

【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】	2020年5月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	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ターゲット・イヤー ファンド2025 DCターゲット・イヤー ファンド2035 DCターゲット・イヤー ファンド2045 DCターゲット・イヤー ファンド2055
【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ターゲット・イヤー ファンド2025 10兆円を上限とします。 DCターゲット・イヤー ファンド2035 10兆円を上限とします。 DCターゲット・イヤー ファンド2045 10兆円を上限とします。 DCターゲット・イヤー ファンド2055 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ターゲット・イヤー ファンド 2025

DCターゲット・イヤー ファンド 2035

DCターゲット・イヤー ファンド 2045

DCターゲット・イヤー ファンド 2055

（以上を総称して「DCターゲット・イヤー ファンド」という場合、あるいは総称してまたは個別に「ファンド」、「当ファンド」という場合があります。また、「DCターゲット・イヤー ファンド 2025」を「2025」、「DCターゲット・イヤー ファンド 2035」を「2035」、「DCターゲット・イヤー ファンド 2045」を「2045」、「DCターゲット・イヤー ファンド 2055」を「2055」という場合があります。）

（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】

2020年 5月29日から2020年11月27日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、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、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、国内及び外国の公社債、株式ならびに国内の短期金融資産等に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の長期的な成長を目指します。

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限 4,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<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。

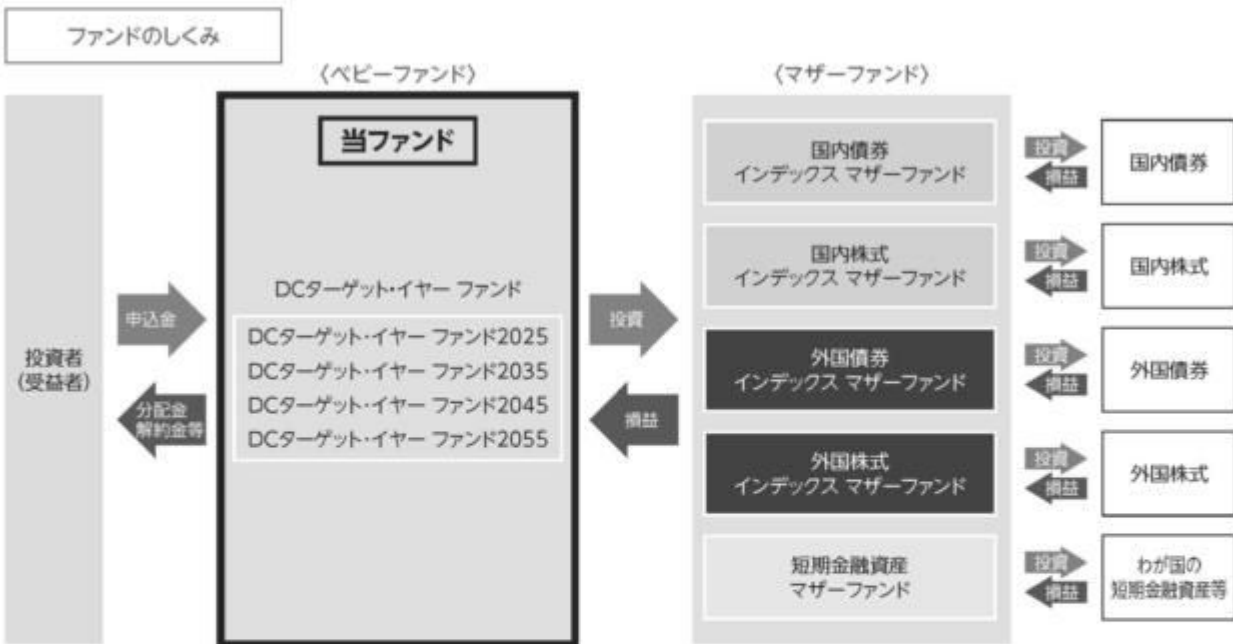
[特殊型]

- (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 >

1. 国内及び外国の主要金融資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

*わが国の短期金融資産等への投資は、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果を目指します。「無担保コール翌日物金利」とは、日本銀行が金融調節を行う上でのターゲット・レートとしている短期金利で、金融機関の間で担保なしにお金を借りて翌営業日に返す翌日物の金利です。

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

- ※1「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公算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。
- ※2「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。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。
- ※3「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。
- ※4「MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)」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。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。

ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

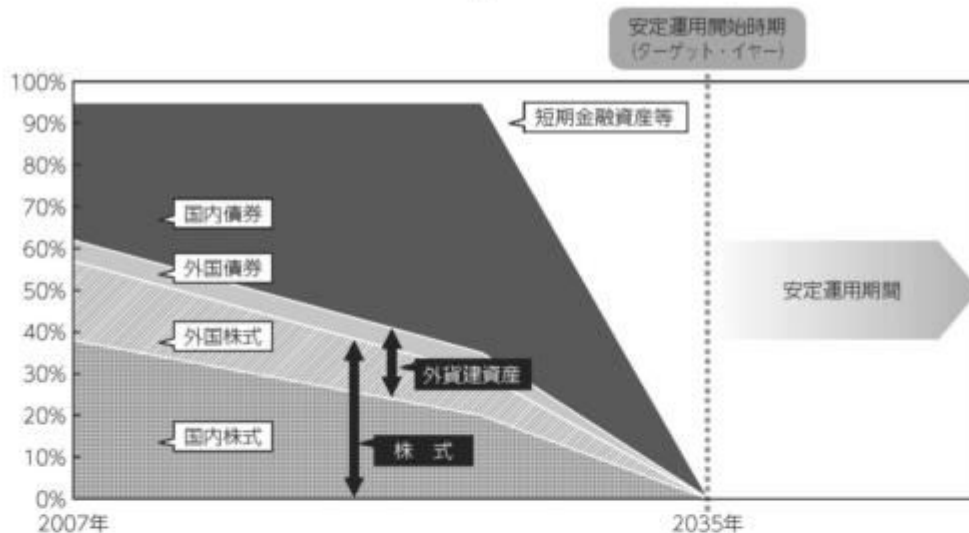
3. 安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)に近づくにしたいが、原則として1年に2回、各マザーファンドの基本組入比率を変更します。

- 株式の実質組入れを徐々に減らし、公社債及び短期金融資産等の実質組入れを徐々に増やすことにより、株価等の変動リスクの低減をはかることを基本とします。
- 原則として1年に2回、各マザーファンドの基本組入比率を変更します。なお、予定された基本組入比率については、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で見直すことがあります。
- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)以降は、「短期金融資産 マザーファンド」に原則として100%投資を行い、より安定的な運用を行うことを基本とします。ただし、低金利状態が続き、基準価額騰落率が継続的にマイナスになることが見込まれる場合には、繰上償還手続きを行うことがあります。
- 将来の市場構造及び市況環境の変化等に応じ、主要投資対象の追加が行われる場合があります。

各ファンドの安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)

DCターゲット・イヤー ファンド2025	2025年8月の決算日の翌日(第19計算期間開始日)
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2035年8月の決算日の翌日(第29計算期間開始日)
DCターゲット・イヤー ファンド2045	2045年8月の決算日の翌日(第39計算期間開始日)
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2055年8月の決算日の翌日(第39計算期間開始日)

基本組入比率イメージ
(例:DCターゲット・イヤー ファンド2035)



※上記は当初設定時における「DCターゲット・イヤー ファンド2035」の基本組入比率のイメージ図であり、実際のファンドの組入比率と異なる場合があります。

基本組入比率の推移

■ 当初設定時	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	短期金融資産等
DCターゲット・イヤー ファンド2025 (2007年9月)	48%	28%	5%	14%	5%
DCターゲット・イヤー ファンド2035 (2007年9月)	33%	38%	5%	19%	5%
DCターゲット・イヤー ファンド2045 (2007年9月)	18%	48%	5%	24%	5%
DCターゲット・イヤー ファンド2055 (2018年2月)	18.75%	47.50%	5.00%	23.75%	5.00%

■ 2020年3月末現在	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	短期金融資産等
DCターゲット・イヤー ファンド2025	33.00%	11.00%	2.75%	5.50%	47.75%
DCターゲット・イヤー ファンド2035	51.75%	25.50%	5.00%	12.75%	5.00%
DCターゲット・イヤー ファンド2045	36.75%	35.50%	5.00%	17.75%	5.00%
DCターゲット・イヤー ファンド2055	21.75%	45.50%	5.00%	22.75%	5.00%

■ 安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)以降	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	短期金融資産等
DCターゲット・イヤー ファンド2025					
DCターゲット・イヤー ファンド2035	0%	0%	0%	0%	100%
DCターゲット・イヤー ファンド2045					
DCターゲット・イヤー ファンド2055					

分配方針

- 原則として、毎年8月28日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、以下の通りとします。

DCターゲット・イヤー ファンド2025	投資信託財産の純資産総額の55%以下
DCターゲット・イヤー ファンド2035	投資信託財産の純資産総額の70%以下
DCターゲット・イヤー ファンド2045	投資信託財産の純資産総額の85%以下
DCターゲット・イヤー ファンド2055	投資信託財産の純資産総額の85%以下

- 外貨建資産への実質投資割合は、以下の通りとします。

DCターゲット・イヤー ファンド2025	投資信託財産の純資産総額の30%以下
DCターゲット・イヤー ファンド2035	投資信託財産の純資産総額の35%以下
DCターゲット・イヤー ファンド2045	投資信託財産の純資産総額の40%以下
DCターゲット・イヤー ファンド2055	投資信託財産の純資産総額の40%以下

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】

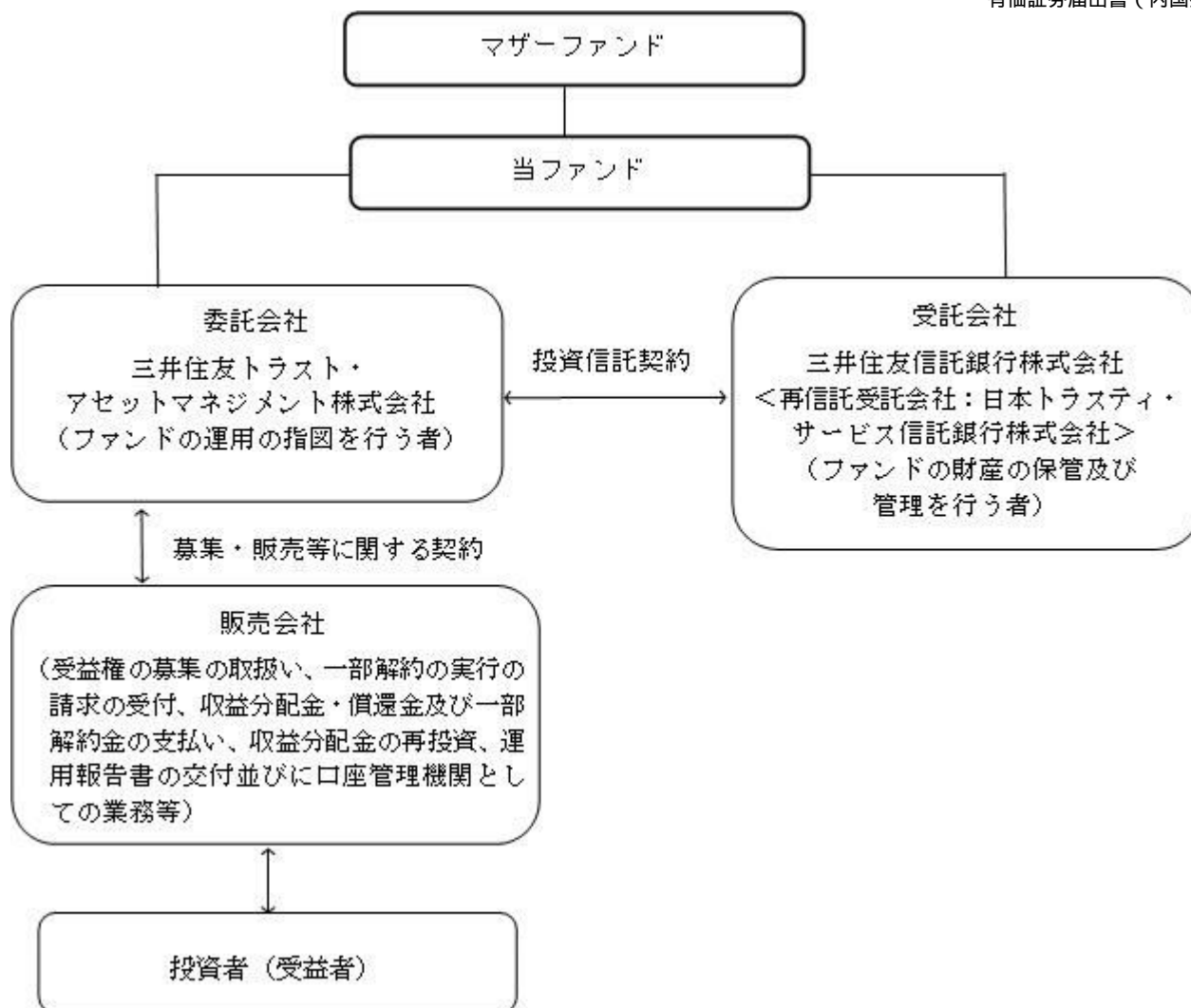
2007年9月26日

「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015」、「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025」、「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035」及び「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045」の投資信託契約締結、設定、運用開始

2012年4月 1日	ファンドの名称を「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015」から「DCターゲット・イヤー ファンド2015」に、「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025」から「DCターゲット・イヤー ファンド2025」に、「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035」から「DCターゲット・イヤー ファンド2035」に、「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045」から「DCターゲット・イヤー ファンド2045」にそれぞれ変更
2017年3月29日	ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 短期金融資産 マザーファンド」の名称を「短期金融資産 マザーファンド」にそれぞれ変更
2018年2月27日	「DCターゲット・イヤー ファンド2015」の信託終了 「DCターゲット・イヤー ファンド2055」の投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

委託会社の概況（2020年 3月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

（イ）基本方針

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目的に運用を行うことを基本とします。

（ロ）運用方法

投資対象

「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」および「短期金融資産 マザーファンド」（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド」ということがあります。）の各受益証券（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。なお、株式および公社債等に直接投資することもあります。また、将来の市場構造および市況環境の変化等に応じ、主要投資対象の追加が行われる場合があります。

投資態度

1)主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内の公社債および株式ならびに外国の公社債および株式ならびに国内の短期金融資産等（短期公社債および短期金融商品を含みます。以下同じ。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の長期的な成長を目的に運用を行うことを基本とします。

2)当初設定時の各マザーファンド受益証券の基本組入比率は以下のとおりとします。

	「国内債券 インデックス マザーファン ド」 受益証券	「国内株式 インデックス マザーファン ド」 受益証券	「外国債券 インデックス マザーファン ド」 受益証券	「外国株式 インデックス マザーファン ド」 受益証券	「短期金融資産 マザーファン ド」 受益証券
DCターゲット・イ ヤー ファンド2025	48%	28%	5%	14%	5%
DCターゲット・イ ヤー ファンド2035	33%	38%	5%	19%	5%
DCターゲット・イ ヤー ファンド2045	18%	48%	5%	24%	5%
DCターゲット・イ ヤー ファンド2055	18.75%	47.50%	5.00%	23.75%	5.00%

3)（１）年8月の決算日の翌日（第（２）計算期間開始日）を安定運用開始時期（以下「ターゲット・イヤー」といいます。）とし、当初設定以降、ターゲット・イヤーに近づくにしたがい、定期的に各マザーファンド受益証券の基本組入比率を変更することで、株式の実質組入れを漸減し、公社債および短期金融資産等の実質組入れを漸増することにより、株価等の変動リスクの低減を図ることを基本とします。なお、各マザーファンド受益証券の基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造および市場環境の変化等を考慮した上で行います。

上記、（１）および（２）となっている箇所には下の表より各々の数字をあてはめてお読みください。

	（１）	（２）
DCターゲット・イヤー ファンド2025	2025	19
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2035	29
DCターゲット・イヤー ファンド2045	2045	39
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2055	39

4)ターゲット・イヤー以降は、「短期金融資産 マザーファンド」受益証券に原則として100%投

資を行い、より安定的な運用を行うことを基本とします。

- 5)各マザーファンド受益証券の各年の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 6)実質組入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、急激な為替変動等により為替差損の可能性が高いと判断される場合には、一時的に為替ヘッジを行う場合があります。
- 7)投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 8)投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 9)投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- 10)ただし、資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託会社は、信託金を主として次に掲げる第1号から第5号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに第6号から第27号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

2025 / 2035 / 2045

- 1．国内債券インデックス マザーファンド
- 2．国内株式インデックス マザーファンド
- 3．外国債券インデックス マザーファンド
- 4．外国株式インデックス マザーファンド
- 5．短期金融資産 マザーファンド
- 6．株券または新株引受権証書

7. 国債証券
 8. 地方債証券
 9. 特別の法律により法人の発行する債券
 10. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 11. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 12. 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。)
 13. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 14. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 15. コマーシャル・ペーパー
 16. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
 17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第6号から第16号までの証券または証書の性質を有するもの
 18. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 19. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 20. 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。)
 21. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
 22. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 24. 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。)
 25. 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。)
 26. 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
 27. 外国の者に対する権利で第26号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第6号の証券または証書、第17号ならびに第22号の証券または証書のうち第6号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第7号から第11号までの証券および第17号ならびに第22号の証券または証書のうち第7号から第11号までの証券の性質を有するもの、および第19号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第18号の証券および第19号の証券(「投資法人債券」を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

2055

1. ~17. 2025/2035/2045 と同じ。
18. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
19. ~27. 2025/2035/2045 と同じ。

なお、第6号の証券または証書、第17号ならびに第22号の証券または証書のうち第6号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第7号から第11号までの証券および第17号ならび

に第22号の証券または証書のうち第7号から第11号までの証券の性質を有するもの、および第19号に記載する証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第18号の証券および第19号の証券（「投資法人債券」および「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

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

(参考)マザーファンド概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

原則として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）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産

総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「短期金融資産 マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の短期金融資産等（短期公社債および短期金融商品を含みます。以下同じ。）を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の短期金融資産等を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

わが国の短期金融資産等を中心に投資を行い、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果をめざします。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限ることとし、投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

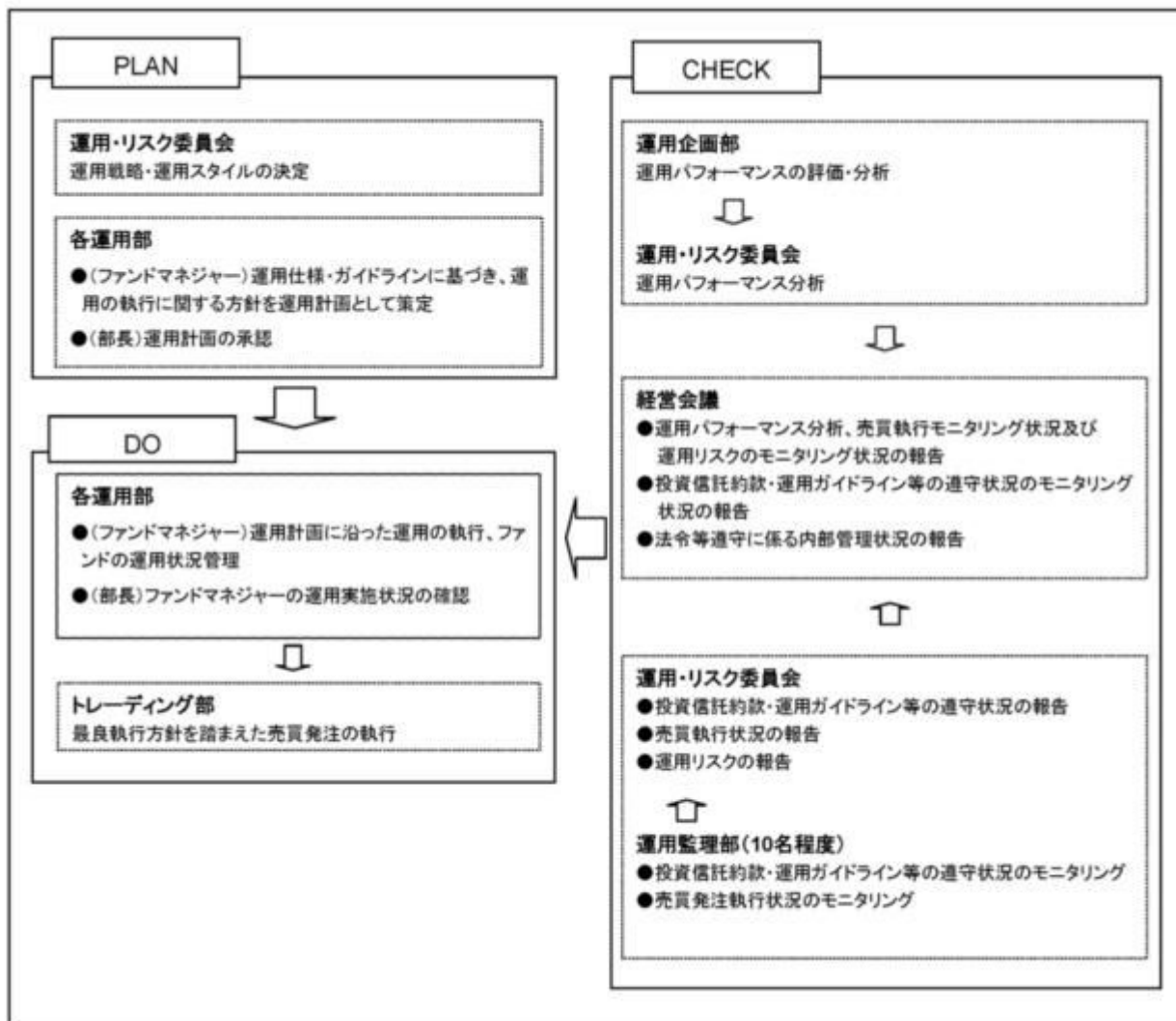
外貨建資産への投資は行いません。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

（イ）株式への投資割合（投資信託約款の「運用の基本方針」）

株式への実質投資割合は、以下の通りとします。

DCターゲット・イヤー ファンド2025...投資信託財産の純資産総額の55%以下

DCターゲット・イヤー ファンド2035...投資信託財産の純資産総額の70%以下

DCターゲット・イヤー ファンド2045...投資信託財産の純資産総額の85%以下

DCターゲット・イヤー ファンド2055...投資信託財産の純資産総額の85%以下

（ロ）外貨建資産の投資割合（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合は、以下の通りとします。

DCターゲット・イヤー ファンド2025...投資信託財産の純資産総額の30%以下

DCターゲット・イヤー ファンド2035...投資信託財産の純資産総額の35%以下

DCターゲット・イヤー ファンド2045...投資信託財産の純資産総額の40%以下

DCターゲット・イヤー ファンド2055...投資信託財産の純資産総額の40%以下

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

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

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

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

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

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

指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

（リ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

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

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

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

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

財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。（投資信託約款第25条）

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

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

（カ）公社債の空売りの指図範囲

2025 / 2035 / 2045

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

2055

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

（投資信託約款第27条）

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

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

（ケ）資金の借入れ

2025 / 2035 / 2045

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託

財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第38条）

2055

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第37条）

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

(ツ) 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またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

ることを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(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率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

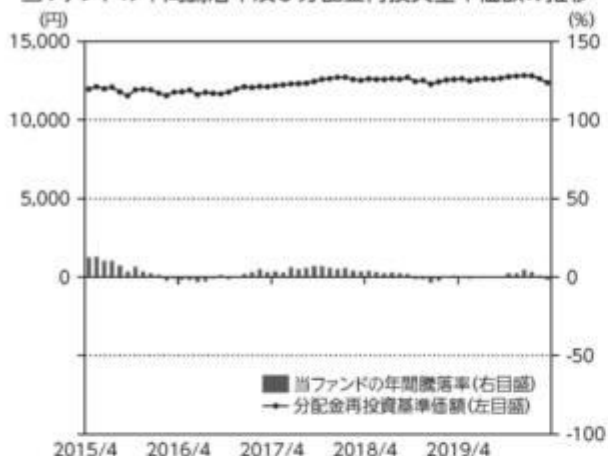
委託会社におけるリスク管理体制

- ・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。

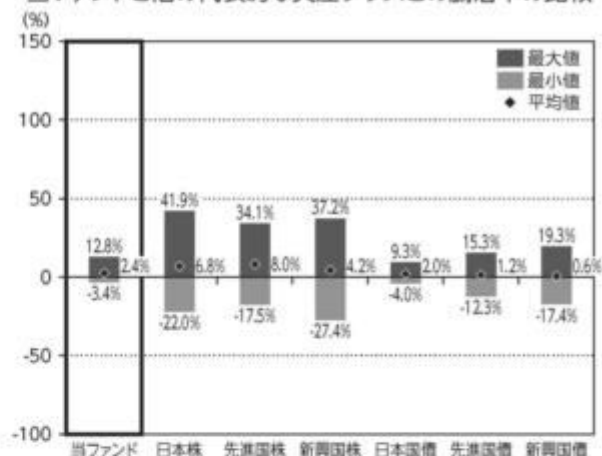
〔参考情報〕

DCターゲット・イヤー ファンド2025

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

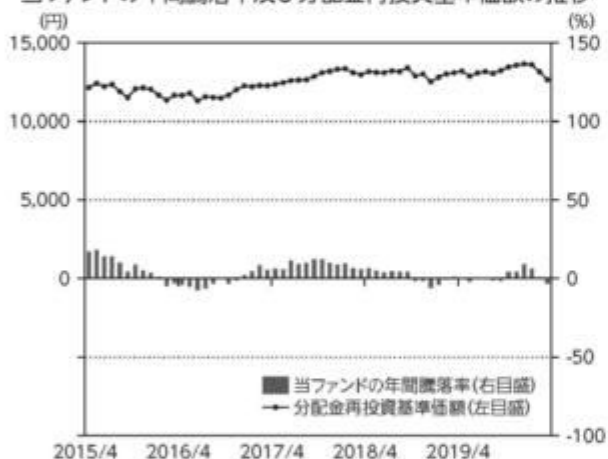


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

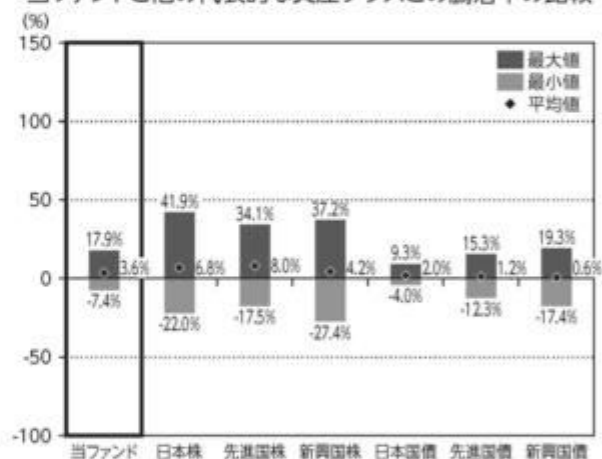


DCターゲット・イヤー ファンド2035

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

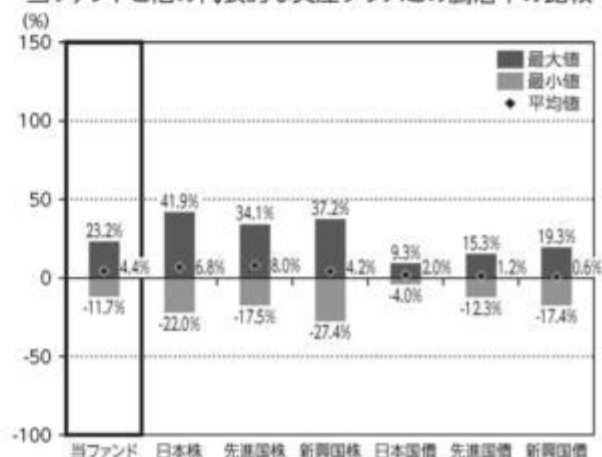


DCターゲット・イヤー ファンド2045

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

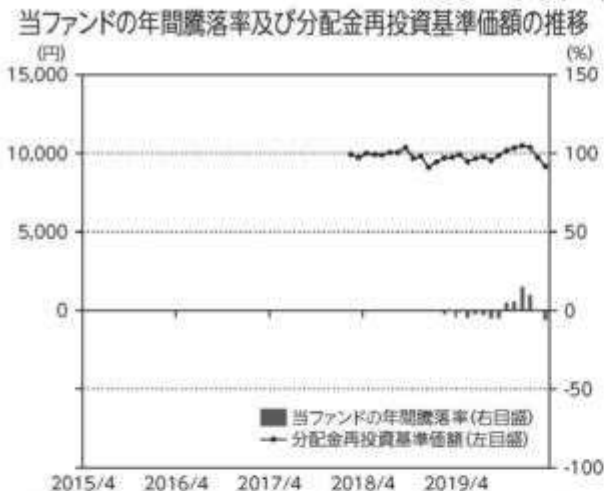


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



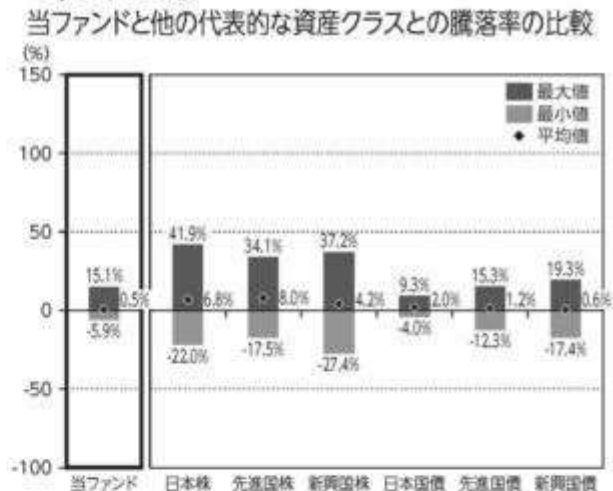
【参考情報】

DCターゲット・イヤー ファンド2055



*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。



*DCターゲット・イヤー ファンド2055、DCターゲット・イヤー ファンド2035及びDCターゲット・イヤー ファンド2045については2015年4月～2020年3月の5年間、DCターゲット・イヤー ファンド2055については2019年2月～2020年3月の1年2ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2015年4月～2020年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、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。

*DCターゲット・イヤー ファンド2055の年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

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国内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、責任を負いません。
先進国株 MSCIコフサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコフサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された企業債・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により開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性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 JPモルガン・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・デベロップメント(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は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、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、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）。

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。

運用管理費用の配分	ターゲット・イヤー 到来前 (第1計算期間から第 (*1)計算期間ま で)		ターゲット・イヤー 到来後 (第(*2) 計算期間以降)		主な役務
	合計	年率0.473% (税抜 0.43%) ()	年率0.231% (税抜 0.21%)		
配分	委託会社	年率0.264% (税抜0.24%)	年率0.11% (税抜0.1%)		委託した資金の運用、 基準価額の計算、開示 資料作成等の対価
	販売会社	年率0.165% (税抜0.15%)	年率0.077% (税抜0.07%)		運用報告書等各種書類 の送付、口座内での ファンドの管理、購入 後の情報提供等の対価
	受託会社	年率0.044% (税抜0.04%)	年率0.044% (税抜0.04%)		運用財産の管理、委託 会社からの指図の実行 の対価

前記(*1)および(*2)となっている箇所には、下の表より各々の数字をあてはめてお読みください。

	(*1)	(*2)
DCターゲット・イヤー ファンド2025	18	19
DCターゲット・イヤー ファンド2035	28	29
DCターゲット・イヤー ファンド2045	38	39
DCターゲット・イヤー ファンド2055	38	39

「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（ ）、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。）。

2025/2035/2045

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

2055

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。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

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

上記は、2020年 3月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更

される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2020年3月31日現在の状況について記載してあります。

【DCターゲット・イヤー ファンド2025】

(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	4,355,651,855	97.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		117,603,700	2.63
合計(純資産総額)		4,473,255,555	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	短期金融資産 マザーファンド	2,032,046,594	1.0125	2,057,650,380	1.0126	2,057,650,381	46.00
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	1,073,788,885	1.4465	1,553,307,018	1.4149	1,519,303,893	33.96
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	337,999,390	1.3830	467,460,504	1.3248	447,781,591	10.01
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	90,533,358	2.4960	225,977,457	2.2580	204,424,322	4.57
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	43,438,073	2.7883	121,122,186	2.9120	126,491,668	2.83

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.37
合計	97.37

(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3期計算期間末 (2010年 8月30日)	201,959,847	201,959,847	8,371	8,371
第4期計算期間末 (2011年 8月29日)	724,631,677	724,631,677	8,291	8,291
第5期計算期間末 (2012年 8月28日)	1,081,707,176	1,081,707,176	8,565	8,565
第6期計算期間末 (2013年 8月28日)	1,646,706,115	1,646,706,115	10,125	10,125
第7期計算期間末 (2014年 8月28日)	2,276,603,227	2,276,603,227	11,010	11,010
第8期計算期間末 (2015年 8月28日)	2,797,335,955	2,797,335,955	11,800	11,800
第9期計算期間末 (2016年 8月29日)	3,085,230,787	3,085,230,787	11,648	11,648
第10期計算期間末 (2017年 8月28日)	3,576,745,772	3,576,745,772	12,292	12,292
第11期計算期間末 (2018年 8月28日)	3,910,205,200	3,910,205,200	12,594	12,594
第12期計算期間末 (2019年 8月28日)	4,383,506,424	4,383,506,424	12,540	12,540
2019年 3月末日	4,209,689,085		12,578	
4月末日	4,207,035,051		12,620	
5月末日	4,227,146,236		12,480	
6月末日	4,290,168,255		12,581	
7月末日	4,339,615,807		12,620	
8月末日	4,430,472,046		12,585	
9月末日	4,461,107,756		12,651	
10月末日	4,515,422,436		12,745	
11月末日	4,548,533,393		12,789	
12月末日	4,586,257,123		12,823	
2020年 1月末日	4,615,281,416		12,803	
2月末日	4,574,519,410		12,623	
3月末日	4,473,255,555		12,370	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
--	-----	---------------

第3期計算期間	2009年 8月29日～2010年 8月30日	0
第4期計算期間	2010年 8月31日～2011年 8月29日	0
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	0
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	0
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	0
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	0
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	0
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	0
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	0
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	2009年 8月29日～2010年 8月30日	2.9
第4期計算期間	2010年 8月31日～2011年 8月29日	1.0
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	3.3
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	18.2
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	8.7
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	7.2
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	1.3
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	5.5
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	2.5
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	0.4
第13期中間計算期間	2019年 8月29日～2020年 2月28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3期計算期間	2009年 8月29日～2010年 8月30日	179,376,915	8,239,304	241,272,411
第4期計算期間	2010年 8月31日～2011年 8月29日	642,969,479	10,282,286	873,959,604
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	416,917,074	27,887,265	1,262,989,413
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	401,280,871	37,829,036	1,626,441,248
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	510,257,180	68,896,868	2,067,801,560
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	385,997,089	83,215,635	2,370,583,014
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	351,565,066	73,529,672	2,648,618,408
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	345,039,082	83,920,170	2,909,737,320
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	350,641,543	155,550,641	3,104,828,222

第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	511,821,385	120,990,227	3,495,659,380
第13期中間計算期間	2019年 8月29日～2020年 2月28日	197,892,583	69,594,455	3,623,957,508

(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ターゲット・イヤー ファンド2035】

(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	3,646,342,812	96.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		117,641,281	3.13
合計(純資産総額)		3,763,984,093	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	1,317,588,334	1.4459	1,905,100,973	1.4149	1,864,255,733	49.53
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	766,926,022	1.3590	1,042,252,464	1.3248	1,016,023,593	26.99
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	224,844,929	2.4342	547,317,527	2.2580	507,699,849	13.49
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	63,881,377	2.7889	178,163,795	2.9120	186,022,569	4.94
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	71,440,913	1.0125	72,333,989	1.0126	72,341,068	1.92

(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	96.87
合計	96.87

(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3期計算期間末 (2010年 8月30日)	122,461,932	122,461,932	7,602	7,602
第4期計算期間末 (2011年 8月29日)	420,355,758	420,355,758	7,470	7,470
第5期計算期間末 (2012年 8月28日)	688,663,598	688,663,598	7,757	7,757
第6期計算期間末 (2013年 8月28日)	1,149,255,645	1,149,255,645	9,744	9,744
第7期計算期間末 (2014年 8月28日)	1,633,177,356	1,633,177,356	10,868	10,868
第8期計算期間末 (2015年 8月28日)	2,071,477,526	2,071,477,526	11,932	11,932
第9期計算期間末 (2016年 8月29日)	2,267,735,876	2,267,735,876	11,461	11,461
第10期計算期間末 (2017年 8月28日)	2,771,734,999	2,771,734,999	12,573	12,573
第11期計算期間末 (2018年 8月28日)	3,240,277,607	3,240,277,607	13,175	13,175
第12期計算期間末 (2019年 8月28日)	3,642,033,135	3,642,033,135	12,949	12,949
2019年 3月末日	3,493,705,527		13,089	
4月末日	3,519,763,044		13,198	
5月末日	3,509,614,141		12,884	
6月末日	3,590,896,098		13,079	
7月末日	3,658,277,754		13,162	
8月末日	3,699,118,322		13,045	
9月末日	3,780,273,337		13,231	
10月末日	3,878,868,550		13,456	
11月末日	3,956,591,216		13,569	
12月末日	4,005,915,023		13,660	
2020年 1月末日	4,020,576,888		13,605	
2月末日	3,910,780,363		13,151	
3月末日	3,763,984,093		12,655	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2009年 8月29日～2010年 8月30日	0
第4期計算期間	2010年 8月31日～2011年 8月29日	0
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	0

第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	0
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	0
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	0
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	0
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	0
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	0
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	2009年 8月29日～2010年 8月30日	5.0
第4期計算期間	2010年 8月31日～2011年 8月29日	1.7
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	3.8
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	25.6
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	11.5
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	9.8
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	3.9
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	9.7
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	4.8
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	1.7
第13期中間計算期間	2019年 8月29日～2020年 2月28日	1.6

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期計算期間	2009年 8月29日～2010年 8月30日	121,042,631	4,757,117	161,095,180
第4期計算期間	2010年 8月31日～2011年 8月29日	411,605,518	9,965,558	562,735,140
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	344,852,373	19,768,611	887,818,902
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	319,739,327	28,167,961	1,179,390,268
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	365,544,435	42,147,384	1,502,787,319
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	295,447,605	62,141,449	1,736,093,475
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	280,298,222	37,748,019	1,978,643,678
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	284,666,336	58,716,974	2,204,593,040
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	333,480,026	78,692,832	2,459,380,234
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	417,662,600	64,376,146	2,812,666,688
第13期中間計算期間	2019年 8月29日～2020年 2月28日	194,236,539	33,164,481	2,973,738,746

(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ターゲット・イヤー ファンド2045】

(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	1,740,367,409	96.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		54,471,215	3.03
合計(純資産総額)		1,794,838,624	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	505,185,827	1.3659	690,033,322	1.3248	669,270,183	37.29
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	438,899,746	1.4446	634,034,574	1.4149	620,999,250	34.60
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	145,672,241	2.4456	356,256,033	2.2580	328,927,920	18.33
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	29,955,870	2.7904	83,588,860	2.9120	87,231,493	4.86
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	33,516,259	1.0125	33,935,213	1.0126	33,938,563	1.89

(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	96.97
合計	96.97

(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3期計算期間末 (2010年 8月30日)	39,310,944	39,310,944	6,765	6,765
第4期計算期間末 (2011年 8月29日)	112,459,110	112,459,110	6,585	6,585
第5期計算期間末 (2012年 8月28日)	201,929,105	201,929,105	6,871	6,871
第6期計算期間末 (2013年 8月28日)	398,978,812	398,978,812	9,144	9,144
第7期計算期間末 (2014年 8月28日)	601,017,817	601,017,817	10,456	10,456
第8期計算期間末 (2015年 8月28日)	818,329,438	818,329,438	11,753	11,753
第9期計算期間末 (2016年 8月29日)	897,737,674	897,737,674	10,969	10,969
第10期計算期間末 (2017年 8月28日)	1,184,545,763	1,184,545,763	12,460	12,460
第11期計算期間末 (2018年 8月28日)	1,515,638,255	1,515,638,255	13,298	13,298
第12期計算期間末 (2019年 8月28日)	1,721,901,931	1,721,901,931	12,782	12,782
2019年 3月末日	1,667,600,930		13,067	
4月末日	1,680,408,839		13,232	
5月末日	1,668,070,218		12,778	
6月末日	1,712,779,884		13,018	
7月末日	1,744,532,490		13,128	
8月末日	1,758,721,989		12,908	
9月末日	1,809,959,617		13,211	
10月末日	1,880,559,668		13,536	
11月末日	1,927,272,199		13,708	
12月末日	1,964,770,964		13,846	
2020年 1月末日	1,967,323,588		13,753	
2月末日	1,882,181,121		13,082	
3月末日	1,794,838,624		12,449	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2009年 8月29日～2010年 8月30日	0
第4期計算期間	2010年 8月31日～2011年 8月29日	0
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	0
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	0
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	0
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	0
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	0

第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	0
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	0
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	2009年 8月29日～2010年 8月30日	7.0
第4期計算期間	2010年 8月31日～2011年 8月29日	2.7
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	4.3
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	33.1
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	14.3
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	12.4
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	6.7
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	13.6
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	6.7
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	3.9
第13期中間計算期間	2019年 8月29日～2020年 2月28日	2.3

(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3期計算期間	2009年 8月29日～2010年 8月30日	57,695,061	10,759,520	58,107,231
第4期計算期間	2010年 8月31日～2011年 8月29日	123,229,417	10,543,180	170,793,468
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	132,499,607	9,393,588	293,899,487
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	178,897,557	36,486,986	436,310,058
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	178,178,605	39,676,309	574,812,354
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	174,356,779	52,914,082	696,255,051
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	161,155,035	39,011,124	818,398,962
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	187,698,313	55,419,992	950,677,283
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	239,625,450	50,566,222	1,139,736,511
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	277,919,743	70,487,031	1,347,169,223
第13期中間計算期間	2019年 8月29日～2020年 2月28日	129,408,947	37,872,599	1,438,705,571

(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ターゲット・イヤー ファンド2055】

(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	7,846,259	96.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		314,585	3.85
合計(純資産総額)		8,160,844	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	2,796,332	1.4672	4,102,799	1.3248	3,704,580	45.39
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	824,891	2.5287	2,085,969	2.2580	1,862,603	22.82
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	1,212,426	1.4314	1,735,471	1.4149	1,715,461	21.02
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	138,864	2.8280	392,710	2.9120	404,371	4.96
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	157,263	1.0123	159,200	1.0126	159,244	1.95

(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	96.15
合計	96.15

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2018年 8月28日)	1,457,998	1,457,998	10,043	10,043
第2期計算期間末	(2019年 8月28日)	4,150,978	4,150,978	9,426	9,426
	2019年 3月末日	2,629,304		9,744	
	4月末日	2,677,465		9,910	
	5月末日	3,160,131		9,466	
	6月末日	4,373,349		9,679	
	7月末日	5,433,299		9,781	
	8月末日	4,714,528		9,542	
	9月末日	5,157,753		9,855	
	10月末日	5,932,648		10,171	
	11月末日	6,998,542		10,343	
	12月末日	10,504,760		10,479	
	2020年 1月末日	10,028,718		10,384	
	2月末日	9,423,334		9,732	
	3月末日	8,160,844		9,168	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2018年 2月27日～2018年 8月28日	0
第2期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2018年 2月27日～2018年 8月28日	0.4
第2期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	6.1
第3期中間計算期間	2019年 8月29日～2020年 2月28日	3.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）

第1期計算期間	2018年 2月27日～2018年 8月28日	1,451,770		1,451,770
第2期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	6,156,092	3,204,277	4,403,585
第3期中間計算期間	2019年 8月29日～2020年 2月28日	7,561,030	2,281,363	9,683,252

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	448,050,550,450	83.43
地方債証券	日本	29,119,683,915	5.42
特殊債券	日本	35,698,139,810	6.65
社債券	日本	20,853,907,600	3.88
	フランス	1,889,078,000	0.35
	オーストラリア	396,840,000	0.07
	アメリカ	202,478,000	0.04
	イギリス	99,511,000	0.02
	小計	23,441,814,600	4.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		710,303,838	0.13
合計(純資産総額)		537,020,492,613	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	9,510,000,000	101.37	9,640,287,000	100.82	9,588,172,200	0.100	2023/12/20	1.79
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	7,300,000,000	101.97	7,444,538,800	100.93	7,368,036,000	0.100	2024/6/20	1.37
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	6,940,000,000	102.47	7,111,793,200	101.50	7,044,169,400	0.100	2026/9/20	1.31
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,900,000,000	101.57	7,008,870,600	100.80	6,955,338,000	0.100	2023/9/20	1.30
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	6,460,000,000	102.39	6,614,812,400	101.35	6,547,339,200	0.100	2026/3/20	1.22
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	104.12	6,580,967,500	102.92	6,504,544,000	0.400	2025/9/20	1.21

日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	6,050,000,000	101.33	6,131,015,300	101.02	6,111,710,000	0.100	2024/12/20	1.14
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	6,050,000,000	101.27	6,127,353,300	100.68	6,091,261,000	0.100	2022/12/20	1.13
日本	国債証券	第141回利付国債（5年）	6,020,000,000	101.36	6,101,914,500	100.98	6,079,477,600	0.100	2024/9/20	1.13
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	5,790,000,000	102.64	5,943,420,000	101.64	5,885,361,300	0.100	2028/3/20	1.10
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	5,230,000,000	103.97	5,437,631,000	102.78	5,375,655,500	0.400	2025/6/20	1.00
日本	国債証券	第131回利付国債（5年）	5,040,000,000	100.81	5,080,824,000	100.47	5,063,839,200	0.100	2022/3/20	0.94
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	4,940,000,000	102.98	5,087,243,100	101.81	5,029,512,800	0.100	2027/9/20	0.94
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	4,940,000,000	103.04	5,090,176,000	101.15	4,997,057,000	0.100	2029/6/20	0.93
日本	国債証券	第132回利付国債（5年）	4,770,000,000	100.89	4,812,641,300	100.54	4,795,996,500	0.100	2022/6/20	0.89
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	4,570,000,000	103.04	4,709,202,200	101.94	4,659,023,600	1.000	2021/12/20	0.87
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	4,490,000,000	102.03	4,581,457,900	101.40	4,552,949,800	0.100	2028/12/20	0.85
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	4,380,000,000	101.50	4,445,702,600	100.87	4,418,368,800	0.100	2024/3/20	0.82
日本	国債証券	第133回利付国債（5年）	4,380,000,000	100.98	4,422,924,000	100.62	4,407,156,000	0.100	2022/9/20	0.82
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	4,280,000,000	101.20	4,331,360,000	100.77	4,313,212,800	0.100	2023/6/20	0.80
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	4,190,000,000	102.48	4,294,243,000	101.49	4,252,472,900	0.100	2028/9/20	0.79
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	4,080,000,000	101.13	4,126,104,000	100.74	4,110,396,000	0.100	2023/3/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	3,820,000,000	102.09	3,900,215,000	101.25	3,868,093,800	0.100	2029/3/20	0.72
日本	国債証券	第403回利付国債（2年）	3,770,000,000	100.80	3,800,271,400	100.31	3,781,837,800	0.100	2021/8/1	0.70
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	3,590,000,000	102.46	3,678,361,000	101.57	3,646,470,700	0.100	2028/6/20	0.68
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	3,540,000,000	102.29	3,621,295,200	101.68	3,599,755,200	0.100	2027/3/20	0.67
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,960,000,000	120.54	3,568,124,400	117.48	3,477,585,600	1.500	2034/6/20	0.65
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	3,400,000,000	102.92	3,499,313,600	102.20	3,474,936,000	0.600	2023/3/20	0.65
日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	3,380,000,000	102.78	3,473,997,800	102.01	3,448,208,400	0.300	2024/12/20	0.64
日本	国債証券	第154回利付国債（20年）	2,950,000,000	116.93	3,449,463,500	113.98	3,362,410,000	1.200	2035/9/20	0.63

