	3,050.00	13,420,000
大真空	3,800	898.00	3,412,400
ローム	46,400	7,450.00	345,680,000
浜松ホトニクス	68,900	3,990.00	274,911,000
三井ハイテック	10,800	1,000.00	10,800,000
新光電気工業	32,500	837.00	27,202,500
京セラ	146,300	6,243.00	913,350,900
太陽誘電	42,800	2,319.00	99,253,200
村田製作所	100,700	17,560.00	1,768,292,000
ユーシン	14,800	982.00	14,533,600
双葉電子工業	15,800	1,760.00	27,808,000
北陸電気工業	3,900	1,083.00	4,223,700
ニチコン	30,500	1,007.00	30,713,500
日本ケミコン	6,800	2,184.00	14,851,200
K O A	14,600	1,614.00	23,564,400
市光工業	14,900	671.00	9,997,900

小糸製作所	57,500	6,660.00	382,950,000
ミツバ	18,200	705.00	12,831,000
S C R E E Nホールディングス	16,700	4,600.00	76,820,000
キャノン電子	8,900	1,835.00	16,331,500
キャノン	516,800	3,219.00	1,663,579,200
リコー	288,900	1,131.00	326,745,900
象印マホービン	18,100	1,240.00	22,444,000
M U T O Hホールディングス	1,400	1,891.00	2,647,400
東京エレクトロン	64,000	15,805.00	1,011,520,000
トヨタ紡織	33,600	1,821.00	61,185,600
芦森工業	2,000	1,709.00	3,418,000
ユニプレス	18,600	1,987.00	36,958,200
豊田自動織機	77,700	5,650.00	439,005,000
モリタホールディングス	16,800	1,858.00	31,214,400
三櫻工業	12,400	557.00	6,906,800
デンソー	211,400	4,800.00	1,014,720,000
東海理化電機製作所	25,300	2,004.00	50,701,200
三井E & Sホールディングス	34,000	1,257.00	42,738,000
川崎重工業	74,700	2,851.00	212,969,700
名村造船所	29,100	430.00	12,513,000
日本車輛製造	3,500	2,666.00	9,331,000
三菱ロジスネクスト	11,500	1,426.00	16,399,000
近畿車輛	1,400	2,138.00	2,993,200
日産自動車	1,132,100	948.60	1,073,910,060
いすゞ自動車	303,400	1,597.50	484,681,500
トヨタ自動車	1,069,700	6,731.00	7,200,150,700
日野自動車	119,900	1,027.00	123,137,300
三菱自動車工業	355,300	623.00	221,351,900
エフテック	6,800	996.00	6,772,800
レシップホールディングス	3,500	731.00	2,558,500
G M B	1,900	937.00	1,780,300
ファルテック	1,800	907.00	1,632,600
武蔵精密工業	23,300	1,578.00	36,767,400
日産車体	18,700	1,004.00	18,774,800
新明和工業	40,000	1,391.00	55,640,000
極東開発工業	19,100	1,500.00	28,650,000
日信工業	17,600	1,575.00	27,720,000
トピー工業	7,900	2,377.00	18,778,300
ティラド	3,500	2,305.00	8,067,500
曙ブレーキ工業	53,200	170.00	9,044,000
タチエス	16,300	1,670.00	27,221,000
N O K	51,600	1,785.00	92,106,000

フタバ産業	26,800	601.00	16,106,800
K Y B	9,600	3,060.00	29,376,000
大同メタル工業	15,800	794.00	12,545,200
プレス工業	47,700	624.00	29,764,800
ミクニ	12,400	493.00	6,113,200
太平洋工業	20,100	1,721.00	34,592,100
ケーヒン	22,100	1,982.00	43,802,200
河西工業	12,000	911.00	10,932,000
アイシン精機	79,000	4,315.00	340,885,000
マツダ	301,300	1,289.50	388,526,350
今仙電機製作所	9,000	1,041.00	9,369,000
本田技研工業	809,800	3,103.00	2,512,809,400
スズキ	175,600	5,705.00	1,001,798,000
S U B A R U	298,000	2,819.50	840,211,000
安永	4,700	1,559.00	7,327,300
ヤマハ発動機	135,600	2,232.00	302,659,200
ショーワ	22,700	1,584.00	35,956,800
T B K	11,700	431.00	5,042,700
エクセディ	13,100	2,643.00	34,623,300
豊田合成	31,000	2,446.00	75,826,000
愛三工業	15,200	759.00	11,536,800
盟和産業	1,500	1,059.00	1,588,500
日本プラスト	7,700	836.00	6,437,200
ヨロズ	9,100	1,626.00	14,796,600
エフ・シー・シー	17,300	2,643.00	45,723,900
シマノ	38,700	17,320.00	670,284,000
テイ・エス テック	22,300	3,225.00	71,917,500
ジャムコ	4,800	2,639.00	12,667,200
テルモ	135,800	6,711.00	911,353,800
クリエートメディック	3,200	995.00	3,184,000
日機装	31,000	1,185.00	36,735,000
島津製作所	123,500	2,766.00	341,601,000
J M S	9,000	648.00	5,832,000
長野計器	7,600	787.00	5,981,200
ブイ・テクノロジー	2,200	14,830.00	32,626,000
東京計器	6,200	1,128.00	6,993,600
愛知時計電機	1,300	3,890.00	5,057,000
インターアクション	4,500	1,783.00	8,023,500
オーバル	9,600	248.00	2,380,800
東京精密	17,400	2,992.00	52,060,800
マニー	11,700	5,080.00	59,436,000
ニコン	167,300	1,728.00	289,094,400

トプコン	51,600	1,519.00	78,380,400
オリンパス	143,000	4,855.00	694,265,000
理研計器	8,500	2,223.00	18,895,500
タムロン	8,500	2,075.00	17,637,500
H O Y A	193,300	6,813.00	1,316,952,900
シード	4,100	1,314.00	5,387,400
ノーリツ鋼機	7,600	2,185.00	16,606,000
エー・アンド・デイ	8,900	739.00	6,577,100
朝日インテック	40,700	5,570.00	226,699,000
シチズン時計	105,100	640.00	67,264,000
リズム時計工業	3,300	1,697.00	5,600,100
大研医器	7,700	590.00	4,543,000
メニコン	13,200	2,884.00	38,068,800
シンシア	1,500	474.00	711,000
松風	4,800	1,308.00	6,278,400
セイコーホールディングス	14,800	2,554.00	37,799,200
ニプロ	66,400	1,495.00	99,268,000
中本パックス	2,700	1,707.00	4,608,900
スノーピーク	3,700	1,401.00	5,183,700
パラマウントベッドホールディングス	11,000	5,060.00	55,660,000
トランザクション	5,300	721.00	3,821,300
S H O - B I	2,800	370.00	1,036,000
ニホンフラッシュ	4,100	2,032.00	8,331,200
前田工織	10,600	2,788.00	29,552,800
永大産業	12,700	435.00	5,524,500
アートネイチャー	10,300	642.00	6,612,600
バンダイナムコホールディングス	99,200	4,850.00	481,120,000
アイフィスジャパン	2,200	568.00	1,249,600
共立印刷	16,100	223.00	3,590,300
S H O E I	4,600	4,075.00	18,745,000
フランスベッドホールディングス	13,700	864.00	11,836,800
パイロットコーポレーション	16,700	5,230.00	87,341,000
萩原工業	5,400	1,660.00	8,964,000
トッパン・フォームズ	20,600	951.00	19,590,600
フジシールインターナショナル	21,500	4,180.00	89,870,000
タカラトミー	40,200	1,128.00	45,345,600
廣済堂	8,800	707.00	6,221,600
エステールホールディングス	2,600	674.00	1,752,400
アーケ	37,000	93.00	3,441,000
タカノ	3,800	875.00	3,325,000
プロネクサス	8,300	1,232.00	10,225,600
ホクシン	6,000	138.00	828,000

ウッドワン	3,300	1,147.00	3,785,100
大建工業	7,300	1,928.00	14,074,400
凸版印刷	135,500	1,774.00	240,377,000
大日本印刷	135,300	2,604.00	352,321,200
図書印刷	9,100	950.00	8,645,000
共同印刷	3,000	2,433.00	7,299,000
N I S S H A	19,700	1,328.00	26,161,600
光村印刷	800	2,229.00	1,783,200
宝印刷	4,700	1,624.00	7,632,800
アシックス	95,300	1,460.00	139,138,000
ツツミ	3,000	2,022.00	6,066,000
小松ウオール工業	2,900	1,939.00	5,623,100
ヤマハ	57,100	5,470.00	312,337,000
河合楽器製作所	3,000	3,360.00	10,080,000
クリナップ	9,000	636.00	5,724,000
ピジョン	58,000	4,690.00	272,020,000
兼松サステック	600	1,567.00	940,200
キングジム	8,100	828.00	6,706,800
リンテック	22,800	2,479.00	56,521,200
イトーキ	17,800	571.00	10,163,800
任天堂	59,100	29,905.00	1,767,385,500
三菱鉛筆	15,800	2,275.00	35,945,000
タカラスタANDARD	19,800	1,718.00	34,016,400
コクヨ	46,000	1,687.00	77,602,000
ナカバヤシ	9,500	550.00	5,225,000
グローブライド	4,600	2,755.00	12,673,000
オカムラ	33,500	1,306.00	43,751,000
美津濃	9,500	2,618.00	24,871,000
東京電力ホールディングス	766,300	673.00	515,719,900
中部電力	293,700	1,786.00	524,548,200
関西電力	391,700	1,656.50	648,851,050
中国電力	132,700	1,468.00	194,803,600
北陸電力	94,000	948.00	89,112,000
東北電力	224,800	1,471.00	330,680,800
四国電力	86,400	1,422.00	122,860,800
九州電力	197,800	1,326.00	262,282,800
北海道電力	89,800	810.00	72,738,000
沖縄電力	17,800	2,098.00	37,344,400
電源開発	76,400	2,844.00	217,281,600
エフオン	4,600	849.00	3,905,400
イーレックス	16,800	856.00	14,380,800
レノバ	11,800	1,095.00	12,921,000

東京瓦斯	188,300	3,051.00	574,503,300
大阪瓦斯	186,300	2,255.00	420,106,500
東邦瓦斯	47,500	4,895.00	232,512,500
北海道瓦斯	5,200	1,463.00	7,607,600
広島ガス	19,900	349.00	6,945,100
西部瓦斯	10,800	2,509.00	27,097,200
静岡ガス	29,500	905.00	26,697,500
メタウォーター	4,600	3,075.00	14,145,000
SBSホールディングス	9,500	1,981.00	18,819,500
東武鉄道	101,200	3,120.00	315,744,000
相鉄ホールディングス	32,900	3,320.00	109,228,000
東京急行電鉄	260,700	1,864.00	485,944,800
京浜急行電鉄	131,500	1,855.00	243,932,500
小田急電鉄	153,700	2,555.00	392,703,500
京王電鉄	53,600	6,430.00	344,648,000
京成電鉄	71,900	3,785.00	272,141,500
富士急行	13,100	3,985.00	52,203,500
新京成電鉄	2,500	2,084.00	5,210,000
東日本旅客鉄道	170,700	10,630.00	1,814,541,000
西日本旅客鉄道	86,000	8,295.00	713,370,000
東海旅客鉄道	85,900	24,890.00	2,138,051,000
西武ホールディングス	122,400	2,004.00	245,289,600
鴻池運輸	15,400	1,796.00	27,658,400
西日本鉄道	26,600	2,712.00	72,139,200
ハマキョウレックス	7,400	4,380.00	32,412,000
サカイ引越センター	5,000	6,630.00	33,150,000
近鉄グループホールディングス	90,900	4,960.00	450,864,000
阪急阪神ホールディングス	121,200	4,090.00	495,708,000
南海電気鉄道	40,600	3,005.00	122,003,000
京阪ホールディングス	40,500	4,595.00	186,097,500
神戸電鉄	2,300	3,965.00	9,119,500
名古屋鉄道	72,800	3,045.00	221,676,000
山陽電気鉄道	7,000	2,197.00	15,379,000
日本通運	35,700	6,990.00	249,543,000
ヤマトホールディングス	159,400	2,973.00	473,896,200
山九	25,300	5,500.00	139,150,000
丸運	5,200	309.00	1,606,800
丸全昭和運輸	7,400	2,837.00	20,993,800
センコーグループホールディングス	50,100	945.00	47,344,500
トナミホールディングス	2,200	6,520.00	14,344,000
ニッコンホールディングス	34,600	2,894.00	100,132,400
日本石油輸送	1,100	2,995.00	3,294,500

福山通運	11,600	4,550.00	52,780,000
セイノーホールディングス	68,100	1,572.00	107,053,200
エスライン	2,800	1,135.00	3,178,000
神奈川中央交通	2,300	3,750.00	8,625,000
日立物流	20,000	3,295.00	65,900,000
丸和運輸機関	4,800	3,575.00	17,160,000
C & F ロジホールディングス	9,300	1,308.00	12,164,400
九州旅客鉄道	76,300	3,715.00	283,454,500
S Gホールディングス	85,900	3,165.00	271,873,500
日本郵船	76,300	1,838.00	140,239,400
商船三井	54,100	2,706.00	146,394,600
川崎汽船	28,300	1,661.00	47,006,300
N S ユナイテッド海運	5,200	2,634.00	13,696,800
飯野海運	44,900	402.00	18,049,800
共栄タンカー	1,200	1,565.00	1,878,000
乾汽船	8,200	718.00	5,887,600
日本航空	166,400	4,063.00	676,083,200
A N Aホールディングス	166,200	4,121.00	684,910,200
パスコ	1,800	933.00	1,679,400
ランコム	2,500	6,910.00	17,275,000
日新	7,900	1,946.00	15,373,400
三菱倉庫	31,500	2,818.00	88,767,000
三井倉庫ホールディングス	11,100	1,970.00	21,867,000
住友倉庫	34,200	1,458.00	49,863,600
澁澤倉庫	5,000	1,658.00	8,290,000
東陽倉庫	16,600	323.00	5,361,800
日本トランスシティ	20,200	449.00	9,069,800
ケイヒン	1,800	1,407.00	2,532,600
中央倉庫	5,600	1,072.00	6,003,200
川西倉庫	1,900	1,239.00	2,354,100
安田倉庫	7,500	905.00	6,787,500
ファイズ	1,200	859.00	1,030,800
東洋埠頭	2,800	1,495.00	4,186,000
宇徳	7,800	548.00	4,274,400
上組	56,100	2,559.00	143,559,900
サンリツ	2,200	720.00	1,584,000
キムラユニティー	2,500	1,117.00	2,792,500
キューソー流通システム	2,300	2,073.00	4,767,900
近鉄エクスプレス	17,200	1,836.00	31,579,200
東海運	5,200	287.00	1,492,400
エーアイティー	5,900	1,090.00	6,431,000
内外トランスライン	2,900	1,504.00	4,361,600

日本コンセプト	2,500	1,034.00	2,585,000
NEC ネットエスアイ	10,400	2,575.00	26,780,000
クロスキャット	2,000	1,014.00	2,028,000
システナ	33,700	1,128.00	38,013,600
デジタルアーツ	5,100	8,460.00	43,146,000
新日鉄住金ソリューションズ	14,200	2,999.00	42,585,800
キューブシステム	5,300	833.00	4,414,900
エイジア	2,000	1,326.00	2,652,000
コア	4,200	1,371.00	5,758,200
ソリトンシステムズ	5,500	1,047.00	5,758,500
ソフトクリエイトホールディングス	4,300	1,567.00	6,738,100
T I S	31,400	5,260.00	165,164,000
ネオス	2,700	1,005.00	2,713,500
電算システム	3,700	2,541.00	9,401,700
グリー	65,300	462.00	30,168,600
コーエーテクモホールディングス	19,300	1,887.00	36,419,100
三菱総合研究所	3,700	3,310.00	12,247,000
電算	1,100	2,228.00	2,450,800
A G S	5,600	712.00	3,987,200
ファインデックス	8,300	802.00	6,656,600
ヒト・コミュニケーションズ	2,300	1,626.00	3,739,800
ブレインパッド	1,800	5,100.00	9,180,000
K L a b	17,000	808.00	13,736,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	12,800	861.00	11,020,800
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	1,554.00	2,486,400
ネクソン	240,000	1,643.00	394,320,000
アイスタイル	24,500	737.00	18,056,500
エムアップ	3,300	2,078.00	6,857,400
エイチーム	6,000	1,867.00	11,202,000
テクノスジャパン	8,200	760.00	6,232,000
コロプラ	27,300	703.00	19,191,900
ブロードリーフ	47,000	581.00	27,307,000
クロス・マーケティンググループ	3,100	434.00	1,345,400
デジタルハーツホールディングス	4,400	1,299.00	5,715,600
メディアドゥホールディングス	3,000	2,336.00	7,008,000
じげん	10,400	669.00	6,957,600
サイバーリンクス	1,600	950.00	1,520,000
フィックスターズ	9,200	1,272.00	11,702,400
C A R T A H O L D I N G S	5,200	1,086.00	5,647,200
オブティム	2,100	3,875.00	8,137,500
セレス	3,200	1,956.00	6,259,200
ベリサーブ	1,000	6,680.00	6,680,000

ティーガイア	9,500	2,035.00	19,332,500
セック	1,600	3,680.00	5,888,000
日本アジアグループ	10,000	371.00	3,710,000
豆蔵ホールディングス	6,600	1,029.00	6,791,400
テクマトリックス	6,800	1,812.00	12,321,600
プロシップ	2,800	1,398.00	3,914,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	227,500	302.00	68,705,000
GMOペイメントゲートウェイ	15,500	6,260.00	97,030,000
ザッパラス	5,400	397.00	2,143,800
システムリサーチ	1,300	3,080.00	4,004,000
インターネットイニシアティブ	15,400	2,510.00	38,654,000
さくらインターネット	11,700	524.00	6,130,800
ヴィンクス	3,300	1,126.00	3,715,800
GMOクラウド	2,100	3,435.00	7,213,500
SRAホールディングス	5,100	2,659.00	13,560,900
Minorityソリューションズ	2,000	1,643.00	3,286,000
朝日ネット	8,000	514.00	4,112,000
eBASE	2,900	1,753.00	5,083,700
アバント	3,500	1,463.00	5,120,500
アドソル日進	3,500	1,739.00	6,086,500
フリービット	5,800	967.00	5,608,600
コムチュア	5,300	2,994.00	15,868,200
サイバーコム	1,700	2,454.00	4,171,800
アステリア	4,900	818.00	4,008,200
マークラインズ	3,400	1,504.00	5,113,600
メディカル・データ・ビジョン	8,600	1,093.00	9,399,800
ショーケース・ティービー	2,300	792.00	1,821,600
モバイルファクトリー	2,700	1,426.00	3,850,200
テラスカイ	600	3,925.00	2,355,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,300	1,483.00	6,376,900
PCIホールディングス	1,700	2,297.00	3,904,900
パイプドHD	1,600	866.00	1,385,600
アイビーシー	1,700	1,161.00	1,973,700
ネオジャパン	2,000	1,003.00	2,006,000
PR TIMES	700	2,313.00	1,619,100
ランドコンピュータ	1,200	1,145.00	1,374,000
ダブルスタンダード	600	4,925.00	2,955,000
オープンドア	4,700	3,155.00	14,828,500
マイネット	3,100	1,110.00	3,441,000
アカツキ	3,300	5,950.00	19,635,000
ベネフィットジャパン	800	843.00	674,400
Ubicomホールディングス	1,900	1,206.00	2,291,400

L I N E	28,700	4,010.00	115,087,000	
カナミックネットワーク	1,500	1,972.00	2,958,000	
ノムラシステムコーポレーション	1,000	731.00	731,000	
チェンジ	1,300	3,910.00	5,083,000	
シンクロ・フード	4,300	712.00	3,061,600	
オークネット	5,200	1,011.00	5,257,200	
A O I T Y O H o l d i n g s	10,500	805.00	8,452,500	
マクロミル	16,900	1,395.00	23,575,500	
ビーグリー	2,000	950.00	1,900,000	
オロ	1,000	5,150.00	5,150,000	
ソルクシーズ	4,300	647.00	2,782,100	
フェイス	3,900	769.00	2,999,100	
ハイマックス	1,200	1,854.00	2,224,800	
野村総合研究所	59,900	4,495.00	269,250,500	
サイバネットシステム	8,100	602.00	4,876,200	
C E ホールディングス	2,700	730.00	1,971,000	
日本システム技術	1,600	1,365.00	2,184,000	
インテージホールディングス	12,300	854.00	10,504,200	
東邦システムサイエンス	3,000	918.00	2,754,000	
ソースネクスト	36,800	530.00	19,504,000	
インフォコム	3,900	4,005.00	15,619,500	
F I G	8,900	337.00	2,999,300	
アルテリア・ネットワークス	8,000	1,314.00	10,512,000	
フォーカスシステムズ	6,500	1,015.00	6,597,500	
クレスコ	2,900	3,365.00	9,758,500	
フジ・メディア・ホールディングス	97,800	1,657.00	162,054,600	
オービック	32,700	10,300.00	336,810,000	
ジャストシステム	13,500	2,662.00	35,937,000	
T D C ソフト	8,500	951.00	8,083,500	
ヤフー	614,600	313.00	192,369,800	
トレンドマイクロ	50,200	5,360.00	269,072,000	
インフォメーション・ディベロプメント	2,800	1,373.00	3,844,400	
日本オラクル	19,100	8,240.00	157,384,000	
アルファシステムズ	3,000	2,637.00	7,911,000	
フューチャー	13,000	1,744.00	22,672,000	
C A C H o l d i n g s	7,000	1,208.00	8,456,000	
ソフトバンク・テクノロジー	4,100	2,075.00	8,507,500	
トーセ	2,800	814.00	2,279,200	
オービックビジネスコンサルタント	9,700	4,430.00	42,971,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	43,000	2,603.00	111,929,000	
アイティフォー	11,700	839.00	9,816,300	
東計電算	1,400	3,060.00	4,284,000	

エクスネット	1,900	842.00	1,599,800
大塚商会	51,000	4,025.00	205,275,000
サイボウズ	11,400	643.00	7,330,200
ソフトブレーン	7,800	520.00	4,056,000
電通国際情報サービス	5,900	3,670.00	21,653,000
デジタルガレージ	18,400	2,904.00	53,433,600
E Mシステムズ	7,800	1,262.00	9,843,600
ウェザーニューズ	3,200	3,085.00	9,872,000
C I J	7,600	806.00	6,125,600
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	2,059.00	2,059,000
日本エンタープライズ	10,700	178.00	1,904,600
WOWOW	4,600	3,045.00	14,007,000
スカラ	6,900	825.00	5,692,500
I M A G I C A G R O U P	8,400	507.00	4,258,800
ネットワンシステムズ	33,400	2,521.00	84,201,400
システムソフト	24,100	100.00	2,410,000
アルゴグラフィックス	4,000	4,960.00	19,840,000
マーベラス	14,700	901.00	13,244,700
エイベックス	16,400	1,432.00	23,484,800
日本ユニシス	29,500	2,831.00	83,514,500
兼松エレクトロニクス	5,200	3,285.00	17,082,000
東京放送ホールディングス	62,600	1,996.00	124,949,600
日本テレビホールディングス	86,600	1,818.00	157,438,800
朝日放送グループホールディングス	9,700	778.00	7,546,600
テレビ朝日ホールディングス	26,000	2,041.00	53,066,000
スカパーJ S A Tホールディングス	72,200	505.00	36,461,000
テレビ東京ホールディングス	7,800	2,498.00	19,484,400
日本BS放送	3,400	1,070.00	3,638,000
ビジョン	3,000	4,745.00	14,235,000
スマートバリュー	2,300	825.00	1,897,500
ワイヤレスゲート	4,500	427.00	1,921,500
コネクシオ	6,900	1,437.00	9,915,300
クロップス	2,000	664.00	1,328,000
日本電信電話	644,300	4,690.00	3,021,767,000
K D D I	830,100	2,701.50	2,242,515,150
ソフトバンク	749,100	1,347.00	1,009,037,700
光通信	11,100	19,900.00	220,890,000
N T T ドコモ	676,400	2,604.00	1,761,345,600
エムティーアイ	11,300	636.00	7,186,800
G M O インターネット	34,400	1,840.00	63,296,000
アイドママーケティングコミュニケーション	2,400	496.00	1,190,400
カドカワ	27,600	1,227.00	33,865,200

学研ホールディングス	3,200	5,330.00	17,056,000
ゼンリン	18,800	3,095.00	58,186,000
昭文社	4,700	486.00	2,284,200
インプレスホールディングス	7,900	156.00	1,232,400
アイネット	5,500	1,420.00	7,810,000
松竹	6,200	11,570.00	71,734,000
東宝	62,000	4,120.00	255,440,000
東映	4,000	13,660.00	54,640,000
エヌ・ティ・ティ・データ	250,900	1,211.00	303,839,900
ピー・シー・エー	1,300	2,316.00	3,010,800
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	2,211.00	3,758,700
D T S	10,600	4,060.00	43,036,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	43,900	3,185.00	139,821,500
シーイーシー	10,200	2,309.00	23,551,800
カプコン	40,400	2,231.00	90,132,400
アイ・エス・ピー	1,900	2,194.00	4,168,600
ジャステック	5,700	981.00	5,591,700
S C S K	24,900	4,850.00	120,765,000
日本システムウエア	3,200	1,952.00	6,246,400
アイネス	12,200	1,297.00	15,823,400
T K C	8,000	3,810.00	30,480,000
富士ソフト	14,100	4,315.00	60,841,500
N S D	15,500	2,465.00	38,207,500
コナミホールディングス	38,500	4,445.00	171,132,500
福井コンピュータホールディングス	3,200	1,919.00	6,140,800
J B C Cホールディングス	7,600	1,625.00	12,350,000
ミロク情報サービス	9,400	2,840.00	26,696,000
ソフトバンクグループ	393,600	10,230.00	4,026,528,000
ハウスイ	800	903.00	722,400
高千穂交易	3,700	1,017.00	3,762,900
伊藤忠食品	2,300	4,875.00	11,212,500
エレマテック	4,400	1,852.00	8,148,800
J A L U X	2,700	2,516.00	6,793,200
あらた	5,200	4,430.00	23,036,000
トーメンデバイス	1,400	2,514.00	3,519,600
東京エレクトロン デバイス	3,400	1,844.00	6,269,600
フィールズ	8,300	720.00	5,976,000
双日	522,200	422.00	220,368,400
アルフレッサ ホールディングス	105,100	3,230.00	339,473,000
横浜冷凍	24,700	924.00	22,822,800
神栄	1,300	770.00	1,001,000
ラサ商事	5,100	858.00	4,375,800

ラクーンホールディングス	4,500	661.00	2,974,500	
アルコニックス	10,100	1,271.00	12,837,100	
神戸物産	14,300	3,700.00	52,910,000	
あいホールディングス	13,500	1,955.00	26,392,500	
ディーブイエックス	3,700	1,178.00	4,358,600	
ダイワボウホールディングス	8,600	6,540.00	56,244,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	26,200	1,527.00	40,007,400	
ラクト・ジャパン	2,000	8,720.00	17,440,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,800	1,089.00	19,384,200	
八洲電機	7,400	840.00	6,216,000	
メディアスホールディングス	5,400	750.00	4,050,000	
U K Cホールディングス	6,100	2,075.00	12,657,500	
ジューテックホールディングス	2,200	1,051.00	2,312,200	
大光	3,100	618.00	1,915,800	
O C H Iホールディングス	2,800	1,258.00	3,522,400	
T O K A Iホールディングス	50,000	918.00	45,900,000	
黒谷	1,700	469.00	797,300	
C o m i n i x	1,700	876.00	1,489,200	
三洋貿易	4,800	2,106.00	10,108,800	
ビューティガレージ	1,500	1,473.00	2,209,500	
ウイン・パートナーズ	6,200	1,171.00	7,260,200	
ミタチ産業	2,900	738.00	2,140,200	
シップヘルスケアホールディングス	19,700	4,255.00	83,823,500	
明治電機工業	3,000	1,820.00	5,460,000	
デリカフーズホールディングス	1,700	1,315.00	2,235,500	
スターティアホールディングス	1,900	582.00	1,105,800	
コメダホールディングス	21,800	2,134.00	46,521,200	
富士興産	3,700	668.00	2,471,600	
協栄産業	1,200	1,578.00	1,893,600	
小野建	8,400	1,606.00	13,490,400	
南陽	1,900	2,261.00	4,295,900	
佐島電機	7,000	982.00	6,874,000	
エコートレーディング	2,200	605.00	1,331,000	
伯東	6,500	1,231.00	8,001,500	
コンドーテック	7,400	1,043.00	7,718,200	
中山福	5,500	553.00	3,041,500	
ナガイレーベン	13,700	2,354.00	32,249,800	
三菱食品	10,400	2,889.00	30,045,600	
松田産業	7,000	1,533.00	10,731,000	
第一興商	14,100	5,470.00	77,127,000	
メディバルホールディングス	102,000	2,635.00	268,770,000	
S P K	2,000	2,341.00	4,682,000	

萩原電気ホールディングス	3,500	3,035.00	10,622,500
アズワン	6,800	8,380.00	56,984,000
スズデン	3,300	1,723.00	5,685,900
尾家産業	3,100	1,281.00	3,971,100
シモジマ	5,900	1,135.00	6,696,500
ドウシシャ	9,000	1,765.00	15,885,000
小津産業	2,100	1,875.00	3,937,500
高速	5,700	1,167.00	6,651,900
たけびし	3,400	1,453.00	4,940,200
リックス	2,200	1,656.00	3,643,200
丸文	8,500	717.00	6,094,500
ハピネット	8,000	1,466.00	11,728,000
橋本総業ホールディングス	1,800	1,494.00	2,689,200
日本ライフライン	29,700	1,743.00	51,767,100
タカショー	4,700	426.00	2,002,200
エクセル	3,400	2,302.00	7,826,800
マルカキカイ	3,100	2,128.00	6,596,800
I D O M	32,200	370.00	11,914,000
日本エム・ディ・エム	5,600	1,119.00	6,266,400
進和	5,600	2,193.00	12,280,800
エスケイジャパン	2,300	711.00	1,635,300
ダイトロン	4,400	1,712.00	7,532,800
シークス	12,100	1,700.00	20,570,000
田中商事	3,200	610.00	1,952,000
オーハシテクニカ	5,400	1,432.00	7,732,800
白銅	3,100	1,676.00	5,195,600
伊藤忠商事	661,300	2,026.50	1,340,124,450
丸紅	932,300	818.90	763,460,470
高島	1,500	1,828.00	2,742,000
長瀬産業	53,200	1,666.00	88,631,200
蝶理	6,100	1,594.00	9,723,400
豊田通商	105,500	3,580.00	377,690,000
三共生興	16,300	449.00	7,318,700
兼松	37,800	1,319.00	49,858,200
ツカモトコーポレーション	1,700	1,035.00	1,759,500
三井物産	778,900	1,796.00	1,398,904,400
日本紙パルプ商事	5,400	4,185.00	22,599,000
日立ハイテクノロジーズ	28,700	4,280.00	122,836,000
カメイ	12,300	1,261.00	15,510,300
東都水産	1,300	2,557.00	3,324,100
O U Gホールディングス	1,500	2,539.00	3,808,500
スターゼン	3,500	4,025.00	14,087,500

