

## 【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11月20日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCバランスファンド30 DCバランスファンド50 DCバランスファンド70
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	DCバランスファンド30 10兆円を上限とします。 DCバランスファンド50 10兆円を上限とします。 DCバランスファンド70 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DCバランスファンド30

DCバランスファンド50

DCバランスファンド70

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

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

**( 7 ) 【申込期間】**

2020年11月21日から2021年 5月21日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

## &lt;信託金限度額&gt;

各ファンドにつき上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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



る旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

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

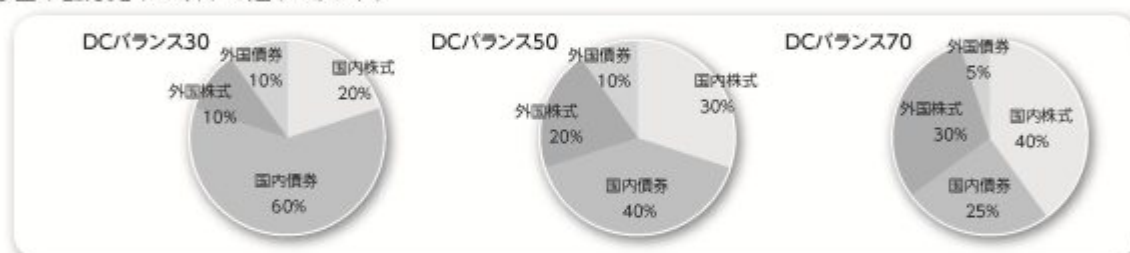
< ファンドの特色 >

## 資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

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

## 国内外の株式・公社債へ分散投資します。

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



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

### <投資対象とするマザーファンド>

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

### ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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

#### 日本株式マザーファンド

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

#### 日本債券マザーファンド

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

#### 外国株式マザーファンド

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

#### 外国債券マザーファンド

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

## ●複合指数について

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

## ファンドのしくみ

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



## 分配方針

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

## 主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、取得時において以下の通りとします。

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

- 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下の通りとします。

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

## ◆各マザーファンドが対象とする指数は次の通りです。

## 日本株式マザーファンド「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」

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

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

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

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

## 日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## 外国株式マザーファンド「MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)」

MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

## 外国債券マザーファンド「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

## (2)【ファンドの沿革】

2006年9月29日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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

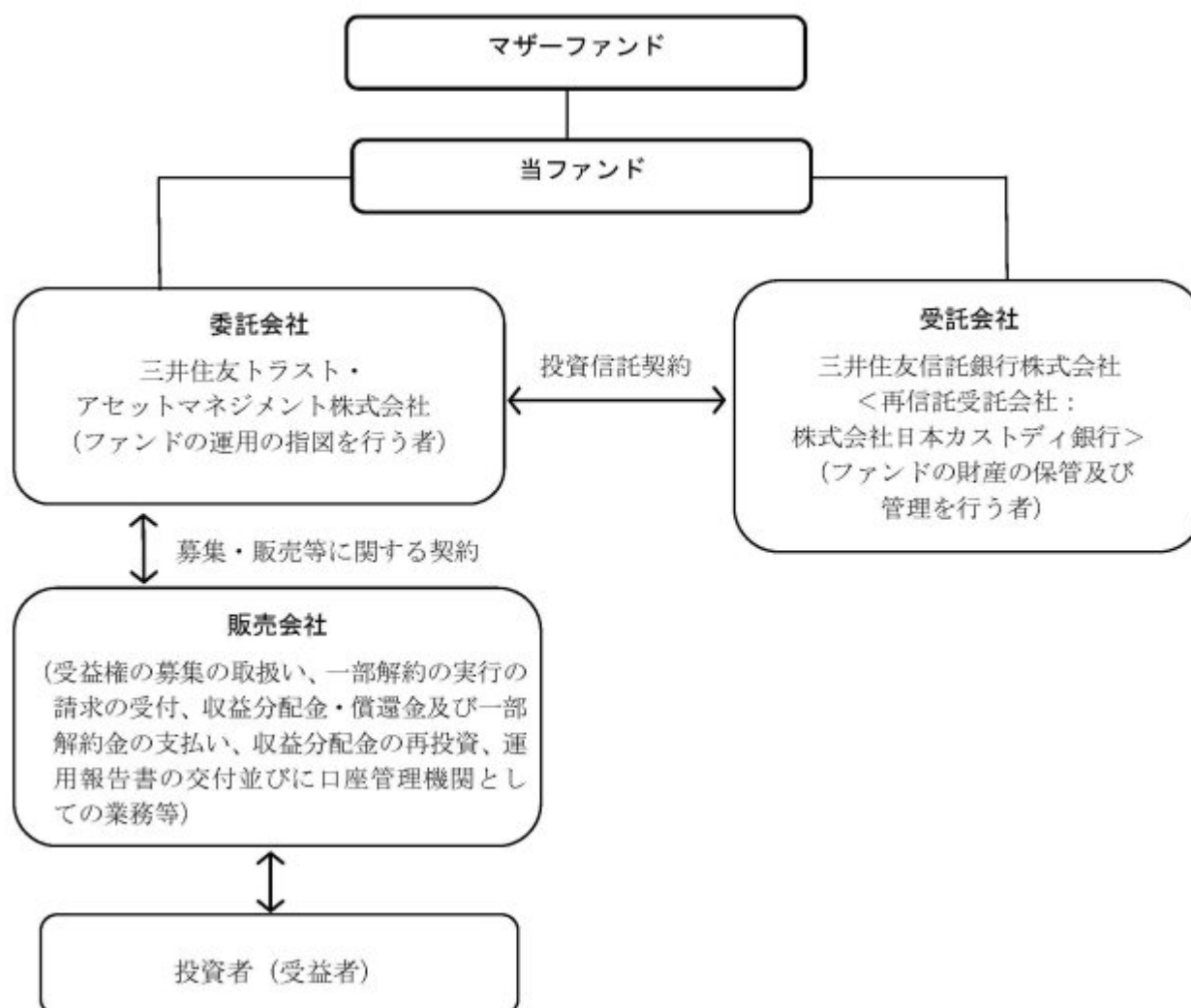
ファンドの名称を中央三井DCバランスファンド30からDCバランスファンド30、中央三井DCバランスファンド50からDCバランスファンド50、中央三井DCバランスファンド70からDCバランスファンド70に変更

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

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

### （３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2020年 9月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 運用方針

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

#### 投資態度

- A．主として、マザーファンド受益証券に投資し、実質的に国内外の株式・公社債へ分散投資を行うことにより、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
- B．各資産への基本配分比率は以下のとおりです。資産配分の異なる3つのファンドから、皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じてご選択いただけます。

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

- C．上記B．の基本配分比率には資産毎に一定の変動許容幅を設けます。
- D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては原則為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- E．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- F．ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- G．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」という場合があります。）を行うことができます。
- I．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### (2)【投資対象】

#### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

めるものをいいます。以下同じ。)

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

B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

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



益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所では有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

（2）投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

### 3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### 「日本債券マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

わが国の公社債に投資を行い、NOMURA - BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

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

### 3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国株式マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

MSCIコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

### 「外国債券マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

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

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

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

### 3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

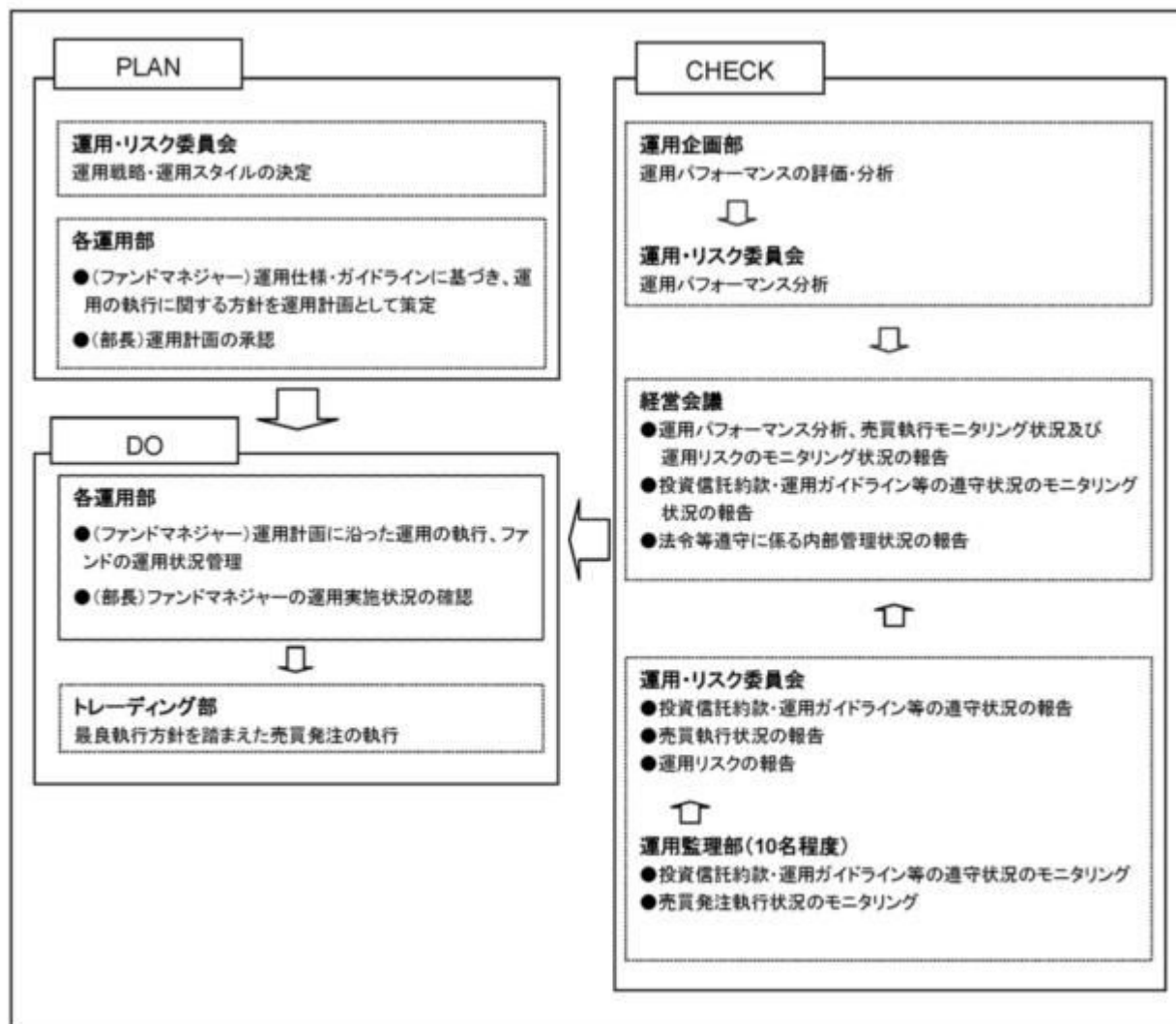
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

#### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は2月21日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### < 約款に定める投資制限 >

#### A．株式への投資割合

委託会社は、株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

DCバランスファンド30.....信託財産の純資産総額の40%以下

DCバランスファンド50.....信託財産の純資産総額の60%以下

DCバランスファンド70.....信託財産の純資産総額の80%以下

#### B．外貨建資産の投資割合

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

DCバランスファンド30.....信託財産の純資産総額の30%以下

DCバランスファンド50.....信託財産の純資産総額の40%以下

DCバランスファンド70.....信託財産の純資産総額の45%以下

#### C．新株引受権証券等への投資割合

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

#### D．投資信託証券への投資割合

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

#### E．同一銘柄の株式への投資制限

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

#### F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

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

#### G．同一銘柄の転換社債等への投資制限

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

#### H．投資する株式等の範囲

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

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

#### I．信用取引の指図範囲

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

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザー

ファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

Ｊ．先物取引等の運用指図

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

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

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

Ｋ．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

Ｌ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

Ｍ．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

ａ．及びｂ．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

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

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

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



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

## T. 資金の借入れ

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

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

ハ. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

二. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## U. 受託会社による資金の立替え

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

ロ. 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

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

## V. 受託会社の自己又は利害関係人等との取引

イ. 受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ. において同じ。）、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、上記（2）に定める資産への投資等を行うことができます。

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

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

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

## &lt; 関連法令に基づく投資制限 &gt;

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### （1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

##### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

## （２）リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

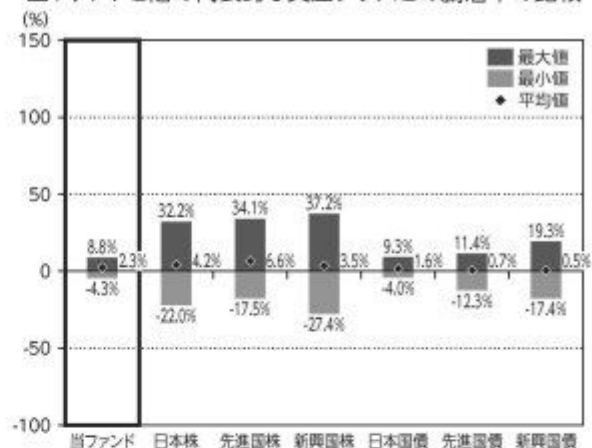
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 【参考情報】

## DCバランスファンド30



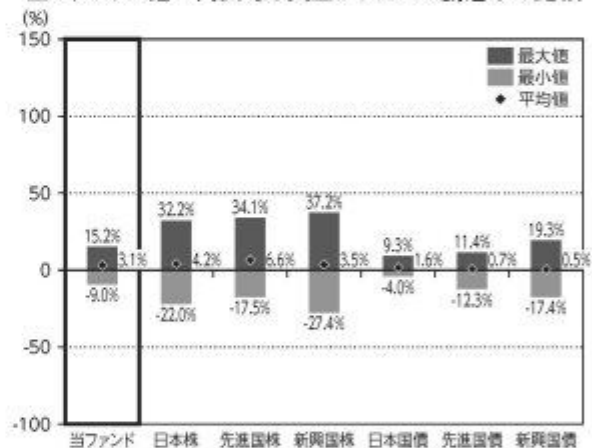
## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



## DCバランスファンド50



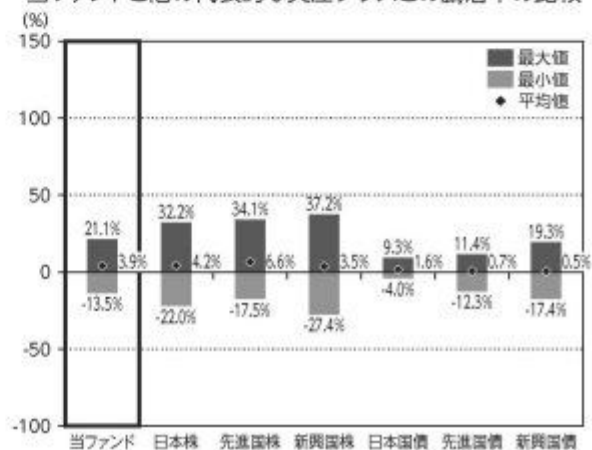
## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



## DCバランスファンド70



## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



## 【参考情報】

- \*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- \*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- \*2015年10月～2020年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEL Morgan Global Bond Index-EMEA 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諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

ありません。

### (2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に下記の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

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

## (3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

DCバランスファンド30：年率 0.231%（税抜 0.21%）（ ）

DCバランスファンド50：年率 0.242%（税抜 0.22%）

DCバランスファンド70：年率 0.253%（税抜 0.23%）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	DCバランスファンド30：年率 0.121%（税抜 0.11%） DCバランスファンド50：年率 0.132%（税抜 0.12%） DCバランスファンド70：年率 0.143%（税抜 0.13%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	DCバランスファンド30：年率 0.066%（税抜 0.06%） DCバランスファンド50：年率 0.066%（税抜 0.06%） DCバランスファンド70：年率 0.066%（税抜 0.06%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	DCバランスファンド30：年率 0.044%（税抜 0.04%） DCバランスファンド50：年率 0.044%（税抜 0.04%） DCバランスファンド70：年率 0.044%（税抜 0.04%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2020年 9月30日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

#### 5【運用状況】

以下は、2020年9月30日現在の状況について記載してあります。

#### 【DCバランスファンド30】

##### （１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	21,207,522,578	99.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		136,685,625	0.64
合計(純資産総額)		21,344,208,203	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### （２）【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	9,202,143,023	1.3919	12,809,239,899	1.3780	12,680,553,085	59.41



日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,361,339,812	1.7413	4,111,844,623	1.7967	4,242,619,240	19.88
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	715,866,317	3.1250	2,237,082,853	3.0017	2,148,815,923	10.07
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	828,208,001	2.5319	2,096,954,087	2.5785	2,135,534,330	10.01

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### □.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.36
合計	99.36

(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5期計算期間末	(2011年 2月21日)	1,240,531,245	1,240,531,245	9,542	9,542
第6期計算期間末	(2012年 2月21日)	1,662,222,385	1,662,222,385	9,432	9,432
第7期計算期間末	(2013年 2月21日)	2,268,392,887	2,268,392,887	10,435	10,435
第8期計算期間末	(2014年 2月21日)	4,826,567,334	4,826,567,334	11,618	11,618
第9期計算期間末	(2015年 2月23日)	9,609,384,153	9,609,384,153	12,811	12,811
第10期計算期間末	(2016年 2月22日)	12,153,839,606	12,153,839,606	12,527	12,527
第11期計算期間末	(2017年 2月21日)	14,214,751,693	14,214,751,693	13,306	13,306
第12期計算期間末	(2018年 2月21日)	16,338,867,196	16,338,867,196	13,983	13,983
第13期計算期間末	(2019年 2月21日)	18,205,085,029	18,205,085,029	14,025	14,025
第14期計算期間末	(2020年 2月21日)	20,310,903,852	20,310,903,852	14,687	14,687
	2019年 9月末日	19,441,231,213		14,271	
	10月末日	19,708,383,628		14,452	
	11月末日	19,865,443,667		14,535	
	12月末日	19,948,053,721		14,604	

2020年 1月末日	20,220,780,033		14,586
2月末日	19,864,534,597		14,241
3月末日	19,473,316,394		13,780
4月末日	19,880,242,549		14,040
5月末日	20,370,706,356		14,271
6月末日	20,709,001,461		14,292
7月末日	20,777,915,688		14,268
8月末日	21,272,234,412		14,551
9月末日	21,344,208,203		14,557

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	0
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	0
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	3.3
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	1.2
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	10.6
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	11.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	10.3
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2.2
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	6.2
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	5.1
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.3
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	4.7
第15期中間計算期間	2020年 2月22日～2020年 8月21日	1.3

(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5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	528,536,037	56,221,849	1,300,125,983
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	544,218,204	82,011,582	1,762,332,605
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	548,368,354	136,959,287	2,173,741,672
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	2,244,075,796	263,589,279	4,154,228,189
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	3,774,064,767	427,446,160	7,500,846,796
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2,707,951,316	506,368,389	9,702,429,723
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	1,522,635,571	541,752,943	10,683,312,351
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	1,622,030,510	620,753,783	11,684,589,078
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	1,853,591,536	558,077,052	12,980,103,562
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	1,679,276,139	830,050,924	13,829,328,777
第15期中間計算期間	2020年 2月22日～2020年 8月21日	1,225,472,740	539,081,621	14,515,719,896

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

#### 【DCバランスファンド50】

##### (1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	21,312,038,879	99.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		135,700,557	0.63
合計(純資産総額)		21,447,739,436	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### (2) 【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	6,115,014,742	1.3915	8,509,373,631	1.3780	8,426,490,314	39.29
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,590,370,472	1.7615	6,324,437,587	1.7967	6,450,818,627	30.08
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,447,254,287	3.1133	4,505,736,772	3.0017	4,344,223,193	20.25
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	810,745,296	2.5376	2,057,347,264	2.5785	2,090,506,745	9.75

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### □.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.37
合計	99.37

(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5期計算期間末 (2011年 2月21日)	1,976,927,724	1,976,927,724	8,829	8,829
第6期計算期間末 (2012年 2月21日)	2,507,016,786	2,507,016,786	8,507	8,507
第7期計算期間末 (2013年 2月21日)	3,400,936,257	3,400,936,257	9,831	9,831
第8期計算期間末 (2014年 2月21日)	4,833,869,383	4,833,869,383	11,529	11,529
第9期計算期間末 (2015年 2月23日)	10,264,606,984	10,264,606,984	13,252	13,252
第10期計算期間末 (2016年 2月22日)	12,016,092,940	12,016,092,940	12,499	12,499
第11期計算期間末 (2017年 2月21日)	14,533,410,562	14,533,410,562	13,835	13,835
第12期計算期間末 (2018年 2月21日)	16,857,871,211	16,857,871,211	14,889	14,889
第13期計算期間末 (2019年 2月21日)	18,131,125,571	18,131,125,571	14,866	14,866
第14期計算期間末 (2020年 2月21日)	20,696,734,917	20,696,734,917	15,946	15,946
2019年 9月末日	19,347,440,414		15,145	
10月末日	19,850,569,614		15,487	
11月末日	20,173,451,714		15,675	
12月末日	20,340,151,257		15,830	
2020年 1月末日	20,512,957,081		15,764	
2月末日	19,692,505,400		15,080	
3月末日	18,760,564,296		14,337	
4月末日	19,397,703,258		14,801	

5月末日	20,136,542,903		15,231	
6月末日	20,483,039,741		15,285	
7月末日	20,534,519,618		15,238	
8月末日	21,401,649,221		15,806	
9月末日	21,447,739,436		15,758	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	0
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	0
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	5.1
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	3.6
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	15.6
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	17.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	14.9
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	5.7
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	10.7
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	7.6
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.2
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	7.3
第15期中間計算期間	2020年 2月22日～2020年 8月21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5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	738,290,364	62,969,453	2,239,164,601
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	858,899,500	150,985,019	2,947,079,082
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	737,283,783	225,124,733	3,459,238,132
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	1,127,761,819	394,119,618	4,192,880,333
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	3,890,146,207	337,276,922	7,745,749,618
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2,389,338,964	521,486,140	9,613,602,442
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	1,427,316,438	535,903,642	10,505,015,238
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	1,604,824,267	787,711,888	11,322,127,617
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	1,487,203,756	613,284,585	12,196,046,788
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	1,542,536,422	759,460,983	12,979,122,227
第15期中間計算期間	2020年 2月22日～2020年 8月21日	1,109,011,050	632,474,402	13,455,658,875

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

## 【DCバランスファンド70】

### (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	8,691,119,345	99.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		56,034,631	0.64
合計(純資産総額)		8,747,153,976	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,940,792,943	1.7727	3,440,566,899	1.7967	3,487,022,680	39.86
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	874,608,355	3.1160	2,725,338,734	3.0017	2,625,311,899	30.01
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	1,559,766,103	1.3900	2,168,077,452	1.3780	2,149,357,689	24.57
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	166,541,430	2.5401	423,040,452	2.5785	429,427,077	4.91

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.36
合計	99.36

(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5期計算期間末 (2011年 2月21日)	887,132,636	887,132,636	8,169	8,169
第6期計算期間末 (2012年 2月21日)	1,010,509,539	1,010,509,539	7,652	7,652
第7期計算期間末 (2013年 2月21日)	1,396,043,467	1,396,043,467	9,146	9,146
第8期計算期間末 (2014年 2月21日)	2,259,670,200	2,259,670,200	11,186	11,186
第9期計算期間末 (2015年 2月23日)	4,376,661,860	4,376,661,860	13,325	13,325
第10期計算期間末 (2016年 2月22日)	4,382,407,791	4,382,407,791	12,156	12,156
第11期計算期間末 (2017年 2月21日)	5,465,018,584	5,465,018,584	14,000	14,000
第12期計算期間末 (2018年 2月21日)	6,554,623,946	6,554,623,946	15,405	15,405
第13期計算期間末 (2019年 2月21日)	7,105,425,421	7,105,425,421	15,276	15,276
第14期計算期間末 (2020年 2月21日)	8,349,294,464	8,349,294,464	16,706	16,706
2019年 9月末日	7,514,513,890		15,559	
10月末日	7,805,163,023		16,048	
11月末日	8,008,496,915		16,340	
12月末日	8,128,639,933		16,575	
2020年 1月末日	8,229,969,920		16,457	
2月末日	7,758,045,057		15,422	
3月末日	7,259,953,625		14,379	
4月末日	7,634,074,492		15,057	
5月末日	8,041,442,944		15,661	
6月末日	8,223,235,078		15,749	
7月末日	8,224,056,384		15,672	
8月末日	8,718,011,419		16,510	

9月末日	8,747,153,976		16,405	
------	---------------	--	--------	--

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	0
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	0
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	7.2
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	6.3
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	19.5
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	22.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	19.1
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	8.8
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	15.2
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	10.0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.8
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	9.4
第15期中間計算期間	2020年 2月22日～2020年 8月21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5期計算期間	2010年 2月23日～2011年 2月21日	339,859,039	65,511,771	1,086,032,906
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	324,628,476	90,057,030	1,320,604,352
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	336,941,132	131,115,473	1,526,430,011



第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	749,827,425	256,234,473	2,020,022,963
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	1,564,258,884	299,743,427	3,284,538,420
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	721,489,462	400,760,508	3,605,267,374
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	578,597,748	280,214,854	3,903,650,268
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	820,305,427	469,118,909	4,254,836,786
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	752,735,309	356,104,678	4,651,467,417
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	795,085,220	448,783,440	4,997,769,197
第15期中間計算期間	2020年 2月22日～2020年 8月21日	577,373,652	330,761,707	5,244,381,142

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

(参考)

## 日本株式マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	248,290,802,475	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,641,809,157	1.84
合計(純資産総額)		252,932,611,632	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,486,380,000	1.77

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,216,600	7,739.83	9,416,277,178	6,932.00	8,433,471,200	3.33

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	849,000	4,842.21	4,111,036,290	6,469.00	5,492,181,000	2.17
日本	株式	ソニー	電気機器	683,100	7,857.84	5,367,690,504	8,032.00	5,486,659,200	2.17
日本	株式	キーエンス	電気機器	98,800	39,541.36	3,906,686,368	48,980.00	4,839,224,000	1.91
日本	株式	任天堂	その他製品	66,900	43,053.27	2,880,263,763	59,660.00	3,991,254,000	1.58
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	907,200	4,344.54	3,941,366,688	3,744.00	3,396,556,800	1.34
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	746,400	4,277.20	3,192,502,080	4,160.00	3,105,024,000	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,430,400	2,815.45	4,027,219,680	2,150.00	3,075,360,000	1.22
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,356,700	571.46	4,204,059,782	416.10	3,061,122,870	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	936,000	2,478.16	2,319,557,760	3,229.00	3,022,344,000	1.19
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	765,200	3,098.34	2,370,849,768	3,885.00	2,972,802,000	1.18
日本	株式	ダイキン工業	機械	138,900	16,138.49	2,241,636,261	19,300.00	2,680,770,000	1.06
日本	株式	日本電産	電気機器	262,500	7,738.93	2,031,469,125	9,805.00	2,573,812,500	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	216,300	10,950.66	2,368,627,758	11,860.00	2,565,318,000	1.01
日本	株式	信越化学工業	化学	183,400	12,618.50	2,314,232,900	13,685.00	2,509,829,000	0.99
日本	株式	村田製作所	電気機器	320,400	6,643.24	2,128,494,096	6,773.00	2,170,069,200	0.86
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	743,800	3,886.96	2,891,120,848	2,917.50	2,170,036,500	0.86
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	858,500	2,993.73	2,570,117,205	2,473.50	2,123,499,750	0.84
日本	株式	KDDI	情報・通信業	780,100	3,260.86	2,543,796,886	2,656.00	2,071,945,600	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	102,500	20,360.80	2,086,982,000	20,120.00	2,062,300,000	0.82
日本	株式	花王	化学	261,100	9,110.14	2,378,657,554	7,887.00	2,059,295,700	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	751,100	2,566.95	1,928,036,145	2,685.00	2,016,703,500	0.80
日本	株式	S M C	機械	34,200	52,298.60	1,788,612,120	58,460.00	1,999,332,000	0.79
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,461,350	1,635.30	2,389,745,655	1,310.50	1,915,099,175	0.76
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	69,200	24,864.07	1,720,593,644	27,330.00	1,891,236,000	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	524,000	4,447.40	2,330,437,600	3,543.00	1,856,532,000	0.73
日本	株式	三菱商事	卸売業	704,100	2,861.39	2,014,704,699	2,512.50	1,769,051,250	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	380,200	6,028.28	2,291,952,056	4,600.00	1,748,920,000	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	929,800	1,958.94	1,821,422,412	1,803.00	1,676,429,400	0.66
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	110,800	15,265.84	1,691,455,072	14,740.00	1,633,192,000	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.15
		建設業	2.42
		食料品	3.70
		繊維製品	0.48

パルプ・紙	0.21
化学	7.17
医薬品	6.38
石油・石炭製品	0.39
ゴム製品	0.54
ガラス・土石製品	0.77
鉄鋼	0.55
非鉄金属	0.64
金属製品	0.56
機械	5.38
電気機器	15.23
輸送用機器	6.92
精密機器	2.69
その他製品	2.75
電気・ガス業	1.40
陸運業	3.67
海運業	0.14
空運業	0.32
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	9.96
卸売業	4.62
小売業	4.96
銀行業	4.65
証券、商品先物取引業	0.77
保険業	1.82
その他金融業	1.12
不動産業	1.91
サービス業	5.61
小計	98.16
合計	98.16

(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	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	276円		4,504,119,000	4,486,380,000	1.77

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

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

## 日本債券マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	308,789,850,950	83.35
地方債証券	日本	20,378,902,162	5.50
特殊債証券	日本	24,953,304,160	6.74
社債券	日本	14,340,334,000	3.87
	フランス	1,095,746,000	0.30
	オーストラリア	200,546,000	0.05
	スペイン	98,888,000	0.03
	小計	15,735,514,000	4.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		618,405,717	0.17
合計(純資産総額)		370,475,976,989	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141回利付国債(5年)	6,750,000,000	101.00	6,817,500,000	100.93	6,813,247,500	0.100	2024/9/20	1.84
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	6,160,000,000	100.88	6,214,208,000	100.75	6,206,754,400	0.100	2023/12/20	1.68
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	4,000,000,000	101.25	4,050,000,000	101.36	4,054,520,000	0.100	2028/12/20	1.09
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	3,980,000,000	101.69	4,047,346,000	101.29	4,031,421,600	0.100	2026/9/20	1.09
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,930,000,000	102.96	4,046,344,000	102.57	4,031,158,200	0.400	2025/9/20	1.09
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	3,900,000,000	101.46	3,957,012,500	101.43	3,956,121,000	0.100	2027/9/20	1.07
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	3,700,000,000	100.66	3,724,426,100	100.53	3,719,758,000	0.100	2022/12/20	1.00
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	3,660,000,000	101.22	3,704,790,000	101.31	3,708,238,800	0.100	2029/3/20	1.00
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	3,560,000,000	102.69	3,655,764,000	102.38	3,644,728,000	0.400	2025/3/20	0.98