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.43
地方債証券	5.42
特殊債券	6.65
社債券	4.37

合計	99.87
----	-------

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	278,084,056,570	97.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,648,235,212	2.68
合計(純資産総額)		285,732,291,782	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	7,477,990,000	2.62

(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	1,571,200	6,650.70	10,449,579,840	6,501.00	10,214,371,200	3.57
日本	株式	ソニー	電気機器	890,500	5,494.43	4,892,789,915	6,421.00	5,717,900,500	2.00
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,847,200	2,469.50	4,561,660,400	2,575.50	4,757,463,600	1.67
日本	株式	キーエンス	電気機器	127,600	31,622.65	4,035,050,140	34,830.00	4,444,308,000	1.56
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,096,400	5,096.40	5,587,692,960	3,788.00	4,153,163,200	1.45
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,171,600	3,805.68	4,458,734,688	3,308.00	3,875,652,800	1.36
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,500,600	504.58	4,793,812,748	403.00	3,828,741,800	1.34
日本	株式	任天堂	その他製品	86,300	38,840.11	3,351,901,493	41,610.00	3,590,943,000	1.26
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,020,800	2,623.13	2,677,691,104	3,377.00	3,447,241,600	1.21
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,029,800	2,814.39	2,898,258,822	3,190.00	3,285,062,000	1.15
日本	株式	第一三共	医薬品	403,000	5,633.61	2,270,344,830	7,434.00	2,995,902,000	1.05
日本	株式	花王	化学	337,200	8,539.28	2,879,445,216	8,830.00	2,977,476,000	1.04
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	963,900	3,573.79	3,444,776,181	2,796.00	2,695,064,400	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,108,700	2,734.61	3,031,862,107	2,430.00	2,694,141,000	0.94
日本	株式	HOYA	精密機器	281,200	8,092.48	2,275,605,376	9,200.00	2,587,040,000	0.91
日本	株式	信越化学工業	化学	236,800	9,568.33	2,265,780,544	10,730.00	2,540,864,000	0.89
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	960,500	3,739.17	3,591,472,785	2,623.00	2,519,391,500	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	496,600	5,526.64	2,744,529,424	4,950.00	2,458,170,000	0.86
日本	株式	ダイキン工業	機械	179,400	13,758.71	2,468,312,574	13,170.00	2,362,698,000	0.83
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,872,100	153.62	2,899,132,002	123.60	2,332,591,560	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	413,700	4,762.05	1,970,060,085	5,472.00	2,263,766,400	0.79
日本	株式	三菱商事	卸売業	973,200	2,800.53	2,725,475,796	2,291.50	2,230,087,800	0.78
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	970,000	2,040.89	1,979,663,300	2,242.50	2,175,225,000	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	676,600	3,785.66	2,561,377,556	3,143.00	2,126,553,800	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,220,900	1,547.95	1,889,892,155	1,671.00	2,040,123,900	0.71
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	117,100	22,186.70	2,598,062,570	17,320.00	2,028,172,000	0.71

日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	247,800	10,209.92	2,530,018,176	8,176.00	2,026,012,800	0.71
日本	株式	S M C	機械	44,200	38,249.11	1,690,610,662	45,750.00	2,022,150,000	0.71
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	143,100	13,585.88	1,944,139,428	13,820.00	1,977,642,000	0.69
日本	株式	ファナック	電気機器	133,800	18,297.92	2,448,261,696	14,655.00	1,960,839,000	0.69

(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	0.19
		建設業	2.63
		食料品	4.10
		繊維製品	0.52
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.35
		医薬品	6.38
		石油・石炭製品	0.45
		ゴム製品	0.64
		ガラス・土石製品	0.73
		鉄鋼	0.57
		非鉄金属	0.63
		金属製品	0.54
		機械	4.77
		電気機器	13.81
		輸送用機器	7.11
		精密機器	2.49
		その他製品	2.40
		電気・ガス業	1.74
陸運業	4.39		
海運業	0.13		
空運業	0.39		
倉庫・運輸関連業	0.18		

	情報・通信業	9.41
	卸売業	4.83
	小売業	4.67
	銀行業	5.03
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	2.15
	その他金融業	1.09
	不動産業	2.10
	サービス業	4.77
	小計	97.32
合計		97.32

(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	533	円	7,561,960,150	7,477,990,000	2.62

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	194,820,053,689	49.62
	フランス	36,656,239,096	9.34
	イタリア	33,324,628,131	8.49
	イギリス	24,243,670,537	6.17
	ドイツ	23,618,040,455	6.02
	スペイン	20,613,657,386	5.25
	ベルギー	8,914,736,414	2.27

	カナダ	7,074,135,095	1.80
	オランダ	6,936,231,850	1.77
	オーストラリア	6,750,946,793	1.72
	オーストリア	5,285,486,321	1.35
	アイルランド	2,684,951,997	0.68
	メキシコ	2,677,982,857	0.68
	ポーランド	2,163,558,213	0.55
	フィンランド	2,121,247,877	0.54
	デンマーク	1,870,366,901	0.48
	マレーシア	1,734,122,509	0.44
	シンガポール	1,578,047,247	0.40
	南アフリカ	1,572,457,171	0.40
	スウェーデン	1,039,901,281	0.26
	ノルウェー	842,587,030	0.21
	小計	386,523,048,850	98.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,117,008,372	1.56
合計(純資産総額)		392,640,057,222	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,454,660,904	0.37
	買建	ドイツ	1,413,141,970	0.36

(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		2,812,473,000	0.72

(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 2.25% 08/15/46	18,760,000	10,031.94	1,881,993,707	13,165.87	2,469,918,965	2.250	2046/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	18,750,000	11,122.37	2,085,445,509	12,263.78	2,299,458,867	2.375	2027/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,466.38	1,726,953,550	13,780.59	2,273,798,794	2.500	2046/2/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	18,010,000	11,361.89	2,046,277,150	12,500.14	2,251,276,254	2.375	2029/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,459.58	1,673,533,325	13,762.74	2,202,039,021	2.500	2046/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	18,900,000	11,024.26	2,083,585,393	11,644.81	2,200,869,090	1.625	2026/11/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/26	18,000,000	11,311.79	2,036,122,236	12,215.74	2,198,833,634	2.625	2026/1/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/21	18,500,000	10,953.84	2,026,461,193	11,243.07	2,079,968,743	2.125	2021/12/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,443.30	1,821,774,076	12,854.69	2,046,467,215	2.875	2028/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	15,990,000	11,458.71	1,832,247,841	12,704.20	2,031,401,905	2.625	2029/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	16,980,000	11,137.35	1,891,123,183	11,711.12	1,988,549,582	2.000	2025/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,681.37	1,682,117,299	13,119.96	1,889,275,204	3.125	2028/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	15,900,000	11,291.34	1,795,323,087	11,831.86	1,881,265,988	2.500	2024/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	12,200,000	11,713.37	1,429,031,494	15,211.54	1,855,808,277	3.000	2049/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,439.90	1,631,330,248	12,813.03	1,827,138,367	2.875	2028/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	11,950,000	11,716.39	1,400,109,107	15,171.58	1,813,004,071	3.000	2048/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,902.55	1,597,224,373	12,233.17	1,792,159,725	2.250	2027/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/30/26	14,600,000	11,194.93	1,634,461,205	12,096.70	1,766,119,601	2.375	2026/4/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 04/30/24	15,000,000	11,069.09	1,660,364,895	11,712.40	1,756,860,549	2.250	2024/4/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/15/29	14,650,000	10,669.34	1,563,058,875	11,800.40	1,728,759,031	1.625	2029/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	15,000,000	11,098.59	1,664,788,834	11,524.92	1,728,739,051	2.375	2023/1/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	15,000,000	11,087.27	1,663,091,086	11,366.78	1,705,017,512	2.000	2022/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	11,000.33	1,650,049,851	11,325.12	1,698,768,281	2.500	2022/1/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	15,000,000	10,935.34	1,640,302,084	11,205.23	1,680,785,832	1.500	2022/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.75% 11/30/21	15,050,000	10,854.16	1,633,551,088	11,160.38	1,679,638,537	1.750	2021/11/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.125% 08/15/21	14,950,000	10,958.67	1,638,321,771	11,172.07	1,670,225,913	2.125	2021/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,819.65	1,585,079,832	11,332.77	1,660,251,396	1.875	2022/10/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	11,500,000	11,272.40	1,296,326,844	14,409.77	1,657,123,802	2.875	2043/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/29/24	13,760,000	11,379.67	1,565,843,949	11,737.91	1,615,136,510	2.375	2024/2/29	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/45	10,900,000	11,258.80	1,227,209,591	14,616.37	1,593,185,332	2.875	2045/8/15	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.44
合計	98.44

(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	40	アメリカドル	4,945,035.09	538,168,168	5,016,250	545,918,487	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	25	アメリカドル	3,370,896.98	366,854,719	3,470,703.25	377,716,635	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	27	アメリカドル	4,600,170.5	500,636,555	4,879,406.25	531,025,782	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	15	ユーロ	1,683,740	201,291,117	1,683,600	201,274,380	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	21	ユーロ	2,817,104	336,784,783	2,845,710	340,204,630	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	42	ユーロ	7,099,088	848,695,970	7,291,200	871,662,960	0.22

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	12,720,000.00	1,386,720,274	1,382,918,400	0.35
	カナダドル	買建	1,520,000.00	114,568,045	116,340,800	0.03
	ユーロ	買建	9,250,000.00	1,103,343,807	1,105,375,000	0.28
	イギリスポンド	買建	1,560,000.00	198,839,940	207,838,800	0.05

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

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	212,241,778,568	62.89
	イギリス	16,611,555,588	4.92
	スイス	12,921,551,041	3.83
	フランス	11,304,752,274	3.35
	カナダ	10,769,930,601	3.19

	ドイツ	9,147,597,493	2.71
	オーストラリア	6,212,762,905	1.84
	アイルランド	5,997,130,960	1.78
	オランダ	5,855,969,721	1.74
	香港	2,909,645,630	0.86
	スペイン	2,891,937,163	0.86
	スウェーデン	2,775,178,294	0.82
	デンマーク	2,435,404,760	0.72
	イタリア	2,003,882,637	0.59
	シンガポール	1,234,361,264	0.37
	フィンランド	1,229,406,260	0.36
	バミューダ	1,094,706,875	0.32
	ベルギー	956,414,465	0.28
	ケイマン	712,532,640	0.21
	イスラエル	637,646,508	0.19
	ジャージー	632,027,509	0.19
	ノルウェー	594,774,172	0.18
	ニュージーランド	339,802,042	0.10
	ルクセンブルク	230,717,834	0.07
	ポルトガル	186,222,118	0.06
	キュラソー	177,799,071	0.05
	オーストリア	176,913,821	0.05
	パナマ	64,254,625	0.02
	リベリア	49,540,838	0.01
	マン島	28,330,500	0.01
	パプアニューギニア	18,291,050	0.01
	英ヴァージン諸島	14,137,425	0.00
	小計	312,456,956,652	92.59
投資信託受益証券	オーストラリア	135,494,637	0.04
	香港	78,370,999	0.02
	小計	213,865,636	0.06
投資証券	アメリカ	7,300,609,413	2.16
	オーストラリア	373,209,888	0.11
	フランス	219,438,888	0.07
	香港	180,210,420	0.05
	イギリス	171,545,031	0.05
	シンガポール	148,797,475	0.04
	カナダ	64,349,512	0.02
	小計	8,458,160,627	2.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		16,342,892,222	4.84
合計(純資産総額)		337,471,875,137	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	11,523,373,132	3.41
	買建	カナダ	594,838,832	0.18
	買建	ドイツ	2,480,267,010	0.73
	買建	イギリス	1,007,115,278	0.30
	買建	オーストラリア	668,992,720	0.20

(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		1,278,299,150	0.38

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	664,066	13,889.58	9,223,602,295	17,437.83	11,579,870,614	3.43
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	407,243	19,801.95	8,064,206,656	27,730.97	11,293,244,352	3.35
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	38,664	199,603.82	7,717,482,430	213,736.67	8,263,914,938	2.45
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	220,562	19,930.80	4,395,979,227	18,060.33	3,983,424,380	1.18
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	28,342	123,646.61	3,504,392,258	124,808.42	3,537,320,257	1.05
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	241,260	14,801.24	3,570,948,501	14,475.47	3,492,353,895	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	27,466	124,362.49	3,415,740,204	124,752.91	3,426,463,627	1.02

スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	273,000	11,220.78	3,063,275,008	11,298.35	3,084,451,734	0.91
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	288,543	11,758.26	3,392,765,491	10,175.60	2,936,099,594	0.87
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	228,573	11,458.07	2,619,007,144	12,515.45	2,860,693,953	0.85
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	157,050	17,863.84	2,805,516,515	18,018.98	2,829,881,296	0.84
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	399,059	4,801.84	1,916,218,785	6,038.97	2,409,908,003	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	120,861	21,689.12	2,621,368,915	19,935.47	2,409,421,976	0.71
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	86,917	26,213.41	2,278,391,082	27,346.80	2,376,902,024	0.70
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	82,362	27,722.85	2,283,310,130	27,561.19	2,269,995,349	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	379,353	6,353.97	2,410,398,889	5,960.61	2,261,178,737	0.67
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	64,487	30,634.87	1,975,551,341	34,959.24	2,254,417,026	0.67
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	670,087	3,489.02	2,337,952,528	3,289.93	2,204,539,927	0.65
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	100,194	20,931.91	2,097,251,989	21,341.56	2,138,296,563	0.63
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	233,609	8,698.18	2,031,974,889	8,374.46	1,956,351,212	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	786,173	3,009.37	2,365,889,396	2,398.61	1,885,724,935	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	373,610	5,343.64	1,996,438,355	4,897.35	1,829,698,934	0.54
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	507,939	4,461.98	2,266,413,689	3,555.47	1,805,964,975	0.54
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	165,445	14,284.90	2,363,366,415	10,861.23	1,796,936,859	0.53
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	128,521	13,864.42	1,781,869,268	13,655.98	1,755,081,285	0.52
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	197,657	9,939.86	1,964,684,165	8,807.73	1,740,911,070	0.52
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	389,430	5,795.58	2,256,974,311	4,388.02	1,708,828,809	0.51
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	130,425	11,235.96	1,465,451,291	12,536.12	1,635,024,455	0.48
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	40,234	38,168.26	1,535,661,922	40,371.57	1,624,310,021	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	416,741	4,593.40	1,914,262,113	3,862.37	1,609,610,728	0.48

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.34
		素材	3.78
		資本財	5.96
		商業・専門サービス	1.18
		運輸	1.72
		自動車・自動車部品	0.89
		耐久消費財・アパレル	1.70
		消費者サービス	1.40
		メディア・娯楽	5.94
		小売	5.07
		食品・生活必需品小売り	1.62
		食品・飲料・タバコ	4.85
		家庭用品・パーソナル用品	2.25
		ヘルスケア機器・サービス	5.08
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.01
		銀行	5.85
		各種金融	4.06
		保険	3.26
		不動産	0.51
		ソフトウェア・サービス	10.70
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.83
電気通信サービス	2.29		
公益事業	3.78		
半導体・半導体製造装置	3.49		
	小計	92.59	
投資信託受益証券			0.06
投資証券			2.51
合計			95.16

(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 (%)
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	811	アメリカドル	97,237,629.5	10,582,371,218	105,884,160	11,523,373,132	3.41

株指先物取引	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	49	カナダドル	7,253,476.5	555,616,300	7,765,520	594,838,832	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	59	スイスフラン	4,967,543	562,375,543	5,285,810	598,406,550	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	580	ユーロ	14,504,790	1,734,047,644	15,741,200	1,881,860,460	0.56
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	78	オーストラリアドル	9,701,871	641,196,654	10,122,450	668,992,720	0.20
	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	136	イギリスポンド	7,129,505	950,505,606	7,554,120	1,007,115,278	0.30

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	8,564,000.00	922,981,780	931,925,870	0.28
	カナダドル	買建	548,000.00	41,952,232	41,971,320	0.01
	ユーロ	買建	1,192,000.00	142,330,998	142,491,680	0.04
	イギリスポンド	買建	291,000.00	38,863,870	38,792,000	0.01
	スイスフラン	買建	359,000.00	40,492,687	40,638,800	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	1,201,000.00	12,993,619	12,970,800	0.00
	ノルウェークローネ	買建	564,000.00	5,711,064	5,781,000	0.00
	デンマーククローネ	買建	820,000.00	13,116,720	13,120,000	0.00
	オーストラリアドル	買建	596,000.00	39,376,924	39,383,680	0.01
	香港ドル	買建	800,000.00	11,109,600	11,224,000	0.00

(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。

短期金融資産 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 (%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,039,178,234	100.00
合計(純資産総額)		9,039,178,234	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

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。

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：2007年9月26日

作成基準日：2020年3月31日

DCターゲット・イヤー ファンド2025



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
短期金融資産 マザーファンド	46.0%	-	-	-	-	-	-	-
国内債券 インデックス マザーファンド	34.0%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.6%
		第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.5%
国内株式 インデックス マザーファンド	10.0%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.4%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.2%
外国株式 インデックス マザーファンド	4.6%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.2%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	2.8%	T 2.25% 08/15/46	アメリカ	国債	-	2.250%	2046/08/15	0.0%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	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)



※2020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：2007年9月26日

作成基準日：2020年3月31日

DCターゲット・イヤー ファンド2035



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内債券 インデックス マザーファンド	49.5%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.9%
		第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.7%
国内株式 インデックス マザーファンド	27.0%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.0%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
外国株式 インデックス マザーファンド	13.5%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/半導体	-	-	0.5%
外国債券 インデックス マザーファンド	4.9%	T 2.25% 08/15/46	アメリカ	国債	-	2.250%	2046/08/15	0.0%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	1.9%	-	-	-	-	-	-	-

※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)



※2020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：2007年9月26日

作成基準日：2020年3月31日

DCターゲット・イヤー ファンド2045

基準価額・純資産の推移



基準価額 12,449円

純資産総額 17.95億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年8月	0円
2016年8月	0円
2017年8月	0円
2018年8月	0円
2019年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

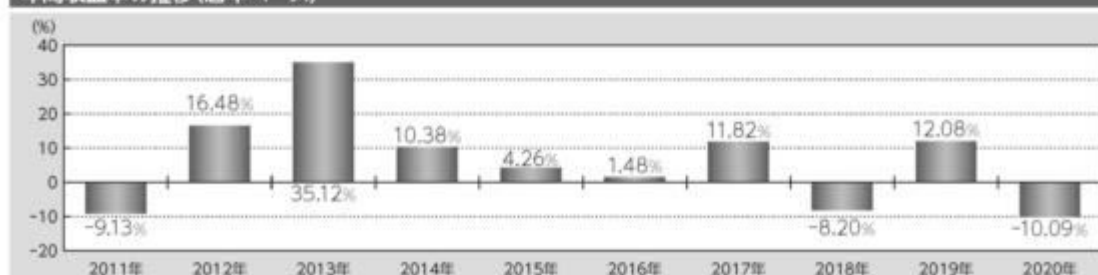
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式 インデックス マザーファンド	37.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.3%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
国内債券 インデックス マザーファンド	34.6%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.6%
		第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.5%
外国株式 インデックス マザーファンド	18.3%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.6%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ソフトウェア	-	-	0.6%
外国債券 インデックス マザーファンド	4.9%	T 2.25% 08/15/46	アメリカ	国債	-	2.250%	2046/08/15	0.0%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	1.9%	-	-	-	-	-	-	-

※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)



※2020年は年初から作成基準日までの収益率です。

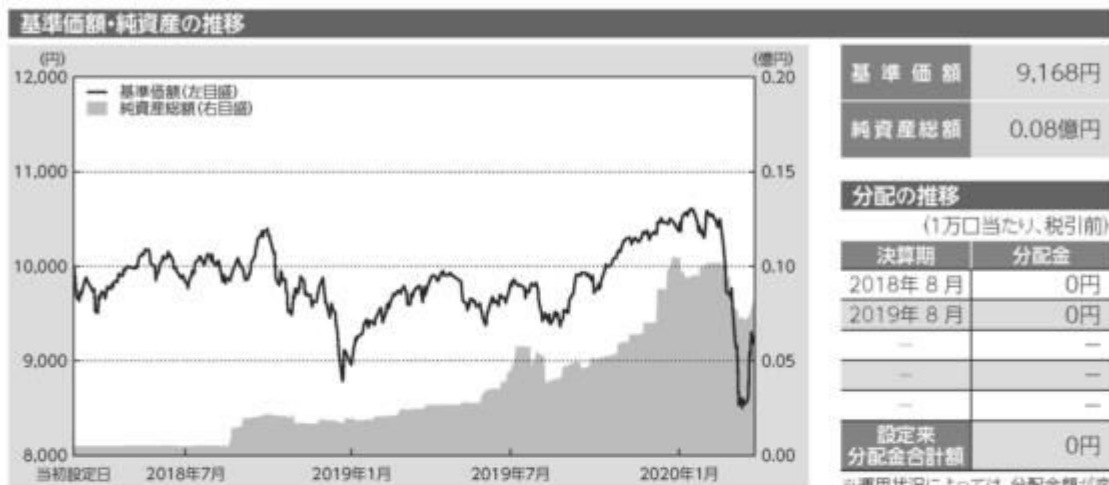
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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：2018年2月27日
作成基準日：2020年3月31日

DCターゲット・イヤー ファンド2055


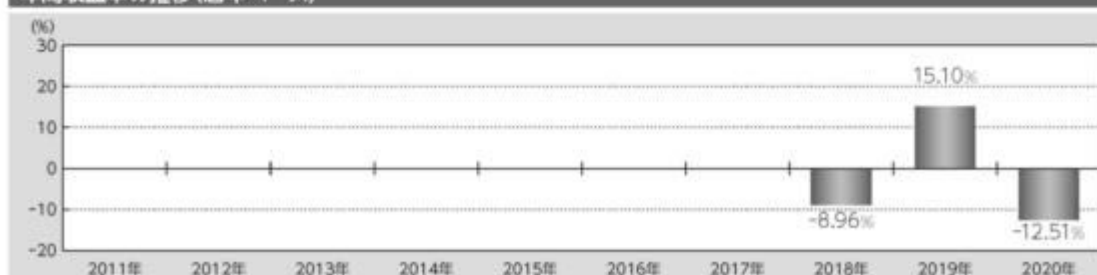
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式 インデックス マザーファンド	45.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.6%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.9%
外国株式 インデックス マザーファンド	22.8%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ソフトウェア	-	-	0.8%
国内債券 インデックス マザーファンド	21.0%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.4%
		第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.3%
外国債券 インデックス マザーファンド	5.0%	T 2.25% 08/15/46	アメリカ	国債	-	2.250%	2046/08/15	0.0%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	2.0%	-	-	-	-	-	-	-

※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）


※2018年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2020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 >

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 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受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口単位とします。

<解約価額>

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

<一部解約代金の支払い>

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

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

<受付不可日>

ありません。

<一部解約受付の中止等>

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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>

ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

・株式

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

・公社債

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

す。

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

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2025、2035、2045は2007年9月26日設定、2055は2018年2月27日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年8月29日から翌年8月28日（第1計算期間は、2025、2035、2045は2007年9月26日から2008年8月28日、2055は2018年2月27日から2018年8月28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】

2025、2035、2045

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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、販売会社を経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。

2055

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

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

- ・ 受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >、< 関係法人との契約の更改手続き >、< 公告 >、< 混蔵寄託 >、< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 > については2025、2035、2045と同一です。

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ターゲット・イヤー ファンド2025】

(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12期計算期間(2018年8月29日から2019年8月28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11期 (2018年 8月28日現在)	第12期 (2019年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	123,320,080	148,088,448
親投資信託受益証券	3,796,003,535	4,252,309,191
流動資産合計	3,919,323,615	4,400,397,639
資産合計	3,919,323,615	4,400,397,639
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	6,904,194
未払受託者報酬	829,120	908,342
未払委託者報酬	8,083,807	8,856,238
未払利息	242	232
その他未払費用	205,246	222,209
流動負債合計	9,118,415	16,891,215
負債合計	9,118,415	16,891,215
純資産の部		
元本等		
元本	3,104,828,222	3,495,659,380
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	805,376,978	887,847,044
(分配準備積立金)	669,465,354	645,407,525
元本等合計	3,910,205,200	4,383,506,424
純資産合計	3,910,205,200	4,383,506,424
負債純資産合計	3,919,323,615	4,400,397,639

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	2017年 8月29日	自	2018年 8月29日
	至	2018年 8月28日	至	2019年 8月28日
営業収益				
受取利息		75		65
有価証券売買等損益		106,195,029		4,735,656
営業収益合計		106,195,104		4,735,721
営業費用				
支払利息		79,536		94,677
受託者報酬		1,642,860		1,778,588
委託者報酬		16,017,741		17,341,046
その他費用		208,151		227,373
営業費用合計		17,948,288		19,441,684
営業利益又は営業損失（ ）		88,246,816		14,705,963
経常利益又は経常損失（ ）		88,246,816		14,705,963
当期純利益又は当期純損失（ ）		88,246,816		14,705,963
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（ ）		4,251,112		647,766
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		667,008,452		805,376,978
剰余金増加額又は欠損金減少額		90,273,744		127,802,762
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		90,273,744		127,802,762
剰余金減少額又は欠損金増加額		35,900,922		31,274,499
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		35,900,922		31,274,499
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		805,376,978		887,847,044

(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11期 (2018年 8月28日現在)	第12期 (2019年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,104,828,222口	3,495,659,380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) 1.2594円 (12,594円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2540円 (12,540円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 2017年 8月29日 至 2018年 8月28日	第12期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28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>- 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>84,008,447円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>472,744,508円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>585,456,907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>1,142,209,862円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,104,828,222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>3,678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	- 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	84,008,447円	収益調整金額	C	472,744,508円	分配準備積立金額	D	585,456,907円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,142,209,862円	当ファンドの期末残存口数	F	3,104,828,222口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,678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>- 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>640,572,702円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>645,407,525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>1,285,980,227円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,495,659,380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>3,678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	- 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	640,572,702円	分配準備積立金額	D	645,407,525円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,285,980,227円	当ファンドの期末残存口数	F	3,495,659,380口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,678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	- 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	84,008,447円																																																											
収益調整金額	C	472,744,508円																																																											
分配準備積立金額	D	585,456,907円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,142,209,862円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,104,828,222口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,678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	- 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	640,572,702円																																																											
分配準備積立金額	D	645,407,525円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,285,980,227円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,495,659,380口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,678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12期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28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12期 (2019年 8月28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11期	第12期
	自 2017年 8月29日 至 2018年 8月28日	自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,909,737,320円	3,104,828,222円
期中追加設定元本額	350,641,543円	511,821,385円
期中一部解約元本額	155,550,641円	120,990,227円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (2018年 8月28日現在)	第12期 (2019年 8月28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	88,965,833	3,353,417
合計	88,965,833	3,353,417

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	385,571,700	529,505,615	
	外国株式インデックス マザーファンド	108,000,999	265,498,855	
	国内債券インデックス マザーファンド	1,085,660,144	1,574,098,642	
	外国債券インデックス マザーファンド	47,554,178	132,433,630	
	短期金融資産 マザーファンド	1,728,475,120	1,750,772,449	
合計		3,355,262,141	4,252,309,191	

(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ターゲット・イヤー ファンド2035】

(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12期計算期間(2018年8月29日から2019年8月28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11期 (2018年 8月28日現在)	第12期 (2019年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	103,593,327	117,721,498
親投資信託受益証券	3,144,158,440	3,532,653,203
流動資産合計	3,247,751,767	3,650,374,701
資産合計	3,247,751,767	3,650,374,701
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	2,974
未払受託者報酬	679,754	758,529
未払委託者報酬	6,627,553	7,395,621
未払利息	204	184
その他未払費用	166,649	184,258
流動負債合計	7,474,160	8,341,566
負債合計	7,474,160	8,341,566
純資産の部		
元本等		
元本	2,459,380,234	2,812,666,688
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	780,897,373	829,366,447
(分配準備積立金)	703,089,166	686,162,065
元本等合計	3,240,277,607	3,642,033,135
純資産合計	3,240,277,607	3,642,033,135
負債純資産合計	3,247,751,767	3,650,374,701

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	2017年 8月29日	自	2018年 8月29日
	至	2018年 8月28日	至	2019年 8月28日
営業収益				
受取利息		59		55
有価証券売買等損益		149,225,037		39,425,237
営業収益合計		149,225,096		39,425,182
営業費用				
支払利息		63,188		80,356
受託者報酬		1,334,133		1,475,024
委託者報酬		13,007,661		14,381,383
その他費用		168,954		188,513
営業費用合計		14,573,936		16,125,276
営業利益又は営業損失（ ）		134,651,160		55,550,458
経常利益又は経常損失（ ）		134,651,160		55,550,458
当期純利益又は当期純損失（ ）		134,651,160		55,550,458
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（ ）		4,450,597		909,260
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		567,141,959		780,897,373
剰余金増加額又は欠損金減少額		104,152,609		123,425,272
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		104,152,609		123,425,272
剰余金減少額又は欠損金増加額		20,597,758		20,315,000
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		20,597,758		20,315,000
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		780,897,373		829,366,447

(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11期 (2018年 8月28日現在)	第12期 (2019年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,459,380,234口	2,812,666,688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) 1.3175円 (13,175円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2949円 (12,949円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 2017年 8月29日 至 2018年 8月28日	第12期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28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>- 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>130,214,681円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>563,740,656円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>572,874,485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>1,266,829,822円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,459,380,234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>5,151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	- 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	130,214,681円	収益調整金額	C	563,740,656円	分配準備積立金額	D	572,874,485円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,266,829,822円	当ファンドの期末残存口数	F	2,459,380,234口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,151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>- 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>762,639,567円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>686,162,065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>1,448,801,632円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,812,666,688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>5,150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	- 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	762,639,567円	分配準備積立金額	D	686,162,065円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,448,801,632円	当ファンドの期末残存口数	F	2,812,666,688口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,150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	- 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	130,214,681円																																																											
収益調整金額	C	563,740,656円																																																											
分配準備積立金額	D	572,874,485円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,266,829,822円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,459,380,234口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,151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	- 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	762,639,567円																																																											
分配準備積立金額	D	686,162,065円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,448,801,632円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,812,666,688口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,150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12期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28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12期 (2019年 8月28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11期	第12期
	自 2017年 8月29日 至 2018年 8月28日	自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,204,593,040円	2,459,380,234円
期中追加設定元本額	333,480,026円	417,662,600円
期中一部解約元本額	78,692,832円	64,376,146円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (2018年 8月28日現在)	第12期 (2019年 8月28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	136,019,630	34,819,238
合計	136,019,630	34,819,238

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	688,458,665	945,460,284	
	外国株式インデックス マザーファンド	188,765,946	464,043,325	
	国内債券インデックス マザーファンド	1,288,187,122	1,867,742,508	
	外国債券インデックス マザーファンド	65,461,662	182,304,182	
	短期金融資産 マザーファンド	72,171,887	73,102,904	
合計		2,303,045,282	3,532,653,203	

(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ターゲット・イヤー ファンド2045】

(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12期計算期間(2018年8月29日から2019年8月28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11期 (2018年 8月28日現在)	第12期 (2019年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	51,275,820	55,786,598
親投資信託受益証券	1,467,798,435	1,670,079,021
未収入金	-	760,000
流動資産合計	1,519,074,255	1,726,625,619
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	756,009
未払受託者報酬	312,649	360,974
未払委託者報酬	3,048,262	3,519,450
未払利息	101	87
その他未払費用	74,988	87,168
流動負債合計	3,436,000	4,723,688
負債合計	3,436,000	4,723,688
純資産の部		
元本等		
元本	1,139,736,511	1,347,169,223
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	375,901,744	374,732,708
(分配準備積立金)	305,015,296	288,256,291
元本等合計	1,515,638,255	1,721,901,931
純資産合計	1,515,638,255	1,721,901,931
負債純資産合計	1,519,074,255	1,726,625,619

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	2017年 8月29日	自	2018年 8月29日
	至	2018年 8月28日	至	2019年 8月28日
営業収益				
受取利息		24		26
有価証券売買等損益		87,565,295		54,479,414
営業収益合計		87,565,319		54,479,388
営業費用				
支払利息		28,573		38,296
受託者報酬		600,891		698,403
委託者報酬		5,858,547		6,809,316
その他費用		76,033		89,177
営業費用合計		6,564,044		7,635,192
営業利益又は営業損失（ ）		81,001,275		62,114,580
経常利益又は経常損失（ ）		81,001,275		62,114,580
当期純利益又は当期純損失（ ）		81,001,275		62,114,580
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（ ）		3,146,276		2,303,229
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		233,868,480		375,901,744
剰余金増加額又は欠損金減少額		76,996,239		81,619,052
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		76,996,239		81,619,052
剰余金減少額又は欠損金増加額		12,817,974		22,976,737
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		12,817,974		22,976,737
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		375,901,744		374,732,708

(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11期 (2018年 8月28日現在)	第12期 (2019年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,139,736,511口	1,347,169,223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) 1.3298円 (13,298円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2782円 (12,782円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 2017年 8月29日 至 2018年 8月28日			第12期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	77,863,312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	297,526,763円	収益調整金額	C	423,944,408円
分配準備積立金額	D	227,151,984円	分配準備積立金額	D	288,256,291円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	602,542,059円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	712,200,699円
当ファンドの期末残存口数	F	1,139,736,511口	当ファンドの期末残存口数	F	1,347,169,223口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,286円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,286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12期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28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12期 (2019年 8月28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11期	第12期
	自 2017年 8月29日 至 2018年 8月28日	自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	950,677,283円	1,139,736,511円
期中追加設定元本額	239,625,450円	277,919,743円
期中一部解約元本額	50,566,222円	70,487,031円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (2018年 8月28日現在)	第12期 (2019年 8月28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	80,921,324	50,582,889
合計	80,921,324	50,582,889

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	451,580,222	620,155,118	
	外国株式インデックス マザーファンド	123,815,508	304,375,663	
	国内債券インデックス マザーファンド	430,761,644	624,561,307	
	外国債券インデックス マザーファンド	31,009,382	86,358,027	
	短期金融資産 マザーファンド	34,187,883	34,628,906	
合計		1,071,354,639	1,670,079,021	

(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ターゲット・イヤー ファンド2055】

(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2期計算期間(2018年8月29日から2019年8月28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1期 (2018年 8月28日現在)	第2期 (2019年 8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	43,038	133,255
親投資信託受益証券	1,414,996	4,025,809
流動資産合計	1,458,034	4,159,064
資産合計	1,458,034	4,159,064
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	4	753
未払委託者報酬	32	7,298
その他未払費用	-	35
流動負債合計	36	8,086
負債合計	36	8,086
純資産の部		
元本等		
元本	1,451,770	4,403,585
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,228	252,607
(分配準備積立金)	16,877	44,094
元本等合計	1,457,998	4,150,978
純資産合計	1,457,998	4,150,978
負債純資産合計	1,458,034	4,159,064

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2018年 2月27日 至 2018年 8月28日	自	2018年 8月29日 至 2019年 8月28日
営業収益				
有価証券売買等損益		18,048		208,064
営業収益合計		18,048		208,064
営業費用				
支払利息		1		3
受託者報酬		157		1,155
委託者報酬		1,013		11,306
その他費用		-		43
営業費用合計		1,171		12,507
営業利益又は営業損失（ ）		16,877		220,571
経常利益又は経常損失（ ）		16,877		220,571
当期純利益又は当期純損失（ ）		16,877		220,571
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（ ）		-		77,226
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		6,228
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		58,102
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		58,102
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,649		173,592
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,649		173,592
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,228		252,607

(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1期 (2018年 8月28日現在)	第2期 (2019年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,451,770口	4,403,585口
2. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 - 円	元本の欠損 252,607円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0043円 (10,043円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.9426円 (9,426円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2018年 2月27日 至 2018年 8月28日			第2期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28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	4,614円	費用控除後の配当等収益額	A	36,827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	12,263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	133円	収益調整金額	C	47,393円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	7,267円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,010円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	91,487円
当ファンドの期末残存口数	F	1,451,770口	当ファンドの期末残存口数	F	4,403,585口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	117円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	207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2期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28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2期 (2019年 8月28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1期	第2期
	自 2018年 2月27日 至 2018年 8月28日	自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	1,451,770円
期中追加設定元本額	951,770円	6,156,092円
期中一部解約元本額	- 円	3,204,277円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 (2018年 8月28日現在)	第2期 (2019年 8月28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	17,776	134,505
合計	17,776	134,505

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,393,739	1,914,021	
	外国株式インデックス マザーファンド	382,203	939,569	
	国内債券インデックス マザーファンド	606,918	879,970	
	外国債券インデックス マザーファンド	74,904	208,600	
	短期金融資産 マザーファンド	82,584	83,649	
合計		2,540,348	4,025,809	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,446,171,103
国債証券	416,522,674,550
地方債証券	26,543,703,337
特殊債券	33,843,614,219
社債券	19,597,844,320
未収入金	559,044,000
未収利息	1,134,845,283
前払費用	54,224,929
流動資産合計	499,702,121,741
資産合計	499,702,121,741
負債の部	
流動負債	
未払金	1,761,860,588
未払解約金	131,896,078
未払利息	2,269

	2019年 8月28日現在
項目	金額（円）
その他未払費用	12
流動負債合計	1,893,758,947
負債合計	1,893,758,947
純資産の部	
元本等	
元本	343,350,525,726
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,457,837,068
元本等合計	497,808,362,794
純資産合計	497,808,362,794
負債純資産合計	499,702,121,741

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28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28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	343,350,525,726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 103,923,000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 1.4499円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,499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 8月28日現在
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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 8月28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。

	2019年 8月28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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月29日
期首元本額	290,958,110,688円
期中追加設定元本額	73,058,361,108円
期中一部解約元本額	20,665,946,070円
期末元本額	343,350,525,726円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,898,071,972円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,076,485円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,350,877,613円
世界経済インデックスファンド	1,863,590,339円
D Cマイセレクション2 5	20,245,722,581円
D Cマイセレクション5 0	22,072,478,038円
D Cマイセレクション7 5	5,957,510,299円
D C日本債券インデックス・オープン	459,709,461円
D C日本債券インデックス・オープンS	86,130,280,795円
D C日本債券インデックス・オープンP	39,841,989,928円
D CマイセレクションS 2 5	8,206,681,602円
D CマイセレクションS 5 0	8,964,737,889円
D CマイセレクションS 7 5	1,705,019,336円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	1,085,660,144円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	1,288,187,122円

区分	2019年 8月28日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	430,761,644円
DC世界経済インデックスファンド	1,636,345,323円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	87,990,968円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	4,809,222円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	42,594,728円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	13,389,556円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	866,233円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	172,365,570円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	290,722,702円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	61,675,646円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	141,257,916円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	4,281,283,443円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	944,447,497円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,562,731,506円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	820,473,761円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	105,827,157円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,237,395,246円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	27,145,332円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,440,286,214円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,792,934,308円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	165,211,899円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,234,605,870円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,080,499,241円
分散投資コア戦略ファンドA	7,646,731,677円
分散投資コア戦略ファンドS	4,622,958,558円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	65,184,338円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	797,354,587円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	51,300,493円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	33,195,959円
SMT インデックスバランス・オープン	64,842,771円
SMT 世界経済インデックス・オープン	10,755,555円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	11,167,961円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	23,291,558円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,440,161円
グローバル経済コア	227,066,829円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,947,652円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	606,918円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	18,784円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	14,886円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,633円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	7,089円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	79,119,187,491円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		8,319,659,750
地方債証券		61,638,838
特殊債券		125,679,580
社債券		148,127,110
合計		8,655,105,278

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第392回利付国債(2年)	530,000,000	532,008,700	
	第393回利付国債(2年)	840,000,000	843,486,000	
	第394回利付国債(2年)	1,040,000,000	1,044,659,200	
	第395回利付国債(2年)	560,000,000	562,682,400	
	第396回利付国債(2年)	2,010,000,000	2,020,291,200	
	第397回利付国債(2年)	1,360,000,000	1,367,398,400	
	第398回利付国債(2年)	5,040,000,000	5,069,282,400	
	第399回利付国債(2年)	3,100,000,000	3,119,282,000	
	第400回利付国債(2年)	630,000,000	634,176,900	
	第401回利付国債(2年)	2,700,000,000	2,718,819,000	
	第402回利付国債(2年)	1,870,000,000	1,883,819,300	
	第403回利付国債(2年)	50,000,000	50,391,500	
	第125回利付国債(5年)	3,610,000,000	3,624,367,800	

第126回利付国債（5年）	2,960,000,000	2,974,770,400	
第127回利付国債（5年）	4,780,000,000	4,809,110,200	
第128回利付国債（5年）	1,610,000,000	1,621,559,800	
第129回利付国債（5年）	3,340,000,000	3,368,022,600	
第130回利付国債（5年）	1,360,000,000	1,372,960,800	
第131回利付国債（5年）	5,540,000,000	5,599,222,600	
第132回利付国債（5年）	4,800,000,000	4,857,120,000	
第133回利付国債（5年）	4,740,000,000	4,802,236,200	
第134回利付国債（5年）	3,170,000,000	3,215,584,600	
第135回利付国債（5年）	5,680,000,000	5,769,914,400	
第136回利付国債（5年）	5,900,000,000	6,002,424,000	
第137回利付国債（5年）	3,430,000,000	3,492,837,600	
第138回利付国債（5年）	9,070,000,000	9,246,502,200	
第139回利付国債（5年）	5,970,000,000	6,092,922,300	
第140回利付国債（5年）	3,960,000,000	4,046,130,000	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	650,904,000	
第2回利付国債（40年）	470,000,000	745,847,700	
第3回利付国債（40年）	550,000,000	883,289,000	
第4回利付国債（40年）	1,000,000,000	1,625,000,000	
第5回利付国債（40年）	890,000,000	1,405,434,600	
第6回利付国債（40年）	720,000,000	1,126,137,600	
第7回利付国債（40年）	720,000,000	1,088,424,000	
第8回利付国債（40年）	800,000,000	1,137,552,000	
第9回利付国債（40年）	1,090,000,000	1,174,257,000	
第10回利付国債（40年）	1,920,000,000	2,419,065,600	
第11回利付国債（40年）	1,730,000,000	2,124,370,800	
第12回利付国債（40年）	520,000,000	581,443,200	
第310回利付国債（10年）	1,410,000,000	1,429,105,500	
第311回利付国債（10年）	1,080,000,000	1,092,344,400	
第312回利付国債（10年）	3,810,000,000	3,884,104,500	
第313回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,383,547,500	
第314回利付国債（10年）	470,000,000	480,208,400	
第315回利付国債（10年）	3,140,000,000	3,225,031,200	
第316回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,199,554,200	
第317回利付国債（10年）	890,000,000	915,827,800	
第318回利付国債（10年）	1,960,000,000	2,012,822,000	
第319回利付国債（10年）	1,710,000,000	1,765,865,700	
第320回利付国債（10年）	4,570,000,000	4,708,699,500	
第321回利付国債（10年）	2,470,000,000	2,553,362,500	
第322回利付国債（10年）	750,000,000	773,377,500	
第323回利付国債（10年）	970,000,000	1,003,241,900	
第324回利付国債（10年）	2,630,000,000	2,712,687,200	

第325回利付国債(10年)	2,920,000,000	3,021,061,200	
第326回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,716,921,400	
第327回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,328,166,400	
第328回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,863,210,500	
第329回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,348,955,000	
第330回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,507,579,200	
第331回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,433,406,000	
第332回利付国債(10年)	3,250,000,000	3,383,607,500	
第333回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,431,355,000	
第334回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,918,898,000	
第335回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,779,461,000	
第336回利付国債(10年)	510,000,000	533,740,500	
第337回利付国債(10年)	3,380,000,000	3,500,733,600	
第338回利付国債(10年)	2,450,000,000	2,556,281,000	
第339回利付国債(10年)	3,890,000,000	4,066,567,100	
第340回利付国債(10年)	4,320,000,000	4,524,768,000	
第341回利付国債(10年)	3,430,000,000	3,577,284,200	
第342回利付国債(10年)	4,060,000,000	4,186,793,800	
第343回利付国債(10年)	2,830,000,000	2,922,880,600	
第344回利付国債(10年)	2,420,000,000	2,503,344,800	
第345回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,052,210,600	
第346回利付国債(10年)	2,860,000,000	2,966,792,400	
第347回利付国債(10年)	2,270,000,000	2,356,714,000	
第348回利付国債(10年)	2,060,000,000	2,140,422,400	
第349回利付国債(10年)	3,390,000,000	3,523,566,000	
第350回利付国債(10年)	5,350,000,000	5,559,880,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	3,830,000,000	3,979,370,000	
第352回利付国債(10年)	3,890,000,000	4,042,410,200	
第353回利付国債(10年)	4,400,000,000	4,570,720,000	
第354回利付国債(10年)	3,940,000,000	4,091,020,200	
第355回利付国債(10年)	1,890,000,000	1,961,442,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	144,250,700	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	205,075,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	153,210,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	149,078,600	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	64,251,000	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	250,659,400	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	237,047,400	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	62,993,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	289,536,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	186,899,200	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	112,840,200	

第12回利付国債(30年)	190,000,000	249,608,700
第13回利付国債(30年)	290,000,000	378,133,900
第14回利付国債(30年)	300,000,000	409,572,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	471,100,600
第16回利付国債(30年)	370,000,000	514,340,700
第17回利付国債(30年)	570,000,000	786,657,000
第18回利付国債(30年)	345,000,000	472,108,350
第19回利付国債(30年)	380,000,000	521,873,000
第20回利付国債(30年)	480,000,000	677,068,800
第21回利付国債(30年)	500,000,000	690,940,000
第22回利付国債(30年)	400,000,000	567,912,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	612,745,700
第24回利付国債(30年)	380,000,000	543,460,800
第25回利付国債(30年)	350,000,000	489,765,500
第26回利付国債(30年)	430,000,000	611,176,200
第27回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,462,055,800
第28回利付国債(30年)	1,640,000,000	2,389,709,600
第29回利付国債(30年)	1,400,000,000	2,024,974,000
第30回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,564,967,500
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,566,598,000
第32回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,947,515,800
第33回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,338,918,500
第34回利付国債(30年)	1,545,000,000	2,241,455,100
第35回利付国債(30年)	1,690,000,000	2,393,394,900
第36回利付国債(30年)	1,680,000,000	2,392,017,600
第37回利付国債(30年)	1,780,000,000	2,507,842,000
第38回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,713,193,200
第39回利付国債(30年)	940,000,000	1,335,016,200
第40回利付国債(30年)	810,000,000	1,133,522,100
第41回利付国債(30年)	930,000,000	1,283,139,600
第42回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,577,167,200
第43回利付国債(30年)	960,000,000	1,330,214,400
第44回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,500,616,800
第45回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,476,497,000
第46回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,749,163,000
第47回利付国債(30年)	1,510,000,000	2,074,619,200
第48回利付国債(30年)	1,590,000,000	2,106,956,700
第49回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,936,617,000
第50回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,254,018,600
第51回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,291,261,600
第52回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,684,544,400
第53回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,255,508,800
第54回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,562,896,300