山善	36,900	1,191.00	43,947,900
椿本興業	2,100	3,700.00	7,770,000
住友商事	559,100	1,640.50	917,203,550
内田洋行	4,400	2,441.00	10,740,400
三菱商事	663,400	3,248.00	2,154,723,200
第一実業	4,300	3,490.00	15,007,000
キャノンマーケティングジャパン	27,000	2,089.00	56,403,000
西華産業	5,400	1,530.00	8,262,000
佐藤商事	8,500	964.00	8,194,000
菱洋エレクトロ	9,700	1,563.00	15,161,100
東京産業	9,500	549.00	5,215,500
ユアサ商事	9,700	3,355.00	32,543,500
神鋼商事	2,100	2,541.00	5,336,100
小林産業	5,700	286.00	1,630,200
阪和興業	16,400	3,335.00	54,694,000
正栄食品工業	5,000	3,135.00	15,675,000
カナデン	9,100	1,297.00	11,802,700
菱電商事	7,600	1,475.00	11,210,000
フルサト工業	5,300	1,682.00	8,914,600
岩谷産業	21,000	3,630.00	76,230,000
すてきナイスグループ	4,100	882.00	3,616,200
昭光通商	3,400	624.00	2,121,600
ニチモウ	1,500	1,759.00	2,638,500
極東貿易	2,900	1,720.00	4,988,000
イワキ	11,500	418.00	4,807,000
三愛石油	25,400	979.00	24,866,600
稲畑産業	22,700	1,587.00	36,024,900
G S Iクレオス	2,500	1,202.00	3,005,000
明和産業	8,800	472.00	4,153,600
ワキタ	20,200	1,236.00	24,967,200
東邦ホールディングス	28,000	2,732.00	76,496,000
サンゲツ	28,600	2,082.00	59,545,200
ミツウロコグループホールディングス	13,900	817.00	11,356,300
シナネンホールディングス	3,900	2,230.00	8,697,000
伊藤忠エネクス	20,900	955.00	19,959,500
サンリオ	29,200	2,355.00	68,766,000
サンワテクノス	5,800	975.00	5,655,000
リョーサン	10,400	3,130.00	32,552,000
新光商事	8,900	1,901.00	16,918,900
トーホー	4,300	2,083.00	8,956,900
三信電気	7,900	1,853.00	14,638,700
東陽テクニカ	11,000	909.00	9,999,000

モスフードサービス	12,400	2,761.00	34,236,400
加賀電子	9,400	2,122.00	19,946,800
ソーダニッカ	9,900	564.00	5,583,600
立花エレテック	7,100	1,730.00	12,283,000
フォーバル	4,200	841.00	3,532,200
PALTAC	17,000	5,710.00	97,070,000
三谷産業	11,200	288.00	3,225,600
西本Wismettacホールディングス	2,100	4,315.00	9,061,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,196.00	956,800
国際紙パルプ商事	16,800	284.00	4,771,200
ヤマタネ	4,800	1,664.00	7,987,200
丸紅建材リース	900	2,039.00	1,835,100
日鉄住金物産	6,700	4,790.00	32,093,000
泉州電業	3,100	2,672.00	8,283,200
トラスコ中山	19,700	3,105.00	61,168,500
オートバックスセブン	37,600	1,852.00	69,635,200
モリト	7,000	788.00	5,516,000
加藤産業	14,800	3,660.00	54,168,000
北恵	1,800	933.00	1,679,400
イノテック	5,700	1,054.00	6,007,800
イエローハット	8,900	2,930.00	26,077,000
J Kホールディングス	8,600	601.00	5,168,600
日伝	7,900	1,585.00	12,521,500
北沢産業	7,200	263.00	1,893,600
杉本商事	5,200	1,802.00	9,370,400
因幡電機産業	13,400	4,495.00	60,233,000
バイテックホールディングス	4,300	2,052.00	8,823,600
東テク	3,100	2,287.00	7,089,700
ミスミグループ本社	118,300	2,759.00	326,389,700
アルテック	7,000	228.00	1,596,000
タキヒヨー	2,900	1,823.00	5,286,700
蔵王産業	1,600	1,313.00	2,100,800
スズケン	43,100	5,990.00	258,169,000
ジェコス	6,600	1,095.00	7,227,000
ルネサスイーストン	8,800	446.00	3,924,800
ローソン	23,900	6,890.00	164,671,000
サンエー	7,200	4,470.00	32,184,000
カワチ薬品	7,400	2,117.00	15,665,800
エービーシー・マート	14,800	6,480.00	95,904,000
ハードオフコーポレーション	3,900	817.00	3,186,300
アスクル	9,900	2,420.00	23,958,000
ゲオホールディングス	14,400	1,655.00	23,832,000

アダストリア	13,100	1,902.00	24,916,200
ジーフット	5,800	678.00	3,932,400
くらコーポレーション	5,600	5,570.00	31,192,000
キャンドウ	4,600	1,585.00	7,291,000
パルグループホールディングス	4,800	3,110.00	14,928,000
エディオン	40,100	972.00	38,977,200
サーラコーポレーション	19,500	578.00	11,271,000
ワッツ	3,200	738.00	2,361,600
ハローズ	3,600	2,140.00	7,704,000
あみやき亭	2,100	3,675.00	7,717,500
ひらまつ	19,200	351.00	6,739,200
大黒天物産	2,300	4,055.00	9,326,500
ハニーズホールディングス	8,500	956.00	8,126,000
ファーマライズホールディングス	2,300	564.00	1,297,200
アルペン	7,300	1,662.00	12,132,600
ハブ	3,100	972.00	3,013,200
クオールホールディングス	14,100	1,475.00	20,797,500
ジーンズ	6,400	5,390.00	34,496,000
ビックカメラ	50,500	1,259.00	63,579,500
D C Mホールディングス	51,000	1,117.00	56,967,000
ペッパーフードサービス	7,500	2,860.00	21,450,000
Monotaro	59,800	2,474.00	147,945,200
東京一番フーズ	2,500	624.00	1,560,000
D Dホールディングス	2,100	2,166.00	4,548,600
きちりホールディングス	2,600	735.00	1,911,000
アークランドサービスホールディングス	6,900	2,051.00	14,151,900
J . フロント リテイリング	121,000	1,228.00	148,588,000
ドトール・日レスホールディングス	16,600	2,193.00	36,403,800
マツモトキヨシホールディングス	39,100	3,900.00	152,490,000
ブロンコビリー	5,000	2,683.00	13,415,000
Z O Z O	102,200	1,814.00	185,390,800
トレジャー・ファクトリー	2,900	747.00	2,166,300
物語コーポレーション	2,300	9,840.00	22,632,000
ココカラファイン	10,600	4,935.00	52,311,000
三越伊勢丹ホールディングス	176,900	1,101.00	194,766,900
H a m e e	3,000	826.00	2,478,000
ウエルシアホールディングス	25,000	4,100.00	102,500,000
クリエイトSDホールディングス	14,000	2,875.00	40,250,000
丸善C H I ホールディングス	11,100	338.00	3,751,800
ティーライフ	1,300	1,036.00	1,346,800
エー・ピーカンパニー	1,900	499.00	948,100
チムニー	2,900	2,681.00	7,774,900

シュッピン	6,600	773.00	5,101,800
ネクステージ	14,700	981.00	14,420,700
ジョイフル本田	27,700	1,447.00	40,081,900
鳥貴族	3,200	1,809.00	5,788,800
キリン堂ホールディングス	3,800	1,566.00	5,950,800
ホットランド	5,000	1,367.00	6,835,000
すかいらーくホールディングス	88,100	1,728.00	152,236,800
綿半ホールディングス	3,600	2,293.00	8,254,800
ヨシックス	1,600	3,160.00	5,056,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	27,500	1,186.00	32,615,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	614.00	2,394,600
B E E N O S	2,300	1,191.00	2,739,300
あさひ	7,900	1,481.00	11,699,900
日本調剤	3,400	3,940.00	13,396,000
コスモス薬品	4,200	20,750.00	87,150,000
トーエル	4,700	720.00	3,384,000
オンリー	1,700	979.00	1,664,300
セブン&アイ・ホールディングス	396,300	4,989.00	1,977,140,700
薬王堂	4,100	2,610.00	10,701,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	25,500	1,283.00	32,716,500
ツルハホールディングス	20,500	9,930.00	203,565,000
サンマルクホールディングス	7,500	2,604.00	19,530,000
フェリシモ	2,200	1,133.00	2,492,600
トリドールホールディングス	11,700	2,304.00	26,956,800
T O K Y O B A S E	8,600	885.00	7,611,000
ウイルプラスホールディングス	1,200	743.00	891,600
ジャパンミート	3,600	1,777.00	6,397,200
サツドラホールディングス	1,400	1,883.00	2,636,200
デファクトスタンダード	700	393.00	275,100
ダイユー・リックホールディングス	5,200	1,013.00	5,267,600
パロックジャパンリミテッド	7,800	918.00	7,160,400
クスリのアオキホールディングス	9,400	7,740.00	72,756,000
力の源ホールディングス	2,700	789.00	2,130,300
スシローグローバルホールディングス	10,400	7,090.00	73,736,000
L I X I L ビバ	8,100	1,466.00	11,874,600
メディカルシステムネットワーク	10,300	441.00	4,542,300
はるやまホールディングス	4,500	858.00	3,861,000
ノジマ	16,800	2,019.00	33,919,200
カップ・クリエイト	13,400	1,415.00	18,961,000
ライトオン	8,100	820.00	6,642,000
良品計画	13,400	26,800.00	359,120,000

三城ホールディングス	11,900	399.00	4,748,100
アドヴァン	14,600	1,009.00	14,731,400
アルビス	3,600	2,365.00	8,514,000
コナカ	12,300	438.00	5,387,400
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,825.00	2,190,000
G - 7ホールディングス	2,800	2,248.00	6,294,400
イオン北海道	9,600	788.00	7,564,800
コジマ	14,200	658.00	9,343,600
ヒマラヤ	3,000	998.00	2,994,000
コーナン商事	12,400	2,828.00	35,067,200
エコス	3,500	1,700.00	5,950,000
ワタミ	12,600	1,651.00	20,802,600
マルシェ	2,600	771.00	2,004,600
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	56,600	6,730.00	380,918,000
西松屋チェーン	21,000	912.00	19,152,000
ゼンショーホールディングス	44,600	2,519.00	112,347,400
幸楽苑ホールディングス	6,000	2,320.00	13,920,000
ハークスレイ	2,000	1,140.00	2,280,000
サイゼリヤ	15,600	2,044.00	31,886,400
V Tホールディングス	32,500	418.00	13,585,000
魚力	2,700	1,467.00	3,960,900
ポプラ	2,500	574.00	1,435,000
フジ・コーポレーション	1,900	2,124.00	4,035,600
ユナイテッドアローズ	10,800	3,540.00	38,232,000
ハイデイ日高	12,400	2,315.00	28,706,000
京都きもの友禅	6,200	443.00	2,746,600
コロナイド	31,400	2,372.00	74,480,800
ピーシーデポコーポレーション	12,800	451.00	5,772,800
壱番屋	6,700	4,810.00	32,227,000
P L A N T	2,200	1,008.00	2,217,600
スギホールディングス	20,800	4,765.00	99,112,000
ヴィア・ホールディングス	11,700	667.00	7,803,900
スクロール	14,800	401.00	5,934,800
ヨンドシーホールディングス	10,500	2,182.00	22,911,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	26,400	12,690.00	335,016,000
木曽路	11,600	2,563.00	29,730,800
S R Sホールディングス	11,300	1,019.00	11,514,700
タカキュー	7,700	188.00	1,447,600
ケーヨー	17,700	546.00	9,664,200
上新電機	11,200	2,367.00	26,510,400
日本瓦斯	15,400	4,035.00	62,139,000
ロイヤルホールディングス	16,500	2,687.00	44,335,500

いなげや	10,700	1,345.00	14,391,500
鳥忠	21,400	2,987.00	63,921,800
チヨダ	10,000	1,897.00	18,970,000
ライフコーポレーション	7,200	2,453.00	17,661,600
リンガーハット	11,700	2,383.00	27,881,100
MrMaxHD	13,200	511.00	6,745,200
テンアライド	8,800	417.00	3,669,600
AOKIホールディングス	19,100	1,266.00	24,180,600
オークワ	13,500	1,158.00	15,633,000
コメリ	14,600	2,789.00	40,719,400
青山商事	16,500	2,751.00	45,391,500
しまむら	11,000	9,220.00	101,420,000
はせがわ	5,200	394.00	2,048,800
高島屋	74,200	1,473.00	109,296,600
松屋	19,100	1,065.00	20,341,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	48,500	1,546.00	74,981,000
近鉄百貨店	3,600	3,425.00	12,330,000
パルコ	9,200	1,148.00	10,561,600
丸井グループ	80,000	2,017.00	161,360,000
アクシアル リテイリング	7,900	3,530.00	27,887,000
イオン	363,800	2,399.00	872,756,200
イズミ	19,200	5,270.00	101,184,000
平和堂	19,200	2,495.00	47,904,000
フジ	11,400	1,896.00	21,614,400
ヤオコー	10,700	5,910.00	63,237,000
ゼビオホールディングス	11,600	1,301.00	15,091,600
ケーズホールディングス	98,300	991.00	97,415,300
Olympicグループ	5,700	752.00	4,286,400
日産東京販売ホールディングス	14,200	328.00	4,657,600
Genky DrugStores	4,600	2,641.00	12,148,600
総合メディカルホールディングス	8,300	1,932.00	16,035,600
ブックオフグループホールディングス	4,900	801.00	3,924,900
アインホールディングス	12,700	7,450.00	94,615,000
元気寿司	2,700	3,965.00	10,705,500
ヤマダ電機	288,100	532.00	153,269,200
アークランドサカモト	16,200	1,439.00	23,311,800
ニトリホールディングス	40,900	14,170.00	579,553,000
グルメ杵屋	6,900	1,174.00	8,100,600
愛眼	7,600	317.00	2,409,200
ケーユーホールディングス	5,100	844.00	4,304,400
吉野家ホールディングス	33,000	1,848.00	60,984,000
松屋フーズホールディングス	4,600	3,680.00	16,928,000

サガミホールディングス	12,800	1,373.00	17,574,400
関西スーパーマーケット	7,300	1,005.00	7,336,500
王将フードサービス	6,900	7,400.00	51,060,000
プレナス	10,700	1,816.00	19,431,200
ミニストップ	7,000	1,933.00	13,531,000
アークス	17,800	2,596.00	46,208,800
パローホールディングス	20,400	2,734.00	55,773,600
ベルク	4,700	5,110.00	24,017,000
大庄	5,100	1,541.00	7,859,100
ファーストリテイリング	12,600	51,090.00	643,734,000
サンドラッグ	35,600	3,470.00	123,532,000
サクスパー ホールディングス	8,100	1,110.00	8,991,000
ヤマザワ	2,000	1,782.00	3,564,000
やまや	1,600	2,373.00	3,796,800
ベルーナ	23,200	904.00	20,972,800
島根銀行	3,000	714.00	2,142,000
じもとホールディングス	64,600	125.00	8,075,000
めぶきフィナンシャルグループ	494,600	303.00	149,863,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,400	1,584.00	21,225,600
九州フィナンシャルグループ	157,100	463.00	72,737,300
ゆうちょ銀行	268,900	1,259.00	338,545,100
富山第一銀行	24,600	389.00	9,569,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	604,800	456.00	275,788,800
西日本フィナンシャルホールディングス	61,500	989.00	60,823,500
関西みらいフィナンシャルグループ	45,400	832.00	37,772,800
三十三フィナンシャルグループ	8,700	1,592.00	13,850,400
第四北越フィナンシャルグループ	16,700	3,715.00	62,040,500
新生銀行	69,500	1,526.00	106,057,000
あおぞら銀行	52,900	3,250.00	171,925,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,593,400	587.40	3,872,963,160
りそなホールディングス	1,038,900	512.00	531,916,800
三井住友トラスト・ホールディングス	186,100	4,219.00	785,155,900
三井住友フィナンシャルグループ	667,300	4,033.00	2,691,220,900
千葉銀行	336,500	679.00	228,483,500
群馬銀行	191,100	481.00	91,919,100
武蔵野銀行	14,400	2,374.00	34,185,600
千葉興業銀行	28,200	333.00	9,390,600
筑波銀行	39,700	210.00	8,337,000
七十七銀行	30,100	1,832.00	55,143,200
青森銀行	7,600	2,873.00	21,834,800
秋田銀行	6,400	2,191.00	14,022,400
山形銀行	11,100	1,946.00	21,600,600

岩手銀行	6,900	3,285.00	22,666,500
東邦銀行	84,700	312.00	26,426,400
東北銀行	4,900	1,093.00	5,355,700
みちのく銀行	6,100	1,615.00	9,851,500
ふくおかフィナンシャルグループ	77,200	2,460.00	189,912,000
静岡銀行	239,200	883.00	211,213,600
十六銀行	13,100	2,324.00	30,444,400
八十二銀行	173,100	476.00	82,395,600
山梨中央銀行	12,300	1,407.00	17,306,100
大垣共立銀行	15,300	2,277.00	34,838,100
福井銀行	8,600	1,597.00	13,734,200
北國銀行	10,300	3,435.00	35,380,500
清水銀行	4,400	1,772.00	7,796,800
富山銀行	2,100	3,140.00	6,594,000
滋賀銀行	19,300	2,619.00	50,546,700
南都銀行	11,400	2,245.00	25,593,000
百五銀行	87,700	387.00	33,939,900
京都銀行	34,100	4,665.00	159,076,500
紀陽銀行	34,000	1,565.00	53,210,000
ほくほくフィナンシャルグループ	63,700	1,248.00	79,497,600
広島銀行	141,000	643.00	90,663,000
山陰合同銀行	57,100	822.00	46,936,200
中国銀行	61,900	1,069.00	66,171,100
鳥取銀行	3,800	1,393.00	5,293,400
伊予銀行	126,700	619.00	78,427,300
百十四銀行	10,400	2,451.00	25,490,400
四国銀行	14,300	1,031.00	14,743,300
阿波銀行	15,400	3,015.00	46,431,000
大分銀行	6,000	3,360.00	20,160,000
宮崎銀行	6,600	2,681.00	17,694,600
佐賀銀行	6,200	1,820.00	11,284,000
十八銀行	6,100	2,727.00	16,634,700
沖縄銀行	8,900	3,390.00	30,171,000
琉球銀行	22,500	1,174.00	26,415,000
セブン銀行	322,200	332.00	106,970,400
みずほフィナンシャルグループ	12,864,600	175.50	2,257,737,300
高知銀行	3,500	728.00	2,548,000
山口フィナンシャルグループ	118,900	1,059.00	125,915,100
長野銀行	3,600	1,561.00	5,619,600
名古屋銀行	7,900	3,500.00	27,650,000
北洋銀行	145,300	307.00	44,607,100
愛知銀行	3,600	3,470.00	12,492,000

中京銀行	4,200	2,177.00	9,143,400
大光銀行	3,700	1,706.00	6,312,200
愛媛銀行	14,000	1,098.00	15,372,000
トマト銀行	4,300	1,059.00	4,553,700
京葉銀行	43,200	715.00	30,888,000
栃木銀行	52,400	241.00	12,628,400
北日本銀行	3,300	2,117.00	6,986,100
東和銀行	16,800	710.00	11,928,000
福島銀行	8,000	389.00	3,112,000
大東銀行	4,600	629.00	2,893,400
トモニホールディングス	75,600	410.00	30,996,000
フィデアホールディングス	92,800	132.00	12,249,600
池田泉州ホールディングス	103,700	299.00	31,006,300
F P G	29,800	1,035.00	30,843,000
マーキュリアインベストメント	3,800	685.00	2,603,000
S B Iホールディングス	112,800	2,335.00	263,388,000
ジャフコ	15,500	3,860.00	59,830,000
大和証券グループ本社	759,900	583.40	443,325,660
野村ホールディングス	1,666,100	445.50	742,247,550
岡三証券グループ	80,900	491.00	39,721,900
丸三証券	28,500	818.00	23,313,000
東洋証券	34,800	163.00	5,672,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	113,100	495.00	55,984,500
光世証券	2,400	762.00	1,828,800
水戸証券	28,100	263.00	7,390,300
いちよし証券	20,200	867.00	17,513,400
松井証券	46,400	1,201.00	55,726,400
だいこう証券ビジネス	4,100	433.00	1,775,300
マネックスグループ	88,700	433.00	38,407,100
カブドットコム証券	72,600	561.00	40,728,600
極東証券	12,900	1,180.00	15,222,000
岩井コスモホールディングス	9,900	1,289.00	12,761,100
藍澤証券	18,100	703.00	12,724,300
マネーパートナーズグループ	11,600	295.00	3,422,000
かんぽ生命保険	35,800	2,478.00	88,712,400
S O M P Oホールディングス	166,900	4,176.00	696,974,400
アニコム ホールディングス	7,700	3,035.00	23,369,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	247,500	3,368.00	833,580,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	77,800	2,122.00	165,091,600
第一生命ホールディングス	535,600	1,707.50	914,537,000
東京海上ホールディングス	343,200	5,571.00	1,911,967,200
T & Dホールディングス	292,800	1,375.50	402,746,400

アドバンスクリエイト	2,200	1,720.00	3,784,000	
全国保証	26,700	4,035.00	107,734,500	
ジェイリース	2,000	390.00	780,000	
イントラスト	2,700	425.00	1,147,500	
日本モーゲージサービス	1,300	1,299.00	1,688,700	
C a s a	3,200	1,070.00	3,424,000	
アルヒ	8,600	2,421.00	20,820,600	
プレミアグループ	1,900	3,310.00	6,289,000	
クレディセゾン	66,300	1,611.00	106,809,300	
芙蓉総合リース	10,800	5,650.00	61,020,000	
興銀リース	17,800	2,722.00	48,451,600	
東京センチュリー	19,100	5,040.00	96,264,000	
日本証券金融	41,700	623.00	25,979,100	
アイフル	144,400	306.00	44,186,400	
リコーリース	7,400	3,470.00	25,678,000	
イオンフィナンシャルサービス	60,500	2,198.00	132,979,000	
アコム	190,300	384.00	73,075,200	
ジャックス	10,500	1,910.00	20,055,000	
オリエントコーポレーション	256,100	118.00	30,219,800	
日立キャピタル	22,300	2,592.00	57,801,600	
アプラスフィナンシャル	45,800	87.00	3,984,600	
オリックス	631,600	1,620.00	1,023,192,000	
三菱UFJリース	213,600	565.00	120,684,000	
九州リースサービス	4,700	705.00	3,313,500	
日本取引所グループ	255,700	1,965.00	502,450,500	
イー・ギャランティ	8,900	1,052.00	9,362,800	
アサックス	4,000	548.00	2,192,000	
NECキャピタルソリューション	3,900	1,650.00	6,435,000	
いちご	121,800	388.00	47,258,400	
日本駐車場開発	116,100	155.00	17,995,500	
ヒューリック	198,100	1,025.00	203,052,500	
三栄建築設計	3,900	1,645.00	6,415,500	
スター・マイカ	4,500	1,378.00	6,201,000	
野村不動産ホールディングス	63,300	2,076.00	131,410,800	
三重交通グループホールディングス	19,600	614.00	12,034,400	
サムティ	13,300	1,515.00	20,149,500	
ディア・ライフ	12,500	435.00	5,437,500	
コーセーアールイー	3,000	763.00	2,289,000	
エー・ディー・ワークス	123,300	35.00	4,315,500	
日本商業開発	6,000	1,538.00	9,228,000	
プレサンスコーポレーション	15,200	1,418.00	21,553,600	
ユニゾホールディングス	14,500	2,147.00	31,131,500	

THE グローバル社	5,100	502.00	2,560,200
日本管理センター	6,400	766.00	4,902,400
サンセイランディック	2,700	754.00	2,035,800
エストラスト	1,300	790.00	1,027,000
フージャースホールディングス	20,700	687.00	14,220,900
オープンハウス	15,600	3,945.00	61,542,000
東急不動産ホールディングス	255,500	616.00	157,388,000
飯田グループホールディングス	79,200	2,036.00	161,251,200
イーランド	1,500	693.00	1,039,500
ムゲンエステート	6,800	624.00	4,243,200
ファーストブラザーズ	2,700	1,128.00	3,045,600
ハウズドゥ	5,300	1,530.00	8,109,000
シーアールイー	3,300	930.00	3,069,000
ケイアイスター不動産	2,600	1,732.00	4,503,200
グッドコムアセット	1,700	1,479.00	2,514,300
ジェイ・エス・ビー	400	4,155.00	1,662,000
テンポイノベーション	900	1,750.00	1,575,000
パーク24	55,500	2,671.00	148,240,500
パラカ	2,500	1,902.00	4,755,000
三井不動産	502,500	2,682.50	1,347,956,250
三菱地所	663,600	1,909.00	1,266,812,400
平和不動産	18,100	2,068.00	37,430,800
東京建物	103,900	1,288.00	133,823,200
ダイビル	28,200	1,093.00	30,822,600
京阪神ビルディング	17,200	912.00	15,686,400
住友不動産	212,900	4,254.00	905,676,600
テーオーシー	22,000	787.00	17,314,000
東京楽天地	1,400	4,645.00	6,503,000
スターツコーポレーション	13,000	2,435.00	31,655,000
フジ住宅	12,300	870.00	10,701,000
空港施設	11,400	542.00	6,178,800
明和地所	5,500	611.00	3,360,500
ゴールドクレスト	7,600	1,616.00	12,281,600
日本エスリード	3,800	1,626.00	6,178,800
日神不動産	14,400	464.00	6,681,600
日本エスコン	17,400	758.00	13,189,200
タカラレーベン	45,100	352.00	15,875,200
サンヨーハウジング名古屋	5,500	940.00	5,170,000
イオンモール	47,700	1,862.00	88,817,400
毎日コムネット	2,200	771.00	1,696,200
ファースト住建	3,700	1,232.00	4,558,400
カチタス	10,700	3,670.00	39,269,000

トーセイ	13,300	1,055.00	14,031,500
穴吹興産	1,100	2,860.00	3,146,000
サンフロンティア不動産	13,300	1,268.00	16,864,400
エフ・ジェー・ネクスト	8,500	875.00	7,437,500
インテリックス	2,900	685.00	1,986,500
ランドビジネス	4,800	804.00	3,859,200
グランディハウス	8,600	442.00	3,801,200
日本空港ビルデング	30,300	4,335.00	131,350,500
日本工営	6,200	2,523.00	15,642,600
L I F U L L	35,700	643.00	22,955,100
ジェイエイシーリクルートメント	7,400	2,434.00	18,011,600
日本M&Aセンター	68,400	2,895.00	198,018,000
メンバーズ	3,200	1,546.00	4,947,200
中広	1,200	581.00	697,200
タケエイ	9,800	818.00	8,016,400
E・Jホールディングス	1,300	1,080.00	1,404,000
トラスト・テック	5,100	3,550.00	18,105,000
コシダカホールディングス	24,600	1,649.00	40,565,400
アルトナー	1,800	919.00	1,654,200
パソナグループ	11,400	1,468.00	16,735,200
C D S	2,400	1,273.00	3,055,200
リンクアンドモチベーション	17,100	912.00	15,595,200
G C A	9,500	895.00	8,502,500
エス・エム・エス	33,800	1,960.00	66,248,000
サニーサイドアップ	1,100	1,600.00	1,760,000
パーソルホールディングス	91,800	1,925.00	176,715,000
リニカル	5,300	1,710.00	9,063,000
クックパッド	29,400	293.00	8,614,200
エスクリ	2,700	629.00	1,698,300
アイ・ケイ・ケイ	4,700	740.00	3,478,000
学情	3,800	1,304.00	4,955,200
スタジオアリス	4,700	2,323.00	10,918,100
シミックホールディングス	5,200	1,615.00	8,398,000
N J S	2,100	1,486.00	3,120,600
総合警備保障	36,500	4,825.00	176,112,500
カカクコム	69,100	2,141.00	147,943,100
アイロムグループ	3,500	1,502.00	5,257,000
セントケア・ホールディング	5,300	574.00	3,042,200
サイネックス	1,700	692.00	1,176,400
ルネサンス	5,200	2,009.00	10,446,800
ディップ	14,800	2,038.00	30,162,400
オプトホールディング	5,700	1,678.00	9,564,600

ツクイ	21,900	738.00	16,162,200
キャリアデザインセンター	2,400	1,210.00	2,904,000
ベネフィット・ワン	12,700	4,225.00	53,657,500
エムスリー	193,200	1,729.00	334,042,800
ツカダ・グローバルホールディング	6,100	619.00	3,775,900
プラス	900	585.00	526,500
アウトソーシング	48,400	1,360.00	65,824,000
ウェルネット	8,900	1,092.00	9,718,800
ワールドホールディングス	2,600	2,123.00	5,519,800
ディー・エヌ・エー	49,500	1,704.00	84,348,000
博報堂D Yホールディングス	127,600	1,788.00	228,148,800
ぐるなび	13,300	720.00	9,576,000
エスアールジータカミヤ	9,700	673.00	6,528,100
ジャパンベストレスキューシステム	7,300	1,284.00	9,373,200
ファンコミュニケーションズ	25,700	529.00	13,595,300
ライク	3,700	973.00	3,600,100
ビジネス・ブレークスルー	4,200	381.00	1,600,200
WDBホールディングス	4,200	2,817.00	11,831,400
ティア	4,900	669.00	3,278,100
C D G	900	1,273.00	1,145,700
バリューコマース	6,200	2,190.00	13,578,000
インフォマート	50,300	1,272.00	63,981,600
J Pホールディングス	26,800	283.00	7,584,400
エコナックホールディングス	17,700	122.00	2,159,400
E P Sホールディングス	14,000	1,815.00	25,410,000
レッグス	2,400	943.00	2,263,200
プレステージ・インターナショナル	17,200	1,314.00	22,600,800
アミューズ	5,600	2,556.00	14,313,600
ドリームインキュベータ	2,900	1,500.00	4,350,000
クイック	5,800	1,560.00	9,048,000
T A C	5,500	235.00	1,292,500
ケネディクス	80,700	535.00	43,174,500
電通	111,800	4,970.00	555,646,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,600	1,738.00	6,256,800
ぴあ	2,600	4,060.00	10,556,000
イオンファンタジー	3,000	2,802.00	8,406,000
シーティーエス	10,600	708.00	7,504,800
ネクシィーズグループ	2,900	1,731.00	5,019,900
みらかホールディングス	25,700	3,040.00	78,128,000
アルプス技研	8,100	1,964.00	15,908,400
ダイオーズ	2,200	1,379.00	3,033,800
日本空調サービス	10,700	677.00	7,243,900