日本	国債証券	第347回利付国債（10年）	3,415,000,000	101.48	3,465,686,000	101.42	3,463,527,150	0.100	2027/6/20	0.93
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	3,220,000,000	101.10	3,255,459,300	101.03	3,253,262,600	0.100	2025/3/20	0.88
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	3,190,000,000	101.33	3,232,490,800	101.18	3,227,705,800	0.100	2026/3/20	0.87
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	3,200,000,000	100.96	3,230,816,000	100.59	3,218,976,000	0.100	2023/3/20	0.87
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	3,090,000,000	100.99	3,120,796,900	100.99	3,120,714,600	0.100	2030/3/20	0.84
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	3,040,000,000	101.11	3,073,744,000	101.12	3,074,139,200	0.100	2029/9/20	0.83
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	2,875,000,000	102.82	2,956,075,000	102.44	2,945,207,500	0.400	2025/6/20	0.79
日本	国債証券	第137回利付国債（5年）	2,880,000,000	100.77	2,902,456,000	100.70	2,900,160,000	0.100	2023/9/20	0.78
日本	国債証券	第153回利付国債（20年）	2,510,000,000	117.22	2,942,222,000	115.31	2,894,381,400	1.300	2035/6/20	0.78
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	2,650,000,000	101.40	2,687,190,300	101.46	2,688,849,000	0.100	2028/3/20	0.73
日本	国債証券	第409回利付国債（2年）	2,640,000,000	100.68	2,657,952,000	100.33	2,648,817,600	0.100	2022/2/1	0.71
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	2,620,000,000	101.69	2,664,278,000	101.06	2,647,798,200	0.100	2029/12/20	0.71
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	2,580,000,000	101.46	2,617,693,800	101.31	2,613,927,000	0.100	2026/12/20	0.71
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	2,580,000,000	101.13	2,609,207,900	101.22	2,611,579,200	0.100	2029/6/20	0.70
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	2,495,000,000	101.57	2,534,243,950	101.36	2,529,106,650	0.100	2027/3/20	0.68
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,140,000,000	118.92	2,544,945,200	117.59	2,516,468,800	1.500	2034/6/20	0.68
日本	国債証券	第170回利付国債（20年）	2,550,000,000	100.17	2,554,559,200	98.58	2,513,892,000	0.300	2039/9/20	0.68
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	2,470,000,000	100.93	2,492,971,000	100.81	2,490,204,600	0.100	2024/3/20	0.67
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	2,455,000,000	101.34	2,488,112,700	101.23	2,485,368,350	0.100	2026/6/20	0.67
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	2,450,000,000	101.37	2,483,755,200	101.43	2,485,206,500	0.100	2028/6/20	0.67
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	2,430,000,000	100.72	2,447,648,700	100.87	2,451,213,900	0.100	2030/6/20	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.35
地方債証券	5.50
特殊債券	6.74
社債券	4.25
合計	99.83

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国株式マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	159,788,005,617	65.19
	イギリス	10,079,073,696	4.11
	スイス	8,780,817,317	3.58
	カナダ	8,125,989,712	3.32
	フランス	7,841,826,959	3.20
	ドイツ	7,512,296,958	3.06
	オーストラリア	4,713,258,945	1.92
	オランダ	4,557,071,269	1.86
	アイルランド	4,308,301,536	1.76
	スウェーデン	2,491,428,282	1.02
	デンマーク	2,010,354,673	0.82
	香港	1,856,192,304	0.76
	スペイン	1,767,999,082	0.72
	イタリア	1,424,463,821	0.58
	フィンランド	983,190,143	0.40
	バミューダ	728,587,724	0.30
	ベルギー	703,328,983	0.29
	シンガポール	682,009,010	0.28
	ジャージー	542,959,245	0.22
	ケイマン	438,392,257	0.18
	ノルウェー	438,366,666	0.18
	イスラエル	424,153,205	0.17
	ニュージーランド	232,482,897	0.09
ルクセンブルク	160,274,545	0.07	
ポルトガル	128,249,733	0.05	
キュラソー	125,304,442	0.05	

	オーストリア	113,989,213	0.05
	リベリア	65,089,557	0.03
	マン島	45,952,422	0.02
	パナマ	42,647,172	0.02
	パプアニューギニア	23,206,634	0.01
	小計	231,135,264,019	94.30
投資信託受益証券	オーストラリア	111,843,898	0.05
	香港	39,306,540	0.02
	小計	151,150,438	0.06
投資証券	アメリカ	4,585,531,446	1.87
	オーストラリア	332,225,449	0.14
	シンガポール	137,334,775	0.06
	イギリス	124,048,061	0.05
	フランス	108,408,788	0.04
	香港	92,533,691	0.04
	カナダ	39,987,013	0.02
	小計	5,420,069,223	2.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,394,003,888	3.42
合計(純資産総額)		245,100,487,568	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	5,960,722,274	2.43
	買建	カナダ	382,426,170	0.16
	買建	ドイツ	1,290,435,948	0.53
	買建	イギリス	495,370,321	0.20
	買建	オーストラリア	246,418,232	0.10

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

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

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		1,018,791,014	0.42

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	940,493	8,858.23	8,331,111,298	12,070.72	11,352,429,546	4.63
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	390,823	19,556.82	7,643,258,515	21,928.10	8,570,008,953	3.50
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	23,000	228,477.99	5,254,993,936	332,728.30	7,652,750,992	3.12
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	130,467	22,789.94	2,973,336,158	27,697.38	3,613,594,337	1.47
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	16,418	156,161.67	2,563,862,425	155,455.11	2,552,262,062	1.04
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	16,282	155,889.82	2,538,198,077	155,104.91	2,525,418,242	1.03
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	142,983	16,057.70	2,295,978,551	15,558.94	2,224,665,062	0.91
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	161,653	12,472.15	2,016,162,079	12,619.88	2,040,042,755	0.83
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	134,369	13,435.23	1,805,278,459	14,522.10	1,951,321,130	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	91,568	21,356.61	1,955,582,175	21,100.75	1,932,153,659	0.79
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	33,380	30,077.23	1,003,978,149	55,971.37	1,868,324,464	0.76
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	40,267	18,255.15	735,080,143	44,337.60	1,785,342,381	0.73
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	48,511	34,595.99	1,678,286,210	35,573.13	1,725,688,303	0.70
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	75,489	23,678.52	1,787,467,894	22,264.55	1,680,728,766	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	58,380	25,389.74	1,482,253,121	28,789.23	1,680,715,714	0.69
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	165,395	14,080.71	2,328,880,394	10,088.03	1,668,509,722	0.68



アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	51,480	30,946.00	1,593,100,240	32,179.07	1,656,578,524	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信 サービス	224,654	6,260.25	1,406,392,182	6,267.59	1,408,039,613	0.57
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	38,187	38,485.20	1,469,634,618	36,835.80	1,406,649,000	0.57
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェ ア・サービ ス	26,156	39,917.59	1,044,084,730	51,771.11	1,354,125,258	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・ 娯楽	98,064	14,761.37	1,447,559,225	13,267.31	1,301,046,468	0.53
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェ ア・サービ ス	48,828	20,800.94	1,015,668,672	26,180.21	1,278,327,294	0.52
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・ 娯楽	23,877	40,354.01	963,532,902	52,210.18	1,246,622,563	0.51
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェ ア・サービ ス	60,561	13,406.41	811,905,679	20,578.09	1,246,230,314	0.51
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	229,894	6,899.80	1,586,224,773	5,415.90	1,245,083,374	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・ 娯楽	247,320	4,667.91	1,154,469,153	4,887.95	1,208,890,267	0.49
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	137,053	8,992.24	1,232,414,691	8,665.01	1,187,566,986	0.48
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	386,877	3,957.18	1,530,945,026	2,994.14	1,158,363,901	0.47
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	301,627	3,994.17	1,204,749,739	3,826.78	1,154,261,981	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバコ	221,557	6,071.41	1,345,164,446	5,175.73	1,146,720,541	0.47

(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	2.59
		素材	4.29
		資本財	5.96
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	2.05
		自動車・自動車部品	1.51
		耐久消費財・アパレル	1.87
		消費者サービス	1.49
		メディア・娯楽	6.49
		小売	6.10

		食品・生活必需品小売り	1.49
		食品・飲料・タバコ	4.30
		家庭用品・パーソナル用品	2.17
		ヘルスケア機器・サービス	5.15
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.23
		銀行	4.74
		各種金融	4.04
		保険	2.90
		不動産	0.46
		ソフトウェア・サービス	12.09
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.02
		電気通信サービス	1.95
		公益事業	3.26
		半導体・半導体製造装置	3.96
		小計	94.30
投資信託受益証券			0.06
投資証券			2.21
合計			96.58

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	338	アメリカドル	56,870,821	6,016,932,862	56,339,530	5,960,722,274	2.43
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	25	カナダドル	4,859,820.5	384,071,614	4,839,000	382,426,170	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	31	スイスフラン	3,238,787	372,590,056	3,162,000	363,756,480	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	233	ユーロ	7,683,298.5	954,035,174	7,462,990	926,679,468	0.38
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	22	オーストラリアドル	3,242,379	244,767,190	3,264,250	246,418,232	0.10
	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	62	イギリスポンド	3,754,777.5	510,987,669	3,640,020	495,370,321	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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	7,124,050.00	755,927,958	753,582,009	0.31
	ユーロ	買建	1,400,000.00	175,646,640	173,838,000	0.07
	イギリスポンド	買建	671,500.00	91,256,850	91,371,005	0.04

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

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

## 外国債券マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	62,247,003,270	42.83
	フランス	15,021,826,508	10.34
	イタリア	13,394,020,527	9.22
	ドイツ	10,941,566,722	7.53
	イギリス	9,314,079,042	6.41
	スペイン	8,647,655,365	5.95
	ベルギー	3,726,120,724	2.56
	オーストラリア	3,441,436,206	2.37
	オランダ	2,735,483,963	1.88
	カナダ	2,711,982,791	1.87
	オーストリア	2,277,838,352	1.57
	アイルランド	1,174,905,094	0.81
	メキシコ	1,044,418,270	0.72
	ポーランド	904,687,556	0.62
	フィンランド	872,005,648	0.60
	デンマーク	763,763,765	0.53
	マレーシア	714,568,037	0.49
	シンガポール	642,101,625	0.44
	イスラエル	560,001,372	0.39
	スウェーデン	439,092,179	0.30
ノルウェー	300,268,635	0.21	
	小計	141,874,825,651	97.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,445,213,197	2.37
合計(純資産総額)		145,320,038,848	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	921,083,221	0.63
	買建	ドイツ	1,191,162,810	0.82

(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		1,959,943,400	1.35

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	8,900,000	11,115.61	989,289,512	11,502.85	1,023,754,273	2.750	2024/2/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	6,910,000	12,581.93	869,411,665	14,562.37	1,006,260,328	3.000	2048/8/15	0.69
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	8,300,000	10,546.93	875,395,813	11,295.80	937,551,659	1.500	2026/8/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 2% 04/30/24	8,000,000	10,815.57	865,245,630	11,270.59	901,647,440	2.000	2024/4/30	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/30/24	8,000,000	10,596.53	847,722,500	11,130.90	890,472,310	1.500	2024/9/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.25% 04/30/24	7,600,000	10,920.95	829,992,732	11,365.64	863,789,219	2.250	2024/4/30	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	7,250,000	10,922.61	791,889,234	11,502.03	833,897,211	2.125	2025/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	10,541.75	780,089,929	10,579.17	782,858,837	0.625	2030/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	6,180,000	10,845.55	670,255,485	12,615.82	779,657,891	2.250	2046/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	11,001.13	737,075,952	11,474.34	768,780,821	2.375	2024/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/15/21	7,000,000	10,835.61	758,493,015	10,906.49	763,454,457	2.875	2021/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	6,500,000	11,008.57	715,557,220	11,645.02	756,926,674	2.250	2025/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/15/29	6,260,000	10,567.60	661,531,860	11,549.55	723,002,322	1.625	2029/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	10,757.71	699,251,215	11,047.83	718,109,234	2.000	2023/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	10,848.21	656,317,280	11,400.77	689,746,985	2.000	2025/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/15/21	6,320,000	10,899.72	688,862,785	10,899.05	688,820,158	2.625	2021/12/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	5,390,000	11,465.24	617,976,893	12,390.99	667,874,818	2.625	2029/2/15	0.46

アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	10,638.27	611,700,676	11,331.75	651,576,120	1.625	2026/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/49	5,110,000	11,705.93	598,173,384	12,722.45	650,117,195	2.250	2049/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/48	4,400,000	12,551.35	552,259,471	14,519.39	638,853,463	3.000	2048/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.5% 06/30/27	6,000,000	10,604.41	636,264,611	10,637.85	638,271,563	0.500	2027/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	5,800,000	10,643.23	617,307,456	10,985.84	637,178,850	1.625	2023/4/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/49	4,400,000	12,337.27	542,839,962	14,312.75	629,761,275	2.875	2049/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	5,800,000	10,891.47	631,705,561	10,853.38	629,496,359	1.500	2022/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	11,094.12	583,550,810	11,920.68	627,027,998	2.250	2027/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	4,750,000	11,375.61	540,341,760	13,184.49	626,263,678	2.500	2046/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	10,634.96	574,288,184	11,349.94	612,896,921	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/22	5,500,000	10,743.24	590,878,536	11,007.74	605,426,036	2.000	2022/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/22	5,400,000	10,963.10	592,007,497	10,922.81	589,832,104	2.125	2022/5/15	0.41
フランス	国債証券	FRTR 5.75% 10/25/32	2,720,000	21,408.29	582,305,745	21,503.13	584,885,402	5.750	2032/10/25	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.63
合計	97.63

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	26	アメリカ ドル	3,275,010.19	346,496,078	3,279,453.06	346,966,134	0.24
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	16	アメリカ ドル	2,228,142.18	235,737,443	2,236,500	236,621,700	0.16
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	18	アメリカ ドル	3,167,697	335,142,342	3,189,937.5	337,495,387	0.23
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	12	ユーロ	1,347,748	167,349,869	1,347,660	167,338,942	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	17	ユーロ	2,298,958	285,461,615	2,299,760	285,561,199	0.20
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	34	ユーロ	5,925,636	735,786,222	5,945,580	738,262,669	0.51

(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	8,000,000.00	847,715,695	846,240,000	0.58
	カナダドル	買建	1,260,000.00	101,129,057	99,565,200	0.07
	ユーロ	買建	6,940,000.00	869,293,748	861,739,800	0.59
	イギリスポンド	買建	1,120,000.00	152,108,222	152,398,400	0.10

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

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2020年9月30日

## DCバランスファンド30

## 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 14,557円

純資産総額 213.44億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2016年2月	0円
2017年2月	0円
2018年2月	0円
2019年2月	0円
2020年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

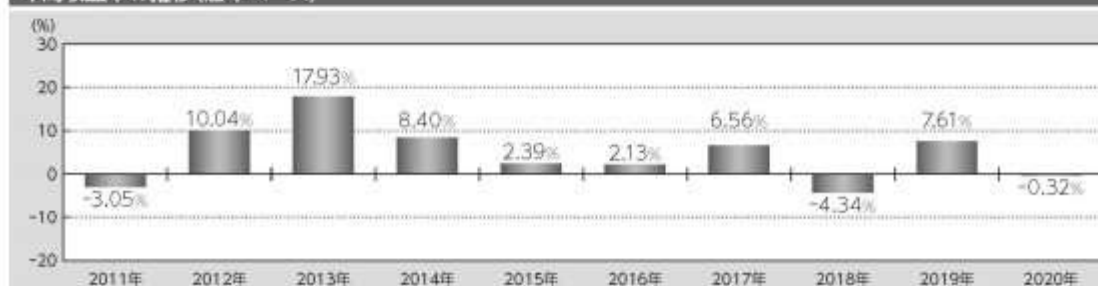
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	59.4%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	1.1%
		第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	1.0%
		第353回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/12/20	0.7%
日本株式 マザーファンド	19.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.4%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
外国株式 マザーファンド	10.1%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ソフトウェア	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.3%
外国債券 マザーファンド	10.0%	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.1%
		T 3% 08/15/48	アメリカ	国債	-	3.000%	2048/08/15	0.1%
		T 1.5% 08/15/26	アメリカ	国債	-	1.500%	2026/08/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※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。

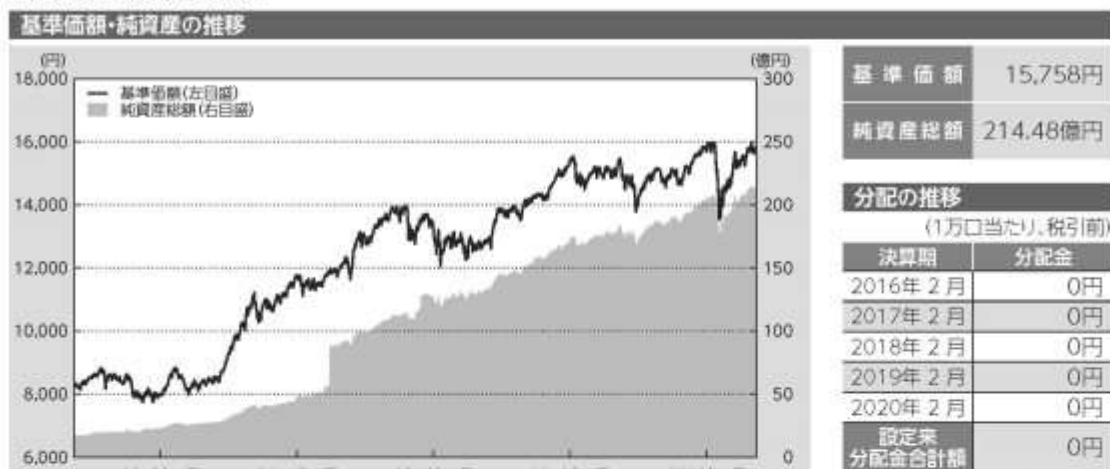
最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 運用実績

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2020年9月30日

### DCバランスファンド50



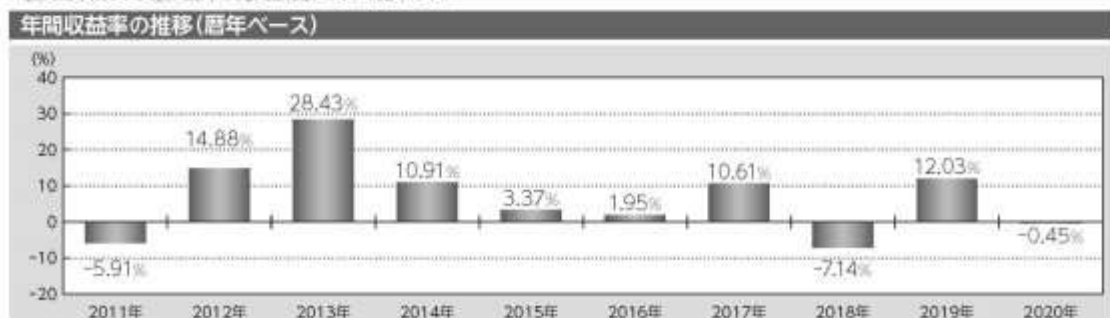
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

※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
日本債券 マザーファンド	39.3%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.7%
		第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.7%
		第353回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/12/20	0.4%
日本株式 マザーファンド	30.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.0%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.7%
外国株式 マザーファンド	20.3%	ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/IT機器	-	-	0.9%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.7%
外国債券 マザーファンド	9.7%	AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.6%
		T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.1%
		T 3% 08/15/48	アメリカ	国債	-	3.000%	2048/08/15	0.1%
		T 1.5% 08/15/26	アメリカ	国債	-	1.500%	2026/08/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



※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：2006年9月29日  
作成基準日：2020年9月30日

## DCバランスファンド70

### 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	16,405円
純資産総額	87.47億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2016年2月	0円
2017年2月	0円
2018年2月	0円
2019年2月	0円
2020年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

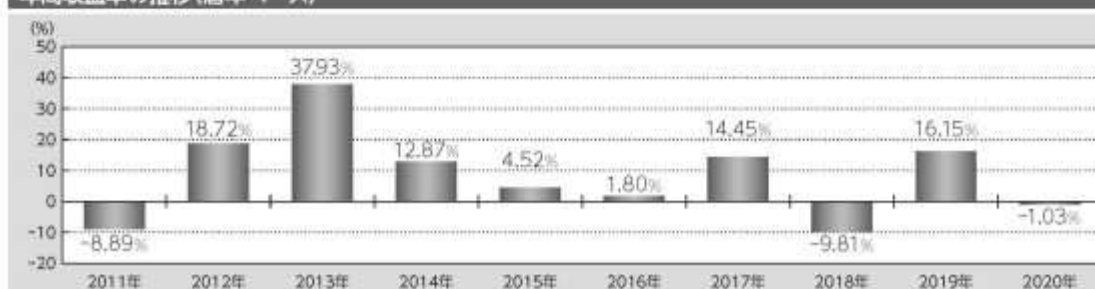
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式 マザーファンド	39.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.3%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.9%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.9%
外国株式 マザーファンド	30.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ソフトウェア	-	-	1.4%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.0%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.9%
日本債券 マザーファンド	24.6%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.5%
		第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.4%
		第353回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/12/20	0.3%
外国債券 マザーファンド	4.9%	T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.0%
		T 3% 08/15/48	アメリカ	国債	-	3.000%	2048/08/15	0.0%
		T 1.5% 08/15/26	アメリカ	国債	-	1.500%	2026/08/15	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。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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

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

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

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

#### < 解約価額 >

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

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

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

#### < 一部解約の制限 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3 【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### < 基準価額の算出方法 >

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

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

#### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

#### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

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

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2006年9月29日設定）

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

#### (4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年2月22日から翌年2月21日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2006年9月29日から2007年2月21日までとします。

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

#### (5)【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

##### (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

### (1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

### < 反対者の買取請求権 >

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

### < 運用報告書 >

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

### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

### (3) 換金（解約）請求権



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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

## 【DCバランスファンド30】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2019年2月22日から2020年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期 (2020年 2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	81,939,255	73,580,659
親投資信託受益証券	18,144,450,639	20,248,119,071
未収入金	3,734,152	21,402,662
流動資産合計	18,230,124,046	20,343,102,392
資産合計	18,230,124,046	20,343,102,392
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,268,556	8,796,279
未払受託者報酬	3,864,260	4,353,927
未払委託者報酬	16,423,036	18,504,123
未払利息	196	32
その他未払費用	482,969	544,179
流動負債合計	25,039,017	32,198,540
負債合計	25,039,017	32,198,540
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	12,980,103,562	13,829,328,777
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,224,981,467	6,481,575,075
(分配準備積立金)	2,310,477,990	2,904,019,781
元本等合計	18,205,085,029	20,310,903,852
純資産合計	18,205,085,029	20,310,903,852
負債純資産合計	18,230,124,046	20,343,102,392

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自 2018年 2月22日	至 2019年 2月21日	自 2019年 2月22日	至 2020年 2月21日
営業収益				
受取利息		14		81
有価証券売買等損益		95,487,599		939,535,803
営業収益合計		95,487,613		939,535,884
営業費用				
支払利息		46,956		40,654
受託者報酬		7,496,151		8,347,791
委託者報酬		31,858,494		35,477,991
その他費用		941,229		1,043,800
営業費用合計		40,342,830		44,910,236
営業利益又は営業損失（ ）		55,144,783		894,625,648
経常利益又は経常損失（ ）		55,144,783		894,625,648
当期純利益又は当期純損失（ ）		55,144,783		894,625,648
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（ ）		2,045,815		20,090,192
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,654,278,118		5,224,981,467
剰余金増加額又は欠損金減少額		734,974,413		715,556,623
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		734,974,413		715,556,623
剰余金減少額又は欠損金増加額		221,461,662		333,498,471
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		221,461,662		333,498,471
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,224,981,467		6,481,575,075

## (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13期 (2019年 2月21日現在)	第14期 (2020年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	12,980,103,562口	13,829,328,777口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4025円 (14,025円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4687円 (14,687円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日	第14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日																																																												
<b>分配金の計算過程</b> <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>210,323,287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>3,728,732,322円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,100,154,703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>6,039,210,312円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>12,980,103,562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>4,652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	210,323,287円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	3,728,732,322円	分配準備積立金額	D	2,100,154,703円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,039,210,312円	当ファンドの期末残存口数	F	12,980,103,562口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,652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	<b>分配金の計算過程</b> <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>263,784,123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>466,783,938円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>4,264,411,028円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,173,451,720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>7,168,430,809円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>13,829,328,777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>5,183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	263,784,123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	466,783,938円	収益調整金額	C	4,264,411,028円	分配準備積立金額	D	2,173,451,720円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,168,430,809円	当ファンドの期末残存口数	F	13,829,328,777口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,183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	210,323,287円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	3,728,732,322円																																																											
分配準備積立金額	D	2,100,154,703円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,039,210,312円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	12,980,103,562口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,652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	263,784,123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	466,783,938円																																																											
収益調整金額	C	4,264,411,028円																																																											
分配準備積立金額	D	2,173,451,720円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,168,430,809円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	13,829,328,777口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,183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14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (2020年 2月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第13期	第14期
	自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日	自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	11,684,589,078円	12,980,103,562円
期中追加設定元本額	1,853,591,536円	1,679,276,139円
期中一部解約元本額	558,077,052円	830,050,924円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期 (2020年 2月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	114,834,059	925,149,782
合計	114,834,059	925,149,782

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,243,336,090	4,057,521,985	
	日本債券マザーファンド	8,603,507,543	12,002,753,373	
	外国株式マザーファンド	709,156,653	2,295,965,579	
	外国債券マザーファンド	745,597,121	1,891,878,134	
合計		12,301,597,407	20,248,119,071	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 【DCバランスファンド50】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2019年2月22日から2020年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期 (2020年 2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	85,990,106	71,708,931
親投資信託受益証券	18,070,303,107	20,632,324,073
未収入金	-	39,473,889
流動資産合計	18,156,293,213	20,743,506,893
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,539,754	22,056,432
未払受託者報酬	3,844,947	4,393,890
未払委託者報酬	17,302,182	19,772,444
未払利息	205	31
その他未払費用	480,554	549,179
流動負債合計	25,167,642	46,771,976
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	12,196,046,788	12,979,122,227
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,935,078,783	7,717,612,690
(分配準備積立金)	3,475,385,814	4,368,969,027
元本等合計	18,131,125,571	20,696,734,917
純資産合計	18,131,125,571	20,696,734,917
負債純資産合計	18,156,293,213	20,743,506,893

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自 2018年 2月22日	至 2019年 2月21日	自 2019年 2月22日	至 2020年 2月21日
営業収益				
受取利息		15		81
有価証券売買等損益		20,797,325		1,424,443,495
営業収益合計		20,797,340		1,424,443,576
営業費用				
支払利息		46,998		41,417
受託者報酬		7,557,887		8,374,767
委託者報酬		34,010,324		37,686,329
その他費用		948,966		1,047,178
営業費用合計		42,564,175		47,149,691
営業利益又は営業損失（ ）		21,766,835		1,377,293,885
経常利益又は経常損失（ ）		21,766,835		1,377,293,885
当期純利益又は当期純損失（ ）		21,766,835		1,377,293,885
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（ ）		2,104,540		25,702,410
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,535,743,594		5,935,078,783
剰余金増加額又は欠損金減少額		717,693,906		799,773,260
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		717,693,906		799,773,260
剰余金減少額又は欠損金増加額		298,696,422		368,830,828
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		298,696,422		368,830,828
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,935,078,783		7,717,612,690

## (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13期 (2019年 2月21日現在)	第14期 (2020年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	12,196,046,788口	12,979,122,227口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4866円 (14,866円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5946円 (15,946円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日	第14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日																																																												
<b>分配金の計算過程</b> <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>253,194,379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>4,759,437,585円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>3,222,191,435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>8,234,823,399円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>12,196,046,788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>6,752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	253,194,379円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	4,759,437,585円	分配準備積立金額	D	3,222,191,435円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,234,823,399円	当ファンドの期末残存口数	F	12,196,046,788口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,752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	<b>分配金の計算過程</b> <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>322,344,820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>772,288,530円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>5,493,363,535円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>3,274,335,677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>9,862,332,562円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>12,979,122,227口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>7,598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	322,344,820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	772,288,530円	収益調整金額	C	5,493,363,535円	分配準備積立金額	D	3,274,335,677円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,862,332,562円	当ファンドの期末残存口数	F	12,979,122,227口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,598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	253,194,379円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	4,759,437,585円																																																											
分配準備積立金額	D	3,222,191,435円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,234,823,399円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	12,196,046,788口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,752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	322,344,820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	772,288,530円																																																											
収益調整金額	C	5,493,363,535円																																																											
分配準備積立金額	D	3,274,335,677円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,862,332,562円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	12,979,122,227口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,598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14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (2020年 2月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第13期	第14期
	自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日	自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	11,322,127,617円	12,196,046,788円
期中追加設定元本額	1,487,203,756円	1,542,536,422円
期中一部解約元本額	613,284,585円	759,460,983円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期 (2020年 2月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	28,229,137	1,403,731,036
合計	28,229,137	1,403,731,036

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,399,944,054	6,149,478,810	
	日本債券マザーファンド	5,770,786,088	8,050,823,671	
	外国株式マザーファンド	1,388,882,149	4,496,644,845	
	外国債券マザーファンド	762,740,107	1,935,376,747	
合計		11,322,352,398	20,632,324,073	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【DCバランスファンド70】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2019年2月22日から2020年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期 (2020年 2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	32,012,170	35,232,651
親投資信託受益証券	7,082,997,095	8,324,796,087
未収入金	-	5,297,790
流動資産合計	7,115,009,265	8,365,326,528
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	709,824	5,830,056
未払受託者報酬	1,510,477	1,736,537
未払委託者報酬	7,174,725	8,248,452
未払利息	76	15
その他未払費用	188,742	217,004
流動負債合計	9,583,844	16,032,064
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,651,467,417	4,997,769,197
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,453,958,004	3,351,525,267
(分配準備積立金)	1,509,587,011	1,901,546,131
元本等合計	7,105,425,421	8,349,294,464
純資産合計	7,105,425,421	8,349,294,464
負債純資産合計	7,115,009,265	8,365,326,528

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	2018年 2月22日	自	2019年 2月22日
	至	2019年 2月21日	至	2020年 2月21日
営業収益				
受取利息		4		32
有価証券売買等損益		40,785,938		715,062,580
営業収益合計		40,785,934		715,062,612
営業費用				
支払利息		18,996		15,625
受託者報酬		2,963,504		3,286,221
委託者報酬		14,076,508		15,609,368
その他費用		371,975		410,823
営業費用合計		17,430,983		19,322,037
営業利益又は営業損失（ ）		58,216,917		695,740,575
経常利益又は経常損失（ ）		58,216,917		695,740,575
当期純利益又は当期純損失（ ）		58,216,917		695,740,575
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（ ）		2,129,183		18,284,576
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,299,787,160		2,453,958,004
剰余金増加額又は欠損金減少額		402,045,238		456,519,616
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		402,045,238		456,519,616
剰余金減少額又は欠損金増加額		191,786,660		236,408,352
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		191,786,660		236,408,352
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,453,958,004		3,351,525,267



## (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13期 (2019年 2月21日現在)	第14期 (2020年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,651,467,417口	4,997,769,197口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5276円 (15,276円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6706円 (16,706円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日	第14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日																																																												
<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>110,432,013円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,084,113,328円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,399,154,998円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,593,700,339円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>4,651,467,417口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>7,725円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	110,432,013円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	2,084,113,328円	分配準備積立金額	D	1,399,154,998円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,593,700,339円	当ファンドの期末残存口数	F	4,651,467,417口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,725円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	<b>分配金の計算過程</b> <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>142,533,260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>383,275,319円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,488,049,473円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,375,737,552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>4,389,595,604円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>4,997,769,197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>8,783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	142,533,260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	383,275,319円	収益調整金額	C	2,488,049,473円	分配準備積立金額	D	1,375,737,552円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,389,595,604円	当ファンドの期末残存口数	F	4,997,769,197口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	8,783円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	110,432,013円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	2,084,113,328円																																																											
分配準備積立金額	D	1,399,154,998円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,593,700,339円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	4,651,467,417口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,725円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	142,533,260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	383,275,319円																																																											
収益調整金額	C	2,488,049,473円																																																											
分配準備積立金額	D	1,375,737,552円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,389,595,604円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	4,997,769,197口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	8,783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14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (2020年 2月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第13期	第14期
	自 2018年 2月22日 至 2019年 2月21日	自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,254,836,786円	4,651,467,417円
期中追加設定元本額	752,735,309円	795,085,220円
期中一部解約元本額	356,104,678円	448,783,440円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 (2019年 2月21日現在)	第14期 (2020年 2月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	37,594,382	707,955,891
合計	37,594,382	707,955,891