第55回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,223,716,000	
第56回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,484,519,400	
第57回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,602,229,600	
第58回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,710,420,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	196,089,900	
第60回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,973,163,900	
第61回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,500,733,000	
第62回利付国債(30年)	670,000,000	735,325,000	
第63回利付国債(30年)	470,000,000	502,091,600	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	92,374,200	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	134,759,300	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	145,248,600	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	227,557,000	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	104,168,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	115,480,200	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	84,474,400	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	211,652,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	148,341,200	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	159,814,500	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	255,024,000	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	320,580,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	213,548,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	370,198,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	251,529,600	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	334,073,600	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	216,470,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	349,436,800	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	241,500,600	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	360,805,500	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	143,442,000	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	212,283,200	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	433,937,400	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	453,572,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	224,830,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	709,329,600	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	405,766,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	226,508,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	148,046,600	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	304,422,300	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	328,613,500	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	192,676,300	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	307,616,400	

第80回利付国債(20年)	220,000,000	251,955,000
第81回利付国債(20年)	390,000,000	446,745,000
第82回利付国債(20年)	600,000,000	691,014,000
第83回利付国債(20年)	290,000,000	335,947,600
第84回利付国債(20年)	470,000,000	541,435,300
第85回利付国債(20年)	290,000,000	337,673,100
第86回利付国債(20年)	210,000,000	247,340,100
第87回利付国債(20年)	550,000,000	644,105,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	497,796,600
第89回利付国債(20年)	350,000,000	412,387,500
第90回利付国債(20年)	630,000,000	746,562,600
第91回利付国債(20年)	450,000,000	536,517,000
第92回利付国債(20年)	880,000,000	1,042,509,600
第93回利付国債(20年)	410,000,000	484,968,500
第94回利付国債(20年)	610,000,000	726,272,100
第95回利付国債(20年)	610,000,000	739,765,300
第96回利付国債(20年)	320,000,000	382,934,400
第97回利付国債(20年)	400,000,000	484,400,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	529,192,400
第99回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,389,349,500
第100回利付国債(20年)	480,000,000	586,406,400
第101回利付国債(20年)	715,000,000	886,078,050
第102回利付国債(20年)	410,000,000	510,380,300
第103回利付国債(20年)	400,000,000	494,312,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	438,364,800
第105回利付国債(20年)	680,000,000	831,606,000
第106回利付国債(20年)	380,000,000	468,258,800
第107回利付国債(20年)	260,000,000	319,300,800
第108回利付国債(20年)	660,000,000	797,907,000
第109回利付国債(20年)	520,000,000	630,687,200
第110回利付国債(20年)	950,000,000	1,170,846,500
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,209,551,200
第112回利付国債(20年)	790,000,000	977,151,000
第113回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,800,711,500
第114回利付国債(20年)	940,000,000	1,171,898,000
第115回利付国債(20年)	700,000,000	880,089,000
第116回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,337,942,600
第117回利付国債(20年)	780,000,000	976,092,000
第118回利付国債(20年)	660,000,000	822,214,800
第119回利付国債(20年)	530,000,000	648,529,200
第120回利付国債(20年)	790,000,000	949,185,000
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,858,380,000
第122回利付国債(20年)	440,000,000	540,139,600

第123回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,620,659,200	
第124回利付国債(20年)	610,000,000	765,281,600	
第125回利付国債(20年)	820,000,000	1,051,559,800	
第126回利付国債(20年)	730,000,000	918,894,800	
第127回利付国債(20年)	990,000,000	1,234,470,600	
第128回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,576,184,400	
第129回利付国債(20年)	550,000,000	681,384,000	
第130回利付国債(20年)	1,115,000,000	1,385,454,400	
第131回利付国債(20年)	870,000,000	1,070,308,800	
第132回利付国債(20年)	840,000,000	1,036,182,000	
第133回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,482,870,900	
第134回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,312,857,000	
第135回利付国債(20年)	590,000,000	730,142,700	
第136回利付国債(20年)	570,000,000	698,096,100	
第137回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,389,673,600	
第138回利付国債(20年)	420,000,000	510,165,600	
第139回利付国債(20年)	550,000,000	675,251,500	
第140回利付国債(20年)	1,670,000,000	2,077,396,500	
第141回利付国債(20年)	1,610,000,000	2,007,670,000	
第142回利付国債(20年)	520,000,000	655,480,800	
第143回利付国債(20年)	720,000,000	890,654,400	
第144回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,798,162,800	
第145回利付国債(20年)	2,455,000,000	3,078,029,900	
第146回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,639,049,000	
第147回利付国債(20年)	1,690,000,000	2,105,554,100	
第148回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,442,528,000	
第149回利付国債(20年)	2,540,000,000	3,141,395,800	
第150回利付国債(20年)	2,270,000,000	2,777,889,800	
第151回利付国債(20年)	1,435,000,000	1,715,700,350	
第152回利付国債(20年)	2,010,000,000	2,405,789,100	
第153回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,904,112,900	
第154回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,376,851,400	
第155回利付国債(20年)	2,160,000,000	2,526,703,200	
第156回利付国債(20年)	1,960,000,000	2,100,218,400	
第157回利付国債(20年)	2,110,000,000	2,188,281,000	
第158回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,404,656,800	
第159回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,286,956,700	
第160回利付国債(20年)	1,950,000,000	2,189,635,500	
第161回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,933,540,000	
第162回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,265,988,000	
第163回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,933,400,000	
第164回利付国債(20年)	1,780,000,000	1,934,379,400	

	第165回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,129,304,800
	第166回利付国債(20年)	900,000,000	1,011,402,000
	第167回利付国債(20年)	2,110,000,000	2,289,392,200
	第168回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,609,222,100
	第169回利付国債(20年)	280,000,000	292,866,000
	国債証券合計	371,390,000,000	416,522,674,550
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,272,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,191,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	141,099,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	139,938,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	136,454,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	137,001,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,070,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,479,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	241,928,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	240,722,000
	第695回東京都公募公債	100,000,000	101,861,000
	第696回東京都公募公債	100,000,000	102,140,000
	第700回東京都公募公債	100,000,000	102,088,000
	第702回東京都公募公債	200,000,000	204,788,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	102,534,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	102,224,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	103,297,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,781,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	102,334,000
	第764回東京都公募公債	150,000,000	152,131,500
	第765回東京都公募公債	100,000,000	101,433,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	101,246,000
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	204,336,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,695,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,265,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,265,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	300,000,000	304,368,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	144,332,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	120,534,000
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,820,000
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	204,790,000
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	101,230,000
	第226回神奈川県公募公債	200,000,000	202,640,000
	第227回神奈川県公募公債	100,000,000	101,246,000
	第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	241,388,000
	第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,657,000

第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,279,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,577,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,086,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,301,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,715,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	154,676,850	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,143,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,048,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,620,880	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,570,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	121,003,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	101,242,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	120,480,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	103,227,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,211,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,261,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	118,799,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,125,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	200,000,000	209,656,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	109,828,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,216,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	102,501,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	130,620,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	114,331,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	105,426,037	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	102,203,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,398,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,324,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,480,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,567,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	121,885,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,293,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,106,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,259,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,270,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,082,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,438,000	

平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,674,000	
平成28年度第13回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,576,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,160,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	113,551,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,771,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,618,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	128,951,835	
平成29年度第1回広島県公募公債	200,000,000	202,394,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	118,701,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	116,880,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	241,338,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	205,476,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,782,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	196,686,300	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,781,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	102,875,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,974,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,966,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,427,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,713,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,326,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,794,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,644,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,409,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	122,363,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	204,306,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,636,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	141,079,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	117,080,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,935,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	112,947,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	121,322,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	120,361,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	121,484,400	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,332,000	

平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,357,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,148,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,425,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	320,000,000	323,785,600	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,508,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,743,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,910,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	364,088,320	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,044,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,190,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,587,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,778,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,424,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,427,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,372,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,554,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,253,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,807,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,777,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,660,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,985,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,983,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,817,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,648,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,592,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,342,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	129,495,564	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,096,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,525,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,398,000	
第159回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,014,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,388,000	
第161回共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,270,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,207,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,183,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,683,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,576,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	196,256,601	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,588,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,146,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	205,026,000	

平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,248,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,645,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	242,804,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	101,260,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	136,705,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	143,362,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	118,830,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	134,831,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,447,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,550,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,463,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,506,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	102,910,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	300,000,000	303,552,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	140,557,200	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	241,184,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	122,189,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	112,645,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	120,262,000	
平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,435,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	101,145,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	203,462,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,508,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	204,532,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	110,971,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,634,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	102,284,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	119,440,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	101,020,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,400,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,052,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	200,000,000	200,794,000	
平成28年度第4回北九州市公募公債	145,000,000	146,529,750	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	120,494,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,570,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	102,275,000	
平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	102,117,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	154,479,000	

	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,428,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	106,113,000	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	173,026,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	204,736,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	203,580,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,532,000	
	地方債証券合計	24,934,220,000	26,543,703,337	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,399,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,549,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,584,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,948,000	
	第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,030,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,619,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,925,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,148,000	
	第12回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,756,000	
	第14回道路債券	100,000,000	106,292,000	
	第17回道路債券	100,000,000	105,067,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	464,376,000	
	第21回道路債券	100,000,000	136,752,000	
	第28回道路債券	200,000,000	278,058,000	
	第33回道路債券	200,000,000	281,610,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,817,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	166,596,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,627,000	
	第42回道路債券	100,000,000	112,002,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,469,000	
	第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,371,000	
	第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,166,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	161,493,000	
	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	242,356,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,794,000	

第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,508,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,658,000	
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	140,417,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,957,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,336,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,592,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,778,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,281,000	
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	102,258,000	
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	102,210,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,392,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,843,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	150,638,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	307,950,090	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	234,850,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,248,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,685,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,563,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,854,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,648,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,034,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,108,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,106,000	
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	204,340,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,392,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,168,000	
	148,000,000	153,157,800	

第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,578,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,192,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,452,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	105,433,320	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,364,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,224,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,028,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,730,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,955,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,987,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,700,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,702,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,238,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,611,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	107,379,850	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	319,020,960	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	207,441,550	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,446,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,269,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,606,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	520,000,000	530,649,600	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,338,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	218,397,700	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,768,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	311,679,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	113,997,400	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	110,496,000	

第5回公営企業債券(30年)	300,000,000	415,755,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,966,000	
第7回公営企業債券(30年)	100,000,000	139,784,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	44,077,600	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	137,082,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	242,692,000	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,620,000	
第19回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,929,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	242,960,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,096,760	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,228,060	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,348,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	121,003,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,293,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,100,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,571,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,010,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,158,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,437,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,512,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,362,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,338,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,893,000	
F73回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,317,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	220,942,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,674,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,426,000	
第87回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,531,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,179,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,948,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,186,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	254,554,160	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,621,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,597,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	112,242,900	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	159,564,600	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,046,000	
F116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,906,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,263,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,588,000	

F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,246,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,795,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	111,750,000	
第 1 9 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,034,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	124,027,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,536,760	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,623,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	212,295,300	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	190,620,320	
第 4 3 回都市再生債券	100,000,000	101,353,000	
第 1 2 7 回都市再生債券	400,000,000	400,424,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	111,519,000	
第 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	105,673,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	20,825,400	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,354,000	14,973,088	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,680,000	15,397,118	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,042,000	15,921,957	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	253,734,000	255,517,750	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	177,722,000	178,843,425	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,936,000	15,724,322	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,011,000	16,907,936	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	12,993,000	13,368,107	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	26,838,000	28,010,283	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,602,000	16,408,467	
第 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,827,000	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	14,161,000	14,829,965	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,475,000	17,492,166	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	14,084,000	14,773,411	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	16,287,000	17,246,141	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,490,000	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,087,000	15,397,339	
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,387,000	15,701,048	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,644,000	23,415,344	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,113,000	23,988,403	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,519,000	26,808,584	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,513,000	29,774,293	

第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,509,000	32,063,003
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,626,000	33,201,340
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,750,000	70,157,920
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,519,000	15,112,101
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,385,000	34,612,764
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,487,000	15,087,196
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,368,000	15,117,291
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,391,000	37,985,514
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,336,000	13,951,989
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,948,000	37,533,802
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,810,000	35,192,990
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,265,000	16,225,473
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,764,000	70,157,692
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,747,000	38,169,574
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,948,000	15,707,806
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,878,000	50,042,733
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,726,000	47,714,591
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,624,000	47,651,738
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,096,000
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,432,000	101,749,598
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,733,000
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,762,000
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,279,000
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,238,000	108,101,349
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,863,000	54,709,760
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,798,000	55,116,179
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,802,000	56,266,867
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,329,000	49,139,317
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,404,000	48,809,119
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,253,000	55,661,985
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	184,591,500
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,956,000	50,484,240
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,912,000	56,630,782
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,206,000	58,046,900
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,247,000	58,999,165
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,331,000
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,950,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	118,612,000	124,530,738
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,531,000	63,325,110
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,044,000	130,992,487
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,928,000
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,117,000	74,263,927
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,710,000	77,845,578

第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,965,000	77,432,479	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,860,000	159,647,380	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,670,000	78,281,787	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,279,000	83,273,868	
第 1 1 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,311,000	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,179,000	90,218,580	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,405,000	90,263,273	
第 1 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,191,000	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,498,000	90,757,353	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,994,000	91,492,061	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,529,000	92,112,806	
第 1 1 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,910,000	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,506,000	93,830,252	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,029,000	94,491,696	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,103,000	94,350,313	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,397,000	94,687,521	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,945,000	95,592,073	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,982,000	191,916,454	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,201,000	95,558,053	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,900,000	193,856,430	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,977,000	96,690,115	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,178,000	193,710,704	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,332,000	97,858,298	
第 1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,306,000	196,838,652	
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,530,000	197,187,300	
第 1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	139,410,000	
第 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,836,000	99,701,377	
第 1 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,387,000	100,511,174	
	97,771,000	99,923,917	

第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,762,000	200,199,432	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,733,000	100,425,283	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,098,000	100,992,753	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,004,000	202,410,948	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,842,000	100,794,492	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,444,000	
第161回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,194,000	
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,812,000	
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,676,000	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,118,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	116,439,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	111,658,000	
い第786号商工債	300,000,000	300,747,000	
い第795号商工債	200,000,000	200,040,000	
い第802号商工債	100,000,000	100,078,000	
い第795号農林債	100,000,000	99,970,000	
い第796号農林債	200,000,000	199,938,000	
第317回信金中金債（5年）	200,000,000	200,142,000	
第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,302,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,310,000	
第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,636,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,340,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,264,000	
第218号商工債（3年）	300,000,000	300,474,000	
第221号商工債（3年）	200,000,000	200,328,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	102,754,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	123,087,000	
第38回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,052,000	
第33回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	204,436,000	
第59回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,703,000	
第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,146,000	
第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,899,000	
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,232,000	
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,741,000	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,012,000	
	200,000,000	204,986,000	

	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券			
	特殊債券合計	31,673,915,000	33,843,614,219	
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	100,123,000	
	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	101,094,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,560,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,906,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,969,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,707,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,035,000	
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,260,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,202,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,585,000	
	第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,243,000	
	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	100,677,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	105,359,000	
	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	300,000,000	300,885,000	
	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	201,460,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	100,291,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,749,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,550,000	
	第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	100,357,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,572,000	
	第11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	100,616,000	
	第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,496,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,741,000	
	第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,914,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	103,594,000		
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,643,000		
第7回J・フロント リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	100,325,000		
第2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	103,315,000		

第11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	100,262,000	
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	100,159,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,862,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,687,000	
第57回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	201,142,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	101,820,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,594,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	101,569,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,806,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	100,199,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	100,295,000	
第8回楽天株式会社無担保社債	100,000,000	100,569,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	104,065,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,363,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,404,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,822,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,403,000	
第22回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,798,000	
第28回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,096,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,383,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,826,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,490,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,582,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,809,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	204,184,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,939,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	101,478,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,697,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,382,000	
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,328,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,360,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,145,000	
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,203,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	200,984,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	103,452,000	

第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,334,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,752,000	
第27回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	100,047,000	
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,758,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	122,353,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,449,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,049,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,195,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	103,386,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	125,793,000	
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	101,460,000	
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	102,665,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	115,978,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,513,000	
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	102,517,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,949,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	308,478,000	
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	101,431,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,269,000	
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,376,000	
第23回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,024,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,671,000	
第73回アコム株式会社無担保社債	200,000,000	201,172,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,383,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,427,000	
第193回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,621,000	
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	200,716,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,185,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,207,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	203,428,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	102,320,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,416,000	

第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,556,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,876,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	201,938,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,372,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,534,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,261,000	
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	104,052,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,412,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	108,705,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,194,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,519,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,961,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	103,402,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,825,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,621,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	241,780,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,813,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,604,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,621,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	20,101,810	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,725,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	117,207,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	117,500,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	21,173,200	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	140,243,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	137,516,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	124,782,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	109,034,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,804,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,678,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,728,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,194,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,192,000	
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	100,000,000	102,798,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,341,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,738,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,213,000	

第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,810,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,961,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,676,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,730,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	204,034,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,383,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,383,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,227,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,556,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,614,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,182,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,857,000	
第330回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,048,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	131,682,600	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,731,000	
第487回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,243,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,352,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,562,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,216,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	203,236,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,957,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,404,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	102,182,710	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,582,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,765,000	
第351回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,077,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,820,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,902,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,950,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,227,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,252,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,436,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	203,720,000	
社債券合計	18,966,000,000	19,597,844,320	
合計		496,507,836,426	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年 8月28日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,174,269,738
株式	280,845,503,060
派生商品評価勘定	1,823,120
未収配当金	369,676,178
前払金	76,007,500
差入委託証拠金	99,650,000
流動資産合計	284,566,929,596
資産合計	284,566,929,596
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,873,820
未払金	500,020,849
未払解約金	38,325,390
未払利息	4,981
その他未払費用	9
流動負債合計	616,225,049
負債合計	616,225,049
純資産の部	
元本等	
元本	206,771,932,531
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	77,178,772,016
元本等合計	283,950,704,547
純資産合計	283,950,704,547
負債純資産合計	284,566,929,596

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28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> <p>先物取引</p>

2019年 8月28日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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 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 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28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	206,771,932,531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 1.3733円 (1万口当たり純資産額) (13,733円)

（金融商品に関する注記）

1.金融商品の状況に関する事項

2019年 8月28日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、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。</p>

	2019年 8月28日現在
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 8月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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つた場合、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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月29日
期首元本額	141,131,117,151円
期中追加設定元本額	81,960,653,056円
期中一部解約元本額	16,319,837,676円
期末元本額	206,771,932,531円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	597,854,247円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,054,931,766円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,911,204円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,031,535,899円
世界経済インデックスファンド	2,070,483,978円
日本株式インデックス・オープン	5,361,945,007円
DCマイセレクション25	6,870,858,628円
DCマイセレクション50	19,430,562,309円
DCマイセレクション75	17,832,471,188円
DC日本株式インデックス・オープン	5,678,381,702円
DCマイセレクションS25	2,745,227,771円
DCマイセレクションS50	7,846,564,207円
DCマイセレクションS75	5,103,149,155円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,553,949,031円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	385,571,700円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	688,458,665円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	451,580,222円
DC世界経済インデックスファンド	1,819,333,000円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,215,445,055円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,912,032円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	39,491,701円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	38,766,263円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	290,300,038円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,717,839円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	85,156,892円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	345,109,389円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	63,345,357円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	497,310,509円

区分	2019年 8月28日現在
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,824,271,319円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	740,005,408円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,285,667,019円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	674,073,258円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	47,417,537円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	815,686,647円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	39,105,366円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	468,106,663円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	592,592,979円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	55,461,567円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	908,284,741円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,999,477,195円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,515,480,646円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,205,290,370円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	4,133,636,875円
分散投資コア戦略ファンドS	8,517,291,268円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	252,004,601円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	275,032,457円
コア投資戦略ファンド（切替型）	544,973,808円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	222,244,885円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,359,382円
SMT インデックスバランス・オープン	75,678,742円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	13,317,569,938円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	680,819,456円
SMT 世界経済インデックス・オープン	14,235,353円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	57,993,473円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	8,499,630円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,530,677円
グローバル経済コア	317,728,126円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,452,524円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	48,555,076円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,393,739円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	187,768,232円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,579,192円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	23,834円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	56,493,410,459円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	646,253,664円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	6,518,624円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		8,593,554,544
合計		8,593,554,544

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2019年 8月28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	3,163,412,500	-	3,087,405,000	76,007,500
	合計	3,163,412,500	-	3,087,405,000	76,007,500

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,800	2,770.00	16,066,000	
日本水産	178,700	587.00	104,896,900	
マルハニチロ	25,800	2,680.00	69,144,000	
カネコ種苗	5,400	1,126.00	6,080,400	
サカタのタネ	21,800	3,405.00	74,229,000	
ホクト	15,000	1,863.00	27,945,000	
ホクリヨウ	2,400	595.00	1,428,000	
住石ホールディングス	38,500	126.00	4,851,000	
日鉄鉱業	4,100	3,840.00	15,744,000	

三井松島ホールディングス	7,500	1,126.00	8,445,000	
国際石油開発帝石	717,000	898.00	643,866,000	
石油資源開発	25,700	2,540.00	65,278,000	
K&Oエナジーグループ	8,700	1,378.00	11,988,600	
ヒノキヤグループ	4,800	1,805.00	8,664,000	
ショーボンドホールディングス	25,500	3,660.00	93,330,000	
ミライト・ホールディングス	50,300	1,533.00	77,109,900	
タマホーム	8,600	1,494.00	12,848,400	
サンヨーホームズ	2,600	618.00	1,606,800	
日本アクア	7,100	499.00	3,542,900	
ファーストコーポレーション	5,500	588.00	3,234,000	
ベステラ	3,400	1,236.00	4,202,400	
TATERU	36,300	163.00	5,916,900	
スペースバリューホールディングス	21,800	439.00	9,570,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,400	671.00	2,281,400	
第一カッター興業	2,200	1,600.00	3,520,000	
安藤・間	114,600	698.00	79,990,800	
東急建設	52,300	686.00	35,877,800	
コムシスホールディングス	63,400	2,980.00	188,932,000	
ミサワホーム	14,200	1,049.00	14,895,800	
ピーアールホールディングス	19,500	345.00	6,727,500	
高松コンストラクショングループ	11,100	2,205.00	24,475,500	
東建コーポレーション	5,500	6,150.00	33,825,000	
ソネック	1,800	849.00	1,528,200	
ヤマウラ	7,500	845.00	6,337,500	
大成建設	146,800	3,645.00	535,086,000	
大林組	442,200	967.00	427,607,400	
清水建設	451,000	868.00	391,468,000	
飛島建設	12,700	1,077.00	13,677,900	
長谷工コーポレーション	184,300	1,113.00	205,125,900	
松井建設	16,700	662.00	11,055,400	
銭高組	1,800	3,865.00	6,957,000	
鹿島建設	345,600	1,282.00	443,059,200	
不動テトラ	10,300	1,104.00	11,371,200	
大末建設	5,800	898.00	5,208,400	
鉄建建設	9,000	2,609.00	23,481,000	
西松建設	31,800	1,870.00	59,466,000	
三井住友建設	106,300	501.00	53,256,300	
大豊建設	10,000	2,561.00	25,610,000	
前田建設工業	105,100	823.00	86,497,300	
佐田建設	11,100	388.00	4,306,800	
ナカノフドー建設	12,500	407.00	5,087,500	

奥村組	24,300	2,749.00	66,800,700
東鉄工業	17,700	3,060.00	54,162,000
イチケン	3,000	1,557.00	4,671,000
富士ピー・エス	6,100	457.00	2,787,700
浅沼組	5,000	3,465.00	17,325,000
戸田建設	171,400	564.00	96,669,600
熊谷組	21,000	2,866.00	60,186,000
青木あすなろ建設	7,800	1,208.00	9,422,400
北野建設	3,200	1,984.00	6,348,800
植木組	2,100	2,292.00	4,813,200
矢作建設工業	20,000	648.00	12,960,000
ピーエス三菱	16,100	680.00	10,948,000
日本ハウスホールディングス	28,200	417.00	11,759,400
大東建託	52,500	13,670.00	717,675,000
新日本建設	17,700	767.00	13,575,900
N I P P O	39,000	1,824.00	71,136,000
東亜道路工業	2,800	2,926.00	8,192,800
前田道路	46,200	2,308.00	106,629,600
日本道路	4,000	5,830.00	23,320,000
東亜建設工業	12,900	1,256.00	16,202,400
日本国土開発	24,100	509.00	12,266,900
若築建設	7,400	1,455.00	10,767,000
東洋建設	54,000	424.00	22,896,000
五洋建設	175,300	536.00	93,960,800
世紀東急工業	21,500	663.00	14,254,500
福田組	4,800	3,740.00	17,952,000
住友林業	104,500	1,266.00	132,297,000
日本基礎技術	15,100	303.00	4,575,300
巴コーポレーション	19,400	345.00	6,693,000
大和ハウス工業	408,300	3,332.00	1,360,455,600
ライト工業	28,300	1,350.00	38,205,000
積水ハウス	451,500	1,869.00	843,853,500
日特建設	12,600	631.00	7,950,600
北陸電気工事	7,100	891.00	6,326,100
ユアテック	23,600	638.00	15,056,800
四電工	2,200	2,672.00	5,878,400
中電工	19,000	2,161.00	41,059,000
関電工	67,100	880.00	59,048,000
きんでん	98,000	1,538.00	150,724,000
東京エネシス	15,200	809.00	12,296,800
トーエネック	4,100	3,100.00	12,710,000
住友電設	10,200	1,970.00	20,094,000

日本電設工業	25,100	1,971.00	49,472,100
協和エクシオ	57,800	2,496.00	144,268,800
新日本空調	11,900	1,689.00	20,099,100
九電工	29,100	3,175.00	92,392,500
三機工業	33,300	1,243.00	41,391,900
日揮	127,000	1,218.00	154,686,000
中外炉工業	4,400	1,396.00	6,142,400
ヤマト	14,000	642.00	8,988,000
太平電業	10,000	2,292.00	22,920,000
高砂熱学工業	35,800	1,667.00	59,678,600
三晃金属工業	2,000	2,259.00	4,518,000
朝日工業社	3,200	2,831.00	9,059,200
明星工業	26,700	695.00	18,556,500
大気社	20,100	3,055.00	61,405,500
ダイダン	9,900	2,039.00	20,186,100
日比谷総合設備	13,300	1,790.00	23,807,000
東芝プラントシステム	31,900	1,716.00	54,740,400
OSJBホールディングス	65,100	225.00	14,647,500
東洋エンジニアリング	17,300	561.00	9,705,300
レイズネクスト	26,500	1,122.00	29,733,000
日本製粉	41,900	1,620.00	67,878,000
日清製粉グループ本社	149,200	1,978.00	295,117,600
日東富士製粉	1,000	6,300.00	6,300,000
昭和産業	12,100	3,005.00	36,360,500
鳥越製粉	11,700	801.00	9,371,700
中部飼料	16,100	1,085.00	17,468,500
フィード・ワン	88,700	158.00	14,014,600
東洋精糖	2,000	1,044.00	2,088,000
日本甜菜製糖	7,500	1,741.00	13,057,500
三井製糖	10,400	2,118.00	22,027,200
塩水港精糖	14,300	204.00	2,917,200
日新製糖	6,300	1,865.00	11,749,500
森永製菓	33,200	5,070.00	168,324,000
中村屋	3,400	4,125.00	14,025,000
江崎グリコ	39,700	4,575.00	181,627,500
名糖産業	6,300	1,269.00	7,994,700
井村屋グループ	5,600	1,986.00	11,121,600
不二家	7,400	1,942.00	14,370,800
山崎製パン	99,000	1,884.00	186,516,000
第一屋製パン	2,300	910.00	2,093,000
モロゾフ	2,200	4,720.00	10,384,000
亀田製菓	8,200	4,640.00	38,048,000

寿スピリッツ	14,000	6,780.00	94,920,000
カルビー	60,200	3,185.00	191,737,000
森永乳業	26,500	4,180.00	110,770,000
六甲バター	9,300	1,601.00	14,889,300
ヤクルト本社	97,800	6,000.00	586,800,000
明治ホールディングス	93,600	7,270.00	680,472,000
雪印メグミルク	31,800	2,368.00	75,302,400
プリマハム	18,600	2,057.00	38,260,200
日本ハム	54,700	3,995.00	218,526,500
林兼産業	4,400	554.00	2,437,600
丸大食品	14,100	2,064.00	29,102,400
S Foods	11,900	3,070.00	36,533,000
伊藤ハム米久ホールディングス	85,000	636.00	54,060,000
サッポロホールディングス	45,100	2,495.00	112,524,500
アサヒグループホールディングス	276,600	4,915.00	1,359,489,000
キリンホールディングス	560,200	2,061.50	1,154,852,300
宝ホールディングス	98,900	1,011.00	99,987,900
オエノンホールディングス	36,000	359.00	12,924,000
養命酒製造	4,000	1,856.00	7,424,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	92,700	2,255.00	209,038,500
サントリー食品インターナショナル	88,400	4,540.00	401,336,000
ダイドーグループホールディングス	7,400	4,250.00	31,450,000
伊藤園	40,100	4,740.00	190,074,000
キーコーヒー	13,000	2,097.00	27,261,000
ユニカフェ	3,500	973.00	3,405,500
ジャパンフーズ	1,900	1,171.00	2,224,900
日清オイリオグループ	17,000	3,175.00	53,975,000
不二製油グループ本社	32,200	2,878.00	92,671,600
かどや製油	1,400	3,515.00	4,921,000
J - オイルミルズ	6,800	3,925.00	26,690,000
キッコーマン	87,100	4,765.00	415,031,500
味の素	291,700	1,933.50	564,001,950
キューピー	73,500	2,469.00	181,471,500
ハウス食品グループ本社	49,400	3,950.00	195,130,000
カゴメ	52,900	2,619.00	138,545,100
焼津水産化学工業	6,400	1,024.00	6,553,600
アリアケジャパン	12,100	8,430.00	102,003,000
ピエトロ	1,700	1,590.00	2,703,000
エバラ食品工業	3,200	2,027.00	6,486,400
やまみ	600	1,890.00	1,134,000
ニチレイ	68,600	2,419.00	165,943,400
東洋水産	68,000	4,275.00	290,700,000

イトアンド	4,600	1,680.00	7,728,000
大冷	1,500	1,998.00	2,997,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,600	793.00	2,854,800
日清食品ホールディングス	56,100	7,040.00	394,944,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,975.00	13,825,000
一正蒲鉾	5,100	1,053.00	5,370,300
フジッコ	14,300	1,876.00	26,826,800
ロック・フィールド	14,200	1,335.00	18,957,000
日本たばこ産業	762,700	2,230.50	1,701,202,350
ケンコーマヨネーズ	7,400	2,181.00	16,139,400
わらべや日洋ホールディングス	8,600	1,663.00	14,301,800
なとり	7,400	1,550.00	11,470,000
イフジ産業	2,300	699.00	1,607,700
ピクルスコーポレーション	3,100	2,229.00	6,909,900
北の達人コーポレーション	51,900	707.00	36,693,300
ユーグレナ	56,300	857.00	48,249,100
ミヨシ油脂	5,100	1,065.00	5,431,500
理研ビタミン	6,200	3,300.00	20,460,000
片倉工業	19,000	1,207.00	22,933,000
ゲンゼ	8,800	4,365.00	38,412,000
東洋紡	54,900	1,283.00	70,436,700
ユニチカ	39,100	308.00	12,042,800
富士紡ホールディングス	6,900	2,504.00	17,277,600
倉敷紡績	12,500	1,869.00	23,362,500
シキボウ	6,800	886.00	6,024,800
日本毛織	42,900	889.00	38,138,100
トーア紡コーポレーション	5,300	472.00	2,501,600
帝国繊維	14,700	1,646.00	24,196,200
帝人	105,400	1,888.00	198,995,200
東レ	1,000,400	753.50	753,801,400
サカイオーベックス	3,400	1,589.00	5,402,600
住江織物	3,800	2,754.00	10,465,200
日本フェルト	8,200	455.00	3,731,000
イチカワ	2,100	1,343.00	2,820,300
日東製網	1,500	1,362.00	2,043,000
アツギ	10,800	801.00	8,650,800
ダイニック	5,200	672.00	3,494,400
セーレン	32,100	1,185.00	38,038,500
ソトー	5,200	964.00	5,012,800
東海染工	1,900	1,113.00	2,114,700
小松マテーレ	21,300	711.00	15,144,300
ワコールホールディングス	36,500	2,390.00	87,235,000

ホギメディカル	16,100	2,875.00	46,287,500
レナウン	37,300	107.00	3,991,100
クラウディアホールディングス	3,400	535.00	1,819,000
T S Iホールディングス	47,800	519.00	24,808,200
マツオカコーポレーション	4,100	2,005.00	8,220,500
ワールド	16,900	2,237.00	37,805,300
三陽商会	7,500	1,237.00	9,277,500
ナイガイ	5,000	386.00	1,930,000
オンワードホールディングス	77,700	486.00	37,762,200
ルックホールディングス	4,600	1,003.00	4,613,800
ゴールドウイン	11,700	14,540.00	170,118,000
デサント	31,500	1,405.00	44,257,500
キング	7,100	482.00	3,422,200
ヤマトインターナショナル	8,100	428.00	3,466,800
特種東海製紙	8,200	3,510.00	28,782,000
王子ホールディングス	580,200	482.00	279,656,400
日本製紙	61,700	1,738.00	107,234,600
三菱製紙	21,000	491.00	10,311,000
北越コーポレーション	85,500	512.00	43,776,000
中越パルプ工業	5,500	1,450.00	7,975,000
巴川製紙所	4,200	791.00	3,322,200
大王製紙	62,800	1,243.00	78,060,400
阿波製紙	3,300	403.00	1,329,900
レンゴー	132,900	766.00	101,801,400
トーモク	7,900	1,451.00	11,462,900
ザ・パック	9,800	3,240.00	31,752,000
クラレ	203,000	1,204.00	244,412,000
旭化成	916,900	943.10	864,728,390
共和レザー	8,000	696.00	5,568,000
昭和電工	91,800	2,632.00	241,617,600
住友化学	1,014,600	461.00	467,730,600
住友精化	6,300	3,040.00	19,152,000
日産化学	78,600	4,530.00	356,058,000
ラサ工業	4,500	1,131.00	5,089,500
クレハ	11,900	5,580.00	66,402,000
多木化学	3,800	4,285.00	16,283,000
テイカ	10,500	1,830.00	19,215,000
石原産業	24,800	837.00	20,757,600
片倉コープアグリ	3,700	1,046.00	3,870,200
日本曹達	20,300	2,373.00	48,171,900
東ソー	199,200	1,346.00	268,123,200
トクヤマ	37,100	2,120.00	78,652,000

セントラル硝子	28,100	2,141.00	60,162,100
東亜合成	80,900	1,012.00	81,870,800
大阪ソーダ	14,000	2,433.00	34,062,000
関東電化工業	30,600	698.00	21,358,800
デンカ	50,700	2,740.00	138,918,000
信越化学工業	227,100	10,475.00	2,378,872,500
日本カーバイド工業	4,400	1,146.00	5,042,400
堺化学工業	8,600	2,241.00	19,272,600
第一稀元素化学工業	14,000	777.00	10,878,000
エア・ウォーター	105,500	1,800.00	189,900,000
大陽日酸	106,200	2,103.00	223,338,600
日本化学工業	4,400	2,044.00	8,993,600
東邦アセチレン	1,900	1,221.00	2,319,900
日本パーカラライジング	70,400	1,128.00	79,411,200
高压ガス工業	20,400	748.00	15,259,200
チタン工業	1,600	2,660.00	4,256,000
四国化成工業	21,700	1,005.00	21,808,500
戸田工業	2,700	2,016.00	5,443,200
ステラ ケミファ	7,600	2,527.00	19,205,200
保土谷化学工業	4,500	2,544.00	11,448,000
日本触媒	21,700	6,000.00	130,200,000
大日精化工業	10,600	2,653.00	28,121,800
カネカ	33,300	3,115.00	103,729,500
三菱瓦斯化学	131,000	1,232.00	161,392,000
三井化学	117,000	2,223.00	260,091,000
J S R	129,300	1,725.00	223,042,500
東京応化工業	22,100	3,410.00	75,361,000
大阪有機化学工業	11,900	924.00	10,995,600
三菱ケミカルホールディングス	861,600	716.80	617,594,880
K Hネオケム	22,700	2,148.00	48,759,600
ダイセル	189,900	801.00	152,109,900
住友ベークライト	22,300	3,635.00	81,060,500
積水化学工業	277,100	1,512.00	418,975,200
日本ゼオン	116,200	1,202.00	139,672,400
アイカ工業	38,700	2,949.00	114,126,300
宇部興産	65,100	1,991.00	129,614,100
積水樹脂	21,300	1,831.00	39,000,300
タキロンシーアイ	27,900	627.00	17,493,300
旭有機材	8,900	1,192.00	10,608,800
日立化成	59,600	3,230.00	192,508,000
ニチバン	6,800	1,472.00	10,009,600
リケンテクノス	35,100	442.00	15,514,200

大倉工業	6,300	1,510.00	9,513,000
積水化成成品工業	19,200	691.00	13,267,200
群栄化学工業	3,300	2,235.00	7,375,500
タイガースポリマー	6,800	511.00	3,474,800
ミライアル	3,700	1,302.00	4,817,400
ダイキアクシス	4,600	704.00	3,238,400
ダイキョーニシカワ	27,200	700.00	19,040,000
竹本容器	4,600	859.00	3,951,400
森六ホールディングス	6,900	2,328.00	16,063,200
日本化薬	79,800	1,148.00	91,610,400
カーリットホールディングス	13,800	535.00	7,383,000
日本精化	10,400	1,031.00	10,722,400
扶桑化学工業	13,100	2,196.00	28,767,600
トリケミカル研究所	2,900	5,040.00	14,616,000
A D E K A	63,500	1,233.00	78,295,500
日油	48,500	3,390.00	164,415,000
新日本理化	23,300	183.00	4,263,900
ハリマ化成グループ	10,700	1,141.00	12,208,700
花王	319,500	7,708.00	2,462,706,000
第一工業製薬	4,800	2,635.00	12,648,000
石原ケミカル	3,200	1,528.00	4,889,600
日華化学	4,300	778.00	3,345,400
ニイタカ	2,000	1,425.00	2,850,000
三洋化成工業	8,700	4,495.00	39,106,500
有機合成薬品工業	9,900	226.00	2,237,400
大日本塗料	14,600	950.00	13,870,000
日本ペイントホールディングス	106,400	4,905.00	521,892,000
関西ペイント	144,800	2,145.00	310,596,000
神東塗料	10,100	156.00	1,575,600
中国塗料	42,300	822.00	34,770,600
日本特殊塗料	9,600	1,004.00	9,638,400
藤倉化成	17,400	522.00	9,082,800
太陽ホールディングス	10,600	3,135.00	33,231,000
D I C	54,400	2,609.00	141,929,600
サカタインクス	28,100	869.00	24,418,900
東洋インキS Cホールディングス	27,200	2,104.00	57,228,800
T & K T O K A	10,000	871.00	8,710,000
富士フイルムホールディングス	273,300	4,506.00	1,231,489,800
資生堂	261,500	8,770.00	2,293,355,000
ライオン	171,100	2,083.00	356,401,300
高砂香料工業	9,100	2,411.00	21,940,100
マンダム	29,600	2,555.00	75,628,000

ミルボン	17,600	5,260.00	92,576,000
ファンケル	58,600	2,498.00	146,382,800
コーセー	22,300	18,410.00	410,543,000
コタ	6,900	1,154.00	7,962,600
シーボン	1,600	2,332.00	3,731,200
ポーラ・オルビスホールディングス	56,200	2,519.00	141,567,800
ノエビアホールディングス	12,600	5,230.00	65,898,000
アジュバンコスメジャパン	2,900	926.00	2,685,400
エステー	9,400	1,520.00	14,288,000
アグロ カネショウ	5,100	1,342.00	6,844,200
コニシ	23,300	1,402.00	32,666,600
長谷川香料	17,400	1,999.00	34,782,600
星光PMC	8,400	723.00	6,073,200
小林製薬	36,900	7,660.00	282,654,000
荒川化学工業	11,800	1,319.00	15,564,200
メック	9,000	1,290.00	11,610,000
日本高純度化学	3,600	2,377.00	8,557,200
タカラバイオ	34,400	2,220.00	76,368,000
JCU	17,100	1,754.00	29,993,400
新田ゼラチン	8,300	626.00	5,195,800
OATアグリオ	2,300	1,319.00	3,033,700
デクセリアルズ	33,900	700.00	23,730,000
アース製薬	9,900	4,960.00	49,104,000
北興化学工業	13,500	436.00	5,886,000
大成ラミック	4,300	2,697.00	11,597,100
クミアイ化学工業	54,400	920.00	50,048,000
日本農薬	23,400	429.00	10,038,600
アキレス	9,600	1,619.00	15,542,400
有沢製作所	20,700	983.00	20,348,100
日東電工	90,800	4,850.00	440,380,000
レック	14,000	955.00	13,370,000
三光合成	15,000	336.00	5,040,000
きもと	22,400	165.00	3,696,000
藤森工業	11,800	2,869.00	33,854,200
前澤化成工業	9,000	1,065.00	9,585,000
未来工業	7,100	1,799.00	12,772,900
ウェーブロックホールディングス	3,600	724.00	2,606,400
JSP	7,700	1,650.00	12,705,000
エフピコ	14,500	6,830.00	99,035,000
天馬	8,800	1,863.00	16,394,400
信越ポリマー	23,600	660.00	15,576,000
東リ	32,800	240.00	7,872,000

ニフコ	52,700	2,429.00	128,008,300
バルカー	10,700	2,044.00	21,870,800
ユニ・チャーム	253,700	3,203.00	812,601,100
ショーエイコーポレーション	1,000	791.00	791,000
協和キリン	132,400	1,909.00	252,751,600
武田薬品工業	1,148,900	3,450.00	3,963,705,000
アステラス製薬	1,157,600	1,443.50	1,670,995,600
大日本住友製薬	97,500	1,840.00	179,400,000
塩野義製薬	168,300	5,708.00	960,656,400
田辺三菱製薬	137,600	1,156.00	159,065,600
わかもと製薬	15,700	248.00	3,893,600
あすか製薬	16,200	1,018.00	16,491,600
日本新薬	34,400	8,770.00	301,688,000
ピオフェルミン製薬	2,200	2,060.00	4,532,000
中外製薬	137,200	7,480.00	1,026,256,000
科研製薬	22,500	5,030.00	113,175,000
エーザイ	157,500	5,305.00	835,537,500
ロート製薬	67,500	2,606.00	175,905,000
小野薬品工業	310,800	1,975.00	613,830,000
久光製薬	38,900	4,225.00	164,352,500
持田製薬	19,900	4,000.00	79,600,000
参天製薬	245,100	1,851.00	453,680,100
扶桑薬品工業	4,600	1,884.00	8,666,400
日本ケミファ	1,700	2,839.00	4,826,300
ツムラ	40,800	2,781.00	113,464,800
日医工	34,600	1,090.00	37,714,000
キッセイ薬品工業	23,300	2,351.00	54,778,300
生化学工業	25,500	1,087.00	27,718,500
栄研化学	23,100	1,537.00	35,504,700
日水製薬	5,500	1,163.00	6,396,500
鳥居薬品	8,200	2,656.00	21,779,200
JCRファーマ	9,300	7,940.00	73,842,000
東和薬品	18,900	2,326.00	43,961,400
富士製薬工業	8,900	1,248.00	11,107,200
沢井製薬	27,000	5,510.00	148,770,000
ゼリア新薬工業	26,000	1,825.00	47,450,000
第一三共	376,600	6,906.00	2,600,799,600
キョーリン製薬ホールディングス	29,000	1,723.00	49,967,000
大幸薬品	5,900	2,202.00	12,991,800
ダイト	7,700	2,997.00	23,076,900
大塚ホールディングス	250,700	4,373.00	1,096,311,100
大正製薬ホールディングス	27,800	7,340.00	204,052,000

ペプチドリーム	66,600	5,600.00	372,960,000
日本コークス工業	111,200	84.00	9,340,800
ニチレキ	16,800	1,021.00	17,152,800
ユシロ化学工業	6,800	1,255.00	8,534,000
ビーピー・カストロール	4,700	1,271.00	5,973,700
富士石油	31,900	225.00	7,177,500
MORESCO	4,800	1,307.00	6,273,600
出光興産	151,900	2,701.00	410,281,900
JXTGホールディングス	2,213,500	424.70	940,073,450
コスモエネルギーホールディングス	38,100	1,843.00	70,218,300
横浜ゴム	76,200	2,004.00	152,704,800
TOYO TIRE	75,600	1,272.00	96,163,200
ブリヂストン	404,500	3,977.00	1,608,696,500
住友ゴム工業	118,200	1,179.00	139,357,800
藤倉コンポジット	11,500	383.00	4,404,500
オカモト	8,800	3,920.00	34,496,000
フコク	5,800	653.00	3,787,400
ニッタ	14,800	2,631.00	38,938,800
住友理工	25,500	738.00	18,819,000
三ツ星ベルト	17,300	1,693.00	29,288,900
バンドー化学	25,100	782.00	19,628,200
日東紡績	19,600	2,712.00	53,155,200
AGC	130,100	2,978.00	387,437,800
日本板硝子	62,900	606.00	38,117,400
石塚硝子	2,200	1,810.00	3,982,000
日本山村硝子	5,500	1,210.00	6,655,000
日本電気硝子	52,900	2,161.00	114,316,900
オハラ	5,200	1,223.00	6,359,600
住友大阪セメント	26,600	4,420.00	117,572,000
太平洋セメント	83,100	2,666.00	221,544,600
日本ヒューム	13,200	632.00	8,342,400
日本コンクリート工業	28,500	232.00	6,612,000
三谷セキサン	6,100	2,675.00	16,317,500
アジアパイルホールディングス	18,700	483.00	9,032,100
東海カーボン	137,900	1,004.00	138,451,600
日本カーボン	6,800	3,525.00	23,970,000
東洋炭素	7,700	1,869.00	14,391,300
ノリタケカンパニーリミテド	7,900	3,740.00	29,546,000
TOTO	101,200	3,815.00	386,078,000
日本碍子	160,600	1,402.00	225,161,200
日本特殊陶業	111,000	1,778.00	197,358,000
MARUWA	4,600	5,430.00	24,978,000

品川リフラクトリーズ	3,500	2,521.00	8,823,500
黒崎播磨	2,600	5,060.00	13,156,000
ヨータイ	11,600	517.00	5,997,200
イソライト工業	6,800	410.00	2,788,000
東京窯業	16,900	273.00	4,613,700
ニッカトー	6,000	600.00	3,600,000
フジミインコーポレーテッド	11,700	2,309.00	27,015,300
クニミネ工業	5,900	847.00	4,997,300
エーアンドエーマテリアル	2,500	963.00	2,407,500
ニチアス	36,000	1,656.00	59,616,000
ニチハ	18,300	2,638.00	48,275,400
日本製鉄	604,700	1,446.00	874,396,200
神戸製鋼所	238,300	538.00	128,205,400
中山製鋼所	18,200	434.00	7,898,800
合同製鐵	6,300	1,988.00	12,524,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	351,500	1,199.50	421,624,250
東京製鐵	69,800	818.00	57,096,400
共英製鋼	14,700	1,637.00	24,063,900
大和工業	27,700	2,546.00	70,524,200
東京鐵鋼	5,400	1,128.00	6,091,200
大阪製鐵	8,700	1,295.00	11,266,500
淀川製鋼所	17,600	1,757.00	30,923,200
丸一鋼管	46,100	2,569.00	118,430,900
モリ工業	3,900	1,760.00	6,864,000
大同特殊鋼	21,300	3,835.00	81,685,500
日本高周波鋼業	4,900	403.00	1,974,700
日本冶金工業	107,900	200.00	21,580,000
山陽特殊製鋼	16,400	1,337.00	21,926,800
愛知製鋼	7,300	2,977.00	21,732,100
日立金属	140,200	1,096.00	153,659,200
日本金属	3,000	749.00	2,247,000
大平洋金属	8,800	1,798.00	15,822,400
新日本電工	84,200	149.00	12,545,800
栗本鐵工所	6,600	1,319.00	8,705,400
虹技	2,000	1,218.00	2,436,000
三菱製鋼	9,700	1,026.00	9,952,200
日亜鋼業	19,200	268.00	5,145,600
日本精線	1,900	2,342.00	4,449,800
エンビプロ・ホールディングス	5,000	574.00	2,870,000
シンニッタン	20,300	400.00	8,120,000
新家工業	3,000	1,324.00	3,972,000
大紀アルミニウム工業所	21,600	651.00	14,061,600