オリエンタルランド	108,400	12,325.00	1,336,030,000
ダスキン	24,700	2,756.00	68,073,200
明光ネットワークジャパン	11,800	937.00	11,056,600
ファルコホールディングス	5,200	1,445.00	7,514,000
ラウンドワン	28,500	1,412.00	40,242,000
リゾートトラスト	38,900	1,583.00	61,578,700
ビー・エム・エル	11,800	3,365.00	39,707,000
ワタベウェディング	1,600	686.00	1,097,600
りらいあコミュニケーションズ	16,800	996.00	16,732,800
リソー教育	46,800	482.00	22,557,600
早稲田アカデミー	1,400	1,717.00	2,403,800
ユー・エス・エス	112,100	2,011.00	225,433,100
東京個別指導学院	3,400	1,204.00	4,093,600
サイバーエージェント	56,500	3,395.00	191,817,500
楽天	427,700	838.00	358,412,600
クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,162.00	6,391,000
テー・オー・ダブリュー	8,300	790.00	6,557,000
セントラルスポーツ	3,400	3,465.00	11,781,000
フルキャストホールディングス	9,200	2,208.00	20,313,600
エン・ジャパン	10,000	3,845.00	38,450,000
リソルホールディングス	1,000	4,345.00	4,345,000
テクノプロ・ホールディングス	18,400	5,980.00	110,032,000
アトラ	2,100	397.00	833,700
インターワークス	1,900	733.00	1,392,700
アイ・アールジャパンホールディングス	2,900	1,436.00	4,164,400
K e e P e r 技研	3,500	1,118.00	3,913,000
ファーストロジック	2,000	692.00	1,384,000
三機サービス	2,000	1,481.00	2,962,000
G u n o s y	6,400	2,633.00	16,851,200
デザインワン・ジャパン	2,200	338.00	743,600
イー・ガーディアン	4,400	2,103.00	9,253,200
リブセンス	5,500	279.00	1,534,500
ジャパンマテリアル	25,100	1,466.00	36,796,600
ベクトル	11,300	1,483.00	16,757,900
ウチヤマホールディングス	4,800	442.00	2,121,600
チャーム・ケア・コーポレーション	2,300	1,679.00	3,861,700
ライクキッズネクスト	2,300	896.00	2,060,800
キャリアリンク	3,700	395.00	1,461,500
I B J	6,300	891.00	5,613,300
アサンテ	3,700	2,248.00	8,317,600
N・フィールド	6,100	927.00	5,654,700
バリューHR	2,000	2,287.00	4,574,000

M & Aキャピタルパートナーズ	2,300	5,330.00	12,259,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,196.00	4,664,400
E R Iホールディングス	2,700	809.00	2,184,300
アビスト	1,500	3,265.00	4,897,500
シグマクシス	4,500	930.00	4,185,000
ウィルグループ	6,100	1,198.00	7,307,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,200	262.00	3,458,400
日本ビューホテル	3,000	1,137.00	3,411,000
リクルートホールディングス	657,100	3,018.00	1,983,127,800
エラン	6,500	1,578.00	10,257,000
土木管理総合試験所	4,200	529.00	2,221,800
日本郵政	751,900	1,345.00	1,011,305,500
ベルシステム24ホールディングス	15,400	1,501.00	23,115,400
鎌倉新書	6,800	1,890.00	12,852,000
一蔵	1,200	621.00	745,200
L I T A L I C O	2,100	1,997.00	4,193,700
グローバルグループ	1,200	874.00	1,048,800
エボラブルアジア	2,700	2,666.00	7,198,200
アトラエ	1,800	3,045.00	5,481,000
ストライク	2,400	2,104.00	5,049,600
ソラスト	22,400	1,164.00	26,073,600
セラク	2,200	601.00	1,322,200
インソース	3,100	2,366.00	7,334,600
ベिकाレント・コンサルティング	4,900	3,295.00	16,145,500
Orchestra Holdings	1,300	877.00	1,140,100
アイモバイル	2,300	879.00	2,021,700
キャリアインデックス	3,200	934.00	2,988,800
MS - J a p a n	3,800	1,746.00	6,634,800
船場	1,600	952.00	1,523,200
グレイステクノロジー	2,500	2,285.00	5,712,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,500	2,091.00	11,500,500
フルテック	1,100	1,129.00	1,241,900
グリーンズ	2,700	1,440.00	3,888,000
ツナグ・ソリューションズ	1,000	624.00	624,000
日総工産	2,300	2,565.00	5,899,500
キュービーネットホールディングス	4,200	2,063.00	8,664,600
スプリックス	2,600	2,755.00	7,163,000
アドバンテッジリスクマネジメント	3,700	946.00	3,500,200
リログループ	50,200	3,000.00	150,600,000
東祥	5,700	3,525.00	20,092,500
エイチ・アイ・エス	16,400	4,275.00	70,110,000
ラックランド	1,900	1,939.00	3,684,100

共立メンテナンス	14,000	5,290.00	74,060,000	
イチネンホールディングス	9,700	1,331.00	12,910,700	
建設技術研究所	6,500	1,503.00	9,769,500	
スペース	6,100	1,352.00	8,247,200	
長大	3,800	806.00	3,062,800	
燦ホールディングス	2,000	2,508.00	5,016,000	
スバル興業	700	5,910.00	4,137,000	
東京テアトル	3,700	1,297.00	4,798,900	
タナベ経営	1,900	1,233.00	2,342,700	
ナガワ	2,600	5,650.00	14,690,000	
よみうりランド	2,000	4,170.00	8,340,000	
東京都競馬	6,000	3,585.00	21,510,000	
カナモト	13,800	2,917.00	40,254,600	
東京ドーム	34,400	1,000.00	34,400,000	
西尾レントオール	9,300	3,420.00	31,806,000	
トランス・コスモス	10,200	2,198.00	22,419,600	
乃村工藝社	21,500	3,250.00	69,875,000	
藤田観光	3,700	2,681.00	9,919,700	
KNT-CTホールディングス	4,900	1,323.00	6,482,700	
日本管財	9,900	1,917.00	18,978,300	
トーカイ	8,900	2,885.00	25,676,500	
白洋舎	1,100	2,890.00	3,179,000	
セコム	97,300	9,587.00	932,815,100	
セントラル警備保障	4,400	4,340.00	19,096,000	
丹青社	17,400	1,280.00	22,272,000	
メイテック	11,600	5,000.00	58,000,000	
応用地質	10,100	1,163.00	11,746,300	
船井総研ホールディングス	19,000	2,561.00	48,659,000	
進学会ホールディングス	4,400	557.00	2,450,800	
オオバ	7,500	619.00	4,642,500	
いであ	2,000	985.00	1,970,000	
学究社	3,100	1,344.00	4,166,400	
ベネッセホールディングス	33,600	3,140.00	105,504,000	
イオンディライト	11,300	4,145.00	46,838,500	
ナック	6,000	1,048.00	6,288,000	
ニチイ学館	13,100	1,249.00	16,361,900	
ダイセキ	15,400	2,657.00	40,917,800	
ステップ	3,500	1,423.00	4,980,500	
合 計	110,269,600		221,273,746,740	

(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。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2019年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	800,212,548
国債証券	251,745,625,550
地方債証券	16,611,393,129
特殊債証券	21,137,535,283
社債証券	12,822,811,000
派生商品評価勘定	249,676
未収入金	699,432,800
未収利息	821,976,147
前払費用	9,160,412
流動資産合計	304,648,396,545
資産合計	304,648,396,545
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,296
前受金	250,000
未払解約金	335,438,711
未払利息	1,916
その他未払費用	29
流動負債合計	335,691,952
負債合計	335,691,952
純資産の部	
元本等	
元本	220,886,925,182
剰余金	
剰余金又は欠損金()	83,425,779,411
元本等合計	304,312,704,593
純資産合計	304,312,704,593
負債純資産合計	304,648,396,545

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2019年 2月21日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <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>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)

2019年 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	220,886,925,182口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 101,737,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3777円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,777円)</p>

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2019年 2月21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>

2019年 2月21日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年 2月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 2月22日
期首元本額	230,447,888,966円
期中追加設定元本額	17,442,985,619円
期中一部解約元本額	27,003,949,403円
期末元本額	220,886,925,182円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	917,444,750円
D C 日本債券インデックスファンド	2,788,015,959円
D C 日本債券インデックスファンド L	36,569,441,586円
D C バランスファンド 3 0	7,710,520,319円
D C バランスファンド 5 0	5,035,728,525円
D C バランスファンド 7 0	1,223,207,931円
日本債券インデックス e	1,427,033,661円
インデックスコレクション（国内債券）	17,081,694,352円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	22,034,835,596円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,523,136,300円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	934,888,144円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	45,381,580,461円
日本債券パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	2,776,002,628円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	404,303,514円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	1,706,136,611円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	192,471,310円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	356,027,751円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	1,585,630,199円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	4,476,638,429円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	1,164,838,469円

区分	2019年 2月21日現在
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	12,965,970,924円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	147,313,444円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	532,730,626円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	3,295,878,467円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	237,442,128円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	398,026,805円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,489,199,399円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	421,229,279円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	948,386,104円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	198,501,791円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	3,111,490,766円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	4,138,886,520円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	248,202,110円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,837,467,720円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	31,131,283,191円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	558,660,707円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	189,705,037円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	43,307,721円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	699,124,180円
私募日本債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	4,541,768円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,434,112,550
地方債証券	21,302,574
特殊債券	37,597,805
社債券	27,102,000
合計	1,520,114,929

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本債券マザーファンド」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

（2019年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	債券先物取引		うち1年超	

	買建	764,250,000	-	764,500,000	250,000
	合計	764,250,000	-	764,500,000	250,000

(注)1. 時価の算定方法

債券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. 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. 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(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第386回利付国債(2年)	1,520,000,000	1,524,742,400	
	第387回利付国債(2年)	1,190,000,000	1,193,950,800	
	第388回利付国債(2年)	1,530,000,000	1,535,538,600	
	第389回利付国債(2年)	380,000,000	381,425,000	
	第390回利付国債(2年)	1,310,000,000	1,315,240,000	
	第391回利付国債(2年)	1,540,000,000	1,546,437,200	
	第392回利付国債(2年)	310,000,000	311,348,500	
	第394回利付国債(2年)	1,200,000,000	1,205,796,000	
	第395回利付国債(2年)	1,440,000,000	1,447,286,400	
	第396回利付国債(2年)	670,000,000	673,557,700	
	第123回利付国債(5年)	2,320,000,000	2,327,470,400	
	第124回利付国債(5年)	2,630,000,000	2,640,283,300	
	第125回利付国債(5年)	2,200,000,000	2,210,076,000	
	第126回利付国債(5年)	2,870,000,000	2,885,211,000	
	第127回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,671,608,000	
	第128回利付国債(5年)	2,330,000,000	2,345,471,200	
	第129回利付国債(5年)	1,980,000,000	1,994,592,600	
	第130回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,895,209,200	
	第131回利付国債(5年)	1,910,000,000	1,926,808,000	
	第132回利付国債(5年)	1,325,000,000	1,337,614,000	
	第133回利付国債(5年)	1,670,000,000	1,687,418,100	
	第134回利付国債(5年)	2,320,000,000	2,345,914,400	
	第135回利付国債(5年)	2,340,000,000	2,367,354,600	
	第136回利付国債(5年)	1,620,000,000	1,640,120,400	

第137回利付国債(5年)	2,020,000,000	2,046,563,000	
第138回利付国債(5年)	980,000,000	993,347,600	
第1回利付国債(40年)	230,000,000	343,532,600	
第2回利付国債(40年)	350,000,000	506,859,500	
第3回利付国債(40年)	410,000,000	598,247,400	
第4回利付国債(40年)	595,000,000	874,566,700	
第5回利付国債(40年)	415,000,000	589,146,450	
第6回利付国債(40年)	610,000,000	852,407,900	
第7回利付国債(40年)	570,000,000	764,962,800	
第8回利付国債(40年)	920,000,000	1,150,184,000	
第9回利付国債(40年)	830,000,000	765,724,800	
第10回利付国債(40年)	890,000,000	968,239,900	
第11回利付国債(40年)	510,000,000	536,341,500	
第306回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,393,454,400	
第307回利付国債(10年)	880,000,000	894,115,200	
第308回利付国債(10年)	970,000,000	989,167,200	
第309回利付国債(10年)	960,000,000	976,425,600	
第310回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,426,320,000	
第311回利付国債(10年)	670,000,000	680,478,800	
第312回利付国債(10年)	2,037,000,000	2,088,841,650	
第313回利付国債(10年)	910,000,000	938,091,700	
第314回利付国債(10年)	250,000,000	256,677,500	
第315回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,052,956,200	
第316回利付国債(10年)	360,000,000	370,792,800	
第317回利付国債(10年)	280,000,000	289,310,000	
第318回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,082,193,000	
第319回利付国債(10年)	560,000,000	580,428,800	
第320回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,312,722,800	
第321回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,596,364,000	
第322回利付国債(10年)	860,000,000	888,818,600	
第323回利付国債(10年)	690,000,000	715,033,200	
第324回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,032,930,000	
第325回利付国債(10年)	2,205,000,000	2,283,167,250	
第326回利付国債(10年)	560,000,000	579,084,800	
第327回利付国債(10年)	1,010,000,000	1,048,319,400	
第328回利付国債(10年)	1,530,000,000	1,578,944,700	
第329回利付国債(10年)	2,035,000,000	2,121,894,500	
第330回利付国債(10年)	1,820,000,000	1,902,282,200	
第331回利付国債(10年)	970,000,000	1,004,900,600	
第332回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,626,038,800	
第333回利付国債(10年)	2,660,000,000	2,766,187,200	
第334回利付国債(10年)	2,660,000,000	2,771,507,200	

第335回利付国債（10年）	2,465,000,000	2,559,384,850	
第336回利付国債（10年）	270,000,000	280,805,400	
第337回利付国債（10年）	2,350,000,000	2,416,387,500	
第338回利付国債（10年）	2,680,000,000	2,774,550,400	
第339回利付国債（10年）	2,795,000,000	2,897,744,200	
第340回利付国債（10年）	2,570,000,000	2,668,276,800	
第341回利付国債（10年）	1,650,000,000	1,704,120,000	
第342回利付国債（10年）	1,590,000,000	1,621,291,200	
第343回利付国債（10年）	2,255,000,000	2,300,145,100	
第344回利付国債（10年）	1,770,000,000	1,805,966,400	
第345回利付国債（10年）	2,100,000,000	2,142,399,000	
第346回利付国債（10年）	2,255,000,000	2,300,100,000	
第347回利付国債（10年）	2,515,000,000	2,564,746,700	
第348回利付国債（10年）	2,600,000,000	2,649,556,000	
第349回利付国債（10年）	2,605,000,000	2,652,541,250	
第350回利付国債（10年）	2,420,000,000	2,462,035,400	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	2,130,000,000	2,164,995,900	
第352回利付国債（10年）	2,310,000,000	2,345,574,000	
第353回利付国債（10年）	830,000,000	841,869,000	
第1回利付国債（30年）	50,000,000	64,737,000	
第2回利付国債（30年）	100,000,000	126,248,000	
第3回利付国債（30年）	140,000,000	175,791,000	
第4回利付国債（30年）	190,000,000	253,509,400	
第5回利付国債（30年）	180,000,000	226,798,200	
第6回利付国債（30年）	270,000,000	348,791,400	
第7回利付国債（30年）	190,000,000	244,452,100	
第9回利付国債（30年）	180,000,000	211,044,600	
第10回利付国債（30年）	170,000,000	192,387,300	
第11回利付国債（30年）	280,000,000	340,855,200	
第12回利付国債（30年）	370,000,000	472,571,400	
第13回利付国債（30年）	350,000,000	442,935,500	
第14回利付国債（30年）	350,000,000	464,348,500	
第15回利付国債（30年）	500,000,000	672,475,000	
第16回利付国債（30年）	250,000,000	337,105,000	
第17回利付国債（30年）	420,000,000	561,300,600	
第18回利付国債（30年）	340,000,000	450,122,600	
第19回利付国債（30年）	300,000,000	398,010,000	
第20回利付国債（30年）	290,000,000	394,791,500	
第21回利付国債（30年）	360,000,000	479,538,000	
第22回利付国債（30年）	380,000,000	519,558,800	
第23回利付国債（30年）	370,000,000	506,966,600	
第24回利付国債（30年）	335,000,000	460,346,950	

第25回利付国債(30年)	335,000,000	449,503,000	
第26回利付国債(30年)	610,000,000	831,009,100	
第27回利付国債(30年)	490,000,000	679,071,400	
第28回利付国債(30年)	900,000,000	1,252,647,000	
第29回利付国債(30年)	620,000,000	854,409,600	
第30回利付国債(30年)	945,000,000	1,289,367,450	
第31回利付国債(30年)	600,000,000	809,934,000	
第32回利付国債(30年)	695,000,000	955,326,150	
第33回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,424,617,200	
第34回利付国債(30年)	920,000,000	1,255,846,000	
第35回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,393,518,000	
第36回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,332,320,000	
第37回利付国債(30年)	1,255,000,000	1,649,885,750	
第38回利付国債(30年)	865,000,000	1,121,048,650	
第39回利付国債(30年)	700,000,000	924,546,000	
第40回利付国債(30年)	335,000,000	435,553,600	
第41回利付国債(30年)	635,000,000	812,241,200	
第42回利付国債(30年)	600,000,000	768,966,000	
第43回利付国債(30年)	625,000,000	801,687,500	
第44回利付国債(30年)	730,000,000	938,210,600	
第45回利付国債(30年)	600,000,000	743,172,000	
第46回利付国債(30年)	810,000,000	1,004,934,600	
第47回利付国債(30年)	795,000,000	1,006,613,100	
第48回利付国債(30年)	760,000,000	925,877,600	
第49回利付国債(30年)	840,000,000	1,023,649,200	
第50回利付国債(30年)	830,000,000	886,199,300	
第51回利付国債(30年)	895,000,000	841,845,950	
第52回利付国債(30年)	950,000,000	940,870,500	
第53回利付国債(30年)	450,000,000	457,083,000	
第54回利付国債(30年)	635,000,000	677,722,800	
第55回利付国債(30年)	840,000,000	895,851,600	
第56回利付国債(30年)	500,000,000	532,840,000	
第57回利付国債(30年)	750,000,000	798,637,500	
第58回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,127,829,400	
第59回利付国債(30年)	730,000,000	756,688,800	
第60回利付国債(30年)	910,000,000	992,273,100	
第61回利付国債(30年)	70,000,000	72,411,500	
第44回利付国債(20年)	370,000,000	380,704,100	
第45回利付国債(20年)	270,000,000	277,519,500	
第46回利付国債(20年)	290,000,000	299,230,700	
第47回利付国債(20年)	470,000,000	487,775,400	
第48回利付国債(20年)	230,000,000	241,343,600	
第49回利付国債(20年)	280,000,000	293,336,400	

第50回利付国債(20年)	590,000,000	615,641,400	
第51回利付国債(20年)	240,000,000	252,249,600	
第52回利付国債(20年)	430,000,000	455,451,700	
第53回利付国債(20年)	350,000,000	372,708,000	
第54回利付国債(20年)	280,000,000	298,961,600	
第55回利付国債(20年)	490,000,000	523,099,500	
第56回利付国債(20年)	410,000,000	439,954,600	
第57回利付国債(20年)	360,000,000	385,095,600	
第58回利付国債(20年)	250,000,000	268,760,000	
第59回利付国債(20年)	440,000,000	471,856,000	
第60回利付国債(20年)	570,000,000	604,678,800	
第61回利付国債(20年)	390,000,000	408,872,100	
第62回利付国債(20年)	250,000,000	260,675,000	
第63回利付国債(20年)	570,000,000	619,173,900	
第64回利付国債(20年)	410,000,000	449,237,000	
第65回利付国債(20年)	370,000,000	407,355,200	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	361,709,700	
第67回利付国債(20年)	310,000,000	342,912,700	
第68回利付国債(20年)	230,000,000	257,949,600	
第69回利付国債(20年)	530,000,000	591,692,000	
第70回利付国債(20年)	490,000,000	557,796,400	
第71回利付国債(20年)	400,000,000	451,044,000	
第72回利付国債(20年)	710,000,000	800,936,800	
第73回利付国債(20年)	540,000,000	609,114,600	
第74回利付国債(20年)	310,000,000	351,499,700	
第75回利付国債(20年)	360,000,000	410,130,000	
第76回利付国債(20年)	340,000,000	383,173,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	328,601,900	
第78回利付国債(20年)	20,000,000	22,646,200	
第79回利付国債(20年)	100,000,000	113,870,000	
第80回利付国債(20年)	250,000,000	286,272,500	
第81回利付国債(20年)	180,000,000	205,972,200	
第82回利付国債(20年)	485,000,000	558,205,900	
第83回利付国債(20年)	70,000,000	80,943,100	
第84回利付国債(20年)	190,000,000	218,391,700	
第85回利付国債(20年)	360,000,000	418,338,000	
第86回利付国債(20年)	240,000,000	282,326,400	
第87回利付国債(20年)	170,000,000	198,764,000	
第88回利付国債(20年)	340,000,000	401,975,200	
第89回利付国債(20年)	320,000,000	375,958,400	
第90回利付国債(20年)	420,000,000	495,814,200	
第91回利付国債(20年)	310,000,000	368,335,800	

第92回利付国債（20年）	790,000,000	930,359,300
第93回利付国債（20年）	260,000,000	305,294,600
第94回利付国債（20年）	445,000,000	526,154,650
第95回利付国債（20年）	400,000,000	481,584,000
第96回利付国債（20年）	200,000,000	237,428,000
第97回利付国債（20年）	210,000,000	252,102,900
第98回利付国債（20年）	370,000,000	440,977,100
第99回利付国債（20年）	460,000,000	550,100,200
第100回利付国債（20年）	760,000,000	918,748,800
第101回利付国債（20年）	360,000,000	441,781,200
第102回利付国債（20年）	370,000,000	455,762,300
第103回利付国債（20年）	335,000,000	409,507,350
第104回利付国債（20年）	260,000,000	312,946,400
第105回利付国債（20年）	500,000,000	604,010,000
第106回利付国債（20年）	270,000,000	328,765,500
第107回利付国債（20年）	270,000,000	327,150,900
第108回利付国債（20年）	725,000,000	864,149,250
第109回利付国債（20年）	290,000,000	346,712,400
第110回利付国債（20年）	515,000,000	626,126,700
第111回利付国債（20年）	450,000,000	553,626,000
第112回利付国債（20年）	550,000,000	670,961,500
第113回利付国債（20年）	1,055,000,000	1,290,655,350
第114回利付国債（20年）	610,000,000	748,659,100
第115回利付国債（20年）	270,000,000	334,297,800
第116回利付国債（20年）	260,000,000	322,969,400
第117回利付国債（20年）	580,000,000	714,055,400
第118回利付国債（20年）	640,000,000	783,161,600
第119回利付国債（20年）	320,000,000	384,348,800
第120回利付国債（20年）	380,000,000	447,830,000
第121回利付国債（20年）	750,000,000	911,250,000
第122回利付国債（20年）	400,000,000	481,392,000
第123回利付国債（20年）	730,000,000	906,448,300
第124回利付国債（20年）	320,000,000	393,580,800
第125回利付国債（20年）	260,000,000	326,877,200
第126回利付国債（20年）	320,000,000	394,633,600
第127回利付国債（20年）	400,000,000	488,496,000
第128回利付国債（20年）	560,000,000	685,624,800
第129回利付国債（20年）	290,000,000	351,511,900
第130回利付国債（20年）	780,000,000	947,029,200
第131回利付国債（20年）	360,000,000	432,608,400
第132回利付国債（20年）	600,000,000	722,472,000
第133回利付国債（20年）	690,000,000	839,585,100
第134回利付国債（20年）	260,000,000	317,028,400

第135回利付国債（20年）	495,000,000	597,187,800	
第136回利付国債（20年）	450,000,000	537,088,500	
第137回利付国債（20年）	460,000,000	556,038,800	
第138回利付国債（20年）	450,000,000	532,129,500	
第139回利付国債（20年）	330,000,000	394,561,200	
第140回利付国債（20年）	1,155,000,000	1,398,762,750	
第141回利付国債（20年）	730,000,000	885,643,300	
第142回利付国債（20年）	450,000,000	552,055,500	
第143回利付国債（20年）	1,110,000,000	1,333,631,700	
第144回利付国債（20年）	340,000,000	403,807,800	
第145回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,326,900,600	
第146回利付国債（20年）	1,150,000,000	1,402,241,000	
第147回利付国債（20年）	1,140,000,000	1,375,729,200	
第148回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,300,162,900	
第149回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,337,459,200	
第150回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,674,847,400	
第151回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,264,846,000	
第152回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,357,389,400	
第153回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,376,470,000	
第154回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,634,704,000	
第155回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,520,996,800	
第156回利付国債（20年）	1,130,000,000	1,150,215,700	
第157回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,307,017,600	
第158回利付国債（20年）	1,060,000,000	1,094,471,200	
第159回利付国債（20年）	1,340,000,000	1,404,440,600	
第160回利付国債（20年）	1,160,000,000	1,235,295,600	
第161回利付国債（20年）	985,000,000	1,030,053,900	
第162回利付国債（20年）	1,250,000,000	1,305,637,500	
第163回利付国債（20年）	955,000,000	996,284,650	
第164回利付国債（20年）	860,000,000	879,909,000	
第165回利付国債（20年）	770,000,000	786,632,000	
第166回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,693,280,000	
第167回利付国債（20年）	190,000,000	193,488,400	
国債証券合計	229,542,000,000	251,745,625,550	
地方債証券			
第1回東京都公募公債（東京グリーンbond（30年））	100,000,000	107,474,000	
第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,348,000	
第7回東京都公募公債（30年）	200,000,000	271,880,000	
第11回東京都公募公債（20年）	200,000,000	235,456,000	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,362,000	
第18回東京都公募公債（20年）	200,000,000	242,036,000	
第20回東京都公募公債（20年）	100,000,000	120,447,000	

第21回東京都公募公債（20年）	100,000,000	121,859,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	102,715,000	
第703回東京都公募公債	100,000,000	102,741,000	
第714回東京都公募公債	100,000,000	102,753,000	
第722回東京都公募公債	200,000,000	206,742,000	
第740回東京都公募公債	100,000,000	102,578,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	102,385,000	
平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	101,575,000	
平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,776,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	300,000,000	303,987,000	
第16回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	122,010,000	
第21回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	119,147,000	
第184回神奈川県公募公債	100,000,000	102,320,000	
第190回神奈川県公募公債	100,000,000	102,858,000	
第196回神奈川県公募公債	100,000,000	102,678,000	
第356回大阪府公募公債（10年）	130,000,000	133,807,700	
第363回大阪府公募公債（10年）	114,000,000	116,966,280	
第371回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	204,586,000	
第376回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,626,000	
第403回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	308,847,000	
第417回大阪府公募公債（10年）	108,000,000	109,838,160	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,366,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	105,860,000	106,531,152	
第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	110,647,000	
平成22年度第19回兵庫県公募公債	100,000,000	102,360,000	
平成25年度第14回兵庫県公募公債	100,000,000	103,437,000	
平成26年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	103,139,000	
平成28年度第30回兵庫県公募公債	100,000,000	101,448,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	103,948,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	102,950,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	102,672,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,682,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	102,329,000	
平成27年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,994,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	121,839,000	
平成23年度第4回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,728,000	
平成23年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,677,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,055,000	
平成25年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,071,000	

平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	204,982,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,600,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,831,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	121,310,000	
平成23年度第1回広島県公募公債	272,000,000	279,191,680	
平成24年度第2回広島県公募公債	100,000,000	102,804,000	
平成27年度第2回広島県公募公債	162,000,000	168,044,220	
平成29年度第7回広島県公募公債	131,440,000	133,101,401	
第9回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	103,752,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	102,842,000	
平成24年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	102,878,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,869,000	
平成27年度第8回埼玉県公募公債	200,000,000	205,400,000	
平成29年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	101,599,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	137,418,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	263,206,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	112,074,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	111,403,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	121,481,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	122,137,000	
平成26年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	102,705,000	
平成28年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,434,000	
平成29年度第5回千葉県公募公債	120,000,000	121,688,400	
平成27年度第3回新潟県公募公債	200,000,000	201,414,000	
平成24年度第1回岐阜県公募公債（10年）	139,630,000	143,647,155	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,535,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,650,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,615,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,691,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,875,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,581,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,615,000	
第103回共同発行市場公募地方債	177,400,000	182,047,880	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,978,000	
第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,490,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,802,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,929,000	

第117回共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,400,000	
第118回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,432,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,694,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,204,000	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,456,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,789,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,379,000	
第153回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,201,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,897,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,677,000	
第175回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,211,000	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,002,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	102,865,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,827,000	
第7回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	107,774,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	109,500,000	
第13回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	106,717,000	
第482回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,519,000	
第488回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,220,000	
第495回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,635,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	113,790,000	
平成27年度第5回京都市公募公債	200,000,000	202,590,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	121,187,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	113,583,000	
平成23年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	102,632,000	
平成25年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	103,370,000	
第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	118,831,000	
第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	119,981,000	
平成23年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,320,000	
平成24年度第7回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,610,000	
第88回川崎市公募公債	100,000,000	103,026,000	
平成29年度第12回福岡市公募公債	130,000,000	131,586,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,813,000	
平成23年度第5回広島市公募公債	151,900,000	156,425,101	
平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	103,033,000	
平成23年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	102,917,000	
平成27年度第1回三重県公募公債	100,000,000	103,033,000	
平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	102,865,000	
平成24年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	102,870,000	