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,803,648,249	3,262,258,587
	日本債券マザーファンド	1,452,129,861	2,025,866,369
	外国株式マザーファンド	823,459,913	2,666,033,814
	外国債券マザーファンド	146,069,724	370,637,317
合計		4,225,307,747	8,324,796,087

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 日本株式マザーファンド

#### 貸借対照表

	2020年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,984,626,347
株式	249,018,304,940
未収入金	17,205,000
未収配当金	380,987,145
前払金	51,888,500
差入委託証拠金	48,775,000
流動資産合計	251,501,786,932
資産合計	251,501,786,932
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	51,898,400
未払解約金	368,262,605
未払利息	867
流動負債合計	420,161,872
負債合計	420,161,872
純資産の部	
元本等	
元本	138,817,553,099
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	112,264,071,961
元本等合計	251,081,625,060
純資産合計	251,081,625,060

	2020年 2月21日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	251,501,786,932

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

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	138,817,553,099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 1.8087円 (1万口当たり純資産額) (18,087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

2020年 2月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年 2月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2020年 2月21日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 2月22日
期首元本額	132,482,711,953円
期中追加設定元本額	21,515,417,494円
期中一部解約元本額	15,180,576,348円
期末元本額	138,817,553,099円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	708,138,880円
D C 日本株式インデックスファンド	312,890,436円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,341,965,493円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,120,197,797円
D C バランスファンド 3 0	2,243,336,090円
D C バランスファンド 5 0	3,399,944,054円
D C バランスファンド 7 0	1,803,648,249円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	600,983,284円
日本株式インデックス e	1,711,285,534円
インデックスコレクション（国内株式）	18,133,148,128円

区分	2020年 2月21日現在
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,243,967,598円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,204,510,521円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,684,561,515円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,442,942,591円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,265,272,909円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,454,786,358円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	97,834,149円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	993,202,128円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	108,936,435円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	481,716,549円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	4,591,192円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	775,496,600円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,217,140,673円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	601,322,512円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	10,131,196,901円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	860,398,931円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	134,676,628円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,619,590,242円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	42,415,743円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	195,090,038円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,587,818,527円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	77,517,429円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	79,331,272円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	38,210,716円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	859,968,515円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	405,782,937円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	6,470,798,460円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	117,823,789円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	59,157,405円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	11,290,810円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	169,000,003円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	5,665,078円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,444,534,930
合計	10,444,534,930

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



## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2020年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,105,988,500	-	2,054,100,000	51,888,500
合計		2,105,988,500	-	2,054,100,000	51,888,500

## (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	5,000	2,798.00	13,990,000	
日本水産	143,400	594.00	85,179,600	
マルハニチロ	20,700	2,544.00	52,660,800	
カネコ種苗	4,300	1,272.00	5,469,600	
サカタのタネ	17,100	3,335.00	57,028,500	
ホクト	10,900	1,970.00	21,473,000	
ホクリヨウ	2,200	778.00	1,711,600	
住石ホールディングス	29,000	141.00	4,089,000	
日鉄鉱業	3,300	4,255.00	14,041,500	
三井松島ホールディングス	5,600	1,119.00	6,266,400	
国際石油開発帝石	575,300	1,069.50	615,283,350	
石油資源開発	18,700	2,766.00	51,724,200	
K & O エナジーグループ	7,000	1,688.00	11,816,000	
ヒノキヤグループ	3,600	2,044.00	7,358,400	
ショーボンドホールディングス	22,300	4,285.00	95,555,500	
ミライト・ホールディングス	42,600	1,527.00	65,050,200	
タマホーム	6,800	1,391.00	9,458,800	
サンヨーホームズ	1,200	740.00	888,000	
日本アクア	5,700	612.00	3,488,400	

ファーストコーポレーション	4,400	585.00	2,574,000
ベストエラ	2,500	1,093.00	2,732,500
TATERU	29,600	192.00	5,683,200
キャンディル	1,300	658.00	855,400
スペースバリューホールディングス	17,500	535.00	9,362,500
ダイセキ環境ソリューション	2,800	983.00	2,752,400
第一カッター興業	1,800	1,885.00	3,393,000
明豊ファシリティワークス	3,500	749.00	2,621,500
安藤・間	85,400	862.00	73,614,800
東急建設	42,000	749.00	31,458,000
コムシスホールディングス	50,900	2,855.00	145,319,500
ピーアールホールディングス	15,600	499.00	7,784,400
高松コンストラクショングループ	8,900	2,600.00	23,140,000
東建コーポレーション	4,400	8,190.00	36,036,000
ソネック	1,500	753.00	1,129,500
ヤマウラ	6,200	939.00	5,821,800
大成建設	110,400	4,010.00	442,704,000
大林組	331,200	1,209.00	400,420,800
清水建設	336,100	1,064.00	357,610,400
飛鳥建設	9,500	1,342.00	12,749,000
長谷工コーポレーション	128,200	1,408.00	180,505,600
松井建設	13,000	733.00	9,529,000
銭高組	1,400	3,905.00	5,467,000
鹿島建設	260,000	1,260.00	327,600,000
不動テトラ	8,700	1,614.00	14,041,800
大末建設	3,800	946.00	3,594,800
鉄建建設	7,200	2,624.00	18,892,800
西松建設	25,500	2,411.00	61,480,500
三井住友建設	80,000	603.00	48,240,000
大豊建設	7,400	2,601.00	19,247,400
前田建設工業	82,900	1,054.00	87,376,600
佐田建設	7,100	392.00	2,783,200
ナカノフドー建設	9,000	455.00	4,095,000
奥村組	18,000	2,828.00	50,904,000
東鉄工業	14,200	3,010.00	42,742,000
イチケン	2,400	1,693.00	4,063,200
富士ピー・エス	4,900	515.00	2,523,500
浅沼組	3,700	4,995.00	18,481,500
戸田建設	137,500	713.00	98,037,500
熊谷組	15,300	3,180.00	48,654,000
北野建設	2,000	2,513.00	5,026,000
植木組	1,500	2,555.00	3,832,500

矢作建設工業	14,600	845.00	12,337,000
ピーエス三菱	10,900	662.00	7,215,800
日本ハウスホールディングス	22,600	445.00	10,057,000
大東建託	39,700	12,555.00	498,433,500
新日本建設	14,100	853.00	12,027,300
N I P P O	27,400	2,670.00	73,158,000
東亜道路工業	2,100	3,365.00	7,066,500
前田道路	35,100	3,390.00	118,989,000
日本道路	3,200	7,130.00	22,816,000
東亜建設工業	10,300	1,750.00	18,025,000
日本国土開発	19,300	590.00	11,387,000
若築建設	6,000	1,596.00	9,576,000
東洋建設	37,100	507.00	18,809,700
五洋建設	131,300	650.00	85,345,000
世紀東急工業	15,900	875.00	13,912,500
福田組	3,800	4,330.00	16,454,000
住友林業	83,900	1,741.00	146,069,900
日本基礎技術	11,100	364.00	4,040,400
巴コーポレーション	14,700	374.00	5,497,800
大和ハウス工業	327,700	3,337.00	1,093,534,900
ライト工業	19,000	1,462.00	27,778,000
積水ハウス	362,300	2,343.00	848,868,900
日特建設	8,600	831.00	7,146,600
北陸電気工事	5,700	1,079.00	6,150,300
ユアテック	18,900	633.00	11,963,700
四電工	1,800	2,560.00	4,608,000
中電工	13,300	2,430.00	32,319,000
関電工	47,100	997.00	46,958,700
きんでん	78,700	1,784.00	140,400,800
東京エネシス	11,000	856.00	9,416,000
トーエネック	3,300	3,680.00	12,144,000
住友電設	9,300	2,410.00	22,413,000
日本電設工業	18,200	2,183.00	39,730,600
協和エクシオ	50,200	2,625.00	131,775,000
新日本空調	8,800	2,005.00	17,644,000
九電工	23,200	3,160.00	73,312,000
三機工業	23,900	1,355.00	32,384,500
日揮ホールディングス	101,900	1,566.00	159,575,400
中外炉工業	3,600	1,708.00	6,148,800
ヤマト	10,600	719.00	7,621,400
太平電業	8,000	2,533.00	20,264,000
高砂熱学工業	28,800	1,860.00	53,568,000

三晃金属工業	1,400	2,614.00	3,659,600
朝日工業社	2,200	3,195.00	7,029,000
明星工業	21,400	788.00	16,863,200
大気社	16,100	3,415.00	54,981,500
ダイダン	7,900	2,736.00	21,614,400
日比谷総合設備	10,700	1,943.00	20,790,100
フィル・カンパニー	1,400	3,890.00	5,446,000
OSJBホールディングス	52,200	264.00	13,780,800
東洋エンジニアリング	13,900	575.00	7,992,500
レイズネクスト	17,800	1,281.00	22,801,800
日本製粉	31,000	1,644.00	50,964,000
日清製粉グループ本社	119,700	1,931.00	231,140,700
日東富士製粉	800	6,180.00	4,944,000
昭和産業	9,700	3,040.00	29,488,000
鳥越製粉	9,400	824.00	7,745,600
中部飼料	12,900	1,636.00	21,104,400
フィード・ワン	71,200	179.00	12,744,800
東洋精糖	1,800	1,192.00	2,145,600
日本甜菜製糖	5,500	1,871.00	10,290,500
三井製糖	9,300	2,082.00	19,362,600
塩水港精糖	11,500	224.00	2,576,000
日新製糖	5,000	2,017.00	10,085,000
森永製菓	24,900	4,630.00	115,287,000
中村屋	2,700	4,020.00	10,854,000
江崎グリコ	31,400	4,660.00	146,324,000
名糖産業	5,100	1,404.00	7,160,400
井村屋グループ	4,500	1,892.00	8,514,000
不二家	5,900	2,256.00	13,310,400
山崎製パン	79,400	2,016.00	160,070,400
第一屋製パン	1,800	955.00	1,719,000
モロゾフ	1,800	4,920.00	8,856,000
亀田製菓	6,000	4,770.00	28,620,000
寿スピリッツ	10,200	6,070.00	61,914,000
カルビー	48,300	3,025.00	146,107,500
森永乳業	19,600	4,020.00	78,792,000
六甲バター	7,000	1,546.00	10,822,000
ヤクルト本社	72,900	5,410.00	394,389,000
明治ホールディングス	70,100	7,040.00	493,504,000
雪印メグミルク	25,500	2,449.00	62,449,500
プリマハム	16,600	2,456.00	40,769,600
日本ハム	40,500	4,560.00	184,680,000
林兼産業	3,500	689.00	2,411,500

丸大食品	11,300	1,990.00	22,487,000
S Foods	8,500	2,612.00	22,202,000
柿安本店	3,700	3,085.00	11,414,500
伊藤ハム米久ホールディングス	68,200	660.00	45,012,000
サッポロホールディングス	36,200	2,436.00	88,183,200
アサヒグループホールディングス	222,000	4,800.00	1,065,600,000
キリンホールディングス	449,500	2,235.00	1,004,632,500
宝ホールディングス	79,400	934.00	74,159,600
オエノンホールディングス	28,000	388.00	10,864,000
養命酒製造	3,200	1,937.00	6,198,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	74,400	2,920.00	217,248,000
サントリー食品インターナショナル	70,900	4,595.00	325,785,500
ダイトーグループホールディングス	5,400	3,940.00	21,276,000
伊藤園	32,200	5,430.00	174,846,000
キーコーヒー	10,400	2,238.00	23,275,200
ユニカフェ	2,700	951.00	2,567,700
ジャパンフーズ	1,500	1,207.00	1,810,500
日清オイリオグループ	13,600	3,715.00	50,524,000
不二製油グループ本社	25,800	2,752.00	71,001,600
かどや製油	1,200	3,810.00	4,572,000
J - オイルミルズ	5,500	4,250.00	23,375,000
キッコーマン	76,300	5,740.00	437,962,000
味の素	234,100	1,969.00	460,942,900
キューピー	59,000	2,135.00	125,965,000
ハウス食品グループ本社	39,600	3,415.00	135,234,000
カゴメ	40,200	2,628.00	105,645,600
焼津水産化学工業	5,100	1,001.00	5,105,100
アリアケジャパン	9,700	7,420.00	71,974,000
ピエトロ	1,400	1,649.00	2,308,600
エバラ食品工業	2,600	2,193.00	5,701,800
やまみ	500	2,252.00	1,126,000
ニチレイ	50,500	2,816.00	142,208,000
東洋水産	54,500	4,535.00	247,157,500
イトアンド	3,700	1,826.00	6,756,200
大冷	1,400	1,973.00	2,762,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,800	1,121.00	6,501,800
日清食品ホールディングス	45,100	8,820.00	397,782,000
永谷園ホールディングス	5,200	2,117.00	11,008,400
一正蒲鉾	4,100	955.00	3,915,500
フジッコ	11,500	1,876.00	21,574,000
ロック・フィールド	11,400	1,410.00	16,074,000
日本たばこ産業	612,000	2,268.50	1,388,322,000

ケンコーマヨネーズ	5,900	2,192.00	12,932,800
わらべや日洋ホールディングス	6,900	1,850.00	12,765,000
なとり	5,900	1,707.00	10,071,300
イフジ産業	1,800	835.00	1,503,000
ピクルスコーポレーション	2,300	2,475.00	5,692,500
北の達人コーポレーション	37,000	641.00	23,717,000
ユーグレナ	45,200	827.00	37,380,400
ミヨシ油脂	4,100	1,077.00	4,415,700
理研ビタミン	5,000	4,020.00	20,100,000
片倉工業	15,300	1,321.00	20,211,300
ゲンゼ	7,700	4,165.00	32,070,500
東洋紡	41,100	1,510.00	62,061,000
ユニチカ	31,300	345.00	10,798,500
富士紡ホールディングス	5,100	3,385.00	17,263,500
倉敷紡績	10,800	2,298.00	24,818,400
シキボウ	5,400	1,267.00	6,841,800
日本毛織	34,300	999.00	34,265,700
トーア紡コーポレーション	4,100	514.00	2,107,400
帝国繊維	11,800	2,128.00	25,110,400
帝人	84,600	1,979.00	167,423,400
東レ	749,400	704.60	528,027,240
サカイオーベックス	2,900	1,930.00	5,597,000
住江織物	3,000	2,346.00	7,038,000
日本フェルト	6,600	485.00	3,201,000
イチカワ	1,700	1,463.00	2,487,100
日東製網	1,200	1,669.00	2,002,800
アツギ	8,600	781.00	6,716,600
ダイニック	3,900	806.00	3,143,400
セーレン	25,700	1,587.00	40,785,900
ソトー	4,200	971.00	4,078,200
東海染工	1,500	1,136.00	1,704,000
小松マテーレ	17,100	802.00	13,714,200
ワコールホールディングス	27,000	2,777.00	74,979,000
ホギメディカル	11,800	3,295.00	38,881,000
レナウン	26,600	105.00	2,793,000
クラウドシアホールディングス	2,700	464.00	1,252,800
T S Iホールディングス	34,800	494.00	17,191,200
マツオカコーポレーション	3,000	2,025.00	6,075,000
ワールド	14,700	2,306.00	33,898,200
三陽商会	5,400	1,473.00	7,954,200
ナイガイ	4,000	415.00	1,660,000
オンワードホールディングス	62,300	609.00	37,940,700

ルックホールディングス	3,600	1,005.00	3,618,000	
ゴールドウイン	18,800	7,150.00	134,420,000	
デサント	20,200	1,612.00	32,562,400	
キング	5,000	559.00	2,795,000	
ヤマトインターナショナル	6,500	406.00	2,639,000	
特種東海製紙	6,600	4,005.00	26,433,000	
王子ホールディングス	432,400	567.00	245,170,800	
日本製紙	45,700	1,705.00	77,918,500	
三菱製紙	11,700	438.00	5,124,600	
北越コーポレーション	68,600	492.00	33,751,200	
中越パルプ工業	4,400	1,472.00	6,476,800	
巴川製紙所	3,100	824.00	2,554,400	
大王製紙	45,400	1,438.00	65,285,200	
阿波製紙	2,700	523.00	1,412,100	
レンゴー	97,800	819.00	80,098,200	
トモク	6,300	1,686.00	10,621,800	
ザ・パック	7,800	4,210.00	32,838,000	
クラレ	162,900	1,262.00	205,579,800	
旭化成	685,500	1,018.50	698,181,750	
共和レザー	5,600	772.00	4,323,200	
昭和電工	73,600	2,654.00	195,334,400	
住友化学	759,900	446.00	338,915,400	
住友精化	4,600	3,130.00	14,398,000	
日産化学	57,800	5,010.00	289,578,000	
ラサ工業	3,600	1,431.00	5,151,600	
クレハ	8,900	6,130.00	54,557,000	
多木化学	3,000	4,445.00	13,335,000	
テイカ	7,600	1,659.00	12,608,400	
石原産業	18,500	819.00	15,151,500	
片倉コープアグリ	2,700	1,219.00	3,291,300	
日本曹達	15,300	3,140.00	48,042,000	
東ソー	159,900	1,631.00	260,796,900	
トクヤマ	29,800	2,693.00	80,251,400	
セントラル硝子	21,100	2,292.00	48,361,200	
東亜合成	64,900	1,221.00	79,242,900	
大阪ソーダ	10,500	2,720.00	28,560,000	
関東電化工業	24,500	1,026.00	25,137,000	
デンカ	37,700	2,948.00	111,139,600	
信越化学工業	177,600	13,755.00	2,442,888,000	
日本カーバイド工業	3,500	1,264.00	4,424,000	
堺化学工業	6,700	2,187.00	14,652,900	
第一稀元素化学工業	11,200	855.00	9,576,000	

エア・ウォーター	96,200	1,513.00	145,550,600
大陽日酸	99,400	2,167.00	215,399,800
日本化学工業	3,200	2,672.00	8,550,400
東邦アセチレン	1,600	1,343.00	2,148,800
日本パーカラライジング	52,200	1,105.00	57,681,000
高压ガス工業	16,400	761.00	12,480,400
チタン工業	1,300	2,184.00	2,839,200
四国化成工業	15,900	1,230.00	19,557,000
戸田工業	2,400	2,056.00	4,934,400
ステラ ケミファ	5,600	3,250.00	18,200,000
保土谷化学工業	3,900	4,305.00	16,789,500
日本触媒	16,100	6,030.00	97,083,000
大日精化工業	9,200	2,633.00	24,223,600
カネカ	26,800	3,315.00	88,842,000
三菱瓦斯化学	97,600	1,824.00	178,022,400
三井化学	93,900	2,546.00	239,069,400
J S R	96,400	2,167.00	208,898,800
東京応化工業	17,700	4,480.00	79,296,000
大阪有機化学工業	9,600	1,726.00	16,569,600
三菱ケミカルホールディングス	691,400	789.30	545,722,020
K Hネオケム	18,200	2,465.00	44,863,000
ダイセル	141,500	989.00	139,943,500
住友ベークライト	16,300	3,610.00	58,843,000
積水化学工業	222,400	1,793.00	398,763,200
日本ゼオン	93,300	1,225.00	114,292,500
アイカ工業	31,000	3,465.00	107,415,000
宇部興産	52,200	2,169.00	113,221,800
積水樹脂	18,600	2,359.00	43,877,400
タキロンシーアイ	22,400	635.00	14,224,000
旭有機材	5,800	1,620.00	9,396,000
日立化成	43,700	4,610.00	201,457,000
ニチバン	5,400	1,675.00	9,045,000
リケンテクノス	26,000	469.00	12,194,000
大倉工業	4,900	1,654.00	8,104,600
積水化成成品工業	13,900	685.00	9,521,500
群栄化学工業	2,400	2,449.00	5,877,600
タイガースポリマー	5,400	582.00	3,142,800
ミライアル	3,600	1,180.00	4,248,000
ダイキアクシス	3,700	817.00	3,022,900
ダイキョーニシカワ	21,800	723.00	15,761,400
竹本容器	3,700	856.00	3,167,200
森六ホールディングス	5,600	2,149.00	12,034,400



日本化薬	64,000	1,274.00	81,536,000
カーリットホールディングス	11,000	558.00	6,138,000
日本精化	8,300	1,394.00	11,570,200
扶桑化学工業	10,500	3,360.00	35,280,000
トリケミカル研究所	2,300	9,530.00	21,919,000
A D E K A	47,600	1,557.00	74,113,200
日油	38,900	3,735.00	145,291,500
新日本理化	17,100	197.00	3,368,700
ハリマ化成グループ	8,600	1,053.00	9,055,800
花王	252,900	8,407.00	2,126,130,300
第一工業製薬	3,900	4,240.00	16,536,000
石原ケミカル	2,800	1,821.00	5,098,800
日華化学	3,500	777.00	2,719,500
ニイタカ	1,600	2,670.00	4,272,000
三洋化成工業	6,200	4,835.00	29,977,000
有機合成薬品工業	7,900	415.00	3,278,500
大日本塗料	11,700	1,060.00	12,402,000
日本ペイントホールディングス	85,400	5,070.00	432,978,000
関西ペイント	116,200	2,556.00	297,007,200
神東塗料	8,100	200.00	1,620,000
中国塗料	29,400	945.00	27,783,000
日本特殊塗料	7,700	1,201.00	9,247,700
藤倉化成	13,900	531.00	7,380,900
太陽ホールディングス	7,600	4,710.00	35,796,000
D I C	43,700	2,909.00	127,123,300
サカタインクス	22,600	1,160.00	26,216,000
東洋インキＳＣホールディングス	21,900	2,410.00	52,779,000
T & K T O K A	8,000	930.00	7,440,000
富士フイルムホールディングス	202,500	5,414.00	1,096,335,000
資生堂	209,800	6,938.00	1,455,592,400
ライオン	137,300	1,989.00	273,089,700
高砂香料工業	6,600	2,296.00	15,153,600
マンダム	23,700	2,548.00	60,387,600
ミルボン	14,100	5,770.00	81,357,000
ファンケル	42,700	3,060.00	130,662,000
コーセー	19,900	14,240.00	283,376,000
コタ	5,500	1,486.00	8,173,000
シーボン	1,400	2,438.00	3,413,200
ポーラ・オルビスホールディングス	45,100	2,254.00	101,655,400
ノエビアホールディングス	10,100	5,160.00	52,116,000
アジュバンコスメジャパン	2,400	991.00	2,378,400
エステー	6,800	1,607.00	10,927,600

アグロ カネショウ	3,300	1,384.00	4,567,200
コニシ	17,400	1,536.00	26,726,400
長谷川香料	14,000	2,166.00	30,324,000
星光PMC	6,000	876.00	5,256,000
小林製薬	29,600	8,500.00	251,600,000
荒川化学工業	9,500	1,507.00	14,316,500
メック	7,200	1,522.00	10,958,400
日本高純度化学	2,900	2,675.00	7,757,500
タカラバイオ	27,600	2,278.00	62,872,800
JCU	12,800	2,970.00	38,016,000
新田ゼラチン	6,600	643.00	4,243,800
OATアグリオ	1,800	1,359.00	2,446,200
デクセリアルズ	27,200	910.00	24,752,000
アース製薬	8,000	6,080.00	48,640,000
北興化学工業	10,800	612.00	6,609,600
大成ラミック	3,500	2,866.00	10,031,000
クミアイ化学工業	43,700	834.00	36,445,800
日本農薬	18,800	552.00	10,377,600
アキレス	7,300	1,941.00	14,169,300
有沢製作所	16,700	913.00	15,247,100
日東電工	72,900	5,920.00	431,568,000
レック	11,300	1,189.00	13,435,700
三光合成	12,100	335.00	4,053,500
きもと	18,000	162.00	2,916,000
藤森工業	9,500	3,315.00	31,492,500
前澤化成工業	6,700	1,144.00	7,664,800
未来工業	5,700	2,057.00	11,724,900
ウェーブロックホールディングス	3,600	684.00	2,462,400
JSP	6,200	1,768.00	10,961,600
エフピコ	11,600	6,880.00	79,808,000
天馬	7,000	1,900.00	13,300,000
信越ポリマー	19,000	969.00	18,411,000
東リ	26,300	295.00	7,758,500
ニフコ	38,800	2,894.00	112,287,200
バルカー	8,600	2,295.00	19,737,000
ユニ・チャーム	203,600	3,855.00	784,878,000
ショーエイコーポレーション	1,200	846.00	1,015,200
協和キリン	106,200	2,702.00	286,952,400
武田薬品工業	878,600	4,229.00	3,715,599,400
アステラス製薬	928,900	1,915.50	1,779,307,950
大日本住友製薬	78,300	1,712.00	134,049,600
塩野義製薬	135,000	6,460.00	872,100,000

わかもと製薬	12,600	265.00	3,339,000
あすか製薬	12,000	1,118.00	13,416,000
日本新薬	27,600	9,160.00	252,816,000
ピオフェルミン製薬	1,800	2,383.00	4,289,400
中外製薬	110,100	12,255.00	1,349,275,500
科研製薬	18,100	5,820.00	105,342,000
エーザイ	126,400	8,997.00	1,137,220,800
ロート製薬	54,200	3,340.00	181,028,000
小野薬品工業	242,500	2,566.00	622,255,000
久光製薬	27,900	5,570.00	155,403,000
持田製薬	14,700	4,275.00	62,842,500
参天製薬	196,700	1,963.00	386,122,100
扶桑薬品工業	3,700	2,028.00	7,503,600
日本ケミファ	1,400	2,671.00	3,739,400
ツムラ	32,700	2,806.00	91,756,200
日医工	29,900	1,331.00	39,796,900
キッセイ薬品工業	18,700	2,862.00	53,519,400
生化学工業	20,500	1,235.00	25,317,500
栄研化学	18,600	2,240.00	41,664,000
日水製薬	4,400	1,313.00	5,777,200
鳥居薬品	6,600	3,625.00	23,925,000
JCRファーマ	7,400	11,060.00	81,844,000
東和薬品	13,500	2,408.00	32,508,000
富士製薬工業	7,200	1,235.00	8,892,000
沢井製薬	21,700	7,000.00	151,900,000
ゼリア新薬工業	19,200	1,952.00	37,478,400
第一三共	302,200	7,655.00	2,313,341,000
キョーリン製薬ホールディングス	23,300	2,136.00	49,768,800
大幸薬品	4,300	4,985.00	21,435,500
ダイト	6,200	3,315.00	20,553,000
大塚ホールディングス	201,200	4,492.00	903,790,400
大正製薬ホールディングス	22,300	7,250.00	161,675,000
ペプチドリーム	53,400	5,070.00	270,738,000
日本コークス工業	89,200	75.00	6,690,000
ニチレキ	12,500	1,392.00	17,400,000
ユシロ化学工業	5,900	1,340.00	7,906,000
ビーピー・カストロール	3,800	1,392.00	5,289,600
富士石油	28,200	233.00	6,570,600
MORESCO	3,800	1,340.00	5,092,000
出光興産	118,800	2,922.00	347,133,600
JXTGホールディングス	1,588,700	473.60	752,408,320
コスモエネルギーホールディングス	30,600	2,027.00	62,026,200

横浜ゴム	61,100	2,014.00	123,055,400
TOYO TIRE	60,600	1,642.00	99,505,200
ブリヂストン	324,600	3,954.00	1,283,468,400
住友ゴム工業	94,900	1,258.00	119,384,200
藤倉コンポジット	9,200	461.00	4,241,200
オカモト	6,400	3,630.00	23,232,000
フコク	4,600	670.00	3,082,000
ニッタ	11,900	2,829.00	33,665,100
住友理工	20,500	829.00	16,994,500
三ツ星ベルト	13,900	1,754.00	24,380,600
バンドー化学	18,600	826.00	15,363,600
日東紡績	15,700	5,130.00	80,541,000
A G C	104,400	3,470.00	362,268,000
日本板硝子	50,500	561.00	28,330,500
石塚硝子	1,900	2,597.00	4,934,300
日本山村硝子	4,400	1,163.00	5,117,200
日本電気硝子	42,400	2,043.00	86,623,200
オハラ	4,200	1,264.00	5,308,800
住友大阪セメント	20,000	4,145.00	82,900,000
太平洋セメント	66,700	2,913.00	194,297,100
日本ヒューム	10,600	758.00	8,034,800
日本コンクリート工業	22,800	281.00	6,406,800
三谷セキサン	4,900	3,825.00	18,742,500
アジアパイルホールディングス	15,000	531.00	7,965,000
東海カーボン	110,700	1,016.00	112,471,200
日本カーボン	5,400	4,045.00	21,843,000
東洋炭素	6,200	2,001.00	12,406,200
ノリタケカンパニーリミテド	5,800	4,195.00	24,331,000
T O T O	75,400	4,545.00	342,693,000
日本碍子	128,900	1,896.00	244,394,400
日本特殊陶業	82,200	1,934.00	158,974,800
M A R U W A	4,100	7,710.00	31,611,000
品川リフラクトリーズ	2,800	2,902.00	8,125,600
黒崎播磨	2,100	6,390.00	13,419,000
ヨータイ	8,400	670.00	5,628,000
イソライト工業	5,500	555.00	3,052,500
東京窯業	13,500	313.00	4,225,500
ニッカトー	4,800	659.00	3,163,200
フジミインコーポレーテッド	9,400	3,120.00	29,328,000
クニミネ工業	4,300	1,206.00	5,185,800
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,371.00	2,467,800
ニチアス	28,900	2,570.00	74,273,000

ニチハ	14,700	2,541.00	37,352,700
日本製鉄	467,400	1,349.50	630,756,300
神戸製鋼所	191,200	448.00	85,657,600
中山製鋼所	14,600	455.00	6,643,000
合同製鐵	5,600	2,748.00	15,388,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	282,100	1,106.00	312,002,600
東京製鐵	50,900	787.00	40,058,300
共英製鋼	11,800	1,864.00	21,995,200
大和工業	22,200	2,501.00	55,522,200
東京鐵鋼	4,300	1,385.00	5,955,500
大阪製鐵	5,600	1,615.00	9,044,000
淀川製鋼所	14,100	1,988.00	28,030,800
丸一鋼管	33,900	2,843.00	96,377,700
モリ工業	3,100	2,607.00	8,081,700
大同特殊鋼	17,100	4,250.00	72,675,000
日本高周波鋼業	4,000	401.00	1,604,000
日本冶金工業	8,700	2,004.00	17,434,800
山陽特殊製鋼	7,600	1,426.00	10,837,600
愛知製鋼	5,900	3,400.00	20,060,000
日立金属	112,500	1,700.00	191,250,000
日本金属	2,400	806.00	1,934,400
大平洋金属	7,100	2,300.00	16,330,000
新日本電工	67,500	172.00	11,610,000
栗本鐵工所	5,200	2,099.00	10,914,800
虹技	1,600	1,298.00	2,076,800
三菱製鋼	7,800	982.00	7,659,600
日亜鋼業	15,400	307.00	4,727,800
日本精線	1,700	3,555.00	6,043,500
エンビプロ・ホールディングス	4,000	706.00	2,824,000
シンニッタン	16,300	382.00	6,226,600
新家工業	2,400	1,402.00	3,364,800
大紀アルミニウム工業所	17,300	663.00	11,469,900
日本輕金属ホールディングス	264,700	217.00	57,439,900
三井金属鋁業	28,200	2,990.00	84,318,000
東邦亜鉛	5,400	1,808.00	9,763,200
三菱マテリアル	69,000	2,779.00	191,751,000
住友金属鋁山	133,500	3,050.00	407,175,000
D O W A ホールディングス	26,400	3,925.00	103,620,000
古河機械金属	18,600	1,342.00	24,961,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,900	1,285.00	14,006,500
東邦チタニウム	18,800	853.00	16,036,400
U A C J	15,900	2,107.00	33,501,300