日本軽金属ホールディングス	355,400	180.00	63,972,000
三井金属鉱業	35,200	2,110.00	74,272,000
東邦亜鉛	7,300	1,772.00	12,935,600
三菱マテリアル	86,000	2,542.00	218,612,000
住友金属鉱山	178,300	2,915.00	519,744,500
D O W Aホールディングス	30,400	3,375.00	102,600,000
古河機械金属	21,600	1,278.00	27,604,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,100	1,459.00	22,030,900
東邦チタニウム	23,500	729.00	17,131,500
U A C J	19,900	1,440.00	28,656,000
C Kサンエツ	2,500	2,840.00	7,100,000
古河電気工業	37,600	2,271.00	85,389,600
住友電気工業	486,700	1,213.50	590,610,450
フジクラ	157,600	325.00	51,220,000
昭和電線ホールディングス	15,100	738.00	11,143,800
東京特殊電線	1,800	1,715.00	3,087,000
タツタ電線	26,200	421.00	11,030,200
カナレ電気	2,200	1,725.00	3,795,000
平河ヒューテック	5,500	1,003.00	5,516,500
リョービ	16,100	1,533.00	24,681,300
アーレスティ	16,300	518.00	8,443,400
アサヒホールディングス	24,500	2,180.00	53,410,000
稲葉製作所	7,300	1,322.00	9,650,600
宮地エンジニアリンググループ	4,000	1,406.00	5,624,000
トーカロ	33,600	759.00	25,502,400
アルファC o	4,600	1,141.00	5,248,600
S U M C O	155,800	1,256.00	195,684,800
川田テクノロジーズ	2,900	6,290.00	18,241,000
R S T e c h n o l o g i e s	3,700	2,785.00	10,304,500
信和	6,900	937.00	6,465,300
東洋製罐グループホールディングス	82,900	1,518.00	125,842,200
ホッカンホールディングス	6,600	1,434.00	9,464,400
コロナ	7,200	987.00	7,106,400
横河ブリッジホールディングス	24,200	1,477.00	35,743,400
駒井ハルテック	2,500	1,388.00	3,470,000
高田機工	1,200	2,402.00	2,882,400
三和ホールディングス	134,400	1,157.00	155,500,800
文化シャッター	38,400	852.00	32,716,800
三協立山	18,100	1,109.00	20,072,900
アルインコ	10,300	893.00	9,197,900
東洋シャッター	3,200	674.00	2,156,800
L I X I Lグループ	192,000	1,706.00	327,552,000

日本ファイルコン	10,000	470.00	4,700,000	
ノーリツ	27,900	1,109.00	30,941,100	
長府製作所	13,200	2,121.00	27,997,200	
リンナイ	23,200	6,710.00	155,672,000	
ダイニチ工業	7,100	591.00	4,196,100	
日東精工	18,000	505.00	9,090,000	
三洋工業	1,700	1,757.00	2,986,900	
岡部	26,400	786.00	20,750,400	
ジーテクト	14,400	1,480.00	21,312,000	
東プレ	24,300	1,561.00	37,932,300	
高周波熱錬	25,100	765.00	19,201,500	
東京製綱	8,000	871.00	6,968,000	
サンコール	7,400	437.00	3,233,800	
モリテック スチール	10,200	317.00	3,233,400	
パイオラックス	20,900	1,712.00	35,780,800	
エイチワン	12,800	604.00	7,731,200	
日本発條	129,700	734.00	95,199,800	
中央発條	1,600	2,739.00	4,382,400	
アドバネクス	1,700	1,632.00	2,774,400	
立川ブラインド工業	5,700	1,335.00	7,609,500	
三益半導体工業	11,600	1,738.00	20,160,800	
日本ドライケミカル	3,600	1,130.00	4,068,000	
日本製鋼所	39,500	1,761.00	69,559,500	
三浦工業	56,400	2,849.00	160,683,600	
タクマ	47,600	1,180.00	56,168,000	
ツガミ	29,400	792.00	23,284,800	
オークマ	16,600	5,080.00	84,328,000	
東芝機械	14,800	1,995.00	29,526,000	
アマダホールディングス	195,600	1,081.00	211,443,600	
アイダエンジニアリング	35,300	771.00	27,216,300	
滝澤鉄工所	4,100	1,173.00	4,809,300	
F U J I	52,000	1,363.00	70,876,000	
牧野フライス製作所	15,300	4,150.00	63,495,000	
オーエスジー	60,200	1,975.00	118,895,000	
ダイジェット工業	1,600	1,457.00	2,331,200	
旭ダイヤモンド工業	34,300	591.00	20,271,300	
D M G 森精機	82,400	1,405.00	115,772,000	
ソディック	30,700	712.00	21,858,400	
ディスコ	17,600	18,760.00	330,176,000	
日東工器	7,200	2,002.00	14,414,400	
日進工具	3,900	1,800.00	7,020,000	
パンチ工業	9,200	440.00	4,048,000	

富士ダイス	5,900	561.00	3,309,900
豊和工業	7,300	726.00	5,299,800
OKK	5,500	696.00	3,828,000
東洋機械金属	9,500	543.00	5,158,500
津田駒工業	2,800	1,174.00	3,287,200
エンシュウ	3,500	1,000.00	3,500,000
島精機製作所	18,000	2,451.00	44,118,000
オプトラン	14,500	2,905.00	42,122,500
NCホールディングス	4,400	438.00	1,927,200
イワキポンプ	5,600	907.00	5,079,200
フリュー	10,500	966.00	10,143,000
ヤマシンフィルタ	22,800	623.00	14,204,400
日阪製作所	16,200	786.00	12,733,200
やまびこ	25,300	976.00	24,692,800
平田機工	6,200	6,570.00	40,734,000
ペガサスミシン製造	12,400	476.00	5,902,400
マルマエ	5,400	834.00	4,503,600
タツモ	6,200	950.00	5,890,000
ナプテスコ	76,700	2,895.00	222,046,500
三井海洋開発	13,900	2,260.00	31,414,000
レオン自動機	12,800	1,430.00	18,304,000
SMC	38,500	39,020.00	1,502,270,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	10,100	379.00	3,827,900
ホソカワミクロン	4,600	3,595.00	16,537,000
ユニオンツール	5,500	3,055.00	16,802,500
オイレス工業	18,300	1,460.00	26,718,000
日精エー・エス・ビー機械	4,400	2,966.00	13,050,400
サトーホールディングス	15,700	2,572.00	40,380,400
技研製作所	11,400	3,200.00	36,480,000
日本エアーテック	4,200	565.00	2,373,000
カワタ	3,600	905.00	3,258,000
日精樹脂工業	11,100	889.00	9,867,900
オカダアイヨン	4,500	1,090.00	4,905,000
ワイエイシイホールディングス	5,200	575.00	2,990,000
小松製作所	595,900	2,212.00	1,318,130,800
住友重機械工業	75,400	3,065.00	231,101,000
日立建機	52,800	2,228.00	117,638,400
日工	3,600	3,300.00	11,880,000
巴工業	5,600	2,318.00	12,980,800
井関農機	13,200	1,316.00	17,371,200
TOWA	11,400	674.00	7,683,600
丸山製作所	3,000	1,123.00	3,369,000

北川鉄工所	6,000	1,760.00	10,560,000
ローツェ	5,800	2,147.00	12,452,600
タカキタ	4,800	502.00	2,409,600
クボタ	705,100	1,498.00	1,056,239,800
荏原実業	3,700	1,908.00	7,059,600
三菱化工機	4,600	1,603.00	7,373,800
月島機械	26,200	1,285.00	33,667,000
帝国電機製作所	9,300	1,077.00	10,016,100
新東工業	31,400	864.00	27,129,600
澁谷工業	11,500	2,617.00	30,095,500
アイチ コーポレーション	22,900	617.00	14,129,300
小森コーポレーション	33,500	1,012.00	33,902,000
鶴見製作所	10,300	1,814.00	18,684,200
住友精密工業	2,200	2,825.00	6,215,000
日本ギア工業	4,100	484.00	1,984,400
酒井重工業	2,500	2,650.00	6,625,000
荏原製作所	58,400	2,452.00	143,196,800
石井鐵工所	2,100	1,966.00	4,128,600
西島製作所	13,600	996.00	13,545,600
北越工業	13,600	1,140.00	15,504,000
ダイキン工業	179,600	13,365.00	2,400,354,000
オルガノ	4,800	4,070.00	19,536,000
トーヨーカネツ	5,000	1,676.00	8,380,000
栗田工業	71,300	2,724.00	194,221,200
椿本チエイン	17,200	3,070.00	52,804,000
大同工業	6,400	775.00	4,960,000
木村化工機	11,300	348.00	3,932,400
アネスト岩田	20,600	865.00	17,819,000
ダイフク	72,400	4,955.00	358,742,000
サムコ	3,700	776.00	2,871,200
加藤製作所	6,800	1,635.00	11,118,000
油研工業	2,300	1,549.00	3,562,700
タダノ	63,600	916.00	58,257,600
フジテック	47,900	1,230.00	58,917,000
C K D	36,700	1,000.00	36,700,000
キトー	10,000	1,391.00	13,910,000
平和	36,700	2,113.00	77,547,100
理想科学工業	11,700	1,716.00	20,077,200
S A N K Y O	33,000	3,640.00	120,120,000
日本金銭機械	14,600	926.00	13,519,600
マースグループホールディングス	8,400	1,826.00	15,338,400
福島工業	8,100	2,921.00	23,660,100

オーイズミ	5,800	377.00	2,186,600
ダイコク電機	6,100	1,473.00	8,985,300
竹内製作所	22,100	1,534.00	33,901,400
アマノ	37,600	3,145.00	118,252,000
J U K I	18,300	785.00	14,365,500
蛇の目マシン工業	12,200	379.00	4,623,800
マックス	20,100	1,629.00	32,742,900
グローリー	36,500	2,819.00	102,893,500
新晃工業	12,300	1,718.00	21,131,400
大和冷機工業	19,100	1,052.00	20,093,200
セガサミーホールディングス	130,600	1,470.00	191,982,000
日本ピストンリング	4,900	1,194.00	5,850,600
リケン	6,100	3,580.00	21,838,000
T P R	17,800	1,564.00	27,839,200
ツバキ・ナカシマ	26,900	1,520.00	40,888,000
ホシザキ	38,500	7,350.00	282,975,000
大豊工業	10,900	748.00	8,153,200
日本精工	270,400	821.00	221,998,400
N T N	283,100	271.00	76,720,100
ジェイテクト	126,300	1,124.00	141,961,200
不二越	12,200	4,010.00	48,922,000
日本トムソン	39,300	407.00	15,995,100
T H K	76,600	2,356.00	180,469,600
ユーシン精機	10,300	873.00	8,991,900
前澤給装工業	5,200	1,915.00	9,958,000
イーグル工業	16,400	934.00	15,317,600
前澤工業	9,000	310.00	2,790,000
日本ピラー工業	13,400	1,035.00	13,869,000
キッツ	53,500	660.00	35,310,000
マキタ	160,200	2,997.00	480,119,400
日立造船	104,700	332.00	34,760,400
三菱重工業	220,600	3,923.00	865,413,800
I H I	101,200	2,026.00	205,031,200
スター精密	21,600	1,431.00	30,909,600
日清紡ホールディングス	87,900	776.00	68,210,400
イビデン	80,800	2,018.00	163,054,400
コニカミノルタ	288,000	743.00	213,984,000
ブラザー工業	171,600	1,799.00	308,708,400
ミネベアミツミ	244,500	1,577.00	385,576,500
日立製作所	592,500	3,569.00	2,114,632,500
三菱電機	1,316,100	1,253.00	1,649,073,300
富士電機	85,400	2,958.00	252,613,200

東洋電機製造	5,300	1,488.00	7,886,400
安川電機	152,600	3,420.00	521,892,000
シンフォニアテクノロジー	18,400	1,066.00	19,614,400
明電舎	26,100	1,702.00	44,422,200
オリジン	3,700	1,316.00	4,869,200
山洋電気	6,500	4,010.00	26,065,000
デンヨー	12,200	1,507.00	18,385,400
東芝テック	16,500	3,100.00	51,150,000
芝浦メカトロニクス	2,500	2,696.00	6,740,000
マブチモーター	36,500	3,660.00	133,590,000
日本電産	158,400	13,590.00	2,152,656,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,600	711.00	5,403,600
トレックス・セミコンダクター	6,200	1,054.00	6,534,800
東光高岳	7,000	1,059.00	7,413,000
ダブル・スコープ	18,500	592.00	10,952,000
ダイヘン	14,400	2,905.00	41,832,000
ヤーマン	19,500	785.00	15,307,500
JVCケンウッド	101,800	296.00	30,132,800
ミマキエンジニアリング	12,500	482.00	6,025,000
第一精工	5,500	1,949.00	10,719,500
日新電機	30,900	1,218.00	37,636,200
大崎電気工業	26,400	652.00	17,212,800
オムロン	139,900	5,050.00	706,495,000
日東工業	21,200	1,923.00	40,767,600
I D E C	17,700	1,668.00	29,523,600
正興電機製作所	3,600	716.00	2,577,600
不二電機工業	1,700	1,184.00	2,012,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	47,500	1,749.00	83,077,500
サクサホールディングス	3,400	1,708.00	5,807,200
メルコホールディングス	5,600	2,722.00	15,243,200
テクノメディカ	3,100	2,000.00	6,200,000
日本電気	170,300	4,660.00	793,598,000
富士通	126,900	8,258.00	1,047,940,200
沖電気工業	57,100	1,465.00	83,651,500
岩崎通信機	6,200	763.00	4,730,600
電気興業	7,000	2,812.00	19,684,000
サンケン電気	15,500	1,807.00	28,008,500
ナカヨ	2,600	1,616.00	4,201,600
アイホン	7,500	1,526.00	11,445,000
ルネサスエレクトロニクス	625,900	642.00	401,827,800
セイコーエプソン	163,400	1,403.00	229,250,200
ワコム	96,400	324.00	31,233,600

アルバック	26,200	4,190.00	109,778,000
アクセル	6,100	574.00	3,501,400
E I Z O	12,100	3,485.00	42,168,500
日本信号	33,600	1,137.00	38,203,200
京三製作所	28,600	333.00	9,523,800
能美防災	17,600	2,129.00	37,470,400
ホーチキ	8,600	1,321.00	11,360,600
星和電機	7,800	498.00	3,884,400
エレコム	12,600	4,185.00	52,731,000
パナソニック	1,503,600	816.20	1,227,238,320
シャープ	130,600	1,072.00	140,003,200
アンリツ	84,800	1,961.00	166,292,800
富士通ゼネラル	40,300	1,664.00	67,059,200
ソニー	883,200	5,893.00	5,204,697,600
T D K	68,900	8,130.00	560,157,000
帝国通信工業	6,100	1,063.00	6,484,300
タムラ製作所	51,000	502.00	25,602,000
アルプスアルパイン	137,200	1,730.00	237,356,000
池上通信機	4,200	1,006.00	4,225,200
鈴木	7,700	571.00	4,396,700
日本トリム	2,600	4,530.00	11,778,000
ローランド ディー . ジー .	7,400	1,981.00	14,659,400
フォスター電機	14,900	1,704.00	25,389,600
S M K	3,700	2,600.00	9,620,000
ヨコオ	9,500	2,604.00	24,738,000
ホシデン	39,100	945.00	36,949,500
ヒロセ電機	18,800	11,650.00	219,020,000
日本航空電子工業	30,300	1,362.00	41,268,600
T O A	14,200	1,176.00	16,699,200
マクセルホールディングス	28,600	1,395.00	39,897,000
古野電気	17,400	873.00	15,190,200
ユニデンホールディングス	3,900	1,646.00	6,419,400
スミダコーポレーション	11,100	969.00	10,755,900
アイコム	7,300	2,173.00	15,862,900
リオン	6,200	2,280.00	14,136,000
本多通信工業	12,000	444.00	5,328,000
横河電機	131,800	1,890.00	249,102,000
新電元工業	4,700	2,984.00	14,024,800
アズビル	83,100	2,653.00	220,464,300
東亜ディーケーケー	6,900	805.00	5,554,500
日本光電工業	58,100	2,927.00	170,058,700
チノー	4,600	1,239.00	5,699,400

共和電業	14,100	394.00	5,555,400
日本電子材料	5,500	458.00	2,519,000
堀場製作所	26,100	5,320.00	138,852,000
アドバンテスト	89,700	4,105.00	368,218,500
小野測器	6,500	489.00	3,178,500
エスベック	11,900	1,795.00	21,360,500
キーエンス	64,600	61,400.00	3,966,440,000
日置電機	7,000	3,160.00	22,120,000
シスメックス	102,600	6,577.00	674,800,200
日本マイクロニクス	23,400	742.00	17,362,800
メガチップス	10,600	1,490.00	15,794,000
O B A R A G R O U P	6,900	3,235.00	22,321,500
澤藤電機	1,800	1,629.00	2,932,200
原田工業	5,800	816.00	4,732,800
コーセル	17,100	983.00	16,809,300
イリソ電子工業	12,100	4,885.00	59,108,500
オブテックスグループ	22,500	1,368.00	30,780,000
千代田インテグレ	6,300	1,925.00	12,127,500
アイ・オー・データ機器	5,300	828.00	4,388,400
レーザーテック	27,000	5,870.00	158,490,000
スタンレー電気	93,000	2,600.00	241,800,000
岩崎電気	5,400	1,136.00	6,134,400
ウシオ電機	76,700	1,320.00	101,244,000
岡谷電機産業	10,400	362.00	3,764,800
ハリオス テクノ ホールディング	12,800	523.00	6,694,400
エノモト	4,100	847.00	3,472,700
日本セラミック	13,500	2,591.00	34,978,500
遠藤照明	7,200	635.00	4,572,000
古河電池	10,000	559.00	5,590,000
双信電機	7,200	416.00	2,995,200
山一電機	9,900	1,079.00	10,682,100
図研	8,800	1,772.00	15,593,600
日本電子	26,100	2,265.00	59,116,500
カシオ計算機	116,500	1,481.00	172,536,500
ファナック	125,100	17,845.00	2,232,409,500
日本シイエムケイ	34,200	468.00	16,005,600
エンプラス	6,100	2,880.00	17,568,000
大真空	5,200	919.00	4,778,800
ローム	63,000	7,490.00	471,870,000
浜松ホトニクス	94,500	3,705.00	350,122,500
三井ハイテック	14,800	1,156.00	17,108,800
新光電気工業	44,600	821.00	36,616,600

京セラ	200,600	6,300.00	1,263,780,000
太陽誘電	58,700	1,909.00	112,058,300
村田製作所	414,300	4,357.00	1,805,105,100
双葉電子工業	21,100	1,226.00	25,868,600
北陸電気工業	5,300	935.00	4,955,500
ニチコン	41,900	858.00	35,950,200
日本ケミコン	9,300	1,326.00	12,331,800
K O A	20,100	1,177.00	23,657,700
市光工業	20,200	682.00	13,776,400
小糸製作所	78,900	4,875.00	384,637,500
ミツバ	24,900	516.00	12,848,400
S C R E E Nホールディングス	22,900	6,100.00	139,690,000
キャノン電子	14,000	1,752.00	24,528,000
キャノン	708,500	2,738.50	1,940,227,250
リコー	395,800	965.00	381,947,000
象印マホービン	38,800	1,291.00	50,090,800
M U T O Hホールディングス	2,000	1,628.00	3,256,000
東京エレクトロン	87,800	18,855.00	1,655,469,000
トヨタ紡織	46,200	1,402.00	64,772,400
芦森工業	3,000	1,296.00	3,888,000
ユニプレス	25,700	1,611.00	41,402,700
豊田自動織機	106,600	5,800.00	618,280,000
モリタホールディングス	23,200	1,518.00	35,217,600
三櫻工業	17,400	425.00	7,395,000
デンソー	289,800	4,386.00	1,271,062,800
東海理化電機製作所	34,800	1,634.00	56,863,200
三井E & Sホールディングス	47,500	785.00	37,287,500
川崎重工業	102,400	2,048.00	209,715,200
名村造船所	39,500	229.00	9,045,500
日本車輛製造	4,800	2,171.00	10,420,800
三菱ロジスネクスト	15,700	1,142.00	17,929,400
近畿車輛	2,000	1,213.00	2,426,000
日産自動車	1,552,100	648.40	1,006,381,640
いすゞ自動車	416,000	1,112.50	462,800,000
トヨタ自動車	1,466,500	6,889.00	10,102,718,500
日野自動車	164,300	818.00	134,397,400
三菱自動車工業	487,100	432.00	210,427,200
エフテック	9,600	669.00	6,422,400
レシップホールディングス	4,700	761.00	3,576,700
G M B	3,000	724.00	2,172,000
ファルテック	2,700	701.00	1,892,700
武蔵精密工業	32,200	1,192.00	38,382,400

日産車体	25,700	950.00	24,415,000
新明和工業	55,100	1,219.00	67,166,900
極東開発工業	26,200	1,187.00	31,099,400
日信工業	24,300	1,327.00	32,246,100
トピー工業	11,000	1,776.00	19,536,000
ティラド	4,900	1,697.00	8,315,300
タチエス	21,900	1,148.00	25,141,200
N O K	71,000	1,413.00	100,323,000
フタバ産業	37,000	664.00	24,568,000
K Y B	13,700	2,884.00	39,510,800
大同メタル工業	21,900	585.00	12,811,500
プレス工業	65,900	424.00	27,941,600
ミクニ	17,700	296.00	5,239,200
太平洋工業	27,800	1,356.00	37,696,800
ケーヒン	30,400	1,397.00	42,468,800
河西工業	16,600	694.00	11,520,400
アイシン精機	108,500	3,075.00	333,637,500
マツダ	413,000	880.50	363,646,500
今仙電機製作所	12,600	814.00	10,256,400
本田技研工業	1,110,200	2,490.00	2,764,398,000
スズキ	240,800	4,085.00	983,668,000
S U B A R U	408,600	2,868.50	1,172,069,100
安永	6,600	1,218.00	8,038,800
ヤマハ発動機	171,600	1,718.00	294,808,800
ショーワ	31,300	1,301.00	40,721,300
T B K	16,400	371.00	6,084,400
エクセディ	18,000	1,928.00	34,704,000
豊田合成	42,700	1,923.00	82,112,100
愛三工業	21,100	688.00	14,516,800
盟和産業	2,300	994.00	2,286,200
日本プラスト	10,800	640.00	6,912,000
ヨロズ	12,500	1,206.00	15,075,000
エフ・シー・シー	23,800	1,883.00	44,815,400
シマノ	49,300	14,930.00	736,049,000
テイ・エス テック	30,700	2,808.00	86,205,600
ジャムコ	6,800	1,470.00	9,996,000
テルモ	372,400	3,094.00	1,152,205,600
クリエートメディック	4,400	893.00	3,929,200
日機装	40,800	1,085.00	44,268,000
島津製作所	169,400	2,548.00	431,631,200
J M S	12,200	584.00	7,124,800
長野計器	10,400	639.00	6,645,600

ブイ・テクノロジー	6,200	5,130.00	31,806,000
東京計器	8,400	858.00	7,207,200
愛知時計電機	1,700	3,850.00	6,545,000
インターアクション	7,100	1,787.00	12,687,700
オーバル	13,000	215.00	2,795,000
東京精密	23,800	2,669.00	63,522,200
マニー	17,500	7,330.00	128,275,000
ニコン	229,300	1,295.00	296,943,500
トプコン	70,700	1,177.00	83,213,900
オリンパス	784,200	1,181.00	926,140,200
理研計器	11,600	1,720.00	19,952,000
タムロン	11,200	2,175.00	24,360,000
H O Y A	264,900	8,585.00	2,274,166,500
シード	5,600	803.00	4,496,800
ノーリツ鋼機	10,400	1,742.00	18,116,800
エー・アンド・デイ	12,000	658.00	7,896,000
朝日インテック	111,700	2,355.00	263,053,500
シチズン時計	144,100	474.00	68,303,400
リズム時計工業	4,500	875.00	3,937,500
大研医器	10,500	523.00	5,491,500
メニコン	18,100	3,965.00	71,766,500
シンシア	1,900	649.00	1,233,100
松風	6,400	1,456.00	9,318,400
セイコーホールディングス	20,300	2,151.00	43,665,300
ニプロ	91,100	1,089.00	99,207,900
中本パックス	3,700	1,422.00	5,261,400
スノーピーク	5,800	1,268.00	7,354,400
パラマウントベッドホールディングス	15,100	3,850.00	58,135,000
トランザクション	8,400	1,050.00	8,820,000
S H O - B I	3,800	339.00	1,288,200
ニホンフラッシュ	5,600	2,429.00	13,602,400
前田工織	14,500	1,401.00	20,314,500
永大産業	17,200	300.00	5,160,000
アートネイチャー	14,100	622.00	8,770,200
バンダイナムコホールディングス	136,100	6,360.00	865,596,000
アイフィスジャパン	3,300	697.00	2,300,100
共立印刷	21,900	139.00	3,044,100
S H O E I	6,300	4,380.00	27,594,000
フランスベッドホールディングス	18,600	1,006.00	18,711,600
パイロットコーポレーション	23,000	3,570.00	82,110,000
萩原工業	7,300	1,308.00	9,548,400
トッパン・フォームズ	28,200	873.00	24,618,600

フジシールインターナショナル	29,500	2,886.00	85,137,000
タカラトミー	55,100	1,102.00	60,720,200
廣濟堂	12,200	691.00	8,430,200
エステールホールディングス	3,500	603.00	2,110,500
アーク	50,200	89.00	4,467,800
タカノ	5,100	716.00	3,651,600
プロネクサス	11,300	998.00	11,277,400
ホクシン	8,100	144.00	1,166,400
ウッドワン	4,400	988.00	4,347,200
大建工業	10,000	1,808.00	18,080,000
凸版印刷	195,600	1,630.00	318,828,000
大日本印刷	185,500	2,251.00	417,560,500
共同印刷	4,100	2,661.00	10,910,100
N I S S H A	27,000	929.00	25,083,000
光村印刷	1,100	1,639.00	1,802,900
宝印刷	6,300	1,596.00	10,054,800
アシックス	108,600	1,359.00	147,587,400
ツツミ	4,100	1,924.00	7,888,400
小松ウオール工業	4,000	1,783.00	7,132,000
ヤマハ	78,300	4,500.00	352,350,000
河合楽器製作所	4,100	2,724.00	11,168,400
クリナップ	12,200	512.00	6,246,400
ピジョン	79,500	3,890.00	309,255,000
兼松サステック	800	1,638.00	1,310,400
キングジム	10,900	827.00	9,014,300
リンテック	31,300	2,008.00	62,850,400
イトーキ	28,000	405.00	11,340,000
任天堂	75,300	40,350.00	3,038,355,000
三菱鉛筆	21,700	1,652.00	35,848,400
タカラスタンダード	27,200	1,624.00	44,172,800
コクヨ	63,100	1,379.00	87,014,900
ナカバヤシ	12,900	502.00	6,475,800
グローブライド	6,400	2,903.00	18,579,200
オカムラ	45,900	1,000.00	45,900,000
美津濃	13,000	2,688.00	34,944,000
東京電力ホールディングス	1,050,600	505.00	530,553,000
中部電力	402,600	1,542.00	620,809,200
関西電力	537,000	1,266.00	679,842,000
中国電力	181,900	1,346.00	244,837,400
北陸電力	128,900	658.00	84,816,200
東北電力	308,200	1,053.00	324,534,600
四国電力	118,500	1,004.00	118,974,000

九州電力	271,200	1,036.00	280,963,200
北海道電力	123,200	525.00	64,680,000
沖縄電力	24,400	1,589.00	38,771,600
電源開発	104,700	2,410.00	252,327,000
エフオン	6,200	687.00	4,259,400
イーレックス	22,900	1,172.00	26,838,800
レノバ	21,600	821.00	17,733,600
東京瓦斯	258,200	2,664.00	687,844,800
大阪瓦斯	255,400	1,863.00	475,810,200
東邦瓦斯	65,200	3,965.00	258,518,000
北海道瓦斯	7,100	1,447.00	10,273,700
広島ガス	27,100	325.00	8,807,500
西部瓦斯	14,800	2,087.00	30,887,600
静岡ガス	38,900	839.00	32,637,100
メタウォーター	6,400	3,650.00	23,360,000
SBSホールディングス	12,500	1,463.00	18,287,500
東武鉄道	138,800	3,205.00	444,854,000
相鉄ホールディングス	45,100	2,753.00	124,160,300
東京急行電鉄	357,400	1,892.00	676,200,800
京浜急行電鉄	180,300	1,931.00	348,159,300
小田急電鉄	210,800	2,385.00	502,758,000
京王電鉄	73,500	6,710.00	493,185,000
京成電鉄	98,600	4,185.00	412,641,000
富士急行	17,900	4,415.00	79,028,500
新京成電鉄	3,400	2,012.00	6,840,800
東日本旅客鉄道	234,000	10,155.00	2,376,270,000
西日本旅客鉄道	118,000	8,887.00	1,048,666,000
東海旅客鉄道	117,800	20,890.00	2,460,842,000
西武ホールディングス	163,000	1,778.00	289,814,000
鴻池運輸	20,900	1,617.00	33,795,300
西日本鉄道	36,500	2,345.00	85,592,500
ハマキョウレックス	10,100	3,565.00	36,006,500
サカイ引越センター	6,900	6,260.00	43,194,000
近鉄グループホールディングス	124,600	5,220.00	650,412,000
阪急阪神ホールディングス	166,200	3,960.00	658,152,000
南海電気鉄道	55,600	2,707.00	150,509,200
京阪ホールディングス	55,500	4,410.00	244,755,000
神戸電鉄	3,200	3,875.00	12,400,000
名古屋鉄道	102,400	3,140.00	321,536,000
山陽電気鉄道	9,600	2,032.00	19,507,200
日本通運	48,000	5,390.00	258,720,000
ヤマトホールディングス	218,500	1,809.00	395,266,500

山九	34,600	5,530.00	191,338,000
丸運	7,100	248.00	1,760,800
丸全昭和運輸	10,100	3,040.00	30,704,000
センコーグループホールディングス	68,700	819.00	56,265,300
トナミホールディングス	3,000	4,005.00	12,015,000
ニッコンホールディングス	47,400	2,317.00	109,825,800
日本石油輸送	1,500	2,852.00	4,278,000
福山通運	16,000	3,575.00	57,200,000
セイノーホールディングス	93,300	1,352.00	126,141,600
エスライン	3,700	811.00	3,000,700
神奈川中央交通	3,100	3,700.00	11,470,000
日立物流	27,400	3,295.00	90,283,000
丸和運輸機関	6,600	5,330.00	35,178,000
C & F ロジホールディングス	12,600	1,146.00	14,439,600
九州旅客鉄道	104,600	3,200.00	334,720,000
S Gホールディングス	117,700	2,784.00	327,676,800
日本郵船	104,700	1,564.00	163,750,800
商船三井	74,200	2,498.00	185,351,600
川崎汽船	38,400	1,048.00	40,243,200
N S ユナイテッド海運	7,200	2,070.00	14,904,000
飯野海運	61,400	317.00	19,463,800
共栄タンカー	1,700	1,304.00	2,216,800
乾汽船	11,200	922.00	10,326,400
日本航空	228,200	3,266.00	745,301,200
A N Aホールディングス	227,800	3,611.00	822,585,800
パスコ	2,400	877.00	2,104,800
トランコム	3,500	5,700.00	19,950,000
日新	10,800	1,440.00	15,552,000
三菱倉庫	43,100	2,583.00	111,327,300
三井倉庫ホールディングス	15,300	1,533.00	23,454,900
住友倉庫	45,900	1,361.00	62,469,900
澁澤倉庫	6,800	1,787.00	12,151,600
東陽倉庫	22,500	287.00	6,457,500
日本トランスシティ	27,400	430.00	11,782,000
ケイヒン	2,400	1,180.00	2,832,000
中央倉庫	7,600	989.00	7,516,400
川西倉庫	2,500	1,029.00	2,572,500
安田倉庫	10,200	919.00	9,373,800
ファイズ	2,200	692.00	1,522,400
東洋埠頭	3,800	1,302.00	4,947,600
宇徳	10,700	500.00	5,350,000
上組	76,900	2,459.00	189,097,100

サンリツ	2,900	638.00	1,850,200
キムラユニティー	3,300	991.00	3,270,300
キューソー流通システム	3,100	1,753.00	5,434,300
近鉄エクスプレス	23,500	1,384.00	32,524,000
東海運	7,100	274.00	1,945,400
エーアイティー	8,100	913.00	7,395,300
内外トランスライン	4,400	1,187.00	5,222,800
日本コンセプト	4,400	1,381.00	6,076,400
NEC ネットエスアイ	14,300	2,702.00	38,638,600
クロスキャット	3,700	951.00	3,518,700
システナ	46,200	1,580.00	72,996,000
デジタルアーツ	7,000	7,540.00	52,780,000
日鉄ソリューションズ	19,400	3,545.00	68,773,000
キューブシステム	7,200	754.00	5,428,800
エイジア	2,700	1,286.00	3,472,200
コア	5,700	1,271.00	7,244,700
ソリトンシステムズ	7,200	934.00	6,724,800
ソフトクリエイティブホールディングス	5,800	1,688.00	9,790,400
T I S	43,100	6,240.00	268,944,000
ネオス	5,200	707.00	3,676,400
電算システム	5,000	2,764.00	13,820,000
グリー	89,600	468.00	41,932,800
コーエーテクモホールディングス	26,500	2,189.00	58,008,500
三菱総合研究所	5,600	3,565.00	19,964,000
電算	1,600	2,025.00	3,240,000
A G S	7,700	645.00	4,966,500
ファインデックス	11,100	1,059.00	11,754,900
ブレインパッド	2,500	6,560.00	16,400,000
K L a b	24,700	1,126.00	27,812,200
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,400	1,138.00	19,801,200
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	1,724.00	3,792,800
ネクソン	366,400	1,431.00	524,318,400
アイスタイル	33,500	633.00	21,205,500
エムアップ	4,600	1,957.00	9,002,200
エイチーム	9,100	1,093.00	9,946,300
エニグモ	9,400	1,148.00	10,791,200
テクノスジャパン	11,400	494.00	5,631,600
コロブラ	42,600	685.00	29,181,000
ブロードリーフ	64,500	551.00	35,539,500
クロス・マーケティンググループ	6,600	315.00	2,079,000
デジタルハーツホールディングス	6,100	958.00	5,843,800
システム情報	6,800	1,053.00	7,160,400

メディアドゥホールディングス	4,500	3,450.00	15,525,000
じげん	18,700	607.00	11,350,900
エンカレッジ・テクノロジー	2,100	726.00	1,524,600
サイバーリンクス	2,200	1,036.00	2,279,200
フィックスターズ	13,900	1,546.00	21,489,400
CARTA HOLDINGS	6,500	941.00	6,116,500
オブティム	5,700	2,886.00	16,450,200
セレス	4,400	1,254.00	5,517,600
ティーガイア	9,300	2,127.00	19,781,100
セック	2,200	3,045.00	6,699,000
日本アジアグループ	13,600	318.00	4,324,800
豆蔵ホールディングス	8,900	1,587.00	14,124,300
テクマトリックス	9,200	2,398.00	22,061,600
プロシップ	3,900	1,165.00	4,543,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,200	2,436.00	76,003,200
GMOペイメントゲートウェイ	21,300	7,940.00	169,122,000
ザッパラス	7,500	350.00	2,625,000
システムリサーチ	1,800	3,820.00	6,876,000
インターネットイニシアティブ	21,100	2,313.00	48,804,300
さくらインターネット	15,800	569.00	8,990,200
ヴィンクス	4,400	1,262.00	5,552,800
GMOクラウド	2,800	2,428.00	6,798,400
SRAホールディングス	7,000	2,372.00	16,604,000
Minor iソリューションズ	2,700	1,762.00	4,757,400
システムインテグレータ	4,000	693.00	2,772,000
朝日ネット	10,800	709.00	7,657,200
eBASE	8,000	911.00	7,288,000
アバント	4,700	1,906.00	8,958,200
アドソル日進	4,700	1,962.00	9,221,400
フリービット	7,900	993.00	7,844,700
コムチュア	7,300	3,810.00	27,813,000
サイバーコム	2,500	1,635.00	4,087,500
アステリア	9,000	637.00	5,733,000
マークラインズ	6,600	1,709.00	11,279,400
メディカル・データ・ビジョン	11,200	1,024.00	11,468,800
ショーケース	3,500	748.00	2,618,000
モバイルファクトリー	3,600	1,736.00	6,249,600
テラスカイ	2,200	1,768.00	3,889,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,616.00	9,534,400
PCIホールディングス	2,700	1,976.00	5,335,200
パイブドHD	2,200	1,188.00	2,613,600
アイビーシー	2,600	971.00	2,524,600

ネオジャパン	2,700	1,009.00	2,724,300
P R T I M E S	1,200	2,923.00	3,507,600
ランドコンピュータ	2,200	979.00	2,153,800
ダブルスタンダード	1,200	4,365.00	5,238,000
オープンドア	6,500	2,268.00	14,742,000
マイネット	4,700	491.00	2,307,700
アカツキ	4,600	7,060.00	32,476,000
ベネフィットジャパン	1,200	1,570.00	1,884,000
U b i c o mホールディングス	2,500	1,628.00	4,070,000
L I N E	29,600	3,710.00	109,816,000
カナミックネットワーク	2,800	1,795.00	5,026,000
ノムラシステムコーポレーション	3,500	386.00	1,351,000
チェンジ	2,700	1,788.00	4,827,600
シンクロ・フード	6,000	460.00	2,760,000
オークネット	8,100	1,178.00	9,541,800
セグエグループ	1,300	1,321.00	1,717,300
エイトレッド	1,500	1,996.00	2,994,000
A O I T Y O H o l d i n g s	13,900	630.00	8,757,000
マクロミル	23,200	888.00	20,601,600
ビーグリー	3,400	833.00	2,832,200
オロ	3,500	2,334.00	8,169,000
テモナ	2,200	479.00	1,053,800
ニーズウェル	1,900	699.00	1,328,100
サインポスト	2,100	2,155.00	4,525,500
ソルクシーズ	5,800	854.00	4,953,200
フェイス	5,500	685.00	3,767,500
プロトコーポレーション	11,800	1,174.00	13,853,200
ハイマックス	1,700	1,812.00	3,080,400
野村総合研究所	246,500	2,092.00	515,678,000
サイバネットシステム	10,400	550.00	5,720,000
C Eホールディングス	3,900	1,035.00	4,036,500
日本システム技術	2,300	1,202.00	2,764,600
インテージホールディングス	16,400	844.00	13,841,600
東邦システムサイエンス	4,100	913.00	3,743,300
ソースネクスト	50,700	428.00	21,699,600
インフォコム	14,200	2,550.00	36,210,000
F I G	14,900	294.00	4,380,600
アルテリア・ネットワークス	14,500	1,424.00	20,648,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,100	1,669.00	5,173,900
フォーカスシステムズ	9,000	803.00	7,227,000
クレスコ	4,000	3,450.00	13,800,000
フジ・メディア・ホールディングス	134,200	1,363.00	182,914,600

オービック	44,800	12,210.00	547,008,000
ジャストシステム	18,400	4,035.00	74,244,000
TDCソフト	11,700	714.00	8,353,800
ヤフー	843,000	261.00	220,023,000
トレンドマイクロ	57,500	5,040.00	289,800,000
IDホールディングス	5,100	1,152.00	5,875,200
日本オラクル	26,200	9,140.00	239,468,000
アルファシステムズ	4,100	2,587.00	10,606,700
フューチャー	17,000	1,784.00	30,328,000
CAC Holdings	9,100	1,102.00	10,028,200
ソフトバンク・テクノロジー	5,600	1,980.00	11,088,000
トーセ	3,800	825.00	3,135,000
オービックビジネスコンサルタント	13,200	4,390.00	57,948,000
伊藤忠テクノソリューションズ	58,900	2,941.00	173,224,900
アイティフォー	15,900	860.00	13,674,000
東計電算	2,000	2,952.00	5,904,000
エクスネット	2,600	912.00	2,371,200
大塚商会	69,900	3,875.00	270,862,500
サイボウズ	15,300	1,108.00	16,952,400
ソフトブレーン	10,200	567.00	5,783,400
電通国際情報サービス	8,100	3,180.00	25,758,000
デジタルガレージ	25,200	3,335.00	84,042,000
EMシステムズ	10,700	1,770.00	18,939,000
ウェザーニューズ	4,400	3,075.00	13,530,000
C I J	9,900	816.00	8,078,400
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	2,630.00	3,682,000
日本エンタープライズ	14,900	168.00	2,503,200
WOWOW	6,300	2,474.00	15,586,200
スカラ	9,200	1,082.00	9,954,400
インテリジェント ウェイブ	5,200	820.00	4,264,000
IMAGICA GROUP	11,500	452.00	5,198,000
ネットワンシステムズ	45,800	2,846.00	130,346,800
システムソフト	33,100	105.00	3,475,500
アルゴグラフィックス	11,100	2,616.00	29,037,600
マーベラス	20,000	770.00	15,400,000
エイベックス	22,300	1,261.00	28,120,300
日本ユニシス	40,400	3,445.00	139,178,000
兼松エレクトロニクス	7,100	2,949.00	20,937,900
東京放送ホールディングス	85,800	1,685.00	144,573,000
日本テレビホールディングス	118,800	1,384.00	164,419,200
朝日放送グループホールディングス	13,200	695.00	9,174,000
テレビ朝日ホールディングス	35,600	1,668.00	59,380,800

スカパーJ S A Tホールディングス	85,600	415.00	35,524,000
テレビ東京ホールディングス	10,700	2,088.00	22,341,600
日本BS放送	4,600	1,085.00	4,991,000
ビジョン	4,100	4,600.00	18,860,000
スマートバリュー	4,200	691.00	2,902,200
ワイヤレスゲート	6,500	774.00	5,031,000
コネクシオ	9,300	1,319.00	12,266,700
クロップス	2,800	576.00	1,612,800
日本電信電話	883,300	5,064.00	4,473,031,200
K D D I	1,058,700	2,868.00	3,036,351,600
ソフトバンク	1,369,300	1,494.50	2,046,418,850
光通信	15,200	24,660.00	374,832,000
N T T ドコモ	817,700	2,664.00	2,178,352,800
エムティーアイ	12,900	691.00	8,913,900
G M O インターネット	51,900	1,770.00	91,863,000
ファイバーゲート	1,300	3,170.00	4,121,000
アйдママーケティングコミュニケーション	3,300	519.00	1,712,700
K A D O K A W A	37,800	1,575.00	59,535,000
学研ホールディングス	4,400	5,040.00	22,176,000
ゼンリン	25,900	1,731.00	44,832,900
昭文社	6,700	348.00	2,331,600
インプレスホールディングス	10,700	136.00	1,455,200
アイネット	7,500	1,325.00	9,937,500
松竹	8,600	12,600.00	108,360,000
東宝	85,000	4,525.00	384,625,000
東映	5,400	15,020.00	81,108,000
エヌ・ティ・ティ・データ	344,000	1,376.00	473,344,000
ピー・シー・エー	1,700	4,700.00	7,990,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,300	2,516.00	5,786,800
D T S	29,000	2,207.00	64,003,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,100	4,445.00	267,144,500
シーイーシー	13,900	2,241.00	31,149,900
カブコン	55,400	2,926.00	162,100,400
アイ・エス・ビー	2,700	1,371.00	3,701,700
ジャステック	8,500	1,023.00	8,695,500
S C S K	34,100	5,170.00	176,297,000
日本システムウエア	4,400	2,381.00	10,476,400
アイネス	16,600	1,081.00	17,944,600
T K C	11,000	4,460.00	49,060,000
富士ソフト	16,600	4,575.00	75,945,000
N S D	21,300	3,160.00	67,308,000
コナミホールディングス	52,800	4,735.00	250,008,000

福井コンピュータホールディングス	4,400	2,070.00	9,108,000
J B C Cホールディングス	10,300	1,431.00	14,739,300
ミロク情報サービス	12,900	2,744.00	35,397,600
ソフトバンクグループ	1,024,700	4,656.00	4,771,003,200
ハウスイ	1,100	776.00	853,600
高千穂交易	5,000	1,068.00	5,340,000
伊藤忠食品	3,200	4,155.00	13,296,000
エレマテック	12,100	936.00	11,325,600
J A L U X	3,700	2,234.00	8,265,800
あらた	9,600	3,505.00	33,648,000
トーメンデバイス	2,000	2,206.00	4,412,000
東京エレクトロン デバイス	4,700	1,888.00	8,873,600
フィールズ	11,300	482.00	5,446,600
双日	715,900	320.00	229,088,000
アルフレッサ ホールディングス	144,000	2,362.00	340,128,000
横浜冷凍	36,300	1,007.00	36,554,100
神栄	1,800	828.00	1,490,400
ラサ商事	6,900	803.00	5,540,700
ラクーンホールディングス	6,300	632.00	3,981,600
アルコニックス	13,800	1,104.00	15,235,200
神戸物産	22,400	5,230.00	117,152,000
あい ホールディングス	18,500	1,705.00	31,542,500
ディーブイエックス	5,100	748.00	3,814,800
ダイワボウホールディングス	11,800	4,085.00	48,203,000
マクニカ・富士エレホールディングス	35,900	1,287.00	46,203,300
ラクト・ジャパン	5,400	3,720.00	20,088,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,400	1,041.00	25,400,400
八洲電機	10,000	860.00	8,600,000
メディアスホールディングス	7,400	627.00	4,639,800
レスターホールディングス	14,200	1,657.00	23,529,400
ジュテックホールディングス	3,000	921.00	2,763,000
大光	5,500	640.00	3,520,000
O C H Iホールディングス	3,800	1,101.00	4,183,800
T O K A Iホールディングス	68,500	984.00	67,404,000
黒谷	3,000	466.00	1,398,000
C o m i n i x	2,300	749.00	1,722,700
三洋貿易	6,500	2,080.00	13,520,000
ビューティガレージ	2,100	1,737.00	3,647,700
ウイン・パートナーズ	8,400	1,011.00	8,492,400
ミタチ産業	3,900	635.00	2,476,500
シップヘルスケアホールディングス	27,000	4,895.00	132,165,000
明治電機工業	4,100	1,265.00	5,186,500