	平成27年度第1回山梨県公募公債(10年)	100,000,000	103,172,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	103,068,000	
地方債証券合計		15,692,230,000	16,611,393,129	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	208,070,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	222,180,000	
	第69回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	300,552,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,181,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	154,567,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	175,489,500	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	586,975,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,944,000	
	第21回道路債券	100,000,000	133,643,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	297,516,000	
	第27回道路債券	100,000,000	112,108,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,337,000	
	第28回道路債券	300,000,000	406,563,000	
	第33回道路債券	100,000,000	137,426,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,320,000	
	第38回道路債券	100,000,000	112,387,000	
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,244,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,133,000	
	第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,585,000	
	第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,815,000	
	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	242,072,000	
	第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	245,052,000	
	第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,484,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,703,000	
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	132,684,000		
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,847,000		
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,173,000		

第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,943,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,792,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,809,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	128,626,250	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,856,000	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,255,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,098,000	
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,039,000	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,180,000	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,122,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,942,000	
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,884,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	215,069,360	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,908,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,781,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,251,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,901,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,540,000	
第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,926,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,468,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,822,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	243,000,000	247,607,280	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,825,000	
第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	104,611,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	121,456,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	120,639,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,409,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	243,740,000	

第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	122,082,000	
第9回公営企業債券(20年)	100,000,000	112,801,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	112,599,000	
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	121,614,000	
第15回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,866,000	
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	364,389,000	
第17回公営企業債券(20年)	200,000,000	233,452,000	
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	119,703,000	
第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,389,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,763,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	353,925,000	
第24回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,955,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,748,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,589,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,786,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	223,776,910	
第43回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,574,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,904,000	
第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,007,000	
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,248,060	
第56回政府保証地方公共団体金融機構債券	193,000,000	200,519,280	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	433,183,740	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,920,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,018,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,868,000	
第107回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,097,000	
第110回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	151,690,500	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,836,000	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,867,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	101,767,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	102,005,000	
第38回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	102,969,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,913,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,142,000	13,491,971	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,495,000	80,015,299	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	31,086,000	32,695,943	
	15,966,000	16,948,068	

第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券			
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	39,948,000	41,285,059	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,834,000	14,279,178	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,254,000	14,963,849	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,617,000	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,631,000	9,650,069	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	57,216,000	60,045,903	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,070,000	15,865,394	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,016,000	35,692,648	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,944,000	15,677,600	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,438,000	22,706,582	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,484,000	16,301,090	
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,141,000	12,253,061	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,974,000	12,218,030	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,089,000	20,353,073	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	59,337,000	61,213,235	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,085,000	12,365,855	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,975,000	20,542,689	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,032,000	28,117,334	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	123,420,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,640,000	25,586,281	
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,514,000	13,911,581	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,994,000	28,274,453	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,372,000	53,207,216	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,435,000	16,015,819	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,551,000	44,968,585	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,382,000	15,911,140	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,761,000	51,596,185	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,136,000	18,958,104	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,184,000	36,705,753	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,275,000	36,590,619	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,490,000	16,098,911	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,662,000	36,873,435	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,132,000	16,831,322	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,149,000	47,923,429	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,558,000	77,580,887	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,052,000	36,885,219	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,871,000	17,741,374	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,232,000	16,013,401	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,521,000	49,206,192	

第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,040,000	47,951,836	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	122,737,000	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	133,053,000	142,628,824	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,960,000	160,115,291	
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,541,000	16,382,389	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,513,000	36,732,185	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,114,000	37,266,137	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,024,000	47,282,403	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,966,000	40,360,135	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,971,000	16,789,194	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,754,000	45,294,015	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,428,000	48,166,854	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,364,000	52,305,600	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,043,000	49,875,459	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,412,000	56,904,069	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,445,000	58,537,722	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,406,000	51,973,629	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,525,000	49,586,159	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,358,000	51,539,623	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,062,000	58,172,452	
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,290,000	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,081,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,619,000	
第102回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,958,000	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,192,000	85,350,638	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,130,000	177,253,709	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,747,000	89,475,066	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,459,000	91,247,802	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,726,000	91,307,553	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,800,000	91,791,536	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,297,000	92,723,059	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,923,000	93,050,895	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,211,000	93,606,152	
第121回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,377,000	94,520,868	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,021,000	96,175,505	
	95,467,000	96,406,395	

	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,431,000	96,517,959	
	第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,337,000	98,504,070	
	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,250,000	99,165,690	
	第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,619,000	99,912,881	
	第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,514,000	100,963,918	
	第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,870,000	100,718,895	
	い第786号商工債	100,000,000	100,326,000	
	い第787号商工債	100,000,000	100,339,000	
	い第779号農林債	100,000,000	100,288,000	
	第308回信金中金債（5年）	100,000,000	100,335,000	
	第322回信金中金債（5年）	100,000,000	99,962,000	
	第327回信金中金債（5年）	200,000,000	200,090,000	
	第328回信金中金債（5年）	100,000,000	99,984,000	
	第331回信金中金債（5年）	100,000,000	100,050,000	
	第339回信金中金債（5年）	100,000,000	100,180,000	
	第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,169,000	
	第218号商工債（3年）	400,000,000	400,248,000	
	第221号商工債（3年）	200,000,000	200,094,000	
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,013,000	
	第18回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	206,686,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,701,000	
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,913,000	
	第34回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,942,000	
	特殊債券合計	19,453,418,000	21,137,535,283	
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,884,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	100,193,000	
	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,266,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,460,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,971,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,495,000	
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,844,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,400,000	

第1回H S B C・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,375,000	
第1回バンコ・サンタンデール・エセ・アー非上位円貨社債	100,000,000	98,894,000	
第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,230,000	
第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	200,364,000	
第3回ロイヤルバンク・オブ・カナダ円貨社債	100,000,000	100,212,000	
第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	103,624,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,632,000	
第9回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,063,000	
第2回株式会社伊藤園無担保社債	100,000,000	100,753,000	
第21回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,908,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,430,000	
第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,412,000	
第18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	99,665,000	
第9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	102,500,000	
第43回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,771,000	
第45回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,490,000	
第1回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	100,372,000	
第5回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,981,000	
第1回J X T Gホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,065,000	
第9回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	101,032,000	
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	104,009,000	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	102,504,000	
第21回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,002,000	
第9回株式会社L I X I Lグループ無担保社債	100,000,000	99,770,000	
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	102,607,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,288,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,351,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,252,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,522,000	
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	100,000,000	100,829,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,847,000	
第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	100,922,000	
第32回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,900,000	
	100,000,000	100,235,000	

第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債			
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,515,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,860,000	
第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス無担保社債	100,000,000	100,281,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	120,211,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,843,000	
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	113,447,000	
第25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	102,090,000	
第28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	102,734,000	
第32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	103,411,000	
第35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	103,919,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	107,732,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,308,000	
第11回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,723,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,121,000	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,738,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,317,000	
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	112,891,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,843,000	
第1回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,024,000	
第41回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,536,000	
第42回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,847,000	
第25回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,011,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,537,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,288,000	
第39回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,099,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,142,000	
第14回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,397,000	
第23回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,319,000	

第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	119,222,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	118,145,000	
第104回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	102,952,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,268,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,255,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,973,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,074,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,280,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,677,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,843,000	
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,701,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,065,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,847,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,100,000	
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,316,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,379,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	118,970,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	121,456,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	117,204,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,733,000	
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,130,000	
第4回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,955,000	
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,775,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	200,000,000	202,372,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,427,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,117,000	
第495回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,605,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,290,000	
第509回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,709,000	
第510回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,818,000	
第377回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,300,000	
第393回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,734,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,611,000	
第321回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,372,000	
第479回東北電力株式会社社債	200,000,000	201,816,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,704,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,038,000	
第431回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,199,000	

第436回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,831,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,275,000	
第316回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,498,000	
第323回北海道電力株式会社社債	100,000,000	108,735,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	111,124,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,698,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,633,000	
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,895,000	
第6回S C S K株式会社無担保社債	100,000,000	100,285,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,897,000	
社債券合計	12,400,000,000	12,822,811,000	
合計		302,317,364,962	

(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

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。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,340,831,290
コール・ローン	1,059,717,480
株式	174,260,348,511
投資信託受益証券	149,804,330
投資証券	4,549,267,230
派生商品評価勘定	759,194,273
未収入金	43,138
未収配当金	252,575,530
差入委託証拠金	1,977,181,076
流動資産合計	188,348,962,858
資産合計	188,348,962,858
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	203,273
前受金	756,271,110
未払解約金	101,142,170
未払利息	2,537

	2019年 2月21日現在
項目	金額（円）
その他未払費用	19
流動負債合計	857,619,109
負債合計	857,619,109
純資産の部	
元本等	
元本	70,292,796,065
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	117,198,547,684
元本等合計	187,491,343,749
純資産合計	187,491,343,749
負債純資産合計	188,348,962,858

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2019年 2月21日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	70,292,796,065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 2.6673円 (1万口当たり純資産額) (26,673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

	2019年 2月21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。

	2019年 2月21日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 2月21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>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	2019年 2月21日現在

（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	2019年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 2月22日
期首元本額	87,229,261,605円
期中追加設定元本額	12,670,534,767円
期中一部解約元本額	29,607,000,307円
期末元本額	70,292,796,065円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,821,040,717円
D C 外国株式インデックスファンド	4,479,537,811円
D C 外国株式インデックスファンド L	20,340,632,836円
D C バランスファンド 3 0	717,892,665円
D C バランスファンド 5 0	1,431,644,147円
D C バランスファンド 7 0	824,740,751円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	407,135,506円
外国株式インデックス e	5,865,287,439円
インデックスコレクション（外国株式）	5,115,830,963円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	2,076,315,656円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	699,437,918円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	631,425,163円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	6,289,327,776円
外国株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	1,273,337,220円
外国株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	974,984,006円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	95,576,034円

区分	2019年 2月21日現在
バランスVA50（適格機関投資家専用）	947,178,144円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	91,011,247円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	513,854,863円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	2,311,815円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,898,758,307円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	622,527,506円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	373,430,439円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	7,228,023,125円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	716,708,466円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	350,592,733円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,205,233,097円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	32,563,947円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	144,814,177円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	173,284,912円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	520,180,232円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	25,467,427円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	853,288,647円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	18,595,130円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	135,816,928円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	383,482,905円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	11,525,410円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,146,918,349
投資信託受益証券	4,929,331
投資証券	39,382,416
合計	3,191,230,096

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式マザーファンド」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

（2019年 2月21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	7,697,002,391	-	8,453,273,501	756,271,110
	合計	7,697,002,391	-	8,453,273,501	756,271,110

(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

(2019年 2月21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	1,000,472,234	-	1,003,392,330	2,920,096
	アメリカドル	759,773,952	-	761,192,880	1,418,928
	ユーロ	150,300,000	-	150,588,000	288,000
	イギリスポンド	90,398,282	-	91,611,450	1,213,168
	売建	84,635,844	-	84,836,050	200,206
	アメリカドル	45,263,007	-	45,259,940	3,067
	オーストラリアドル	39,372,837	-	39,576,110	203,273
合計		1,085,108,078	-	1,088,228,380	2,719,890

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	22,664	45.16	1,023,506.24	
	ANTERO RESOURCES CORP	7,288	9.84	71,713.92	
	APACHE CORP	17,138	33.80	579,264.40	
	BAKER HUGHES A GE CO	23,189	26.58	616,363.62	

CABOT OIL & GAS CORP	20,624	24.95	514,568.80
CHENIERE ENERGY INC	9,030	65.96	595,618.80
CHEVRON CORP	85,815	120.28	10,321,828.20
CIMAREX ENERGY CO	4,237	76.42	323,791.54
CONCHO RESOURCES INC	9,073	112.45	1,020,258.85
CONOCOPHILLIPS	52,195	70.65	3,687,576.75
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,103	45.00	184,635.00
DEVON ENERGY CORPORATION	23,726	30.27	718,186.02
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,107	106.45	756,540.15
EOG RESOURCES INC	26,047	98.78	2,572,922.66
EXXON MOBIL	189,325	78.53	14,867,692.25
HALLIBURTON CO	37,650	32.29	1,215,718.50
HELMERICH & PAYNE	4,776	57.07	272,566.32
HESS CORP	11,835	58.64	694,004.40
HOLLYFRONTIER CORP	7,524	56.10	422,096.40
KINDER MORGAN INC	89,708	19.17	1,719,702.36
MARATHON OIL CORP	38,194	17.08	652,353.52
MARATHON PETROLEUM CORP	31,076	65.11	2,023,358.36
NATIONAL OILWELL VARCO INC	17,063	29.81	508,648.03
NOBLE ENERGY INC	20,854	24.05	501,538.70
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	34,412	68.25	2,348,619.00
ONEOK INC	17,621	68.12	1,200,342.52
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	8,938	18.54	165,710.52
PHILLIPS 66	19,087	97.45	1,860,028.15
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,721	141.28	1,090,822.88
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	6,331	23.95	151,627.45
SCHLUMBERGER	62,217	45.90	2,855,760.30
TARGA RESOURCES CORP	8,989	44.89	403,516.21
TECHNIPFMC PLC	19,859	24.59	488,332.81
VALERO ENERGY CORP	18,564	85.43	1,585,922.52
WILLIAMS COS	51,953	27.35	1,420,914.55
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,146	177.64	1,802,335.44
ALBEMARLE CORP	4,921	82.81	407,508.01
AVERY DENNISON CORP	3,332	106.43	354,624.76
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,844	26.92	291,920.48
BALL CORP	14,866	54.40	808,710.40
CELANESE CORP-SERIES A	6,085	102.72	625,051.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	44.58	462,695.82
CHEMOURS CO/THE	8,553	38.18	326,553.54
CROWN HOLDINGS INC	5,436	54.26	294,957.36
DOWDUPONT INC	103,180	56.24	5,802,843.20
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,407	84.60	542,032.20

ECOLAB INC	11,897	165.29	1,966,455.13
FMC CORP	5,380	87.45	470,481.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	61,991	13.35	827,579.85
INT'L PAPER CO	17,669	47.74	843,518.06
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,981	129.97	517,410.57
LINDE PLC	24,333	170.30	4,143,909.90
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,319	89.16	1,276,682.04
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,699	192.27	518,936.73
MOSAIC CO/THE	14,763	33.48	494,265.24
NEWMONT MINING CORP	24,013	35.39	849,820.07
NUCOR CORP	14,326	61.48	880,762.48
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,206	100.72	423,628.32
PPG INDUSTRIES INC	10,386	109.74	1,139,759.64
SEALED AIR CORP	7,368	42.82	315,497.76
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,620	439.27	1,590,157.40
STEEL DYNAMICS INC	9,144	39.04	356,981.76
VULCAN MATERIALS CO	5,948	114.27	679,677.96
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,000	79.89	159,780.00
WESTROCK CO	11,037	40.32	445,011.84
3 M COMPANY	26,378	208.53	5,500,604.34
ACUITY BRANDS INC	1,559	128.57	200,440.63
AERCAP HOLDINGS NV	5,656	47.65	269,508.40
ALLEGION PLC	3,778	87.95	332,275.10
AMETEK INC	10,392	79.81	829,385.52
ARCONIC INC	18,227	18.39	335,194.53
BOEING CO	24,474	421.55	10,317,014.70
CATERPILLAR	26,897	140.31	3,773,918.07
CUMMINS INC	7,235	155.39	1,124,246.65
DEERE&CO	13,918	159.88	2,225,209.84
DOVER CORP	6,899	92.08	635,259.92
EATON CORP	18,804	79.72	1,499,054.88
EMERSON ELECTRIC CO	28,827	68.58	1,976,955.66
FASTENAL CO	12,914	62.10	801,959.40
FLOWSERVE CORP	5,872	47.75	280,388.00
FLUOR CORP	6,155	37.70	232,043.50
FORTIVE CORP	12,820	81.06	1,039,189.20
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,720	47.83	321,417.60
GENERAL DYNAMICS CORP	11,530	174.45	2,011,408.50
GENERAL ELECTRIC CO	393,285	10.10	3,972,178.50
GRAINGER (WW) INC	2,090	311.04	650,073.60
HARRIS CORP	5,338	165.20	881,837.60
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,789	44.13	343,728.57

HONEYWELL INTL INC	33,447	154.58	5,170,237.26
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	220.83	440,114.19
IDEX CORP	3,126	143.17	447,549.42
ILLINOIS TOOL WORKS	13,124	143.61	1,884,737.64
INGERSOLL-RAND PLC	10,620	105.57	1,121,153.40
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,145	73.80	379,701.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,500	70.85	673,075.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	9,400	39.92	375,248.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	39,771	35.43	1,409,086.53
L3 TECHNOLOGIES INC	3,315	212.96	705,962.40
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,551	248.54	385,485.54
LOCKHEED MARTIN CORP	11,461	307.20	3,520,819.20
MASCO CORP	13,089	37.57	491,753.73
MIDDLEBY CORP	2,145	118.68	254,568.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,556	288.22	2,177,790.32
OWENS CORNING	4,925	52.61	259,104.25
PACCAR INC	16,390	69.04	1,131,565.60
PARKER HANNIFIN CORP	6,250	175.34	1,095,875.00
PENTAIR PLC	7,018	42.79	300,300.22
RAYTHEON COMPANY	13,058	187.29	2,445,632.82
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,373	178.84	960,907.32
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,427	313.47	1,387,731.69
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	49.78	378,427.56
SMITH (A.O.) CORP	6,846	52.47	359,209.62
SNAP-ON INC	2,319	159.83	370,645.77
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	5,095	97.98	499,208.10
STANLEY BLACK&DECKER	6,944	136.82	950,078.08
TEXTRON	10,911	54.99	599,995.89
TRANSDIGM GROUP INC	2,064	436.19	900,296.16
UNITED RENTALS INC	3,773	136.26	514,108.98
UNITED TECHNOLOGIES CORP	35,627	128.43	4,575,575.61
WABCO HOLDINGS INC	2,071	117.82	244,005.22
WABTEC CORP	3,656	75.08	274,492.48
XYLEM INC	8,037	74.07	595,300.59
CINTAS CORP	3,912	203.06	794,370.72
COPART INC	9,323	53.48	498,594.04
COSTAR GROUP INC	1,619	409.60	663,142.40
EQUIFAX INC	5,386	108.13	582,388.18
IHS MARKIT LTD	16,714	53.04	886,510.56
MANPOWER GROUP	2,894	84.54	244,658.76
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,880	25.85	410,498.00
REPUBLIC SERVICES INC	10,405	77.23	803,578.15

ROBERT HALF INTL INC	4,993	67.73	338,175.89
ROLLINS INC	7,140	39.35	280,959.00
TRANSUNION	8,217	63.04	517,999.68
VERISK ANALYTICS INC	7,047	122.83	865,583.01
WASTE CONNECTIONS INC	11,869	83.43	990,230.67
WASTE MANAGEMENT INC	18,594	99.18	1,844,152.92
AMERCO	376	380.75	143,162.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,122	35.06	144,517.32
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,245	92.02	574,664.90
CSX CORP	35,868	73.25	2,627,331.00
DELTA AIR LINES INC	7,841	51.24	401,772.84
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,487	75.55	565,642.85
FEDEX CORP	11,407	181.91	2,075,047.37
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,908	113.79	444,691.32
KANSAS CITY SOUTHERN	4,597	111.06	510,542.82
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	34.72	243,040.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,174	183.49	2,233,807.26
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,480	152.50	378,200.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,089	54.41	331,302.49
UNION PACIFIC CORP	33,540	170.99	5,735,004.60
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,649	88.50	234,436.50
UNITED PARCEL SERVICE B	31,006	111.07	3,443,836.42
XPO LOGISTICS INC	5,355	55.09	295,006.95
APTIV PLC	11,109	81.71	907,716.39
AUTOLIV INC	3,858	82.77	319,326.66
BORGWARNER INC	9,348	41.86	391,307.28
FORD MOTOR COMPANY	166,310	8.94	1,486,811.40
GENERAL MOTORS CO	57,189	39.95	2,284,700.55
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,447	19.38	202,462.86
HARLEY-DAVIDSON	7,429	37.27	276,878.83
LEAR CORP	2,989	157.93	472,052.77
TESLA INC	5,765	302.56	1,744,258.40
CAPRI HOLDINGS LTD	6,771	43.70	295,892.70
DR HORTON INC	16,002	39.87	637,999.74
GARMIN LTD	4,973	83.06	413,057.38
HANESBRANDS INC	15,911	18.96	301,672.56
HASBRO INC	5,071	86.92	440,771.32
LEGGETT & PLATT INC	5,338	45.27	241,651.26
LENNAR CORP-CL A	12,416	48.95	607,763.20
LULULEMON ATHLETICA INC	4,379	148.12	648,617.48
MATTEL INC	12,938	13.63	176,344.94
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	139.77	395,549.10

NEWELL BRANDS INC	20,391	17.15	349,705.65
NIKE B	57,467	84.84	4,875,500.28
NVR INC	171	2,590.30	442,941.30
POLARIS INDUSTRIES INC	2,942	86.87	255,571.54
PULTE GROUP INC	12,739	27.14	345,736.46
PVH CORP	3,435	114.06	391,796.10
RALPH LAUREN CORPORATION	2,566	125.33	321,596.78
TAPESTRY INC	12,753	34.99	446,227.47
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,197	21.28	153,152.16
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	7,301	19.18	140,033.18
VF CORP	14,390	86.37	1,242,864.30
WHIRLPOOL CORP	3,060	142.70	436,662.00
ARAMARK	11,643	32.57	379,212.51
BLOCK H & R INC	10,235	23.90	244,616.50
CARNIVAL CORPORATION	18,317	58.85	1,077,955.45
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,083	597.74	647,352.42
DARDEN RESTAURANTS INC	5,327	110.54	588,846.58
DOMINO'S PIZZA INC	1,716	278.49	477,888.84
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,868	83.34	1,072,419.12
LAS VEGAS SANDS CORP	18,195	61.35	1,116,263.25
MARRIOTT INTL A	12,913	126.97	1,639,563.61
MCDONALD'S CORP	34,773	180.49	6,276,178.77
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	23.40	245,957.40
MGM RESORTS INTERNATIONAL	24,157	28.81	695,963.17
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	9,482	53.70	509,183.40
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,974	120.83	842,668.42
STARBUCKS CORP	59,581	70.39	4,193,906.59
VAIL RESORTS INC	1,670	211.29	352,854.30
WYNN RESORTS LTD	4,366	129.18	563,999.88
YUM BRANDS INC	14,173	94.72	1,342,466.56
ACTIVISION BLIZZARD INC	33,382	42.78	1,428,081.96
ALPHABET INC-CL A	13,381	1,120.59	14,994,614.79
ALPHABET INC-CL C	14,096	1,113.80	15,700,124.80
CBS CORP-CL B	15,534	51.20	795,340.80
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,165	349.76	2,506,030.40
COMCAST CORP-CL A	204,859	37.79	7,741,621.61
DISCOVERY INC - A	7,886	29.09	229,403.74
DISCOVERY INC-C	12,260	27.42	336,169.20
DISH NETWORK CORPORATION-A	9,561	31.26	298,876.86
ELECTRONIC ARTS INC	13,186	98.63	1,300,535.18
FACEBOOK INC-A	107,955	162.56	17,549,164.80
IAC/INTERACTIVECORP	3,234	216.85	701,292.90

INTERPUBLIC GROUP OF COS	16,191	23.66	383,079.06
LIBERTY BROADBAND-C	4,295	89.37	383,844.15
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	25.64	200,786.84
LIBERTY GLOBAL PLC-C	23,297	24.78	577,299.66
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	31.61	312,464.85
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	6,975	40.46	282,208.50
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	40.38	128,044.98
LIVE NATION ENTERTAINMENT	5,790	55.65	322,213.50
NETFLIX INC	19,529	359.91	7,028,682.39
NEWS CORP-CLASS A	16,730	12.88	215,482.40
OMNICOM GROUP	10,331	75.05	775,341.55
SIRIUS XM HOLDINGS INC	70,068	6.04	423,210.72
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,126	88.67	454,522.42
THE WALT DISNEY CO	66,637	113.68	7,575,294.16
TRIPADVISOR INC	4,286	55.40	237,444.40
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	47,439	50.77	2,408,478.03
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	19,768	50.38	995,911.84
TWITTER INC	30,534	31.37	957,851.58
VIACOM INC-CLASS B	15,680	29.31	459,580.80
ZILLOW GROUP INC-C	5,057	34.83	176,135.31
ADVANCE AUTO PARTS	3,293	166.00	546,638.00
AMAZON.COM	18,517	1,622.10	30,036,425.70
AUTOZONE INC	1,203	921.14	1,108,131.42
BEST BUY COMPANY INC	10,819	60.32	652,602.08
BOOKING HOLDINGS INC	2,131	1,926.17	4,104,668.27
BURLINGTON STORES INC	3,121	163.25	509,503.25
CARMAX INC	7,647	62.40	477,172.80
DOLLAR GENERAL CORP	11,473	118.99	1,365,172.27
DOLLAR TREE INC	10,680	99.19	1,059,349.20
EBAY	40,519	36.74	1,488,668.06
EXPEDIA GROUP INC	5,616	128.59	722,161.44
GAP	10,261	25.16	258,166.76
GENUINE PARTS CO	6,575	109.11	717,398.25
GRUBHUB INC	4,540	81.68	370,827.20
HOME DEPOT	51,249	191.85	9,832,120.65
KOHL'S CORP	7,505	65.45	491,202.25
L BRANDS INC	9,728	27.48	267,325.44
LKQ CORP	13,137	26.97	354,304.89
LOWES COMPANIES	36,638	105.66	3,871,171.08
MACY'S INC	13,046	25.02	326,410.92
MERCADOLIBRE INC	1,832	368.34	674,798.88
NORDSTROM INC	5,106	45.00	229,770.00

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,464	383.58	1,328,721.12
QURATE RETAIL INC	18,532	21.84	404,738.88
ROSS STORES INC	16,274	93.97	1,529,267.78
TARGET (DAYTON HUDSON)	22,382	72.71	1,627,395.22
TIFFANY & CO	4,819	91.62	441,516.78
TJX COMPANIES INC	56,288	50.51	2,843,106.88
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,562	97.55	542,573.10
ULTA BEAUTY INC	2,528	306.31	774,351.68
WAYFAIR INC- CLASS A	2,697	117.99	318,219.03
COSTCO WHOLESALE CORP	19,677	217.11	4,272,073.47
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	17,000	9.00	153,000.00
KROGER CO	35,590	28.75	1,023,212.50
SYSCO CORP	21,272	67.35	1,432,669.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	37,900	71.80	2,721,220.00
WALMART INC	66,134	99.88	6,605,463.92
ALTRIA GROUP INC	84,578	50.51	4,272,034.78
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	23,973	41.97	1,006,146.81
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,853	48.24	571,788.72
BUNGE LIMITED	6,250	52.70	329,375.00
CAMPBELL SOUP CO (US)	7,946	35.18	279,540.28
COCA-COLA CO	180,973	45.10	8,161,882.30
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	9,254	46.46	429,940.84
CONAGRA BRANDS INC	22,174	24.03	532,841.22
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,321	166.98	1,222,460.58
GENERAL MILLS INC	25,674	46.95	1,205,394.30
HERSHEY FOODS CORPORATION	6,369	110.68	704,920.92
HORMEL FOODS CORP	12,393	43.13	534,510.09
INGREDION INC	2,843	93.50	265,820.50
JM SMUCKER CO	5,075	106.94	542,720.50
KELLOGG CO	11,660	58.45	681,527.00
KRAFT HEINZ CO/THE	26,184	48.26	1,263,639.84
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,742	70.06	472,344.52
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,226	130.42	681,574.92
MOLSON COORS BREWING CO -B	8,447	61.39	518,561.33
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	65,916	47.99	3,163,308.84
MONSTER BEVERAGE CORP	17,658	58.70	1,036,524.60
PEPSICO INC	63,373	115.83	7,340,494.59
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	69,689	85.04	5,926,352.56
TYSON FOODS INC	13,383	63.60	851,158.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,915	64.94	708,820.10
CLOROX COMPANY	5,812	155.28	902,487.36
COLGATE-PALMOLIVE CO	37,299	66.51	2,480,756.49

COTY INC-CL A	19,809	11.15	220,870.35
ESTEE LAUDER CO-CL A	9,618	156.67	1,506,852.06
KIMBERLY-CLARK CORP	15,676	118.58	1,858,860.08
PROCTER & GAMBLE CO	111,470	99.28	11,066,741.60
ABBOTT LABORATORIES	78,663	75.54	5,942,203.02
ABIOMED INC	1,891	362.25	685,014.75
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,394	253.79	861,363.26
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,377	86.33	636,856.41
ANTHEM INC	11,677	312.95	3,654,317.15
BAXTER INTERNATIONAL	21,878	74.13	1,621,816.14
BECTON DICKINSON & CO	12,026	249.06	2,995,195.56
BOSTON SCIENTIFIC CORP	62,264	40.11	2,497,409.04
CARDINAL HEALTH	13,433	55.91	751,039.03
CENTENE CORP	18,310	65.28	1,195,276.80
CERNER CORP	12,991	57.77	750,490.07
CIGNA CORP	17,107	194.12	3,320,810.84
CVS HEALTH CORP	55,726	64.22	3,578,723.72
DANAHER CORP	28,306	112.20	3,175,933.20
DAVITA INC	6,479	59.06	382,649.74
DENTSPLY SIRONA INC	10,232	42.69	436,804.08
DEXCOM INC	4,071	145.54	592,493.34
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,054	176.68	1,599,660.72
HCA HEALTHCARE INC	12,016	142.33	1,710,237.28
HENRY SCHEIN INC	6,861	60.17	412,826.37
HOLOGIC INC	11,102	46.42	515,354.84
HUMANA INC	6,209	308.88	1,917,835.92
IDEXX LABORATORIES INC	3,926	211.44	830,113.44
INTUITIVE SURGICAL INC	5,117	549.65	2,812,559.05
LABORATORY CRP OF AMER	4,584	149.75	686,454.00
MCKESSON CORP	8,657	134.04	1,160,384.28
MEDTRONIC PLC	60,552	92.80	5,619,225.60
QUEST DIAGNOSTICS	6,077	88.94	540,488.38
RESMED INC	6,412	99.77	639,725.24
STRYKER CORP	15,141	187.64	2,841,057.24
TELEFLEX INC	1,940	286.48	555,771.20
THE COOPER COS INC	2,123	284.62	604,248.26
UNITEDHEALTH GROUP INC	43,094	269.51	11,614,263.94
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	134.32	523,579.36
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,067	132.64	539,446.88
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,351	118.00	631,418.00
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,296	277.98	638,242.08
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,231	123.98	1,144,459.38