C Kサンエツ	2,200	3,345.00	7,359,000
古河電気工業	32,500	2,552.00	82,940,000
住友電気工業	390,500	1,453.00	567,396,500
フジクラ	126,300	387.00	48,878,100
昭和電線ホールディングス	12,100	1,290.00	15,609,000
東京特殊電線	1,600	2,568.00	4,108,800
タツタ電線	20,900	572.00	11,954,800
カナレ電気	1,800	1,786.00	3,214,800
平河ヒューテック	4,000	1,303.00	5,212,000
リョービ	12,900	1,646.00	21,233,400
アーレスティ	13,900	510.00	7,089,000
アサヒホールディングス	18,300	2,736.00	50,068,800
稲葉製作所	5,900	1,337.00	7,888,300
宮地エンジニアリンググループ	3,200	1,988.00	6,361,600
トーカロ	29,000	1,110.00	32,190,000
アルファC o	3,700	1,179.00	4,362,300
SUMCO	125,000	1,967.00	245,875,000
川田テクノロジーズ	2,100	6,140.00	12,894,000
RS Technologies	2,900	2,815.00	8,163,500
信和	4,500	1,047.00	4,711,500
東洋製罐グループホールディングス	66,500	1,962.00	130,473,000
ホッカンホールディングス	5,700	1,814.00	10,339,800
コロナ	5,800	1,009.00	5,852,200
横河ブリッジホールディングス	19,400	2,175.00	42,195,000
駒井ハルテック	2,000	1,702.00	3,404,000
高田機工	1,000	2,761.00	2,761,000
三和ホールディングス	100,200	1,099.00	110,119,800
文化シャッター	30,800	836.00	25,748,800
三協立山	14,500	1,294.00	18,763,000
アルインコ	7,600	1,075.00	8,170,000
東洋シャッター	2,500	654.00	1,635,000
LIXILグループ	154,100	1,910.00	294,331,000
日本フィルコン	8,000	514.00	4,112,000
ノーリツ	21,700	1,310.00	28,427,000
長府製作所	10,600	2,250.00	23,850,000
リンナイ	20,300	8,190.00	166,257,000
ダイニチ工業	5,600	653.00	3,656,800
日東精工	14,400	538.00	7,747,200
三洋工業	1,400	1,983.00	2,776,200
岡部	21,200	856.00	18,147,200
ジーテクト	13,000	1,467.00	19,071,000
東プレ	19,500	1,599.00	31,180,500

高周波熱錬	20,100	817.00	16,421,700
東京製鋼	7,500	948.00	7,110,000
サンコール	5,900	548.00	3,233,200
モリテック スチール	8,100	336.00	2,721,600
パイオラックス	15,400	1,787.00	27,519,800
エイチワン	10,200	680.00	6,936,000
日本発條	112,000	905.00	101,360,000
中央発條	1,300	2,806.00	3,647,800
アドバネクス	1,500	1,492.00	2,238,000
立川ブラインド工業	4,600	1,234.00	5,676,400
三益半導体工業	9,300	2,226.00	20,701,800
日本ドライケミカル	2,700	1,756.00	4,741,200
日本製鋼所	31,700	1,785.00	56,584,500
三浦工業	45,200	3,765.00	170,178,000
タクマ	35,500	1,249.00	44,339,500
ツガミ	21,700	994.00	21,569,800
オークマ	12,200	4,950.00	60,390,000
東芝機械	11,800	3,200.00	37,760,000
アマダホールディングス	132,900	1,070.00	142,203,000
アイダエンジニアリング	27,400	882.00	24,166,800
滝澤鉄工所	3,300	1,277.00	4,214,100
F U J I	45,000	1,870.00	84,150,000
牧野フライス製作所	12,300	4,040.00	49,692,000
オーエスジー	48,300	1,763.00	85,152,900
ダイジェット工業	1,300	1,343.00	1,745,900
旭ダイヤモンド工業	27,600	574.00	15,842,400
D M G 森精機	66,100	1,519.00	100,405,900
ソディック	24,700	821.00	20,278,700
ディスコ	14,100	24,710.00	348,411,000
日東工器	5,800	2,444.00	14,175,200
日進工具	3,100	2,778.00	8,611,800
パンチ工業	9,700	407.00	3,947,900
富士ダイス	4,800	613.00	2,942,400
豊和工業	5,900	773.00	4,560,700
O K K	4,400	595.00	2,618,000
東洋機械金属	7,700	504.00	3,880,800
津田駒工業	2,100	1,008.00	2,116,800
エンシュウ	2,600	1,103.00	2,867,800
島精機製作所	16,800	1,907.00	32,037,600
オプトラン	11,700	3,315.00	38,785,500
N C ホールディングス	3,400	655.00	2,227,000
イワキポンプ	5,100	1,058.00	5,395,800

フリーー	10,300	1,143.00	11,772,900
ヤマシンフィルタ	22,800	710.00	16,188,000
日阪製作所	13,000	935.00	12,155,000
やまびこ	20,400	997.00	20,338,800
平田機工	5,000	5,750.00	28,750,000
ペガサスミシン製造	10,900	452.00	4,926,800
マルマエ	4,400	887.00	3,902,800
タツモ	5,000	1,374.00	6,870,000
ナブテスコ	61,600	3,225.00	198,660,000
三井海洋開発	11,100	2,009.00	22,299,900
レオン自動機	10,300	1,318.00	13,575,400
S M C	33,100	49,020.00	1,622,562,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9,300	748.00	6,956,400
ホソカワミクロン	3,700	5,370.00	19,869,000
ユニオンツール	3,900	2,985.00	11,641,500
オイレス工業	13,600	1,529.00	20,794,400
日精エー・エス・ビー機械	3,600	4,090.00	14,724,000
サトーホールディングス	14,900	2,738.00	40,796,200
技研製作所	9,200	4,315.00	39,698,000
日本エアーテック	3,500	1,139.00	3,986,500
カワタ	3,200	995.00	3,184,000
日精樹脂工業	8,900	931.00	8,285,900
オカダアイヨン	3,400	1,058.00	3,597,200
ワイエイシイホールディングス	4,500	608.00	2,736,000
小松製作所	478,400	2,283.00	1,092,187,200
住友重機械工業	60,500	2,636.00	159,478,000
日立建機	42,400	2,953.00	125,207,200
日工	14,600	761.00	11,110,600
巴工業	4,600	2,120.00	9,752,000
井関農機	10,600	1,361.00	14,426,600
T O W A	10,800	1,103.00	11,912,400
丸山製作所	2,400	1,632.00	3,916,800
北川鉄工所	4,800	1,980.00	9,504,000
ローツェ	4,700	3,935.00	18,494,500
タカキタ	3,900	531.00	2,070,900
クボタ	560,300	1,592.00	891,997,600
荏原実業	2,700	2,007.00	5,418,900
三菱化工機	3,700	1,902.00	7,037,400
月島機械	19,500	1,357.00	26,461,500
帝国電機製作所	8,800	1,459.00	12,839,200
新東工業	25,200	900.00	22,680,000
澁谷工業	9,300	2,703.00	25,137,900



アイチ コーポレーション	18,400	684.00	12,585,600
小森コーポレーション	26,900	925.00	24,882,500
鶴見製作所	8,300	1,928.00	16,002,400
住友精密工業	1,600	2,984.00	4,774,400
日本ギア工業	3,500	386.00	1,351,000
酒井重工業	2,000	2,563.00	5,126,000
荏原製作所	43,700	2,855.00	124,763,500
石井鐵工所	1,400	2,898.00	4,057,200
西島製作所	10,800	844.00	9,115,200
北越工業	11,000	1,295.00	14,245,000
ダイキン工業	134,600	15,455.00	2,080,243,000
オルガノ	3,800	6,920.00	26,296,000
トーヨーカネツ	4,600	2,449.00	11,265,400
栗田工業	57,200	3,220.00	184,184,000
椿本チエイン	15,100	3,215.00	48,546,500
大同工業	5,200	786.00	4,087,200
木村化工機	8,900	556.00	4,948,400
アネスト岩田	16,600	1,035.00	17,181,000
ダイフク	54,000	7,040.00	380,160,000
サムコ	3,000	1,886.00	5,658,000
加藤製作所	5,800	1,466.00	8,502,800
油研工業	1,800	1,672.00	3,009,600
タダノ	51,100	1,018.00	52,019,800
フジテック	38,500	1,691.00	65,103,500
C K D	29,400	1,931.00	56,771,400
キトー	8,100	1,652.00	13,381,200
平和	29,500	2,267.00	66,876,500
理想科学工業	9,400	1,899.00	17,850,600
S A N K Y O	23,500	3,940.00	92,590,000
日本金銭機械	11,800	771.00	9,097,800
マースグループホールディングス	6,800	2,011.00	13,674,800
フクシマガリレイ	6,500	4,095.00	26,617,500
オーイズミ	4,700	523.00	2,458,100
ダイコク電機	4,900	1,391.00	6,815,900
竹内製作所	17,800	1,904.00	33,891,200
アマノ	27,700	2,890.00	80,053,000
J U K I	14,700	827.00	12,156,900
蛇の目マシン工業	9,900	392.00	3,880,800
マックス	16,200	2,006.00	32,497,200
グローリー	27,200	3,220.00	87,584,000
新晃工業	9,900	1,664.00	16,473,600
大和冷機工業	15,400	1,050.00	16,170,000

セガサミーホールディングス	104,800	1,676.00	175,644,800
日本ピストンリング	3,900	1,487.00	5,799,300
リケン	4,900	3,420.00	16,758,000
T P R	14,300	1,671.00	23,895,300
ツバキ・ナカシマ	21,600	1,197.00	25,855,200
ホシザキ	30,900	10,310.00	318,579,000
大豊工業	8,800	672.00	5,913,600
日本精工	199,000	901.00	179,299,000
N T N	244,800	291.00	71,236,800
ジェイテクト	101,400	1,156.00	117,218,400
不二越	9,800	3,995.00	39,151,000
日本トムソン	31,600	431.00	13,619,600
T H K	61,500	2,755.00	169,432,500
ユーシン精機	8,300	893.00	7,411,900
前澤給装工業	3,900	2,215.00	8,638,500
イーグル工業	13,200	933.00	12,315,600
前澤工業	7,400	383.00	2,834,200
日本ピラー工業	10,800	1,475.00	15,930,000
キッツ	43,000	700.00	30,100,000
マキタ	137,800	4,105.00	565,669,000
日立造船	84,000	424.00	35,616,000
三菱重工業	177,000	3,768.00	666,936,000
I H I	76,100	2,729.00	207,676,900
スター精密	16,400	1,313.00	21,533,200
日清紡ホールディングス	70,500	1,051.00	74,095,500
イビデン	64,900	2,750.00	178,475,000
コニカミノルタ	231,600	645.00	149,382,000
ブラザー工業	129,200	2,134.00	275,712,800
ミネベアミツミ	196,300	2,189.00	429,700,700
日立製作所	507,500	4,178.00	2,120,335,000
三菱電機	1,056,100	1,556.00	1,643,291,600
富士電機	63,700	3,355.00	213,713,500
東洋電機製造	4,200	1,384.00	5,812,800
安川電機	113,700	3,705.00	421,258,500
シンフォニアテクノロジー	13,800	1,187.00	16,380,600
明電舎	19,500	1,960.00	38,220,000
オリジン	2,900	1,476.00	4,280,400
山洋電気	5,200	5,100.00	26,520,000
デンヨー	9,100	2,032.00	18,491,200
東芝テック	13,300	4,140.00	55,062,000
芝浦メカトロニクス	2,000	3,325.00	6,650,000
マブチモーター	29,400	4,120.00	121,128,000

日本電産	127,100	14,070.00	1,788,297,000
トレックス・セミコンダクター	6,500	1,508.00	9,802,000
東光高岳	6,400	1,145.00	7,328,000
ダイヘン	11,600	3,285.00	38,106,000
ヤーマン	16,200	620.00	10,044,000
JVCケンウッド	88,400	256.00	22,630,400
ミマキエンジニアリング	10,700	502.00	5,371,400
第一精工	4,500	2,389.00	10,750,500
日新電機	24,800	1,118.00	27,726,400
大崎電気工業	21,200	610.00	12,932,000
オムロン	94,700	6,660.00	630,702,000
日東工業	15,600	2,135.00	33,306,000
I D E C	15,300	1,846.00	28,243,800
正興電機製作所	3,200	1,311.00	4,195,200
不二電機工業	1,800	1,210.00	2,178,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	35,500	2,118.00	75,189,000
サクサホールディングス	2,500	1,839.00	4,597,500
メルコホールディングス	3,800	2,549.00	9,686,200
テクノメディカ	2,700	2,065.00	5,575,500
日本電気	128,100	4,780.00	612,318,000
富士通	101,800	12,485.00	1,270,973,000
沖電気工業	43,000	1,324.00	56,932,000
岩崎通信機	4,600	822.00	3,781,200
電気興業	5,100	3,300.00	16,830,000
サンケン電気	11,600	3,050.00	35,380,000
ナカヨ	2,100	1,625.00	3,412,500
アイホン	6,000	1,708.00	10,248,000
ルネサスエレクトロニクス	505,100	772.00	389,937,200
セイコーエプソン	131,100	1,696.00	222,345,600
ワコム	72,400	388.00	28,091,200
アルバック	19,400	3,605.00	69,937,000
アクセル	5,100	866.00	4,416,600
E I Z O	8,200	3,810.00	31,242,000
日本信号	27,000	1,340.00	36,180,000
京三製作所	24,900	544.00	13,545,600
能美防災	14,200	2,317.00	32,901,400
ホーチキ	8,000	1,377.00	11,016,000
星和電機	6,300	617.00	3,887,100
エレコム	11,600	3,885.00	45,066,000
パナソニック	1,206,700	1,195.00	1,442,006,500
シャープ	122,300	1,483.00	181,370,900
アンリツ	68,000	2,002.00	136,136,000

富士通ゼネラル	28,700	2,414.00	69,281,800
ソニー	667,600	7,479.00	4,992,980,400
T D K	51,000	11,310.00	576,810,000
帝国通信工業	5,200	1,234.00	6,416,800
タムラ製作所	35,500	567.00	20,128,500
アルプスアルパイン	93,700	1,842.00	172,595,400
池上通信機	3,300	1,029.00	3,395,700
鈴木	6,400	875.00	5,600,000
日本トリム	1,600	3,735.00	5,976,000
ローランド ディー . ジー .	6,100	1,844.00	11,248,400
フォスター電機	11,100	1,602.00	17,782,200
S M K	2,700	2,816.00	7,603,200
ヨコオ	7,000	2,923.00	20,461,000
ホシデン	29,300	1,079.00	31,614,700
ヒロセ電機	16,400	12,840.00	210,576,000
日本航空電子工業	24,300	1,911.00	46,437,300
T O A	11,400	1,017.00	11,593,800
マクセルホールディングス	23,200	1,419.00	32,920,800
古野電気	14,100	1,060.00	14,946,000
ユニデンホールディングス	3,000	2,084.00	6,252,000
スミダコーポレーション	8,600	1,116.00	9,597,600
アイコム	5,900	2,564.00	15,127,600
リオン	4,600	2,747.00	12,636,200
本多通信工業	10,200	516.00	5,263,200
横河電機	96,900	1,951.00	189,051,900
新電元工業	3,800	3,425.00	13,015,000
アズビル	66,700	2,952.00	196,898,400
東亜ディーケーケー	5,800	968.00	5,614,400
日本光電工業	43,800	3,505.00	153,519,000
チノー	3,700	1,235.00	4,569,500
共和電業	11,300	428.00	4,836,400
日本電子材料	4,300	999.00	4,295,700
堀場製作所	20,900	6,660.00	139,194,000
アドバンテスト	78,500	5,560.00	436,460,000
小野測器	5,600	578.00	3,236,800
エスベック	9,600	2,183.00	20,956,800
キーエンス	95,700	38,540.00	3,688,278,000
日置電機	5,700	3,630.00	20,691,000
シスメックス	75,500	7,409.00	559,379,500
日本マイクロニクス	18,900	1,081.00	20,430,900
メガチップス	10,200	1,816.00	18,523,200
O B A R A G R O U P	5,600	3,130.00	17,528,000

澤藤電機	1,600	1,954.00	3,126,400
原田工業	5,600	963.00	5,392,800
コーセル	13,400	1,146.00	15,356,400
イリソ電子工業	9,000	4,065.00	36,585,000
オブテックスグループ	17,700	1,504.00	26,620,800
千代田インテグレ	5,200	2,121.00	11,029,200
アイ・オー・データ機器	4,500	903.00	4,063,500
レーザーテック	46,500	5,520.00	256,680,000
スタンレー電気	74,500	2,901.00	216,124,500
岩崎電気	4,500	1,668.00	7,506,000
ウシオ電機	61,700	1,464.00	90,328,800
岡谷電機産業	9,900	363.00	3,593,700
ハリオス テクノ ホールディング	11,100	392.00	4,351,200
エノモト	3,600	1,224.00	4,406,400
日本セラミック	10,900	2,480.00	27,032,000
遠藤照明	6,200	686.00	4,253,200
古河電池	8,300	704.00	5,843,200
双信電機	6,400	412.00	2,636,800
山一電機	8,000	1,843.00	14,744,000
図研	7,100	2,400.00	17,040,000
日本電子	21,000	3,275.00	68,775,000
カシオ計算機	93,500	2,079.00	194,386,500
ファナック	100,300	20,180.00	2,024,054,000
日本シイエムケイ	25,800	561.00	14,473,800
エンプラス	5,600	3,020.00	16,912,000
大真空	4,200	1,715.00	7,203,000
ローム	47,000	8,300.00	390,100,000
浜松ホトニクス	75,900	4,605.00	349,519,500
三井ハイテック	12,000	1,630.00	19,560,000
新光電気工業	35,900	1,384.00	49,685,600
京セラ	148,700	7,452.00	1,108,112,400
太陽誘電	47,200	3,535.00	166,852,000
村田製作所	310,300	6,256.00	1,941,236,800
双葉電子工業	17,200	1,165.00	20,038,000
北陸電気工業	4,800	1,048.00	5,030,400
ニチコン	36,400	873.00	31,777,200
日本ケミコン	8,000	1,821.00	14,568,000
K O A	16,400	1,197.00	19,630,800
市光工業	16,600	714.00	11,852,400
小糸製作所	63,400	4,640.00	294,176,000
ミツバ	20,300	723.00	14,676,900
S C R E E Nホールディングス	18,300	6,040.00	110,532,000

キヤノン電子	11,400	2,004.00	22,845,600
キヤノン	568,500	2,776.00	1,578,156,000
リコー	268,800	1,114.00	299,443,200
象印マホービン	31,300	1,917.00	60,002,100
MUTOHホールディングス	1,800	1,718.00	3,092,400
東京エレクトロン	70,400	24,845.00	1,749,088,000
トヨタ紡織	30,800	1,628.00	50,142,400
芦森工業	2,200	1,266.00	2,785,200
ユニプレス	20,500	1,292.00	26,486,000
豊田自動織機	85,500	6,370.00	544,635,000
モリタホールディングス	18,500	1,796.00	33,226,000
三櫻工業	13,400	1,045.00	14,003,000
デンソー	232,500	4,452.00	1,035,090,000
東海理化電機製作所	27,800	1,810.00	50,318,000
三井E & Sホールディングス	38,100	865.00	32,956,500
川崎重工業	82,200	2,205.00	181,251,000
名村造船所	34,000	241.00	8,194,000
日本車輛製造	3,800	2,861.00	10,871,800
三菱ロジスネクスト	14,000	1,633.00	22,862,000
近畿車輛	1,600	1,367.00	2,187,200
日産自動車	1,245,500	504.10	627,856,550
いすゞ自動車	306,000	1,139.50	348,687,000
トヨタ自動車	1,178,200	7,837.00	9,233,553,400
日野自動車	131,900	1,008.00	132,955,200
三菱自動車工業	390,900	404.00	157,923,600
エフテック	7,400	750.00	5,550,000
レシップホールディングス	4,100	612.00	2,509,200
GMB	2,000	806.00	1,612,000
ファルテック	1,900	977.00	1,856,300
武蔵精密工業	23,500	1,346.00	31,631,000
日産車体	20,600	1,066.00	21,959,600
新明和工業	28,400	1,291.00	36,664,400
極東開発工業	19,600	1,387.00	27,185,200
日信工業	19,500	2,241.00	43,699,500
トピー工業	8,700	1,725.00	15,007,500
ティラド	3,900	1,757.00	6,852,300
曙ブレーキ工業	58,000	235.00	13,630,000
タチエス	17,400	1,266.00	22,028,400
NOK	56,800	1,570.00	89,176,000
フタバ産業	29,400	625.00	18,375,000
KYB	11,800	2,743.00	32,367,400
大同メタル工業	20,300	670.00	13,601,000

プレス工業	52,500	360.00	18,900,000
ミクニ	13,600	321.00	4,365,600
太平洋工業	22,200	1,303.00	28,926,600
ケーヒン	22,100	2,587.00	57,172,700
河西工業	14,300	741.00	10,596,300
アイシン精機	87,000	3,940.00	342,780,000
マツダ	310,700	897.00	278,697,900
今仙電機製作所	9,900	852.00	8,434,800
本田技研工業	831,500	3,039.00	2,526,928,500
スズキ	209,300	4,835.00	1,011,965,500
S U B A R U	327,800	2,905.50	952,422,900
安永	5,100	1,194.00	6,089,400
ヤマハ発動機	137,700	1,932.00	266,036,400
ショーワ	22,700	2,286.00	51,892,200
T B K	12,700	464.00	5,892,800
エクセディ	14,400	2,223.00	32,011,200
豊田合成	34,100	2,535.00	86,443,500
愛三工業	16,600	696.00	11,553,600
盟和産業	1,700	1,062.00	1,805,400
日本プラスト	8,400	666.00	5,594,400
ヨロズ	9,900	1,450.00	14,355,000
エフ・シー・シー	17,300	2,123.00	36,727,900
シマノ	39,500	15,550.00	614,225,000
テイ・エス テック	24,500	3,105.00	76,072,500
ジャムコ	5,300	1,297.00	6,874,100
テルモ	298,800	3,775.00	1,127,970,000
クリエートメディック	3,500	1,121.00	3,923,500
日機装	31,700	1,093.00	34,648,100
日本エム・ディ・エム	6,100	1,866.00	11,382,600
島津製作所	126,200	2,878.00	363,203,600
J M S	9,000	822.00	7,398,000
長野計器	7,700	954.00	7,345,800
ブイ・テクノロジー	5,000	4,445.00	22,225,000
東京計器	6,800	893.00	6,072,400
愛知時計電機	1,400	4,325.00	6,055,000
インターアクション	5,700	2,722.00	15,515,400
オーバル	9,600	234.00	2,246,400
東京精密	19,100	3,865.00	73,821,500
マニー	42,100	2,548.00	107,270,800
ニコン	170,900	1,186.00	202,687,400
トプコン	53,200	1,217.00	64,744,400
オリンパス	584,300	2,076.00	1,213,006,800

理研計器	9,300	2,235.00	20,785,500
タムロン	8,500	2,698.00	22,933,000
H O Y A	210,900	10,175.00	2,145,907,500
シード	4,500	941.00	4,234,500
ノーリツ鋼機	7,100	1,499.00	10,642,900
エー・アンド・デイ	9,700	983.00	9,535,100
朝日インテック	89,700	2,739.00	245,688,300
シチズン時計	123,700	480.00	59,376,000
リズム時計工業	3,300	882.00	2,910,600
大研医器	7,400	669.00	4,950,600
メニコン	14,500	4,955.00	71,847,500
シンシア	1,200	562.00	674,400
松風	4,800	1,937.00	9,297,600
セイコーホールディングス	14,900	2,260.00	33,674,000
ニプロ	73,100	1,237.00	90,424,700
中本パックス	2,700	1,584.00	4,276,800
スノーピーク	5,000	821.00	4,105,000
パラマウントベッドホールディングス	11,100	4,565.00	50,671,500
トランザクション	6,700	1,055.00	7,068,500
粧美堂	3,100	391.00	1,212,100
ニホンフラッシュ	4,900	2,529.00	12,392,100
前田工織	11,600	2,222.00	25,775,200
永大産業	13,800	326.00	4,498,800
アートネイチャー	11,300	738.00	8,339,400
バンダイナムコホールディングス	109,200	5,920.00	646,464,000
アイフィスジャパン	2,700	717.00	1,935,900
共立印刷	17,600	169.00	2,974,400
S H O E I	5,100	5,540.00	28,254,000
フランスベッドホールディングス	14,900	921.00	13,722,900
パイロットコーポレーション	17,200	4,140.00	71,208,000
萩原工業	5,900	1,644.00	9,699,600
トッパン・フォームズ	22,600	1,153.00	26,057,800
フジシールインターナショナル	23,700	2,127.00	50,409,900
タカラトミー	47,400	1,043.00	49,438,200
廣濟堂	7,400	939.00	6,948,600
エステールホールディングス	2,800	692.00	1,937,600
アーケ	40,300	89.00	3,586,700
タカノ	4,100	734.00	3,009,400
プロネクサス	9,100	1,129.00	10,273,900
ホクシン	6,500	144.00	936,000
ウッドワン	3,500	1,072.00	3,752,000
大建工業	7,100	1,857.00	13,184,700



凸版印刷	149,100	2,029.00	302,523,900
大日本印刷	138,200	2,914.00	402,714,800
共同印刷	3,300	2,890.00	9,537,000
N I S S H A	21,700	960.00	20,832,000
光村印刷	900	1,627.00	1,464,300
T A K A R A & C O M P A N Y	5,100	1,664.00	8,486,400
アシックス	87,200	1,325.00	115,540,000
ツツミ	3,300	1,927.00	6,359,100
小松ウオール工業	3,200	2,065.00	6,608,000
ヤマハ	62,800	5,740.00	360,472,000
河合楽器製作所	3,300	2,957.00	9,758,100
クリナップ	9,800	594.00	5,821,200
ピジョン	63,800	3,910.00	249,458,000
オリバー	2,200	3,645.00	8,019,000
兼松サステック	700	1,811.00	1,267,700
キングジム	8,800	825.00	7,260,000
リンテック	25,100	2,531.00	63,528,100
イトーキ	22,500	423.00	9,517,500
任天堂	64,800	39,950.00	2,588,760,000
三菱鉛筆	17,400	1,588.00	27,631,200
タカラスタANDARD	21,800	1,700.00	37,060,000
コクヨ	50,700	1,594.00	80,815,800
ナカバヤシ	10,400	606.00	6,302,400
グローブライド	4,700	2,173.00	10,213,100
オカムラ	36,800	995.00	36,616,000
美津濃	9,600	2,541.00	24,393,600
東京電力ホールディングス	843,000	435.00	366,705,000
中部電力	323,100	1,520.50	491,273,550
関西電力	400,100	1,276.00	510,527,600
中国電力	146,000	1,478.00	215,788,000
北陸電力	96,500	829.00	79,998,500
東北電力	263,800	1,022.00	269,603,600
四国電力	95,100	881.00	83,783,100
九州電力	217,700	854.00	185,915,800
北海道電力	98,800	517.00	51,079,600
沖縄電力	19,600	2,001.00	39,219,600
電源開発	84,000	2,533.00	212,772,000
エフオン	5,000	653.00	3,265,000
イーレックス	15,000	1,433.00	21,495,000
レノバ	17,400	1,113.00	19,366,200
東京瓦斯	203,100	2,388.50	485,104,350
大阪瓦斯	204,900	1,893.00	387,875,700

東邦瓦斯	51,900	4,075.00	211,492,500
北海道瓦斯	5,700	1,604.00	9,142,800
広島ガス	21,700	344.00	7,464,800
西部瓦斯	11,900	2,366.00	28,155,400
静岡ガス	30,000	954.00	28,620,000
メタウォーター	5,100	4,125.00	21,037,500
SBSホールディングス	9,100	1,826.00	16,616,600
東武鉄道	111,400	3,575.00	398,255,000
相鉄ホールディングス	33,800	2,712.00	91,665,600
東急	266,300	1,842.00	490,524,600
京浜急行電鉄	135,600	1,812.00	245,707,200
小田急電鉄	157,100	2,282.00	358,502,200
京王電鉄	54,800	5,770.00	316,196,000
京成電鉄	73,500	3,845.00	282,607,500
富士急行	14,400	3,315.00	47,736,000
新京成電鉄	2,700	2,432.00	6,566,400
東日本旅客鉄道	185,900	9,089.00	1,689,645,100
西日本旅客鉄道	94,100	8,657.00	814,623,700
東海旅客鉄道	87,800	20,690.00	1,816,582,000
西武ホールディングス	141,700	1,682.00	238,339,400
鴻池運輸	16,800	1,464.00	24,595,200
西日本鉄道	29,300	2,586.00	75,769,800
ハマキョウレックス	8,100	3,170.00	25,677,000
サカイ引越センター	5,600	6,140.00	34,384,000
近鉄グループホールディングス	100,000	5,200.00	520,000,000
阪急阪神ホールディングス	133,400	4,020.00	536,268,000
南海電気鉄道	47,400	2,660.00	126,084,000
京阪ホールディングス	44,500	4,750.00	211,375,000
神戸電鉄	2,400	3,965.00	9,516,000
名古屋鉄道	82,200	3,080.00	253,176,000
山陽電気鉄道	7,100	2,106.00	14,952,600
日本通運	35,300	5,800.00	204,740,000
ヤマトホールディングス	175,300	1,931.00	338,504,300
山九	27,800	5,040.00	140,112,000
丸運	5,700	296.00	1,687,200
丸全昭和運輸	8,100	2,751.00	22,283,100
センコーグループホールディングス	55,100	867.00	47,771,700
トナミホールディングス	2,400	4,945.00	11,868,000
ニッコンホールディングス	35,800	2,397.00	85,812,600
日本石油輸送	1,100	3,120.00	3,432,000
福山通運	12,800	3,620.00	46,336,000
セイノーホールディングス	74,900	1,330.00	99,617,000

エスライン	3,000	984.00	2,952,000
神奈川中央交通	2,500	3,935.00	9,837,500
日立物流	18,300	3,125.00	57,187,500
丸和運輸機関	10,500	1,960.00	20,580,000
C & F ロジホールディングス	10,100	1,284.00	12,968,400
九州旅客鉄道	89,200	3,645.00	325,134,000
S Gホールディングス	105,000	2,224.00	233,520,000
日本郵船	84,000	1,732.00	145,488,000
商船三井	63,500	2,555.00	162,242,500
川崎汽船	30,800	1,464.00	45,091,200
N S ユナイテッド海運	5,800	1,847.00	10,712,600
飯野海運	49,400	358.00	17,685,200
共栄タンカー	2,600	918.00	2,386,800
乾汽船	5,800	1,152.00	6,681,600
日本航空	180,000	3,000.00	540,000,000
A N Aホールディングス	182,800	3,246.00	593,368,800
パスコ	1,900	1,898.00	3,606,200
ランコム	2,800	7,940.00	22,232,000
日新	8,600	1,699.00	14,611,400
三菱倉庫	31,700	2,870.00	90,979,000
三井倉庫ホールディングス	11,400	1,737.00	19,801,800
住友倉庫	36,800	1,433.00	52,734,400
澁澤倉庫	5,500	2,065.00	11,357,500
東陽倉庫	18,100	315.00	5,701,500
日本トランスシティ	22,000	479.00	10,538,000
ケイヒン	1,900	1,332.00	2,530,800
中央倉庫	6,100	1,148.00	7,002,800
川西倉庫	1,800	1,034.00	1,861,200
安田倉庫	8,200	1,009.00	8,273,800
ファイズホールディングス	2,100	781.00	1,640,100
東洋埠頭	3,000	1,357.00	4,071,000
宇徳	8,500	517.00	4,394,500
上組	57,300	2,276.00	130,414,800
サンリツ	2,400	666.00	1,598,400
キムラユニティー	2,700	1,098.00	2,964,600
キューソー流通システム	2,500	1,899.00	4,747,500
近鉄エクスプレス	21,200	1,894.00	40,152,800
東海運	5,700	280.00	1,596,000
エーアイティー	7,100	947.00	6,723,700
内外トランスライン	3,500	1,201.00	4,203,500
日本コンセプト	3,200	1,407.00	4,502,400
N E C ネットズエスアイ	9,900	4,210.00	41,679,000