デリカフーズホールディングス	2,300	1,450.00	3,335,000
スターティアホールディングス	2,600	483.00	1,255,800
コメダホールディングス	30,000	1,969.00	59,070,000
富士興産	5,000	705.00	3,525,000
協栄産業	1,600	1,314.00	2,102,400
小野建	11,600	1,262.00	14,639,200
南陽	2,700	1,471.00	3,971,700
佐島電機	9,600	752.00	7,219,200
エコートレーディング	3,000	521.00	1,563,000
伯東	8,900	1,050.00	9,345,000
コンドーテック	10,100	862.00	8,706,200
中山福	7,500	479.00	3,592,500
ナガイレーベン	18,800	2,135.00	40,138,000
三菱食品	14,300	2,565.00	36,679,500
松田産業	9,500	1,395.00	13,252,500
第一興商	19,300	4,665.00	90,034,500
メディパルホールディングス	139,900	2,217.00	310,158,300
S P K	2,800	2,430.00	6,804,000
萩原電気ホールディングス	4,800	2,715.00	13,032,000
アズワン	9,300	9,600.00	89,280,000
スズデン	4,500	1,234.00	5,553,000
尾家産業	4,200	1,128.00	4,737,600
シモジマ	8,000	1,010.00	8,080,000
ドウシシャ	12,200	1,707.00	20,825,400
小津産業	2,900	1,664.00	4,825,600
高速	7,700	1,142.00	8,793,400
たけびし	4,600	1,227.00	5,644,200
リックス	2,900	1,422.00	4,123,800
丸文	11,500	524.00	6,026,000
ハビネット	10,800	1,215.00	13,122,000
橋本総業ホールディングス	2,600	1,453.00	3,777,800
日本ライフライン	38,400	1,633.00	62,707,200
タカショー	6,300	445.00	2,803,500
エクセル	4,800	1,117.00	5,361,600
マルカ	4,600	1,806.00	8,307,600
I D O M	43,700	407.00	17,785,900
日本エム・ディ・エム	7,600	1,566.00	11,901,600
進和	7,700	2,167.00	16,685,900
エスケイジャパン	3,200	384.00	1,228,800
ダイトロン	5,700	1,161.00	6,617,700
シークス	16,500	1,297.00	21,400,500
田中商事	4,400	604.00	2,657,600

オーハシテクニカ	7,300	1,338.00	9,767,400
白銅	4,200	1,266.00	5,317,200
伊藤忠商事	906,600	2,083.00	1,888,447,800
丸紅	1,278,200	664.30	849,108,260
高島	2,100	1,523.00	3,198,300
長瀬産業	72,900	1,398.00	101,914,200
蝶理	8,300	1,582.00	13,130,600
豊田通商	144,700	3,230.00	467,381,000
三共生興	22,100	484.00	10,696,400
兼松	51,800	1,157.00	59,932,600
ツカモトコーポレーション	2,300	1,001.00	2,302,300
三井物産	1,067,900	1,627.00	1,737,473,300
日本紙パルプ商事	7,400	3,605.00	26,677,000
日立ハイテクノロジーズ	39,400	5,710.00	224,974,000
カメイ	16,900	981.00	16,578,900
東都水産	1,800	2,527.00	4,548,600
OUGホールディングス	2,100	2,667.00	5,600,700
スターゼン	4,800	3,885.00	18,648,000
山善	50,600	902.00	45,641,200
椿本興業	2,900	3,110.00	9,019,000
住友商事	766,600	1,560.00	1,195,896,000
内田洋行	5,500	3,195.00	17,572,500
三菱商事	909,500	2,541.50	2,311,494,250
第一実業	5,900	2,600.00	15,340,000
キャノンマーケティングジャパン	37,000	2,128.00	78,736,000
西華産業	7,400	1,232.00	9,116,800
佐藤商事	11,600	757.00	8,781,200
菱洋エレクトロ	13,200	1,744.00	23,020,800
東京産業	12,900	460.00	5,934,000
ユアサ商事	13,300	2,824.00	37,559,200
神鋼商事	2,900	2,148.00	6,229,200
小林産業	7,800	268.00	2,090,400
阪和興業	22,500	2,752.00	61,920,000
正栄食品工業	8,700	2,907.00	25,290,900
カナデン	11,700	1,191.00	13,934,700
菱電商事	10,300	1,555.00	16,016,500
フルサト工業	7,200	1,340.00	9,648,000
岩谷産業	28,800	3,470.00	99,936,000
すてきナイスグループ	5,600	598.00	3,348,800
昭光通商	4,400	593.00	2,609,200
ニチモウ	2,000	1,632.00	3,264,000
極東貿易	4,000	1,718.00	6,872,000

イワキ	17,000	475.00	8,075,000
三愛石油	34,800	929.00	32,329,200
稲畑産業	31,200	1,200.00	37,440,000
G S Iクレオス	3,500	988.00	3,458,000
明和産業	12,000	574.00	6,888,000
クワザワ	4,700	392.00	1,842,400
ワキタ	27,700	984.00	27,256,800
東邦ホールディングス	38,400	2,481.00	95,270,400
サンゲツ	38,500	1,946.00	74,921,000
ミツウロコグループホールディングス	17,200	901.00	15,497,200
シナネンホールディングス	5,300	1,710.00	9,063,000
伊藤忠エネクス	28,700	792.00	22,730,400
サンリオ	40,000	2,000.00	80,000,000
サンワテクノス	7,900	731.00	5,774,900
リョーサン	14,300	2,507.00	35,850,100
新光商事	12,200	1,860.00	22,692,000
トーホー	5,900	1,767.00	10,425,300
三信電気	8,900	1,472.00	13,100,800
東陽テクニカ	14,900	1,025.00	15,272,500
モスフードサービス	17,000	2,327.00	39,559,000
加賀電子	12,900	1,564.00	20,175,600
ソーダニッカ	13,400	508.00	6,807,200
立花エレテック	9,600	1,474.00	14,150,400
フォーバル	5,700	894.00	5,095,800
P A L T A C	23,400	4,970.00	116,298,000
三谷産業	15,200	273.00	4,149,600
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,800	3,415.00	9,562,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,211.00	1,332,100
国際紙パルプ商事	30,300	290.00	8,787,000
ヤマタネ	6,500	1,260.00	8,190,000
丸紅建材リース	1,300	1,603.00	2,083,900
日鉄物産	9,200	3,965.00	36,478,000
泉州電業	4,100	2,503.00	10,262,300
トラスコ中山	27,000	2,322.00	62,694,000
オートバックスセブン	51,500	1,780.00	91,670,000
モリト	9,500	756.00	7,182,000
加藤産業	20,300	3,010.00	61,103,000
北恵	2,500	874.00	2,185,000
イノテック	7,700	817.00	6,290,900
イエローハット	24,500	1,560.00	38,220,000
J Kホールディングス	11,800	454.00	5,357,200
日伝	10,800	1,862.00	20,109,600

北沢産業	9,800	245.00	2,401,000
杉本商事	7,000	1,780.00	12,460,000
因幡電機産業	18,400	4,630.00	85,192,000
東テク	4,300	1,941.00	8,346,300
ミスミグループ本社	162,300	2,328.00	377,834,400
アルテック	10,400	197.00	2,048,800
タキヒヨー	3,900	1,767.00	6,891,300
蔵王産業	2,100	1,344.00	2,822,400
スズケン	59,100	5,560.00	328,596,000
ジェコス	9,000	829.00	7,461,000
グローセル	11,900	396.00	4,712,400
ローソン	32,800	5,330.00	174,824,000
サンエー	9,800	4,400.00	43,120,000
カワチ薬品	10,100	1,987.00	20,068,700
エービーシー・マート	20,300	6,880.00	139,664,000
ハードオフコーポレーション	5,300	689.00	3,651,700
アスクル	13,600	2,752.00	37,427,200
ゲオホールディングス	19,900	1,314.00	26,148,600
アダストリア	18,000	2,070.00	37,260,000
ジーフット	8,100	643.00	5,208,300
くら寿司	7,300	4,140.00	30,222,000
キャンドウ	6,300	1,613.00	10,161,900
パルグループホールディングス	6,700	3,205.00	21,473,500
エディオン	55,100	998.00	54,989,800
サーラコーポレーション	26,600	577.00	15,348,200
ワッツ	5,900	670.00	3,953,000
ハローズ	4,900	2,099.00	10,285,100
フジオフードシステム	5,500	2,738.00	15,059,000
あみやき亭	2,800	3,335.00	9,338,000
ひらまつ	26,300	335.00	8,810,500
大黒天物産	3,200	3,140.00	10,048,000
ハニーズホールディングス	11,500	1,389.00	15,973,500
ファーマライズホールディングス	3,300	540.00	1,782,000
アルペン	10,000	1,527.00	15,270,000
ハブ	4,300	1,078.00	4,635,400
クオールホールディングス	19,200	1,374.00	26,380,800
ジinzホールディングス	6,900	5,880.00	40,572,000
ビックカメラ	77,000	1,057.00	81,389,000
D C Mホールディングス	70,000	1,062.00	74,340,000
ペッパーフードサービス	10,400	1,537.00	15,984,800
MonotaRO	92,200	2,510.00	231,422,000
東京一番フーズ	3,500	609.00	2,131,500

D Dホールディングス	2,900	2,979.00	8,639,100
きちりホールディングス	3,700	714.00	2,641,800
アークランドサービスホールディングス	9,500	1,889.00	17,945,500
J. フロント リテイリング	165,900	1,208.00	200,407,200
ドトール・日レスホールディングス	22,800	2,000.00	45,600,000
マツモトキヨシホールディングス	53,600	3,865.00	207,164,000
ブロンコピリー	6,800	2,197.00	14,939,600
Z O Z O	140,100	2,110.00	295,611,000
トレジャー・ファクトリー	3,900	1,173.00	4,574,700
物語コーポレーション	3,200	9,680.00	30,976,000
ココカラファイン	14,600	5,720.00	83,512,000
三越伊勢丹ホールディングス	242,800	793.00	192,540,400
H a m e e	4,100	714.00	2,927,400
ウエルシアホールディングス	34,300	5,520.00	189,336,000
クリエイトSDホールディングス	19,200	2,320.00	44,544,000
丸善CHIホールディングス	15,100	366.00	5,526,600
ティーライフ	1,900	848.00	1,611,200
エー・ピーカンパニー	2,700	502.00	1,355,400
チムニー	4,000	2,437.00	9,748,000
シュッピン	8,900	1,039.00	9,247,100
ネクステージ	20,800	1,142.00	23,753,600
ジョイフル本田	38,100	1,325.00	50,482,500
鳥貴族	4,300	2,112.00	9,081,600
キリン堂ホールディングス	5,200	1,752.00	9,110,400
ホットランド	7,700	1,353.00	10,418,100
すかいらーくホールディングス	145,300	1,806.00	262,411,800
S F Pホールディングス	5,600	2,258.00	12,644,800
綿半ホールディングス	4,900	2,244.00	10,995,600
ヨシックス	2,200	3,205.00	7,051,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,800	948.00	35,834,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	642.00	3,980,400
B E E N O S	4,600	1,261.00	5,800,600
あさひ	10,800	1,207.00	13,035,600
日本調剤	4,600	3,615.00	16,629,000
コスモス薬品	5,700	21,410.00	122,037,000
トーエル	6,500	665.00	4,322,500
オンリー	2,400	897.00	2,152,800
セブン&アイ・ホールディングス	543,300	3,751.00	2,037,918,300
薬王堂	5,700	2,425.00	13,822,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	34,900	1,624.00	56,677,600
ツルハホールディングス	28,200	11,420.00	322,044,000

サンマルクホールディングス	10,300	2,455.00	25,286,500
フェリシモ	3,000	1,004.00	3,012,000
トリドールホールディングス	16,100	2,405.00	38,720,500
T O K Y O B A S E	11,800	839.00	9,900,200
ウイルプラスホールディングス	2,200	808.00	1,777,600
ジャパンミート	6,600	1,996.00	13,173,600
サツドラホールディングス	2,000	1,704.00	3,408,000
デファクトスタンダード	1,600	305.00	488,000
アレンザホールディングス	7,200	746.00	5,371,200
串カツ田中ホールディングス	2,000	1,993.00	3,986,000
パロックジャパンリミテッド	10,600	986.00	10,451,600
クスリのアオキホールディングス	12,900	8,040.00	103,716,000
力の源ホールディングス	5,000	810.00	4,050,000
スシローグローバルホールディングス	14,200	6,690.00	94,998,000
L I X I L ビバ	11,100	1,362.00	15,118,200
メディカルシステムネットワーク	14,000	514.00	7,196,000
はるやまホールディングス	6,200	772.00	4,786,400
ノジマ	23,100	1,756.00	40,563,600
カップ・クリエイト	18,200	1,390.00	25,298,000
ライトオン	9,700	719.00	6,974,300
良品計画	18,400	17,970.00	330,648,000
三城ホールディングス	16,600	276.00	4,581,600
アドヴァン	19,900	1,130.00	22,487,000
アルビス	5,000	2,326.00	11,630,000
コナカ	15,600	399.00	6,224,400
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,575.00	2,677,500
G - 7ホールディングス	3,900	2,931.00	11,430,900
イオン北海道	13,200	719.00	9,490,800
コジマ	22,600	459.00	10,373,400
ヒマラヤ	4,700	808.00	3,797,600
コーナン商事	17,100	2,314.00	39,569,400
エコス	4,900	1,494.00	7,320,600
ワタミ	17,100	1,378.00	23,563,800
マルシェ	3,600	779.00	2,804,400
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	77,600	6,560.00	509,056,000
西松屋チェーン	28,600	911.00	26,054,600
ゼンショーホールディングス	63,100	2,386.00	150,556,600
幸楽苑ホールディングス	8,300	2,639.00	21,903,700
ハークスレイ	2,800	1,000.00	2,800,000
サイゼリヤ	21,400	2,532.00	54,184,800
V Tホールディングス	58,900	431.00	25,385,900
魚力	3,700	1,547.00	5,723,900

フジ・コーポレーション	3,500	2,035.00	7,122,500
ユナイテッドアローズ	14,900	3,065.00	45,668,500
ハイデイ日高	18,800	2,136.00	40,156,800
京都きもの友禅	8,700	320.00	2,784,000
コロワイド	43,100	2,028.00	87,406,800
ピーシーデポコーポレーション	17,500	470.00	8,225,000
壱番屋	9,200	5,070.00	46,644,000
P L A N T	3,500	685.00	2,397,500
スギホールディングス	28,500	5,530.00	157,605,000
スクロール	20,400	315.00	6,426,000
ヨンドシーホールディングス	14,400	2,448.00	35,251,200
ユニー・ファミリーマートホールディングス	145,000	2,480.00	359,600,000
木曽路	15,900	2,624.00	41,721,600
S R Sホールディングス	15,400	1,024.00	15,769,600
タカキュー	10,800	173.00	1,868,400
ケーヨー	24,300	475.00	11,542,500
上新電機	15,400	1,927.00	29,675,800
日本瓦斯	20,500	3,065.00	62,832,500
ロイヤルホールディングス	22,700	2,561.00	58,134,700
いなげや	14,600	1,464.00	21,374,400
島忠	27,500	2,460.00	67,650,000
チヨダ	13,700	1,525.00	20,892,500
ライフコーポレーション	9,900	2,082.00	20,611,800
リンガーハット	16,000	2,528.00	40,448,000
M r M a x H D	18,100	425.00	7,692,500
テンアライド	11,900	427.00	5,081,300
A O K Iホールディングス	26,100	1,003.00	26,178,300
オークワ	18,600	1,115.00	20,739,000
コメリ	20,100	2,158.00	43,375,800
青山商事	22,700	1,842.00	41,813,400
しまむら	15,100	8,260.00	124,726,000
はせがわ	7,200	397.00	2,858,400
高島屋	101,800	1,215.00	123,687,000
松屋	26,300	751.00	19,751,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	66,700	1,091.00	72,769,700
近鉄百貨店	5,000	3,075.00	15,375,000
パルコ	12,600	1,213.00	15,283,800
丸井グループ	109,700	2,109.00	231,357,300
アクシアル リテイリング	10,800	3,775.00	40,770,000
イオン	498,800	1,842.00	918,789,600
イズミ	26,400	4,005.00	105,732,000
平和堂	26,400	1,955.00	51,612,000

フジ	15,700	1,809.00	28,401,300
ヤオコー	14,700	4,720.00	69,384,000
ゼビオホールディングス	15,800	1,112.00	17,569,600
ケーズホールディングス	134,800	1,120.00	150,976,000
Olympicグループ	7,900	595.00	4,700,500
日産東京販売ホールディングス	19,600	274.00	5,370,400
Genky DrugStores	6,400	2,058.00	13,171,200
総合メディカルホールディングス	11,400	1,443.00	16,450,200
ブックオフグループホールディングス	6,700	1,156.00	7,745,200
アインホールディングス	17,400	5,540.00	96,396,000
元気寿司	3,700	2,777.00	10,274,900
ヤマダ電機	395,200	488.00	192,857,600
アークランドサカモト	22,100	1,174.00	25,945,400
ニトリホールディングス	56,100	15,675.00	879,367,500
グルメ杵屋	9,400	1,158.00	10,885,200
愛眼	10,300	240.00	2,472,000
ケーユーホールディングス	6,900	775.00	5,347,500
吉野家ホールディングス	45,300	2,250.00	101,925,000
松屋フーズホールディングス	6,300	3,770.00	23,751,000
サガミホールディングス	17,400	1,348.00	23,455,200
関西スーパーマーケット	9,900	1,088.00	10,771,200
王将フードサービス	9,500	7,210.00	68,495,000
プレナス	14,600	1,730.00	25,258,000
ミニストップ	9,700	1,433.00	13,900,100
アークス	24,400	2,190.00	53,436,000
パローホールディングス	28,100	1,760.00	49,456,000
ベルク	6,400	5,040.00	32,256,000
大庄	7,000	1,600.00	11,200,000
ファーストリテイリング	17,300	62,450.00	1,080,385,000
サンドラッグ	48,800	3,280.00	160,064,000
サックスパーホールディングス	11,100	878.00	9,745,800
ヤマザワ	2,800	1,626.00	4,552,800
やまや	2,300	2,231.00	5,131,300
ベルーナ	32,000	599.00	19,168,000
島根銀行	4,000	614.00	2,456,000
じもとホールディングス	87,700	90.00	7,893,000
めぶきフィナンシャルグループ	677,800	233.00	157,927,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,200	1,223.00	22,258,600
九州フィナンシャルグループ	215,000	402.00	86,430,000
ゆうちょ銀行	368,500	955.00	351,917,500
富山第一銀行	33,900	268.00	9,085,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	816,500	354.00	289,041,000

西日本フィナンシャルホールディングス	82,900	650.00	53,885,000
関西みらいフィナンシャルグループ	62,100	666.00	41,358,600
三十三フィナンシャルグループ	11,800	1,461.00	17,239,800
第四北越フィナンシャルグループ	22,900	2,429.00	55,624,100
新生銀行	95,300	1,434.00	136,660,200
あおぞら銀行	72,500	2,455.00	177,987,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,935,000	498.40	4,453,204,000
りそなホールディングス	1,424,400	403.40	574,602,960
三井住友トラスト・ホールディングス	255,200	3,403.00	868,445,600
三井住友フィナンシャルグループ	914,800	3,427.00	3,135,019,600
千葉銀行	448,000	517.00	231,616,000
群馬銀行	262,000	337.00	88,294,000
武蔵野銀行	19,800	1,715.00	33,957,000
千葉興業銀行	38,500	278.00	10,703,000
筑波銀行	54,000	153.00	8,262,000
七十七銀行	41,300	1,336.00	55,176,800
青森銀行	10,400	2,493.00	25,927,200
秋田銀行	8,700	1,902.00	16,547,400
山形銀行	15,200	1,416.00	21,523,200
岩手銀行	9,400	2,414.00	22,691,600
東邦銀行	116,100	232.00	26,935,200
東北銀行	6,600	934.00	6,164,400
みちのく銀行	8,300	1,538.00	12,765,400
ふくおかフィナンシャルグループ	114,800	1,782.00	204,573,600
静岡銀行	322,500	700.00	225,750,000
十六銀行	17,800	2,096.00	37,308,800
八十二銀行	315,300	375.00	118,237,500
山梨中央銀行	16,500	940.00	15,510,000
大垣共立銀行	27,700	2,152.00	59,610,400
福井銀行	11,700	1,259.00	14,730,300
北國銀行	13,700	2,367.00	32,427,900
清水銀行	5,800	1,740.00	10,092,000
富山銀行	2,800	2,410.00	6,748,000
滋賀銀行	26,400	2,281.00	60,218,400
南都銀行	20,600	2,170.00	44,702,000
百五銀行	119,300	314.00	37,460,200
京都銀行	46,700	3,690.00	172,323,000
紀陽銀行	46,500	1,405.00	65,332,500
ほくほくフィナンシャルグループ	87,200	951.00	82,927,200
広島銀行	193,300	469.00	90,657,700
山陰合同銀行	78,300	593.00	46,431,900
中国銀行	112,600	856.00	96,385,600

鳥取銀行	5,000	1,326.00	6,630,000
伊予銀行	173,600	495.00	85,932,000
百十四銀行	14,200	1,935.00	27,477,000
四国銀行	19,300	884.00	17,061,200
阿波銀行	20,200	2,231.00	45,066,200
大分銀行	8,200	2,995.00	24,559,000
宮崎銀行	9,000	2,227.00	20,043,000
佐賀銀行	8,500	1,349.00	11,466,500
沖縄銀行	12,200	2,999.00	36,587,800
琉球銀行	30,700	1,020.00	31,314,000
セブン銀行	441,400	270.00	119,178,000
みずほフィナンシャルグループ	17,637,400	152.80	2,694,994,720
高知銀行	4,700	722.00	3,393,400
山口フィナンシャルグループ	163,200	657.00	107,222,400
長野銀行	4,800	1,560.00	7,488,000
名古屋銀行	10,800	3,080.00	33,264,000
北洋銀行	199,600	204.00	40,718,400
愛知銀行	4,900	3,335.00	16,341,500
中京銀行	5,700	2,127.00	12,123,900
大光銀行	4,900	1,688.00	8,271,200
愛媛銀行	18,800	1,085.00	20,398,000
トマト銀行	5,800	996.00	5,776,800
京葉銀行	56,700	594.00	33,679,800
栃木銀行	72,100	161.00	11,608,100
北日本銀行	4,500	1,658.00	7,461,000
東和銀行	22,800	687.00	15,663,600
福島銀行	11,300	192.00	2,169,600
大東銀行	6,200	535.00	3,317,000
トモニホールディングス	102,900	314.00	32,310,600
フィデアホールディングス	126,000	110.00	13,860,000
池田泉州ホールディングス	142,400	173.00	24,635,200
F P G	40,900	1,012.00	41,390,800
マーキュリアインベストメント	6,000	693.00	4,158,000
S B Iホールディングス	154,700	2,109.00	326,262,300
ジャフコ	21,300	3,575.00	76,147,500
大和証券グループ本社	1,041,900	445.40	464,062,260
野村ホールディングス	2,284,300	416.10	950,497,230
岡三証券グループ	111,100	348.00	38,662,800
丸三証券	38,900	484.00	18,827,600
東洋証券	47,700	127.00	6,057,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	155,400	274.00	42,579,600
光世証券	3,400	555.00	1,887,000

水戸証券	38,400	188.00	7,219,200
いちよし証券	26,400	615.00	16,236,000
松井証券	63,700	884.00	56,310,800
だいこう証券ビジネス	5,600	524.00	2,934,400
マネックスグループ	120,300	291.00	35,007,300
極東証券	17,600	799.00	14,062,400
岩井コスモホールディングス	13,400	1,055.00	14,137,000
藍澤証券	23,600	648.00	15,292,800
マネーパートナーズグループ	15,800	257.00	4,060,600
スパークス・グループ	52,100	232.00	12,087,200
かんぽ生命保険	46,000	1,491.00	68,586,000
S O M P Oホールディングス	228,800	4,188.00	958,214,400
アニコム ホールディングス	10,700	4,185.00	44,779,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	339,400	3,330.00	1,130,202,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	106,700	2,396.00	255,653,200
第一生命ホールディングス	734,400	1,421.00	1,043,582,400
東京海上ホールディングス	464,100	5,418.00	2,514,493,800
T & Dホールディングス	401,400	1,011.50	406,016,100
アドバンスクリエイト	3,000	1,777.00	5,331,000
全国保証	36,600	3,965.00	145,119,000
ジェイリース	3,600	321.00	1,155,600
イントラスト	3,600	699.00	2,516,400
日本モーゲージサービス	2,300	1,039.00	2,389,700
C a s a	5,800	1,167.00	6,768,600
アルヒ	11,800	2,011.00	23,729,800
プレミアグループ	7,400	1,784.00	13,201,600
クレディセゾン	90,900	1,151.00	104,625,900
芙蓉総合リース	14,900	5,830.00	86,867,000
興銀リース	24,400	2,575.00	62,830,000
東京センチュリー	26,100	4,090.00	106,749,000
日本証券金融	57,200	481.00	27,513,200
アイフル	198,000	212.00	41,976,000
リコーリース	10,200	3,165.00	32,283,000
イオンフィナンシャルサービス	82,900	1,503.00	124,598,700
アコム	260,900	366.00	95,489,400
ジャックス	14,300	2,112.00	30,201,600
オリエントコーポレーション	351,100	126.00	44,238,600
日立キャピタル	30,600	2,051.00	62,760,600
アプラスフィナンシャル	62,300	68.00	4,236,400
オリックス	866,000	1,528.50	1,323,681,000
三菱UFJリース	292,800	565.00	165,432,000
九州リースサービス	6,400	581.00	3,718,400

日本取引所グループ	350,600	1,641.00	575,334,600
イー・ギャランティ	12,200	1,267.00	15,457,400
アサックス	5,400	584.00	3,153,600
NECキャピタルソリューション	5,300	2,033.00	10,774,900
いちご	167,600	414.00	69,386,400
日本駐車場開発	148,500	168.00	24,948,000
スター・マイカ・ホールディングス	7,300	1,781.00	13,001,300
ヒューリック	271,900	1,035.00	281,416,500
三栄建築設計	5,900	1,407.00	8,301,300
野村不動産ホールディングス	86,900	2,236.00	194,308,400
三重交通グループホールディングス	28,200	530.00	14,946,000
サムティ	18,900	1,840.00	34,776,000
ディア・ライフ	18,600	521.00	9,690,600
コーセーアールイー	5,300	654.00	3,466,200
エー・ディー・ワークス	399,800	33.00	13,193,400
日本商業開発	8,800	1,451.00	12,768,800
プレサンスコーポレーション	21,200	1,558.00	33,029,600
ユニゾホールディングス	18,800	4,220.00	79,336,000
日本管理センター	9,300	1,298.00	12,071,400
サンセイランディック	5,100	761.00	3,881,100
エストラスト	1,800	635.00	1,143,000
フージャースホールディングス	28,200	607.00	17,117,400
オープンハウス	19,000	4,875.00	92,625,000
東急不動産ホールディングス	350,700	657.00	230,409,900
飯田グループホールディングス	108,900	1,630.00	177,507,000
イーランド	3,300	659.00	2,174,700
ムゲンエステート	10,700	590.00	6,313,000
ハウスドゥ	7,100	1,504.00	10,678,400
シーアールイー	4,100	1,140.00	4,674,000
ケイアイスター不動産	4,000	1,778.00	7,112,000
グッドコムアセット	3,600	1,631.00	5,871,600
ジェイ・エス・ビー	1,600	4,360.00	6,976,000
テンポイノベーション	2,000	1,738.00	3,476,000
パーク24	70,100	2,391.00	167,609,100
パラカ	3,800	2,029.00	7,710,200
三井不動産	689,000	2,528.00	1,741,792,000
三菱地所	909,800	2,048.00	1,863,270,400
平和不動産	24,200	2,518.00	60,935,600
東京建物	142,600	1,380.00	196,788,000
ダイビル	39,200	1,018.00	39,905,600
京阪神ビルディング	23,500	1,236.00	29,046,000
住友不動産	292,000	4,044.00	1,180,848,000

テーオーシー	31,000	789.00	24,459,000
東京楽天地	2,000	5,280.00	10,560,000
スターツコーポレーション	18,100	2,369.00	42,878,900
フジ住宅	18,100	663.00	12,000,300
空港施設	17,200	507.00	8,720,400
明和地所	9,000	522.00	4,698,000
ゴールドクレスト	10,700	1,991.00	21,303,700
日本エスリード	5,700	1,567.00	8,931,900
日神不動産	21,500	436.00	9,374,000
日本エスコン	24,800	754.00	18,699,200
タカラレーベン	62,000	385.00	23,870,000
サンヨーハウジング名古屋	8,400	960.00	8,064,000
イオンモール	65,700	1,720.00	113,004,000
毎日コムネット	4,200	718.00	3,015,600
ファースト住建	6,400	1,187.00	7,596,800
カチタス	14,700	4,000.00	58,800,000
トーセイ	18,700	1,210.00	22,627,000
穴吹興産	1,800	2,724.00	4,903,200
サンフロンティア不動産	18,700	1,236.00	23,113,200
エフ・ジェー・ネクスト	12,300	1,011.00	12,435,300
インテリックス	5,100	718.00	3,661,800
ランドビジネス	5,500	771.00	4,240,500
日本社宅サービス	4,300	955.00	4,106,500
グランディハウス	13,700	420.00	5,754,000
日本空港ビルデング	41,700	4,095.00	170,761,500
日本工営	8,500	2,550.00	21,675,000
L I F U L L	44,100	641.00	28,268,100
ジェイエシーリクルートメント	9,800	1,965.00	19,257,000
日本M&Aセンター	93,800	2,975.00	279,055,000
メンバーズ	4,300	1,825.00	7,847,500
中広	1,600	574.00	918,400
アイティメディア	2,700	718.00	1,938,600
タケエイ	13,200	908.00	11,985,600
E・Jホールディングス	1,700	1,170.00	1,989,000
トラスト・テック	14,000	1,216.00	17,024,000
コシダカホールディングス	30,400	1,726.00	52,470,400
アルトナー	3,300	671.00	2,214,300
パソナグループ	15,400	1,402.00	21,590,800
C D S	3,200	1,259.00	4,028,800
リンクアンドモチベーション	28,100	493.00	13,853,300
G C A	15,100	697.00	10,524,700
エス・エム・エス	46,300	2,391.00	110,703,300

サニーサイドアップ	2,900	934.00	2,708,600
パーソルホールディングス	125,800	2,177.00	273,866,600
リニカル	7,200	1,028.00	7,401,600
クックパッド	44,400	285.00	12,654,000
エスクリ	3,600	820.00	2,952,000
アイ・ケイ・ケイ	6,300	702.00	4,422,600
学情	5,000	1,100.00	5,500,000
スタジオアリス	6,400	2,081.00	13,318,400
シミックホールディングス	7,000	1,683.00	11,781,000
N J S	2,900	1,550.00	4,495,000
総合警備保障	50,100	5,350.00	268,035,000
カカクコム	94,200	2,626.00	247,369,200
アイロムグループ	4,800	1,601.00	7,684,800
セントケア・ホールディング	9,500	493.00	4,683,500
サイネックス	2,400	609.00	1,461,600
ルネサンス	7,100	1,548.00	10,990,800
ディップ	20,300	2,436.00	49,450,800
オプトホールディング	7,500	1,506.00	11,295,000
ツクイ	30,000	432.00	12,960,000
キャリアデザインセンター	3,300	1,312.00	4,329,600
ベネフィット・ワン	34,900	1,678.00	58,562,200
エムスリー	264,800	2,306.00	610,628,800
ツカダ・グローバルホールディング	8,300	573.00	4,755,900
プラス	1,700	586.00	996,200
アウトソーシング	72,000	923.00	66,456,000
ウェルネット	12,100	714.00	8,639,400
ワールドホールディングス	4,300	1,520.00	6,536,000
ディー・エヌ・エー	67,900	2,237.00	151,892,300
博報堂D Yホールディングス	174,900	1,560.00	272,844,000
ぐるなび	18,100	677.00	12,253,700
タカミヤ	13,200	717.00	9,464,400
ジャパンベストレスキューシステム	8,500	1,148.00	9,758,000
ファンコミュニケーションズ	34,900	536.00	18,706,400
ライク	5,000	1,816.00	9,080,000
ビジネス・ブレークスルー	5,700	365.00	2,080,500
WDBホールディングス	5,800	2,306.00	13,374,800
ティア	7,600	622.00	4,727,200
C D G	1,300	1,375.00	1,787,500
バリューコマース	8,200	1,705.00	13,981,000
インフォマート	69,000	1,573.00	108,537,000
J Pホールディングス	36,500	265.00	9,672,500
エコナックホールディングス	24,000	121.00	2,904,000

E P Sホールディングス	19,000	1,271.00	24,149,000
レグス	3,200	1,565.00	5,008,000
プレステージ・インターナショナル	23,600	1,831.00	43,211,600
アミューズ	7,700	2,503.00	19,273,100
ドリームインキュベータ	3,900	1,216.00	4,742,400
クイック	7,900	1,328.00	10,491,200
T A C	7,600	190.00	1,444,000
ケネディクス	120,000	518.00	62,160,000
電通	129,700	3,595.00	466,271,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,900	1,158.00	5,674,200
ぴあ	3,600	4,165.00	14,994,000
イオンファンタジー	4,100	2,943.00	12,066,300
シーティーエス	14,400	675.00	9,720,000
ネクシィーズグループ	4,500	1,732.00	7,794,000
みらかホールディングス	35,200	2,316.00	81,523,200
アルプス技研	11,700	1,402.00	16,403,400
ダイオーズ	3,000	1,412.00	4,236,000
日本空調サービス	14,500	693.00	10,048,500
オリエンタルランド	148,600	15,295.00	2,272,837,000
ダスキン	32,400	2,720.00	88,128,000
明光ネットワークジャパン	14,900	916.00	13,648,400
ファルコホールディングス	7,000	1,596.00	11,172,000
ラウンドワン	39,100	1,720.00	67,252,000
リゾートトラスト	53,300	1,658.00	88,371,400
ビー・エム・エル	16,200	2,992.00	48,470,400
ワタベウェディング	2,300	574.00	1,320,200
りらいあコミュニケーションズ	22,800	1,300.00	29,640,000
リソー教育	64,200	453.00	29,082,600
早稲田アカデミー	3,800	795.00	3,021,000
ユー・エス・エス	153,700	2,013.00	309,398,100
東京個別指導学院	4,600	852.00	3,919,200
サイバーエージェント	72,400	4,680.00	338,832,000
楽天	586,300	932.00	546,431,600
クリーク・アンド・リバー社	7,500	1,132.00	8,490,000
テー・オー・ダブリュー	11,200	730.00	8,176,000
山田コンサルティンググループ	6,200	1,596.00	9,895,200
セントラルスポーツ	4,700	2,991.00	14,057,700
フルキャストホールディングス	12,700	1,970.00	25,019,000
エン・ジャパン	18,300	3,855.00	70,546,500
リソルホールディングス	1,400	3,960.00	5,544,000
テクノプロ・ホールディングス	25,200	5,960.00	150,192,000
アトラ	3,600	220.00	792,000

インターワークス	2,700	541.00	1,460,700
アイ・アールジャパンホールディングス	5,100	4,295.00	21,904,500
K e e P e r 技研	4,700	1,353.00	6,359,100
ファーストロジック	3,200	628.00	2,009,600
三機サービス	2,800	847.00	2,371,600
G u n o s y	8,900	1,378.00	12,264,200
デザインワン・ジャパン	3,000	278.00	834,000
イー・ガーディアン	6,500	1,744.00	11,336,000
リブセンス	8,700	251.00	2,183,700
ジャパンマテリアル	34,500	1,096.00	37,812,000
ベクトル	15,900	865.00	13,753,500
ウチヤマホールディングス	6,500	471.00	3,061,500
チャーム・ケア・コーポレーション	4,100	2,296.00	9,413,600
ライクキッズネクスト	3,200	907.00	2,902,400
キャリアリンク	4,900	563.00	2,758,700
I B J	8,600	1,186.00	10,199,600
アサンテ	5,100	1,964.00	10,016,400
N・フィールド	8,900	610.00	5,429,000
バリューHR	2,700	2,952.00	7,970,400
M&Aキャピタルパートナーズ	4,500	6,100.00	27,450,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,300	1,534.00	8,130,200
E R Iホールディングス	3,700	747.00	2,763,900
アビスト	2,000	2,442.00	4,884,000
シグマクシス	6,100	1,246.00	7,600,600
ウィルグループ	8,400	790.00	6,636,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,000	212.00	3,816,000
日本ビューホテル	4,100	1,647.00	6,752,700
リクルートホールディングス	900,900	3,313.00	2,984,681,700
エラン	8,400	1,693.00	14,221,200
土木管理総合試験所	5,800	417.00	2,418,600
ネットマーケティング	4,700	739.00	3,473,300
日本郵政	1,030,900	958.00	987,602,200
ベルシステム24ホールディングス	21,200	1,564.00	33,156,800
鎌倉新書	9,400	1,666.00	15,660,400
ソネット・メディア・ネットワークス	1,800	606.00	1,090,800
一蔵	1,600	575.00	920,000
L I T A L I C O	3,000	1,789.00	5,367,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	815.00	1,711,500
エボラブルアジア	5,700	1,892.00	10,784,400
アトラエ	3,300	2,403.00	7,929,900
ストライク	4,800	2,559.00	12,283,200
ソラスト	30,900	1,272.00	39,304,800

セラク	4,200	686.00	2,881,200
インソース	4,900	2,876.00	14,092,400
ベikalレント・コンサルティング	8,900	4,850.00	43,165,000
Orchestra Holdings	2,600	1,022.00	2,657,200
アイモバイル	4,200	724.00	3,040,800
キャリアインデックス	4,600	472.00	2,171,200
MS - Japan	5,200	1,322.00	6,874,400
船場	2,200	893.00	1,964,600
グレイステクノロジー	4,600	2,839.00	13,059,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,000	2,653.00	26,530,000
フルテック	1,900	1,191.00	2,262,900
グリーンズ	4,900	1,308.00	6,409,200
ツナググループ・ホールディングス	1,800	530.00	954,000
ソウルドアウト	2,000	1,461.00	2,922,000
MS & Consulting	2,200	957.00	2,105,400
日総工産	8,500	1,032.00	8,772,000
キュービーネットホールディングス	7,700	2,257.00	17,378,900
RPAホールディングス	5,400	1,568.00	8,467,200
スプリックス	4,300	1,584.00	6,811,200
アドバンテッジリスクマネジメント	5,100	797.00	4,064,700
リログループ	68,800	2,696.00	185,484,800
東祥	7,900	2,760.00	21,804,000
エイチ・アイ・エス	19,700	2,586.00	50,944,200
ラックランド	2,600	2,207.00	5,738,200
共立メンテナンス	19,300	4,210.00	81,253,000
イチネンホールディングス	13,200	1,004.00	13,252,800
建設技術研究所	8,800	1,582.00	13,921,600
スペース	8,300	1,134.00	9,412,200
長大	4,800	833.00	3,998,400
燦ホールディングス	2,800	2,077.00	5,815,600
スバル興業	900	5,990.00	5,391,000
東京テアトル	5,000	1,328.00	6,640,000
タナベ経営	2,500	1,260.00	3,150,000
ナガワ	3,500	4,980.00	17,430,000
よみうりランド	2,800	4,475.00	12,530,000
東京都競馬	8,300	3,105.00	25,771,500
カナモト	20,600	2,639.00	54,363,400
東京ドーム	47,100	1,057.00	49,784,700
西尾レントオール	12,800	2,748.00	35,174,400
トランス・コスモス	14,000	2,502.00	35,028,000
乃村工芸社	58,900	1,312.00	77,276,800
藤田観光	5,500	2,691.00	14,800,500

KNT-CTホールディングス	6,700	1,496.00	10,023,200	
日本管財	13,500	1,862.00	25,137,000	
トーカイ	12,200	2,189.00	26,705,800	
白洋舎	1,500	2,791.00	4,186,500	
セコム	133,500	9,090.00	1,213,515,000	
セントラル警備保障	6,100	5,030.00	30,683,000	
丹青社	23,900	1,254.00	29,970,600	
メイテック	15,600	5,500.00	85,800,000	
応用地質	13,700	1,041.00	14,261,700	
船井総研ホールディングス	26,100	2,126.00	55,488,600	
進学会ホールディングス	6,000	484.00	2,904,000	
オオバ	10,100	595.00	6,009,500	
いであ	2,500	1,071.00	2,677,500	
学究社	4,200	1,206.00	5,065,200	
ベネッセホールディングス	46,100	2,679.00	123,501,900	
イオンディライト	15,500	3,245.00	50,297,500	
ナック	8,100	894.00	7,241,400	
ニチイ学館	18,000	1,651.00	29,718,000	
ダイセキ	21,100	2,535.00	53,488,500	
ステップ	4,700	1,403.00	6,594,100	
合 計	153,883,000		280,845,503,060	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	671,243,361

	2019年 8月28日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	3,829,534,274
国債証券	378,086,762,179
派生商品評価勘定	29,047,451
未収入金	537,873
未収利息	2,208,940,431
前払費用	270,066,627
差入委託証拠金	297,924,343
流動資産合計	385,394,056,539
資産合計	385,394,056,539
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,638,549
前受金	19,083,136
未払解約金	51,076,870
未払利息	6,009
その他未払費用	9
流動負債合計	84,804,573
負債合計	84,804,573
純資産の部	
元本等	
元本	138,356,719,879
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	246,952,532,087
元本等合計	385,309,251,966
純資産合計	385,309,251,966
負債純資産合計	385,394,056,539

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28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>

2019年 8月28日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	138,356,719,879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 2.7849円 (1万口当たり純資産額) (27,849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 8月28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。

	2019年 8月28日現在
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 8月28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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月29日
期首元本額	94,007,194,057円
期中追加設定元本額	60,449,495,039円
期中一部解約元本額	16,099,969,217円
期末元本額	138,356,719,879円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,766,941,433円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	715,909,037円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	476,264,879円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,019,973,396円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,866,810円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,157,863,753円
世界経済インデックスファンド	6,665,674,005円
D C マイセレクション 2 5	1,691,216,486円
D C マイセレクション 5 0	1,281,799,537円
D C マイセレクション 7 5	817,096,699円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,886,282,574円
D C マイセレクション S 2 5	676,142,399円
D C マイセレクション S 5 0	519,942,498円
D C マイセレクション S 7 5	233,324,309円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	47,554,178円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	65,461,662円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	31,009,382円
D C 世界経済インデックスファンド	5,780,880,309円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	621,793,619円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	41,988,424円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,776,276円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,021,753円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	49,501,498円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	99,170,676円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	174,527,660円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	158,276,498円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	414,340,126円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,137,079,885円

区分	2019年 8月28日現在
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	607,027,029円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,157,939,969円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	877,265,148円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	86,401,545円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	614,248,246円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	35,527,524円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	236,200,270円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	295,637,098円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	971,537,122円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	2,059,292,629円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	838,905,195円
外国債券ファンド・シリーズ1	471,091,136円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,378,191,685円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,652,743,627円
分散投資コア戦略ファンドA	1,516,843,116円
分散投資コア戦略ファンドS	3,655,248,169円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	263,469,099円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,664,212,467円
コア投資戦略ファンド(切替型)	633,079,220円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	234,323,157円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	112,633,350円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,073,467,374円
SMT インデックスバランス・オープン	233,973,477円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	24,450,532,929円
SMT 世界経済インデックス・オープン	69,058,663円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	93,691,353円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	128,777,190円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,322,949円
グローバル経済コア	983,679,741円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	5,870,524円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	74,904円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	205,163,075円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	20,311,164円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	16,800円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	22,219円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	27,638円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	32,515円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	840,387,805円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	11,569,638,857円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	351,157,322円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	40,425,016,818円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		18,162,045,599
合計		18,162,045,599

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2019年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	3,344,992,114	-		3,364,075,250	19,083,136
	合計	3,344,992,114	-		3,364,075,250	19,083,136

(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28日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	4,219,098,634	-		4,214,424,400	4,674,234
	アメリカドル	2,133,770,750	-		2,136,490,300	2,719,550
	カナダドル	170,288,780	-		170,001,600	287,180
	ユーロ	1,643,827,441	-		1,632,735,300	11,092,141
	イギリスポンド	271,211,663	-		275,197,200	3,985,537
	合計	4,219,098,634	-		4,214,424,400	4,674,234

(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	6,500,000.00	6,453,027.36	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,722,671.92	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,960,156.25	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,777,468.76	
		T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,480,449.21	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,521,384.77	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,944,921.90	
		T 1.375% 01/31/21	11,000,000.00	10,959,394.49	
		T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,466,601.61	
		T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,674,132.85	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,993,359.40	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,497,070.32	
		T 1.375% 09/30/20	15,970,000.00	15,909,800.60	
		T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,990,000.00	
		T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,977,031.28	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,504,394.52	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,822,851.58	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,012,343.76	
		T 1.5% 08/15/20	10,000,000.00	9,976,367.20	
		T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	13,258,781.31	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,196,503.88	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,526,386.71	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,371,436.76	
		T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	5,038,867.20	
		T 1.625% 07/31/20	24,000,000.00	23,966,718.72	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,514,160.15	

T 1.625% 08/31/22	15,000,000.00	15,083,203.20	
T 1.625% 10/15/20	7,500,000.00	7,493,261.70	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	9,078,398.46	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,226,886.77	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,047,736.32	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,633,462.90	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,517,871.10	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,623,863.32	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,289,687.47	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,830,578.14	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,713,964.80	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,627,966.77	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,062,617.17	
T 1.75% 07/15/22	13,320,000.00	13,434,989.02	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	10,247,535.20	
T 1.75% 10/31/20	9,200,000.00	9,204,492.17	
T 1.75% 11/30/21	15,050,000.00	15,136,419.95	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,208,808.60	
T 1.875% 01/31/22	12,000,000.00	12,113,906.28	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,525,000.00	
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,558,437.50	
T 1.875% 04/30/22	10,450,000.00	10,565,113.33	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,111,445.29	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,051,718.76	
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,853,154.33	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,446,195.32	
T 1.875% 12/15/20	10,000,000.00	10,026,953.10	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,020,625.00	
T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	9,385,441.42	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,636,164.04	
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	12,467,343.72	
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,579,541.02	
T 2.125% 06/30/22	2,100,000.00	2,140,851.57	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,964,812.51	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,169,458.99	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,524,628.89	
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,428,347.68	
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,283,125.04	
T 2.125% 11/30/23	12,680,000.00	13,054,456.25	
T 2.125% 12/31/21	18,500,000.00	18,775,331.98	
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,441,985.95	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,144,218.76	

T 2.25% 02/15/21	13,280,000.00	13,398,793.71
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,465,324.26
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,080,440.43
T 2.25% 04/15/22	10,000,000.00	10,204,687.50
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,537,802.73
T 2.25% 04/30/24	15,000,000.00	15,575,976.60
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,040,546.89
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,065,003.94
T 2.25% 08/15/46	19,200,000.00	20,403,000.00
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,566,027.32
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,580,582.08
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,615,531.27
T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	15,553,035.22
T 2.25% 12/31/23	11,500,000.00	11,905,644.56
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,765,859.39
T 2.375% 01/31/23	15,000,000.00	15,475,195.35
T 2.375% 04/15/21	11,500,000.00	11,642,402.31
T 2.375% 04/30/26	14,600,000.00	15,472,578.19
T 2.375% 05/15/27	18,750,000.00	20,028,808.68
T 2.375% 05/15/29	13,040,000.00	14,092,368.80
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,082,519.50
T 2.375% 12/31/20	11,000,000.00	11,103,339.83
T 2.5% 01/15/22	15,000,000.00	15,356,250.00
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,593,343.75
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,285,742.20
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	7,993,781.25
T 2.5% 02/15/45	7,300,000.00	8,126,382.84
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	18,394,921.87
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,203,615.24
T 2.5% 05/15/24	2,900,000.00	3,045,566.39
T 2.5% 05/15/46	16,000,000.00	17,846,250.08
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,741,775.40
T 2.5% 12/31/20	10,000,000.00	10,110,351.60
T 2.625% 01/31/26	18,000,000.00	19,316,250.00
T 2.625% 02/15/29	15,000,000.00	16,517,578.20
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,457,367.18
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,721,816.44
T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,765,356.62
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,480,453.15
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,416,345.71
T 2.625% 07/31/20	12,700,000.00	12,797,978.46
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,545,869.12
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,123,320.34