ABBVIE INC	67,885	79.99	5,430,121.15
AGILENT TECHNOLOGIES	13,682	78.56	1,074,857.92
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,546	129.84	1,239,452.64
ALKERMES PLC	6,874	33.35	229,247.90
ALLERGAN PLC	15,277	140.33	2,143,821.41
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,367	77.75	339,534.25
AMGEN	29,151	186.92	5,448,904.92
BEIGENE LTD-ADR	1,700	139.01	236,317.00
BIOGEN INC	9,107	335.16	3,052,302.12
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,661	90.66	694,546.26
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	73,265	51.30	3,758,494.50
CELGENE CORP	31,275	90.40	2,827,260.00
GILEAD SCIENCES INC	58,190	66.98	3,897,566.20
ILLUMINA INC	6,620	302.24	2,000,828.80
INCYTE CORP	7,617	83.74	637,847.58
IQVIA HOLDINGS INC	7,572	141.19	1,069,090.68
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	126.78	337,615.14
JOHNSON & JOHNSON	119,951	136.35	16,355,318.85
LILLY (ELI) & CO	43,354	122.66	5,317,801.64
MERCK & CO	119,123	79.43	9,461,939.89
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,064	673.05	716,125.20
MYLAN NV	23,155	31.62	732,161.10
NEKTAR THERAPEUTICS	7,098	43.03	305,426.94
PERRIGO CO PLC	5,954	48.94	291,388.76
PFIZER	262,477	42.20	11,076,529.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,411	422.51	1,441,181.61
SEATTLE GENETICS INC	5,163	69.76	360,170.88
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	42,257	17.40	735,271.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,074	252.22	4,558,624.28
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,883	117.89	221,986.87
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,513	187.84	2,162,601.92
WATERS CORP	3,288	234.00	769,392.00
ZOETIS INC	21,911	94.39	2,068,179.29
BANK OF AMERICA CORP	424,855	29.41	12,494,985.55
BB&T CORP	33,523	51.78	1,735,820.94
CIT GROUP INC	5,078	51.26	260,298.28
CITIGROUP	113,371	64.64	7,328,301.44
CITIZENS FINANCIAL GROUP	21,932	37.66	825,959.12
COMERICA INC	7,447	88.31	657,644.57
EAST WEST BANCORP INC	6,421	55.67	357,457.07
FIFTH THIRD BANCORP	31,240	27.93	872,533.20
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,006	103.19	722,949.14

HUNTINGTON BANCSHARES INC	49,512	14.27	706,536.24
JPMORGAN CHASE & CO	150,456	105.69	15,901,694.64
KEY CORP	47,807	17.95	858,135.65
M & T BANK CORP	6,028	176.00	1,060,928.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	15,184	17.70	268,756.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,254	126.52	2,689,056.08
REGIONS FINL CORP	50,550	16.36	826,998.00
SIGNATURE BANK	2,135	135.60	289,506.00
SUNTRUST BANKS	19,945	66.55	1,327,339.75
SVB FINANCIAL GROUP	2,318	250.81	581,377.58
US BANCORP	70,282	51.60	3,626,551.20
WELLS FARGO & CO	204,878	49.81	10,204,973.18
ZIONS BANCORPORATION	9,403	51.28	482,185.84
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,299	109.95	252,775.05
ALLY FINANCIAL INC	18,129	27.17	492,564.93
AMERICAN EXPRESS	33,264	106.78	3,551,929.92
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,178	132.89	820,994.42
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	11,436	19.51	223,116.36
BANK NEW YORK CO	43,552	53.32	2,322,192.64
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,153	206.16	11,988,822.48
BLACKROCK INC	5,288	437.22	2,312,019.36
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,946	82.72	1,732,653.12
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,031	95.15	478,699.65
CME GROUP INC	16,262	175.59	2,855,444.58
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,954	71.62	1,071,005.48
E*TRADE FINANCIAL CORP	11,954	48.44	579,051.76
EATON VANCE CORP	5,267	41.80	220,160.60
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	32.62	481,079.76
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,299	198.60	3,236,981.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,929	74.48	1,856,711.92
INVESCO LTD	19,405	19.04	369,471.20
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	12,843	20.85	267,776.55
MOODY'S CORP	7,406	169.46	1,255,020.76
MORGAN STANLEY	57,267	42.42	2,429,266.14
MSCI INC	3,844	176.11	676,966.84
NASDAQ INC	5,565	88.08	490,165.20
NORTHERN TRUST CORP	9,699	93.47	906,565.53
PRICE T ROWE GROUP INC	10,375	98.18	1,018,617.50
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,365	82.78	444,114.70
S&P GLOBAL INC	11,118	198.02	2,201,586.36
SCHWAB (CHARLES) CORP	55,704	46.45	2,587,450.80
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	52.57	330,612.73

STATE STREET CORP	17,712	72.24	1,279,514.88
SYNCHRONY FINANCIAL	30,651	31.79	974,395.29
TD AMERITRADE HOLDING CORP	12,743	56.66	722,018.38
VOYA FINANCIAL INC	7,619	50.18	382,321.42
AFLAC	33,273	49.12	1,634,369.76
ALLEGHANY CORP	620	650.82	403,508.40
ALLSTATE CORP	15,101	95.06	1,435,501.06
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,005	99.85	300,049.25
AMERICAN INT'L GROUP	38,661	43.29	1,673,634.69
AON PLC	10,514	172.80	1,816,819.20
ARCH CAPITAL GROUP LTD	17,198	32.30	555,495.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,112	80.49	652,934.88
ASSURANT INC	2,482	98.83	245,296.06
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,517	44.60	290,658.20
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,534	43.34	196,503.56
CHUBB LTD	21,128	134.81	2,848,265.68
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,944	85.95	596,836.80
EVEREST RE GROUP LTD	1,724	221.65	382,124.60
FNF GROUP	12,232	34.91	427,019.12
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,057	49.07	787,916.99
LINCOLN NATIONAL CORP	9,779	62.63	612,458.77
LOEWS CORP	12,517	47.44	593,806.48
MARKEL CORP	609	1,019.76	621,033.84
MARSH & MCLENNAN COS	21,834	91.95	2,007,636.30
METLIFE INC	38,135	45.05	1,717,981.75
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,999	52.22	678,807.78
PROGRESSIVE CORP	25,056	72.48	1,816,058.88
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,074	95.02	1,717,391.48
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,601	144.45	375,714.45
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,736	145.15	251,980.40
TORCHMARK CORP	4,553	84.01	382,497.53
TRAVELERS COS INC/THE	11,612	129.74	1,506,540.88
UNUM GROUP	9,797	37.31	365,526.07
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,957	171.08	1,019,123.56
WR BERKLEY CORP	3,829	82.59	316,237.11
CBRE GROUP INC-A	14,472	50.12	725,336.64
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	47,400	7.15	338,910.00
JONES LANG LASALLE INC	2,230	164.28	366,344.40
WEYERHAEUSER CO	34,135	25.87	883,072.45
ACCENTURE PLC-CL A	28,652	159.71	4,576,010.92
ADOBE INC	21,961	258.10	5,668,134.10
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	7,570	69.83	528,613.10

ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,154	173.42	373,546.68
ANSYS INC	3,623	174.66	632,793.18
AUTODESK INC	9,411	159.80	1,503,877.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	19,589	150.56	2,949,319.84
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,223	100.16	523,135.68
CADENCE DESIGN SYSTEMS	12,649	55.07	696,580.43
CDK GLOBAL INC	5,199	57.90	301,022.10
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,591	119.99	670,864.09
CITRIX SYSTEMS INC	5,700	105.37	600,609.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	25,224	72.25	1,822,434.00
DXC TECHNOLOGY CO	12,201	66.44	810,634.44
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,224	107.06	1,522,821.44
FIRST DATA CORP- CLASS A	21,830	25.24	550,989.20
FISERV INC	17,584	84.73	1,489,892.32
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,043	227.50	919,782.50
FORTINET INC	5,865	83.87	491,897.55
GARTNER INC	3,870	141.10	546,057.00
GLOBAL PAYMENTS INC	7,160	125.94	901,730.40
GODADDY INC - CLASS A	6,655	72.39	481,755.45
INTL BUSINESS MACHINES CORP	40,941	138.00	5,649,858.00
INTUIT INC	10,900	235.97	2,572,073.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,199	132.83	424,923.17
LEIDOS HOLDINGS	6,384	61.68	393,765.12
MASTERCARD INC-CLASS A	41,331	221.11	9,138,697.41
MICROSOFT CORP	325,404	107.15	34,867,038.60
ORACLE CORP	132,460	51.77	6,857,454.20
PALO ALTO NETWORKS INC	4,133	226.64	936,703.12
PAYCHEX INC	14,576	75.32	1,097,864.32
PAYPAL HOLDINGS INC	50,466	94.73	4,780,644.18
PTC INC	5,381	91.83	494,137.23
RED HAT INC	7,991	182.31	1,456,839.21
SABRE CORP	10,169	21.97	223,412.93
SALESFORCE.COM INC	32,263	158.54	5,114,976.02
SERVICENOW INC	8,181	229.50	1,877,539.50
SPLUNK INC	6,291	133.12	837,457.92
SQUARE INC - A	12,757	75.97	969,149.29
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,353	59.26	554,258.78
SYMANTEC CORP	26,285	22.47	590,623.95
SYNOPSYS INC	6,658	102.98	685,640.84
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,332	93.67	686,788.44
VERISIGN INC	5,216	176.01	918,068.16
VISA INC-CLASS A SHARES	79,558	144.73	11,514,429.34

VMWARE INC-CLASS A	3,606	170.76	615,760.56
WESTERN UNION CO	20,387	17.84	363,704.08
WIX.COM LTD	2,000	111.11	222,220.00
WORKDAY INC-CLASS A	6,243	188.65	1,177,741.95
WORLDPAY INC-CLASS A	13,494	88.33	1,191,925.02
AMPHENOL CORPORATION	12,924	93.48	1,208,135.52
APPLE INC	215,659	172.03	37,099,817.77
ARISTA NETWORKS INC	2,252	270.72	609,661.44
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	81.99	315,743.49
CDW CORP/DE	6,846	94.79	648,932.34
CISCO SYSTEMS	210,625	49.63	10,453,318.75
COGNEX CORP	8,111	51.27	415,850.97
COMMSCOPE HOLDING CO INC	6,775	23.45	158,907.62
CORNING	36,416	34.66	1,262,178.56
DELL TECHNOLOGIES -C	5,808	55.54	322,576.32
F5 NETWORKS INC	2,755	168.18	463,335.90
FLEX LTD	21,868	10.40	227,427.20
FLIR SYSTEMS INC	5,527	52.80	291,825.60
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	65,377	16.05	1,049,300.85
HP INC	70,636	23.38	1,651,469.68
IPG PHOTONICS CORP	1,782	153.22	273,038.04
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	27.19	443,414.52
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8,361	81.08	677,909.88
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,260	139.21	1,010,664.60
NETAPP INC	12,069	65.27	787,743.63
SEAGATE TECHNOLOGY	11,767	45.89	539,987.63
TE CONNECTIVITY LTD	15,023	82.78	1,243,603.94
TRIMBLE IMS HOLDINGS	10,999	39.98	439,740.02
WESTERN DIGITAL CORP	13,413	48.46	649,993.98
XEROX CORP	11,291	30.87	348,553.17
AT&T INC	324,738	30.85	10,018,167.30
CENTURYLINK INC	43,253	13.90	601,216.70
SPRINT CORP	39,898	6.31	251,756.38
T-MOBILE US INC	15,154	72.75	1,102,453.50
VERIZON COMMUNICATIONS	184,769	55.76	10,302,719.44
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,950	25.74	256,113.00
AES CORP	27,865	17.15	477,884.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	10,283	45.17	464,483.11
AMEREN CORPORATION	10,875	70.40	765,600.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,538	80.52	1,814,759.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,011	98.66	790,365.26
ATMOS ENERGY CORP	4,707	98.00	461,286.00

CENTERPOINT ENERGY INC	22,540	30.98	698,289.20
CMS ENERGY CORP	12,638	52.79	667,160.02
CONSOLIDATED EDISON INC	14,002	79.01	1,106,298.02
DOMINION ENERGY INC	34,045	73.54	2,503,669.30
DTE ENERGY COMPANY	8,072	121.77	982,927.44
DUKE ENERGY CORP	32,025	88.85	2,845,421.25
EDISON INTL	14,680	62.68	920,142.40
ENERGY CORP	8,099	91.24	738,952.76
EVERGY INC	12,398	59.39	736,317.22
EVERSOURCE ENERGY	14,253	70.27	1,001,558.31
EXELON CORP	43,521	48.13	2,094,665.73
FIRSTENERGY CORP	20,684	39.59	818,879.56
NEXTERA ENERGY INC	21,173	185.64	3,930,555.72
NISOURCE INC	16,007	26.28	420,663.96
NRG ENERGY INC	13,957	42.06	587,031.42
OGE ENERGY CORP	8,794	41.94	368,820.36
PINNACLE WEST CAPITAL	4,956	90.93	450,649.08
PPL CORPORATION	31,240	31.18	974,063.20
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	21,647	56.61	1,225,436.67
SEMPRA ENERGY	12,361	117.13	1,447,843.93
SOUTHERN CO	45,673	49.74	2,271,775.02
UGI CORP	7,302	53.46	390,364.92
VISTRA ENERGY CORP	14,141	26.64	376,716.24
WEC ENERGY GROUP INC	14,208	75.10	1,067,020.80
XCEL ENERGY INC	22,910	54.10	1,239,431.00
ADVANCED MICRO DEVICES	41,274	23.95	988,512.30
ANALOG DEVICES	16,620	106.82	1,775,348.40
APPLIED MATERIALS	44,532	39.00	1,736,748.00
BROADCOM INC	19,367	283.42	5,488,995.14
INTEL CORP	206,503	51.39	10,612,189.17
KLA-TENCOR CORP	7,032	112.87	793,701.84
LAM RESEARCH CORP	7,362	182.21	1,341,430.02
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	24,854	19.80	492,109.20
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,629	55.92	706,213.68
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,561	89.65	946,793.65
MICRON TECHNOLOGY	51,863	42.21	2,189,137.23
NVIDIA CORP	25,926	158.55	4,110,567.30
NXP SEMICONDUCTORS NV	15,149	94.25	1,427,793.25
ON SEMICONDUCTOR CORP	19,013	22.59	429,503.67
QORVO INC	5,629	65.86	370,725.94
QUALCOMM	63,160	52.45	3,312,742.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,199	82.33	675,023.67

	TEXAS INSTRUMENTS	43,629	107.94	4,709,314.26
	XILINX INC	11,010	120.11	1,322,411.10
	アメリカドル 小計	13,559,707		1,069,019,457.06 (118,340,453,896)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	9,635	10.27	98,951.45
	CAMECO CORP	19,186	15.83	303,714.38
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	54,225	37.27	2,020,965.75
	CENOVUS ENERGY INC	50,155	11.64	583,804.20
	ENBRIDGE	90,282	48.30	4,360,620.60
	ENCANA CORP	38,719	9.10	352,342.90
	HUSKY ENERGY INC	12,746	15.98	203,681.08
	IMPERIAL OIL	11,645	36.42	424,110.90
	INTER PIPELINE LTD	18,856	21.26	400,878.56
	KEYERA CORP	7,525	29.23	219,955.75
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,276	48.25	1,123,067.00
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,703	19.82	192,313.46
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	15,297	10.61	162,301.17
	SUNCOR ENERGY	72,627	45.24	3,285,645.48
	TOURMALINE OIL CORP	12,981	20.24	262,735.44
	TRANSCANADA CORP	40,558	58.07	2,355,203.06
	VERMILION ENERGY INC	6,153	33.58	206,617.74
	AGNICO EAGLE MINES	11,064	57.64	637,728.96
	BARRICK GOLD CORP	70,067	18.14	1,271,015.38
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	57.38	418,988.76
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,625	14.65	477,956.25
	FRANCO-NEVADA CORP	8,688	101.29	880,007.52
	GOLDCORP INC	41,363	15.21	629,131.23
	KINROSS GOLD CORP	60,197	5.00	300,985.00
	LUNDIN MINING CORP	30,173	6.72	202,762.56
	METHANEX CORP	2,991	76.77	229,619.07
	NUTRIEN LTD	26,842	71.72	1,925,108.24
	TECK RESOURCES LTD-CL B	21,579	30.50	658,159.50
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	48,543	2.51	121,842.93
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,615	68.70	179,650.50
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,916	28.99	490,394.84
	BOMBARDIER B	104,404	2.84	296,507.36
	CAE INC	9,539	28.07	267,759.73
	FINNING INTERNATIONAL INC	5,794	26.09	151,165.46
	SNC-LAVALIN GROUP INC	8,775	34.31	301,070.25
	WSP GLOBAL INC	5,400	70.57	381,078.00
	THOMSON REUTERS CORP	10,798	69.36	748,949.28
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,764	113.39	3,715,109.96

CP RAILWAY LIMITED	6,333	273.91	1,734,672.03
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,849	69.54	1,032,599.46
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	45.02	450,200.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	11,055	85.22	942,107.10
STARS GROUP INC/THE	9,180	22.25	204,255.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,409	27.37	585,964.33
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,526	145.72	368,088.72
DOLLARAMA INC	12,978	37.09	481,354.02
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	18,698	73.08	1,366,449.84
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	30.93	226,716.90
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	66.54	603,384.72
METRO INC	11,606	48.85	566,953.10
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	97.71	362,015.55
SAPUTO INC	10,742	41.76	448,585.92
AURORA CANNABIS INC	30,000	9.30	279,000.00
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	31.61	459,735.84
CANOPY GROWTH CORP	8,800	60.80	535,040.00
BANK MONTREAL	28,847	99.05	2,857,295.35
BANK NOVA SCOTIA	55,570	75.58	4,199,980.60
CANADIAN IMPERIAL BANK	19,509	114.20	2,227,927.80
NATIONAL BANK OF CANADA	14,068	62.56	880,094.08
ROYAL BANK OF CANADA	64,679	102.78	6,647,707.62
TORONTO-DOMINION BANK	82,054	76.29	6,259,899.66
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	37,208	58.67	2,182,993.36
CI FINANCIAL CORP	9,872	18.81	185,692.32
IGM FINANCIAL INC	3,890	34.60	134,594.00
ONEX CORP	3,102	77.50	240,405.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,189	665.16	790,875.24
GREAT-WEST LIFECO INC	11,567	29.95	346,431.65
IA FINANCIAL CORP INC	3,734	50.90	190,060.60
INTACT FINANCIAL CORP	6,633	110.93	735,798.69
MANULIFE FINANCIAL CORP	87,856	22.27	1,956,553.12
POWER CORP OF CANADA	13,509	27.63	373,253.67
POWER FINANCIAL CORP	12,518	28.68	359,016.24
SUN LIFE FINANCIAL INC	26,701	49.64	1,325,437.64
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	21.71	151,970.00
BLACKBERRY LIMITED	25,075	11.20	280,840.00
CGI INC - CL A	10,929	87.89	960,549.81
CONSTELLATION SOFTWARE INC	862	1,158.44	998,575.28
OPEN TEXT CORP	10,909	49.68	541,959.12
SHOPIFY INC - CLASS A	3,654	236.35	863,622.90
BCE INC	7,663	57.68	442,001.84

	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	15,589	72.64	1,132,384.96
	TELUS CORP	11,560	47.00	543,320.00
	ALTAGAS INCOME LTD	8,078	15.93	128,682.54
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	42.13	184,192.36
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	33.46	200,023.88
	EMERA INC	1,710	46.39	79,326.90
	FORTIS INC	19,700	46.36	913,292.00
	HYDRO ONE LTD	14,740	20.65	304,381.00
	カナダドル 小計	1,885,156		81,108,161.46 (6,817,140,970)
ユーロ	ENAGAS	8,653	24.60	212,863.80
	ENI	113,983	15.25	1,738,468.71
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	14.63	347,171.47
	NESTE OIL OYJ	5,822	86.18	501,739.96
	OMV AG	5,641	46.40	261,742.40
	REPSOL SA	61,264	15.20	931,519.12
	SNAM SPA	91,077	4.17	379,791.09
	TENARIS SA	19,529	12.00	234,348.00
	TOTAL SA	106,930	49.63	5,306,935.90
	VOPAK	3,661	43.30	158,521.30
	AIR LIQUIDE	18,583	108.20	2,010,680.60
	AKZO NOBEL	9,943	79.76	793,053.68
	ARCELORMITTAL	30,928	20.29	627,683.76
	ARKEMA	3,446	85.56	294,839.76
	BASF SE	41,168	66.32	2,730,261.76
	COVESTRO AG	8,327	51.02	424,843.54
	CRH PLC	38,973	27.65	1,077,603.45
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,772	25.05	169,638.60
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	40.86	132,631.56
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,759	65.06	439,740.54
	IMERYS SA	2,111	50.15	105,866.65
	KONINKLIJKE DSM NV	8,408	91.40	768,491.20
	LANXESS	3,921	49.02	192,207.42
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,350	26.32	272,412.00
	SOLVAY SA	2,897	100.85	292,162.45
	STORA ENSO OYJ R	23,291	11.96	278,560.36
	SYMRISE AG	5,350	77.84	416,444.00
	THYSSEN KRUPP	18,959	13.28	251,775.52
	UMICORE	9,946	36.96	367,604.16
	UPM KYMMENE OYJ	23,447	26.91	630,958.77
	VOESTALPINE AG	5,948	26.33	156,610.84
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,360	37.24	385,806.40

AIRBUS SE	26,294	111.12	2,921,789.28
ALSTOM	6,679	38.08	254,336.32
ANDRITZ AG	3,617	44.78	161,969.26
BOUYGUES ORD	9,144	31.57	288,676.08
BRENTAG AG	7,062	44.04	311,010.48
CNH INDUSTRIAL NV	43,124	9.32	401,915.68
DASSAULT AVIATION SA	121	1,333.00	161,293.00
EIFFAGE	3,707	83.66	310,127.62
FERROVIAL SA	20,149	20.10	404,994.90
GEA GROUP AG	7,649	20.89	159,787.61
HOCHTIEF AG	998	135.20	134,929.60
KINGSPAN GROUP PLC	5,706	39.96	228,011.76
KION GROUP AG	3,430	54.24	186,043.20
KONE OYJ-B	14,855	44.75	664,761.25
LEGRAND SA	12,078	58.12	701,973.36
LEONARDO SPA	22,011	8.91	196,294.09
METSO OYJ	4,950	29.45	145,777.50
MTU AERO ENGINES AG	2,433	191.20	465,189.60
OSRAM LICHT AG	4,606	39.18	180,463.08
PRYSMIAN SPA	11,275	18.88	212,872.00
REXEL SA	13,109	11.31	148,262.79
SAFRAN SA	14,464	117.50	1,699,520.00
SAINT-GOBAIN	22,629	33.17	750,603.93
SCHNEIDER ELECTRIC SE	23,645	69.40	1,640,963.00
SIEMENS	34,270	94.60	3,241,942.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	13.60	167,579.20
THALES SA	4,691	107.25	503,109.75
VINCI S.A.	21,944	81.04	1,778,341.76
WARTSILA OYJ	18,738	14.68	275,073.84
BUREAU VERITAS SA	13,374	19.50	260,793.00
EDENRED	10,133	37.72	382,216.76
RANDSTAD NV	5,866	46.58	273,238.28
SOCIETE BIC SA	1,751	82.35	144,194.85
TELEPERFORMANCE	2,616	153.10	400,509.60
WOLTERS KLUWER	12,729	56.38	717,661.02
ADP	1,532	171.60	262,891.20
AENA SME SA	2,696	154.00	415,184.00
ATLANTIA SPA	21,349	21.07	449,823.43
BOLLORE	37,200	3.65	135,780.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,748	23.03	224,496.44
DEUTSCHE POST AG-REG	44,062	26.71	1,176,896.02
FRAPORT AG	1,934	71.48	138,242.32

GETLINK	18,631	12.60	234,750.60
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	21,089	7.46	157,450.47
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,831	72.51	1,075,395.81
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	63.55	164,086.10
CONTINENTAL AG	4,832	144.80	699,673.60
DAIMLER AG	40,787	51.76	2,111,135.12
FAURECIA	3,558	42.06	149,649.48
FERRARI NV	5,161	110.90	572,354.90
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	50,762	13.26	673,205.64
MICHELIN	7,746	103.00	797,838.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,157	30.87	190,066.59
PEUGEOT SA	26,059	22.18	577,988.62
PIRELLI & C SPA	20,549	6.11	125,677.68
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	7,141	57.22	408,608.02
RENAULT SA	8,523	59.97	511,124.31
VALEO SA	10,585	28.16	298,073.60
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,341	146.68	1,223,457.88
VOLKSWAGEN STAMM	1,238	151.00	186,938.00
ADIDAS AG	8,451	202.10	1,707,947.10
ESSILORLUXOTTICA	13,066	107.30	1,401,981.80
HERMES INTERNATIONAL	1,412	549.00	775,188.00
HUGO BOSS AG	3,285	63.68	209,188.80
KERING	3,286	474.50	1,559,207.00
LVMH	12,385	296.60	3,673,391.00
MONCLER SPA	7,343	34.71	254,875.53
PUMA AG	349	459.00	160,191.00
SEB SA	1,191	140.00	166,740.00
ACCOR	7,846	40.06	314,310.76
PADDY POWER PLC	4,606	71.05	327,256.30
SODEXO	3,785	95.88	362,905.80
AXEL SPRINGER SE	2,214	52.45	116,124.30
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,675	18.86	163,653.87
JC DECAUX SA	3,750	27.72	103,950.00
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	7,988	15.82	126,370.16
PUBLICIS GROUPE	9,131	48.98	447,236.38
RTL GROUP	2,176	48.82	106,232.32
SES	16,206	18.29	296,488.77
TELENET GROUP HOLDING NV	2,831	39.70	112,390.70
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,479	67.24	233,927.96
VIVENDI	47,122	23.95	1,128,571.90
DELIVERY HERO SE	4,800	35.40	169,920.00
INDITEX	48,248	25.48	1,229,359.04

ZALANDO SE	4,976	26.89	133,804.64
CARREFOUR	25,231	17.90	451,634.90
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	43.81	144,485.38
COLRUYT SA	3,126	62.24	194,562.24
JERONIMO MARTINS	13,062	12.64	165,168.99
KONINKLIJKE AHOLD NV	54,884	22.91	1,257,666.86
METRO AG	8,880	14.83	131,690.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,441	68.81	2,369,885.21
DANONE (GROUPE)	26,663	66.88	1,783,221.44
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	26,648	8.28	220,645.44
HEINEKEN HOLDING NV	4,955	84.70	419,688.50
HEINEKEN NV	11,372	87.92	999,826.24
KERRY GROUP PLC-A	8,164	89.85	733,535.40
PERNOD-RICARD	9,206	151.00	1,390,106.00
REMY COINTREAU	1,020	112.20	114,444.00
BEIERSDORF AG	4,768	91.54	436,462.72
HENKEL AG & CO KGAA	4,514	82.50	372,405.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	7,927	88.52	701,698.04
LOREAL	10,959	224.40	2,459,199.60
UNILEVER NV-CVA	69,472	49.14	3,414,201.44
BIOMERIEUX	1,835	69.80	128,083.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,583	70.54	675,984.82
FRESENIUS SE&CO KGAA	18,774	49.00	919,926.00
KONINKLIJKE PHILIPS	41,751	34.76	1,451,264.76
SARTORIUS AG-VORZUG	1,250	147.00	183,750.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,294	36.28	228,377.79
BAYER	41,799	68.36	2,857,379.64
EUROFINS SCIENTIFIC	389	359.00	139,651.00
GRIFOLS SA	11,921	23.83	284,077.43
IPSEN	1,866	124.15	231,663.90
MERCK KGAA	5,323	97.08	516,756.84
ORION OYJ-CLASS B	5,393	29.62	159,740.66
QIAGEN N.V.	11,006	34.04	374,644.24
RECORDATI SPA	5,195	33.53	174,188.35
SANOFI	50,194	74.20	3,724,394.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,200	104.00	124,800.00
UCB (GROUPE)	5,104	79.18	404,134.72
ABN AMRO GROUP NV-CVA	19,718	20.73	408,754.14
AIB GROUP PLC	37,786	3.89	146,987.54
BANCO BILBAO VIZCAYA	310,588	5.23	1,626,549.35
BANCO DE SABADELL SA	216,777	0.95	206,718.54
BANCO SANTANDER SA	737,872	4.14	3,055,159.01

BANK OF IRELAND GROUP PLC	46,790	5.48	256,643.15
BANKIA SA	59,546	2.59	154,224.14
BANKINTER SA	24,407	6.94	169,482.20
BNP PARIBAS	49,994	42.56	2,127,994.61
CAIXABANK	152,587	3.03	462,948.95
COMMERZBANK AG	46,733	6.67	311,896.04
CREDIT AGRICOLE SA	51,640	10.59	546,867.60
ERSTE GROUP BANK AG	14,009	32.60	456,693.40
ING GROEP NV-CVA	176,104	11.09	1,954,049.98
INTESA SANPAOLO	647,852	2.05	1,332,307.63
KBC GROEP NV	10,861	62.74	681,419.14
MEDIOBANCA	29,447	8.31	244,940.14
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	23.10	181,704.60
SOCIETE GENERALE	33,271	25.32	842,421.72
UNICREDIT SPA	89,297	11.43	1,020,664.71
AMUNDI SA	2,812	55.54	156,178.48
DEUTSCHE BANK NAMEN	87,471	7.68	672,564.51
DEUTSCHE BOERSE	8,615	111.05	956,695.75
EURAZEO SA	2,229	65.15	145,219.35
EXOR NV	4,379	56.94	249,340.26
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,728	83.60	311,660.80
NATIXIS	40,748	4.45	181,695.33
WENDEL	1,047	104.00	108,888.00
AEGON	76,385	4.66	356,565.18
AGEAS	7,693	43.00	330,799.00
ALLIANZ SE-REG	19,330	192.00	3,711,360.00
ASSICURAZIONI GENERALI	51,245	15.22	780,205.12
AXA	84,125	21.16	1,780,085.00
CNP ASSURANCES	8,406	20.38	171,314.28
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,358	130.40	307,483.20
MAPFRE SA	56,454	2.47	139,723.65
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,824	206.20	1,407,108.80
NN GROUP NV	14,216	37.98	539,923.68
POSTE ITALIANE SPA	25,777	7.72	199,204.65
SAMPO OYJ-A SHS	19,591	42.80	838,494.80
SCOR SE	6,580	38.60	253,988.00
AROUNDTOWN SA	35,430	7.47	264,662.10
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,109	42.16	679,155.44
VONOVIA SE	21,618	43.93	949,678.74
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	19,420	68.94	1,338,814.80
ATOS SE	4,174	82.86	345,857.64
CAPGEMINI SA	7,143	103.30	737,871.90