クロスキャット	2,900	1,195.00	3,465,500
システナ	37,100	1,663.00	61,697,300
デジタルアーツ	5,100	5,580.00	28,458,000
日鉄ソリューションズ	15,600	3,360.00	52,416,000
キューブシステム	5,800	707.00	4,100,600
エイジア	2,100	1,570.00	3,297,000
コア	4,600	1,328.00	6,108,800
ソリトンシステムズ	4,700	1,131.00	5,315,700
ソフトクリエイティブホールディングス	4,700	1,765.00	8,295,500
T I S	34,600	7,130.00	246,698,000
ネオス	4,100	672.00	2,755,200
電算システム	4,000	2,576.00	10,304,000
グリー	72,000	463.00	33,336,000
コーエーテクモホールディングス	21,300	3,000.00	63,900,000
三菱総合研究所	4,500	4,255.00	19,147,500
電算	1,300	2,242.00	2,914,600
A G S	6,200	790.00	4,898,000
ファインデックス	8,900	879.00	7,823,100
ブレインパッド	2,200	5,060.00	11,132,000
K L a b	20,000	762.00	15,240,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	12,800	977.00	12,505,600
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	1,659.00	2,654,400
ネクソン	295,200	1,840.00	543,168,000
アイスタイル	27,200	341.00	9,275,200
エムアップ	3,100	2,700.00	8,370,000
エイチーム	7,400	897.00	6,637,800
エニグモ	7,600	829.00	6,300,400
テクノスジャパン	8,500	496.00	4,216,000
コロプラ	34,100	928.00	31,644,800
ブロードリーフ	51,800	515.00	26,677,000
クロス・マーケティンググループ	5,300	436.00	2,310,800
デジタルハーツホールディングス	5,700	963.00	5,489,100
システム情報	5,500	840.00	4,620,000
メディアドゥホールディングス	3,300	3,095.00	10,213,500
じげん	26,100	441.00	11,510,100
エンカレッジ・テクノロジー	2,000	904.00	1,808,000
サイバーリンクス	1,800	1,017.00	1,830,600
フィックスターズ	11,200	1,346.00	15,075,200
C A R T A H O L D I N G S	5,200	1,087.00	5,652,400
オブティム	2,800	4,440.00	12,432,000
セレス	3,600	1,281.00	4,611,600
S H I F T	2,700	7,390.00	19,953,000

ティーガイア	9,300	2,293.00	21,324,900
セック	1,600	3,625.00	5,800,000
日本アジアグループ	10,900	359.00	3,913,100
豆蔵ホールディングス	7,200	1,881.00	13,543,200
テクマトリックス	7,400	2,850.00	21,090,000
プロシップ	3,200	1,382.00	4,422,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,100	1,889.00	47,413,900
GMOペイメントゲートウェイ	17,100	7,570.00	129,447,000
ザッパラス	6,000	365.00	2,190,000
システムリサーチ	2,900	2,044.00	5,927,600
インターネットイニシアティブ	15,400	3,370.00	51,898,000
さくらインターネット	11,500	617.00	7,095,500
ヴィンクス	3,100	967.00	2,997,700
GMOクラウド	2,000	2,495.00	4,990,000
SRAホールディングス	5,600	2,567.00	14,375,200
システムインテグレータ	3,600	908.00	3,268,800
朝日ネット	7,800	721.00	5,623,800
eBASE	6,400	1,700.00	10,880,000
アバント	7,600	981.00	7,455,600
アドソル日進	3,800	2,539.00	9,648,200
フリービット	6,400	813.00	5,203,200
コムチュア	11,700	2,236.00	26,161,200
サイバーコム	2,000	1,892.00	3,784,000
アステリア	6,700	532.00	3,564,400
アイル	3,800	1,803.00	6,851,400
マークライنز	5,300	2,002.00	10,610,600
メディカル・データ・ビジョン	8,200	896.00	7,347,200
ショーケース	2,800	686.00	1,920,800
モバイルファクトリー	2,500	1,828.00	4,570,000
テラスカイ	3,800	3,440.00	13,072,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,640.00	7,708,000
PCIホールディングス	2,200	2,254.00	4,958,800
パイプドHD	1,500	1,674.00	2,511,000
アイビーシー	2,100	1,095.00	2,299,500
ネオジャパン	2,200	1,362.00	2,996,400
PR TIMES	1,000	2,542.00	2,542,000
ランドコンピュータ	1,800	1,211.00	2,179,800
ダブルスタンダード	1,400	4,085.00	5,719,000
オープンドア	5,300	1,190.00	6,307,000
マイネット	3,300	555.00	1,831,500
アカツキ	3,700	4,760.00	17,612,000
ベネフィットジャパン	900	1,597.00	1,437,300

U b i c o mホールディングス	2,500	1,315.00	3,287,500	
L I N E	21,600	5,370.00	115,992,000	
カナミックネットワーク	6,600	681.00	4,494,600	
ノムラシステムコーポレーション	2,700	471.00	1,271,700	
チェンジ	2,200	4,105.00	9,031,000	
シンクロ・フード	4,900	410.00	2,009,000	
オークネット	6,600	1,198.00	7,906,800	
セグエグループ	2,000	969.00	1,938,000	
エイトレッド	1,400	1,392.00	1,948,800	
A O I T Y O H o l d i n g s	10,800	740.00	7,992,000	
マクロミル	18,700	1,025.00	19,167,500	
ビーグリー	2,200	1,480.00	3,256,000	
オロ	2,800	3,195.00	8,946,000	
ユーザーローカル	600	3,460.00	2,076,000	
テモナ	1,900	799.00	1,518,100	
ニーズウェル	1,600	714.00	1,142,400	
サインポスト	1,700	2,045.00	3,476,500	
ソルクシーズ	4,700	852.00	4,004,400	
フェイス	4,000	787.00	3,148,000	
プロトコーポレーション	9,500	1,359.00	12,910,500	
ハイマックス	1,300	1,957.00	2,544,100	
野村総合研究所	147,000	2,696.00	396,312,000	
サイバネットシステム	7,700	771.00	5,936,700	
C Eホールディングス	6,500	469.00	3,048,500	
日本システム技術	1,800	1,233.00	2,219,400	
インテージホールディングス	13,200	841.00	11,101,200	
東邦システムサイエンス	3,000	907.00	2,721,000	
ソースネクスト	49,700	401.00	19,929,700	
インフォコム	11,400	2,807.00	31,999,800	
H E R O Z	1,200	4,960.00	5,952,000	
ラクスル	5,500	3,435.00	18,892,500	
F I G	12,100	288.00	3,484,800	
システムサポート	1,000	3,365.00	3,365,000	
イーソル	3,800	1,871.00	7,109,800	
アルテリア・ネットワークス	11,600	1,890.00	21,924,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	1,514.00	3,785,000	
フォーカスシステムズ	6,700	899.00	6,023,300	
クレスコ	6,400	1,894.00	12,121,600	
フジ・メディア・ホールディングス	100,000	1,411.00	141,100,000	
オービック	35,900	14,780.00	530,602,000	
ジャストシステム	16,900	5,100.00	86,190,000	
T D C ソフト	9,300	920.00	8,556,000	

Zホールディングス	1,423,600	442.00	629,231,200
トレンドマイクロ	46,100	5,890.00	271,529,000
IDホールディングス	4,100	1,630.00	6,683,000
日本オラクル	21,000	9,680.00	203,280,000
アルファシステムズ	3,300	2,829.00	9,335,700
フューチャー	12,600	1,778.00	22,402,800
CAC Holdings	6,900	1,301.00	8,976,900
SBテクノロジー	3,800	2,379.00	9,040,200
トーセ	3,100	889.00	2,755,900
オービックビジネスコンサルタント	10,600	4,220.00	44,732,000
伊藤忠テクノソリューションズ	47,300	3,365.00	159,164,500
アイティフォー	12,800	749.00	9,587,200
東計電算	1,600	4,485.00	7,176,000
エクスネット	1,900	976.00	1,854,400
大塚商会	56,100	4,920.00	276,012,000
サイボウズ	12,300	2,106.00	25,903,800
ソフトブレーン	6,500	504.00	3,276,000
電通国際情報サービス	6,500	5,050.00	32,825,000
デジタルガレージ	18,700	4,000.00	74,800,000
EMシステムズ	14,800	903.00	13,364,400
ウェザーニューズ	3,600	3,885.00	13,986,000
CIJ	8,000	816.00	6,528,000
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,200.00	4,160,000
日本エンタープライズ	11,600	258.00	2,992,800
WOWOW	5,100	2,660.00	13,566,000
スカラ	7,700	707.00	5,443,900
インテリジェント ウェイブ	4,200	747.00	3,137,400
IMAGICA GROUP	9,200	457.00	4,204,400
ネットワンシステムズ	39,600	2,440.00	96,624,000
システムソフト	27,000	94.00	2,538,000
アルゴグラフィックス	8,900	3,720.00	33,108,000
マーベラス	16,200	675.00	10,935,000
エイベックス	18,000	1,228.00	22,104,000
日本ユニシス	32,400	3,750.00	121,500,000
兼松エレクトロニクス	5,700	3,370.00	19,209,000
東京放送ホールディングス	63,100	1,904.00	120,142,400
日本テレビホールディングス	86,700	1,468.00	127,275,600
朝日放送グループホールディングス	10,600	728.00	7,716,800
テレビ朝日ホールディングス	28,600	2,013.00	57,571,800
スカパーJ SATホールディングス	68,700	484.00	33,250,800
テレビ東京ホールディングス	8,600	2,386.00	20,519,600
日本BS放送	3,700	1,241.00	4,591,700

ビジョン	9,800	1,140.00	11,172,000
スマートバリュー	3,400	883.00	3,002,200
ワイヤレスゲート	5,200	573.00	2,979,600
コネクシオ	6,000	1,552.00	9,312,000
ク Robbins	2,200	692.00	1,522,400
日本電信電話	1,385,300	2,811.50	3,894,770,950
K D D I	772,300	3,425.00	2,645,127,500
ソフトバンク	941,900	1,502.50	1,415,204,750
光通信	10,700	23,680.00	253,376,000
N T T ドコモ	765,500	3,145.00	2,407,497,500
エムティーアイ	10,400	648.00	6,739,200
G M O インターネット	41,000	2,069.00	84,829,000
ファイバーゲート	2,100	1,293.00	2,715,300
アйдママーケティングコミュニケーション	3,500	562.00	1,967,000
K A D O K A W A	28,000	1,629.00	45,612,000
学研ホールディングス	3,500	7,230.00	25,305,000
ゼンリン	20,800	1,474.00	30,659,200
昭文社	5,400	362.00	1,954,800
インプレスホールディングス	8,600	166.00	1,427,600
アイネット	5,500	1,446.00	7,953,000
松竹	6,900	13,840.00	95,496,000
東宝	62,000	3,830.00	237,460,000
東映	3,900	13,730.00	53,547,000
エヌ・ティ・ティ・データ	276,100	1,443.00	398,412,300
ピー・シー・エー	1,400	3,990.00	5,586,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,868.00	5,449,200
D T S	23,300	2,178.00	50,747,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,200	4,945.00	218,569,000
シーイーシー	11,200	1,974.00	22,108,800
カブコン	48,900	3,390.00	165,771,000
アイ・エス・ビー	2,100	2,315.00	4,861,500
ジャステック	6,800	1,036.00	7,044,800
S C S K	24,000	6,240.00	149,760,000
日本システムウエア	3,500	2,264.00	7,924,000
アイネス	10,400	1,691.00	17,586,400
T K C	8,800	5,300.00	46,640,000
富士ソフト	13,300	4,120.00	54,796,000
N S D	34,200	1,893.00	64,740,600
コナミホールディングス	37,700	4,335.00	163,429,500
福井コンピュータホールディングス	4,100	3,090.00	12,669,000
J B C C ホールディングス	7,100	1,937.00	13,752,700
ミロク情報サービス	9,200	2,655.00	24,426,000



ソフトバンクグループ	822,300	5,664.00	4,657,507,200
ハウスイ	900	844.00	759,600
高千穂交易	4,000	1,129.00	4,516,000
伊藤忠食品	2,600	4,940.00	12,844,000
エレマテック	9,700	1,025.00	9,942,500
JALUX	2,900	2,233.00	6,475,700
あらた	8,300	4,510.00	37,433,000
トーメンデバイス	1,600	3,930.00	6,288,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,838.00	10,784,400
フィールズ	8,000	474.00	3,792,000
双日	574,500	342.00	196,479,000
アルフレッサ ホールディングス	115,600	2,173.00	251,198,800
横浜冷凍	29,200	932.00	27,214,400
ラサ商事	5,500	920.00	5,060,000
ラクーンホールディングス	5,000	856.00	4,280,000
アルコニックス	11,100	1,247.00	13,841,700
神戸物産	35,900	4,455.00	159,934,500
あい ホールディングス	14,900	1,717.00	25,583,300
ディーブイエックス	3,700	925.00	3,422,500
ダイワボウホールディングス	8,800	6,260.00	55,088,000
マクニカ・富士エレホールディングス	24,800	1,710.00	42,408,000
ラクト・ジャパン	3,900	3,890.00	15,171,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,600	1,050.00	20,580,000
八洲電機	8,100	886.00	7,176,600
メディアスホールディングス	5,900	795.00	4,690,500
レスターホールディングス	10,800	1,829.00	19,753,200
ジュテックホールディングス	2,400	1,163.00	2,791,200
大光	4,500	657.00	2,956,500
OCHIホールディングス	3,000	1,475.00	4,425,000
TOKAIホールディングス	55,000	994.00	54,670,000
黒谷	2,400	485.00	1,164,000
Cominix	1,800	813.00	1,463,400
三洋貿易	10,400	1,189.00	12,365,600
ビューティガレージ	1,700	2,004.00	3,406,800
ウイン・パートナーズ	7,500	1,061.00	7,957,500
ミタチ産業	3,100	690.00	2,139,000
シップヘルスケアホールディングス	16,700	4,620.00	77,154,000
明治電機工業	3,300	1,452.00	4,791,600
デリカフーズホールディングス	3,700	693.00	2,564,100
スターティアホールディングス	2,400	699.00	1,677,600
コメダホールディングス	22,700	2,131.00	48,373,700
ピーバンドットコム	800	1,184.00	947,200

アセンテック	800	3,000.00	2,400,000
富士興産	3,200	667.00	2,134,400
協栄産業	1,200	1,370.00	1,644,000
小野建	9,300	1,280.00	11,904,000
南陽	2,300	1,804.00	4,149,200
佐島電機	7,700	853.00	6,568,100
エコートレーディング	2,400	570.00	1,368,000
伯東	6,400	1,195.00	7,648,000
コンドーテック	8,100	1,173.00	9,501,300
中山福	6,000	510.00	3,060,000
ナガイレーベン	15,100	2,341.00	35,349,100
三菱食品	11,400	2,894.00	32,991,600
松田産業	7,600	1,535.00	11,666,000
第一興商	15,500	4,750.00	73,625,000
メディパルホールディングス	112,300	2,186.00	245,487,800
S P K	2,200	2,638.00	5,803,600
萩原電気ホールディングス	3,900	2,550.00	9,945,000
アズワン	6,800	8,890.00	60,452,000
スズデン	3,600	1,423.00	5,122,800
尾家産業	3,100	1,452.00	4,501,200
シモジマ	6,400	1,128.00	7,219,200
ドウシシャ	9,800	1,555.00	15,239,000
小津産業	2,300	1,685.00	3,875,500
高速	6,200	1,218.00	7,551,600
たけびし	3,700	1,442.00	5,335,400
リックス	2,400	1,707.00	4,096,800
丸文	9,200	605.00	5,566,000
ハピネット	8,700	1,282.00	11,153,400
橋本総業ホールディングス	2,100	1,712.00	3,595,200
日本ライフライン	30,800	1,414.00	43,551,200
タカショー	5,100	457.00	2,330,700
マルカ	3,700	2,083.00	7,707,100
I D O M	28,100	617.00	17,337,700
進和	6,200	2,169.00	13,447,800
エスケイジャパン	2,300	420.00	966,000
ダイトロン	4,400	1,943.00	8,549,200
シークス	13,200	1,363.00	17,991,600
田中商事	3,200	709.00	2,268,800
オーハシテクニカ	5,900	1,476.00	8,708,400
白銅	3,700	1,423.00	5,265,100
伊藤忠商事	727,500	2,651.50	1,928,966,250
丸紅	1,082,600	788.80	853,954,880

高島	1,700	1,897.00	3,224,900
長瀬産業	58,500	1,440.00	84,240,000
蝶理	6,600	2,092.00	13,807,200
豊田通商	116,100	3,640.00	422,604,000
三共生興	15,800	556.00	8,784,800
兼松	38,800	1,311.00	50,866,800
ツカモトコーポレーション	1,900	1,172.00	2,226,800
三井物産	914,200	1,942.00	1,775,376,400
日本紙パルプ商事	5,900	3,935.00	23,216,500
日立ハイテク	36,100	8,010.00	289,161,000
カメイ	13,600	1,105.00	15,028,000
東都水産	1,300	2,880.00	3,744,000
OUGホールディングス	1,700	2,612.00	4,440,400
スターゼン	3,800	4,425.00	16,815,000
山善	40,600	998.00	40,518,800
椿本興業	1,900	3,920.00	7,448,000
住友商事	656,300	1,648.00	1,081,582,400
内田洋行	4,400	5,860.00	25,784,000
三菱商事	729,900	2,865.00	2,091,163,500
第一実業	5,100	3,560.00	18,156,000
キャノンマーケティングジャパン	29,700	2,710.00	80,487,000
西華産業	5,900	1,297.00	7,652,300
佐藤商事	8,600	931.00	8,006,600
菱洋エレクトロ	10,600	1,925.00	20,405,000
東京産業	9,400	581.00	5,461,400
ユアサ商事	9,900	3,330.00	32,967,000
神鋼商事	2,600	2,401.00	6,242,600
小林産業	6,300	287.00	1,808,100
阪和興業	19,400	2,519.00	48,868,600
正栄食品工業	6,700	3,665.00	24,555,500
カナデン	8,500	1,300.00	11,050,000
菱電商事	7,500	1,656.00	12,420,000
フルサト工業	5,700	1,618.00	9,222,600
岩谷産業	23,100	3,655.00	84,430,500
すてきナイスグループ	4,000	1,104.00	4,416,000
昭光通商	3,300	682.00	2,250,600
ニチモウ	1,600	1,972.00	3,155,200
極東貿易	3,000	1,900.00	5,700,000
イワキ	13,700	505.00	6,918,500
三愛石油	25,600	1,079.00	27,622,400
稲畑産業	22,900	1,449.00	33,182,100
G S Iクレオス	2,600	1,227.00	3,190,200

明和産業	9,600	564.00	5,414,400
クワザワ	3,700	621.00	2,297,700
ワキタ	22,200	1,012.00	22,466,400
東邦ホールディングス	33,400	2,250.00	75,150,000
サンゲツ	28,600	1,790.00	51,194,000
ミツウロコグループホールディングス	15,300	1,128.00	17,258,400
シナネンホールディングス	4,300	2,155.00	9,266,500
伊藤忠エネクス	23,000	918.00	21,114,000
サンリオ	29,200	1,902.00	55,538,400
サンワテクノス	7,400	929.00	6,874,600
リョーサン	11,500	2,411.00	27,726,500
新光商事	16,300	794.00	12,942,200
トーホー	4,700	1,737.00	8,163,900
三信電気	5,600	1,619.00	9,066,400
東陽テクニカ	12,000	1,042.00	12,504,000
モスフードサービス	13,700	2,992.00	40,990,400
加賀電子	10,400	2,257.00	23,472,800
ソーダニッカ	10,800	597.00	6,447,600
立花エレテック	7,700	1,724.00	13,274,800
フォーバル	4,600	1,180.00	5,428,000
PALTA C	16,700	5,000.00	83,500,000
三谷産業	13,800	354.00	4,885,200
西本Wismettacホールディングス	1,900	3,145.00	5,975,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	2,195.00	1,975,500
国際紙パルプ商事	24,700	290.00	7,163,000
ヤマタネ	5,200	1,466.00	7,623,200
丸紅建材リース	1,000	1,823.00	1,823,000
日鉄物産	7,400	4,615.00	34,151,000
泉州電業	3,200	3,015.00	9,648,000
トラスコ中山	21,700	2,371.00	51,450,700
オートバックスセブン	38,600	1,525.00	58,865,000
モリト	7,600	789.00	5,996,400
加藤産業	16,300	3,440.00	56,072,000
北恵	2,000	920.00	1,840,000
イノテック	6,200	1,146.00	7,105,200
イエローハット	19,700	1,649.00	32,485,300
J Kホールディングス	9,400	735.00	6,909,000
日伝	9,400	1,926.00	18,104,400
北沢産業	7,900	251.00	1,982,900
杉本商事	5,600	1,903.00	10,656,800
因幡電機産業	29,600	2,621.00	77,581,600
東テク	3,500	2,456.00	8,596,000

ミスミグループ本社	130,300	2,626.00	342,167,800
アルテック	8,400	248.00	2,083,200
タキヒヨー	3,200	1,784.00	5,708,800
蔵王産業	2,000	1,458.00	2,916,000
スズケン	44,100	3,945.00	173,974,500
ジェコス	7,200	1,041.00	7,495,200
グローセル	10,500	443.00	4,651,500
ローソン	26,300	6,210.00	163,323,000
サンエー	8,700	4,590.00	39,933,000
カワチ薬品	8,200	2,097.00	17,195,400
エービーシー・マート	16,300	6,800.00	110,840,000
ハードオフコーポレーション	4,400	801.00	3,524,400
アスクル	10,900	3,320.00	36,188,000
ゲオホールディングス	18,900	1,221.00	23,076,900
アダストリア	14,500	2,109.00	30,580,500
ジーフット	6,600	613.00	4,045,800
くら寿司	5,500	5,330.00	29,315,000
キャンドウ	5,100	1,634.00	8,333,400
パルグループホールディングス	5,400	3,500.00	18,900,000
エディオン	47,900	1,001.00	47,947,900
サーラコーポレーション	21,400	593.00	12,690,200
ワッツ	4,900	608.00	2,979,200
ハローズ	4,000	2,764.00	11,056,000
フジオフードシステム	8,900	1,654.00	14,720,600
あみやき亭	2,300	3,420.00	7,866,000
ひらまつ	19,900	247.00	4,915,300
大黒天物産	2,600	3,395.00	8,827,000
ハニーズホールディングス	9,300	1,336.00	12,424,800
ファーマライズホールディングス	2,800	647.00	1,811,600
アルペン	8,100	1,892.00	15,325,200
ハブ	3,200	1,010.00	3,232,000
クオールホールディングス	15,400	1,380.00	21,252,000
ジinzホールディングス	5,500	7,300.00	40,150,000
ビックカメラ	61,900	1,072.00	66,356,800
D C Mホールディングス	56,300	1,041.00	58,608,300
Monotaro	74,000	2,638.00	195,212,000
東京一番フーズ	3,000	601.00	1,803,000
D Dホールディングス	4,100	1,645.00	6,744,500
きちりホールディングス	3,000	713.00	2,139,000
アーランドサービスホールディングス	7,700	1,983.00	15,269,100
J . フロント リテイリング	124,300	1,287.00	159,974,100
ドトール・日レスホールディングス	16,700	2,077.00	34,685,900

マツモトキヨシホールディングス	43,000	3,810.00	163,830,000
ブロンコピリー	5,500	2,500.00	13,750,000
Z O Z O	71,600	1,687.00	120,789,200
トレジャー・ファクトリー	3,200	844.00	2,700,800
物語コーポレーション	2,600	8,430.00	21,918,000
ココカラファイン	10,900	5,140.00	56,026,000
三越伊勢丹ホールディングス	182,000	797.00	145,054,000
H a m e e	3,300	1,628.00	5,372,400
ウエルシアホールディングス	31,000	6,430.00	199,330,000
クリエイトSDホールディングス	17,600	2,684.00	47,238,400
丸善CHIホールディングス	12,100	366.00	4,428,600
ティーライフ	1,600	843.00	1,348,800
エー・ピーカンパニー	2,300	591.00	1,359,300
チムニー	3,300	2,206.00	7,279,800
シュッピン	7,200	970.00	6,984,000
ネクステージ	15,000	1,003.00	15,045,000
ジョイフル本田	30,600	1,242.00	38,005,200
鳥貴族	3,500	2,643.00	9,250,500
麒麟堂ホールディングス	4,200	1,696.00	7,123,200
ホットランド	7,100	1,258.00	8,931,800
すかいらーくホールディングス	116,700	1,836.00	214,261,200
S F Pホールディングス	4,500	2,093.00	9,418,500
綿半ホールディングス	4,000	1,817.00	7,268,000
ヨシックス	1,800	2,651.00	4,771,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,400	962.00	29,244,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,100	677.00	3,452,700
B E E N O S	4,200	1,115.00	4,683,000
あさひ	7,900	1,226.00	9,685,400
日本調剤	3,200	3,820.00	12,224,000
コスモス薬品	4,600	23,840.00	109,664,000
トーエル	5,300	783.00	4,149,900
オンリー	2,000	778.00	1,556,000
セブン&アイ・ホールディングス	406,900	3,937.00	1,601,965,300
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	28,100	2,129.00	59,824,900
ツルハホールディングス	22,600	12,720.00	287,472,000
サンマルクホールディングス	8,300	2,152.00	17,861,600
フェリシモ	2,500	939.00	2,347,500
トリドールホールディングス	12,900	2,810.00	36,249,000
T O K Y O B A S E	9,700	452.00	4,384,400
ウイルプラスホールディングス	1,800	767.00	1,380,600
J Mホールディングス	5,300	2,255.00	11,951,500

サツドラホールディングス	1,700	1,807.00	3,071,900
アレンザホールディングス	5,400	975.00	5,265,000
串カツ田中ホールディングス	1,700	2,097.00	3,564,900
パロックジャパンリミテッド	7,400	965.00	7,141,000
クスリのアオキホールディングス	9,300	6,700.00	62,310,000
力の源ホールディングス	4,900	891.00	4,365,900
スシログローバルホールディングス	11,400	9,010.00	102,714,000
LIXILビバ	10,400	2,324.00	24,169,600
メディカルシステムネットワーク	10,400	476.00	4,950,400
はるやまホールディングス	5,100	843.00	4,299,300
ノジマ	18,600	2,123.00	39,487,800
カッパ・クリエイト	14,600	1,449.00	21,155,400
ライトオン	7,800	573.00	4,469,400
良品計画	138,200	1,726.00	238,533,200
三城ホールディングス	11,700	315.00	3,685,500
アドヴァン	16,100	1,219.00	19,625,900
アルビス	4,000	2,160.00	8,640,000
コナカ	12,800	402.00	5,145,600
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,691.00	2,367,400
G-7ホールディングス	6,200	2,542.00	15,760,400
イオン北海道	10,600	831.00	8,808,600
コジマ	18,300	482.00	8,820,600
ヒマラヤ	3,900	831.00	3,240,900
コーナン商事	14,900	2,423.00	36,102,700
エコス	3,900	1,697.00	6,618,300
ワタミ	12,500	1,133.00	14,162,500
マルシェ	3,000	766.00	2,298,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	228,600	1,957.00	447,370,200
西松屋チェーン	23,000	900.00	20,700,000
ゼンショーホールディングス	49,900	2,424.00	120,957,600
幸楽苑ホールディングス	6,700	1,825.00	12,227,500
ハークスレイ	2,400	1,129.00	2,709,600
サイゼリヤ	17,200	2,257.00	38,820,400
V Tホールディングス	43,500	412.00	17,922,000
魚力	3,000	1,615.00	4,845,000
フジ・コーポレーション	2,800	2,037.00	5,703,600
ユナイテッドアローズ	11,000	2,754.00	30,294,000
ハイデイ日高	15,100	1,895.00	28,614,500
京都きもの友禅	7,200	326.00	2,347,200
コロワイド	34,700	2,193.00	76,097,100
ピーシーデポコーポレーション	14,200	578.00	8,207,600
壱番屋	7,400	5,340.00	39,516,000

P L A N T	3,000	550.00	1,650,000
スギホールディングス	20,800	5,430.00	112,944,000
薬王堂ホールディングス	4,600	2,227.00	10,244,200
スクロール	16,500	348.00	5,742,000
ヨンドシーホールディングス	10,700	2,290.00	24,503,000
ファミリーマート	83,100	2,542.00	211,240,200
木曽路	13,700	2,860.00	39,182,000
S R S ホールディングス	12,500	1,040.00	13,000,000
タカキュー	9,200	182.00	1,674,400
ケーヨー	21,600	547.00	11,815,200
上新電機	12,400	2,004.00	24,849,600
日本瓦斯	16,500	3,740.00	61,710,000
ロイヤルホールディングス	18,200	2,106.00	38,329,200
いなげや	13,000	1,366.00	17,758,000
島忠	19,600	2,991.00	58,623,600
チヨダ	11,000	1,428.00	15,708,000
ライフコーポレーション	7,900	2,624.00	20,729,600
リンガーハット	12,900	2,397.00	30,921,300
Mr M a x H D	14,700	475.00	6,982,500
テンアライド	9,600	438.00	4,204,800
A O K I ホールディングス	21,000	1,017.00	21,357,000
オークワ	16,400	1,476.00	24,206,400
コメリ	16,100	2,197.00	35,371,700
青山商事	21,600	1,296.00	27,993,600
しまむら	12,100	7,770.00	94,017,000
はせがわ	6,000	398.00	2,388,000
高島屋	75,900	1,098.00	83,338,200
松屋	21,100	790.00	16,669,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	49,400	944.00	46,633,600
近鉄百貨店	4,000	3,325.00	13,300,000
丸井グループ	95,400	2,345.00	223,713,000
アクシアル リテイリング	8,700	3,695.00	32,146,500
イオン	400,300	2,296.50	919,288,950
イズミ	21,200	3,310.00	70,172,000
平和堂	21,200	1,874.00	39,728,800
フジ	12,600	1,825.00	22,995,000
ヤオコー	11,800	5,870.00	69,266,000
ゼビオホールディングス	12,700	1,100.00	13,970,000
ケーズホールディングス	100,500	1,294.00	130,047,000
O l y m p i c グループ	5,700	583.00	3,323,100
日産東京販売ホールディングス	16,000	253.00	4,048,000
Genky DrugStores	5,200	1,946.00	10,119,200



ナルミヤ・インターナショナル	1,900	1,171.00	2,224,900
総合メディカルホールディングス	9,200	2,548.00	23,441,600
ブックオフグループホールディングス	6,100	912.00	5,563,200
アインホールディングス	12,800	6,790.00	86,912,000
元気寿司	2,700	2,916.00	7,873,200
ヤマダ電機	317,200	588.00	186,513,600
アークランドサカモト	16,500	1,199.00	19,783,500
ニトリホールディングス	45,000	16,455.00	740,475,000
グルメ杵屋	7,600	1,161.00	8,823,600
愛眼	8,300	247.00	2,050,100
ケーユーホールディングス	5,700	885.00	5,044,500
吉野家ホールディングス	34,200	2,536.00	86,731,200
松屋フーズホールディングス	5,000	4,470.00	22,350,000
サガミホールディングス	14,100	1,318.00	18,583,800
関西スーパーマーケット	8,800	1,001.00	8,808,800
王将フードサービス	7,700	6,460.00	49,742,000
プレナス	11,800	1,914.00	22,585,200
ミニストップ	7,800	1,497.00	11,676,600
アークス	21,400	1,920.00	41,088,000
パローホールディングス	23,100	1,806.00	41,718,600
ベルク	5,200	5,570.00	28,964,000
大庄	5,700	1,609.00	9,171,300
ファーストリテイリング	13,900	58,860.00	818,154,000
サンドラッグ	39,200	3,315.00	129,948,000
サックスパー ホールディングス	9,000	806.00	7,254,000
ヤマザワ	2,600	1,667.00	4,334,200
やまや	2,200	2,219.00	4,881,800
ベルーナ	22,600	614.00	13,876,400
島根銀行	2,100	612.00	1,285,200
じもとホールディングス	70,400	102.00	7,180,800
めぶきフィナンシャルグループ	541,200	233.00	126,099,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,100	1,219.00	17,187,900
九州フィナンシャルグループ	170,900	408.00	69,727,200
ゆうちょ銀行	295,100	1,009.00	297,755,900
富山第一銀行	24,800	312.00	7,737,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	612,600	420.00	257,292,000
西日本フィナンシャルホールディングス	71,000	679.00	48,209,000
関西みらいフィナンシャルグループ	61,100	571.00	34,888,100
三十三フィナンシャルグループ	9,700	1,581.00	15,335,700
第四北越フィナンシャルグループ	18,100	2,566.00	46,444,600
新生銀行	76,400	1,668.00	127,435,200
あおぞら銀行	62,100	3,030.00	188,163,000