T 2.625% 12/31/23	11,500,000.00	12,086,679.74
T 2.625% 12/31/25	16,700,000.00	17,908,140.62
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,174,609.39
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	11,467,625.00
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,960,109.35
T 2.75% 05/31/23	20,000,000.00	20,970,312.60
T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	11,282,167.99
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,303,750.00
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,256,308.58
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,478,359.39
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	11,661,710.93
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,426,933.61
T 2.75% 09/30/20	11,100,000.00	11,222,056.59
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,277,613.26
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,869,046.89
T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	10,617,488.32
T 2.875% 04/30/25	10,000,000.00	10,794,921.90
T 2.875% 05/15/28	14,260,000.00	15,902,128.12
T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	13,622,109.37
T 2.875% 05/31/25	9,800,000.00	10,588,210.96
T 2.875% 07/31/25	9,460,000.00	10,240,080.49
T 2.875% 08/15/28	15,920,000.00	17,794,331.32
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	12,988,882.86
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,025,351.56
T 2.875% 10/15/21	12,250,000.00	12,598,837.86
T 2.875% 10/31/20	13,000,000.00	13,174,687.50
T 2.875% 10/31/23	11,000,000.00	11,648,828.18
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,598,869.16
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,533,496.10
T 2% 02/15/23	12,000,000.00	12,236,718.72
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,662,500.00
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,023,593.76
T 2% 04/30/24	10,000,000.00	10,270,312.50
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,828,722.64
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,224,375.04
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,794,902.37
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,210,460.94
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,049,218.75
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,707,437.50
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,864,015.60
T 2% 09/30/20	5,000,000.00	5,014,453.15
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,708,927.74

T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,427,187.51
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,616,823.48
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,521,806.62
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,036,250.00
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,225,867.18
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,889,765.62
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	6,158,203.15
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,438,193.36
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	5,915,023.46
T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	14,858,437.56
T 3.125% 11/15/28	14,400,000.00	16,441,875.07
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,992,167.98
T 3.375% 05/15/44	6,610,000.00	8,506,243.75
T 3.375% 11/15/48	8,300,000.00	10,949,515.62
T 3.5% 02/15/39	3,930,000.00	5,061,103.12
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,420,425.80
T 3.625% 02/15/44	7,500,000.00	10,013,671.87
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,663,281.26
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,684,218.76
T 3.75% 11/15/43	12,500,000.00	16,979,492.25
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	4,286,214.85
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,471,066.42
T 3% 02/15/49	14,970,000.00	18,494,967.18
T 3% 05/15/42	2,950,000.00	3,558,207.04
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,259,335.95
T 3% 05/15/47	7,750,000.00	9,504,648.43
T 3% 08/15/48	11,950,000.00	14,721,839.90
T 3% 09/30/25	15,000,000.00	16,376,367.15
T 3% 10/31/25	10,000,000.00	10,928,515.60
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	7,344,605.49
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,273,851.56
T 4.25% 11/15/40	4,350,000.00	6,211,664.06
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,423,750.00
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,749,359.37
T 4.375% 05/15/41	2,650,000.00	3,855,750.00
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,892,218.75
T 4.5% 02/15/36	3,840,000.00	5,421,600.00
T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,315,875.00
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,484,921.87
T 4.625% 02/15/40	8,700,000.00	12,952,125.00
T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	4,487,226.56
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,662,976.56
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,667,773.43

	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,724,125.00	
	T 5.375% 02/15/31	3,300,000.00	4,643,718.75	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,606,968.75	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,179,851.57	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,975,511.72	
	T 6.25% 05/15/30	1,900,000.00	2,795,671.87	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,957,957.03	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,938,597.65	
	アメリカドル 小計	1,611,470,000.00	1,720,778,168.98 (181,937,875,806)	
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	3,038,914.50	
	CAN 0.75% 03/01/21	5,690,000.00	5,632,701.70	
	CAN 0.75% 09/01/20	5,320,000.00	5,278,663.60	
	CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,669,112.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	460,000.00	465,046.20	
	CAN 1.5% 06/01/23	3,200,000.00	3,232,096.00	
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,352,152.50	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	609,675.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	4,000,000.00	4,069,720.00	
	CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,716,740.00	
	CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,951,472.15	
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,487,887.50	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,405,685.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	3,800,000.00	4,029,653.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	2,860,000.00	3,157,096.80	
	CAN 2.5% 06/01/24	3,060,000.00	3,245,986.80	
	CAN 2.75% 06/01/22	4,910,000.00	5,105,835.35	
	CAN 2.75% 12/01/48	2,870,000.00	3,811,087.35	
	CAN 2.75% 12/01/64	790,000.00	1,158,874.70	
	CAN 2% 06/01/28	2,140,000.00	2,296,669.40	
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,173,753.65	
	CAN 2% 11/01/20	2,110,000.00	2,122,512.30	
	CAN 2% 12/01/51	950,000.00	1,103,244.50	
	CAN 3.25% 06/01/21	5,630,000.00	5,812,637.20	
	CAN 3.5% 12/01/45	3,330,000.00	4,866,711.75	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,730,000.00	4,060,615.65	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	3,087,237.30	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,880,000.00	2,950,603.60	
	CAN 5% 06/01/37	2,320,000.00	3,653,582.40	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,789,818.50	
	カナダドル 小計	81,350,000.00	91,335,786.40 (7,262,108,376)	

メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	21,209,450.25	
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	44,187,297.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,070,000.00	35,712,134.55	
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	46,208,015.50	
	MBONO 6.5% 06/10/21	63,590,000.00	63,040,582.40	
	MBONO 7.25% 12/09/21	25,330,000.00	25,424,227.60	
	MBONO 7.5% 06/03/27	54,070,000.00	55,745,088.60	
	MBONO 7.75% 05/29/31	33,600,000.00	35,171,304.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	35,990,000.00	37,006,537.55	
	MBONO 7.75% 11/23/34	19,630,000.00	20,447,785.80	
	MBONO 8.5% 05/31/29	29,250,000.00	32,294,925.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	24,110,000.00	26,700,860.60	
	MBONO 8% 09/05/24	18,970,000.00	19,811,414.35	
	MBONO 8% 11/07/47	18,970,000.00	20,009,556.00	
	MBONO 8% 12/07/23	45,700,000.00	47,490,297.50	
	メキシコペソ 小計		509,770,000.00	530,459,476.70
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	2,200,000.00	2,288,264.00	
	BGB 0.5% 10/22/24	2,270,000.00	2,408,072.75	
	BGB 0.8% 06/22/25	3,100,000.00	3,361,950.00	
	BGB 0.8% 06/22/27	3,110,000.00	3,432,818.00	
	BGB 0.8% 06/22/28	3,160,000.00	3,509,827.80	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,040,000.00	2,296,948.20	
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	1,010,259.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	987,588.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	2,260,000.00	2,953,853.90	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,250,000.00	1,668,300.00	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,330,000.00	1,761,006.45	
	BGB 1% 06/22/26	2,930,000.00	3,248,578.90	
	BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,707,428.25	
	BGB 2.15% 06/22/66	1,000,000.00	1,537,405.00	
	BGB 2.25% 06/22/23	2,660,000.00	2,974,119.40	
	BGB 2.25% 06/22/57	800,000.00	1,214,616.00	
	BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,834,999.40	
	BGB 3.75% 06/22/45	1,600,000.00	2,949,272.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	3,270,000.00	3,430,295.40	
	BGB 3% 06/22/34	2,220,000.00	3,235,050.60	
	BGB 4.25% 03/28/41	3,370,000.00	6,214,583.30	
	BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,600,733.25	
	BGB 4.25% 09/28/22	3,290,000.00	3,812,090.10	
	BGB 4.5% 03/28/26	2,420,000.00	3,250,156.80	
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,491,809.00	
	BGB 4% 03/28/32	1,580,000.00	2,428,436.30	

BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,237,818.10
BGB 5% 03/28/35	3,580,000.00	6,388,044.60
BKO 0% 03/12/21	2,960,000.00	3,000,285.60
BTPS 0.05% 04/15/21	7,190,000.00	7,209,952.25
BTPS 0.2% 10/15/20	1,390,000.00	1,396,783.20
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,600,136.90
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,413,237.00
BTPS 0.65% 10/15/23	3,220,000.00	3,257,352.00
BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,566,158.75
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,243,154.80
BTPS 0.95% 03/01/23	3,500,000.00	3,572,765.00
BTPS 0.95% 03/15/23	6,500,000.00	6,637,377.50
BTPS 1.2% 04/01/22	1,450,000.00	1,489,331.25
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,012,214.75
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,989,334.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,402,338.50
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,088,981.25
BTPS 1.45% 11/15/24	1,300,000.00	1,357,512.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,910,000.00	3,047,657.55
BTPS 1.6% 06/01/26	3,600,000.00	3,803,670.00
BTPS 1.65% 03/01/32	5,250,000.00	5,426,820.00
BTPS 1.75% 07/01/24	4,000,000.00	4,230,680.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,124,660.00
BTPS 1% 07/15/22	3,600,000.00	3,680,676.00
BTPS 2.05% 08/01/27	3,850,000.00	4,194,016.75
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,620,937.50
BTPS 2.2% 06/01/27	6,300,000.00	6,929,181.00
BTPS 2.25% 09/01/36	2,650,000.00	2,885,823.50
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,832,111.00
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,799,900.00
BTPS 2.45% 10/01/23	3,960,000.00	4,280,007.60
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,267,582.25
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	7,026,560.00
BTPS 2.7% 03/01/47	3,000,000.00	3,418,005.00
BTPS 2.8% 03/01/67	1,870,000.00	2,064,395.85
BTPS 2.8% 12/01/28	5,700,000.00	6,588,630.00
BTPS 2.95% 09/01/38	2,860,000.00	3,375,286.20
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,796,949.00
BTPS 2% 12/01/25	3,150,000.00	3,395,967.75
BTPS 3.1% 03/01/40	1,070,000.00	1,280,126.60
BTPS 3.25% 09/01/46	3,500,000.00	4,364,307.50
BTPS 3.35% 03/01/35	3,390,000.00	4,174,954.50

BTPS 3.45% 03/01/48	2,530,000.00	3,257,792.45
BTPS 3.5% 03/01/30	6,430,000.00	7,860,096.30
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	4,025,986.00
BTPS 3.75% 05/01/21	3,570,000.00	3,799,104.75
BTPS 3.75% 08/01/21	7,990,000.00	8,568,116.45
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,485,045.25
BTPS 3.85% 09/01/49	2,270,000.00	3,098,493.25
BTPS 3% 08/01/29	2,100,000.00	2,466,996.00
BTPS 4.5% 03/01/24	4,650,000.00	5,474,096.25
BTPS 4.5% 03/01/26	6,160,000.00	7,621,090.40
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,486,326.00
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,909,107.00
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,328,311.25
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	4,642,031.55
BTPS 4.75% 09/01/44	2,940,000.00	4,447,602.60
BTPS 4% 02/01/37	5,470,000.00	7,299,961.15
BTPS 4% 09/01/20	4,400,000.00	4,586,230.00
BTPS 5.0% 08/01/39	4,300,000.00	6,506,652.50
BTPS 5.25% 11/01/29	4,760,000.00	6,612,711.00
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,934,089.00
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	4,013,574.75
BTPS 5.75% 02/01/33	3,930,000.00	5,944,478.70
BTPS 5% 03/01/22	6,600,000.00	7,404,441.00
BTPS 5% 03/01/25	5,650,000.00	6,984,388.75
BTPS 5% 08/01/34	3,690,000.00	5,347,603.35
BTPS 5% 09/01/40	4,020,000.00	6,097,757.10
BTPS 6.5% 11/01/27	5,620,000.00	8,093,249.60
BTPS 6% 05/01/31	4,800,000.00	7,195,344.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,021,775.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,082,436.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,690,000.00	5,085,812.55
DBR 0.25% 02/15/29	3,510,000.00	3,847,433.85
DBR 0.25% 08/15/28	4,160,000.00	4,550,603.20
DBR 0.5% 02/15/25	3,790,000.00	4,089,523.70
DBR 0.5% 02/15/26	5,000,000.00	5,462,475.00
DBR 0.5% 02/15/28	5,820,000.00	6,478,562.10
DBR 0.5% 08/15/27	4,650,000.00	5,156,175.75
DBR 0% 08/15/26	4,960,000.00	5,269,206.40
DBR 1.25% 08/15/48	3,100,000.00	4,467,472.00
DBR 1.5% 02/15/23	5,270,000.00	5,725,723.25
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,223,538.75
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,558,662.80
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	3,009,678.00

DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,852,050.75
DBR 1.75% 07/04/22	6,150,000.00	6,627,547.50
DBR 1% 08/15/24	3,200,000.00	3,512,912.00
DBR 1% 08/15/25	4,920,000.00	5,492,614.20
DBR 2.25% 09/04/20	4,650,000.00	4,796,986.50
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,075,131.50
DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	3,037,880.50
DBR 2.5% 07/04/44	5,120,000.00	8,811,443.20
DBR 2.5% 08/15/46	5,200,000.00	9,208,706.00
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,530,686.50
DBR 2% 08/15/23	3,850,000.00	4,309,285.75
DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000.00	10,978,655.05
DBR 3.25% 07/04/42	2,600,000.00	4,829,617.00
DBR 4.0% 01/04/37	4,060,000.00	7,355,603.50
DBR 4.25% 07/04/39	2,700,000.00	5,311,413.00
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,848,179.50
DBR 4.75% 07/04/34	4,130,000.00	7,524,653.50
DBR 4.75% 07/04/40	3,210,000.00	6,820,961.10
DBR 5.5% 01/04/31	3,900,000.00	6,760,162.50
DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,830,539.80
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,640,510.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,191,112.50
DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	1,036,951.50
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,063,900.00
FRTR 0.25% 11/25/26	5,850,000.00	6,216,502.50
FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,373,884.70
FRTR 0.5% 05/25/26	10,400,000.00	11,212,604.00
FRTR 0.5% 05/25/29	7,000,000.00	7,639,170.00
FRTR 0.75% 05/25/28	8,430,000.00	9,369,987.15
FRTR 0.75% 11/25/28	8,510,000.00	9,481,459.05
FRTR 0% 02/25/21	6,000,000.00	6,073,290.00
FRTR 0% 03/25/23	11,000,000.00	11,331,045.00
FRTR 0% 03/25/24	11,240,000.00	11,638,514.20
FRTR 0% 03/25/25	2,530,000.00	2,627,721.25
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,159,675.50
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,681,535.00
FRTR 1.25% 05/25/34	3,950,000.00	4,746,754.50
FRTR 1.25% 05/25/36	6,420,000.00	7,767,108.60
FRTR 1.5% 05/25/31	8,820,000.00	10,701,438.30
FRTR 1.5% 05/25/50	2,760,000.00	3,611,639.40
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	5,039,383.95
FRTR 1.75% 05/25/66	1,860,000.00	2,703,277.50

FRTR 1.75% 06/25/39	4,040,000.00	5,348,354.00
FRTR 1.75% 11/25/24	8,710,000.00	9,865,599.25
FRTR 1% 05/25/27	6,650,000.00	7,474,134.50
FRTR 1% 11/25/25	7,200,000.00	7,965,216.00
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,698,374.50
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,309,895.90
FRTR 2.5% 05/25/30	7,960,000.00	10,455,619.20
FRTR 2.5% 10/25/20	5,450,000.00	5,657,427.00
FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	6,391,550.00
FRTR 2% 05/25/48	4,840,000.00	6,992,348.00
FRTR 3.25% 05/25/45	5,070,000.00	8,835,286.20
FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000.00	11,819,773.00
FRTR 3.5% 04/25/26	5,670,000.00	7,284,163.95
FRTR 3.75% 04/25/21	11,370,000.00	12,241,226.25
FRTR 3% 04/25/22	8,520,000.00	9,405,781.80
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,594,468.75
FRTR 4.5% 04/25/41	6,640,000.00	12,864,302.80
FRTR 4.75% 04/25/35	4,200,000.00	7,417,431.00
FRTR 4% 04/25/55	2,900,000.00	6,219,717.00
FRTR 4% 04/25/60	2,450,000.00	5,519,115.00
FRTR 4% 10/25/38	4,880,000.00	8,575,990.00
FRTR 5.5% 04/25/29	4,050,000.00	6,439,095.00
FRTR 5.75% 10/25/32	5,410,000.00	9,758,287.50
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,699,064.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,348,185.00
IRISH 0.8% 03/15/22	2,040,000.00	2,116,132.80
IRISH 0.9% 05/15/28	1,710,000.00	1,873,134.00
IRISH 0% 10/18/22	1,340,000.00	1,368,307.50
IRISH 1.1% 05/15/29	910,000.00	1,015,892.15
IRISH 1.3% 05/15/33	780,000.00	894,831.60
IRISH 1.35% 03/18/31	890,000.00	1,021,795.65
IRISH 1.5% 05/15/50	870,000.00	1,050,259.65
IRISH 1.7% 05/15/37	940,000.00	1,146,621.40
IRISH 1% 05/15/26	2,040,000.00	2,227,516.80
IRISH 2.4% 05/15/30	1,630,000.00	2,053,148.00
IRISH 2% 02/18/45	1,480,000.00	1,979,329.80
IRISH 3.4% 03/18/24	1,470,000.00	1,738,194.15
IRISH 3.9% 03/20/23	1,290,000.00	1,500,798.90
IRISH 5.4% 03/13/25	2,370,000.00	3,145,938.00
IRISH 5% 10/18/20	230,000.00	245,073.05
NETHER 0.25% 07/15/25	2,880,000.00	3,055,392.00
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,732,184.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,280,000.00	1,474,566.40

NETHER 0.5% 07/15/26	2,620,000.00	2,846,643.10
NETHER 0.75% 07/15/27	4,530,000.00	5,045,763.15
NETHER 0.75% 07/15/28	2,540,000.00	2,860,243.20
NETHER 0% 01/15/22	3,500,000.00	3,573,255.00
NETHER 0% 01/15/24	3,410,000.00	3,536,204.10
NETHER 1.75% 07/15/23	2,950,000.00	3,257,065.50
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,813,168.20
NETHER 2.5% 01/15/33	2,430,000.00	3,413,943.45
NETHER 2.75% 01/15/47	2,680,000.00	4,909,049.80
NETHER 2% 07/15/24	3,010,000.00	3,433,823.05
NETHER 3.25% 07/15/21	2,930,000.00	3,159,169.95
NETHER 3.75% 01/15/23	3,170,000.00	3,679,197.10
NETHER 3.75% 01/15/42	2,900,000.00	5,595,245.50
NETHER 4% 01/15/37	2,860,000.00	5,085,022.80
NETHER 5.5% 01/15/28	1,140,000.00	1,744,815.60
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	257,975.00
OBL 0.25% 10/16/20	5,010,000.00	5,073,501.75
OBL 0% 04/05/24	5,900,000.00	6,154,496.50
OBL 0% 04/09/21	4,450,000.00	4,513,256.75
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,297,633.40
OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,592,431.50
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,650,414.00
OBL 0% 10/13/23	2,930,000.00	3,045,881.50
OBL 0% 10/18/24	960,000.00	1,005,264.00
RAGB 0.5% 02/20/29	780,000.00	851,791.20
RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,278,930.50
RAGB 0.75% 02/20/28	2,870,000.00	3,189,789.75
RAGB 0.75% 10/20/26	3,310,000.00	3,639,841.50
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,546,545.00
RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,127,357.00
RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,912,917.15
RAGB 1.5% 02/20/47	1,130,000.00	1,541,800.25
RAGB 1.5% 11/02/86	640,000.00	998,675.20
RAGB 1.65% 10/21/24	1,870,000.00	2,103,824.80
RAGB 1.75% 10/20/23	2,330,000.00	2,580,509.95
RAGB 2.1% 09/20/17	1,000,000.00	2,034,260.00
RAGB 2.4% 05/23/34	1,550,000.00	2,154,368.25
RAGB 3.15% 06/20/44	1,330,000.00	2,345,282.10
RAGB 3.4% 11/22/22	2,550,000.00	2,902,435.50
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,363,249.35
RAGB 3.65% 04/20/22	2,310,000.00	2,585,663.85
RAGB 3.8% 01/26/62	640,000.00	1,529,750.40

RAGB 4.15% 03/15/37	2,640,000.00	4,625,161.20
RAGB 4.85% 03/15/26	2,120,000.00	2,906,520.00
RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	202,141.55
RFGB 0.375% 09/15/20	1,330,000.00	1,345,960.00
RFGB 0.5% 04/15/26	1,170,000.00	1,260,926.55
RFGB 0.5% 09/15/27	1,050,000.00	1,141,108.50
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	732,645.00
RFGB 0.5% 09/15/29	430,000.00	471,290.75
RFGB 0.75% 04/15/31	870,000.00	984,739.95
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	756,419.40
RFGB 0% 04/15/22	850,000.00	868,258.00
RFGB 0% 09/15/23	1,460,000.00	1,507,844.20
RFGB 1.125% 04/15/34	770,000.00	928,161.85
RFGB 1.375% 04/15/47	550,000.00	754,561.50
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	705,194.75
RFGB 1.625% 09/15/22	1,430,000.00	1,537,671.85
RFGB 2.625% 07/04/42	920,000.00	1,496,504.20
RFGB 2.75% 07/04/28	920,000.00	1,193,727.60
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	678,735.00
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	856,796.00
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,450,710.95
SPGB 0.05% 01/31/21	3,600,000.00	3,631,590.00
SPGB 0.05% 10/31/21	4,700,000.00	4,760,700.50
SPGB 0.25% 07/30/24	450,000.00	463,875.75
SPGB 0.35% 07/30/23	4,780,000.00	4,926,865.50
SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,363,869.60
SPGB 0.45% 10/31/22	2,850,000.00	2,937,224.25
SPGB 0.6% 10/31/29	1,160,000.00	1,221,265.40
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,255,759.00
SPGB 1.3% 10/31/26	5,090,000.00	5,624,602.70
SPGB 1.4% 04/30/28	6,230,000.00	7,018,686.85
SPGB 1.4% 07/30/28	5,900,000.00	6,650,332.50
SPGB 1.45% 04/30/29	6,540,000.00	7,425,385.20
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,927,964.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,431,021.25
SPGB 1.6% 04/30/25	4,910,000.00	5,444,085.25
SPGB 1.85% 07/30/35	2,410,000.00	2,911,677.65
SPGB 1.95% 04/30/26	4,820,000.00	5,520,201.40
SPGB 1.95% 07/30/30	3,650,000.00	4,371,805.75
SPGB 2.15% 10/31/25	3,370,000.00	3,871,961.50
SPGB 2.35% 07/30/33	3,540,000.00	4,506,774.00
SPGB 2.7% 10/31/48	2,320,000.00	3,339,152.80
SPGB 2.75% 10/31/24	4,400,000.00	5,109,764.00

	SPGB 2.9% 10/31/46	3,430,000.00	5,064,223.50
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,850,000.00	3,259,219.00
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,310,000.00	3,963,261.60
	SPGB 4.2% 01/31/37	3,350,000.00	5,418,641.75
	SPGB 4.4% 10/31/23	4,250,000.00	5,112,516.25
	SPGB 4.65% 07/30/25	3,970,000.00	5,136,544.80
	SPGB 4.7% 07/30/41	3,980,000.00	7,191,302.80
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,758,820.00
	SPGB 4.85% 10/31/20	3,950,000.00	4,201,378.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	3,300,000.00	6,023,919.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,778,497.80
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,400,000.00	4,753,656.00
	SPGB 5.4% 01/31/23	4,860,000.00	5,847,381.90
	SPGB 5.5% 04/30/21	5,980,000.00	6,589,481.60
	SPGB 5.75% 07/30/32	4,300,000.00	7,338,509.00
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,948,578.80
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,958,321.40
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,645,287.00
	ユーロ 小計	1,002,570,000.00	1,225,581,554.95 (143,638,158,240)
イギリスポ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	5,730,000.00	5,760,225.75
	UKT 0.75% 07/22/23	5,930,000.00	6,027,014.80
	UKT 0.875% 10/22/29	510,000.00	528,864.90
	UKT 1.25% 07/22/27	4,900,000.00	5,243,000.00
	UKT 1.5% 01/22/21	3,120,000.00	3,166,878.00
	UKT 1.5% 07/22/26	4,100,000.00	4,433,063.50
	UKT 1.5% 07/22/47	5,040,000.00	5,603,371.20
	UKT 1.625% 10/22/28	5,750,000.00	6,369,562.50
	UKT 1.625% 10/22/54	1,330,000.00	1,571,827.25
	UKT 1.625% 10/22/71	1,200,000.00	1,540,764.00
	UKT 1.75% 01/22/49	1,480,000.00	1,746,570.20
	UKT 1.75% 07/22/57	2,750,000.00	3,428,287.50
	UKT 1.75% 09/07/22	3,400,000.00	3,544,347.00
	UKT 1.75% 09/07/37	4,920,000.00	5,612,317.80
	UKT 1% 04/22/24	5,030,000.00	5,187,413.85
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,692,787.50
	UKT 2.5% 07/22/65	4,170,000.00	6,565,602.45
	UKT 2.75% 09/07/24	2,450,000.00	2,747,270.75
	UKT 2% 09/07/25	2,170,000.00	2,394,595.00
	UKT 3.25% 01/22/44	4,670,000.00	6,895,838.75
UKT 3.5% 01/22/45	3,360,000.00	5,208,403.20	
UKT 3.5% 07/22/68	3,670,000.00	7,304,180.80	

	UKT 3.75% 07/22/52	3,280,000.00	5,795,924.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	8,060,000.00	8,331,662.30	
	UKT 3.75% 09/07/21	3,770,000.00	4,028,188.45	
	UKT 4.25% 03/07/36	4,290,000.00	6,568,140.15	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,000,000.00	4,328,535.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	2,450,000.00	3,928,072.75	
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	884,182.25	
	UKT 4.25% 12/07/40	3,050,000.00	4,967,596.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	3,950,000.00	6,963,810.50	
	UKT 4.25% 12/07/49	2,170,000.00	3,988,492.55	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,740,000.00	5,466,176.70	
	UKT 4.5% 09/07/34	3,170,000.00	4,862,890.95	
	UKT 4.5% 12/07/42	3,910,000.00	6,747,232.85	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,710,000.00	3,966,247.60	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,196,655.00	
	UKT 4% 01/22/60	2,950,000.00	5,945,975.75	
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,129,829.00	
	UKT 5% 03/07/25	2,500,000.00	3,142,375.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,889,487.50	
	UKT 8% 06/07/21	740,000.00	840,036.90	
	イギリスポンド 小計	136,690,000.00	181,543,697.90 (23,577,080,046)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,490,000.00	8,304,612.40	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,590,000.00	8,455,411.80	
	SGB 1.5% 11/13/23	16,650,000.00	18,232,332.75	
	SGB 1% 11/12/26	11,970,000.00	13,345,113.60	
	SGB 2.5% 05/12/25	11,460,000.00	13,550,877.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	8,460,000.00	14,049,395.10	
	SGB 3.5% 06/01/22	17,590,000.00	19,668,434.40	
	SGB 5% 12/01/20	18,910,000.00	20,264,334.20	
	スウェーデンクローナ 小計	100,120,000.00	115,870,511.25 (1,266,464,687)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	7,460,000.00	7,642,024.00	
	NGB 1.75% 02/17/27	7,460,000.00	7,793,163.60	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	6,002,855.00	
	NGB 1.75% 09/06/29	5,140,000.00	5,415,632.50	
	NGB 2% 04/26/28	5,730,000.00	6,135,311.55	
	NGB 2% 05/24/23	13,440,000.00	13,874,716.80	
	NGB 3.75% 05/25/21	16,040,000.00	16,764,526.80	
	NGB 3% 03/14/24	9,950,000.00	10,781,670.75	
	ノルウェークローネ 小計	71,020,000.00	74,409,901.00 (872,828,138)	
	DGB 0.25% 11/15/20	9,400,000.00	9,530,895.00	

デンマーク クローネ	DGB 0.5% 11/15/27	17,460,000.00	19,342,275.30	
	DGB 0.5% 11/15/29	4,930,000.00	5,537,942.95	
	DGB 1.5% 11/15/23	13,990,000.00	15,435,586.70	
	DGB 1.75% 11/15/25	11,230,000.00	13,101,591.80	
	DGB 3% 11/15/21	12,960,000.00	14,096,786.40	
	DGB 4.5% 11/15/39	24,490,000.00	50,313,235.60	
デンマーククローネ 小計		94,460,000.00	127,358,313.75	(2,002,072,692)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	7,810,000.00	7,844,559.25	
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,798,854.15	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,048,897.10	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,810,000.00	7,095,985.95	
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,410,000.00	7,781,611.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	6,770,000.00	7,136,392.40	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,000,000.00	6,462,300.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	2,460,000.00	2,672,347.20	
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,613,759.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,782,133.75	
	POLGB 4% 10/25/23	4,390,000.00	4,822,327.20	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,110,000.00	3,249,763.40	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	813,783.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,051,692.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,704,096.00	
ポーランドズロチ 小計		75,720,000.00	79,878,502.10	(2,138,347,501)
オーストラ リアドル	ACGB 1.5% 06/21/31	1,450,000.00	1,540,683.00	
	ACGB 1.75% 11/21/20	6,310,000.00	6,383,259.10	
	ACGB 2.25% 05/21/28	5,790,000.00	6,462,855.90	
	ACGB 2.25% 11/21/22	1,970,000.00	2,068,273.45	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,540,000.00	4,117,055.40	
	ACGB 2.75% 04/21/24	6,060,000.00	6,631,185.30	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	1,001,688.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,430,000.00	1,763,726.25	
	ACGB 2.75% 11/21/27	5,750,000.00	6,616,697.50	
	ACGB 2.75% 11/21/28	4,700,000.00	5,478,132.00	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,460,000.00	5,267,728.30	
	ACGB 2% 12/21/21	2,720,000.00	2,800,076.80	
	ACGB 3.25% 04/21/25	4,980,000.00	5,670,551.70	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,090,000.00	4,983,992.20	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,570,000.00	2,099,129.25	
	ACGB 3.75% 04/21/37	2,320,000.00	3,249,890.80	
	ACGB 3% 03/21/47	2,480,000.00	3,309,126.00	
ACGB 4.25% 04/21/26	6,370,000.00	7,804,301.05		

	ACGB 4.5% 04/21/33	2,650,000.00	3,827,024.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	5,660,000.00	7,306,012.90	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,000,000.00	4,692,040.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,930,000.00	4,264,698.45	
	ACGB 5.75% 07/15/22	5,330,000.00	6,097,733.20	
	オーストラリアドル 小計	88,360,000.00	103,435,860.55	(7,383,251,726)
シンガポールドドル	SIGB 1.25% 10/01/21	990,000.00	982,763.10	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	803,452.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	780,000.00	782,987.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	875,657.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,607,808.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	700,000.00	744,079.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	656,151.30	
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	282,530.30	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,128,975.75	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,320,000.00	1,541,647.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	830,000.00	961,849.65	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,600,000.00	1,667,208.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	560,000.00	619,234.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	670,000.00	747,150.50	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	416,808.05	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,148,779.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,070,000.00	1,087,259.10	
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,060,000.00	1,267,516.20	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,190,000.00	1,344,039.55	
	SIGB 3% 09/01/24	1,050,000.00	1,119,352.50	
	シンガポールドドル 小計	18,510,000.00	19,785,248.95	(1,506,053,150)
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,517,712.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,725,987.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,710,000.00	2,734,904.90	
	MGS 3.62% 11/30/21	2,690,000.00	2,720,437.35	
	MGS 3.659% 10/15/20	2,360,000.00	2,374,761.80	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,339,689.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	356,865.25	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,527,930.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	3,160,000.00	3,228,429.80	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,990,000.00	3,098,955.60	
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	763,803.75	
	MGS 3.882% 03/14/25	500,000.00	515,837.50	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,511,055.00	

	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,169,713.85	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,049,262.95	
	MGS 3.9% 11/30/26	3,560,000.00	3,699,053.60	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,803,248.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,089,606.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,973,539.50	
	MGS 4.127% 04/15/32	2,050,000.00	2,182,481.25	
	MGS 4.16% 07/15/21	3,700,000.00	3,771,798.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,615,549.50	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,149,170.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,512,945.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	3,160,000.00	3,363,551.40	
	MGS 4.498% 04/15/30	3,040,000.00	3,328,389.60	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,688,250.00	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,490,000.00	1,736,654.60	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,480,000.00	2,843,382.00	
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	944,000.00	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,550,000.00	1,858,225.25	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,712,505.60	
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	686,247.00	
	マレーシアリングット 小計	65,080,000.00	68,593,943.55 (1,725,137,680)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	43,600,000.00	48,966,942.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,987,847.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	17,650,000.00	12,417,392.75	
	SAGB 6.75% 03/31/21	10,700,000.00	10,730,281.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	17,600,000.00	17,866,112.00	
	SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	13,864,904.85	
	SAGB 8.25% 03/31/32	25,870,000.00	23,871,413.15	
	SAGB 8.5% 01/31/37	27,100,000.00	24,337,426.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	24,302,920.10	
	SAGB 8.75% 02/28/48	44,900,000.00	40,107,598.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	21,250,000.00	20,016,968.75	
	SAGB 8% 01/31/30	29,930,000.00	28,068,802.95	
	SAGB 9% 01/31/40	14,650,000.00	13,564,947.75	
	南アフリカランド 小計	307,740,000.00	286,103,556.80 (1,971,253,506)	
	合計		378,086,762,179 (378,086,762,179)	

有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 204銘柄	100.0%	48.1%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 299銘柄	100.0%	38.0%
イギリスポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 33銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	11,199,408,629
コール・ローン	220,501,897
株式	319,523,141,908
投資信託受益証券	271,335,475
投資証券	9,347,435,947
派生商品評価勘定	8,614,821
未収入金	258,738,395
未収配当金	667,040,206
前払金	240,793,310
差入委託証拠金	1,859,385,874

	2019年 8月28日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	343,596,396,462
資産合計	343,596,396,462
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	249,744,765
未払金	6,295,394,097
未払解約金	21,956,893
未払利息	346
流動負債合計	6,567,096,101
負債合計	6,567,096,101
純資産の部	
元本等	
元本	137,096,412,688
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	199,932,887,673
元本等合計	337,029,300,361
純資産合計	337,029,300,361
負債純資産合計	343,596,396,462

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28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> <p>(1) 先物取引</p>

2019年 8月28日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,096,412,688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 2.4583円 (1万口当たり純資産額) (24,583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 8月28日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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 8月28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 8月28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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月29日
期首元本額	136,681,567,439円
期中追加設定元本額	17,715,931,069円
期中一部解約元本額	17,301,085,820円
期末元本額	137,096,412,688円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,466,220,276円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,743,667円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,239,640,372円
世界経済インデックスファンド	7,569,485,034円
外国株式インデックス・オープン	900,056,568円
D C マイセレクション 2 5	1,096,492,671円
D C マイセレクション 5 0	4,819,722,695円
D C マイセレクション 7 5	5,043,226,923円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,614,970,127円
D C マイセレクション S 2 5	436,244,542円

区分	2019年 8月28日現在
DCマイセレクションS50	1,949,370,034円
DCマイセレクションS75	1,438,262,461円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	108,000,999円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	188,765,946円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	123,815,508円
DC世界経済インデックスファンド	6,556,305,835円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,969,721,903円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,491,154円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	10,674,210円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	40,540,056円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	49,025,636円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	195,398,699円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	34,527,140円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	271,078,469円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	715,505,651円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	367,824,539円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,398,383,445円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,840,154,878円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	77,673,998円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	349,172,169円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	8,588,264円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	123,544,818円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,845,367,154円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,094,899,634円
外国株式ファンド・シリーズ1	875,518,535円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,485,538,253円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,428,856,181円
分散投資コア戦略ファンドA	2,320,725,574円
分散投資コア戦略ファンドS	4,952,005,797円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	911,559,773円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,024,664,542円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,150,900,817円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	815,879,667円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,449,930円
SMT インデックスバランス・オープン	273,404,019円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,668,443,645円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,223,198,128円
SMT 世界経済インデックス・オープン	79,500,691円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	325,395,018円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	50,012,229円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,459,532円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	46,789,800円
グローバル経済コア	1,064,322,288円

区分	2019年 8月28日現在
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A 対応型)	6,808,292円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	382,203円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	367,788,121円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	74,560,043円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	58,867円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	66,613円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	74,359円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	81,330円
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,372,424,434円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,176,993,754円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	360,749,756円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	32,905,022円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,654,249,794
投資信託受益証券	17,470,156
投資証券	452,165,427
合計	4,123,885,377

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年 8月28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	8,717,967,165	-	8,477,173,855	240,793,310
合計		8,717,967,165	-	8,477,173,855	240,793,310

(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28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	787,623,534	-	787,286,900	336,634
	アメリカドル	279,956,400	-	279,827,210	129,190
	カナダドル	143,605,896	-	143,577,000	28,896
	ユーロ	167,675,320	-	167,596,000	79,320
	イギリスポンド	47,787,008	-	47,788,480	1,472
	スイスフラン	16,546,338	-	16,484,220	62,118
	デンマーククローネ	21,189,212	-	21,190,560	1,348
	オーストラリアドル	58,962,358	-	58,951,620	10,738
	香港ドル	21,868,302	-	21,861,810	6,492
	イスラエルシェケル	30,032,700	-	30,010,000	22,700
合計		787,623,534	-	787,286,900	336,634

(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	APACHE CORP	34,273	20.96	718,362.08	
	BAKER HUGHES A GE CO	44,400	21.29	945,276.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	16.60	595,591.40	
	CHENIERE ENERGY INC	19,927	58.23	1,160,349.21	
	CHEVRON CORP	162,402	115.83	18,811,023.66	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	37.63	285,950.37	
	CONCHO RESOURCES INC	17,481	69.02	1,206,538.62	
	CONOCOPHILLIPS	96,515	50.98	4,920,334.70	

CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	28.55	218,321.85
DEVON ENERGY CORPORATION	37,861	21.34	807,953.74
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,487	92.37	1,245,794.19
EOG RESOURCES INC	49,600	71.66	3,554,336.00
EXXON MOBIL	360,671	67.19	24,233,484.49
HALLIBURTON CO	76,620	17.31	1,326,292.20
HELMERICH & PAYNE	8,315	36.65	304,744.75
HESS CORP	22,081	59.71	1,318,456.51
HOLLYFRONTIER CORP	14,110	43.15	608,846.50
KINDER MORGAN INC	174,156	20.04	3,490,086.24
MARATHON OIL CORP	74,537	11.53	859,411.61
MARATHON PETROLEUM CORP	57,720	45.33	2,616,447.60
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	18.46	559,541.06
NOBLE ENERGY INC	38,291	21.51	823,639.41
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,592	42.35	3,243,671.20
ONEOK INC	34,074	68.32	2,327,935.68
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	16.65	340,908.75
PHILLIPS 66	38,115	94.52	3,602,629.80
PIONEER NATURAL RESOURCES	14,455	118.02	1,705,979.10
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	21.28	210,459.20
SCHLUMBERGER	118,363	31.25	3,698,843.75
TARGA RESOURCES CORP	20,002	32.46	649,264.92
TECHNIPFMC PLC	36,005	24.72	890,043.60
VALERO ENERGY CORP	35,352	71.71	2,535,091.92
WILLIAMS COS	103,730	22.92	2,377,491.60
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,806	225.54	4,241,505.24
ALBEMARLE CORP	8,647	59.30	512,767.10
AMCOR PLC	138,214	9.78	1,351,732.92
AVERY DENNISON CORP	7,457	112.92	842,044.44
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	26.92	473,953.52
BALL CORP	27,142	79.02	2,144,760.84
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	107.22	1,185,102.66
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	46.69	890,424.99
CORTEVA INC	64,411	28.73	1,850,528.03
CROWN HOLDINGS INC	11,700	64.56	755,352.00
DOW INC	65,790	41.17	2,708,574.30
DUPONT DE NEMOURS INC	64,206	63.96	4,106,615.76
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	61.55	729,859.90
ECOLAB INC	21,748	204.72	4,452,250.56
FMC CORP	12,118	83.24	1,008,702.32
FREEMPORT-MCMORAN INC	124,849	8.71	1,087,434.79
INT'L PAPER CO	33,803	36.74	1,241,922.22

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,674	107.33	930,980.42
LINDE PLC	46,307	184.74	8,554,755.18
LYONDELLBASELL INDU-CL A	23,007	69.75	1,604,738.25
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,367	250.21	1,342,877.07
MOSAIC CO/THE	31,911	17.66	563,548.26
NEWMONT GOLDCORP CORP	69,458	40.75	2,830,413.50
NUCOR CORP	26,204	46.61	1,221,368.44
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	97.66	868,197.40
PPG INDUSTRIES INC	19,958	107.41	2,143,688.78
SEALED AIR CORP	14,689	39.91	586,237.99
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,101	515.39	3,659,784.39
STEEL DYNAMICS INC	18,273	25.90	473,270.70
VULCAN MATERIALS CO	10,740	139.82	1,501,666.80
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	56.10	193,825.50
WESTROCK CO	21,244	32.31	686,393.64
3 M COMPANY	49,185	155.75	7,660,563.75
ACUITY BRANDS INC	3,505	120.71	423,088.55
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	50.43	571,371.90
ALLEGION PLC	7,435	93.77	697,179.95
AMETEK INC	19,001	83.73	1,590,953.73
ARCONIC INC	36,550	25.18	920,329.00
BOEING CO	45,573	354.73	16,166,110.29
CATERPILLAR	48,214	113.38	5,466,503.32
CUMMINS INC	12,585	142.80	1,797,138.00
DEERE&CO	25,734	150.10	3,862,673.40
DOVER CORP	12,008	88.93	1,067,871.44
EATON CORP	36,194	76.86	2,781,870.84
EMERSON ELECTRIC CO	52,562	57.27	3,010,225.74
FASTENAL CO	46,922	29.70	1,393,583.40
FLOWSERVE CORP	10,826	40.22	435,421.72
FLUOR CORP	11,267	16.35	184,215.45
FORTIVE CORP	25,813	69.03	1,781,871.39
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	49.44	633,326.40
GENERAL DYNAMICS CORP	21,021	183.36	3,854,410.56
GENERAL ELECTRIC CO	744,434	7.93	5,903,361.62
GRAINGER (WW) INC	3,976	265.37	1,055,111.12
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	37.70	574,020.20
HEICO CORP	3,640	145.10	528,164.00
HEICO CORP-CLASS A	6,449	109.74	707,713.26
HONEYWELL INTL INC	62,077	157.48	9,775,885.96
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	202.61	713,592.42
IDEX CORP	6,916	162.61	1,124,610.76

ILLINOIS TOOL WORKS	28,028	145.00	4,064,060.00
INGERSOLL-RAND PLC	20,322	116.51	2,367,716.22
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	85.02	1,022,450.52
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	52.24	1,050,024.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	31.47	645,135.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	68,082	41.99	2,858,763.18
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,859	210.48	3,969,442.32
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	247.40	713,749.00
LOCKHEED MARTIN CORP	21,716	379.99	8,251,862.84
MASCO CORP	24,547	39.34	965,678.98
MIDDLEBY CORP	4,364	108.65	474,148.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,775	364.18	5,016,579.50
OWENS CORNING	7,979	54.89	437,967.31
PACCAR INC	30,075	63.43	1,907,657.25
PARKER HANNIFIN CORP	11,340	157.83	1,789,792.20
PENTAIR PLC	13,583	34.73	471,737.59
RAYTHEON COMPANY	23,520	178.39	4,195,732.80
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	146.25	1,537,233.75
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,720	353.76	3,084,787.20
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	43.41	600,273.48
SMITH (A.O.) CORP	12,146	44.48	540,254.08
SNAP-ON INC	4,900	145.10	710,990.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	77.85	660,245.85
STANLEY BLACK&DECKER	13,234	129.62	1,715,391.08
TEXTRON	18,220	42.77	779,269.40
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	512.51	2,086,940.72
UNITED RENTALS INC	6,446	103.80	669,094.80
UNITED TECHNOLOGIES CORP	69,887	124.57	8,705,823.59
WABCO HOLDINGS INC	3,841	132.66	509,547.06
WABTEC CORP	15,679	65.94	1,033,873.26
XYLEM INC	16,060	74.28	1,192,936.80
CINTAS CORP	7,616	261.15	1,988,918.40
COPART INC	17,540	74.63	1,309,010.20
COSTAR GROUP INC	3,008	612.61	1,842,730.88
EQUIFAX INC	10,799	144.71	1,562,723.29
IHS MARKIT LTD	32,775	64.39	2,110,382.25
MANPOWER GROUP	5,123	78.89	404,153.47
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	20.32	558,881.28
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	88.60	1,635,644.60
ROBERT HALF INTL INC	9,566	52.90	506,041.40
ROLLINS INC	10,546	31.53	332,515.38
TRANSUNION	15,344	83.39	1,279,536.16

VERISK ANALYTICS INC	13,480	158.91	2,142,106.80
WASTE CONNECTIONS INC	23,008	91.29	2,100,400.32
WASTE MANAGEMENT INC	36,280	117.75	4,271,970.00
AMERCO	602	343.07	206,528.14
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	24.45	242,544.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	82.33	942,513.84
CSX CORP	64,710	64.41	4,167,971.10
DELTA AIR LINES INC	15,095	56.14	847,433.30
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	69.88	964,553.64
FEDEX CORP	21,165	149.53	3,164,802.45
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	100.66	718,108.44
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	121.21	1,059,739.03
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	31.75	339,725.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,814	169.95	3,877,239.30
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	159.51	836,629.95
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	50.49	578,867.85
UBER TECHNOLOGIES INC	15,749	33.11	521,449.39
UNION PACIFIC CORP	60,776	157.47	9,570,396.72
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,003	81.94	491,885.82
UNITED PARCEL SERVICE B	59,531	114.13	6,794,273.03
XPO LOGISTICS INC	8,001	66.26	530,146.26
APTIV PLC	22,107	81.02	1,791,109.14
AUTOLIV INC	6,639	64.58	428,746.62
BORGWARNER INC	15,953	31.14	496,776.42
FORD MOTOR COMPANY	335,147	8.76	2,935,887.72
GENERAL MOTORS CO	109,074	35.89	3,914,665.86
HARLEY-DAVIDSON	14,677	30.39	446,034.03
LEAR CORP	5,287	106.88	565,074.56
TESLA INC	10,812	214.08	2,314,632.96
CAPRI HOLDINGS LTD	11,547	25.89	298,951.83
DR HORTON INC	28,998	48.93	1,418,872.14
GARMIN LTD	11,464	79.81	914,941.84
HANESBRANDS INC	31,136	13.50	420,336.00
HASBRO INC	10,617	107.26	1,138,779.42
LEGGETT & PLATT INC	10,594	36.33	384,880.02
LENNAR CORP-CL A	23,545	50.50	1,189,022.50
LULULEMON ATHLETICA INC	9,496	180.11	1,710,324.56
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	112.58	569,879.96
NEWELL BRANDS INC	37,563	15.70	589,739.10
NIKE B	107,215	82.03	8,794,846.45
NVR INC	294	3,591.89	1,056,015.66
POLARIS INC	4,691	77.75	364,725.25