	DASSAULT SYSTEMES SA	5,884	128.60	756,682.40
	SAP SE	44,018	94.45	4,157,500.10
	WIRECARD AG	5,219	114.25	596,270.75
	INGENICO GROUP	3,351	56.98	190,939.98
	NOKIA OYJ	251,415	5.34	1,344,064.59
	1&1 DRILLISCH AG	2,406	34.80	83,728.80
	DEUTSCHE TELEKOM	149,447	14.58	2,178,937.26
	ELISA A	7,434	36.36	270,300.24
	ILIAD SA	1,337	93.08	124,447.96
	KPN (KON.)	142,629	2.73	389,377.17
	ORANGE	86,416	13.64	1,179,146.32
	PROXIMUS	7,531	22.71	171,029.01
	TELECOM ITALIA ORD	534,432	0.53	287,417.52
	TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.46	159,794.93
	TELEFONICA	207,234	7.68	1,591,557.12
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.98	122,146.45
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	32.36	190,568.04
	E.ON SE	98,112	9.67	948,743.04
	ELECTRICITE DE FRANCE	24,433	13.44	328,379.52
	ENDESA	16,647	21.87	364,069.89
	ENEL	363,911	5.23	1,903,982.35
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	118,885	3.27	389,110.60
	ENGIE	83,020	14.11	1,171,412.20
	FORTUM OYJ	19,008	19.62	373,032.00
	IBERDROLA SA	284,628	7.32	2,084,046.21
	INNOGY SE	6,865	40.57	278,513.05
	NATURGY ENERGY GROUP SA	14,147	23.80	336,698.60
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,346	18.84	326,885.37
	RWE STAMM	21,261	22.37	475,608.57
	SUEZ	17,194	11.51	197,988.91
	TERNA SPA	66,644	5.32	354,812.65
	UNIPER SE	8,984	25.97	233,314.48
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,851	19.42	482,606.42
	VERBUND AG	3,100	44.14	136,834.00
	ASML HOLDING NV	18,482	161.84	2,991,126.88
	INFINEON TECHNOLOGIES	50,873	19.69	1,001,943.73
	STMICROELECTRONICS	29,889	14.67	438,621.07
	ユーロ 小計	8,834,802		165,065,154.16 (20,714,026,195)
イギリスポンド	BP PLC	890,579	5.39	4,803,783.12
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	204,921	24.28	4,975,481.88
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	166,963	24.40	4,074,732.01

WOOD GROUP (JOHN) PLC	33,000	5.42	179,124.00
ANGLO AMERICAN PLC	46,963	20.20	948,652.60
ANTOFAGASTA PLC	16,971	9.35	158,746.73
BHP GROUP PLC	91,562	18.23	1,669,724.63
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,632	50.84	286,330.88
FRESNILLO PLC	10,869	10.27	111,678.97
GLENCORE PLC	509,769	3.10	1,582,577.86
JOHNSON MATTHEY PLC	8,385	32.03	268,571.55
MONDI PLC	15,660	18.85	295,269.30
RIO TINTO PLC REG	52,689	44.49	2,344,133.61
ASHTED GROUP PLC	22,351	20.27	453,054.77
BAE SYSTEMS PLC	144,528	5.04	728,999.23
BUNZL PLC	14,890	25.15	374,483.50
DCC PLC	4,508	66.95	301,810.60
FERGUSON PLC	10,326	53.94	556,984.44
MEGGITT PLC	31,622	5.60	177,083.20
MELROSE INDUSTRIES PLC	208,890	1.72	359,708.58
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	74,095	9.88	732,354.98
SMITHS GROUP PLC	20,046	14.62	293,072.52
WEIR GROUP PLC/THE	12,587	16.19	203,846.46
BABCOCK INTL GROUP PLC	14,809	5.59	82,900.78
EXPERIAN PLC	38,175	20.17	769,989.75
G4S PLC	77,964	2.10	164,114.22
INTERTEK GROUP PLC	7,061	51.96	366,889.56
RELX PLC	85,706	16.85	1,444,146.10
EASYJET PLC	9,909	13.20	130,798.80
ROYAL MAIL PLC	44,164	2.78	122,864.24
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	5.71	291,186.33
BURBERRY GROUP PLC	18,236	19.47	355,146.10
PERSIMMON PLC	13,492	24.41	329,339.72
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.67	277,466.20
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	38.31	250,930.50
CARNIVAL PLC	8,185	43.51	356,129.35
COMPASS GROUP PLC	68,629	17.31	1,187,967.99
GVC HOLDINGS PLC	20,500	6.49	133,045.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	7,472	45.45	339,602.40
MERLIN ENTERTAINME	30,924	3.70	114,480.64
TUI AG-DI	17,558	8.43	148,049.05
WHITBREAD PLC	7,881	49.37	389,084.97
AUTO TRADER GROUP PLC	42,371	4.61	195,584.53
INFORMA PLC	54,925	7.15	392,713.75
ITV PLC	154,979	1.34	209,144.16

PEARSON	33,153	8.92	295,857.37
WPP PLC	56,653	8.48	480,757.35
KINGFISHER PLC	90,095	2.41	217,669.52
MARKS & SPENCER GROUP PLC	82,369	2.91	240,270.37
NEXT PLC	6,461	50.06	323,437.66
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	2.27	254,229.12
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.34	192,332.21
TESCO	441,556	2.27	1,004,098.34
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,323	23.29	356,872.67
BRITISH AMERICAN TOBACCO	102,261	28.50	2,914,949.80
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	26.51	241,638.65
DIAGEO	109,773	30.14	3,309,107.08
IMPERIAL BRANDS PLC	41,332	27.13	1,121,543.82
RECKITT BENCKISER PLC	29,887	60.25	1,800,691.75
UNILEVER PLC	52,033	42.36	2,204,117.88
CONVATEC GROUP PLC	57,895	1.26	73,266.12
NMC HEALTH PLC	4,750	27.82	132,145.00
SMITH & NEPHEW PLC	39,534	14.38	568,498.92
ASTRAZENECA	56,458	61.43	3,468,214.94
GLAXOSMITHKLINE	221,189	15.74	3,481,514.86
BARCLAYS	741,595	1.60	1,193,078.03
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	887,685	6.43	5,711,365.29
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,125,749	0.61	1,910,770.36
ROYAL BANK OF SCOTLAND	205,762	2.58	530,865.96
STANDARD CHARTERED PLC	125,164	6.16	772,011.55
3I GROUP PLC	42,422	9.50	403,263.53
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,976	16.84	201,735.72
INVESTEC PLC	32,355	4.84	156,598.20
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	13,833	45.08	623,591.64
SCHRODERS PLC	5,525	26.64	147,186.00
ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	9.47	253,274.52
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	105,646	2.34	248,003.98
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	21.84	215,604.48
AVIVA PIC	181,949	4.25	773,829.09
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	3.52	242,652.06
LEGAL & GENERAL GROUP	269,808	2.71	732,798.52
PRUDENTIAL	112,358	15.36	1,725,818.88
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	51,693	5.41	279,969.28
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	18,245	18.60	339,357.00
SAGE GROUP PLC	46,955	6.62	311,123.83
BT GROUP PLC	382,244	2.29	876,676.61
VODAFONE GROUP PLC	1,191,443	1.42	1,696,376.54

	CENTRICA PLC	239,385	1.37	328,436.22
	NATIONAL GRID PLC	145,466	8.47	1,233,115.28
	SEVERN TRENT PLC	11,927	20.24	241,402.48
	SSE PLC	45,896	11.90	546,391.88
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	8.52	295,919.18
	イギリスbond 小計	13,323,303		78,604,209.10 (11,348,089,667)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	21.15	185,020.20
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	408	561.50	229,092.00
	GIVAUDAN-REG	401	2,455.00	984,455.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	21,140	48.93	1,034,380.20
	SIKA AG-BR	5,812	132.00	767,184.00
	ABB LTD	81,841	20.04	1,640,093.64
	GEBERIT AG-REG	1,662	397.60	660,811.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	219.80	200,237.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,651	226.20	373,456.20
	ADECCO GROUP AG-REG	6,618	52.98	350,621.64
	SGS SA	225	2,481.00	558,225.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,431	138.95	337,787.45
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	23,231	73.18	1,700,044.58
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,228	285.70	350,839.60
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	55.25	165,971.00
	DUFREY AG-REG	1,811	99.82	180,774.02
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	100	1,739.00	173,900.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	72,600.00	363,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	48	6,350.00	304,800.00
	NESTLE SA - REGISTERED	136,996	90.52	12,400,877.92
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,672	184.60	493,251.20
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	480	771.00	370,080.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,226	290.00	935,540.00
	NOVARTIS	96,975	90.68	8,793,693.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	31,426	276.70	8,695,574.20
	VIFOR PHARMA AG	2,126	128.10	272,340.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG	113,429	12.03	1,364,550.87
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,752	40.27	432,983.04
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	79.60	182,204.40
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	713	711.00	506,943.00
	UBS GROUP AG	172,537	12.50	2,156,712.50
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	159.10	371,339.40
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,587	416.70	661,302.90
	SWISS RE LTD	13,799	97.46	1,344,850.54
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,775	324.10	2,195,777.50

	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	84.40	305,696.80	
	TEMENOS AG - REG	2,443	141.30	345,195.90	
	SWISSCOM	1,239	454.40	563,001.60	
	スイスフラン 小計	766,695		52,952,608.90 (5,857,617,596)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,250	306.40	2,834,200.00	
	BOLIDEN AB	13,081	245.90	3,216,617.90	
	ALFA LAVAL AB	14,233	205.90	2,930,574.70	
	ASSA ABLOY AB-B	43,306	192.75	8,347,231.50	
	ATLAS COPCO A	28,978	255.00	7,389,390.00	
	ATLAS COPCO B	18,786	236.25	4,438,192.50	
	EPIROC AB-A	26,536	91.80	2,436,004.80	
	EPIROC AB-B	12,127	86.39	1,047,651.53	
	SANDVIK AB	48,851	152.40	7,444,892.40	
	SKANSKA B	17,528	164.25	2,878,974.00	
	SKF AB-B	18,340	159.65	2,927,981.00	
	VOLVO B	68,697	138.25	9,497,360.25	
	SECURITAS B	15,577	147.95	2,304,617.15	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,955	242.80	2,174,274.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	75.48	1,648,558.68	
	HENNES & MAURITZ B	41,410	139.94	5,794,915.40	
	ICA GRUPPEN AB	4,719	359.00	1,694,121.00	
	SWEDISH MATCH AB	6,770	446.10	3,020,097.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	28,761	265.20	7,627,417.20	
	NORDEA BANK ABP	134,014	84.70	11,350,985.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	69,722	94.96	6,620,801.12	
	SVENSKA HANDELSBK A	65,730	103.70	6,816,201.00	
	SWEDBANK AB-A	39,241	182.05	7,143,824.05	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	191.65	1,654,131.15	
	INVESTOR AB-B SHS	19,673	419.40	8,250,856.20	
	KINNEVIK AB - B	11,182	225.40	2,520,422.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,030	290.00	588,700.00	
	ERICSSON (LM) B	134,339	85.26	11,453,743.14	
HEXAGON AB-B SHS	12,400	482.90	5,987,960.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,225	562.50	1,814,062.50		
TELE2 AB-B SHS	18,919	120.50	2,279,739.50		
TELIA CO AB	133,145	40.15	5,345,771.75		
	スウェーデンクローナ 小計	1,099,997		151,480,270.02 (1,799,585,607)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	5,500	293.60	1,614,800.00	
	EQUINOR ASA	51,887	196.75	10,208,767.25	
	NORSK HYDRO	61,358	34.85	2,138,326.30	

	YARA INTERNATIONAL ASA	7,407	353.80	2,620,596.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	297.00	1,397,682.00	
	MOWI ASA	18,884	195.40	3,689,933.60	
	ORKLA	33,665	67.76	2,281,140.40	
	DNB ASA	43,059	161.55	6,956,181.45	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	151.50	1,689,679.50	
	TELENOR ASA	32,710	164.70	5,387,337.00	
	ノルウェークローネ 小計	270,329		37,984,444.10 (489,239,640)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,151	655.60	2,721,395.60	
	NOVOZYMES A/S	9,595	303.80	2,914,961.00	
	VESTAS WIND SYSEMS	9,068	548.00	4,969,264.00	
	ISS A/S	6,102	203.50	1,241,757.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	199	8,785.00	1,748,215.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	270	9,366.00	2,528,820.00	
	DSV A/S	8,200	540.00	4,428,000.00	
	PANDORA A/S	5,549	329.50	1,828,395.50	
	CARLSBERG AS-B	5,005	795.00	3,978,975.00	
	COLOPLAST-B	5,071	638.00	3,235,298.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,463	201.40	898,848.20	
	GENMAB A/S	2,406	1,008.00	2,425,248.00	
	H LUNDBECK A/S	3,647	292.90	1,068,206.30	
	NOVO NORDISK A/S-B	81,781	327.10	26,750,565.10	
	DANSKE BANK A/S	32,879	126.40	4,155,905.60	
TRYG A/S	5,192	175.40	910,676.80		
ORSTED A/S	8,810	478.50	4,215,585.00		
	デンマーククローネ 小計	192,388		70,020,116.10 (1,177,738,352)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,821	27.80	356,423.80	
	OIL SEARCH LTD	52,747	8.18	431,470.46	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	72,570	7.59	550,806.30	
	SANTOS	83,906	6.94	582,307.64	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,845	29.29	141,910.05	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	41,887	37.30	1,562,385.10	
	WORLEYPARSONS LTD	14,417	15.46	222,886.82	
	ALUMINA LIMITED	75,453	2.72	205,232.16	
	AMCOR	51,848	14.85	769,942.80	
	BHP GROUP LTD	131,644	37.94	4,994,573.36	
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	12.16	262,035.84	
	BORAL LIMITED	42,845	4.80	205,656.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	77,834	6.69	520,709.46	
INCITEC PIVOT LTD	81,242	3.28	266,473.76		

JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	15,221	17.79	270,781.59
NEWCREST MINING LIMITED	30,755	25.44	782,407.20
ORICA LTD	19,570	18.05	353,238.50
RIO TINTO LTD	17,915	94.94	1,700,850.10
SOUTH32 LTD	216,184	3.91	845,279.44
CIMIC GROUP LIMITED	2,943	48.65	143,176.95
BRAMBLES LTD	63,458	11.33	718,979.14
SEEK LTD	17,113	17.15	293,487.95
AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	4.66	436,194.64
TRANSURBAN GROUP	112,078	12.26	1,374,076.28
ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,733	24.64	634,061.12
CROWN RESORTS LTD	18,801	11.55	217,151.55
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,974	44.50	132,343.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,988	43.06	128,663.28
TABCORP HOLDINGS LTD	90,583	4.49	406,717.67
REA GROUP LTD	3,000	77.43	232,290.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,021	3.51	129,943.71
WESFARMERS LTD	50,229	32.72	1,643,492.88
COLES GROUP LTD	50,229	11.37	571,103.73
WOOLWORTHS GROUP LTD	57,160	28.69	1,639,920.40
COCA-COLA AMATIL LIMITED	22,146	8.36	185,140.56
TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	14.72	507,545.60
COCHLEAR LIMITED	2,282	173.45	395,812.90
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,451	59.53	443,558.03
SONIC HEALTHCARE LTD	19,089	24.30	463,862.70
CSL LIMITED	20,235	185.35	3,750,557.25
AUST AND NZ BANKING GROUP	129,340	27.27	3,527,101.80
BANK OF QUEENSLAND LTD	19,098	8.85	169,017.30
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	23,879	9.78	233,536.62
COMMONWEALTH BANK OF AUST	79,134	71.66	5,670,742.44
NATIONAL AUSTRALIA BANK	123,216	24.54	3,023,720.64
WESTPAC BANKING	154,963	26.42	4,094,122.46
AMP LTD	113,052	2.27	256,628.04
ASX LTD	7,739	68.69	531,591.91
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,531	7.70	235,088.70
MACQUARIE GROUP LIMITED	14,169	126.00	1,785,294.00
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	96,651	7.28	703,619.28
MEDIBANK PRIVATE LTD	102,821	2.82	289,955.22
QBE INSURANCE GROUP	54,883	11.30	620,177.90
SUNCORP GROUP LIMITED	60,266	12.85	774,418.10
COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	18.01	395,679.70
TELSTRA CORP	186,467	3.20	596,694.40

	TPG TELECOM LTD	22,697	6.83	155,020.51	
	AGL ENERGY LTD	26,594	21.31	566,718.14	
	AUSNET SERVICES	117,666	1.73	204,150.51	
	オーストラリアドル 小計	3,183,986		53,306,727.39 (4,245,347,769)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	49,092	4.98	244,478.16	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,114	7.34	360,496.76	
	A2 MILK CO LTD	23,672	14.22	336,615.84	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	26,518	13.38	354,810.84	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	11.30	248,600.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	66,673	3.89	259,691.33	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	3.58	229,241.72	
	ニュージーランドドル 小計	301,103		2,033,934.65 (154,599,372)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	120,448	82.20	9,900,825.60	
	NWS HOLDINGS LTD	73,500	19.74	1,450,890.00	
	MTR CORP	79,000	44.60	3,523,400.00	
	MINTH GROUP LTD	34,000	30.70	1,043,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	57,500	47.55	2,734,125.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	47,000	26.35	1,238,450.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	105,000	54.70	5,743,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	60,400	15.60	942,240.00	
	SANDS CHINA LTD	104,600	37.55	3,927,730.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	38,000	10.50	399,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	42,000	8.40	352,800.00	
	WYNN MACAU LTD	60,800	19.42	1,180,736.00	
	WH GROUP LTD	363,500	7.48	2,718,980.00	
	BANK EAST ASIA	46,964	28.20	1,324,384.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	162,500	32.80	5,330,000.00	
	HANG SENG BANK	33,700	188.40	6,349,080.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	54,900	260.00	14,274,000.00	
	AIA GROUP LTD	546,800	75.75	41,420,100.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	113,948	66.10	7,531,962.80	
	HANG LUNG GROUP LTD	29,000	24.10	698,900.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	72,000	18.94	1,363,680.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	51,601	44.85	2,314,304.85	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	31,000	42.10	1,305,100.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	33.35	1,233,950.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	305,000	12.98	3,958,900.00	
	SINO LAND CO	128,600	14.82	1,905,852.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	70,000	134.40	9,408,000.00		
SWIRE PACIFIC A	20,000	92.35	1,847,000.00		

	SWIRE PROPERTIES LTD	40,600	31.55	1,280,930.00	
	WHARF HOLDINGS	61,000	25.00	1,525,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	61,000	55.90	3,409,900.00	
	WHEELOCK & CO LTD	40,000	53.15	2,126,000.00	
	PCCW LTD	212,000	4.76	1,009,120.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	64.25	2,056,000.00	
	CLP HOLDINGS	72,500	95.65	6,934,625.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	405,870	17.86	7,248,838.20	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	59,000	53.20	3,138,800.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	85.10	995,670.00	
	香港ドル 小計	3,884,431		165,146,574.25 (2,328,566,696)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	57,500	6.32	363,400.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	2.66	164,920.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.77	281,996.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	117,400	1.42	166,708.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	113,900	2.43	276,777.00	
	SINGAPORE AIRLINES	17,500	10.02	175,350.00	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	14,600	5.14	75,044.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	1.10	351,670.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	84,550	2.49	210,529.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,600	36.55	168,130.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	486,720	0.26	126,547.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	76,800	3.35	257,280.00	
	DBS GROUP	79,000	25.08	1,981,320.00	
	OCBC BANK	136,050	11.67	1,587,703.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	58,100	25.98	1,509,438.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	7.86	334,050.00	
	CAPITALAND LTD	118,900	3.43	407,827.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	9.53	209,660.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	6.79	168,392.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	16.16	231,088.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	347,180	3.05	1,058,899.00	
	シンガポールドル 小計	2,272,900		10,106,729.20 (827,943,256)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	20.20	575,376.80	
	ELBIT SYSTEMS LTD	732	482.00	352,824.00	
	BANK HAPUALIM BM	40,686	24.80	1,009,012.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	59,200	24.00	1,420,800.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	68.66	430,635.52	
	AZRIELI GROUP	1,471	199.50	293,464.50	
	NICE LTD	2,295	415.60	953,802.00	

	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	54,899	3.29	180,892.20	
	イスラエルシェケル 小計	194,039		5,216,807.82 (159,999,495)	
	合 計	49,768,836		174,260,348,511 (174,260,348,511)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	58,685	550,465.30	
		LENDLEASE GROUP	27,483	378,990.57	
		SYDNEY AIRPORT	53,915	374,709.25	
		オーストラリアドル 小計	140,083	1,304,165.12 (103,863,710)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	1,053,000.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	2,205,200.00	
		香港ドル 小計	315,000	3,258,200.00 (45,940,620)	
	投資信託受益証券合計	455,083	149,804,330 (149,804,330)		
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	27,007	477,213.69	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,524	610,604.28	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	19,805	3,499,345.45	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	55,661	562,732.71	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,260	1,215,066.00	
		BOSTON PROPERTIES	6,944	929,593.28	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	11,000	218,680.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,103	395,939.50	
		CROWN CASTLE INTL CORP	18,686	2,234,471.88	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,268	1,098,165.32	
		DUKE REALTY CORP	15,871	474,860.32	
		EQUINIX INC	3,545	1,529,773.85	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	16,603	1,206,706.04	
		ESSEX PROPERTY TRUST	2,962	819,851.98	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,625	540,000.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,090	412,916.70	
		HCP INC	20,968	646,443.44	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,932	648,101.76	
		INVITATION HOMES INC	15,261	354,513.03	
		IRON MOUNTAIN INC	12,039	430,033.08	
KIMCO REALTY CORP	17,599	309,038.44			

	LIBERTY PROPERTY TRUST	5,658	269,037.90	
	MACERICH CO/THE	4,623	201,192.96	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,069	523,171.49	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,300	376,242.00	
	PROLOGIS INC	28,374	1,995,259.68	
	PUBLIC STORAGE	7,084	1,456,612.08	
	REALTY INCOME CORP	12,311	847,119.91	
	REGENCY CENTERS CORP	6,825	449,289.75	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,238	958,501.62	
	SIMON PROPERTY GROUP	13,909	2,492,770.98	
	SL GREEN REALTY CORP	4,007	364,116.09	
	UDR INC	11,920	528,413.60	
	VENTAS INC	16,040	1,015,813.20	
	VEREIT INC	40,232	328,293.12	
	VORNADO REALTY TRUST	7,639	519,299.22	
	WELLTOWER INC	16,702	1,265,176.50	
	WP CAREY INC	6,973	517,257.14	
	アメリカドル 小計	509,657	32,721,617.99 (3,622,283,111)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,812	177,801.12	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	225,235.10	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,942	99,910.32	
	カナダドル 小計	19,699	502,946.54 (42,272,656)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	
	COVIVIO(FP)	1,902	166,995.60	
	GECINA SA	1,960	244,804.00	
	ICADE	1,843	135,460.50	
	KLEPIERRE	8,356	251,515.60	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,283	903,621.06	
	ユーロ 小計	1,625,928	1,702,396.76 (213,633,769)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	224,786.15	
	HAMMERSON PLC	32,130	117,467.28	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	279,291.34	
	SEGRO PLC	43,067	274,164.52	
	イギリスポンド 小計	146,504	895,709.29 (129,313,550)	
オーストラリアドル	DEXUS	47,933	578,071.98	
	GOODMAN GROUP	73,073	934,603.67	
	GPT GROUP	84,564	496,390.68	
	MIRVAC GROUP	176,235	458,211.00	

	SCENTRE GROUP	228,183	883,068.21
	STOCKLAND	121,481	447,050.08
	VICINITY CENTERS	163,023	401,036.58
	オーストラリアドル 小計	894,492	4,198,432.20 (334,363,140)
香港ドル	LINK REIT	96,000	8,644,800.00
	香港ドル 小計	96,000	8,644,800.00 (121,891,680)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	120,300	333,231.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110,000	207,900.00
	CAPITALAND MALL TRUST	117,100	285,724.00
	SUNTEC REIT	113,000	216,960.00
	シンガポールドル 小計	460,400	1,043,815.00 (85,509,324)
	投資証券合計	3,752,680	4,549,267,230 (4,549,267,230)
	合計		4,699,071,560 (4,699,071,560)

(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	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 594銘柄	97.0%			66.1%
	投資証券 38銘柄			3.0%	2.0%
カナダドル	株式 88銘柄	99.4%			3.8%
	投資証券 3銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 237銘柄	99.0%			11.6%
	投資証券 6銘柄			1.0%	0.1%
イギリスポンド	株式 92銘柄	98.9%			6.3%
	投資証券 4銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.3%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	90.6%			2.4%

	投資信託受 3銘柄 益証券		2.2%		0.1%
	投資証券 7銘柄			7.1%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	93.3%			1.3%
	投資信託受 2銘柄 益証券		1.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.9%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	90.6%			0.5%
	投資証券 4銘柄			9.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2019年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	337,719,544
コール・ローン	2,660,220,973
国債証券	130,056,106,957
派生商品評価勘定	15,787,049
未収入金	560,342
未収利息	968,693,131
前払費用	34,441,754
差入委託証拠金	164,111,692
流動資産合計	134,237,641,442
資産合計	134,237,641,442
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,614,768
前受金	5,951,112
未払金	327,109
未払解約金	81,781,079
未払利息	6,370
その他未払費用	60
流動負債合計	90,680,498
負債合計	90,680,498

	2019年 2月21日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	56,992,555,742
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	77,154,405,202
元本等合計	134,146,960,944
純資産合計	134,146,960,944
負債純資産合計	134,237,641,442

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までには個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2019年 2月21日現在

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,992,555,742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) 2.3538円 (23,538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

	2019年 2月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年 2月21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>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 2月22日
期首元本額	61,331,732,290円
期中追加設定元本額	4,939,084,656円

区分	2019年 2月21日現在
期中一部解約元本額	9,278,261,204円
期末元本額	56,992,555,742円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,309,185,499円
D C 外国債券インデックスファンド	1,967,924,884円
D C 外国債券インデックスファンド L	11,952,066,904円
D C バランスファンド 3 0	740,646,156円
D C バランスファンド 5 0	716,654,157円
D C バランスファンド 7 0	136,292,903円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	446,396,203円
外国債券インデックス e	1,395,178,620円
インデックスコレクション（外国債券）	3,355,388,136円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	2,115,921,660円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	354,314,477円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	101,430,113円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,690,392,014円
外国債券パッシブファンド私募 A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,247,101,789円
外国債券インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	783,380,628円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	240,709,309円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	1,031,330,143円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	470,798,528円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	886,103,293円
V A バランス株式 3 0（適格機関投資家専用）	1,289,999円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	1,561,590,846円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	2,338,724,394円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	771,530,917円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	7,991,953,681円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	392,564,031円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	440,810,020円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,948,088,963円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	140,360,666円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	241,915,524円
V A バランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	124,477,867円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	62,284,957円
バランス V A 2 0（適格機関投資家専用）	113,318,467円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	3,678,397,797円
バランス V A 2 0 L（適格機関投資家専用）	14,163,564円
バランス V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	322,778,363円
世界バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	98,592,689円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	1,790,280,760円
私募外国債券インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	18,216,821円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 2月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		241,801,379
合計		241,801,379

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券マザーファンド」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

(2019年 2月21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	1,889,247,923	-	1,895,199,035	5,951,112
	合計	1,889,247,923	-	1,895,199,035	5,951,112

(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

(2019年 2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,510,389,031	-	2,517,610,200	7,221,169
	アメリカドル	1,275,114,240	-	1,277,495,600	2,381,360
	カナダドル	105,938,701	-	106,616,500	677,799
	ユーロ	955,657,500	-	957,488,700	1,831,200
	イギリスポンド	173,678,590	-	176,009,400	2,330,810
	合計	2,510,389,031	-	2,517,610,200	7,221,169

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 02/28/21	4,550,000.00	4,426,547.67	
		T 1.125% 03/31/20	2,000,000.00	1,969,731.86	
		T 1.125% 06/30/21	4,000,000.00	3,878,209.04	
		T 1.25% 01/31/20	4,000,000.00	3,953,059.32	
		T 1.25% 03/31/21	8,500,000.00	8,286,600.87	
		T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	3,747,046.82	
		T 1.25% 10/31/21	4,950,000.00	4,793,002.97	
		T 1.375% 01/31/21	1,600,000.00	1,565,473.96	
		T 1.375% 02/29/20	5,000,000.00	4,941,718.90	
		T 1.375% 03/31/20	4,500,000.00	4,443,263.32	
		T 1.375% 04/30/20	8,250,000.00	8,139,268.50	
		T 1.375% 04/30/21	3,000,000.00	2,928,829.47	
		T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,927,194.30	
		T 1.375% 08/31/20	1,750,000.00	1,719,740.40	
		T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,288,056.17	
		T 1.375% 09/30/20	2,950,000.00	2,896,348.23	
		T 1.375% 09/30/23	7,100,000.00	6,761,382.75	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,885,403.54	
		T 1.5% 01/31/22	3,000,000.00	2,917,659.54	
		T 1.5% 02/28/23	4,200,000.00	4,043,239.28	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,848,468.68	
		T 1.5% 08/15/26	8,300,000.00	7,694,056.92	
		T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,407,347.03	
		T 1.625% 04/30/23	8,100,000.00	7,826,197.56	
		T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,066,104.82	
		T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,200,145.80	