三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,169,900	566.30	4,060,314,370
りそなホールディングス	1,143,000	441.00	504,063,000
三井住友トラスト・ホールディングス	196,900	4,053.00	798,035,700
三井住友フィナンシャルグループ	720,300	3,754.00	2,704,006,200
千葉銀行	358,300	611.00	218,921,300
群馬銀行	204,700	356.00	72,873,200
武蔵野銀行	15,500	1,647.00	25,528,500
千葉興業銀行	28,600	335.00	9,581,000
筑波銀行	43,300	199.00	8,616,700
七十七銀行	35,200	1,555.00	54,736,000
青森銀行	8,100	2,569.00	20,808,900
秋田銀行	6,700	1,891.00	12,669,700
山形銀行	11,700	1,353.00	15,830,100
岩手銀行	6,800	2,573.00	17,496,400
東邦銀行	93,100	244.00	22,716,400
東北銀行	5,000	1,023.00	5,115,000
みちのく銀行	6,700	1,345.00	9,011,500
ふくおかフィナンシャルグループ	87,700	1,855.00	162,683,500
静岡銀行	257,900	752.00	193,940,800
十六銀行	13,100	2,075.00	27,182,500
スルガ銀行	106,600	448.00	47,756,800
八十二銀行	251,400	401.00	100,811,400
山梨中央銀行	12,100	925.00	11,192,500
大垣共立銀行	20,600	2,233.00	45,999,800
福井銀行	8,900	1,553.00	13,821,700
北國銀行	10,700	3,150.00	33,705,000
清水銀行	4,300	1,976.00	8,496,800
富山銀行	2,000	1,969.00	3,938,000
滋賀銀行	20,900	2,628.00	54,925,200
南都銀行	17,300	2,475.00	42,817,500
百五銀行	93,700	318.00	29,796,600
京都銀行	37,300	4,215.00	157,219,500
紀陽銀行	36,900	1,608.00	59,335,200
ほくほくフィナンシャルグループ	69,300	1,013.00	70,200,900
広島銀行	153,800	521.00	80,129,800
山陰合同銀行	61,800	609.00	37,636,200
中国銀行	89,600	944.00	84,582,400
鳥取銀行	3,500	1,324.00	4,634,000
伊予銀行	148,600	537.00	79,798,200
百十四銀行	11,100	2,007.00	22,277,700
四国銀行	15,800	930.00	14,694,000
阿波銀行	17,000	2,391.00	40,647,000

大分銀行	6,000	2,280.00	13,680,000
宮崎銀行	6,900	2,350.00	16,215,000
佐賀銀行	6,300	1,532.00	9,651,600
沖縄銀行	9,500	3,335.00	31,682,500
琉球銀行	24,000	1,052.00	25,248,000
セブン銀行	347,900	321.00	111,675,900
みずほフィナンシャルグループ	14,153,100	159.10	2,251,758,210
高知銀行	3,800	796.00	3,024,800
山口フィナンシャルグループ	130,000	648.00	84,240,000
長野銀行	3,400	1,455.00	4,947,000
名古屋銀行	8,400	3,390.00	28,476,000
北洋銀行	157,000	228.00	35,796,000
愛知銀行	3,800	3,485.00	13,243,000
中京銀行	4,300	2,210.00	9,503,000
大光銀行	3,600	1,614.00	5,810,400
愛媛銀行	14,500	1,077.00	15,616,500
トマト銀行	4,000	1,031.00	4,124,000
京葉銀行	44,400	585.00	25,974,000
栃木銀行	50,300	195.00	9,808,500
北日本銀行	3,200	2,086.00	6,675,200
東和銀行	18,300	784.00	14,347,200
福島銀行	9,800	215.00	2,107,000
大東銀行	5,400	617.00	3,331,800
トモニホールディングス	80,500	338.00	27,209,000
フィデアホールディングス	101,100	122.00	12,334,200
池田泉州ホールディングス	119,800	189.00	22,642,200
F P G	32,300	955.00	30,846,500
マーキュリアインベストメント	4,800	695.00	3,336,000
S B Iホールディングス	116,400	2,436.00	283,550,400
ジャフコ	16,000	4,665.00	74,640,000
大和証券グループ本社	836,000	539.00	450,604,000
野村ホールディングス	1,833,000	561.80	1,029,779,400
岡三証券グループ	89,100	391.00	34,838,100
丸三証券	31,300	506.00	15,837,800
東洋証券	38,300	150.00	5,745,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	120,100	322.00	38,672,200
光世証券	2,700	586.00	1,582,200
水戸証券	30,800	223.00	6,868,400
いちよし証券	19,700	611.00	12,036,700
松井証券	59,700	893.00	53,312,100
だいこう証券ビジネス	5,300	674.00	3,572,200
マネックスグループ	79,200	248.00	19,641,600

極東証券	14,200	755.00	10,721,000
岩井コスモホールディングス	10,000	1,267.00	12,670,000
藍澤証券	18,900	709.00	13,400,100
マネーパートナーズグループ	11,700	226.00	2,644,200
スパークス・グループ	36,700	258.00	9,468,600
かんぽ生命保険	36,900	1,836.00	67,748,400
S O M P Oホールディングス	195,800	4,387.00	858,974,600
アニコム ホールディングス	8,600	3,910.00	33,626,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	272,300	3,748.00	1,020,580,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	85,600	2,388.00	204,412,800
第一生命ホールディングス	589,400	1,644.00	968,973,600
東京海上ホールディングス	372,500	6,269.00	2,335,202,500
T & Dホールディングス	311,300	1,220.00	379,786,000
アドバンスクリエイト	2,400	1,790.00	4,296,000
全国保証	29,400	4,520.00	132,888,000
ジェイリース	2,900	335.00	971,500
イントラスト	3,600	775.00	2,790,000
日本モーゲージサービス	2,100	2,223.00	4,668,300
C a s a	3,600	1,468.00	5,284,800
アルヒ	16,600	1,777.00	29,498,200
プレミアグループ	5,600	2,040.00	11,424,000
クレディセゾン	73,000	1,816.00	132,568,000
芙蓉総合リース	10,900	6,940.00	75,646,000
みずほリース	16,100	3,230.00	52,003,000
東京センチュリー	21,000	5,110.00	107,310,000
日本証券金融	45,900	496.00	22,766,400
アイフル	158,900	300.00	47,670,000
リコーリース	8,200	4,245.00	34,809,000
イオンフィナンシャルサービス	63,700	1,779.00	113,322,300
アコム	209,300	517.00	108,208,100
ジャックス	11,500	2,432.00	27,968,000
オリエントコーポレーション	281,700	161.00	45,353,700
日立キャピタル	24,600	3,060.00	75,276,000
アプラスフィナンシャル	50,000	82.00	4,100,000
オリックス	651,500	1,911.00	1,245,016,500
三菱U F Jリース	264,300	697.00	184,217,100
九州リースサービス	5,100	604.00	3,080,400
日本取引所グループ	298,900	1,973.00	589,729,700
イー・ギャランティ	11,100	1,300.00	14,430,000
アサックス	5,400	719.00	3,882,600
N E Cキャピタルソリューション	4,200	2,461.00	10,336,200
いちご	135,900	393.00	53,408,700

日本駐車場開発	124,400	146.00	18,162,400
スター・マイカ・ホールディングス	6,300	1,618.00	10,193,400
ヒューリック	223,600	1,329.00	297,164,400
三栄建築設計	5,100	1,513.00	7,716,300
野村不動産ホールディングス	63,800	2,725.00	173,855,000
三重交通グループホールディングス	23,600	575.00	13,570,000
サムティ	15,500	1,818.00	28,179,000
ディア・ライフ	16,100	577.00	9,289,700
エー・ディー・ワークス	193,200	29.00	5,602,800
日本商業開発	7,500	1,773.00	13,297,500
ユニゾホールディングス	14,600	5,850.00	85,410,000
ハウスコム	2,300	1,536.00	3,532,800
日本管理センター	8,100	1,387.00	11,234,700
サンセイランディック	4,800	823.00	3,950,400
エストラスト	1,400	823.00	1,152,200
フージャースホールディングス	20,800	695.00	14,456,000
オープンハウス	30,700	3,275.00	100,542,500
東急不動産ホールディングス	285,300	777.00	221,678,100
飯田グループホールディングス	87,700	1,631.00	143,038,700
イーランド	3,500	815.00	2,852,500
ムゲンエステート	9,300	596.00	5,542,800
ハウズドゥ	5,700	1,158.00	6,600,600
シーアールイー	4,000	1,053.00	4,212,000
ケイアイスター不動産	4,000	1,645.00	6,580,000
グッドコムアセット	3,200	1,876.00	6,003,200
ジェイ・エス・ビー	1,400	5,180.00	7,252,000
テンポイノベーション	3,900	913.00	3,560,700
パーク24	56,500	2,579.00	145,713,500
パラカ	3,400	1,993.00	6,776,200
三井不動産	514,300	2,924.00	1,503,813,200
三菱地所	730,500	2,170.00	1,585,185,000
平和不動産	19,600	3,435.00	67,326,000
東京建物	114,700	1,697.00	194,645,900
ダイビル	28,100	1,363.00	38,300,300
京阪神ビルディング	18,000	1,469.00	26,442,000
住友不動産	234,600	3,852.00	903,679,200
テーオーシー	22,200	845.00	18,759,000
東京楽天地	2,000	5,730.00	11,460,000
スターツコーポレーション	14,700	2,572.00	37,808,400
フジ住宅	14,300	661.00	9,452,300
空港施設	13,300	531.00	7,062,300
明和地所	8,300	629.00	5,220,700

ゴールドクレスト	9,000	1,889.00	17,001,000
エスリード	4,800	1,872.00	8,985,600
日神グループホールディングス	18,300	530.00	9,699,000
日本エスコン	20,500	907.00	18,593,500
タカラレーベン	50,700	494.00	25,045,800
A V A N T I A	7,400	953.00	7,052,200
イオンモール	53,000	1,823.00	96,619,000
毎日コムネット	4,000	912.00	3,648,000
ファースト住建	5,700	1,245.00	7,096,500
カチタス	13,200	3,945.00	52,074,000
トーセイ	15,400	1,363.00	20,990,200
穴吹興産	3,100	1,636.00	5,071,600
サンフロンティア不動産	15,600	1,266.00	19,749,600
エフ・ジェー・ネクスト	10,500	1,105.00	11,602,500
インテリックス	5,000	667.00	3,335,000
ランドビジネス	4,400	733.00	3,225,200
日本社宅サービス	4,000	1,035.00	4,140,000
グランディハウス	11,300	443.00	5,005,900
日本空港ビルデング	33,500	5,120.00	171,520,000
日本工営	6,800	3,300.00	22,440,000
L I F U L L	35,400	485.00	17,169,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,800	1,594.00	10,839,200
日本M&Aセンター	76,300	3,675.00	280,402,500
メンバーズ	3,000	1,592.00	4,776,000
中広	1,300	539.00	700,700
UTグループ	11,900	2,583.00	30,737,700
アイティメディア	3,200	1,150.00	3,680,000
タケエイ	9,800	1,000.00	9,800,000
E・Jホールディングス	1,300	1,649.00	2,143,700
ビーネックスグループ	11,200	965.00	10,808,000
コシダカホールディングス	24,400	1,466.00	35,770,400
アルトナー	2,600	870.00	2,262,000
パソナグループ	12,400	1,284.00	15,921,600
C D S	2,600	1,383.00	3,595,800
リンクアンドモチベーション	22,400	540.00	12,096,000
G C A	12,300	798.00	9,815,400
エス・エム・エス	31,400	2,293.00	72,000,200
サニーサイドアップグループ	2,400	894.00	2,145,600
パーソルホールディングス	100,900	1,682.00	169,713,800
リニカル	5,000	987.00	4,935,000
クックパッド	35,600	318.00	11,320,800
エスクリ	3,300	736.00	2,428,800

アイ・ケイ・ケイ	5,100	736.00	3,753,600
学情	3,600	1,950.00	7,020,000
スタジオアリス	5,100	1,836.00	9,363,600
シミックホールディングス	5,600	1,603.00	8,976,800
エプロ	1,700	1,124.00	1,910,800
N J S	2,300	1,748.00	4,020,400
総合警備保障	40,200	5,530.00	222,306,000
カカクコム	75,600	2,815.00	212,814,000
アイロムグループ	3,600	1,481.00	5,331,600
セントケア・ホールディング	6,800	463.00	3,148,400
サイネックス	1,900	694.00	1,318,600
ルネサンス	5,700	1,667.00	9,501,900
ディップ	14,300	3,055.00	43,686,500
オプトホールディング	5,500	1,920.00	10,560,000
ツクイ	24,000	630.00	15,120,000
キャリアデザインセンター	2,600	1,237.00	3,216,200
ベネフィット・ワン	27,600	1,894.00	52,274,400
エムスリー	222,500	3,055.00	679,737,500
ツカダ・グローバルホールディング	6,600	536.00	3,537,600
プラス	1,300	763.00	991,900
アウトソーシング	57,800	979.00	56,586,200
ウェルネット	9,700	663.00	6,431,100
ワールドホールディングス	3,400	1,942.00	6,602,800
ディー・エヌ・エー	49,500	1,582.00	78,309,000
博報堂D Yホールディングス	140,400	1,426.00	200,210,400
ぐるなび	17,700	844.00	14,938,800
タカミヤ	10,900	597.00	6,507,300
ジャパンベストレスキューシステム	6,800	849.00	5,773,200
ファンコミュニケーションズ	28,000	436.00	12,208,000
ライク	4,100	1,882.00	7,716,200
ビジネス・ブレークスルー	4,600	403.00	1,853,800
エスプール	19,600	763.00	14,954,800
W D Bホールディングス	4,600	2,580.00	11,868,000
ティア	6,100	604.00	3,684,400
C D G	1,200	1,399.00	1,678,800
バリューコマース	5,700	2,365.00	13,480,500
インフォマート	110,700	720.00	79,704,000
J Pホールディングス	32,100	308.00	9,886,800
エコナックホールディングス	19,100	134.00	2,559,400
E P Sホールディングス	15,300	1,269.00	19,415,700
レッグス	2,600	1,273.00	3,309,800
プレステージ・インターナショナル	37,900	971.00	36,800,900

アミューズ	5,500	2,639.00	14,514,500
ドリームインキュベータ	3,100	1,478.00	4,581,800
クイック	6,300	1,431.00	9,015,300
T A C	6,600	198.00	1,306,800
ケネディクス	96,200	678.00	65,223,600
電通グループ	104,000	3,325.00	345,800,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,900	1,020.00	3,978,000
ぴあ	2,900	3,840.00	11,136,000
イオンファンタジー	3,900	2,186.00	8,525,400
シーティーエス	11,500	689.00	7,923,500
ネクシィーズグループ	3,600	1,578.00	5,680,800
みらかホールディングス	28,300	2,775.00	78,532,500
アルプス技研	9,000	1,939.00	17,451,000
ダイオーズ	2,100	1,328.00	2,788,800
日本空調サービス	10,700	770.00	8,239,000
オリエンタルランド	107,300	13,455.00	1,443,721,500
ダスキン	26,000	2,999.00	77,974,000
明光ネットワークジャパン	12,000	918.00	11,016,000
ファルコホールディングス	5,600	1,928.00	10,796,800
ラウンドワン	28,300	950.00	26,885,000
リゾートトラスト	46,300	1,603.00	74,218,900
ビー・エム・エル	13,000	3,215.00	41,795,000
ワタベウェディング	1,800	513.00	923,400
りらいあコミュニケーションズ	18,300	1,405.00	25,711,500
リソー教育	46,400	381.00	17,678,400
早稲田アカデミー	3,400	1,040.00	3,536,000
ユー・エス・エス	113,000	1,852.00	209,276,000
東京個別指導学院	3,700	656.00	2,427,200
サイバーエージェント	58,100	4,350.00	252,735,000
楽天	470,500	987.00	464,383,500
クリーク・アンド・リバー社	5,300	1,044.00	5,533,200
テー・オー・ダブリュー	9,000	864.00	7,776,000
山田コンサルティンググループ	5,000	1,501.00	7,505,000
セントラルスポーツ	3,800	2,975.00	11,305,000
フルキャストホールディングス	10,100	2,300.00	23,230,000
エン・ジャパン	18,000	3,435.00	61,830,000
リソルホールディングス	1,100	4,135.00	4,548,500
テクノプロ・ホールディングス	20,200	7,630.00	154,126,000
アトラ	2,600	316.00	821,600
インターワークス	2,100	539.00	1,131,900
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	7,540.00	30,914,000
K e e P e r 技研	3,800	1,157.00	4,396,600



ファーストロジック	2,500	585.00	1,462,500
三機サービス	2,200	999.00	2,197,800
Gunosy	7,100	1,155.00	8,200,500
デザインワン・ジャパン	2,400	285.00	684,000
イー・ガーディアン	5,200	1,915.00	9,958,000
リブセンス	6,900	281.00	1,938,900
ジャパンマテリアル	31,100	1,483.00	46,121,300
ベクトル	12,700	1,139.00	14,465,300
ウチヤマホールディングス	5,200	442.00	2,298,400
チャーム・ケア・コーポレーション	7,500	933.00	6,997,500
ライクキッズ	2,300	855.00	1,966,500
キャリアリンク	3,500	567.00	1,984,500
I B J	7,000	1,164.00	8,148,000
アサンテ	4,100	1,875.00	7,687,500
N・フィールド	7,100	562.00	3,990,200
バリューHR	2,000	3,440.00	6,880,000
M&Aキャピタルパートナーズ	7,200	3,710.00	26,712,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,666.00	6,497,400
E R Iホールディングス	3,000	771.00	2,313,000
アビスト	1,600	2,520.00	4,032,000
シグマクシス	7,000	1,663.00	11,641,000
ウィルグループ	6,700	987.00	6,612,900
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,400	212.00	3,052,800
リクルートホールディングス	722,900	4,488.00	3,244,375,200
エラン	6,000	1,624.00	9,744,000
土木管理総合試験所	4,600	417.00	1,918,200
ネットマーケティング	3,800	786.00	2,986,800
日本郵政	827,200	1,003.50	830,095,200
ベルシステム24ホールディングス	17,000	1,485.00	25,245,000
鎌倉新書	7,600	1,644.00	12,494,400
S M N	1,700	803.00	1,365,100
一蔵	1,200	611.00	733,200
L I T A L I C O	3,500	2,433.00	8,515,500
グローバルキッズCOMPANY	1,700	736.00	1,251,200
エアトリ	4,600	1,336.00	6,145,600
アトラエ	2,600	2,847.00	7,402,200
ストライク	3,800	4,640.00	17,632,000
ソラスト	27,900	1,073.00	29,936,700
セラク	3,300	1,231.00	4,062,300
インソース	4,900	2,879.00	14,107,100
ベイカレント・コンサルティング	6,100	7,640.00	46,604,000
Orchestra Holdings	2,100	997.00	2,093,700

アイモバイル	3,300	718.00	2,369,400
キャリアインデックス	4,400	338.00	1,487,200
MS - J a p a n	3,300	1,262.00	4,164,600
船場	1,700	1,090.00	1,853,000
グレイステクノロジー	4,600	3,050.00	14,030,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,700	2,160.00	23,112,000
フルテック	1,500	1,125.00	1,687,500
グリーンズ	3,900	851.00	3,318,900
ツナググループ・ホールディングス	1,300	563.00	731,900
GameWith	2,400	734.00	1,761,600
ソウルドアウト	1,600	2,037.00	3,259,200
MS&Consulting	1,500	1,048.00	1,572,000
ミダック	1,000	1,180.00	1,180,000
日総工産	6,800	807.00	5,487,600
キュービーネットホールディングス	6,200	2,229.00	13,819,800
RPAホールディングス	5,800	1,133.00	6,571,400
スプリックス	3,500	983.00	3,440,500
マネジメントソリューションズ	1,100	3,605.00	3,965,500
アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	865.00	4,498,000
リログループ	55,200	2,664.00	147,052,800
東祥	6,300	1,928.00	12,146,400
エイチ・アイ・エス	15,800	2,475.00	39,105,000
ラックランド	2,400	2,117.00	5,080,800
共立メンテナンス	16,700	4,070.00	67,969,000
イチネンホールディングス	11,400	1,346.00	15,344,400
建設技術研究所	7,000	2,155.00	15,085,000
スペース	6,600	1,156.00	7,629,600
長大	3,800	1,075.00	4,085,000
燦ホールディングス	4,500	1,552.00	6,984,000
スバル興業	600	8,480.00	5,088,000
東京テアトル	4,000	1,330.00	5,320,000
タナベ経営	2,000	1,295.00	2,590,000
ナガワ	3,200	6,370.00	20,384,000
よみうりランド	2,200	4,090.00	8,998,000
東京都競馬	6,600	3,705.00	24,453,000
カナモト	16,600	2,651.00	44,006,600
東京ドーム	41,000	928.00	38,048,000
西尾レントオール	10,300	2,920.00	30,076,000
トランス・コスモス	9,600	2,652.00	25,459,200
乃村工藝社	43,300	1,166.00	50,487,800
藤田観光	4,400	2,418.00	10,639,200
KNT - CTホールディングス	6,300	1,157.00	7,289,100

日本管財	10,900	1,900.00	20,710,000
トーカイ	9,800	2,458.00	24,088,400
白洋舎	1,200	2,780.00	3,336,000
セコム	107,100	9,502.00	1,017,664,200
セントラル警備保障	4,900	5,270.00	25,823,000
丹青社	19,100	1,132.00	21,621,200
メイテック	12,500	5,600.00	70,000,000
応用地質	10,900	1,424.00	15,521,600
船井総研ホールディングス	20,900	2,914.00	60,902,600
進学会ホールディングス	4,200	508.00	2,133,600
オオバ	8,000	711.00	5,688,000
いであ	1,900	1,991.00	3,782,900
学究社	3,000	1,350.00	4,050,000
ベネッセホールディングス	33,700	2,925.00	98,572,500
イオンディライト	12,500	3,670.00	45,875,000
ナック	5,700	1,021.00	5,819,700
ニチイ学館	14,400	1,288.00	18,547,200
ダイセキ	17,000	2,899.00	49,283,000
ステップ	3,800	1,628.00	6,186,400
合 計	123,661,500		249,018,304,940

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 日本債券マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	834,967,691
国債証券	307,118,180,350
地方債証券	19,763,679,839

	2020年 2月21日現在
項目	金額（円）
特殊債券	25,614,328,331
社債券	15,303,979,000
未収入金	302,439,000
未収利息	839,528,710
前払費用	74,063,133
流動資産合計	369,851,166,054
資産合計	369,851,166,054
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,330
未払金	700,510,000
未払解約金	192,561,308
未払利息	365
流動負債合計	893,092,003
負債合計	893,092,003
純資産の部	
元本等	
元本	264,459,131,890
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	104,498,942,161
元本等合計	368,958,074,051
純資産合計	368,958,074,051
負債純資産合計	369,851,166,054

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

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	264,459,131,890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 102,040,000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 1.3951円 (1万口当たり純資産額) (13,951円)

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

### (金融商品に関する注記)

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 2月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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

	2020年 2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券

	2020年 2月21日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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> <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	2020年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 2月22日
期首元本額	220,886,925,182円
期中追加設定元本額	60,304,919,637円
期中一部解約元本額	16,732,712,929円
期末元本額	264,459,131,890円
期末元本額の内訳	

区分	2020年 2月21日現在
日本債券インデックスファンド	931,157,623円
D C日本債券インデックスファンド	2,749,801,265円
D C日本債券インデックスファンドL	39,163,115,168円
D Cバランスファンド30	8,603,507,543円
D Cバランスファンド50	5,770,786,088円
D Cバランスファンド70	1,452,129,861円
日本債券インデックスe	1,381,989,860円
インデックスコレクション(国内債券)	36,344,151,550円
インデックスコレクション(バランス株式30)	47,552,807,381円
インデックスコレクション(バランス株式50)	3,781,200,110円
インデックスコレクション(バランス株式70)	1,382,579,242円
私募日本債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	46,893,545,775円
日本債券パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	2,751,945,903円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	281,304,562円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	1,260,159,347円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	166,691,958円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	241,635,938円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	1,536,631,240円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	4,050,310,199円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,111,778,640円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	12,402,524,437円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	135,546,761円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	444,245,214円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	3,204,663,217円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	223,782,519円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	389,686,581円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,242,634,970円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	409,104,052円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	942,000,646円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	100,791,887円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	3,809,641,321円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,713,516,369円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	28,619,310,364円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	511,793,680円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	183,099,240円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	43,860,326円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	668,892,975円
私募日本債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	6,808,078円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年 2月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	2,016,086,600	
地方債証券	40,930,556	
特殊債券	71,976,967	
社債券	41,801,000	
合計	2,170,795,123	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2020年 2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引	152,920,000	-	152,900,000	20,000
	買建				
合計		152,920,000	-	152,900,000	20,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第398回利付国債(2年)	3,190,000,000	3,198,389,700	
	第399回利付国債(2年)	1,440,000,000	1,444,104,000	
	第400回利付国債(2年)	400,000,000	401,224,000	
	第401回利付国債(2年)	1,010,000,000	1,013,322,900	
	第402回利付国債(2年)	490,000,000	491,715,000	
	第403回利付国債(2年)	670,000,000	672,492,400	
	第405回利付国債(2年)	130,000,000	130,551,200	



第406回利付国債(2年)	740,000,000	743,307,800	
第407回利付国債(2年)	4,410,000,000	4,431,035,700	
第408回利付国債(2年)	870,000,000	874,271,700	
第409回利付国債(2年)	620,000,000	623,186,800	
第127回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,660,074,000	
第128回利付国債(5年)	2,330,000,000	2,337,968,600	
第129回利付国債(5年)	1,980,000,000	1,988,236,800	
第130回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,889,061,600	
第131回利付国債(5年)	1,910,000,000	1,920,657,800	
第132回利付国債(5年)	1,125,000,000	1,132,053,750	
第133回利付国債(5年)	1,670,000,000	1,681,840,300	
第134回利付国債(5年)	3,330,000,000	3,355,907,400	
第135回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,966,497,000	
第136回利付国債(5年)	2,040,000,000	2,059,033,200	
第137回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,898,555,600	
第138回利付国債(5年)	7,700,000,000	7,781,312,000	
第139回利付国債(5年)	2,860,000,000	2,891,574,400	
第140回利付国債(5年)	1,800,000,000	1,821,114,000	
第141回利付国債(5年)	7,060,000,000	7,147,685,200	
第142回利付国債(5年)	410,000,000	415,272,600	
第1回利付国債(40年)	230,000,000	358,264,100	
第2回利付国債(40年)	350,000,000	530,603,500	
第3回利付国債(40年)	380,000,000	581,502,600	
第4回利付国債(40年)	595,000,000	920,149,650	
第5回利付国債(40年)	415,000,000	623,176,450	
第6回利付国債(40年)	610,000,000	904,935,000	
第7回利付国債(40年)	1,480,000,000	2,120,336,800	
第8回利付国債(40年)	960,000,000	1,290,921,600	
第9回利付国債(40年)	780,000,000	791,216,400	
第10回利付国債(40年)	970,000,000	1,152,583,100	
第11回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,455,325,200	
第12回利付国債(40年)	310,000,000	324,861,400	
第313回利付国債(10年)	910,000,000	924,095,900	
第314回利付国債(10年)	250,000,000	253,340,000	
第315回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,038,207,000	
第316回利付国債(10年)	360,000,000	365,950,800	
第317回利付国債(10年)	280,000,000	285,541,200	
第318回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,069,131,000	
第319回利付国債(10年)	560,000,000	572,852,000	
第320回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,296,835,100	
第321回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,577,129,400	
第322回利付国債(10年)	860,000,000	878,954,400	

第323回利付国債(10年)	690,000,000	707,077,500	
第324回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,697,217,200	
第325回利付国債(10年)	2,245,000,000	2,301,147,450	
第326回利付国債(10年)	560,000,000	573,865,600	
第327回利付国債(10年)	1,010,000,000	1,037,865,900	
第328回利付国債(10年)	2,010,000,000	2,057,958,600	
第329回利付国債(10年)	2,035,000,000	2,101,157,850	
第330回利付国債(10年)	1,650,000,000	1,707,733,500	
第331回利付国債(10年)	830,000,000	853,082,300	
第332回利付国債(10年)	2,270,000,000	2,337,577,900	
第333回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,362,615,900	
第334回利付国債(10年)	2,340,000,000	2,418,834,600	
第335回利付国債(10年)	2,265,000,000	2,335,373,550	
第336回利付国債(10年)	270,000,000	278,985,600	
第337回利付国債(10年)	1,870,000,000	1,913,608,400	
第338回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,892,001,400	
第339回利付国債(10年)	3,415,000,000	3,521,274,800	
第340回利付国債(10年)	3,930,000,000	4,058,157,300	
第341回利付国債(10年)	2,150,000,000	2,210,651,500	
第342回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,243,751,500	
第343回利付国債(10年)	2,055,000,000	2,091,085,800	
第344回利付国債(10年)	2,320,000,000	2,362,363,200	
第345回利付国債(10年)	2,580,000,000	2,628,942,600	
第346回利付国債(10年)	2,255,000,000	2,299,333,300	
第347回利付国債(10年)	2,315,000,000	2,361,276,850	
第348回利付国債(10年)	3,900,000,000	3,979,170,000	
第349回利付国債(10年)	2,585,000,000	2,638,199,300	
第350回利付国債(10年)	2,590,000,000	2,642,836,000	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	2,080,000,000	2,121,100,800	
第352回利付国債(10年)	1,570,000,000	1,600,583,600	
第353回利付国債(10年)	4,020,000,000	4,096,942,800	
第354回利付国債(10年)	2,610,000,000	2,657,736,900	
第355回利付国債(10年)	2,570,000,000	2,615,848,800	
第356回利付国債(10年)	4,000,000,000	4,069,400,000	
第357回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,067,115,000	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	63,790,500	
第2回利付国債(30年)	100,000,000	124,651,000	
第3回利付国債(30年)	140,000,000	173,740,000	
第4回利付国債(30年)	190,000,000	249,948,800	
第5回利付国債(30年)	180,000,000	224,848,800	
第6回利付国債(30年)	150,000,000	192,243,000	
第7回利付国債(30年)	190,000,000	242,998,600	