PULTE GROUP INC	21,959	33.39	733,211.01
PVH CORP	7,252	69.81	506,262.12
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	85.42	391,052.76
ROKU INC	7,065	147.02	1,038,696.30
TAPESTRY INC	25,989	20.48	532,254.72
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	17.82	284,229.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	16.12	262,481.96
VF CORP	28,754	79.56	2,287,668.24
WHIRLPOOL CORP	5,324	134.10	713,948.40
ARAMARK	19,980	40.01	799,399.80
BLOCK H & R INC	16,984	26.90	456,869.60
CARNIVAL CORPORATION	35,126	43.03	1,511,471.78
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,257	842.11	1,900,642.27
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	119.52	1,198,905.12
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	222.45	768,119.85
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	91.13	2,143,650.99
LAS VEGAS SANDS CORP	28,379	54.29	1,540,695.91
MARRIOTT INTL A	23,516	125.35	2,947,730.60
MCDONALD'S CORP	65,110	216.05	14,067,015.50
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	20.31	358,715.22
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	27.89	1,245,455.84
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	49.09	875,667.42
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,291	101.77	1,556,165.07
STARBUCKS CORP	103,316	96.09	9,927,634.44
VAIL RESORTS INC	3,574	236.54	845,393.96
WYNN RESORTS LTD	8,052	104.15	838,615.80
YUM BRANDS INC	26,166	116.97	3,060,637.02
ACTIVISION BLIZZARD INC	65,500	51.09	3,346,395.00
ALPHABET INC-CL A	25,523	1,170.82	29,882,838.86
ALPHABET INC-CL C	26,716	1,167.84	31,200,013.44
ALTICE USA INC- A	12,457	28.66	357,017.62
CBS CORP-CL B	28,628	41.04	1,174,893.12
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	398.49	5,432,215.68
COMCAST CORP-CL A	386,179	43.60	16,837,404.40
DISCOVERY INC - A	12,804	26.47	338,921.88
DISCOVERY INC-C	31,156	24.89	775,472.84
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	32.37	589,716.66
ELECTRONIC ARTS INC	25,447	94.06	2,393,544.82
FACEBOOK INC-A	204,769	181.30	37,124,619.70
FOX CORP - CLASS A	30,270	31.93	966,521.10
FOX CORP- CLASS B	15,092	31.62	477,209.04
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	253.07	1,700,883.47

INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	19.90	673,296.60
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	102.15	884,925.45
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	25.81	400,467.96
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,606	25.14	1,071,114.84
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	39.99	747,533.07
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	39.72	605,054.76
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	39.44	251,784.96
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	70.31	888,507.47
NETFLIX INC	37,291	291.03	10,852,799.73
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.51	452,301.29
OMNICOM GROUP	19,030	75.40	1,434,862.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.06	784,800.30
SNAP INC - A	57,914	15.51	898,246.14
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,552	130.84	1,249,783.68
THE WALT DISNEY CO	153,426	134.49	20,634,262.74
TRIPADVISOR INC	10,393	35.81	372,173.33
TWITTER INC	61,378	42.14	2,586,468.92
VIACOM INC-CLASS B	31,895	24.37	777,281.15
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	32.78	326,554.36
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	134.89	834,429.54
AMAZON.COM	35,663	1,761.83	62,832,143.29
AUTOZONE INC	2,085	1,064.79	2,220,087.15
BEST BUY COMPANY INC	20,711	67.82	1,404,620.02
BOOKING HOLDINGS INC	3,695	1,919.99	7,094,363.05
BURLINGTON STORES INC	6,004	170.38	1,022,961.52
CARMAX INC	14,253	79.53	1,133,541.09
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	138.75	3,098,287.50
DOLLAR TREE INC	19,630	96.75	1,899,202.50
EBAY	71,876	39.00	2,803,164.00
EXPEDIA GROUP INC	12,028	128.46	1,545,116.88
GAP	21,891	15.58	341,061.78
GENUINE PARTS CO	12,722	87.85	1,117,627.70
GRUBHUB INC	8,261	56.46	466,416.06
HOME DEPOT	94,028	218.21	20,517,849.88
KOHL'S CORP	14,645	44.75	655,363.75
L BRANDS INC	19,499	16.15	314,908.85
LKQ CORP	24,693	25.03	618,065.79
LOWES COMPANIES	67,906	106.04	7,200,752.24
MACY'S INC	25,926	14.30	370,741.80
MERCADOLIBRE INC	3,727	594.13	2,214,322.51
NORDSTROM INC	10,094	27.89	281,521.66
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,699	376.92	2,524,987.08

QURATE RETAIL INC	35,071	10.65	373,506.15
ROSS STORES INC	31,827	102.58	3,264,813.66
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,758	104.70	4,581,462.60
TIFFANY & CO	9,326	82.67	770,980.42
TJX COMPANIES INC	103,117	53.41	5,507,478.97
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,497	99.40	944,001.80
ULTA BEAUTY INC	4,911	323.77	1,590,034.47
WAYFAIR INC- CLASS A	5,327	108.23	576,541.21
COSTCO WHOLESALE CORP	37,514	292.38	10,968,343.32
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	7.07	239,673.00
KROGER CO	68,147	23.12	1,575,558.64
SYSCO CORP	41,755	73.87	3,084,441.85
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,407	49.45	3,333,276.15
WALMART INC	122,245	112.42	13,742,782.90
ALTRIA GROUP INC	158,456	45.25	7,170,134.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,798	37.42	1,788,601.16
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,439	58.99	1,559,636.61
BUNGE LIMITED	11,767	52.58	618,708.86
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	42.05	591,727.60
COCA-COLA CO	345,522	54.72	18,906,963.84
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,270	55.49	1,124,782.30
CONAGRA BRANDS INC	39,943	27.91	1,114,809.13
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	198.19	2,778,227.42
GENERAL MILLS INC	50,246	51.91	2,608,269.86
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,521	159.38	1,995,596.98
HORMEL FOODS CORP	23,465	42.41	995,150.65
INGREDION INC	5,835	73.25	427,413.75
JM SMUCKER CO	9,442	103.69	979,040.98
KELLOGG CO	21,051	62.10	1,307,267.10
KRAFT HEINZ CO/THE	57,581	25.00	1,439,525.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	68.45	884,647.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,976	163.03	1,626,387.28
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	50.17	757,567.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	122,234	54.42	6,651,974.28
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	56.57	1,976,103.24
PEPSICO INC	119,526	134.76	16,107,323.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	132,697	71.70	9,514,374.90
TYSON FOODS INC	24,363	89.97	2,191,939.11
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,264	79.72	1,695,166.08
CLOROX COMPANY	10,995	158.65	1,744,356.75
COLGATE-PALMOLIVE CO	69,644	73.44	5,114,655.36
COTY INC-CL A	30,534	8.80	268,699.20

ESTEE LAUDER CO-CL A	18,739	200.55	3,758,106.45
KIMBERLY-CLARK CORP	29,423	141.14	4,152,762.22
PROCTER & GAMBLE CO	213,814	120.55	25,775,277.70
ABBOTT LABORATORIES	150,743	83.65	12,609,651.95
ABIOMED INC	3,502	190.06	665,590.12
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	173.80	1,088,683.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	81.28	1,044,204.16
ANTHEM INC	21,803	251.30	5,479,093.90
BAXTER INTERNATIONAL	40,492	86.39	3,498,103.88
BECTON DICKINSON & CO	23,072	250.32	5,775,383.04
BOSTON SCIENTIFIC CORP	118,988	42.22	5,023,673.36
CARDINAL HEALTH	25,252	41.93	1,058,816.36
CENTENE CORP	35,914	45.03	1,617,207.42
CERNER CORP	27,944	68.19	1,905,501.36
CIGNA CORP	32,466	146.27	4,748,801.82
CVS HEALTH CORP	111,087	59.19	6,575,239.53
DANAHER CORP	55,089	138.25	7,616,054.25
DAVITA INC	9,056	53.78	487,031.68
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	51.56	1,040,893.28
DEXCOM INC	7,827	175.00	1,369,725.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,839	214.89	3,833,422.71
HCA HEALTHCARE INC	22,986	117.40	2,698,556.40
HENRY SCHEIN INC	12,492	60.46	755,266.32
HOLOGIC INC	24,459	48.26	1,180,391.34
HUMANA INC	11,566	272.06	3,146,645.96
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	284.77	2,051,767.85
INTUITIVE SURGICAL INC	9,879	495.02	4,890,302.58
LABORATORY CRP OF AMER	8,827	163.93	1,447,010.11
MCKESSON CORP	16,655	138.75	2,310,881.25
MEDTRONIC PLC	114,560	107.54	12,319,782.40
QUEST DIAGNOSTICS	11,580	100.46	1,163,326.80
RESMED INC	12,398	135.98	1,685,880.04
STERIS PLC	7,229	153.02	1,106,181.58
STRYKER CORP	28,773	218.51	6,287,188.23
TELEFLEX INC	3,971	359.99	1,429,520.29
THE COOPER COS INC	4,135	326.39	1,349,622.65
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,179	222.93	18,097,234.47
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	140.68	1,019,648.64
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	105.49	868,921.13
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,982	163.41	1,794,568.62
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,403	265.24	1,167,851.72
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,342	134.50	2,332,499.00

ABBVIE INC	126,373	65.67	8,298,914.91
AGILENT TECHNOLOGIES	27,387	69.48	1,902,848.76
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,048	110.16	2,098,327.68
ALKERMES PLC	12,547	20.05	251,567.35
ALLERGAN PLC	27,804	160.77	4,470,049.08
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,585	82.21	787,982.85
AMGEN	52,414	206.49	10,822,966.86
BEIGENE LTD-ADR	3,149	141.61	445,929.89
BIOGEN INC	16,410	220.79	3,623,163.90
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,192	74.68	1,209,218.56
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	139,879	47.93	6,704,400.47
CELGENE CORP	59,466	96.70	5,750,362.20
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	30,661	25.62	785,534.82
EXACT SCIENCES CORP	10,748	119.01	1,279,119.48
GILEAD SCIENCES INC	108,729	63.31	6,883,632.99
ILLUMINA INC	12,589	285.02	3,588,116.78
INCYTE CORP	16,120	80.26	1,293,791.20
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,236	66.14	743,149.04
IQVIA HOLDINGS INC	14,255	153.66	2,190,423.30
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	125.18	622,269.78
JOHNSON & JOHNSON	226,749	129.64	29,395,740.36
LILLY (ELI) & CO	74,693	110.73	8,270,755.89
MERCK & CO	219,928	85.52	18,808,242.56
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,025	647.23	1,310,640.75
MYLAN NV	42,644	18.67	796,163.48
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	16.91	228,403.37
PERKINELMER INC	9,475	80.20	759,895.00
PERRIGO CO PLC	11,333	45.43	514,858.19
PFIZER	474,281	34.34	16,286,809.54
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,921	281.41	1,947,638.61
SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,448	92.15	594,183.20
SEATTLE GENETICS INC	9,601	74.78	717,962.78
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	94,834	6.71	636,336.14
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,187	272.93	9,330,657.91
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,634	178.25	3,856,260.50
WATERS CORP	5,663	204.19	1,156,327.97
ZOETIS INC	40,953	125.24	5,128,953.72
BANK OF AMERICA CORP	770,049	26.47	20,383,197.03
BB&T CORP	64,191	45.67	2,931,602.97
CIT GROUP INC	7,038	41.29	290,599.02
CITIGROUP	197,425	61.66	12,173,225.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	31.89	1,275,918.90

COMERICA INC	14,360	58.80	844,368.00
EAST WEST BANCORP INC	13,827	37.83	523,075.41
FIFTH THIRD BANCORP	63,013	25.30	1,594,228.90
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,126	88.55	1,250,857.30
HUNTINGTON BANCSHARES INC	85,663	12.56	1,075,927.28
JPMORGAN CHASE & CO	276,504	105.74	29,237,532.96
KEY CORP	87,033	15.81	1,375,991.73
M & T BANK CORP	10,559	143.86	1,519,017.74
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	13.94	511,876.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,554	124.13	4,785,708.02
REGIONS FINL CORP	83,851	13.85	1,161,336.35
SIGNATURE BANK	4,354	112.76	490,957.04
SUNTRUST BANKS	38,353	59.61	2,286,222.33
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	184.71	810,876.90
US BANCORP	129,084	51.04	6,588,447.36
WELLS FARGO & CO	364,038	44.75	16,290,700.50
ZIONS BANCORPORATION	15,186	39.49	599,695.14
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	74.84	331,765.72
ALLY FINANCIAL INC	36,028	30.49	1,098,493.72
AMERICAN EXPRESS	60,573	117.75	7,132,470.75
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	125.24	1,484,094.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,694	19.85	450,475.90
BANK NEW YORK CO	71,617	40.95	2,932,716.15
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	110,807	198.35	21,978,568.45
BLACKROCK INC	9,909	410.51	4,067,743.59
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,520	83.11	3,284,507.20
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	120.06	1,136,968.20
CME GROUP INC	30,553	216.22	6,606,169.66
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,947	77.49	2,088,123.03
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	39.64	836,721.12
EATON VANCE CORP	10,061	40.46	407,068.06
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,260	273.73	892,359.80
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	25.95	676,516.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,130	198.07	5,571,709.10
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,352	93.12	4,409,418.24
INVESCO LTD	30,943	15.31	473,737.33
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	18.04	463,736.24
KKR & CO INC -A	42,145	25.66	1,081,440.70
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,212	405.68	1,303,044.16
MOODY'S CORP	14,592	213.27	3,112,035.84
MORGAN STANLEY	108,193	39.79	4,304,999.47
MSCI INC	7,262	231.23	1,679,192.26

NASDAQ INC	9,996	98.27	982,306.92
NORTHERN TRUST CORP	17,320	84.49	1,463,366.80
PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	107.08	2,148,667.28
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,942	75.66	827,871.72
S&P GLOBAL INC	20,750	257.26	5,338,145.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,845	36.12	3,678,641.40
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	55.83	603,075.66
STATE STREET CORP	32,349	49.40	1,598,040.60
SYNCHRONY FINANCIAL	53,095	31.39	1,666,652.05
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	42.50	994,670.00
VOYA FINANCIAL INC	12,505	48.86	610,994.30
AFLAC	63,745	48.98	3,122,230.10
ALLEGHANY CORP	1,276	744.90	950,492.40
ALLSTATE CORP	28,490	102.63	2,923,928.70
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,013	100.06	701,720.78
AMERICAN INT'L GROUP	74,317	52.74	3,919,478.58
AON PLC	20,104	191.14	3,842,678.56
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	39.11	1,351,289.61
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	88.04	1,318,134.88
ASSURANT INC	4,769	120.86	576,381.34
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	37.56	501,313.32
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,416	34.62	360,601.92
CHUBB LTD	38,690	155.53	6,017,455.70
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,306	110.39	1,468,849.34
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	212.69	460,686.54
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	245.55	823,329.15
FNF GROUP	24,961	43.72	1,091,294.92
GLOBE LIFE INC	8,473	86.52	733,083.96
HARTFORD FINANCIAL SVCS	31,710	58.55	1,856,620.50
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	51.42	914,761.80
LOEWS CORP	22,051	47.45	1,046,319.95
MARKEL CORP	1,132	1,126.34	1,275,016.88
MARSH & MCLENNAN COS	43,684	97.56	4,261,811.04
METLIFE INC	67,515	43.86	2,961,207.90
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	52.51	1,215,869.05
PROGRESSIVE CORP	49,905	74.96	3,740,878.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,732	78.29	2,719,168.28
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	148.84	808,350.04
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,822	186.44	712,573.68
TRAVELERS COS INC/THE	22,051	147.10	3,243,702.10
UNUM GROUP	18,574	25.16	467,321.84
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	191.26	2,090,471.80

MR BERKLEY CORP	12,637	71.78	907,083.86
CBRE GROUP INC-A	26,855	49.33	1,324,757.15
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.48	540,876.00
JONES LANG LASALLE INC	4,484	130.05	583,144.20
WEYERHAEUSER CO	62,107	25.05	1,555,780.35
ACCENTURE PLC-CL A	54,403	197.16	10,726,095.48
ADOBE INC	41,615	289.45	12,045,461.75
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	88.21	1,250,641.38
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	122.08	490,273.28
ANSYS INC	6,865	211.04	1,448,789.60
AUTODESK INC	18,836	150.21	2,829,355.56
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,793	166.85	6,138,912.05
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	129.45	1,249,192.50
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,110	67.11	1,618,022.10
CDK GLOBAL INC	10,687	42.31	452,166.97
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	106.72	1,152,682.72
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	92.41	1,049,038.32
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,363	59.70	2,887,271.10
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	111.90	346,890.00
DOCUSIGN INC	8,693	44.76	389,098.68
DROPBOX INC-CLASS A	16,247	17.53	284,809.91
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	31.76	746,296.48
EPAM SYSTEMS INC	4,620	188.90	872,718.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	52,366	136.73	7,160,003.18
FISERV INC	49,096	106.98	5,252,290.08
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,292	292.57	2,133,420.44
FORTINET INC	12,963	80.86	1,048,188.18
GARTNER INC	7,761	130.53	1,013,043.33
GLOBAL PAYMENTS INC	13,420	162.22	2,176,992.40
GODADDY INC - CLASS A	14,919	64.00	954,816.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,631	131.17	9,920,518.27
INTUIT INC	22,128	283.21	6,266,870.88
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,658	142.60	949,430.80
LEIDOS HOLDINGS	10,999	85.03	935,244.97
MASTERCARD INC-CLASS A	77,481	276.64	21,434,343.84
MICROSOFT CORP	620,342	135.74	84,205,223.08
MONGODB INC	3,652	150.21	548,566.92
OKTA INC	8,635	135.07	1,166,329.45
ORACLE CORP	204,053	52.39	10,690,336.67
PALO ALTO NETWORKS INC	8,064	202.08	1,629,573.12
PAYCHEX INC	27,697	80.66	2,234,040.02
PAYCOM SOFTWARE INC	4,238	255.10	1,081,113.80

PAYPAL HOLDINGS INC	95,208	107.45	10,230,099.60
PTC INC	9,984	64.92	648,161.28
SABRE CORP	24,114	23.00	554,622.00
SALESFORCE.COM INC	70,919	153.57	10,891,030.83
SERVICENOW INC	15,779	266.21	4,200,527.59
SPLUNK INC	12,887	112.97	1,455,844.39
SQUARE INC - A	27,989	61.75	1,728,320.75
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,645	45.32	890,311.40
SYMANTEC CORP	53,148	23.07	1,226,124.36
SYNOPSYS INC	12,264	136.69	1,676,366.16
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,218	131.26	1,866,254.68
TWILIO INC - A	9,579	131.48	1,259,446.92
VERISIGN INC	9,194	203.79	1,873,645.26
VISA INC-CLASS A SHARES	148,232	178.38	26,441,624.16
VMWARE INC-CLASS A	6,787	130.56	886,110.72
WESTERN UNION CO	38,757	21.87	847,615.59
WIX.COM LTD	3,961	145.64	576,880.04
WORKDAY INC-CLASS A	13,860	188.35	2,610,531.00
AMPHENOL CORPORATION	25,582	85.04	2,175,493.28
APPLE INC	392,086	204.16	80,048,277.76
ARISTA NETWORKS INC	4,324	223.78	967,624.72
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	67.38	449,155.08
CDW CORP/DE	12,482	112.58	1,405,223.56
CISCO SYSTEMS	366,517	46.79	17,149,330.43
COGNEX CORP	16,230	43.04	698,539.20
CORNING	66,228	27.07	1,792,791.96
DELL TECHNOLOGIES -C	13,890	45.60	633,384.00
F5 NETWORKS INC	5,350	122.07	653,074.50
FLEX LTD	40,465	9.11	368,636.15
FLIR SYSTEMS INC	11,686	47.56	555,786.16
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,105	12.93	1,449,517.65
HP INC	124,838	17.73	2,213,377.74
IPG PHOTONICS CORP	3,207	116.52	373,679.64
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	22.85	715,296.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	94.51	1,498,267.03
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,936	178.51	2,487,715.36
NETAPP INC	20,586	46.51	957,454.86
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	46.94	1,071,921.84
TE CONNECTIVITY LTD	28,434	89.66	2,549,392.44
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	36.17	745,897.74
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	52.66	1,241,564.82
XEROX HOLDINGS CORP	16,718	27.49	459,577.82

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,600	198.59	913,514.00
AT&T INC	622,137	34.72	21,600,596.64
CENTURYLINK INC	83,301	11.36	946,299.36
SPRINT CORP	64,825	6.70	434,327.50
T-MOBILE US INC	28,273	77.12	2,180,413.76
VERIZON COMMUNICATIONS	352,577	57.18	20,160,352.86
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	20,398	33.89	691,288.22
AES CORP	52,646	14.61	769,158.06
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	52.34	1,007,859.04
AMEREN CORPORATION	21,002	75.75	1,590,901.50
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,422	90.67	3,755,732.74
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,471	125.10	1,935,422.10
ATMOS ENERGY CORP	9,385	108.04	1,013,955.40
CENTERPOINT ENERGY INC	42,792	27.28	1,167,365.76
CMS ENERGY CORP	24,527	62.56	1,534,409.12
CONSOLIDATED EDISON INC	27,494	88.04	2,420,571.76
DOMINION ENERGY INC	68,162	77.15	5,258,698.30
DTE ENERGY COMPANY	15,603	130.40	2,034,631.20
DUKE ENERGY CORP	62,154	92.15	5,727,491.10
EDISON INTL	30,299	73.33	2,221,825.67
ENTERGY CORP	15,636	112.10	1,752,795.60
EVERGY INC	21,330	65.29	1,392,635.70
EVERSOURCE ENERGY	27,188	80.56	2,190,265.28
EXELON CORP	82,975	46.24	3,836,764.00
FIRSTENERGY CORP	45,526	45.43	2,068,246.18
NEXTERA ENERGY INC	40,857	224.01	9,152,376.57
NISOURCE INC	32,308	29.24	944,685.92
NRG ENERGY INC	23,078	35.37	816,268.86
OGE ENERGY CORP	15,686	42.70	669,792.20
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	94.50	889,812.00
PPL CORPORATION	59,613	29.18	1,739,507.34
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,254	59.46	2,571,882.84
SEMPRA ENERGY	23,257	141.43	3,289,237.51
SOUTHERN CO	88,512	57.76	5,112,453.12
UGI CORP	18,019	47.55	856,803.45
VISTRA ENERGY CORP	29,561	23.99	709,168.39
WEC ENERGY GROUP INC	26,996	95.31	2,572,988.76
XCEL ENERGY INC	44,029	63.99	2,817,415.71
ADVANCED MICRO DEVICES	87,922	30.20	2,655,244.40
ANALOG DEVICES	31,611	107.05	3,383,957.55
APPLIED MATERIALS	80,718	45.51	3,673,476.18
BROADCOM INC	33,768	275.57	9,305,447.76

	INTEL CORP	381,705	45.79	17,478,271.95
	KLA CORP	13,856	142.42	1,973,371.52
	LAM RESEARCH CORP	12,864	199.77	2,569,841.28
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	54,737	23.51	1,286,866.87
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,423	52.76	1,235,797.48
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,744	84.35	1,749,756.40
	MICRON TECHNOLOGY	95,275	42.44	4,043,471.00
	NVIDIA CORP	49,363	161.80	7,986,933.40
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,078	98.72	2,475,700.16
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	17.23	620,211.08
	QORVO INC	10,609	70.21	744,857.89
	QUALCOMM	103,733	73.97	7,673,130.01
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	72.87	1,057,343.70
	TEXAS INSTRUMENTS	80,031	122.18	9,778,187.58
	XILINX INC	21,744	100.22	2,179,183.68
	アメリカドル 小計	25,759,072		2,077,324,655.11 (219,635,535,784)
カナダドル	CAMECO CORP	28,709	11.17	320,679.53
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,328	30.12	3,112,239.36
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	10.99	1,062,359.34
	ENBRIDGE	172,807	43.75	7,560,306.25
	ENCANA CORP	138,637	5.74	795,776.38
	HUSKY ENERGY INC	31,439	8.86	278,549.54
	IMPERIAL OIL	24,763	31.71	785,234.73
	INTER PIPELINE LTD	35,455	24.07	853,401.85
	KEYERA CORP	18,607	31.90	593,563.30
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	47.07	1,989,931.32
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	16.25	298,187.50
	SUNCOR ENERGY	134,430	37.26	5,008,861.80
	TC ENERGY CORP	79,239	65.53	5,192,531.67
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	12.26	244,770.90
	VERMILION ENERGY INC	10,067	18.52	186,440.84
	AGNICO EAGLE MINES	21,459	85.17	1,827,663.03
	BARRICK GOLD CORP	149,092	26.27	3,916,646.84
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	59.02	775,463.78
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	7.89	448,941.00
	FRANCO-NEVADA CORP	16,758	130.89	2,193,454.62
	KINROSS GOLD CORP	107,615	6.86	738,238.90
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	17,033	66.50	1,132,694.50
	LUNDIN MINING CORP	62,243	5.98	372,213.14
	METHANEX CORP	7,099	40.82	289,781.18
	NUTRIEN LTD	51,428	64.85	3,335,105.80

TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	22.03	1,006,264.31
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	44.28	191,599.56
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	39.72	1,463,205.36
BOMBARDIER B	151,366	1.70	257,322.20
CAE INC	25,999	33.55	872,266.45
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	16.05	236,143.65
WSP GLOBAL INC	9,471	69.88	661,833.48
THOMSON REUTERS CORP	16,142	89.47	1,444,224.74
AIR CANADA	11,591	42.71	495,051.61
CANADIAN NATL RAILWAY CO	61,174	120.78	7,388,595.72
CP RAILWAY LIMITED	11,825	314.38	3,717,543.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	64.36	1,800,664.08
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	48.15	850,280.85
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,365	102.64	2,192,903.60
STARS GROUP INC/THE	20,487	19.28	394,989.36
QUEBECOR INC -CL B	15,200	29.55	449,160.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	25.01	899,034.47
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	135.15	731,026.35
DOLLARAMA INC	26,700	51.34	1,370,778.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	36,158	81.78	2,957,001.24
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	36.79	561,157.87
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	71.61	1,118,404.98
METRO INC	22,050	55.05	1,213,852.50
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	107.29	738,477.07
SAPUTO INC	20,412	39.40	804,232.80
AURORA CANNABIS INC	53,000	7.40	392,200.00
CANOPY GROWTH CORP	16,400	31.18	511,352.00
CRONOS GROUP INC	15,900	14.69	233,571.00
BANK MONTREAL	54,609	89.21	4,871,668.89
BANK NOVA SCOTIA	104,375	68.57	7,156,993.75
CANADIAN IMPERIAL BANK	37,990	100.23	3,807,737.70
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	60.45	1,706,382.60
ROYAL BANK OF CANADA	122,426	97.92	11,987,953.92
TORONTO-DOMINION BANK	156,017	71.83	11,206,701.11
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	72,274	67.72	4,894,395.28
CI FINANCIAL CORP	18,671	19.38	361,843.98
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.30	271,280.50
ONEX CORP	6,603	76.79	507,044.37
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	580.67	1,338,444.35
GREAT-WEST LIFE CO INC	23,788	28.24	671,773.12
IA FINANCIAL CORP INC	8,230	54.23	446,312.90
INTACT FINANCIAL CORP	11,102	130.21	1,445,591.42

	MANULIFE FINANCIAL CORP	168,472	21.51	3,623,832.72	
	POWER CORP OF CANADA	29,774	27.14	808,066.36	
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	27.57	571,801.80	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	48,943	53.00	2,593,979.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	21.99	274,105.35	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	8.96	353,024.00	
	CGI INC - CL A	21,192	103.97	2,203,332.24	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	1,282.60	2,181,702.60	
	OPEN TEXT CORP	24,643	51.42	1,267,143.06	
	SHOPIFY INC - CLASS A	8,392	541.49	4,544,184.08	
	BCE INC	12,539	61.54	771,650.06	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	32,095	65.16	2,091,310.20	
	TELUS CORP	16,454	46.88	771,363.52	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	17.82	434,718.90	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	47.35	248,161.35	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	38.32	395,615.68	
	EMERA INC	20,611	56.53	1,165,139.83	
	FORTIS INC	38,447	54.83	2,108,049.01	
	HYDRO ONE LTD	32,299	24.41	788,418.59	
	カナダドル 小計	3,441,476		156,135,896.09 (12,414,365,098)	
ユーロ	ENI	217,599	13.30	2,894,501.89	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	12.53	499,533.51	
	NESTE OIL OYJ	36,438	28.91	1,053,422.58	
	OMV AG	12,139	45.40	551,110.60	
	REPSOL SA	129,100	12.55	1,620,205.00	
	TENARIS SA	40,648	9.93	403,715.93	
	TOTAL SA	204,013	43.96	8,969,431.54	
	VOPAK	6,360	42.87	272,653.20	
	AIR LIQUIDE	36,297	123.70	4,489,938.90	
	AKZO NOBEL	19,742	81.05	1,600,089.10	
	ARCELORMITTAL	53,985	12.41	670,061.82	
	ARKEMA	5,335	76.96	410,581.60	
	BASF SE	77,211	58.24	4,496,768.64	
	COVESTRO AG	15,098	39.39	594,710.22	
	CRH PLC	71,124	29.50	2,098,158.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	22.39	301,235.06	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	31.82	183,346.84	
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,833	60.80	719,446.40	
	IMERYS SA	3,000	36.32	108,960.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,234	110.80	1,687,927.20	
	LANXESS	7,293	51.78	377,631.54	

SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	27.62	540,385.30
SOLVAY SA	6,906	88.74	612,838.44
STORA ENSO OYJ R	47,237	9.76	461,033.12
SYMRISE AG	11,581	81.50	943,851.50
THYSSEN KRUPP	33,044	10.57	349,275.08
UMICORE	17,605	26.70	470,053.50
UPM KYMMENE OYJ	43,990	23.20	1,020,568.00
VOESTALPINE AG	8,140	20.26	164,916.40
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,695	33.70	731,121.50
AIRBUS SE	49,825	122.56	6,106,552.00
ALSTOM	13,816	38.54	532,468.64
ANDRITZ AG	5,242	32.40	169,840.80
BOUYGUES ORD	19,381	32.72	634,146.32
BRENTAG AG	11,626	42.04	488,757.04
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	8.37	778,627.62
DASSAULT AVIATION SA	213	1,262.00	268,806.00
EIFFAGE	6,079	92.20	560,483.80
FERROVIAL SA	39,067	25.86	1,010,272.62
GEA GROUP AG	13,382	23.96	320,632.72
HOCHTIEF AG	2,222	98.65	219,200.30
KINGSPAN GROUP PLC	11,813	42.22	498,744.86
KION GROUP AG	5,887	42.48	250,079.76
KNORR-BREMSE AG	4,123	84.50	348,393.50
KONE OYJ-B	30,120	51.16	1,540,939.20
LEGRAND SA	21,794	62.60	1,364,304.40
LEONARDO SPA	35,425	10.31	365,408.87
METSO OYJ	9,561	32.35	309,298.35
MTU AERO ENGINES AG	4,753	245.80	1,168,287.40
PRYSMIAN SPA	21,155	19.05	403,108.52
SAFRAN SA	27,984	128.25	3,588,948.00
SAINT-GOBAIN	40,731	31.80	1,295,245.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,063	73.62	3,391,158.06
SIEMENS	65,307	89.00	5,812,323.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	12.24	214,177.29
THALES SA	9,665	106.10	1,025,456.50
VINCI S.A.	43,091	97.82	4,215,161.62
WARTSILA OYJ	34,386	10.62	365,179.32
BUREAU VERITAS SA	25,073	21.48	538,568.04
EDENRED	18,941	44.78	848,177.98
RANDSTAD NV	9,588	41.80	400,778.40
SOCIETE BIC SA	2,424	58.50	141,804.00
TELEPERFORMANCE	5,057	194.70	984,597.90

WOLTERS KLUWER	22,886	64.80	1,483,012.80
ADP	2,382	154.90	368,971.80
AENA SME SA	5,610	164.25	921,442.50
ATLANTIA SPA	42,039	22.79	958,068.81
BOLLORE	61,805	3.85	237,949.25
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	13.85	322,317.20
DEUTSCHE POST AG-REG	84,986	29.22	2,483,715.85
FRAPORT AG	3,561	74.58	265,579.38
GETLINK	36,478	12.64	461,081.92
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,946	59.49	1,721,997.54
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	47.56	237,371.96
CONTINENTAL AG	9,928	107.88	1,071,032.64
DAIMLER AG	77,754	41.54	3,229,901.16
FAURECIA	5,945	37.05	220,262.25
FERRARI NV	9,947	144.95	1,441,817.65
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,379	11.60	1,117,996.40
MICHELIN	14,695	92.40	1,357,818.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	25.44	261,828.48
PEUGEOT SA	52,883	19.69	1,041,266.27
PIRELLI & C SPA	39,097	4.84	189,503.15
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	56.00	785,568.00
RENAULT SA	17,362	51.66	896,920.92
VALEO SA	19,350	24.04	465,174.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,999	143.50	2,295,856.50
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	146.15	379,113.10
ADIDAS AG	15,411	264.10	4,070,045.10
ESSILORLUXOTTICA	24,247	132.85	3,221,213.95
HERMES INTERNATIONAL	2,600	618.00	1,606,800.00
HUGO BOSS AG	4,852	50.72	246,093.44
KERING	6,332	430.05	2,723,076.60
LVMH	23,706	359.85	8,530,604.10
MONCLER SPA	15,736	34.21	538,328.56
PUMA SE	7,720	67.70	522,644.00
SEB SA	2,075	140.80	292,160.00
ACCOR	17,931	38.51	690,522.81
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,143	75.02	535,867.86
SODEXO	8,135	101.55	826,109.25
AXEL SPRINGER SE-TEND	3,827	62.50	239,187.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	15.66	187,544.16
JC DECAUX SA	4,674	25.00	116,850.00
PUBLICIS GROUPE	17,601	43.10	758,603.10
RTL GROUP	3,513	42.00	147,546.00

SES	31,369	14.41	452,027.29
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	43.66	218,212.68
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	72.54	495,448.20
VIVENDI	77,307	25.31	1,956,640.17
DELIVERY HERO SE	8,671	44.03	381,784.13
INDITEX	93,820	27.16	2,548,151.20
ZALANDO SE	9,155	43.93	402,179.15
CARREFOUR	53,759	15.39	827,619.80
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	36.43	134,317.41
COLRUYT SA	4,160	46.21	192,233.60
JERONIMO MARTINS	20,234	14.30	289,346.20
KONINKLIJKE AHOLD NV	98,234	20.77	2,040,811.35
METRO AG	13,712	14.16	194,230.48
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,052	85.16	5,539,828.32
DANONE (GROUPE)	52,307	80.60	4,215,944.20
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	8.46	359,769.96
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	88.55	947,573.55
HEINEKEN NV	22,649	94.88	2,148,937.12
KERRY GROUP PLC-A	13,146	109.10	1,434,228.60
PERNOD-RICARD	18,169	166.00	3,016,054.00
REMY COINTREAU	1,575	132.20	208,215.00
BEIERSDORF AG	9,190	113.00	1,038,470.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	81.40	701,505.20
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,736	88.76	1,396,727.36
LOREAL	21,584	244.10	5,268,654.40
UNILEVER NV	123,171	55.14	6,791,648.94
BIOMERIEUX	3,246	73.80	239,554.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	105.10	360,493.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	60.30	1,085,158.80
FRESENIUS SE&CO KGAA	36,747	43.96	1,615,398.12
KONINKLIJKE PHILIPS	79,182	41.93	3,320,101.26
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	179.00	581,034.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	35.86	448,312.50
BAYER	79,624	66.98	5,333,215.52
EUROFINS SCIENTIFIC	971	378.40	367,426.40
GRIFOLS SA	27,685	28.84	798,435.40
IPSEN	2,722	92.30	251,240.60
MERCK KGAA	10,480	95.74	1,003,355.20
ORION OYJ-CLASS B	7,975	34.37	274,100.75
QIAGEN N.V.	21,801	31.22	680,627.22
RECORDATI SPA	7,493	40.97	306,988.21
SANOFI	96,027	77.87	7,477,622.49

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,004	137.90	414,251.60
UCB (GROUPE)	10,465	67.70	708,480.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	33,189	16.01	531,521.83
AIB GROUP PLC	70,200	2.28	160,617.60
BANCO BILBAO VIZCAYA	556,129	4.29	2,386,071.47
BANCO DE SABADELL SA	442,961	0.76	339,396.71
BANCO SANTANDER SA	1,366,379	3.46	4,735,186.42
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,000	3.45	289,800.00
BANKIA SA	110,053	1.64	181,257.29
BANKINTER SA	58,881	5.31	313,129.15
BNP PARIBAS	94,302	40.32	3,802,728.15
CAIXABANK	286,347	2.04	586,438.65
COMMERZBANK AG	80,494	4.95	398,847.77
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	10.08	935,766.72
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	30.03	827,626.80
FINECOBANK SPA	53,120	9.36	497,309.44
ING GROEP NV-CVA	332,029	8.49	2,820,586.35
INTESA SANPAOLO	1,286,795	1.94	2,506,934.01
KBC GROEP NV	21,492	51.72	1,111,566.24
MEDIOBANCA	53,990	8.80	475,543.92
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	20.44	255,295.60
SOCIETE GENERALE	63,719	22.42	1,428,898.57
UNICREDIT SPA	172,440	9.71	1,675,944.36
AMUNDI SA	4,764	57.70	274,882.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	6.42	1,035,427.30
DEUTSCHE BOERSE	15,674	128.95	2,021,162.30
EURAZEO SA	3,357	60.00	201,420.00
EXOR NV	10,345	60.08	621,527.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	82.96	518,251.12
NATIXIS	69,996	3.46	242,536.14
WENDEL	2,023	125.00	252,875.00
AEGON	166,267	3.47	577,777.82
AGEAS	16,065	48.57	780,277.05
ALLIANZ SE-REG	36,222	198.76	7,199,484.72
ASSICURAZIONI GENERALI	89,649	16.43	1,472,933.07
AXA	165,661	21.25	3,521,124.55
CNP ASSURANCES	11,830	16.39	193,893.70
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	146.70	690,370.20
MAPFRE SA	90,939	2.41	219,890.50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	217.70	2,757,170.50
NN GROUP NV	27,631	30.37	839,153.47
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.49	437,240.43

SAMPO OYJ-A SHS	38,075	36.68	1,396,591.00
SCOR SE	13,354	36.34	485,284.36
AROUNDTOWN SA	79,006	7.47	590,174.82
DEUTSCHE WOHNEN SE	29,009	29.50	855,765.50
VONOVIA SE	43,528	43.86	1,909,138.08
ADYEN NV	884	649.00	573,716.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,510	67.04	2,447,630.40
ATOS SE	7,634	67.38	514,378.92
CAPGEMINI SA	13,238	107.45	1,422,423.10
DASSAULT SYSTEMES SA	11,300	128.50	1,452,050.00
SAP SE	83,843	108.54	9,100,319.22
WIRECARD AG	9,864	144.75	1,427,814.00
WORLDLINE SA	7,022	61.60	432,555.20
INGENICO GROUP	4,681	89.52	419,043.12
NOKIA OYJ	489,813	4.47	2,193,382.61
1&1 DRILLISCH AG	3,773	24.32	91,759.36
CELLNEX TELECOM SA	16,559	36.92	611,358.28
DEUTSCHE TELEKOM	279,433	14.90	4,163,551.70
ELISA A	11,722	45.43	532,530.46
ILIAD SA	2,053	94.74	194,501.22
KPN (KON.)	308,450	2.79	862,426.20
ORANGE	170,925	13.52	2,310,906.00
PROXIMUS	13,141	26.44	347,448.04
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.46	397,630.25
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.44	207,146.76
TELEFONICA	400,024	6.14	2,457,347.43
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	2.24	150,608.78
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	28.53	271,405.89
E.ON SE	183,255	8.34	1,528,896.46
ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	10.58	526,206.88
ENAGAS	18,299	20.13	368,358.87
ENDESA	24,774	23.44	580,702.56
ENEL	694,781	6.49	4,515,381.71
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,913	3.37	795,026.81
ENGIE	156,560	13.66	2,138,609.60
FORTUM OYJ	38,328	19.90	762,918.84
IBERDROLA SA	512,842	9.30	4,771,481.96
INNOGY SE	11,000	44.75	492,250.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,130	23.96	554,194.80
RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.89	709,016.48
RWE STAMM	47,044	25.90	1,218,439.60
SNAM SPA	163,694	4.56	746,935.72

	SUEZ	28,043	13.56	380,403.29
	TERNA SPA	130,230	5.73	746,217.90
	UNIPER SE	14,751	27.56	406,537.56
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	21.56	986,197.52
	VERBUND AG	7,463	54.50	406,733.50
	ASML HOLDING NV	36,326	193.46	7,027,627.96
	INFINEON TECHNOLOGIES	107,254	15.22	1,632,405.88
	STMICROELECTRONICS	57,598	15.78	908,896.44
	ユーロ 小計	16,451,299		317,532,712.04 (37,214,833,851)
イギリスポンド	BP PLC	1,735,604	4.88	8,470,615.32
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	372,635	22.48	8,376,834.80
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	319,578	22.43	7,168,134.54
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	3.90	210,654.00
	ANGLO AMERICAN PLC	87,419	16.90	1,477,730.77
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.10	290,577.02
	BHP GROUP PLC	180,556	16.72	3,019,979.65
	CRODA INTERNATIONAL PLC	9,999	45.64	456,354.36
	EVRAZ PLC	43,000	4.83	207,733.00
	FRESNILLO PLC	17,743	6.97	123,775.16
	GLENCORE PLC	941,686	2.23	2,107,493.26
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	28.33	477,303.84
	MONDI PLC	42,009	15.96	670,463.64
	RIO TINTO PLC REG	96,995	39.34	3,816,268.27
	ASHTREAD GROUP PLC	42,021	21.53	904,712.13
	BAE SYSTEMS PLC	274,735	5.41	1,486,316.35
	BUNZL PLC	27,712	20.27	561,722.24
	DCC PLC	9,127	68.94	629,215.38
	FERGUSON PLC	19,208	58.84	1,130,198.72
	MEGGITT PLC	66,268	6.14	406,885.52
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.67	685,643.75
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	149,025	7.48	1,115,601.15
	SMITHS GROUP PLC	37,146	15.72	584,120.85
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,277	77.95	489,292.15
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	13.89	258,159.54
	EXPERIAN PLC	77,938	25.35	1,975,728.30
	G4S PLC	132,555	1.72	228,060.87
	INTERTEK GROUP PLC	12,722	53.32	678,337.04
	RELX PLC	163,442	19.49	3,185,484.58
	RENTOKIL INITIAL PLC	157,705	4.47	706,202.99
	EASYJET PLC	11,633	9.71	112,956.43
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	6.47	624,347.36

BURBERRY GROUP PLC	35,328	21.09	745,067.52
PERSIMMON PLC	26,389	19.30	509,307.70
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.48	401,564.46
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	39.67	420,462.33
CARNIVAL PLC	13,721	34.07	467,474.47
COMPASS GROUP PLC	136,301	20.75	2,828,245.75
GVC HOLDINGS PLC	42,500	6.10	259,590.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	50.86	815,845.26
MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.52	294,242.96
TUI AG-DI	37,945	8.25	313,273.92
WHITBREAD PLC	11,623	43.06	500,486.38
AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	5.35	428,213.52
INFORMA PLC	100,899	8.64	871,969.15
ITV PLC	295,435	1.14	336,795.90
PEARSON	66,305	8.09	536,407.45
WPP PLC	113,065	9.47	1,070,951.68
KINGFISHER PLC	170,994	1.93	330,018.42
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	1.89	256,458.64
NEXT PLC	11,202	58.82	658,901.64
OCADO GROUP PLC	38,762	12.36	479,098.32
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.82	381,466.67
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.96	291,107.43
TESCO	856,393	2.13	1,830,111.84
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	22.67	653,916.15
BRITISH AMERICAN TOBACCO	195,779	28.32	5,544,461.28
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.89	482,944.40
DIAGEO	204,601	34.44	7,047,481.44
IMPERIAL BRANDS PLC	83,245	20.61	1,716,095.67
RECKITT BENCKISER PLC	60,485	62.54	3,782,731.90
UNILEVER PLC	94,764	50.95	4,828,225.80
NMC HEALTH PLC	9,509	22.98	218,516.82
SMITH & NEPHEW PLC	75,051	19.37	1,454,113.12
ASTRAZENECA	111,905	72.40	8,101,922.00
GLAXOSMITHKLINE	425,577	16.87	7,180,335.14
BARCLAYS	1,471,691	1.36	2,011,507.25
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,725,998	5.80	10,026,322.38
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,968,726	0.49	2,970,038.05
ROYAL BANK OF SCOTLAND	395,524	1.84	728,357.44
STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.06	1,416,993.29
3I GROUP PLC	79,251	10.79	855,118.29
HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,021	19.09	515,830.89
INVESTEC PLC	54,280	4.13	224,339.24

	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	68.40	1,798,646.40
	SCHRODERS PLC	8,614	26.71	230,079.94
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	9.38	419,934.00
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	193,491	2.50	485,081.93
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	21.65	351,920.75
	AVIVA PIC	348,023	3.58	1,247,662.45
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.89	328,636.35
	LEGAL & GENERAL GROUP	490,014	2.19	1,076,560.75
	PRUDENTIAL	217,306	13.48	2,929,284.88
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.28	457,439.86
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	29,065	15.66	455,390.42
	SAGE GROUP PLC	89,321	6.93	618,994.53
	HALMA PLC	32,374	19.51	631,778.61
	BT GROUP PLC	730,298	1.60	1,168,476.80
	VODAFONE GROUP PLC	2,283,635	1.51	3,454,683.02
	CENTRICA PLC	440,558	0.66	293,675.96
	NATIONAL GRID PLC	291,880	8.54	2,492,947.08
	SEVERN TRENT PLC	18,112	20.52	371,658.24
	SSE PLC	93,277	11.28	1,052,630.94
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.95	468,175.50
	イギリスポンド 小計	25,433,297		147,756,873.35 (19,189,185,141)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.76	309,075.47
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	569.00	382,368.00
	GIVAUDAN-REG	813	2,580.00	2,097,540.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	45.81	1,847,700.54
	SIKA AG-BR	10,500	138.20	1,451,100.00
	ABB LTD	153,407	18.15	2,784,337.05
	GEBERIT AG-REG	3,021	439.90	1,328,937.90
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	217.20	321,238.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	217.90	821,047.20
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	51.42	679,978.08
	SGS SA	437	2,380.00	1,040,060.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	139.45	706,593.15
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	44,744	76.00	3,400,544.00
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	266.30	661,222.90
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	50.05	197,096.90
	DUFREY AG-REG	3,825	78.82	301,486.50
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,972.00	315,520.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	80,500.00	644,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,260.00	755,040.00
	NESTLE SA - REGISTERED	261,093	109.06	28,474,802.58

	ALCON INC	35,606	58.48	2,082,238.88
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,104	228.30	1,165,243.20
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	895	765.20	684,854.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,507	351.20	2,285,258.40
	NOVARTIS	183,180	88.21	16,158,307.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	59,906	271.80	16,282,450.80
	VIFOR PHARMA AG	3,601	155.35	559,415.35
	CREDIT SUISSE GROUP AG	218,862	11.19	2,449,065.78
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	37.78	800,067.06
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	69.75	236,940.75
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,608	793.20	1,275,465.60
	UBS GROUP AG	329,974	10.32	3,405,331.68
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	179.00	693,983.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	464.90	1,370,990.10
	SWISS RE LTD	26,239	98.58	2,586,640.62
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,930	347.20	4,489,296.00
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	98.75	619,853.75
	TEMENOS AG - REG	5,252	161.40	847,672.80
	SWISSCOM	2,064	484.70	1,000,420.80
	スイスフラン 小計	1,495,880		107,513,185.44 (11,583,470,599)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	279.70	3,969,222.70
	BOLIDEN AB	23,903	200.70	4,797,332.10
	ALFA LAVAL AB	25,639	170.95	4,382,987.05
	ASSA ABLOY AB-B	85,980	206.10	17,720,478.00
	ATLAS COPCO A	59,675	274.80	16,398,690.00
	ATLAS COPCO B	36,538	247.10	9,028,539.80
	EPIROC AB-A	53,833	98.70	5,313,317.10
	EPIROC AB-B	29,972	94.24	2,824,561.28
	SANDVIK AB	100,730	136.10	13,709,353.00
	SKANSKA B	28,530	179.65	5,125,414.50
	SKF AB-B	28,335	149.40	4,233,249.00
	VOLVO B	125,906	126.70	15,952,290.20
	SECURITAS B	22,844	144.70	3,305,526.80
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	218.80	3,975,596.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	74.36	2,878,624.32
	HENNES & MAURITZ B	69,119	180.30	12,462,155.70
	ICA GRUPPEN AB	7,959	484.40	3,855,339.60
	SWEDISH MATCH AB	15,149	377.90	5,724,807.10
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	52,085	293.60	15,292,156.00
	NORDEA BANK ABP	254,073	60.80	15,447,638.40
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	82.50	11,443,575.00