T 1.625% 07/31/20	1,200,000.00	1,184,562.56	
T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,360,557.07	
T 1.625% 08/31/22	500,000.00	485,771.84	
T 1.625% 10/15/20	5,270,000.00	5,192,929.78	
T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	3,878,975.00	
T 1.625% 11/30/20	5,000,000.00	4,922,372.05	
T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,578,022.34	
T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,573,865.38	
T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,446,862.00	
T 1.75% 04/30/22	2,000,000.00	1,956,164.40	
T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,497,258.95	
T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,698,900.66	
T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,443,122.10	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	3,948,561.28	
T 1.75% 12/31/20	3,000,000.00	2,958,974.22	
T 1.875% 04/30/22	2,800,000.00	2,749,374.60	
T 1.875% 05/31/22	2,350,000.00	2,306,343.34	
T 1.875% 06/30/20	3,200,000.00	3,172,071.64	
T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,547,675.33	
T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,469,460.39	
T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	1,957,933.04	
T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,444,376.95	
T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,179,195.09	
T 2.125% 05/15/25	7,250,000.00	7,076,839.69	
T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	2,975,806.83	
T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,087,909.03	
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,471,407.72	
T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,875,201.60	
T 2.125% 08/31/20	1,000,000.00	993,961.64	
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	1,982,224.44	
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,155,915.05	
T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,656,981.17	
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,370,841.92	
T 2.125% 12/31/22	6,800,000.00	6,711,989.98	
T 2.25% 01/31/24	8,100,000.00	8,012,836.95	
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,803,857.59	
T 2.25% 03/31/21	900,000.00	895,378.43	
T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,675,370.40	
T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,475,665.39	
T 2.25% 08/15/27	6,330,000.00	6,155,940.57	
T 2.25% 08/15/46	7,450,000.00	6,412,814.05	
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,465,429.42	

T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	4,929,298.25
T 2.25% 11/15/25	6,500,000.00	6,378,004.88
T 2.25% 11/15/27	6,800,000.00	6,602,129.72
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,463,477.95
T 2.25% 12/31/24	3,700,000.00	3,646,246.77
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,541,228.56
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	6,656,211.94
T 2.375% 12/31/20	4,300,000.00	4,288,719.85
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	3,995,196.12
T 2.5% 02/15/45	5,350,000.00	4,878,408.46
T 2.5% 02/15/46	7,500,000.00	6,817,890.97
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,701,474.63
T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,453,396.52
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,513,306.62
T 2.625% 08/15/20	2,400,000.00	2,403,055.36
T 2.625% 11/15/20	2,350,000.00	2,353,542.90
T 2.75% 02/15/24	7,250,000.00	7,340,498.85
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,714,529.19
T 2.75% 08/15/42	2,100,000.00	2,023,266.58
T 2.75% 08/15/47	4,700,000.00	4,478,258.79
T 2.75% 09/30/20	1,400,000.00	1,404,676.25
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,503,508.26
T 2.75% 11/15/42	2,740,000.00	2,636,714.08
T 2.75% 11/15/47	4,700,000.00	4,476,093.41
T 2.875% 05/15/28	2,260,000.00	2,303,613.33
T 2.875% 05/15/43	1,250,000.00	1,228,102.80
T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,280,358.22
T 2.875% 08/15/45	8,130,000.00	7,967,466.66
T 2.875% 10/15/21	4,250,000.00	4,292,740.76
T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,058,490.59
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,382,711.59
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	5,873,161.22
T 2% 02/28/21	3,150,000.00	3,118,742.58
T 2% 05/31/21	5,500,000.00	5,441,099.01
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,463,583.12
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	975,233.28
T 2% 07/31/20	4,000,000.00	3,969,755.28
T 2% 07/31/22	6,000,000.00	5,907,749.82
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,628,068.07
T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,150,821.94
T 2% 09/30/20	4,000,000.00	3,966,996.44
T 2% 10/31/21	4,200,000.00	4,148,388.38
T 2% 11/15/21	1,300,000.00	1,284,098.43

T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,589,914.60
T 2% 11/30/20	2,800,000.00	2,774,582.80
T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,406,143.60
T 2% 12/31/21	3,380,000.00	3,337,085.01
T 3.125% 02/15/42	1,300,000.00	1,338,021.52
T 3.125% 02/15/43	2,100,000.00	2,155,094.27
T 3.125% 05/15/21	6,250,000.00	6,335,392.18
T 3.125% 08/15/44	7,200,000.00	7,386,763.89
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	895,854.28
T 3.375% 05/15/44	1,500,000.00	1,604,793.21
T 3.5% 02/15/39	1,100,000.00	1,209,741.24
T 3.5% 05/15/20	300,000.00	303,426.48
T 3.625% 02/15/20	9,800,000.00	9,901,493.30
T 3.625% 02/15/21	7,050,000.00	7,202,792.95
T 3.625% 02/15/44	5,850,000.00	6,516,205.83
T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	1,781,200.60
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,247,313.51
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,407,139.80
T 3.875% 08/15/40	1,550,000.00	1,789,439.98
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,107,562.62
T 3% 05/15/45	200,000.00	200,742.25
T 3% 05/15/47	3,400,000.00	3,407,873.51
T 3% 09/30/25	7,000,000.00	7,191,633.68
T 3% 10/31/25	5,950,000.00	6,113,235.33
T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,057,589.87
T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,031,695.94
T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,093,564.50
T 4.375% 02/15/38	700,000.00	862,368.33
T 4.375% 05/15/40	1,600,000.00	1,975,209.24
T 4.375% 05/15/41	1,350,000.00	1,670,076.25
T 4.375% 11/15/39	1,050,000.00	1,295,368.35
T 4.5% 02/15/36	1,000,000.00	1,237,298.97
T 4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,566,935.18
T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	1,911,720.81
T 4.75% 02/15/41	350,000.00	454,189.85
T 5.0% 05/15/37	650,000.00	857,219.03
T 5.25% 02/15/29	500,000.00	612,876.24
T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,099,052.29
T 5.375% 02/15/31	750,000.00	954,957.36
T 5.5% 08/15/28	250,000.00	309,415.29
T 6.0% 02/15/26	600,000.00	731,387.40
T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,334,926.93

	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	967,813.48	
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,563,950.07	
	T 6.5% 11/15/26	450,000.00	573,233.16	
	T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	2,976,093.01	
	T 8.75% 08/15/20	6,340,000.00	6,909,422.15	
	アメリカドル 小計	546,110,000.00	543,653,926.17 (60,182,489,627)	
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	850,000.00	818,069.75	
	CAN 0.75% 03/01/21	1,980,000.00	1,940,073.30	
	CAN 0.75% 09/01/20	1,750,000.00	1,723,478.75	
	CAN 0.75% 09/01/21	1,500,000.00	1,462,312.50	
	CAN 1.5% 03/01/20	2,620,000.00	2,612,690.20	
	CAN 1.5% 06/01/23	2,440,000.00	2,410,610.20	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,450,000.00	1,414,873.75	
	CAN 1% 06/01/27	1,060,000.00	989,059.50	
	CAN 1% 09/01/22	1,150,000.00	1,119,128.25	
	CAN 2.25% 06/01/25	970,000.00	993,798.95	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,530,000.00	1,583,366.40	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,100,000.00	1,133,687.50	
	CAN 2.75% 12/01/48	870,000.00	985,614.30	
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	415,387.00	
	CAN 2% 06/01/28	350,000.00	353,104.50	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,400,000.00	1,445,871.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,550,000.00	2,605,054.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,500,000.00	1,907,362.50	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,391,717.25	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,110,000.00	1,503,539.40	
	CAN 5.75% 06/01/33	590,000.00	862,305.65	
	CAN 5% 06/01/37	1,060,000.00	1,523,659.90	
	CAN 8.0% 06/01/27	480,000.00	704,498.40	
	カナダドル 小計	29,710,000.00	31,899,263.45 (2,681,133,092)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	7,174,784.00	
	MBONO 10% 12/05/24	22,350,000.00	24,272,323.50	
	MBONO 5.75% 03/05/26	8,450,000.00	7,350,443.75	
	MBONO 6.5% 06/09/22	17,400,000.00	16,598,904.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	25,200,000.00	24,348,618.00	
	MBONO 7.25% 12/09/21	2,300,000.00	2,249,883.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	13,350,000.00	12,738,303.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	11,850,000.00	11,199,968.25	
	MBONO 7.75% 11/13/42	15,500,000.00	13,986,347.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	7,650,000.00	7,092,812.25	
	MBONO 8.5% 05/31/29	8,000,000.00	8,075,880.00	

	MBONO 8.5% 11/18/38	8,200,000.00	8,035,057.00
	MBONO 8% 06/11/20	22,400,000.00	22,358,784.00
	MBONO 8% 11/07/47	4,650,000.00	4,287,718.50
	MBONO 8% 12/07/23	9,200,000.00	9,156,438.00
	メキシコペソ 小計	182,900,000.00	178,926,264.75 (1,030,615,284)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	180,000.00	183,121.20
	BGB 0.5% 10/22/24	350,000.00	359,978.50
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,149,296.50
	BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	774,682.50
	BGB 0.8% 06/22/28	840,000.00	861,163.80
	BGB 0.9% 06/22/29	250,000.00	256,346.25
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	412,282.00
	BGB 1.6% 06/22/47	710,000.00	714,696.65
	BGB 1.9% 06/22/38	330,000.00	363,174.90
	BGB 1% 06/22/26	1,200,000.00	1,266,240.00
	BGB 1% 06/22/31	1,360,000.00	1,387,186.40
	BGB 2.15% 06/22/66	310,000.00	334,372.20
	BGB 2.25% 06/22/23	970,000.00	1,076,084.05
	BGB 2.25% 06/22/57	290,000.00	324,553.50
	BGB 2.6% 06/22/24	1,200,000.00	1,371,114.00
	BGB 3.75% 06/22/45	620,000.00	924,079.00
	BGB 3.75% 09/28/20	1,130,000.00	1,207,139.45
	BGB 3% 06/22/34	500,000.00	637,532.50
	BGB 4.25% 03/28/41	1,240,000.00	1,917,412.00
	BGB 4.25% 09/28/21	1,250,000.00	1,403,625.00
	BGB 4.25% 09/28/22	1,330,000.00	1,552,103.35
	BGB 4.5% 03/28/26	950,000.00	1,239,379.50
	BGB 4% 03/28/22	790,000.00	898,522.30
	BGB 4% 03/28/32	450,000.00	624,890.25
	BGB 5.5% 03/28/28	1,350,000.00	1,955,799.00
	BGB 5% 03/28/35	1,430,000.00	2,252,793.40
	BTPS 0.05% 04/15/21	1,720,000.00	1,694,750.40
	BTPS 0.2% 10/15/20	900,000.00	895,954.50
	BTPS 0.35% 06/15/20	900,000.00	900,252.00
	BTPS 0.35% 11/01/21	800,000.00	786,896.00
	BTPS 0.65% 10/15/23	560,000.00	534,002.00
	BTPS 0.65% 11/01/20	1,200,000.00	1,202,760.00
	BTPS 0.95% 03/01/23	1,800,000.00	1,756,053.00
	BTPS 1.25% 12/01/26	1,600,000.00	1,470,648.00
	BTPS 1.35% 04/15/22	2,400,000.00	2,407,956.00
	BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,022,085.40
	BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,552,836.50

BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	579,633.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,437,457.50	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,281,784.50	
BTPS 1.65% 03/01/32	450,000.00	384,588.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,350,000.00	2,249,361.25	
BTPS 2.15% 12/15/21	1,700,000.00	1,750,371.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,680,000.00	1,631,641.20	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,170,000.00	1,015,788.15	
BTPS 2.45% 09/01/33	500,000.00	458,632.50	
BTPS 2.5% 12/01/24	1,800,000.00	1,839,726.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,700,000.00	1,459,492.50	
BTPS 2.8% 03/01/67	520,000.00	423,885.80	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,100,000.00	1,096,546.00	
BTPS 2.95% 09/01/38	550,000.00	510,411.00	
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,031,047.50	
BTPS 3.25% 09/01/46	450,000.00	426,098.25	
BTPS 3.35% 03/01/35	650,000.00	651,777.75	
BTPS 3.45% 03/01/48	810,000.00	781,265.25	
BTPS 3.5% 03/01/30	1,850,000.00	1,937,320.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	1,550,000.00	1,644,743.75	
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,648,758.25	
BTPS 3.75% 08/01/21	1,900,000.00	2,027,870.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	3,570,000.00	3,879,072.75	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,750,000.00	2,862,172.50	
BTPS 4.5% 02/01/20	880,000.00	915,486.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	1,460,000.00	1,637,105.30	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,250,000.00	2,555,550.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	1,050,000.00	1,170,225.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,817,609.50	
BTPS 4.75% 09/01/21	2,630,000.00	2,874,655.75	
BTPS 4.75% 09/01/28	1,650,000.00	1,927,777.50	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,765,912.50	
BTPS 4% 02/01/37	2,000,000.00	2,167,980.00	
BTPS 4% 09/01/20	1,470,000.00	1,548,505.35	
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	1,737,756.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	2,300,000.00	2,778,963.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	1,936,682.50	
BTPS 5.5% 11/01/22	2,200,000.00	2,511,993.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,010,000.00	2,568,378.00	
BTPS 5% 03/01/22	1,450,000.00	1,611,667.75	
BTPS 5% 03/01/25	1,300,000.00	1,504,087.00	
BTPS 5% 08/01/34	1,800,000.00	2,166,444.00	

BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	1,925,640.00
BTPS 6.5% 11/01/27	1,250,000.00	1,615,450.00
BTPS 6% 05/01/31	2,300,000.00	2,970,967.50
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	465,783.50
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,382,453.00
DBR 0.25% 02/15/27	2,930,000.00	3,017,314.00
DBR 0.25% 02/15/29	300,000.00	304,513.50
DBR 0.25% 08/15/28	260,000.00	265,081.70
DBR 0.5% 02/15/25	700,000.00	733,866.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,150,990.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,270,000.00	1,328,750.20
DBR 0.5% 08/15/27	900,000.00	943,402.50
DBR 0% 08/15/26	2,050,000.00	2,075,584.00
DBR 1.25% 08/15/48	910,000.00	1,036,731.15
DBR 1.5% 02/15/23	1,950,000.00	2,105,064.00
DBR 1.5% 05/15/23	1,360,000.00	1,473,893.20
DBR 1.5% 05/15/24	1,450,000.00	1,592,897.50
DBR 1.5% 09/04/22	2,050,000.00	2,197,292.50
DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,384,731.25
DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,777,272.75
DBR 1% 08/15/24	1,950,000.00	2,095,011.75
DBR 1% 08/15/25	1,500,000.00	1,624,027.50
DBR 2.25% 09/04/20	1,900,000.00	1,982,859.00
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,089,756.50
DBR 2.5% 01/04/21	2,130,000.00	2,254,636.95
DBR 2.5% 07/04/44	1,800,000.00	2,572,857.00
DBR 2.5% 08/15/46	1,750,000.00	2,539,661.25
DBR 2% 01/04/22	970,000.00	1,041,474.45
DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	2,098,759.95
DBR 3.25% 07/04/21	1,700,000.00	1,854,317.50
DBR 3.25% 07/04/42	1,050,000.00	1,657,761.00
DBR 3% 07/04/20	2,750,000.00	2,884,997.50
DBR 4.0% 01/04/37	1,550,000.00	2,493,857.00
DBR 4.25% 07/04/39	970,000.00	1,668,026.55
DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	1,012,102.00
DBR 4.75% 07/04/34	1,430,000.00	2,373,313.80
DBR 4.75% 07/04/40	1,050,000.00	1,944,710.25
DBR 5.5% 01/04/31	1,160,000.00	1,891,182.80
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,259,817.50
DBR 6.25% 01/04/24	720,000.00	954,928.80
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	1,017,266.50
DBR 6.5% 07/04/27	200,000.00	311,109.00
FRTR 0.25% 11/25/20	1,350,000.00	1,367,772.75

FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	2,050,625.25	
FRTR 0.5% 05/25/25	3,100,000.00	3,190,272.00	
FRTR 0.5% 05/25/26	2,250,000.00	2,302,548.75	
FRTR 0.75% 05/25/28	3,280,000.00	3,366,903.60	
FRTR 0% 02/25/20	890,000.00	894,770.40	
FRTR 0% 03/25/23	900,000.00	908,707.50	
FRTR 0% 03/25/24	950,000.00	954,693.00	
FRTR 0% 05/25/20	2,050,000.00	2,063,622.25	
FRTR 0% 05/25/21	1,000,000.00	1,010,210.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	350,000.00	363,567.75	
FRTR 1.25% 05/25/36	1,750,000.00	1,789,042.50	
FRTR 1.5% 05/25/31	3,200,000.00	3,475,328.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,821,871.00	
FRTR 1.75% 05/25/66	540,000.00	539,667.90	
FRTR 1.75% 06/25/39	970,000.00	1,060,384.60	
FRTR 1.75% 11/25/24	3,000,000.00	3,309,705.00	
FRTR 1% 05/25/27	2,900,000.00	3,059,920.50	
FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,376,001.60	
FRTR 2.25% 05/25/24	2,390,000.00	2,687,411.60	
FRTR 2.25% 10/25/22	2,470,000.00	2,703,044.50	
FRTR 2.5% 05/25/30	2,150,000.00	2,578,817.50	
FRTR 2.5% 10/25/20	3,450,000.00	3,624,690.75	
FRTR 2.75% 10/25/27	2,400,000.00	2,895,972.00	
FRTR 2% 05/25/48	750,000.00	835,185.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	2,710,000.00	3,803,647.60	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,120,000.00	4,528,971.80	
FRTR 3.5% 04/25/20	1,950,000.00	2,042,420.25	
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,873,433.20	
FRTR 3.75% 04/25/21	3,700,000.00	4,040,363.00	
FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	4,153,968.75	
FRTR 4.25% 10/25/23	4,000,000.00	4,838,820.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	2,450,000.00	3,989,616.75	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,250,000.00	3,526,605.00	
FRTR 4% 04/25/55	1,090,000.00	1,798,091.25	
FRTR 4% 04/25/60	920,000.00	1,554,956.40	
FRTR 4% 10/25/38	1,800,000.00	2,705,112.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,735,600.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	2,220,000.00	3,640,389.30	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	2,023,112.50	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,504,816.50	
IRISH 0.8% 03/15/22	450,000.00	464,634.00	
IRISH 0.9% 05/15/28	380,000.00	387,647.50	

IRISH 1.1% 05/15/29	240,000.00	246,327.60
IRISH 1.7% 05/15/37	660,000.00	694,273.80
IRISH 1% 05/15/26	740,000.00	772,301.00
IRISH 2.4% 05/15/30	820,000.00	949,010.60
IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	677,591.80
IRISH 3.4% 03/18/24	420,000.00	491,431.50
IRISH 3.9% 03/20/23	580,000.00	675,543.40
IRISH 4.5% 04/18/20	980,000.00	1,036,707.70
IRISH 5.4% 03/13/25	950,000.00	1,245,264.75
IRISH 5% 10/18/20	440,000.00	479,831.00
NETHER 0.25% 07/15/25	630,000.00	645,075.90
NETHER 0.5% 07/15/26	1,450,000.00	1,505,999.00
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	948,681.00
NETHER 0.75% 07/15/28	600,000.00	630,477.00
NETHER 0% 01/15/22	1,100,000.00	1,115,708.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,620,000.00	1,770,749.10
NETHER 2.25% 07/15/22	1,120,000.00	1,224,048.00
NETHER 2.5% 01/15/33	910,000.00	1,156,564.50
NETHER 2.75% 01/15/47	970,000.00	1,446,197.25
NETHER 2% 07/15/24	1,560,000.00	1,749,111.00
NETHER 3.25% 07/15/21	1,300,000.00	1,419,522.00
NETHER 3.5% 07/15/20	710,000.00	750,651.05
NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	349,434.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,080,000.00	1,779,904.80
NETHER 4% 01/15/37	1,120,000.00	1,767,169.60
NETHER 5.5% 01/15/28	850,000.00	1,257,281.75
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	918,043.00
OBL 0.25% 10/16/20	1,800,000.00	1,824,606.00
OBL 0% 04/08/22	1,030,000.00	1,047,190.70
OBL 0% 04/14/23	600,000.00	611,451.00
OBL 0% 04/17/20	2,050,000.00	2,063,796.50
RAGB 0.75% 02/20/28	40,000.00	41,502.60
RAGB 0.75% 10/20/26	1,800,000.00	1,881,540.00
RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	657,501.00
RAGB 0% 09/20/22	270,000.00	273,365.55
RAGB 1.2% 10/20/25	810,000.00	874,625.85
RAGB 1.5% 02/20/47	100,000.00	107,198.00
RAGB 1.5% 11/02/86	190,000.00	187,265.90
RAGB 1.65% 10/21/24	650,000.00	715,663.00
RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	820,923.75
RAGB 2.1% 09/20/17	290,000.00	356,405.65
RAGB 2.4% 05/23/34	520,000.00	637,678.60
RAGB 3.15% 06/20/44	730,000.00	1,060,460.05

RAGB 3.4% 11/22/22	670,000.00	765,200.30
RAGB 3.5% 09/15/21	1,100,000.00	1,213,261.50
RAGB 3.65% 04/20/22	570,000.00	643,108.20
RAGB 3.8% 01/26/62	260,000.00	468,501.80
RAGB 3.9% 07/15/20	880,000.00	934,212.40
RAGB 4.15% 03/15/37	1,000,000.00	1,542,940.00
RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,271,655.75
RAGB 6.25% 07/15/27	370,000.00	556,681.65
RFGB 0.5% 04/15/26	420,000.00	432,845.70
RFGB 0.5% 09/15/27	180,000.00	184,005.00
RFGB 0.5% 09/15/28	140,000.00	141,934.10
RFGB 0.75% 04/15/31	350,000.00	357,255.50
RFGB 0.875% 09/15/25	190,000.00	201,138.75
RFGB 0% 04/15/22	250,000.00	252,975.00
RFGB 1.125% 04/15/34	260,000.00	274,688.70
RFGB 1.375% 04/15/47	170,000.00	185,215.85
RFGB 1.5% 04/15/23	720,000.00	773,802.00
RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	407,040.80
RFGB 2.625% 07/04/42	410,000.00	560,695.50
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	466,144.10
RFGB 2% 04/15/24	200,000.00	222,490.00
RFGB 3.375% 04/15/20	770,000.00	804,580.70
RFGB 3.5% 04/15/21	720,000.00	781,675.20
RFGB 4% 07/04/25	360,000.00	453,335.40
SPGB 0.05% 01/31/21	500,000.00	502,297.50
SPGB 0.4% 04/30/22	1,770,000.00	1,796,470.35
SPGB 0.45% 10/31/22	800,000.00	813,184.00
SPGB 0.75% 07/30/21	1,000,000.00	1,022,310.00
SPGB 1.15% 07/30/20	950,000.00	969,722.00
SPGB 1.3% 10/31/26	1,750,000.00	1,805,650.00
SPGB 1.4% 01/31/20	660,000.00	670,754.70
SPGB 1.4% 04/30/28	1,420,000.00	1,453,000.80
SPGB 1.4% 07/30/28	450,000.00	458,095.50
SPGB 1.45% 10/31/27	2,250,000.00	2,322,753.75
SPGB 1.5% 04/30/27	1,200,000.00	1,247,802.00
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,329,156.25
SPGB 1.95% 04/30/26	1,560,000.00	1,685,158.80
SPGB 1.95% 07/30/30	1,560,000.00	1,643,709.60
SPGB 2.15% 10/31/25	1,550,000.00	1,698,063.75
SPGB 2.35% 07/30/33	1,050,000.00	1,129,616.25
SPGB 2.7% 10/31/48	600,000.00	635,844.00
SPGB 2.75% 10/31/24	1,900,000.00	2,143,295.00

	SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,223,469.50
	SPGB 3.45% 07/30/66	700,000.00	837,200.00
	SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,763,167.50
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,420,000.00	1,911,973.20
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,574,482.80
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,767,970.80
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,390,000.00	2,018,884.65
	SPGB 4.8% 01/31/24	860,000.00	1,048,808.70
	SPGB 4.85% 10/31/20	1,000,000.00	1,086,755.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,220,000.00	1,808,271.80
	SPGB 4% 04/30/20	2,650,000.00	2,785,507.75
	SPGB 5.15% 10/31/28	750,000.00	1,020,022.50
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,040,000.00	1,620,158.80
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,870,000.00	3,471,049.75
	SPGB 5.5% 04/30/21	2,740,000.00	3,080,116.20
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	2,180,633.25
	SPGB 5.85% 01/31/22	1,800,000.00	2,114,424.00
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,850,000.00	2,524,463.75
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,399,228.00
	ユーロ 小計	348,070,000.00	401,413,969.70 (50,373,439,057)
イギリスボ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	950,000.00	941,549.75
	UKT 0.75% 07/22/23	1,950,000.00	1,942,833.75
	UKT 1.25% 07/22/27	1,390,000.00	1,408,931.80
	UKT 1.5% 01/22/21	2,570,000.00	2,607,226.45
	UKT 1.5% 07/22/26	2,150,000.00	2,229,550.00
	UKT 1.5% 07/22/47	1,480,000.00	1,412,378.80
	UKT 1.625% 10/22/28	1,350,000.00	1,405,127.25
	UKT 1.625% 10/22/71	160,000.00	162,363.20
	UKT 1.75% 07/22/57	500,000.00	518,402.50
	UKT 1.75% 09/07/22	1,640,000.00	1,695,284.40
	UKT 1.75% 09/07/37	1,440,000.00	1,467,453.60
	UKT 1% 04/22/24	300,000.00	301,641.00
	UKT 2.25% 09/07/23	950,000.00	1,010,101.75
	UKT 2.5% 07/22/65	1,350,000.00	1,747,764.00
	UKT 2.75% 09/07/24	420,000.00	462,457.80
	UKT 2% 07/22/20	2,350,000.00	2,391,853.50
	UKT 2% 09/07/25	1,450,000.00	1,549,651.25
	UKT 3.25% 01/22/44	1,550,000.00	2,033,204.75
	UKT 3.5% 01/22/45	1,250,000.00	1,716,256.25
	UKT 3.5% 07/22/68	1,750,000.00	2,878,793.75
UKT 3.75% 07/22/52	1,110,000.00	1,708,428.75	
UKT 3.75% 09/07/20	890,000.00	930,975.60	

	UKT 3.75% 09/07/21	620,000.00	666,980.50
	UKT 4.25% 03/07/36	1,740,000.00	2,438,697.00
	UKT 4.25% 06/07/32	1,100,000.00	1,478,785.00
	UKT 4.25% 09/07/39	930,000.00	1,352,866.35
	UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	949,226.25
	UKT 4.25% 12/07/40	1,220,000.00	1,797,590.70
	UKT 4.25% 12/07/46	1,600,000.00	2,497,344.00
	UKT 4.25% 12/07/49	1,060,000.00	1,711,597.90
	UKT 4.25% 12/07/55	1,350,000.00	2,326,664.25
	UKT 4.5% 09/07/34	1,350,000.00	1,910,196.00
	UKT 4.5% 12/07/42	1,340,000.00	2,080,597.90
	UKT 4.75% 03/07/20	800,000.00	833,076.00
	UKT 4.75% 12/07/30	1,000,000.00	1,376,725.00
	UKT 4.75% 12/07/38	620,000.00	949,700.50
	UKT 4% 01/22/60	1,000,000.00	1,716,760.00
	UKT 4% 03/07/22	1,750,000.00	1,920,563.75
	UKT 5% 03/07/25	1,600,000.00	1,984,856.00
	UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	651,300.75
	UKT 8% 06/07/21	400,000.00	466,256.00
	イギリスポンド 小計	49,630,000.00	61,632,013.75 (8,897,813,825)
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	3,200,000.00	3,330,064.00
	SGB 0.75% 11/12/29	1,980,000.00	2,037,637.80
	SGB 1.5% 11/13/23	5,270,000.00	5,684,880.75
	SGB 1% 11/12/26	3,210,000.00	3,417,414.15
	SGB 2.5% 05/12/25	4,150,000.00	4,795,677.75
	SGB 3.5% 03/30/39	3,210,000.00	4,679,538.00
	SGB 3.5% 06/01/22	7,450,000.00	8,379,499.25
	SGB 5% 12/01/20	6,420,000.00	7,043,831.40
	スウェーデンクローナ 小計	34,890,000.00	39,368,543.10 (467,698,292)
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	3,150,000.00	3,152,189.25
	NGB 1.75% 02/17/27	2,900,000.00	2,940,962.50
	NGB 1.75% 03/13/25	1,690,000.00	1,723,588.75
	NGB 2% 04/26/28	1,500,000.00	1,548,622.50
	NGB 2% 05/24/23	4,550,000.00	4,687,273.50
	NGB 3.75% 05/25/21	5,420,000.00	5,735,579.50
	NGB 3% 03/14/24	3,550,000.00	3,838,845.75
	ノルウェークローネ 小計	22,760,000.00	23,627,061.75 (304,316,555)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/20	4,010,000.00	4,070,009.65
	DGB 0.5% 11/15/27	2,000,000.00	2,085,120.00

	DGB 1.5% 11/15/23	3,700,000.00	4,030,965.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,280,000.00	5,976,168.00	
	DGB 3% 11/15/21	6,200,000.00	6,804,252.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	9,820,000.00	17,494,280.90	
デンマーククローネ 小計		31,010,000.00	40,460,795.55	(680,550,581)
ポーランドズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	1,750,000.00	1,752,187.50	
	POLGB 1.75% 07/25/21	2,050,000.00	2,058,374.25	
	POLGB 2.25% 04/25/22	2,000,000.00	2,029,440.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	1,040,000.00	1,063,535.20	
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,150,000.00	3,158,473.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,910,000.00	1,902,656.05	
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,560,000.00	1,574,258.40	
	POLGB 2% 04/25/21	2,630,000.00	2,656,050.15	
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,000,000.00	2,110,190.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,870,000.00	3,123,650.60	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,300,000.00	2,444,417.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,151,986.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	1,300,000.00	1,474,635.50	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,130,000.00	1,251,706.65	
ポーランドズロチ 小計		26,590,000.00	27,751,561.30	(804,517,762)
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	1,750,000.00	1,750,262.50	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,450,000.00	1,470,169.50	
	ACGB 2.5% 05/21/30	590,000.00	612,240.05	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,400,000.00	1,470,077.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	180,000.00	185,068.80	
	ACGB 2.75% 06/21/35	580,000.00	610,267.30	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,900,000.00	2,006,077.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,750,000.00	1,850,292.50	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,440,000.00	1,528,300.80	
	ACGB 2% 12/21/21	1,900,000.00	1,917,983.50	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,050,000.00	2,219,084.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,530,000.00	1,690,504.65	
	ACGB 3.25% 06/21/39	550,000.00	615,290.50	
	ACGB 3.75% 04/21/37	820,000.00	977,944.30	
	ACGB 3% 03/21/47	830,000.00	889,079.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,150,000.00	2,484,411.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	1,360,000.00	1,401,799.60	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,220,000.00	1,553,291.80	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,400,000.00	2,895,540.00	
ACGB 5.5% 04/21/23	1,820,000.00	2,100,052.50		
ACGB 5.75% 05/15/21	2,000,000.00	2,175,580.00		