第9回利付国債(30年)	180,000,000	211,348,800
第10回利付国債(30年)	170,000,000	193,415,800
第11回利付国債(30年)	280,000,000	341,107,200
第12回利付国債(30年)	370,000,000	471,894,300
第13回利付国債(30年)	330,000,000	417,723,900
第14回利付国債(30年)	350,000,000	463,886,500
第15回利付国債(30年)	800,000,000	1,075,520,000
第16回利付国債(30年)	250,000,000	337,115,000
第17回利付国債(30年)	420,000,000	562,266,600
第18回利付国債(30年)	340,000,000	451,333,000
第19回利付国債(30年)	300,000,000	399,552,000
第20回利付国債(30年)	290,000,000	396,685,200
第21回利付国債(30年)	360,000,000	482,936,400
第22回利付国債(30年)	380,000,000	523,351,200
第23回利付国債(30年)	370,000,000	511,317,800
第24回利付国債(30年)	335,000,000	464,135,800
第25回利付国債(30年)	335,000,000	454,628,500
第26回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,300,875,900
第27回利付国債(30年)	490,000,000	687,675,800
第28回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,482,642,000
第29回利付国債(30年)	520,000,000	729,372,800
第30回利付国債(30年)	555,000,000	771,849,600
第31回利付国債(30年)	670,000,000	924,935,000
第32回利付国債(30年)	955,000,000	1,344,429,900
第33回利付国債(30年)	1,170,000,000	1,586,028,600
第34回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,865,737,300
第35回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,532,059,200
第36回利付国債(30年)	1,480,000,000	2,034,319,200
第37回利付国債(30年)	1,195,000,000	1,624,877,350
第38回利付国債(30年)	895,000,000	1,202,736,800
第39回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,424,321,600
第40回利付国債(30年)	545,000,000	735,461,150
第41回利付国債(30年)	565,000,000	750,834,150
第42回利付国債(30年)	700,000,000	932,491,000
第43回利付国債(30年)	985,000,000	1,313,881,650
第44回利付国債(30年)	670,000,000	895,890,500
第45回利付国債(30年)	770,000,000	994,901,600
第46回利付国債(30年)	880,000,000	1,138,095,200
第47回利付国債(30年)	795,000,000	1,049,272,800
第48回利付国債(30年)	760,000,000	967,700,400
第49回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,990,232,400
第50回利付国債(30年)	830,000,000	934,837,300
第51回利付国債(30年)	1,315,000,000	1,315,000,000

第52回利付国債（30年）	950,000,000	997,975,000	
第53回利付国債（30年）	1,070,000,000	1,151,095,300	
第54回利付国債（30年）	715,000,000	806,498,550	
第55回利付国債（30年）	840,000,000	947,226,000	
第56回利付国債（30年）	940,000,000	1,061,015,600	
第57回利付国債（30年）	580,000,000	654,448,800	
第58回利付国債（30年）	1,460,000,000	1,646,807,000	
第59回利付国債（30年）	570,000,000	627,860,700	
第60回利付国債（30年）	1,150,000,000	1,329,802,500	
第61回利付国債（30年）	710,000,000	781,177,500	
第62回利付国債（30年）	360,000,000	376,228,800	
第63回利付国債（30年）	1,040,000,000	1,058,044,000	
第64回利付国債（30年）	1,160,000,000	1,178,687,600	
第65回利付国債（30年）	160,000,000	162,598,400	
第49回利付国債（20年）	280,000,000	286,770,400	
第50回利付国債（20年）	590,000,000	603,003,600	
第51回利付国債（20年）	240,000,000	246,844,800	
第52回利付国債（20年）	430,000,000	445,325,200	
第53回利付国債（20年）	350,000,000	364,441,000	
第54回利付国債（20年）	280,000,000	292,062,400	
第55回利付国債（20年）	490,000,000	511,986,300	
第56回利付国債（20年）	410,000,000	430,676,300	
第57回利付国債（20年）	360,000,000	377,319,600	
第58回利付国債（20年）	250,000,000	263,375,000	
第59回利付国債（20年）	440,000,000	463,412,400	
第60回利付国債（20年）	570,000,000	595,490,400	
第61回利付国債（20年）	390,000,000	404,172,600	
第62回利付国債（20年）	250,000,000	258,170,000	
第63回利付国債（20年）	570,000,000	607,637,100	
第64回利付国債（20年）	410,000,000	440,614,700	
第65回利付国債（20年）	370,000,000	399,574,100	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	355,106,400	
第67回利付国債（20年）	310,000,000	336,390,300	
第68回利付国債（20年）	230,000,000	252,404,300	
第69回利付国債（20年）	530,000,000	579,454,300	
第70回利付国債（20年）	490,000,000	544,855,500	
第71回利付国債（20年）	400,000,000	441,304,000	
第72回利付国債（20年）	710,000,000	784,358,300	
第73回利付国債（20年）	540,000,000	597,045,600	
第74回利付国債（20年）	310,000,000	344,255,000	
第75回利付国債（20年）	360,000,000	401,835,600	
第76回利付国債（20年）	340,000,000	376,036,600	

第77回利付国債(20年)	290,000,000	322,219,000
第78回利付国債(20年)	20,000,000	22,226,400
第79回利付国債(20年)	100,000,000	111,668,000
第80回利付国債(20年)	250,000,000	280,512,500
第81回利付国債(20年)	180,000,000	202,008,600
第82回利付国債(20年)	485,000,000	547,026,650
第83回利付国債(20年)	70,000,000	79,357,600
第84回利付国債(20年)	190,000,000	214,282,000
第85回利付国債(20年)	360,000,000	410,061,600
第86回利付国債(20年)	240,000,000	276,314,400
第87回利付国債(20年)	170,000,000	194,680,600
第88回利付国債(20年)	340,000,000	393,607,800
第89回利付国債(20年)	320,000,000	368,412,800
第90回利付国債(20年)	420,000,000	486,103,800
第91回利付国債(20年)	310,000,000	360,849,300
第92回利付国債(20年)	790,000,000	913,666,600
第93回利付国債(20年)	260,000,000	300,333,800
第94回利付国債(20年)	445,000,000	517,210,150
第95回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,300,761,000
第96回利付国債(20年)	200,000,000	233,542,000
第97回利付国債(20年)	210,000,000	247,961,700
第98回利付国債(20年)	370,000,000	434,050,700
第99回利付国債(20年)	460,000,000	541,857,000
第100回利付国債(20年)	760,000,000	905,023,200
第101回利付国債(20年)	360,000,000	434,566,800
第102回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,297,556,900
第103回利付国債(20年)	335,000,000	403,427,100
第104回利付国債(20年)	260,000,000	308,737,000
第105回利付国債(20年)	500,000,000	596,080,000
第106回利付国債(20年)	270,000,000	324,221,400
第107回利付国債(20年)	270,000,000	323,122,500
第108回利付国債(20年)	725,000,000	854,731,500
第109回利付国債(20年)	290,000,000	342,887,300
第110回利付国債(20年)	515,000,000	618,339,900
第111回利付国債(20年)	450,000,000	546,543,000
第112回利付国債(20年)	550,000,000	662,832,500
第113回利付国債(20年)	905,000,000	1,094,669,900
第114回利付国債(20年)	610,000,000	740,472,900
第115回利付国債(20年)	270,000,000	330,417,900
第116回利付国債(20年)	260,000,000	319,326,800
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,315,504,800
第118回利付国債(20年)	450,000,000	545,364,000
第119回利付国債(20年)	320,000,000	381,184,000

第120回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,556,725,100	
第121回利付国債(20年)	750,000,000	904,402,500	
第122回利付国債(20年)	490,000,000	585,677,400	
第123回利付国債(20年)	480,000,000	590,947,200	
第124回利付国債(20年)	320,000,000	390,489,600	
第125回利付国債(20年)	500,000,000	623,070,000	
第126回利付国債(20年)	450,000,000	550,782,000	
第127回利付国債(20年)	400,000,000	485,152,000	
第128回利付国債(20年)	650,000,000	790,634,000	
第129回利付国債(20年)	260,000,000	313,307,800	
第130回利付国債(20年)	680,000,000	822,052,000	
第131回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,341,009,600	
第132回利付国債(20年)	600,000,000	720,102,000	
第133回利付国債(20年)	620,000,000	751,421,400	
第134回利付国債(20年)	1,420,000,000	1,726,237,200	
第135回利付国債(20年)	365,000,000	439,317,650	
第136回利付国債(20年)	450,000,000	536,206,500	
第137回利付国債(20年)	460,000,000	554,934,800	
第138回利付国債(20年)	450,000,000	531,814,500	
第139回利付国債(20年)	530,000,000	632,873,000	
第140回利付国債(20年)	1,195,000,000	1,445,758,800	
第141回利付国債(20年)	780,000,000	945,703,200	
第142回利付国債(20年)	540,000,000	661,602,600	
第143回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,443,264,000	
第144回利付国債(20年)	1,400,000,000	1,665,608,000	
第145回利付国債(20年)	1,210,000,000	1,474,070,400	
第146回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,380,317,600	
第147回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,332,122,000	
第148回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,630,830,400	
第149回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,658,511,600	
第150回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,877,888,200	
第151回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,383,125,100	
第152回利付国債(20年)	1,300,000,000	1,512,199,000	
第153回利付国債(20年)	2,710,000,000	3,198,098,100	
第154回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,575,207,000	
第155回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,455,961,600	
第156回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,178,929,000	
第157回利付国債(20年)	1,300,000,000	1,313,481,000	
第158回利付国債(20年)	1,940,000,000	2,053,063,200	
第159回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,483,072,200	
第160回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,189,735,000	
第161回利付国債(20年)	955,000,000	1,025,794,150	

	第162回利付国債(20年)	1,250,000,000	1,342,825,000	
	第163回利付国債(20年)	955,000,000	1,026,004,250	
	第164回利付国債(20年)	960,000,000	1,014,624,000	
	第165回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,817,575,600	
	第166回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,354,625,600	
	第167回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,298,080,500	
	第168回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,501,866,500	
	第169回利付国債(20年)	810,000,000	823,527,000	
	第170回利付国債(20年)	2,560,000,000	2,600,857,600	
	第171回利付国債(20年)	30,000,000	30,455,700	
	国債証券合計	278,955,000,000	307,118,180,350	
地方債証券	第1回東京都公募公債(東京グリーンbond(30年))	100,000,000	114,591,000	
	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,242,000	
	第7回東京都公募公債(30年)	200,000,000	281,418,000	
	第11回東京都公募公債(20年)	200,000,000	231,378,000	
	第13回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,819,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,326,000	
	第18回東京都公募公債(20年)	200,000,000	239,800,000	
	第20回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,596,000	
	第21回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,909,000	
	第714回東京都公募公債	100,000,000	102,120,000	
	第722回東京都公募公債	200,000,000	205,386,000	
	第740回東京都公募公債	100,000,000	102,283,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	102,189,000	
	第786回東京都公募公債	200,000,000	202,672,000	
	平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	101,637,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	300,000,000	303,696,000	
	第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	121,676,000	
	第21回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	119,745,000	
	第184回神奈川県公募公債	100,000,000	101,346,000	
	第190回神奈川県公募公債	100,000,000	102,057,000	
	第196回神奈川県公募公債	100,000,000	102,114,000	
	第243回神奈川県公募公債	100,000,000	100,195,000	
	第356回大阪府公募公債(10年)	130,000,000	132,557,100	
	第363回大阪府公募公債(10年)	114,000,000	116,236,680	
	第371回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	203,746,000	
	第376回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,985,000	
	第403回大阪府公募公債(10年)	300,000,000	308,103,000	
	第415回大阪府公募公債(10年)	108,000,000	109,085,400	
	第417回大阪府公募公債(10年)	108,000,000	109,838,160	
	第423回大阪府公募公債(10年)	300,000,000	304,056,000	

平成25年度第2回京都府公募公債（15年）	100,000,000	108,542,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,968,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	105,860,000	106,566,086	
平成29年度第3回京都府公募公債	100,000,000	100,034,000	
令和元年度第3回京都府公募公債	100,000,000	100,086,000	
第3回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	117,454,000	
第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	110,217,000	
平成25年度第14回兵庫県公募公債	100,000,000	102,901,000	
平成26年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	102,714,000	
平成28年度第30回兵庫県公募公債	100,000,000	101,483,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	110,790,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	101,588,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	101,559,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,118,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	101,865,000	
平成27年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,656,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	121,509,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,149,000	
平成25年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,545,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	204,570,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,635,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,084,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	202,946,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,261,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	120,017,000	
平成23年度第1回広島県公募公債	272,000,000	276,047,360	
平成24年度第2回広島県公募公債	100,000,000	102,050,000	
平成27年度第2回広島県公募公債	162,000,000	167,326,560	
平成29年度第7回広島県公募公債	131,440,000	133,508,865	
第5回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	237,778,000	
第9回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	111,370,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	203,236,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,921,000	
平成24年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	102,045,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,170,000	
平成27年度第8回埼玉県公募公債	200,000,000	204,928,000	



平成29年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	101,642,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	140,699,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	273,230,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,492,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,112,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	102,185,000	
平成29年度第6回福岡県公募公債	170,000,000	172,743,800	
平成29年度第8回福岡県公募公債	200,000,000	203,600,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	240,914,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	121,403,000	
平成26年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	102,394,000	
平成28年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,500,000	
平成29年度第5回千葉県公募公債	120,000,000	122,032,800	
令和元年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,164,000	
平成27年度第3回新潟県公募公債	200,000,000	201,460,000	
平成24年度第1回岐阜県公募公債（10年）	139,630,000	142,641,819	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,476,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,552,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,709,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,587,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,643,000	
第103回共同発行市場公募地方債	177,400,000	180,383,868	
第105回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,954,000	
第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,051,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,182,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,234,000	
第117回共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,335,000	
第118回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,974,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,128,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,820,000	
第130回共同発行市場公募地方債	350,000,000	360,587,500	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,916,000	
第134回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,908,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,596,000	
第139回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,184,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,452,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,128,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,773,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,239,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,718,000	

第175回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,488,500	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,431,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	102,168,000	
平成29年度第1回熊本県公募公債（5年）	100,000,000	100,041,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,846,000	
第7回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	114,368,000	
平成29年度第1回大阪市公募公債（5年）	200,000,000	200,066,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	107,659,000	
第13回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	114,467,000	
第482回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,994,000	
第488回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,788,000	
第495回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,667,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	111,842,000	
第6回京都市公募公債（20年）	100,000,000	118,009,000	
平成27年度第5回京都市公募公債	200,000,000	202,446,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	119,591,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	111,577,000	
平成23年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,453,000	
平成25年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	102,793,000	
第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	119,405,000	
第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	120,710,000	
平成23年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,346,000	
平成24年度第7回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,959,000	
第88回川崎市公募公債	100,000,000	102,736,000	
平成29年度第12回福岡市公募公債	130,000,000	132,050,100	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	102,469,000	
平成23年度第5回広島市公募公債	151,900,000	154,997,241	
平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,744,000	
平成23年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	101,575,000	
平成26年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	205,750,000	
平成27年度第1回三重県公募公債	100,000,000	102,744,000	
平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	102,168,000	
平成24年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	102,172,000	
平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	102,845,000	
平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	102,131,000	
地方債証券合計	18,720,230,000	19,763,679,839	
特殊債券			
第2回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	206,208,000	

第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	218,038,800	
第69回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	300,795,000	
第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,275,000	
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	160,793,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	172,039,500	
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	576,410,000	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,018,000	
第21回道路債券	100,000,000	133,006,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	311,958,000	
第27回道路債券	100,000,000	109,900,000	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,505,000	
第28回道路債券	300,000,000	405,861,000	
第33回道路債券	100,000,000	137,443,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,641,000	
第38回道路債券	100,000,000	110,397,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,806,000	
第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,112,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,267,000	
第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,911,000	
第87回日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	510,560,000	
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	240,268,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	243,484,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	139,224,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,212,000	
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	137,630,000	
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,388,000	
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,059,000	
第128回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,725,000	
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	101,639,000	
	100,000,000	101,698,000	

第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,831,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	127,408,750	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,899,000	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,219,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,138,000	
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,145,000	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,502,000	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	409,436,000	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,007,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,178,000	
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,854,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	213,572,920	
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	203,732,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,128,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,291,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,206,000	
第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,794,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,402,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,441,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	243,000,000	247,787,100	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,305,000	
第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	102,505,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	120,224,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	119,803,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,566,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	241,926,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	121,176,000	
第9回公営企業債券（20年）	100,000,000	110,670,000	

第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,674,000	
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	121,113,000	
第15回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,886,000	
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	363,291,000	
第17回公営企業債券(20年)	200,000,000	228,862,000	
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	119,659,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	100,000,000	100,093,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,453,000	
第22回公営企業債券(20年)	300,000,000	350,013,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	355,167,000	
第24回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,363,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,652,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,598,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,901,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,870,000	
第35回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,202,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	221,704,560	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,219,000	
第41回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,221,000	
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,196,000	
第43回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,094,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,562,000	
第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,076,000	
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,278,460	
第56回政府保証地方公共団体金融機構債券	193,000,000	198,988,790	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	431,529,210	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,788,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,921,000	
第96回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,267,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,922,000	
第107回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,390,000	
第110回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	152,287,500	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,211,000	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,295,000	
F190回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,724,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,014,000	

第19回首都高速道路株式会社社債	200,000,000	200,276,000	
第21回首都高速道路株式会社社債	300,000,000	300,846,000	
第81回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,011,000	
第159回都市再生債券	100,000,000	94,381,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	103,777,000	
第38回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	102,041,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,198,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,636,000	11,817,172	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,765,000	69,039,683	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,780,000	28,882,032	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,142,000	14,823,502	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,133,000	35,858,847	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,225,000	12,481,725	
第5回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	296,577,000	297,220,572	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,667,000	13,097,551	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,692,000	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	50,756,000	52,459,878	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,352,000	13,857,239	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,164,000	31,464,068	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,308,000	13,832,069	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,854,000	19,878,221	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,743,000	14,288,047	
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,832,000	10,913,348	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,672,000	10,764,526	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,883,000	17,941,057	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	47,421,000	48,442,448	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,566,000	10,668,173	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,895,000	16,223,390	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,728,000	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,056,000	24,696,370	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,769,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,991,000	22,603,318	
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,375,000	12,642,671	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,591,000	25,589,629	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,960,000	46,062,141	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,805,000	14,305,845	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,132,000	40,318,873	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,324,000	13,700,935	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,632,000	45,087,563	

第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,998,000	16,706,391	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,871,000	33,195,277	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,470,000	32,521,545	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,589,000	14,092,064	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,294,000	32,188,283	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,330,000	14,877,406	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,094,000	42,622,285	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,140,000	69,740,000	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,234,000	32,796,949	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,923,000	15,656,166	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,524,000	14,178,020	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,317,000	43,700,164	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,908,000	42,460,116	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,661,000	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,150,000	125,411,418	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,952,000	140,749,239	
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,680,000	14,269,197	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,571,000	32,505,227	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,245,000	33,140,634	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,311,000	42,046,791	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,827,000	35,897,212	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,131,000	14,795,863	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,174,000	40,417,485	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,296,000	42,710,536	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,457,000	47,107,526	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,396,000	44,952,902	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,494,000	51,814,278	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,158,000	53,001,958	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,156,000	46,460,943	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,651,000	44,520,393	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,089,000	46,062,423	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,788,000	52,644,835	
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,272,000	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,867,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,576,000	
第90回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,759,000	
第92回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,947,000	
第102回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,987,000	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,016,000	79,123,534	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,374,000	168,340,540	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,915,000	85,009,255	

第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,910,000	86,989,029	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,115,000	87,014,901	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,172,000	87,452,515	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,670,000	88,356,598	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,236,000	88,808,865	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,417,000	89,050,823	
第121回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,611,000	90,148,400	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,667,000	92,243,699	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,115,000	92,506,326	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,841,000	92,354,411	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,887,000	94,463,292	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,987,000	95,365,789	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,372,000	96,101,838	
第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,470,000	97,362,215	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,513,000	96,840,630	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,921,000	97,901,840	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,592,000	98,416,652	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,108,000	98,169,808	
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	298,476,000	299,708,705	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	299,661,000	302,615,657	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,056,000	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,876,000	
第57回日本学生支援債券	100,000,000	100,020,000	
い第835号商工債	200,000,000	200,148,000	
第322回信金中金債（5年）	100,000,000	100,047,000	
第327回信金中金債（5年）	200,000,000	200,240,000	
第328回信金中金債（5年）	100,000,000	100,125,000	
第331回信金中金債（5年）	100,000,000	100,186,000	
第339回信金中金債（5年）	100,000,000	100,346,000	



	第342回信金中金債(5年)	100,000,000	100,374,000
	第218号商工債(3年)	400,000,000	400,480,000
	第221号商工債(3年)	200,000,000	200,268,000
	第231号商工債(3年)	100,000,000	100,163,000
	第236号商工債(3年)	100,000,000	100,051,000
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,490,000
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,356,000
	第18回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	205,550,000
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,580,000
	第32回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,961,000
	第34回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,770,000
	特殊債券合計	23,896,501,000	25,614,328,331
社債券	第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,081,000
	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,652,000
	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 非上位円貨社債	200,000,000	201,130,000
	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 円貨社債	200,000,000	200,172,000
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 非上位円貨社債	100,000,000	100,665,000
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	100,378,000
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	100,109,000
	第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円 貨社債	200,000,000	200,034,000
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	200,000,000	200,294,000
	第1回HSBC・ホールディングス・ピーエ ルシー円貨社債	100,000,000	100,378,000
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー 非上位円貨社債	100,000,000	100,242,000
	第12回ウエストパック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	200,000,000	200,634,000
	第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	102,837,000
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,954,000
	第3回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,704,000
	第2回株式会社伊藤園無担保社債	100,000,000	100,266,000
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,443,000
	第10回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	101,162,000
	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	100,022,000
	第9回株式会社セブン&アイ・ホールディ ングス無担保社債	100,000,000	101,675,000
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	101,275,000

第11回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,800,000	
第22回レンゴー株式会社無担保社債	100,000,000	100,960,000	
第45回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,409,000	
第22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	100,606,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第1回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	100,096,000	
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	100,340,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	98,951,000	
第5回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,038,000	
第1回JXTGホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,084,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,911,000	
第9回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	101,335,000	
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	102,938,000	
第11回日本電気硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,047,000	
第9回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,739,000	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	101,295,000	
第21回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,500,000	
第31回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,827,000	
第1回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	100,000,000	99,977,000	
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	101,893,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,688,000	
第8回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,795,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,943,000	
第15回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	300,435,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,557,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,921,000	
第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	100,640,000	
第32回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,952,000	
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	100,230,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,112,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,768,000	
第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス無担保社債	100,000,000	100,057,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	119,845,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,329,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	100,401,000	

第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	112,183,000	
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	101,967,000	
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,655,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	105,820,000	
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	101,911,000	
第11回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,250,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	101,911,000	
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	111,638,000	
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,158,000	
第1回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,988,000	
第41回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,660,000	
第42回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,917,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,985,000	
第25回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,017,000	
第72回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,271,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,932,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,732,000	
第83回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
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	200,200,000	
第39回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,042,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,084,000	
第69回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,861,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	119,159,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	116,327,000	
第104回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,882,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,628,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,946,000	
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	102,944,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,026,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,199,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,818,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,084,000	

第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,951,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,013,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,990,000	
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,944,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,318,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,603,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,631,000	
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,273,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,816,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	133,036,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	116,517,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	119,869,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	117,136,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	117,834,000	
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	207,546,000	
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,469,000	
第4回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,475,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	200,000,000	202,334,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,193,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,335,000	
第535回中部電力株式会社社債	200,000,000	199,748,000	
第495回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,043,000	
第505回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,331,000	
第509回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,814,000	
第510回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,904,000	
第377回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,585,000	
第393回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,400,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,319,000	
第321回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,059,000	
第479回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,622,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,973,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,741,000	
第426回九州電力株式会社社債	200,000,000	207,320,000	
第431回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,029,000	
第436回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,597,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,004,000	
第482回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,981,000	
第320回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,910,000	

第323回北海道電力株式会社社債	100,000,000	109,049,000	
第357回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,897,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	109,640,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,216,000	
第56回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,004,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,172,000	
第38回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	133,594,000	
第5回SCK株式会社無担保社債	100,000,000	100,024,000	
第6回SCK株式会社無担保社債	100,000,000	99,939,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,060,000	
社債券合計	14,800,000,000	15,303,979,000	
合計		367,800,167,520	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,185,018,775
コール・ローン	1,391,231,524
株式	218,517,371,834
投資信託受益証券	164,317,298
投資証券	6,104,730,320
派生商品評価勘定	452,394,532
未収入金	900,652
未収配当金	288,826,381
差入委託証拠金	3,649,216,289
流動資産合計	239,754,007,605
資産合計	239,754,007,605
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,966,009
前受金	416,175,302
未払解約金	463,313,868
未払利息	608

	2020年 2月21日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	897,455,787
負債合計	897,455,787
純資産の部	
元本等	
元本	73,774,978,389
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	165,081,573,429
元本等合計	238,856,551,818
純資産合計	238,856,551,818
負債純資産合計	239,754,007,605

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

	2020年 2月21日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2020年 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	73,774,978,389口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.2376円 (1万口当たり純資産額) (32,376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

	2020年 2月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2020年 2月21日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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

	2020年 2月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>



	2020年 2月21日現在

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 2月22日
期首元本額	70,292,796,065円
期中追加設定元本額	13,935,376,414円
期中一部解約元本額	10,453,194,090円
期末元本額	73,774,978,389円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,715,653,592円
D C 外国株式インデックスファンド	4,535,177,387円
D C 外国株式インデックスファンド L	21,237,244,192円
D C バランスファンド 3 0	709,156,653円
D C バランスファンド 5 0	1,388,882,149円
D C バランスファンド 7 0	823,459,913円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	364,583,525円
外国株式インデックス e	5,489,108,806円
インデックスコレクション（外国株式）	9,334,897,072円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	3,867,445,970円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	899,677,090円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	765,425,652円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,504,693,757円
外国株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	1,256,936,747円
外国株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	794,396,420円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	57,565,055円

区分	2020年 2月21日現在
バランスVA50（適格機関投資家専用）	585,338,863円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	65,085,538円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	287,986,803円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	1,340,714円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,316,799,221円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	489,260,343円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	314,353,526円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,011,207,751円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	584,146,843円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	241,397,610円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	967,793,287円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	25,342,456円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	122,008,578円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	138,939,459円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	426,836,565円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	22,827,627円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	111,949,128円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	302,952,056円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	15,108,041円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,738,322,996
投資信託受益証券	215,906
投資証券	233,440,968
合計	1,971,979,870

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2020年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	13,552,173,970	-	13,968,349,272	416,175,302
合計		13,552,173,970	-	13,968,349,272	416,175,302

## (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はありません。

## 通貨関連

(2020年 2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	998,886,208	-	1,017,538,124	18,651,916
	アメリカドル	759,546,409	-	775,467,099	15,920,690
	ユーロ	143,857,200	-	145,140,000	1,282,800
	イギリスポンド	95,482,599	-	96,931,025	1,448,426
	売建	130,051,105	-	130,449,800	398,695
	アメリカドル	70,902,955	-	71,170,800	267,845
	カナダドル	29,468,950	-	29,603,000	134,050
	オーストラリアドル	29,679,200	-	29,676,000	3,200
	合計	1,128,937,313	-	1,147,987,924	18,253,221

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

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	17,138	28.58	489,804.04	
	BAKER HUGHES CO	30,686	20.66	633,972.76	
	CABOT OIL & GAS CORP	18,624	15.35	285,878.40	
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	54.87	618,165.42	
	CHEVRON CORP	90,072	109.81	9,890,806.32	

CONCHO RESOURCES INC	9,073	81.34	737,997.82
CONOCOPHILLIPS	52,881	58.88	3,113,633.28
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,103	25.75	105,652.25
DEVON ENERGY CORPORATION	20,829	22.15	461,362.35
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,107	78.48	557,757.36
EOG RESOURCES INC	28,047	75.99	2,131,291.53
EXXON MOBIL	200,665	59.86	12,011,806.90
HALLIBURTON CO	43,350	21.95	951,532.50
HESS CORP	13,266	64.72	858,575.52
HOLLYFRONTIER CORP	7,524	42.61	320,597.64
KINDER MORGAN INC	97,439	22.24	2,167,043.36
MARATHON OIL CORP	38,194	10.25	391,488.50
MARATHON PETROLEUM CORP	31,523	60.26	1,899,575.98
NATIONAL OILWELL VARCO INC	17,063	23.62	403,028.06
NOBLE ENERGY INC	20,854	18.55	386,841.70
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,476	42.97	1,868,163.72
ONEOK INC	19,821	77.52	1,536,523.92
PHILLIPS 66	21,428	90.19	1,932,591.32
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,721	142.53	1,100,474.13
SCHLUMBERGER	66,667	33.83	2,255,344.61
TARGA RESOURCES CORP	11,512	39.45	454,148.40
TECHNIPFMC PLC	19,859	17.24	342,369.16
VALERO ENERGY CORP	19,846	84.17	1,670,437.82
WILLIAMS COS	56,453	22.05	1,244,788.65
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,525	255.40	2,688,085.00
ALBEMARLE CORP	4,921	94.31	464,099.51
AMCOR PLC	71,648	10.27	735,824.96
AVERY DENNISON CORP	4,144	136.77	566,774.88
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,844	29.65	321,524.60
BALL CORP	16,262	76.60	1,245,669.20
CELANESE CORP-SERIES A	6,028	108.90	656,449.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	39.48	409,762.92
CORTEVA INC	37,876	31.57	1,195,745.32
CROWN HOLDINGS INC	7,597	78.89	599,327.33
DOW INC	35,582	48.76	1,734,978.32
DUPONT DE NEMOURS INC	35,629	52.55	1,872,303.95
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,407	74.13	474,950.91
ECOLAB INC	12,371	206.31	2,552,261.01
FMC CORP	6,680	108.29	723,377.20
FREEMPORT-MCMORAN INC	72,491	12.08	875,691.28
INT'L PAPER CO	17,669	42.95	758,883.55
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,263	132.69	698,347.47

LINDE PLC	25,700	221.20	5,684,840.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,921	83.35	1,076,965.35
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,199	258.08	825,597.92
MOSAIC CO/THE	14,763	18.47	272,672.61
NEWMONT CORPORATION	37,580	48.10	1,807,598.00
NUCOR CORP	14,326	47.85	685,499.10
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,206	99.10	416,814.60
PPG INDUSTRIES INC	11,346	119.36	1,354,258.56
RPM INTERNATIONAL INC	5,543	74.32	411,955.76
SEALED AIR CORP	7,368	34.94	257,437.92
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,968	584.08	2,317,629.44
STEEL DYNAMICS INC	9,144	29.35	268,376.40
VULCAN MATERIALS CO	5,948	135.79	807,678.92
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,000	63.40	126,800.00
WESTROCK CO	11,037	40.55	447,550.35
3 M COMPANY	27,657	158.56	4,385,293.92
ACUITY BRANDS INC	1,559	115.85	180,610.15
AERCAP HOLDINGS NV	5,656	62.60	354,065.60
ALLEGION PLC	4,638	129.85	602,244.30
AMETEK INC	10,392	100.55	1,044,915.60
ARCONIC INC	18,227	33.70	614,249.90
BOEING CO	25,477	336.28	8,567,405.56
CATERPILLAR	26,779	136.93	3,666,848.47
CUMMINS INC	7,213	167.12	1,205,436.56
DEERE&CO	14,281	165.83	2,368,218.23
DOVER CORP	6,899	119.02	821,118.98
EATON CORP	20,102	105.10	2,112,720.20
EMERSON ELECTRIC CO	29,394	72.02	2,116,955.88
FASTENAL CO	25,828	39.02	1,007,808.56
FLOWSERVE CORP	5,872	46.35	272,167.20
FORTIVE CORP	14,620	76.79	1,122,669.80
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,720	72.99	490,492.80
GENERAL DYNAMICS CORP	11,739	185.95	2,182,867.05
GENERAL ELECTRIC CO	418,761	12.53	5,247,075.33
GRAINGER (WW) INC	2,090	310.29	648,506.10
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,789	43.02	335,082.78
HEICO CORP	2,252	127.23	286,521.96
HEICO CORP-CLASS A	3,238	101.88	329,887.44
HONEYWELL INTL INC	34,426	180.70	6,220,778.20
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	237.42	473,178.06
IDEX CORP	3,709	173.58	643,808.22
ILLINOIS TOOL WORKS	15,432	190.00	2,932,080.00