	SVENSKA HANDELSBK A	136,386	84.02	11,459,151.72	
	SWEDBANK AB-A	80,216	123.85	9,934,751.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	197.00	2,520,024.00	
	INVESTOR AB-B SHS	40,438	443.90	17,950,428.20	
	KINNEVIK AB - B	18,104	260.00	4,707,040.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	361.00	2,628,080.00	
	ERICSSON (LM) B	268,755	77.48	20,823,137.40	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	438.20	9,423,052.80	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	486.40	3,012,761.60	
	TELE2 AB-B SHS	38,012	139.00	5,283,668.00	
	TELIA CO AB	235,437	41.70	9,817,722.90	
	スウェーデンクローナ 小計	2,095,171		275,400,671.87 (3,010,129,343)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	10,311	226.40	2,334,410.40	
	EQUINOR ASA	80,907	151.00	12,216,957.00	
	NORSK HYDRO	106,150	27.66	2,936,109.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	374.80	5,048,556.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	255.20	1,778,999.20	
	MOWI ASA	40,968	220.80	9,045,734.40	
	ORKLA	69,804	83.00	5,793,732.00	
	DNB ASA	80,217	142.65	11,442,955.05	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	174.85	3,247,663.90	
	TELENOR ASA	60,821	185.65	11,291,418.65	
	ノルウェークローネ 小計	488,193		65,136,535.60 (764,051,562)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,079	553.00	5,020,687.00	
	NOVOZYMES A/S	17,687	271.50	4,802,020.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS	15,201	528.60	8,035,248.60	
	ISS A/S	14,253	167.00	2,380,251.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	6,820.00	2,039,180.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	7,210.00	3,662,680.00	
	DSV A/S	18,714	666.60	12,474,752.40	
	PANDORA A/S	8,431	317.60	2,677,685.60	
	CARLSBERG AS-B	9,692	985.00	9,546,620.00	
	COLOPLAST-B	10,223	810.40	8,284,719.20	
	DEMANT A/S	7,420	204.40	1,516,648.00	
	GENMAB A/S	5,595	1,372.50	7,679,137.50	
	H LUNDBECK A/S	4,871	245.00	1,193,395.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	150,997	353.60	53,392,539.20	
	DANSKE BANK A/S	59,378	87.72	5,208,638.16	
TRYG A/S	9,828	199.50	1,960,686.00		
ORSTED A/S	15,908	661.80	10,527,914.40		

	デンマーククローネ 小計	358,084		140,402,802.56 (2,207,132,056)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	24.66	508,711.14
	OIL SEARCH LTD	118,781	6.43	763,761.83
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	7.41	1,227,058.95
	SANTOS	156,437	7.00	1,095,059.00
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	20.15	258,181.95
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,590	30.96	2,587,946.40
	WORLEYPARSONS LTD	34,596	12.25	423,801.00
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.16	368,189.28
	BHP GROUP LTD	251,513	34.95	8,790,379.35
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	12.85	633,864.80
	BORAL LIMITED	81,732	4.07	332,649.24
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	7.55	1,016,803.80
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.14	472,880.86
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	22.44	838,425.72
	NEWCREST MINING LIMITED	66,006	35.51	2,343,873.06
	ORICA LTD	29,211	21.04	614,599.44
	RIO TINTO LTD	32,522	83.76	2,724,042.72
	SOUTH32 LTD	408,172	2.45	1,000,021.40
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	31.21	287,756.20
	BRAMBLES LTD	129,297	11.10	1,435,196.70
	SEEK LTD	26,358	20.07	529,005.06
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	5.84	931,404.08
	TRANSURBAN GROUP	229,164	14.90	3,414,543.60
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	29.36	1,548,798.72
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.10	366,968.80
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	47.88	156,232.44
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.63	772,496.98
	REA GROUP LTD	3,593	104.77	376,438.61
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	4.76	214,975.88
	WESFARMERS LTD	97,071	39.10	3,795,476.10
	COLES GROUP LTD	93,277	13.56	1,264,836.12
	WOOLWORTHS GROUP LTD	107,751	35.97	3,875,803.47
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	10.77	496,820.10	
TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	17.89	1,044,328.75	
COCHLEAR LIMITED	4,811	211.08	1,015,505.88	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	67.70	829,189.60	
SONIC HEALTHCARE LTD	38,989	28.59	1,114,695.51	
CSL LIMITED	38,683	234.05	9,053,756.15	
AUST AND NZ BANKING GROUP	242,083	26.38	6,386,149.54	
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	9.05	322,180.00	

	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.98	465,925.32	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	151,067	77.15	11,654,819.05	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	237,761	27.30	6,490,875.30	
	WESTPAC BANKING	294,403	27.62	8,131,410.86	
	AMP LTD	244,230	1.66	405,421.80	
	ASX LTD	15,814	85.23	1,347,827.22	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	6.60	290,848.80	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	26,817	123.51	3,312,167.67	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	50.91	555,529.92	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	7.98	1,670,652.90	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	3.56	763,662.72	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	12.28	1,388,782.04	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	13.50	1,389,433.50	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	15.23	675,846.48	
	TELSTRA CORP	342,339	3.74	1,280,347.86	
	TPG TELECOM LTD	31,475	6.54	205,846.50	
	AGL ENERGY LTD	51,344	18.69	959,619.36	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.76	212,205.95	
	オーストラリアドル 小計	5,931,661		106,434,031.48 (7,597,261,167)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	4.44	340,299.36	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	9.20	781,540.00	
	A2 MILK CO LTD	66,854	14.42	964,034.68	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	15.15	689,446.20	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	12.60	457,594.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.39	639,248.35	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.80	530,611.20	
	ニュージーランドドル 小計	566,266		4,402,773.99 (296,086,550)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	233,996	69.30	16,215,922.80	
	NWS HOLDINGS LTD	163,000	13.12	2,138,560.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	54.60	6,497,400.00	
	MTR CORP	133,000	46.65	6,204,450.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	20.70	1,417,950.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	187,000	48.75	9,116,250.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	11.52	774,144.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	35.50	7,199,400.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	8.10	793,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.50	990,000.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	15.98	2,249,984.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	64,000	36.85	2,358,400.00	
	WH GROUP LTD	829,500	6.42	5,325,390.00	

	BANK EAST ASIA	109,160	20.05	2,188,658.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	26.45	8,199,500.00	
	HANG SENG BANK	68,000	166.90	11,349,200.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,200	241.40	24,671,080.00	
	AIA GROUP LTD	1,031,200	75.35	77,700,920.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	54.30	11,728,582.80	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.46	3,020,580.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	36.85	4,614,651.80	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	32.60	1,923,400.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	27.10	1,747,950.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	9.86	4,846,190.00	
	SINO LAND CO	315,400	11.36	3,582,944.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	136,500	112.50	15,356,250.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	78.45	3,177,225.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	26.75	2,573,350.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	17.20	1,565,200.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	95,000	42.90	4,075,500.00	
	WHELOCK & CO LTD	65,000	46.10	2,996,500.00	
	PCCW LTD	357,000	4.27	1,524,390.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	54.25	2,712,500.00	
	CLP HOLDINGS	141,000	79.85	11,258,850.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	897,504	15.44	13,857,461.76	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	53.50	5,938,500.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	89.90	2,130,630.00	
	香港ドル 小計	7,608,384		284,021,664.16 (3,828,612,032)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	5.79	650,217.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	2.07	221,490.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.94	429,460.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	0.90	180,909.50	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.41	401,265.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	8.82	382,197.06	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.73	242,176.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	0.88	374,000.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	1.99	252,929.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	30.24	299,376.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.26	108,940.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.72	664,392.00	
	DBS GROUP	156,300	24.17	3,777,771.00	
	OCBC BANK	264,200	10.58	2,795,236.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	103,300	24.46	2,526,718.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	8.18	509,614.00	

	CAPITALAND LTD	223,500	3.38	755,430.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	9.13	284,856.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.18	341,050.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	14.55	373,935.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	667,443	3.20	2,135,817.60	
	シンガポールドル 小計	3,530,276		17,707,779.16 (1,347,916,149)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	15.97	1,082,063.32	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	536.00	1,150,256.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	25.80	2,536,398.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	24.99	3,514,968.45	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	14.81	1,473,595.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	80.21	1,002,865.63	
	AZRIELI GROUP	4,323	256.10	1,107,120.30	
	NICE LTD	4,894	533.00	2,608,502.00	
	イスラエルシェケル 小計	430,087		14,475,768.70 (434,562,576)	
	合 計	93,589,146		319,523,141,908 (319,523,141,908)	

(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	102,205	1,125,277.05	
		LENDLEASE GROUP	44,009	730,549.40	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	745,838.00	
		オーストラリアドル 小計	236,074	2,601,664.45 (185,706,808)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,664,775.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	4,687,500.00	
		香港ドル 小計	595,500	6,352,275.00 (85,628,667)	
		投資信託受益証券合計	831,574	271,335,475 (271,335,475)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	697,600.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,814	1,435,199.36	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,711	8,665,610.69	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,055,253.34	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,733	2,441,402.64	
		BOSTON PROPERTIES	13,590	1,715,601.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	943,040.28	

CROWN CASTLE INTL CORP	35,498	5,185,192.86	
DIGITAL REALTY TRUST INC	17,838	2,146,624.92	
DUKE REALTY CORP	29,929	984,664.10	
EQUINIX INC	7,183	4,004,666.16	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,285	982,673.65	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	31,274	2,620,135.72	
ESSEX PROPERTY TRUST	5,691	1,814,518.44	
EXTRA SPACE STORAGE INC	10,951	1,327,589.73	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	765,502.13	
HCP INC	41,014	1,418,674.26	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,065,739.66	
INVITATION HOMES INC	38,000	1,104,280.00	
IRON MOUNTAIN INC	24,669	769,919.49	
KIMCO REALTY CORP	35,407	644,761.47	
LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	606,113.94	
MACERICH CO/THE	10,128	281,153.28	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,237	1,281,160.55	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	14,182	787,101.00	
PROLOGIS INC	53,238	4,366,048.38	
PUBLIC STORAGE	13,426	3,520,699.98	
REALTY INCOME CORP	27,116	1,982,993.08	
REGENCY CENTERS CORP	14,271	896,646.93	
SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	2,480,491.44	
SIMON PROPERTY GROUP	25,938	3,773,200.86	
SL GREEN REALTY CORP	8,067	625,353.84	
SUN COMMUNITIES INC	7,365	1,094,880.90	
UDR INC	24,799	1,180,680.39	
VENTAS INC	30,413	2,214,066.40	
VEREIT INC	77,798	739,081.00	
VORNADO REALTY TRUST	15,390	911,703.60	
WELLTOWER INC	34,628	3,080,506.88	
WP CAREY INC	14,644	1,294,090.28	
アメリカドル 小計	1,014,528	72,904,624.03	(7,708,205,898)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	211,792.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	409,865.40
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	178,164.84
カナダドル 小計	30,576	799,822.24	(63,593,866)
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,578	337,584.30
	GECINA SA	4,459	633,178.00
	ICADE	2,845	226,462.00

	KLEPIERRE	17,225	477,821.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,888	1,468,762.40
	ユーロ 小計	39,995	3,143,808.20 (368,454,321)
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	410,729.20
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	459,383.30
	SEGREO PLC	94,451	733,506.46
	イギリスポンド 小計	232,415	1,603,618.96 (208,261,994)
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	1,210,938.30
	GOODMAN GROUP	140,271	2,074,608.09
	GPT GROUP	167,884	1,050,953.84
	MIRVAC GROUP	306,089	970,302.13
	SCENTRE GROUP	486,663	1,917,452.22
	STOCKLAND	207,412	927,131.64
	VICINITY CENTERS	291,115	727,787.50
	オーストラリアドル 小計	1,693,524	8,879,173.72 (633,795,420)
香港ドル	LINK REIT	179,500	16,074,225.00
	香港ドル 小計	179,500	16,074,225.00 (216,680,553)
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	600,400.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	505,440.00
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	520,780.00
	SUNTEC REIT	173,000	323,510.00
	シンガポールドル 小計	813,800	1,950,130.00 (148,443,895)
	投資証券合計	4,004,338	9,347,435,947 (9,347,435,947)
	合計		9,618,771,422 (9,618,771,422)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 611銘柄	96.6%			66.7%

	投資証券 39銘柄			3.4%	2.3%
カナダドル	株式 86銘柄	99.5%			3.8%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.0%			11.3%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
イギリスポンド	株式 94銘柄	98.9%			5.8%
	投資証券 3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.5%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%			0.9%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.2%
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 58銘柄	90.3%			2.3%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券 7銘柄			7.5%	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 37銘柄	92.7%			1.2%
	投資信託受益証券 2銘柄		2.1%		0.0%
	投資証券 1銘柄			5.2%	0.1%
シンガポールドル	株式 21銘柄	90.1%			0.4%
	投資証券 4銘柄			9.9%	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。

短期金融資産 マザーファンド

貸借対照表

	2019年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	22,978,250,508
流動資産合計	22,978,250,508

	2019年 8月28日現在
項目	金額（円）
資産合計	22,978,250,508
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,470
未払利息	36,060
その他未払費用	75
流動負債合計	56,605
負債合計	56,605
純資産の部	
元本等	
元本	22,686,110,842
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	292,083,061
元本等合計	22,978,193,903
純資産合計	22,978,193,903
負債純資産合計	22,978,250,508

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,686,110,842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 1.0129円 (1万口当たり純資産額) (10,129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 8月28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、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。

	2019年 8月28日現在
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 8月28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	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	2019年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2018年 8月29日

区分	2019年 8月28日現在
期首元本額	26,309,290,036円
期中追加設定元本額	47,215,097,079円
期中一部解約元本額	50,838,276,273円
期末元本額	22,686,110,842円
期末元本額の内訳	
T C A グローバル・キャピタルファンド(毎月決算型)	98,805円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,728,475,120円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	72,171,887円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	34,187,883円
バランス G (2 5) V A (適格機関投資家専用)	6,760,615,573円
F O F s 用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	113,836,816円
ブラジル国債ファンド(毎月分配型)	2,120,953円
ブラジル国債ファンド(年2回決算型)	140,627円
ブラジル高配当株オープン(毎月決算型)	9,880,568円
アメリカ高配当株オープン(毎月決算型)	296,510円
アメリカ高配当株オープン(年2回決算型)	98,901円
米国成長株式ファンド	493,486円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	82,584円
日本株配当戦略投信 2 0 1 6 - 0 9 (適格機関投資家専用)	9,472,002,047円
北米株配当戦略投信 2 0 1 8 - 0 8 (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	4,491,609,082円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

【DCターゲット・イヤー ファンド2025】

(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13期中間計算期間(2019年8月29日から2020年2月28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せん。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2019年 8月28日現在)	第13期中間計算期間 (2020年 2月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	148,088,448	130,955,009
親投資信託受益証券	4,252,309,191	4,454,827,624
未収入金	-	440,000
流動資産合計	4,400,397,639	4,586,222,633
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,904,194	848,972
未払受託者報酬	908,342	998,093
未払委託者報酬	8,856,238	9,731,360
未払利息	232	97
その他未払費用	222,209	124,701
流動負債合計	16,891,215	11,703,223
純資産の部		
元本等		
元本	3,495,659,380	3,623,957,508
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	887,847,044	950,561,902
(分配準備積立金)	645,407,525	632,853,704
元本等合計	4,383,506,424	4,574,519,410
純資産合計	4,383,506,424	4,574,519,410
負債純資産合計	4,400,397,639	4,586,222,633

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2018年 8月29日 至 2019年 2月28日	第13期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日
営業収益		
受取利息	14	106
有価証券売買等損益	5,888,243	38,588,433
営業収益合計	5,888,229	38,588,539
営業費用		
支払利息	50,175	31,601
受託者報酬	870,246	998,093
委託者報酬	8,484,808	9,731,360
その他費用	113,072	124,741
営業費用合計	9,518,301	10,885,795
営業利益又は営業損失（ ）	15,406,530	27,702,744
経常利益又は経常損失（ ）	15,406,530	27,702,744
中間純利益又は中間純損失（ ）	15,406,530	27,702,744
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（ ）	536,594	1,325,273
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	805,376,978	887,847,044
剰余金増加額又は欠損金減少額	66,082,539	54,035,934
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	66,082,539	54,035,934
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,699,372	17,698,547
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,699,372	17,698,547
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	842,890,209	950,561,902

(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12期 (2019年 8月28日現在)	第13期中間計算期間 (2020年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,495,659,380口	3,623,957,508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) 1.2540円 (12,540円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2623円 (12,623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13期中間計算期間 (2020年 2月28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13期中間計算期間 (2020年 2月28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12期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28日	第13期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,104,828,222円	3,495,659,380円
期中追加設定元本額	511,821,385円	197,892,583円
期中一部解約元本額	120,990,227円	69,594,455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ターゲット・イヤー ファンド2035】

(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13期中間計算期間(2019年8月29日から2020年2月28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12期 (2019年 8月28日現在)	第13期中間計算期間 (2020年 2月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	117,721,498	125,426,134
親投資信託受益証券	3,532,653,203	3,794,718,560
流動資産合計	3,650,374,701	3,920,144,694
資産合計	3,650,374,701	3,920,144,694
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,974	7,185
未払受託者報酬	758,529	860,430
未払委託者報酬	7,395,621	8,389,129
未払利息	184	93
その他未払費用	184,258	107,494
流動負債合計	8,341,566	9,364,331
負債合計	8,341,566	9,364,331
純資産の部		
元本等		
元本	2,812,666,688	2,973,738,746
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	829,366,447	937,041,617
(分配準備積立金)	686,162,065	678,379,581
元本等合計	3,642,033,135	3,910,780,363
純資産合計	3,642,033,135	3,910,780,363
負債純資産合計	3,650,374,701	3,920,144,694

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2018年 8月29日 至 2019年 2月28日	第13期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日
営業収益		
受取利息	11	90
有価証券売買等損益	25,755,274	62,235,357
営業収益合計	25,755,263	62,235,447
営業費用		
支払利息	41,779	26,685
受託者報酬	716,495	860,430
委託者報酬	6,985,762	8,389,129
その他費用	93,052	107,529
営業費用合計	7,837,088	9,383,773
営業利益又は営業損失（ ）	33,592,351	52,851,674
経常利益又は経常損失（ ）	33,592,351	52,851,674
中間純利益又は中間純損失（ ）	33,592,351	52,851,674
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（ ）	561,938	1,857,148
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	780,897,373	829,366,447
剰余金増加額又は欠損金減少額	62,424,456	66,511,960
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	62,424,456	66,511,960
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,888,615	9,831,316
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,888,615	9,831,316
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	801,402,801	937,041,617

(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12期 (2019年 8月28日現在)	第13期中間計算期間 (2020年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,812,666,688口	2,973,738,746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) 1.2949円 (12,949円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3151円 (13,151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13期中間計算期間 (2020年 2月28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13期中間計算期間 (2020年 2月28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12期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28日	第13期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,459,380,234円	2,812,666,688円
期中追加設定元本額	417,662,600円	194,236,539円
期中一部解約元本額	64,376,146円	33,164,481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ターゲット・イヤー ファンド2045】

(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13期中間計算期間(2019年8月29日から2020年2月28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せん。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2019年 8月28日現在)	第13期中間計算期間 (2020年 2月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	55,786,598	65,822,475
親投資信託受益証券	1,670,079,021	1,824,320,761
未収入金	760,000	1,350,000
流動資産合計	1,726,625,619	1,891,493,236
資産合計	1,726,625,619	1,891,493,236
負債の部		
流動負債		
未払解約金	756,009	4,770,850
未払受託者報酬	360,974	417,598
未払委託者報酬	3,519,450	4,071,483
未払利息	87	49
その他未払費用	87,168	52,135
流動負債合計	4,723,688	9,312,115
負債合計	4,723,688	9,312,115
純資産の部		
元本等		
元本	1,347,169,223	1,438,705,571
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	374,732,708	443,475,550
(分配準備積立金)	288,256,291	280,547,188
元本等合計	1,721,901,931	1,882,181,121
純資産合計	1,721,901,931	1,882,181,121
負債純資産合計	1,726,625,619	1,891,493,236

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2018年 8月29日 至 2019年 2月28日	第13期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日
営業収益		
受取利息	5	43
有価証券売買等損益	27,782,089	41,671,740
営業収益合計	27,782,084	41,671,783
営業費用		
支払利息	19,966	12,721
受託者報酬	337,429	417,598
委託者報酬	3,289,866	4,071,483
その他費用	43,791	52,150
営業費用合計	3,691,052	4,553,952
営業利益又は営業損失（ ）	31,473,136	37,117,831
経常利益又は経常損失（ ）	31,473,136	37,117,831
中間純利益又は中間純損失（ ）	31,473,136	37,117,831
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（ ）	1,542,447	2,786,642
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	375,901,744	374,732,708
剰余金増加額又は欠損金減少額	44,780,887	45,056,599
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	44,780,887	45,056,599
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,259,766	10,644,946
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,259,766	10,644,946
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	379,492,176	443,475,550

(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12期 (2019年 8月28日現在)	第13期中間計算期間 (2020年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,347,169,223口	1,438,705,571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) 1.2782円 (12,782円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3082円 (13,082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13期中間計算期間 (2020年 2月28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13期中間計算期間 (2020年 2月28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12期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28日	第13期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,139,736,511円	1,347,169,223円
期中追加設定元本額	277,919,743円	129,408,947円
期中一部解約元本額	70,487,031円	37,872,599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ターゲット・イヤー ファンド2055】

(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3期中間計算期間(2019年8月29日から2020年2月28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2期 (2019年 8月28日現在)	第3期中間計算期間 (2020年 2月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	133,255	925,433
親投資信託受益証券	4,025,809	9,105,211
未収入金	-	56,956
流動資産合計	4,159,064	10,087,600
資産合計	4,159,064	10,087,600
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	646,790
未払受託者報酬	753	1,613
未払委託者報酬	7,298	15,728
その他未払費用	35	135
流動負債合計	8,086	664,266
負債合計	8,086	664,266
純資産の部		
元本等		
元本	4,403,585	9,683,252
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	252,607	259,918
(分配準備積立金)	44,094	33,285
元本等合計	4,150,978	9,423,334
純資産合計	4,150,978	9,423,334
負債純資産合計	4,159,064	10,087,600

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2018年 8月29日 至 2019年 2月28日	第3期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	55,771	112,316
営業収益合計	55,771	112,316
営業費用		
支払利息	-	7
受託者報酬	402	1,613
委託者報酬	4,008	15,728
その他費用	8	135
営業費用合計	4,418	17,483
営業利益又は営業損失（ ）	60,189	129,799
経常利益又は経常損失（ ）	60,189	129,799
中間純利益又は中間純損失（ ）	60,189	129,799
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（ ）	26,962	91,524
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,228	252,607
剰余金増加額又は欠損金減少額	924	214,012
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	924	36,438
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	177,574
剰余金減少額又は欠損金増加額	46,850	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	46,850	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	72,925	259,918

(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2期 (2019年 8月28日現在)	第3期中間計算期間 (2020年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,403,585口	9,683,252口
2. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 252,607円	元本の欠損 259,918円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9426円 (1万口当たり純資産額) (9,426円)	1口当たり純資産額 0.9732円 (1万口当たり純資産額) (9,732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3期中間計算期間 (2020年 2月28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

	第3期中間計算期間 (2020年 2月28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>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> <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>

（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2期 自 2018年 8月29日 至 2019年 8月28日	第3期中間計算期間 自 2019年 8月29日 至 2020年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,451,770円	4,403,585円
期中追加設定元本額	6,156,092円	7,561,030円
期中一部解約元本額	3,204,277円	2,281,363円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 2月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,434,218,350
国債証券	470,649,738,300
地方債証券	30,852,699,445
特殊債券	38,497,161,893
社債券	23,990,413,970
未収入金	12,004,398,660
未収利息	1,290,856,619
前払費用	31,213,661
流動資産合計	579,750,700,898
資産合計	579,750,700,898
負債の部	
流動負債	
未払金	13,853,678,840
未払解約金	320,759,227
未払利息	1,819
流動負債合計	14,174,439,886
負債合計	14,174,439,886
純資産の部	
元本等	
元本	393,306,442,963
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	172,269,818,049
元本等合計	565,576,261,012
純資産合計	565,576,261,012
負債純資産合計	579,750,700,898

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 2月28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）

	2020年 2月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	393,306,442,963口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 102,875,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4380円 (1万口当たり純資産額) (14,380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

	2020年 2月28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	2020年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月29日
期首元本額	343,350,525,726円
期中追加設定元本額	60,429,235,435円
期中一部解約元本額	10,473,318,198円
期末元本額	393,306,442,963円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,838,915,490円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,791,285円
S M T 国内債券インデックス・オープン	18,387,139,610円
世界経済インデックスファンド	1,898,212,392円
D C マイセレクション 2 5	21,506,994,700円
D C マイセレクション 5 0	23,407,569,893円
D C マイセレクション 7 5	6,571,857,464円
D C 日本債券インデックス・オープン	457,253,469円
D C 日本債券インデックス・オープン S	89,193,344,549円
D C 日本債券インデックス・オープン P	69,189,775,376円
D C マイセレクション S 2 5	8,929,547,017円
D C マイセレクション S 5 0	9,688,383,241円
D C マイセレクション S 7 5	1,914,466,503円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,075,960,637円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,441,804,379円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	497,395,573円
D C 世界経済インデックスファンド	2,528,032,373円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	69,217,714円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,496,023円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	43,938,112円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	13,795,070円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	936,306円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	158,097,197円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	237,128,694円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	58,118,177円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	106,324,915円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	4,055,391,560円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	925,257,612円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,504,248,430円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	802,462,619円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	92,998,901円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,193,235,572円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	27,372,534円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,369,576,915円

区分	2020年 2月28日現在
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,728,599,188円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	156,740,070円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,414,966,554円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,558,547,079円
分散投資コア戦略ファンドA	12,107,273,774円
分散投資コア戦略ファンドS	11,035,940,003円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	81,674,761円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	894,851,637円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	46,097,985円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,010,164円
SMT インデックスバランス・オープン	57,834,489円
SMT 世界経済インデックス・オープン	14,374,096円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	23,760,523円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	37,853,107円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,978,981円
グローバル経済コア	217,432,004円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,154,765円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,545,954円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	162,450円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	43,499円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,695円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	7,089円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	76,656,041,584円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	18,274,970円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 2月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,703,625,578
株式	284,393,627,080
未収入金	135,581,854
未収配当金	605,663,748
前払金	460,411,400
流動資産合計	289,298,909,660

	2020年 2月28日現在
項目	金額（円）
資産合計	289,298,909,660
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	460,443,300
未払金	123,923,110
未払解約金	116,432,877
未払利息	2,769
流動負債合計	700,802,056
負債合計	700,802,056
純資産の部	
元本等	
元本	204,862,878,114
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	83,735,229,490
元本等合計	288,598,107,604
純資産合計	288,598,107,604
負債純資産合計	289,298,909,660

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 2月28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）

	2020年 2月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		204,862,878,114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)	1.4087円 (14,087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

	2020年 2月28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	2020年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月29日
期首元本額	206,771,932,531円
期中追加設定元本額	19,728,631,712円
期中一部解約元本額	21,637,686,129円
期末元本額	204,862,878,114円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	540,576,205円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,996,560,478円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,420,919円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,258,142,093円
世界経済インデックスファンド	2,113,420,771円
日本株式インデックス・オープン	4,422,366,729円
DCマイセレクション25	6,777,905,443円
DCマイセレクション50	19,143,356,106円
DCマイセレクション75	17,654,931,155円
DC日本株式インデックス・オープン	5,620,581,746円
DCマイセレクションS25	2,768,300,241円
DCマイセレクションS50	7,904,682,919円
DCマイセレクションS75	5,155,843,136円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,728,753,922円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	338,939,648円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	679,078,837円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	459,173,199円
DC世界経済インデックスファンド	2,814,642,510円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,084,803,548円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,194,356円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	33,613,839円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	39,929,163円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	276,142,411円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,582,381円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	73,887,086円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	259,776,160円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	55,310,674円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	346,563,281円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,594,959,221円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	678,319,700円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,964,241,951円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	602,676,470円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	38,635,799円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	737,846,680円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	34,844,154円

区分	2020年 2月28日現在
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	419,050,952円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	531,692,200円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	52,821,786円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	806,462,751円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,554,598,923円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,679,174,968円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,002,792,632円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,033,776,175円
分散投資コア戦略ファンドA	6,190,630,568円
分散投資コア戦略ファンドS	17,758,549,641円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	299,577,879円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	304,515,945円
コア投資戦略ファンド(切替型)	704,217,606円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,457,551円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,643,911円
SMT インデックスバランス・オープン	69,110,355円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	12,666,541,745円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	19,418,216円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	66,858,108円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	11,514,007円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,065,813円
グローバル経済コア	261,075,642円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	14,939,868円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	40,809,469円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,958,846円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	371,773,817円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	28,792,567円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	124,963円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	41,910円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	21,888円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	23,834円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	47,450,077,868円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	542,911,170円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	18,401,510円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	13,383,994円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2020年 2月28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	4,674,006,400	-	4,213,595,000	460,411,400
	合計	4,674,006,400	-	4,213,595,000	460,411,400

(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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2020年 2月28日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	736,505,786
コール・ローン	3,574,657,686
国債証券	407,441,959,891
派生商品評価勘定	20,302,741
未収入金	937,361
未収利息	2,707,564,057
前払費用	124,898,223
差入委託証拠金	319,034,941
流動資産合計	414,925,860,686
資産合計	414,925,860,686
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,547,557
前受金	16,951,029
未払金	1,477,944
未払解約金	304,998,829
未払利息	2,672
流動負債合計	338,978,031
負債合計	338,978,031
純資産の部	
元本等	
元本	142,262,529,302
剰余金	
剰余金又は欠損金()	272,324,353,353
元本等合計	414,586,882,655
純資産合計	414,586,882,655
負債純資産合計	414,925,860,686

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2020年 2月28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）

2020年 2月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	142,262,529,302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 2.9142円 (1万口当たり純資産額) (29,142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

	2020年 2月28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	2020年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月29日
期首元本額	138,356,719,879円
期中追加設定元本額	11,862,684,027円
期中一部解約元本額	7,956,874,604円
期末元本額	142,262,529,302円
期末元本額の内訳	

区分	2020年 2月28日現在
外国債券オープン（毎月決算型）	1,666,370,441円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	669,954,771円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	471,049,301円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,037,358,805円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,976,894円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,584,248,840円
世界経済インデックスファンド	6,797,138,711円
D C マイセレクション 2 5	1,721,497,314円
D C マイセレクション 5 0	1,308,546,392円
D C マイセレクション 7 5	944,516,465円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,953,379,506円
D C マイセレクション S 2 5	707,799,614円
D C マイセレクション S 5 0	544,174,802円
D C マイセレクション S 7 5	273,562,812円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	43,529,379円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	69,253,737円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	33,175,686円
D C 世界経済インデックスファンド	9,111,829,232円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	618,104,081円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	31,949,274円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,716,019円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,082,256円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	46,411,220円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	89,950,660円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	135,826,156円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	144,394,884円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	301,829,321円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	1,986,035,775円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	588,682,628円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	2,122,477,540円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	835,424,907円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	73,523,111円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	591,761,835円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	33,234,235円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	220,249,357円
バランス F（25）V A 1（適格機関投資家専用）	281,997,180円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	921,099,069円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1（適格機関投資家専用）	2,036,960,057円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	863,019,605円
外国債券ファンド・シリーズ 1	561,887,151円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,177,068,436円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,972,275,999円
分散投資コア戦略ファンド A	1,750,414,452円

区分	2020年 2月28日現在
分散投資コア戦略ファンドS	6,593,342,498円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	313,085,995円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,947,825,899円
コア投資戦略ファンド(切替型)	961,216,994円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	218,641,211円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	105,488,488円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,066,223,678円
SMT インデックスバランス・オープン	212,800,179円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	22,962,704,901円
SMT 世界経済インデックス・オープン	96,462,791円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	106,382,172円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	169,388,006円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,703,414円
グローバル経済コア	892,516,590円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	7,767,285円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	172,642円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	249,643,871円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	19,162,672円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	117,085円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	50,609円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	27,754円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	32,515円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	709,274,516円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	10,815,295,455円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	347,513,154円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	40,050,721,085円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	81,229,933円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2020年 2月28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	2,776,440,927	-	2,793,391,956	16,951,029
	合計	2,776,440,927	-	2,793,391,956	16,951,029

(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

（2020年 2月28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	2,851,390,645	-	2,839,194,800	12,195,845
	アメリカドル	1,485,401,276	-	1,474,726,800	10,674,476
	カナダドル	115,972,260	-	114,226,000	1,746,260
	ユーロ	1,050,334,098	-	1,052,800,000	2,465,902
	イギリスポンド	199,683,011	-	197,442,000	2,241,011
合計		2,851,390,645	-	2,839,194,800	12,195,845

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 2月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,712,414,181
コール・ローン	1,263,205,120
株式	352,754,833,541
投資信託受益証券	276,154,385
投資証券	10,072,243,716
派生商品評価勘定	106,406
未収入金	1,624,479
未収配当金	688,806,959
前払金	1,088,015,128
差入委託証拠金	642,471,352
流動資産合計	376,499,875,267
資産合計	376,499,875,267
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,093,208,212
未払解約金	391,153,222
未払利息	944

	2020年 2月28日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	1,484,362,378
負債合計	1,484,362,378
純資産の部	
元本等	
元本	141,118,327,922
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	233,897,184,967
元本等合計	375,015,512,889
純資産合計	375,015,512,889
負債純資産合計	376,499,875,267

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 2月28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>

	2020年 2月28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)

	2020年 2月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,118,327,922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 2.6575円 (1万口当たり純資産額) (26,575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

	2020年 2月28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。

2020年 2月28日現在	
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	2020年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月29日
期首元本額	137,096,412,688円
期中追加設定元本額	18,008,618,836円
期中一部解約元本額	13,986,703,602円
期末元本額	141,118,327,922円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,375,312,208円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,971,137円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,067,878,474円
世界経済インデックスファンド	7,400,338,943円
外国株式インデックス・オープン	710,514,568円

区分	2020年 2月28日現在
DCマイセレクション25	1,059,968,254円
DCマイセレクション50	4,685,763,675円
DCマイセレクション75	4,582,574,147円
DC外国株式インデックス・オープン	8,952,392,189円
DCマイセレクションS25	429,766,205円
DCマイセレクションS50	1,939,224,636円
DCマイセレクションS75	1,356,370,430円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	90,741,452円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	181,858,173円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	122,986,330円
DC世界経済インデックスファンド	9,819,210,416円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,914,528,879円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	7,966,343円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	10,869,716円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	39,169,694円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	37,854,248円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	138,256,125円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	29,957,802円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	187,471,599円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	598,250,341円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	321,347,277円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,170,910,227円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,664,535,380円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	63,162,042円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	306,339,561円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	7,119,621円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	101,524,340円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,750,665,949円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,821,318,682円
外国株式ファンド・シリーズ1	999,237,126円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,147,459,980円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,268,074,755円
分散投資コア戦略ファンドA	2,488,858,275円
分散投資コア戦略ファンドS	7,529,579,522円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,041,963,785円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,120,114,684円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,354,628,498円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	724,547,452円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	40,065,466円
SMT インデックスバランス・オープン	240,161,968円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,165,998,351円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	29,446,738,232円
SMT 世界経済インデックス・オープン	95,849,009円

区分	2020年 2月28日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	330,080,480円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	56,824,179円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,782,095円
i - S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	58,553,530円
グローバル経済コア	867,243,867円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	8,771,905円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	755,534円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	874,242,211円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	66,563,030円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	402,015円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	144,829円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	74,665円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	81,330円
F O F s用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,086,281,409円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	808,866,835円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,106,308,361円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	90,541,839円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	65,398,558円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 01（適格機関投資家専用）	341,366,833円
S M T A Mバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	736,648,251円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 2月28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	12,759,495,980	-	11,671,480,852	1,088,015,128
	合計	12,759,495,980	-	11,671,480,852	1,088,015,128

(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

（2020年 2月28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	786,430,538	-	781,343,860	5,086,678
	アメリカドル	542,478,000	-	538,295,000	4,183,000
	カナダドル	39,366,628	-	38,870,160	496,468
	ユーロ	120,216,000	-	120,320,000	104,000
	イギリスポンド	49,858,550	-	49,381,500	477,050
	スイスフラン	34,511,360	-	34,477,200	34,160
合計		786,430,538	-	781,343,860	5,086,678

(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。

短期金融資産 マザーファンド

貸借対照表

項目	2020年 2月28日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	23,035,793,040
流動資産合計	23,035,793,040
資産合計	23,035,793,040
負債の部	
流動負債	
未払解約金	41,233
未払利息	17,223
流動負債合計	58,456
負債合計	58,456
純資産の部	
元本等	
元本	22,747,943,598
剰余金	
剰余金又は欠損金()	287,790,986
元本等合計	23,035,734,584
純資産合計	23,035,734,584
負債純資産合計	23,035,793,040

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 2月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		22,747,943,598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)	1.0127円 (10,127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

	2020年 2月28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	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。

（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	2020年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 8月29日
期首元本額	22,686,110,842円
期中追加設定元本額	28,103,203,607円
期中一部解約元本額	28,041,370,851円
期末元本額	22,747,943,598円

区分	2020年 2月28日現在
期末元本額の内訳	
T C Aグローバル・キャピタルファンド(毎月決算型)	98,805円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	2,036,272,561円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	78,678,950円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	38,226,413円
バランスG(25)VA(適格機関投資家専用)	6,760,615,573円
F O F s用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	15,390,832円
ブラジル国債ファンド(毎月分配型)	2,120,953円
ブラジル国債ファンド(年2回決算型)	140,627円
ブラジル高配当株オープン(毎月決算型)	9,880,568円
アメリカ高配当株オープン(毎月決算型)	296,510円
アメリカ高配当株オープン(年2回決算型)	98,901円
米国成長株式ファンド	493,486円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	200,514円
日本株配当戦略投信2016-09(適格機関投資家専用)	9,323,590,461円
北米株配当戦略投信2018-08(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	9,875円
日本株配当戦略投信2019-09(適格機関投資家専用)	4,481,828,569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。

2【ファンドの現況】

【DCターゲット・イヤー ファンド2025】

【純資産額計算書】

(2020年 3月31日現在)

資産総額	4,475,248,283円
負債総額	1,992,728円
純資産総額（ - ）	4,473,255,555円
発行済口数	3,616,297,392口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2370円
（1万口当たり純資産額）	（12,370円）

【DCターゲット・イヤー ファンド2035】

【純資産額計算書】

(2020年 3月31日現在)

資産総額	3,765,965,161円
負債総額	1,981,068円
純資産総額（ - ）	3,763,984,093円
発行済口数	2,974,349,670口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2655円
（1万口当たり純資産額）	（12,655円）

【DCターゲット・イヤー ファンド2045】

【純資産額計算書】

(2020年 3月31日現在)

資産総額	1,796,750,022円
負債総額	1,911,398円
純資産総額（ - ）	1,794,838,624円
発行済口数	1,441,772,408口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2449円
（1万口当たり純資産額）	（12,449円）

【DCターゲット・イヤー ファンド2055】

【純資産額計算書】

(2020年 3月31日現在)

資産総額	8,164,099円
負債総額	3,255円
純資産総額(-)	8,160,844円
発行済口数	8,900,991口
1口当たり純資産額(/)	0.9168円
(1万口当たり純資産額)	(9,168円)

(参考)

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2020年 3月31日現在)

資産総額	541,700,734,110円
負債総額	4,680,241,497円
純資産総額(-)	537,020,492,613円
発行済口数	379,552,519,382口
1口当たり純資産額(/)	1.4149円
(1万口当たり純資産額)	(14,149円)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2020年 3月31日現在)

資産総額	286,112,891,528円
負債総額	380,599,746円
純資産総額(-)	285,732,291,782円
発行済口数	215,676,267,391口
1口当たり純資産額(/)	1.3248円
(1万口当たり純資産額)	(13,248円)

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 3月31日現在）

資産総額	394,136,693,880円
負債総額	1,496,636,658円
純資産総額（ - ）	392,640,057,222円
発行済口数	134,837,064,235口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9120円
（1万口当たり純資産額）	（29,120円）

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 3月31日現在）

資産総額	338,917,674,442円
負債総額	1,445,799,305円
純資産総額（ - ）	337,471,875,137円
発行済口数	149,458,546,758口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2580円
（1万口当たり純資産額）	（22,580円）

短期金融資産 マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 3月31日現在）

資産総額	9,039,212,712円
負債総額	34,478円
純資産総額（ - ）	9,039,178,234円
発行済口数	8,926,315,055口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0126円
（1万口当たり純資産額）	（10,126円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2020年3月31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年間ににお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2020年 5月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年3月31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	545	11,815,780
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	82	293,064
単位型公社債投資信託	23	176,922
合計	650	12,285,766

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

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。

- (2) 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載していましたが、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに变更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (3) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（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。また、第34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：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】

(単位：千円)

	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 (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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	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なっております。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なっております。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なっております。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 その他有価証券	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 其他有価証券」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)	18,603,427		
							うち、投資有価証券	13,907,536		
							うち、関係会社株式	4,663,000		
							(承継負債合計)	13,989		
							(差引純資産)	18,589,438		
							(分割対価)	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おりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 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)
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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		25,294
金銭の信託		3,373
未収委託者報酬		6,890
未収運用受託報酬		5,509
その他		2,758
流動資産合計		43,826

固定資産

有形固定資産	1	881
無形固定資産		2,539
投資その他の資産		
投資有価証券		10,344
関係会社株式		4,663
繰延税金資産		319
その他		32
投資その他の資産合計		15,358

固定資産合計		18,780
--------	--	--------

資産合計		62,606
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,726
未払法人税等		688
賞与引当金		146
その他	2	655
流動負債合計		9,216

固定負債

退職給付引当金		582
資産除去債務		132
その他		3
固定負債合計		718

負債合計

9,935

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	305
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	30,860
利益剰余金合計	33,266
株主資本合計	52,505
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	120
繰延ヘッジ損益	286
評価・換算差額等合計	165
純資産合計	52,671
負債・純資産合計	62,606

中間損益計算書

(単位：百万円)

第34期中間会計期間

(自 2019年4月1日

至 2019年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		16,961
運用受託報酬		5,393
その他営業収益		253
営業収益合計		22,608
営業費用		11,776
一般管理費	1	4,411
営業利益		6,421
営業外収益	2	1,110
営業外費用	3	456
経常利益		7,075
税引前中間純利益		7,075
法人税、住民税及び事業税		2,197
法人税等調整額		18
法人税等合計		2,179

中間純利益

4,895

中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当中間期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
中間純利益			4,895	4,895	4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 （純額）					
当中間期変動額合計	230	-	2,359	2,589	2,589
当中間期末残高	305	2,100	30,860	33,266	52,505

	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	393	133	526	50,442
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	513	152	360	360
当中間期変動額合計	513	152	360	2,229
当中間期末残高	120	286	165	52,671

重要な会計方針

第34期中間会計期間

（自 2019年4月1日
至 2019年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間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．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6．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当中間会計期間の負担額を計上しております。

(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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

7．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。

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 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。

(2) 連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第34期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 470百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 62百万円 無形固定資産 42百万円
2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益 481百万円 投資有価証券償還益 309百万円 為替差益 181百万円
3	営業外費用の主要項目 デリバティブ費用 456百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日
----------------------	------	-------	---------	------------	------------

(金融商品関係)

第34期中間会計期間末(2019年9月30日)

2019年9月30日における貸借対照表計上額、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、次表には含まれておりません(注2)を参照ください。)

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	25,294	25,294	-
(2)金銭の信託	3,373	3,373	
(3)未収委託者報酬	6,890	6,890	-
(4)未収運用受託報酬	5,509	5,509	
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,344	10,344	-
(6)未払金	(7,726)	(7,726)	-
(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	(51)	(51)	
ヘッジ会計が適用されているもの	48	48	
デリバティブ取引計	(3)	(3)	

(*)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。

(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

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5)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。

(6)未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、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) 非上場株式(貸借対照表計上額:投資有価証券0百万円、関係会社株式4,663百万円)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ため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第34期中間会計期間末(2019年9月30日)

1. 子会社株式

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: 百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

2. その他有価証券

(単位: 百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	6,576	6,415	160
小計	6,576	6,415	160
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,767	4,101	334
小計	3,767	4,101	334
合計	10,344	10,517	173

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額0百万円)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。

(デリバティブ取引関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建				
米ドル	872	-	1	1
英ポンド	52	-	0	0
カナダドル	2	-	0	0
スイスフラン	6	-	0	0
香港ドル	195	-	0	0
ユーロ	155	-	2	2
合計	1,285	-	5	5

(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 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,493	-	57	57
合計		6,493	-	57	57

(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。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,500	-	5
	英ポンド		2,259	-	41
	カナダドル		22	-	0
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		96	-	0
	ユーロ		113	-	1
合計			5,046	-	48

(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。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

(関連情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省

略しております。

(2)有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	17,557,176円40銭
1株当たり中間純利益	1,631,928円83銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益	4,895百万円
普通株式に係る中間純利益	4,895百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、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

2020年5月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（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。

再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

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10月28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

松崎雅則

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ターゲット・イヤー ファンド2025の2018年8月29日から2019年8月28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ターゲット・イヤー ファンド2025の2019年8月28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10月28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

松崎雅則

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ターゲット・イヤー ファンド2035の2018年8月29日から2019年8月28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ターゲット・イヤー ファンド2035の2019年8月28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10月28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

松崎雅則

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ターゲット・イヤー ファンド2045の2018年8月29日から2019年8月28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ターゲット・イヤー ファンド2045の2019年8月28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10月28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

松崎雅則

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ターゲット・イヤー ファンド2055の2018年8月29日から2019年8月28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ターゲット・イヤー ファンド2055の2019年8月28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12月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤 澤	孝 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹 内	知 明 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、「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2019年4月1日から2020年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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、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9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年4月28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

松崎雅則

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ターゲット・イヤー ファンド2025の2019年8月29日から2020年2月28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ターゲット・イヤー ファンド2025の2020年2月28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8月29日から2020年2月28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

2020年4月28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

松崎雅則

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ターゲット・イヤー ファンド2035の2019年8月29日から2020年2月28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ターゲット・イヤー ファンド2035の2020年2月28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8月29日から2020年2月28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

2020年4月28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

松崎雅則

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ターゲット・イヤー ファンド2045の2019年8月29日から2020年2月28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ターゲット・イヤー ファンド2045の2020年2月28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8月29日から2020年2月28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

2020年4月28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

松崎雅則

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ターゲット・イヤー ファンド2055の2019年8月29日から2020年2月28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ターゲット・イヤー ファンド2055の2020年2月28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8月29日から2020年2月28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。