	ACGB 5.75% 07/15/22	2,000,000.00	2,269,930.00	
オーストラリアドル 小計		31,670,000.00	34,673,246.70 (2,761,377,367)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	290,000.00	285,027.95	
	SIGB 2.125% 06/01/26	200,000.00	200,985.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	720,000.00	725,169.60	
	SIGB 2.25% 08/01/36	210,000.00	205,592.10	
	SIGB 2.375% 06/01/25	350,000.00	357,392.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	70,000.00	72,985.15	
	SIGB 2.75% 03/01/46	380,000.00	395,262.70	
	SIGB 2.75% 04/01/42	380,000.00	397,233.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	500,000.00	516,435.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	100,000.00	106,811.50	
	SIGB 2.875% 09/01/30	370,000.00	394,660.50	
	SIGB 2% 07/01/20	320,000.00	320,300.80	
	SIGB 3.125% 09/01/22	320,000.00	332,824.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	600,000.00	611,820.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	270,000.00	304,064.55	
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	585,483.05	
	SIGB 3% 09/01/24	470,000.00	494,806.60	
シンガポールドル 小計		6,080,000.00	6,306,853.50 (516,657,438)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,200,000.00	2,181,223.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,287,149.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	550,000.00	550,426.25	
	MGS 3.502% 05/31/27	670,000.00	647,008.95	
	MGS 3.62% 11/30/21	950,000.00	952,265.75	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	816,428.10	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,350,000.00	1,357,627.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,200,000.00	1,189,926.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	150,000.00	150,589.50	
	MGS 4.059% 09/30/24	750,000.00	759,067.50	
	MGS 4.127% 04/15/32	690,000.00	679,819.05	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,880,000.00	1,905,709.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,650,000.00	1,680,657.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,050,000.00	1,029,136.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,650,000.00	1,695,515.25	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,900,000.00	1,965,398.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,203,447.80	
MGS 4.935% 09/30/43	1,210,000.00	1,254,528.00		
MGS 5.248% 09/15/28	950,000.00	1,040,473.25		
マレーシアリンギット 小計		22,120,000.00	22,346,395.90 (608,045,432)	

南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	16,050,000.00	17,564,959.50
	SAGB 6.25% 03/31/36	10,300,000.00	7,389,323.00
	SAGB 6.5% 02/28/41	7,550,000.00	5,300,024.50
	SAGB 6.75% 03/31/21	3,900,000.00	3,877,711.50
	SAGB 7.75% 02/28/23	5,300,000.00	5,278,084.50
	SAGB 7% 02/28/31	8,840,000.00	7,313,641.40
	SAGB 8.25% 03/31/32	5,300,000.00	4,796,447.00
	SAGB 8.5% 01/31/37	9,000,000.00	8,030,700.00
	SAGB 8.75% 01/31/44	11,600,000.00	10,391,744.00
	SAGB 8.75% 02/28/48	11,300,000.00	10,116,494.50
	SAGB 8.875% 02/28/35	2,800,000.00	2,612,078.00
	SAGB 8% 01/31/30	8,200,000.00	7,460,196.00
	SAGB 9% 01/31/40	4,850,000.00	4,482,855.00
	南アフリカランド 小計	104,990,000.00	94,614,258.90 (747,452,645)
合計		130,056,106,957 (130,056,106,957)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 158銘柄	100.0%	46.3%
カナダドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 268銘柄	100.0%	38.7%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 19銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

【DCバランスファンド30】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期中間計算期間(2019年2月22日から2019年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	81,939,255	65,949,183
親投資信託受益証券	18,144,450,639	18,840,481,230
未収入金	3,734,152	32,062,888
流動資産合計	18,230,124,046	18,938,493,301
資産合計	18,230,124,046	18,938,493,301
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,268,556	12,881,134
未払受託者報酬	3,864,260	3,993,864
未払委託者報酬	16,423,036	16,973,868
未払利息	196	130
その他未払費用	482,969	499,173
流動負債合計	25,039,017	34,348,169
負債合計	25,039,017	34,348,169
純資産の部		
元本等		
元本	12,980,103,562	13,426,220,096
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	5,224,981,467	5,477,925,036
(分配準備積立金)	2,310,477,990	2,247,634,982
元本等合計	18,205,085,029	18,904,145,132
純資産合計	18,205,085,029	18,904,145,132
負債純資産合計	18,230,124,046	18,938,493,301

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間 自 2018年 2月22日 至 2018年 8月21日	第14期中間計算期間 自 2019年 2月22日 至 2019年 8月21日
営業収益		
受取利息	8	27
有価証券売買等損益	28,474,205	91,412,486
営業収益合計	28,474,197	91,412,513
営業費用		
支払利息	21,488	23,914
受託者報酬	3,631,891	3,993,864
委託者報酬	15,435,458	16,973,868
その他費用	455,396	499,601
営業費用合計	19,544,233	21,491,247
営業利益又は営業損失（ ）	48,018,430	69,921,266
経常利益又は経常損失（ ）	48,018,430	69,921,266
中間純利益又は中間純損失（ ）	48,018,430	69,921,266
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,456,423	1,955,934
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,654,278,118	5,224,981,467
剰余金増加額又は欠損金減少額	448,317,916	332,728,062
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	448,317,916	332,728,062
剰余金減少額又は欠損金増加額	105,883,843	147,749,825
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	105,883,843	147,749,825
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,947,237,338	5,477,925,036

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	12,980,103,562口	13,426,220,096口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4025円 (14,025円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4080円 (14,080円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日	第14期中間計算期間 自 2019年 2月22日 至 2019年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	11,684,589,078円	12,980,103,562円
期中追加設定元本額	1,853,591,536円	814,594,525円
期中一部解約元本額	558,077,052円	368,477,991円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

【DCバランスファンド50】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期中間計算期間(2019年2月22日から2019年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	85,990,106	66,018,086
親投資信託受益証券	18,070,303,107	18,605,917,015
未収入金	-	36,506,886
流動資産合計	18,156,293,213	18,708,441,987
資産合計	18,156,293,213	18,708,441,987
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,539,754	15,849,698
未払受託者報酬	3,844,947	3,980,877
未払委託者報酬	17,302,182	17,913,885
未払利息	205	130
その他未払費用	480,554	497,553
流動負債合計	25,167,642	38,242,143
負債合計	25,167,642	38,242,143
純資産の部		
元本等		
元本	12,196,046,788	12,652,636,843
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	5,935,078,783	6,017,563,001
(分配準備積立金)	3,475,385,814	3,382,938,952
元本等合計	18,131,125,571	18,670,199,844
純資産合計	18,131,125,571	18,670,199,844
負債純資産合計	18,156,293,213	18,708,441,987

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間 自 2018年 2月22日 至 2018年 8月21日	第14期中間計算期間 自 2019年 2月22日 至 2019年 8月21日
営業収益		
受取利息	8	27
有価証券売買等損益	15,190,021	121,917,741
営業収益合計	15,190,029	121,917,714
営業費用		
支払利息	21,697	24,303
受託者報酬	3,712,940	3,980,877
委託者報酬	16,708,142	17,913,885
その他費用	465,526	497,979
営業費用合計	20,908,305	22,417,044
営業利益又は営業損失（ ）	5,718,276	144,334,758
経常利益又は経常損失（ ）	5,718,276	144,334,758
中間純利益又は中間純損失（ ）	5,718,276	144,334,758
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,182,592	989,014
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,535,743,594	5,935,078,783
剰余金増加額又は欠損金減少額	371,764,752	391,706,149
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	371,764,752	391,706,149
剰余金減少額又は欠損金増加額	151,182,377	163,898,159
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	151,182,377	163,898,159
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,748,425,101	6,017,563,001

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	12,196,046,788口	12,652,636,843口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4866円 (14,866円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4756円 (14,756円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日	第14期中間計算期間 自 2019年 2月22日 至 2019年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	11,322,127,617円	12,196,046,788円
期中追加設定元本額	1,487,203,756円	794,711,323円
期中一部解約元本額	613,284,585円	338,121,268円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

【DCバランスファンド70】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期中間計算期間(2019年2月22日から2019年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	32,012,170	29,987,516
親投資信託受益証券	7,082,997,095	7,142,365,141
未収入金	-	22,611,398
流動資産合計	7,115,009,265	7,194,964,055
資産合計	7,115,009,265	7,194,964,055
負債の部		
流動負債		
未払解約金	709,824	20,092,688
未払受託者報酬	1,510,477	1,549,684
未払委託者報酬	7,174,725	7,360,916
未払利息	76	59
その他未払費用	188,742	193,650
流動負債合計	9,583,844	29,196,997
負債合計	9,583,844	29,196,997
純資産の部		
元本等		
元本	4,651,467,417	4,781,904,426
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,453,958,004	2,383,862,632
(分配準備積立金)	1,509,587,011	1,437,439,732
元本等合計	7,105,425,421	7,165,767,058
純資産合計	7,105,425,421	7,165,767,058
負債純資産合計	7,115,009,265	7,194,964,055

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間 自 2018年 2月22日 至 2018年 8月21日	第14期中間計算期間 自 2019年 2月22日 至 2019年 8月21日
営業収益		
受取利息	2	10
有価証券売買等損益	21,501,173	131,117,019
営業収益合計	21,501,175	131,117,009
営業費用		
支払利息	8,733	9,214
受託者報酬	1,453,027	1,549,684
委託者報酬	6,901,783	7,360,916
その他費用	182,153	193,814
営業費用合計	8,545,696	9,113,628
営業利益又は営業損失（ ）	12,955,479	140,230,637
経常利益又は経常損失（ ）	12,955,479	140,230,637
中間純利益又は中間純損失（ ）	12,955,479	140,230,637
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,057,826	1,319,162
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,299,787,160	2,453,958,004
剰余金増加額又は欠損金減少額	213,188,934	193,818,707
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	213,188,934	193,818,707
剰余金減少額又は欠損金増加額	92,226,643	122,364,280
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	92,226,643	122,364,280
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,432,647,104	2,383,862,632

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,651,467,417口	4,781,904,426口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5276円 (15,276円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4985円 (14,985円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第14期中間計算期間 (2019年 8月21日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日	第14期中間計算期間 自 2019年 2月22日 至 2019年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,254,836,786円	4,651,467,417円
期中追加設定元本額	752,735,309円	363,310,171円
期中一部解約元本額	356,104,678円	232,873,162円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,921,862,660
株式	209,094,704,370

	2019年 8月21日現在
項目	金額（円）
未収配当金	336,314,888
前払金	91,315,400
差入委託証拠金	52,176,970
流動資産合計	211,496,374,288
資産合計	211,496,374,288
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	91,324,580
未払金	973,590
未払解約金	202,120,293
未払利息	3,803
その他未払費用	6
流動負債合計	294,422,272
負債合計	294,422,272
純資産の部	
元本等	
元本	132,060,026,774
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	79,141,925,242
元本等合計	211,201,952,016
純資産合計	211,201,952,016
負債純資産合計	211,496,374,288

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2019年 8月21日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	132,060,026,774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 1.5993円 (1万口当たり純資産額) (15,993円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月21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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 2月22日
期首元本額	132,482,711,953円
期中追加設定元本額	5,265,905,161円
期中一部解約元本額	5,688,590,340円
期末元本額	132,060,026,774円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	758,120,756円
D C 日本株式インデックスファンド	334,225,740円
D C 日本株式インデックスファンド L	54,194,574,034円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,151,564,576円
D C バランスファンド 3 0	2,278,935,221円
D C バランスファンド 5 0	3,373,951,449円
D C バランスファンド 7 0	1,749,121,366円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	624,594,062円
日本株式インデックス e	1,833,638,530円
インデックスコレクション（国内株式）	11,425,963,589円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	7,175,070,997円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,087,485,531円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	1,585,830,631円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,418,150,752円
日本株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	2,291,563,179円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,651,195,846円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	123,936,829円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	1,224,727,572円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	132,282,788円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	689,382,462円
V A バランス株式 3 0（適格機関投資家専用）	4,591,192円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	878,927,353円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	1,360,630,274円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	643,009,745円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	10,906,299,142円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	886,439,230円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	158,938,831円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,783,070,588円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	48,324,000円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	216,327,549円

区分	2019年 8月21日現在
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	2,775,759,281円
V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	86,887,724円
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	87,031,088円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	1,018,120,147円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	972,521,351円
バランスV A 20 L（適格機関投資家専用）	10,876,562円
バランスV A 25 L（適格機関投資家専用）	459,435,347円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	7,259,078,906円
世界バランスV A 25（適格機関投資家専用）	128,318,091円
国内バランスV A 30（適格機関投資家専用）	65,186,884円
国内バランスV A 25（適格機関投資家専用）	11,933,163円
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	187,624,535円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	6,379,881円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,135,355,400	-	2,044,040,000	91,315,400
合計		2,135,355,400	-	2,044,040,000	91,315,400

（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。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	834,447,705
国債証券	263,550,474,490
地方債証券	17,117,006,228
特殊債券	21,148,162,017
社債券	13,472,949,000
未収利息	805,649,415

	2019年 8月21日現在
項目	金額（円）
前払費用	10,106,745
流動資産合計	316,938,795,600
資産合計	316,938,795,600
負債の部	
流動負債	
未払解約金	588,272,655
未払利息	1,651
流動負債合計	588,274,306
負債合計	588,274,306
純資産の部	
元本等	
元本	223,757,918,352
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	92,592,602,942
元本等合計	316,350,521,294
純資産合計	316,350,521,294
負債純資産合計	316,938,795,600

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 8月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	223,757,918,352口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 103,657,000円</p>

		2019年 8月21日現在
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,4138円 (14,138円)

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

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

		2019年 8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	

（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	2019年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 2月22日
期首元本額	220,886,925,182円
期中追加設定元本額	10,515,751,833円
期中一部解約元本額	7,644,758,663円
期末元本額	223,757,918,352円

区分	2019年 8月21日現在
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	905,511,038円
D C日本債券インデックスファンド	2,774,091,141円
D C日本債券インデックスファンドL	37,897,366,895円
D Cバランスファンド30	8,125,789,665円
D Cバランスファンド50	5,444,083,529円
D Cバランスファンド70	1,309,696,220円
日本債券インデックスe	1,395,285,839円
インデックスコレクション(国内債券)	18,435,098,176円
インデックスコレクション(バランス株式30)	25,118,792,667円
インデックスコレクション(バランス株式50)	3,348,400,833円
インデックスコレクション(バランス株式70)	1,178,866,259円
私募日本債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	45,473,958,144円
日本債券パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	2,763,067,285円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	340,773,541円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	1,447,364,563円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	183,984,560円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	314,118,455円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	1,504,746,736円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	4,218,781,421円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,130,500,029円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	12,553,065,123円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	138,149,102円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	474,391,606円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	3,207,937,888円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	231,776,606円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	377,615,464円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,271,919,077円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	415,298,225円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	939,276,583円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	2,468,341,224円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	3,946,622,505円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	89,057,118円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,782,908,929円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	29,116,292,831円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	524,965,957円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	184,278,815円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	43,860,326円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	674,813,274円
私募日本債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	7,070,703円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,742,224,193
コール・ローン	1,169,869,837
株式	168,172,331,747
投資信託受益証券	145,440,201
投資証券	4,801,136,098
派生商品評価勘定	17,446,493
未収入金	20,125
未収配当金	337,375,210
前払金	98,012,074
差入委託証拠金	2,265,737,357
流動資産合計	183,749,593,335
資産合計	183,749,593,335
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	107,075,852
未払解約金	198,938,004
未払利息	2,315
その他未払費用	3
流動負債合計	306,016,174
負債合計	306,016,174
純資産の部	
元本等	
元本	69,147,498,758
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	114,296,078,403
元本等合計	183,443,577,161
純資産合計	183,443,577,161
負債純資産合計	183,749,593,335

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	2019年 8月21日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 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</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2019年 8月21日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	69,147,498,758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 2.6529円 (1万口当たり純資産額) (26,529円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月21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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 2月22日
期首元本額	70,292,796,065円
期中追加設定元本額	3,891,090,701円
期中一部解約元本額	5,036,388,008円
期末元本額	69,147,498,758円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,777,381,037円
DC外国株式インデックスファンド	4,499,092,145円
DC外国株式インデックスファンドL	20,700,925,457円
DCバランスファンド30	721,459,539円
DCバランスファンド50	1,414,785,813円
DCバランスファンド70	812,341,916円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	389,205,593円
外国株式インデックスe	5,707,391,076円
インデックスコレクション（外国株式）	5,455,073,480円
インデックスコレクション（バランス株式30）	2,301,281,339円
インデックスコレクション（バランス株式50）	873,689,114円
インデックスコレクション（バランス株式70）	734,477,162円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	6,107,749,505円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,283,881,554円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	900,995,480円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	74,836,714円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	740,917,763円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	78,341,180円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	408,243,147円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	1,454,244円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,705,573,924円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	569,876,497円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	348,489,296円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,696,155,493円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	629,312,090円

区分	2019年 8月21日現在
V A バランスファンド(株 4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	283,559,943円
V A ポートフォリオ 4 0(適格機関投資家専用)	1,062,660,913円
V A ポートフォリオ 2 0(適格機関投資家専用)	28,620,010円
バランス V A 4 0(適格機関投資家専用)	133,325,029円
V A バランスファンド 2(株 4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	155,152,061円
V A バランス 5 0 - 5 0(適格機関投資家専用)	463,899,913円
V A ファンド 2 5(適格機関投資家専用)	601,239,947円
バランス V A 2 0 L(適格機関投資家専用)	6,821,214円
バランス V A 2 5 L(適格機関投資家専用)	128,721,523円
V A バランス 2 0 - 8 0(適格機関投資家専用)	333,381,504円
私募外国株式インデックスファンド A L(適格機関投資家専用)	17,186,143円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年 8月21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	10,398,391,569	-	10,300,379,495	98,012,074
	合計	10,398,391,569	-	10,300,379,495	98,012,074

(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

(2019年 8月21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	990,537,181	-	998,928,626	8,391,445
	アメリカドル	767,936,376	-	775,229,476	7,293,100
	ユーロ	141,814,200	-	141,600,000	214,200
	イギリスポンド	80,786,605	-	82,099,150	1,312,545
	売建	23,277,870	-	23,286,600	8,730
	イギリスポンド	23,277,870	-	23,286,600	8,730

合計	1,013,815,051	-	1,022,215,226	8,382,715
----	---------------	---	---------------	-----------

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	327,491,591
コール・ローン	1,057,846,517
国債証券	130,100,420,993
派生商品評価勘定	4,090,703
未収入金	535,062
未収利息	842,747,459
前払費用	22,185,278
差入委託証拠金	238,608,688
流動資産合計	132,593,926,291
資産合計	132,593,926,291
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,259,545
前受金	3,529,582
未払金	2,417,087
未払解約金	356,304,821
未払利息	2,093
その他未払費用	6
流動負債合計	363,513,134
負債合計	363,513,134
純資産の部	
元本等	
元本	54,916,782,976
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	77,313,630,181
元本等合計	132,230,413,157
純資産合計	132,230,413,157
負債純資産合計	132,593,926,291

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2019年 8月21日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2019年 8月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	54,916,782,976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 2.4078円 (1万口当たり純資産額) (24,078円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 8月21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>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 2月22日
期首元本額	56,992,555,742円
期中追加設定元本額	2,757,704,861円
期中一部解約元本額	4,833,477,627円
期末元本額	54,916,782,976円
期末元本額の内訳	

区分	2019年 8月21日現在
外国債券インデックスファンド	2,272,673,877円
DC外国債券インデックスファンド	2,062,327,610円
DC外国債券インデックスファンドL	12,397,521,035円
DCバランスファンド30	744,903,519円
DCバランスファンド50	730,885,409円
DCバランスファンド70	140,495,456円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	439,304,476円
外国債券インデックスe	1,347,451,372円
インデックスコレクション（外国債券）	3,638,914,819円
インデックスコレクション（バランス株式30）	2,384,371,229円
インデックスコレクション（バランス株式50）	458,527,119円
インデックスコレクション（バランス株式70）	126,089,127円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,058,756,569円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,162,063,488円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	686,028,159円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	195,032,317円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	846,704,871円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	443,877,916円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	771,205,322円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	834,613円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,479,374,774円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	2,127,978,603円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	718,414,384円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	7,527,433,850円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	359,113,136円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	388,847,801円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,870,080,385円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	135,127,457円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	222,163,020円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	121,468,870円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	60,839,522円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	2,864,265,147円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	4,661,875円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	303,796,781円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	92,682,183円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,704,826,694円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	27,740,191円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2019年 8月21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	600,506,034	-	604,035,616	3,529,582
	合計	600,506,034	-	604,035,616	3,529,582

(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

(2019年 8月21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	556,839,075	-	556,128,000	711,075
	アメリカドル	346,026,180	-	346,179,400	153,220
	カナダドル	28,120,750	-	27,930,000	190,750
	ユーロ	139,128,795	-	138,060,000	1,068,795
	イギリスポンド	43,563,350	-	43,958,600	395,250
	売建	14,647,643	-	14,634,992	12,651
	マレーシアリン ギット	14,647,643	-	14,634,992	12,651
	合計	571,486,718	-	570,762,992	698,424

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DCバランスファンド30】

【純資産額計算書】

(2019年 9月30日現在)

資産総額	19,462,866,225円
負債総額	21,635,012円
純資産総額 (-)	19,441,231,213円
発行済口数	13,622,883,173口
1口当たり純資産額 (/)	1.4271円
(1万口当たり純資産額)	(14,271円)

【DCバランスファンド50】

【純資産額計算書】

(2019年 9月30日現在)

資産総額	19,392,445,017円
負債総額	45,004,603円
純資産総額 (-)	19,347,440,414円
発行済口数	12,774,639,458口
1口当たり純資産額 (/)	1.5145円
(1万口当たり純資産額)	(15,145円)

【DCバランスファンド70】

【純資産額計算書】

(2019年 9月30日現在)

資産総額	7,527,107,517円
負債総額	12,593,627円
純資産総額 (-)	7,514,513,890円
発行済口数	4,829,801,428口
1口当たり純資産額 (/)	1.5559円
(1万口当たり純資産額)	(15,559円)

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2019年 9月30日現在)

資産総額	225,604,799,856円
負債総額	377,640,079円
純資産総額（ - ）	225,227,159,777円
発行済口数	131,515,207,937口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7126円
（1万口当たり純資産額）	（17,126円）

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

(2019年 9月30日現在)

資産総額	317,594,581,130円
負債総額	3,187,973,312円
純資産総額（ - ）	314,406,607,818円
発行済口数	224,153,812,786口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4026円
（1万口当たり純資産額）	（14,026円）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

(2019年 9月30日現在)

資産総額	190,798,810,213円
負債総額	267,232,925円
純資産総額（ - ）	190,531,577,288円
発行済口数	68,978,793,919口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7622円
（1万口当たり純資産額）	（27,622円）

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

(2019年 9月30日現在)

資産総額	131,952,056,027円
負債総額	91,977,860円
純資産総額（ - ）	131,860,078,167円
発行済口数	54,308,772,074口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4280円
（1万口当たり純資産額）	（24,280円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年9月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

[D0（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 - D0 - 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2019年11月21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。

2019年9月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	523	12,410,879
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	87	339,434
単位型公社債投資信託	9	79,382
合計	619	12,829,695

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。

なお、財務諸表の金額については、千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、当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,973,152	23,830,484
有価証券	-	2,268,127
前払費用	157,614	197,843
未収委託者報酬	5,373,307	6,351,590
未収運用受託報酬	-	5,525,778
未収収益	896	212,722
その他	8,946	2,261,900
流動資産合計	29,513,917	40,648,447
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 36,782	1 282,407
器具備品	1 79,655	1 564,981
その他	1 1,912	1 14,462
有形固定資産合計	118,350	861,851
無形固定資産		
ソフトウェア	210,679	1,487,265
その他	4,377	7,256
無形固定資産合計	215,056	1,494,522
投資その他の資産		
投資有価証券	42,802	11,334,053
関係会社株式	-	4,663,000
長期貸付金	17,088	-
繰延税金資産	248,633	141,789
その他	32,880	32,492
貸倒引当金	17,088	-
投資その他の資産合計	324,317	16,171,335
固定資産合計	657,724	18,527,709
資産合計	30,171,641	59,176,157

（単位：千円）

	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	22,767,534	28,501,567
利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	-	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411
負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157

(2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	-	5,464,685
その他営業収益	-	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	-	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	-	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240
営業利益	5,516,262	8,554,888

(単位:千円)

前事業年度

当事業年度

（自 2017年4月1日
至 2018年3月31日）（自 2018年4月1日
至 2019年3月31日）

営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	-	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	-	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	50,178	125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	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	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
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	300,000	350,000	350,000

	株主資本	
	利益剰余金	
	その他利益剰余金	

	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	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	1,134	-	1,134	21,847,309
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				30,000
当期純利益				3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317		1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	-	1,317	3,744,907
当期末残高	182	-	182	25,592,216

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	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	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700,000	1,700,000	1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
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	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	株主資本	
	利益剰余金	

	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	株主資本合計
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589,438
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	500	-	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	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	182	-	182	25,592,216
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589,438
剰余金の配当				30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

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

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく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。）

時価のないもの

移動平均法による原価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. 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、原則として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。

4．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、期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。

5．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。

6．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。

7．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

(有形固定資産の減価償却方法の変更)

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しておりましたが、当事業年度より定額法へ変更しております。

この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。なお、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に及ぼす影響は軽微であります。

表示方法の変更

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

(貸借対照表関係)

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

注記事項

（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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
建 物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	"	351,328	"
そ の 他	2,677	"	3,595	"
計	392,342	"	408,445	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017年6月30日

4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の 種類	配当金の 総額(千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
----	-----------	----------------	------------	-----------------	-----	-------

2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日
----------------------	------	--------	-----------	--------	------------	------------

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2019年6月27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(千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券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有価証券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。

有価証券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6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	23,973,152	23,973,152	-
(2) 未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	-
(3) 未収運用受託報酬	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	42,799	42,799	-
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	-	-	-
デリバティブ取引計	-	-	-

（*）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。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額 （*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	-
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	-
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602,178	13,602,178	-
(5) 未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	-
(6) 未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	-

(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(850)	(850)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	-
デリバティブ取引計	81,231	81,231	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

これらは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。

(4) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(5) 未払金、及び(6) 未払法人税等

これらは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。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(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(2018年3月31日)

(単位:千円)

	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	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
未収運用受託報酬	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

	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	23,830,484	-	-	-
未収委託者報酬	6,351,590	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525,778	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる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：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

２．その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	23,576	25,037	1,461
小計	23,576	25,037	1,461
合計	42,799	42,536	262

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196,375	9,602,961	406,585
小計	9,196,375	9,602,961	406,585
合計	13,602,178	13,035,220	566,957

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538,203	46,789	34,437

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

種類	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)	
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	887,121	-	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	-	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	-	42	42
	スイスフラン	7,802	-	6	6
	香港ドル	183,640	-	645	645
	ユーロ	183,228	-	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	-	90	90
	スイスフラン	1,110	-	5	5
	香港ドル	560	-	4	4
	ユーロ	2,492	-	0	0
	合計	1,346,753	-	7,916	7,916

（注） 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（2）株式関連

種類	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引				
株価指数先物取引 売建	6,739,103	-	8,766	8,766
合計	6,739,103	-	8,766	8,766

（注） 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

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 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)
--------------	------------------	---------	--------------	------------------------	------------

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,432,867	-	13,731
	英ポンド		2,575,513	-	50,256
	カナダドル		40,963	-	566
	スイスフラン		34,448	-	132
	香港ドル		566,113	-	2,528
	人民元		1,725,146	-	9,137
	ユーロ		262,583	-	6,080
	買建				
	ユーロ		6,313	-	86
	合計		8,643,951	-	82,081

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(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. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

(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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	"	-	"
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	"	40,467	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	"	164,674	"
その他	23,674	"	82,358	"
繰延税金資産 合計	255,547	"	413,091	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	-	"
有価証券評価差額	-	"	173,602	"
繰延ヘッジ損益	-	"	58,719	"
その他	80	"	38,979	"
繰延税金負債 合計	6,913	"	271,302	"
繰延税金資産の純額	248,633	"	141,789	"

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。

（企業結合等関係）

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

その他取引の概要に関する事項

三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

(2)実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,945,175千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	4,679,437千円

[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。

(持分法損益等)

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 2017年4月1日 至 2018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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	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	投信販売代行手数料等	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用	4,809,206	その他未払金	424,421

（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

投信販売代行手数料

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。

投資助言費用

各助言案件について、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。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	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	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603,427 13,907,536 4,663,000 13,989 18,589,438 無対価	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

投資助言費用

各助言案件について、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。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

(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（2018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（2019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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21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 2017年4月1日	当事業年度 (自 2018年4月1日

	至 2018年3月31日)	至 2019年3月31日)
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2019年11月21日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2019年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(参考) 再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2019年6月5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

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
業務執行社員

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第33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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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2019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すべ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。

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。

独立監査人の監査報告書

2019年4月19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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド30の2018年2月22日から2019年2月21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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド30の2019年2月21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すべ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。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年4月19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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド50の2018年2月22日から2019年2月21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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド50の2019年2月21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すべ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。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年4月19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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド70の2018年2月22日から2019年2月21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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド70の2019年2月21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すべ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。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年10月21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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド30の2019年2月22日から2019年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド30の2019年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年2月22日から2019年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年10月21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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド50の2019年2月22日から2019年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド50の2019年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年2月22日から2019年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年10月21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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド70の2019年2月22日から2019年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド70の2019年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年2月22日から2019年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。