INGERSOLL-RAND PLC	11,592	146.01	1,692,547.92
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,714	102.03	685,029.42
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,500	58.00	551,000.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	9,400	31.35	294,690.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	38,179	42.24	1,612,680.96
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,670	223.80	2,387,946.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,551	248.71	385,749.21
LOCKHEED MARTIN CORP	12,185	425.97	5,190,444.45
MASCO CORP	13,089	45.40	594,240.60
MIDDLEBY CORP	2,145	112.01	240,261.45
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,666	363.25	2,784,674.50
OWENS CORNING	4,925	66.85	329,236.25
PACCAR INC	16,659	75.54	1,258,420.86
PARKER HANNIFIN CORP	6,224	215.28	1,339,902.72
PENTAIR PLC	7,018	44.55	312,651.90
RAYTHEON COMPANY	13,279	220.44	2,927,222.76
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,373	205.31	1,103,130.63
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,981	384.01	1,912,753.81
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	48.35	367,556.70
SMITH (A.O.) CORP	6,846	44.52	304,783.92
SNAP-ON INC	2,319	159.95	370,924.05
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	5,095	65.03	331,327.85
STANLEY BLACK&DECKER	6,944	162.05	1,125,275.20
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,569	392.15	615,283.35
TEXTRON	10,911	47.63	519,690.93
TRANSDIGM GROUP INC	2,310	634.32	1,465,279.20
UNITED RENTALS INC	3,773	155.72	587,531.56
UNITED TECHNOLOGIES CORP	39,243	149.90	5,882,525.70
WABCO HOLDINGS INC	2,071	135.96	281,573.16
WABTEC CORP	8,979	78.84	707,904.36
XYLEM INC	8,037	88.66	712,560.42
CINTAS CORP	3,912	297.70	1,164,602.40
COPART INC	9,323	97.30	907,127.90
COSTAR GROUP INC	1,780	721.51	1,284,287.80
EQUIFAX INC	5,386	161.43	869,461.98
IHS MARKIT LTD	18,311	80.44	1,472,936.84
MANPOWER GROUP	2,894	92.38	267,347.72
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,880	22.25	353,330.00
REPUBLIC SERVICES INC	10,405	99.12	1,031,343.60
ROBERT HALF INTL INC	4,993	59.26	295,885.18
ROLLINS INC	7,140	39.97	285,385.80
TRANSUNION	9,217	100.35	924,925.95

VERISK ANALYTICS INC	7,047	169.39	1,193,691.33
WASTE CONNECTIONS INC	11,869	102.57	1,217,403.33
WASTE MANAGEMENT INC	20,266	124.05	2,513,997.30
AMERCO	376	343.02	128,975.52
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,122	28.51	117,518.22
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,245	74.82	467,250.90
CSX CORP	36,187	80.45	2,911,244.15
DELTA AIR LINES INC	7,841	58.38	457,757.58
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,487	75.47	565,043.89
FEDEX CORP	11,965	164.91	1,973,148.15
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,908	109.96	429,723.68
KANSAS CITY SOUTHERN	4,597	175.97	808,934.09
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	39.66	277,620.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,577	210.81	2,651,357.37
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,758	225.72	622,535.76
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,089	56.94	346,707.66
UBER TECHNOLOGIES INC	7,121	40.92	291,391.32
UNION PACIFIC CORP	33,663	183.40	6,173,794.20
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,649	79.91	211,681.59
UNITED PARCEL SERVICE B	33,245	106.48	3,539,927.60
XPO LOGISTICS INC	3,909	99.11	387,420.99
APTIV PLC	12,409	91.09	1,130,335.81
AUTOLIV INC	3,858	75.22	290,198.76
BORGWARNER INC	9,348	35.15	328,582.20
FORD MOTOR COMPANY	187,784	8.03	1,507,905.52
GENERAL MOTORS CO	61,408	35.29	2,167,088.32
HARLEY-DAVIDSON	7,429	35.87	266,478.23
LEAR CORP	2,989	124.70	372,728.30
TESLA INC	6,408	899.41	5,763,419.28
CAPRI HOLDINGS LTD	6,771	28.86	195,411.06
DR HORTON INC	16,002	62.05	992,924.10
GARMIN LTD	6,194	99.81	618,223.14
HANESBRANDS INC	15,911	14.72	234,209.92
HASBRO INC	6,321	98.88	625,020.48
LEGGETT & PLATT INC	5,338	45.19	241,224.22
LENNAR CORP-CL A	12,416	71.03	881,908.48
LULULEMON ATHLETICA INC	5,331	263.68	1,405,678.08
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	134.17	379,701.10
NEWELL BRANDS INC	20,391	19.89	405,576.99
NIKE B	59,484	102.53	6,098,894.52
NVR INC	171	4,037.77	690,458.67
POLARIS INC	2,942	94.52	278,077.84

PULTE GROUP INC	12,739	46.67	594,529.13
PVH CORP	3,435	86.88	298,432.80
RALPH LAUREN CORPORATION	2,566	121.86	312,692.76
TAPESTRY INC	12,753	28.81	367,413.93
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,197	16.50	118,750.50
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	7,301	14.94	109,076.94
VF CORP	16,290	83.99	1,368,197.10
WHIRLPOOL CORP	3,060	149.08	456,184.80
ARAMARK	11,643	42.86	499,018.98
CARNIVAL CORPORATION	20,517	42.50	871,972.50
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,205	927.59	1,117,745.95
DARDEN RESTAURANTS INC	5,327	120.68	642,862.36
DOMINO'S PIZZA INC	1,716	373.16	640,342.56
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,089	112.00	1,465,968.00
LAS VEGAS SANDS CORP	16,694	67.44	1,125,843.36
MARRIOTT INTL A	13,393	146.84	1,966,628.12
MCDONALD'S CORP	36,067	215.08	7,757,290.36
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	20.91	219,785.01
MGM RESORTS INTERNATIONAL	24,267	32.34	784,794.78
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	9,482	48.51	459,971.82
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,633	109.80	947,903.40
STARBUCKS CORP	56,915	88.60	5,042,669.00
VAIL RESORTS INC	1,670	248.54	415,061.80
WYNN RESORTS LTD	4,366	133.33	582,118.78
YUM BRANDS INC	14,608	103.87	1,517,332.96
ACTIVISION BLIZZARD INC	36,668	64.00	2,346,752.00
ALPHABET INC-CL A	14,200	1,516.99	21,541,258.00
ALPHABET INC-CL C	14,820	1,518.15	22,498,983.00
ALTICE USA INC- A	6,423	29.01	186,331.23
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,383	539.22	3,981,061.26
COMCAST CORP-CL A	215,243	46.02	9,905,482.86
DISCOVERY INC - A	7,886	29.98	236,422.28
DISCOVERY INC-C	18,339	28.60	524,495.40
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	41.00	516,723.00
ELECTRONIC ARTS INC	14,145	109.20	1,544,634.00
FACEBOOK INC-A	114,028	214.58	24,468,128.24
FOX CORP - CLASS A	15,812	37.03	585,518.36
FOX CORP- CLASS B	6,589	36.54	240,762.06
IAC/INTERACTIVECORP	3,797	233.56	886,827.32
INTERPUBLIC GROUP OF COS	16,191	24.93	403,641.63
LIBERTY BROADBAND-C	5,220	138.27	721,769.40
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	21.41	167,661.71



LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,297	20.29	371,246.13
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	46.81	462,716.85
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	6,975	51.14	356,701.50
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	50.93	161,499.03
LIVE NATION ENTERTAINMENT	7,407	75.66	560,413.62
MATCH GROUP INC	2,319	75.15	174,272.85
NETFLIX INC	20,797	386.00	8,027,642.00
NEWS CORP-CLASS A	16,730	14.54	243,337.85
OMNICOM GROUP	10,331	78.78	813,876.18
PINTEREST INC- CLASS A	5,775	23.54	135,943.50
ROKU INC	4,013	124.08	497,933.04
SIRIUS XM HOLDINGS INC	70,068	7.34	514,299.12
SNAP INC - A	35,320	16.92	597,614.40
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,126	115.13	590,156.38
THE WALT DISNEY CO	85,448	140.37	11,994,335.76
TRIPADVISOR INC	4,286	28.97	124,165.42
TWITTER INC	33,955	39.05	1,325,942.75
VIACOMCBS INC-CLASS B	27,145	29.29	795,077.05
ZILLOW GROUP INC-C	5,057	63.63	321,776.91
ADVANCE AUTO PARTS	3,293	142.48	469,186.64
AMAZON.COM	19,923	2,153.10	42,896,211.30
AUTOZONE INC	1,179	1,082.52	1,276,291.08
BEST BUY COMPANY INC	10,819	91.93	994,590.67
BOOKING HOLDINGS INC	2,023	1,970.91	3,987,150.93
BURLINGTON STORES INC	3,121	245.80	767,141.80
CARMAX INC	7,647	101.90	779,229.30
DOLLAR GENERAL CORP	12,304	165.73	2,039,141.92
DOLLAR TREE INC	10,680	93.22	995,589.60
EBAY	37,152	37.69	1,400,258.88
EXPEDIA GROUP INC	6,437	121.66	783,125.42
GAP	10,261	17.47	179,259.67
GENUINE PARTS CO	6,575	99.61	654,935.75
GRUBHUB INC	4,540	58.29	264,636.60
HOME DEPOT	51,957	247.02	12,834,418.14
KOHL'S CORP	7,505	44.77	335,998.85
LKQ CORP	13,137	34.02	446,920.74
LOWES COMPANIES	37,134	126.57	4,700,050.38
MERCADOLIBRE INC	2,025	742.59	1,503,744.75
NORDSTROM INC	5,106	41.08	209,754.48
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,669	395.18	1,449,915.42
ROSS STORES INC	17,444	123.81	2,159,741.64
TARGET (DAYTON HUDSON)	24,358	118.26	2,880,577.08

TIFFANY & CO	4,819	134.19	646,661.61
TJX COMPANIES INC	57,582	63.87	3,677,762.34
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,562	99.00	550,638.00
ULTA BEAUTY INC	2,528	301.34	761,787.52
WAYFAIR INC- CLASS A	2,697	82.33	222,044.01
COSTCO WHOLESALE CORP	20,897	324.08	6,772,299.76
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	17,000	5.17	87,890.00
KROGER CO	38,532	29.78	1,147,482.96
SYSCO CORP	23,327	76.71	1,789,414.17
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,697	51.87	1,903,473.39
WALMART INC	67,768	117.69	7,975,615.92
ALTRIA GROUP INC	88,876	45.56	4,049,190.56
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	26,815	44.23	1,186,027.45
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,909	71.55	1,066,738.95
BUNGE LIMITED	6,250	53.98	337,375.00
CAMPBELL SOUP CO (US)	7,946	47.74	379,342.04
COCA-COLA CO	192,749	59.72	11,510,970.28
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	10,990	55.91	614,450.90
CONAGRA BRANDS INC	22,174	29.88	662,559.12
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,026	208.34	1,672,136.84
GENERAL MILLS INC	28,968	54.13	1,568,037.84
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,193	160.11	1,151,671.23
HORMEL FOODS CORP	14,360	45.53	653,810.80
INGREDION INC	2,843	94.94	269,914.42
JM SMUCKER CO	5,075	110.56	561,092.00
KELLOGG CO	11,660	65.67	765,712.20
KRAFT HEINZ CO/THE	32,422	27.42	889,011.24
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,742	94.92	639,950.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,946	163.83	974,133.18
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	8,447	55.41	468,048.27
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	68,669	59.04	4,054,217.76
MONSTER BEVERAGE CORP	19,672	70.40	1,384,908.80
PEPSICO INC	66,364	145.16	9,633,398.24
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	73,919	87.44	6,463,477.36
TYSON FOODS INC	13,383	78.80	1,054,580.40
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,915	76.31	832,923.65
CLOROX COMPANY	5,812	164.17	954,156.04
COLGATE-PALMOLIVE CO	38,898	75.16	2,923,573.68
COTY INC-CL A	15,799	11.42	180,424.58
ESTEE LAUDER CO-CL A	10,575	211.32	2,234,709.00
KIMBERLY-CLARK CORP	16,449	142.17	2,338,554.33
PROCTER & GAMBLE CO	118,685	126.58	15,023,147.30

ABBOTT LABORATORIES	83,936	88.46	7,424,978.56
ABIOMED INC	1,891	168.08	317,839.28
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,394	272.49	924,831.06
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,377	96.53	712,101.81
ANTHEM INC	12,183	293.94	3,581,071.02
BAXTER INTERNATIONAL	23,206	93.06	2,159,550.36
BECTON DICKINSON & CO	12,859	253.46	3,259,242.14
BOSTON SCIENTIFIC CORP	66,417	42.50	2,822,722.50
CARDINAL HEALTH	13,433	60.42	811,621.86
CENTENE CORP	27,677	65.73	1,819,209.21
CERNER CORP	15,351	76.71	1,177,575.21
CIGNA CORP	17,982	220.41	3,963,412.62
CVS HEALTH CORP	61,863	71.94	4,450,424.22
DANAHER CORP	29,731	160.26	4,764,690.06
DAVITA INC	4,396	84.65	372,121.40
DENTSPLY SIRONA INC	10,232	57.44	587,726.08
DEXCOM INC	4,071	302.51	1,231,518.21
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,936	233.91	2,324,129.76
HCA HEALTHCARE INC	13,055	148.11	1,933,576.05
HENRY SCHEIN INC	6,861	68.92	472,860.12
HOLOGIC INC	13,047	52.70	687,576.90
HUMANA INC	6,453	370.99	2,393,998.47
IDEXX LABORATORIES INC	3,926	281.45	1,104,972.70
INSULET CORP	2,587	216.44	559,930.28
INTUITIVE SURGICAL INC	5,492	618.29	3,395,648.68
LABORATORY CRP OF AMER	4,584	188.81	865,505.04
MCKESSON CORP	8,904	170.78	1,520,625.12
MEDTRONIC PLC	63,716	113.86	7,254,703.76
QUEST DIAGNOSTICS	6,077	112.84	685,728.68
RESMED INC	6,412	176.00	1,128,512.00
STERIS PLC	4,144	168.28	697,352.32
STRYKER CORP	16,041	224.47	3,600,723.27
TELEFLEX INC	2,243	384.36	862,119.48
THE COOPER COS INC	2,406	354.83	853,720.98
UNITEDHEALTH GROUP INC	44,950	302.13	13,580,743.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	140.03	545,836.94
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,067	145.07	589,999.69
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,301	164.97	1,039,475.97
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,168	171.67	543,850.56
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,859	158.39	1,561,567.01
ABBVIE INC	70,246	94.23	6,619,280.58
AGILENT TECHNOLOGIES	14,894	84.34	1,256,159.96

ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,887	102.54	1,116,352.98
ALLERGAN PLC	15,641	198.74	3,108,492.34
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,441	133.12	724,305.92
AMGEN	28,485	222.14	6,327,657.90
BEIGENE LTD-ADR	1,700	171.00	290,700.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	945	409.07	386,571.15
BIOGEN INC	8,804	336.64	2,963,778.56
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,811	89.66	789,994.26
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	111,353	65.17	7,256,875.01
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	15,148	30.23	457,924.04
EXACT SCIENCES CORP	6,356	102.64	652,379.84
GILEAD SCIENCES INC	60,287	67.00	4,039,229.00
ILLUMINA INC	7,024	300.46	2,110,431.04
INCYTE CORP	8,916	82.77	737,977.32
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,654	61.29	407,823.66
IQVIA HOLDINGS INC	7,572	164.14	1,242,868.08
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	135.50	360,836.50
JOHNSON & JOHNSON	125,126	148.37	18,564,944.62
LILLY (ELI) & CO	41,302	142.00	5,864,884.00
MERCK & CO	121,476	82.49	10,020,555.24
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,191	755.39	899,669.49
MYLAN NV	23,155	20.92	484,518.37
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,726	103.15	384,336.90
PERKINELMER INC	5,468	93.30	510,164.40
PERRIGO CO PLC	5,954	59.61	354,917.94
PFIZER	262,459	35.85	9,409,155.15
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,890	399.14	1,552,654.60
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,156	123.09	388,472.04
SEATTLE GENETICS INC	5,163	118.33	610,937.79
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	13.31	756,766.67
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,028	336.06	6,394,549.68
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,265	245.10	3,006,151.50
WATERS CORP	3,249	217.34	706,137.66
ZOETIS INC	22,767	143.55	3,268,202.85
BANK OF AMERICA CORP	419,362	34.85	14,614,765.70
CITIGROUP	107,238	78.22	8,388,156.36
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,232	38.78	784,596.96
COMERICA INC	7,736	63.43	490,694.48
EAST WEST BANCORP INC	6,421	47.67	306,089.07
FIFTH THIRD BANCORP	34,171	29.83	1,019,320.93
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,106	117.69	953,995.14
HUNTINGTON BANCSHARES INC	49,512	14.14	700,099.68

JPMORGAN CHASE & CO	151,573	137.49	20,839,771.77
KEY CORP	48,707	20.02	975,114.14
M & T BANK CORP	6,180	169.53	1,047,695.40
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,684	16.35	370,883.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,213	154.48	3,276,984.24
REGIONS FINL CORP	46,000	16.54	760,840.00
SIGNATURE BANK	2,815	146.47	412,313.05
SVB FINANCIAL GROUP	2,318	270.79	627,691.22
TRUIST FINANCIAL CORP	63,869	55.31	3,532,594.39
US BANCORP	71,241	54.80	3,904,006.80
WELLS FARGO & CO	198,610	47.34	9,402,197.40
ZIONS BANCORPORATION	8,203	46.25	379,388.75
ALLY FINANCIAL INC	18,129	29.40	532,992.60
AMERICAN EXPRESS	33,560	136.58	4,583,624.80
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,178	179.72	1,110,310.16
BANK NEW YORK CO	40,579	45.83	1,859,735.57
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	62,460	228.17	14,251,498.20
BLACKROCK INC	5,530	566.92	3,135,067.60
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	31,683	62.45	1,978,603.35
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	22,472	103.54	2,326,750.88
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,031	122.83	617,957.73
CME GROUP INC	17,057	209.00	3,564,913.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,312	75.79	1,160,496.48
E*TRADE FINANCIAL CORP	10,854	54.73	594,039.42
EATON VANCE CORP	5,267	51.68	272,198.56
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,018	27.15	489,188.70
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,887	302.65	571,100.55
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	25.67	378,581.16
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,412	232.73	3,586,834.76
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	26,753	95.21	2,547,153.13
INVESCO LTD	19,405	18.03	349,872.15
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	12,843	23.72	304,635.96
KKR & CO INC -A	21,470	33.70	723,539.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,635	344.60	563,421.00
MOODY'S CORP	8,148	278.87	2,272,232.76
MORGAN STANLEY	59,098	53.75	3,176,517.50
MSCI INC	3,844	321.71	1,236,653.24
NASDAQ INC	5,565	114.49	637,136.85
NORTHERN TRUST CORP	9,149	102.70	939,602.30
PRICE T ROWE GROUP INC	11,317	137.74	1,558,803.58
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,365	101.26	543,259.90
S&P GLOBAL INC	11,737	303.41	3,561,123.17

SCHWAB (CHARLES) CORP	56,318	48.58	2,735,928.44
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	69.24	435,450.36
STATE STREET CORP	17,955	77.89	1,398,514.95
SYNCHRONY FINANCIAL	28,151	33.64	946,999.64
TD AMERITRADE HOLDING CORP	12,743	51.01	650,020.43
VOYA FINANCIAL INC	6,370	63.62	405,259.40
AFLAC	35,444	51.49	1,825,011.56
ALLEGHANY CORP	620	800.43	496,266.60
ALLSTATE CORP	15,769	123.46	1,946,840.74
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	112.30	427,076.90
AMERICAN INT'L GROUP	41,590	49.80	2,071,182.00
AON PLC	11,266	234.33	2,639,961.78
ARCH CAPITAL GROUP LTD	19,644	47.90	940,947.60
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,023	108.17	976,017.91
ASSURANT INC	2,482	141.57	351,376.74
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,517	49.75	324,220.75
BROWN & BROWN INC	10,208	48.51	495,190.08
CHUBB LTD	21,713	163.15	3,542,475.95
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,944	112.12	778,561.28
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	919	160.58	147,573.02
EVEREST RE GROUP LTD	1,724	287.93	496,391.32
FNF GROUP	12,232	44.02	538,452.64
GLOBE LIFE INC	4,553	111.16	506,111.48
HARTFORD FINANCIAL SVCS	17,456	58.08	1,013,844.48
LINCOLN NATIONAL CORP	9,779	61.03	596,812.37
LOEWS CORP	12,517	53.89	674,541.13
MARKEL CORP	609	1,341.08	816,717.72
MARSH & MCLENNAN COS	24,158	117.08	2,828,418.64
METLIFE INC	38,091	52.28	1,991,397.48
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,999	55.98	727,684.02
PROGRESSIVE CORP	27,959	80.84	2,260,205.56
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,254	93.78	1,805,640.12
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,601	153.20	398,473.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,195	196.77	431,910.15
TRAVELERS COS INC/THE	12,478	133.98	1,671,802.44
UNUM GROUP	9,797	30.12	295,085.64
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,957	209.50	1,247,991.50
WR BERKLEY CORP	6,277	78.07	490,045.39
CBRE GROUP INC-A	14,472	63.70	921,866.40
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	47,400	5.48	259,752.00
JONES LANG LASALLE INC	2,230	165.85	369,845.50
WEYERHAEUSER CO	34,135	30.87	1,053,747.45

ACCENTURE PLC-CL A	30,270	213.90	6,474,753.00
ADOBE INC	23,050	378.96	8,735,028.00
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	7,570	101.47	768,127.90
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,154	103.06	221,991.24
ANSYS INC	4,061	294.02	1,194,015.22
AUTODESK INC	10,510	206.67	2,172,101.70
AUTOMATIC DATA PROCESS	20,669	180.77	3,736,335.13
BLACK KNIGHT INC	6,389	75.01	479,238.89
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,009	74.49	447,610.41
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,223	121.38	633,967.74
CADENCE DESIGN SYSTEMS	12,649	76.97	973,593.53
CDK GLOBAL INC	5,199	51.49	267,696.51
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,591	117.54	657,166.14
CITRIX SYSTEMS INC	5,700	119.57	681,549.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	25,224	69.56	1,754,581.44
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,300	122.65	159,445.00
DOCUSIGN INC	4,516	90.31	407,839.96
DROPBOX INC-CLASS A	8,461	18.71	158,347.61
DXC TECHNOLOGY CO	12,201	30.40	370,910.40
EPAM SYSTEMS INC	2,341	238.05	557,275.05
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	29,197	156.78	4,577,505.66
FISERV INC	27,534	121.84	3,354,742.56
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,169	317.39	1,323,198.91
FORTINET INC	7,064	118.00	833,552.00
GARTNER INC	3,870	154.95	599,656.50
GLOBAL PAYMENTS INC	14,319	208.47	2,985,081.93
GODADDY INC - CLASS A	8,747	77.20	675,268.40
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,516	122.07	429,198.12
INTL BUSINESS MACHINES CORP	42,104	151.22	6,366,966.88
INTUIT INC	12,393	301.24	3,733,267.32
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,785	174.46	660,331.10
LEIDOS HOLDINGS	6,384	119.27	761,419.68
MASTERCARD INC-CLASS A	42,822	344.45	14,750,037.90
MICROSOFT CORP	343,647	184.42	63,375,379.74
MONGODB INC	2,136	178.10	380,421.60
NORTONLIFELOCK INC	30,049	20.79	624,718.71
OKTA INC	5,218	138.55	722,953.90
ORACLE CORP	110,960	55.51	6,159,389.60
PALO ALTO NETWORKS INC	4,630	249.14	1,153,518.20
PAYCHEX INC	15,554	90.23	1,403,437.42
PAYCOM SOFTWARE INC	2,192	310.33	680,243.36
PAYPAL HOLDINGS INC	53,124	122.43	6,503,971.32

PTC INC	5,381	88.38	475,572.78
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,092	243.76	753,705.92
SABRE CORP	13,846	22.25	308,073.50
SALESFORCE.COM INC	39,578	193.36	7,652,802.08
SERVICENOW INC	8,947	352.94	3,157,754.18
SPLUNK INC	7,244	173.41	1,256,182.04
SQUARE INC - A	15,395	85.70	1,319,351.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,145	64.89	723,199.05
SYNOPSYS INC	7,259	155.08	1,125,725.72
TWILIO INC - A	5,545	126.71	702,606.95
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,658	334.16	554,037.28
VERISIGN INC	5,146	209.06	1,075,822.76
VISA INC-CLASS A SHARES	81,893	211.45	17,316,274.85
VMWARE INC-CLASS A	3,606	162.20	584,893.20
WESTERN UNION CO	20,387	26.50	540,255.50
WIX.COM LTD	2,000	141.68	283,360.00
WORKDAY INC-CLASS A	7,886	190.56	1,502,756.16
AMPHENOL CORPORATION	14,273	103.71	1,480,252.83
APPLE INC	214,089	320.30	68,572,706.70
ARISTA NETWORKS INC	2,873	228.28	655,848.44
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	80.00	308,080.00
CDW CORP/DE	6,846	138.24	946,391.04
CISCO SYSTEMS	203,151	46.85	9,517,624.35
COGNEX CORP	8,111	52.75	427,855.25
CORNING	36,416	28.29	1,030,208.64
DELL TECHNOLOGIES -C	7,869	52.95	416,663.55
F5 NETWORKS INC	2,755	132.85	366,001.75
FLEX LTD	21,868	13.82	302,215.76
FLIR SYSTEMS INC	5,527	58.19	321,616.13
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	63,109	14.47	913,187.23
HP INC	71,162	22.64	1,611,107.68
IPG PHOTONICS CORP	1,782	140.87	251,030.34
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	24.32	396,610.56
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8,361	98.46	823,224.06
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,963	185.60	1,477,932.80
NETAPP INC	10,843	53.71	582,377.53
SEAGATE TECHNOLOGY	11,767	54.75	644,243.25
TE CONNECTIVITY LTD	16,121	92.92	1,497,963.32
TRIMBLE IMS HOLDINGS	10,999	46.13	507,383.87
WESTERN DIGITAL CORP	13,413	69.06	926,301.78
XEROX HOLDINGS CORP	9,091	36.78	334,366.98
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,538	242.72	616,023.36



AT&T INC	346,563	38.61	13,380,797.43
CENTURYLINK INC	43,253	13.37	578,292.61
SPRINT CORP	39,898	9.48	378,233.04
T-MOBILE US INC	16,444	99.50	1,636,178.00
VERIZON COMMUNICATIONS	196,208	58.09	11,397,722.72
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,950	35.00	348,250.00
AES CORP	32,456	20.80	675,084.80
ALLIANT ENERGY CORPORATION	10,283	59.57	612,558.31
AMEREN CORPORATION	10,875	85.66	931,552.50
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,090	102.38	2,466,334.20
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,722	137.30	1,197,530.60
ATMOS ENERGY CORP	5,099	119.23	607,953.77
CENTERPOINT ENERGY INC	22,540	25.72	579,728.80
CMS ENERGY CORP	12,638	68.59	866,840.42
CONSOLIDATED EDISON INC	15,957	94.58	1,509,213.06
DOMINION ENERGY INC	39,738	89.25	3,546,616.50
DTE ENERGY COMPANY	8,837	133.95	1,183,716.15
DUKE ENERGY CORP	35,248	101.43	3,575,204.64
EDISON INTL	16,154	77.32	1,249,027.28
ENTERGY CORP	9,586	131.45	1,260,079.70
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,225	53.50	493,537.50
EVERGY INC	11,198	73.56	823,724.88
EVERSOURCE ENERGY	15,568	95.65	1,489,079.20
EXELON CORP	46,455	49.85	2,315,781.75
FIRSTENERGY CORP	25,296	51.79	1,310,079.84
NEXTERA ENERGY INC	22,969	277.03	6,363,102.07
NISOURCE INC	16,007	30.05	481,010.35
NRG ENERGY INC	12,298	39.04	480,113.92
OGE ENERGY CORP	8,794	44.92	395,026.48
PINNACLE WEST CAPITAL	4,956	101.09	501,002.04
PPL CORPORATION	34,774	35.41	1,231,347.34
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	24,289	59.18	1,437,423.02
SEMPRA ENERGY	13,139	159.89	2,100,794.71
SOUTHERN CO	50,483	69.81	3,524,218.23
UGI CORP	8,719	41.00	357,479.00
VISTRA ENERGY CORP	18,337	22.91	420,100.67
WEC ENERGY GROUP INC	15,159	102.39	1,552,130.01
XCEL ENERGY INC	24,711	70.67	1,746,326.37
ADVANCED MICRO DEVICES	49,254	57.27	2,820,776.58
ANALOG DEVICES	17,665	124.55	2,200,175.75
APPLIED MATERIALS	44,077	66.40	2,926,712.80
BROADCOM INC	18,916	309.24	5,849,583.84

	INTEL CORP	210,133	65.45	13,753,204.85	
	KLA CORP	7,655	167.30	1,280,681.50	
	LAM RESEARCH CORP	6,913	328.49	2,270,851.37	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,494	25.13	766,314.22	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,629	62.43	788,428.47	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,465	108.13	1,239,710.45	
	MICRON TECHNOLOGY	52,644	59.00	3,105,996.00	
	NVIDIA CORP	27,485	308.70	8,484,619.50	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	13,310	134.80	1,794,188.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	19,013	20.60	391,667.80	
	QORVO INC	5,629	101.56	571,681.24	
	QUALCOMM	57,803	89.47	5,171,634.41	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,301	117.50	975,367.50	
	TERADYNE INC	7,292	67.89	495,053.88	
	TEXAS INSTRUMENTS	44,372	131.47	5,833,586.84	
	XILINX INC	12,166	89.79	1,092,385.14	
	アメリカドル 小計	14,230,547		1,364,570,514.10	(152,982,000,335)
カナダドル	CAMECO CORP	19,186	12.03	230,807.58	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	56,829	40.45	2,298,733.05	
	CENOVUS ENERGY INC	50,155	12.23	613,395.65	
	ENBRIDGE	96,373	55.41	5,340,027.93	
	HUSKY ENERGY INC	12,746	8.32	106,046.72	
	IMPERIAL OIL	11,645	32.16	374,503.20	
	INTER PIPELINE LTD	18,856	22.10	416,717.60	
	KEYERA CORP	10,963	36.18	396,641.34	
	OVINTIV INC	11,260	21.64	243,666.40	
	PARKLAND FUEL CORP	5,384	47.00	253,048.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	26,492	53.22	1,409,904.24	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,703	14.70	142,634.10	
	SUNCOR ENERGY	74,403	40.46	3,010,345.38	
	TC ENERGY CORP	44,391	76.06	3,376,379.46	
	AGNICO EAGLE MINES	11,064	68.15	754,011.60	
	BARRICK GOLD CORP	85,905	27.54	2,365,823.70	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	57.09	416,871.18	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,625	12.04	392,805.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,688	154.08	1,338,647.04	
	KINROSS GOLD CORP	60,197	7.42	446,661.74	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	12,974	46.22	599,658.28	
	LUNDIN MINING CORP	30,173	7.16	216,038.68	
	METHANEX CORP	2,991	45.61	136,419.51	
	NUTRIEN LTD	27,577	57.40	1,582,919.80	

TECK RESOURCES LTD-CL B	21,579	17.09	368,785.11
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,615	61.15	159,907.25
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	20,043	43.03	862,450.29
BOMBARDIER B	104,404	1.40	146,165.60
CAE INC	11,940	40.34	481,659.60
WSP GLOBAL INC	5,400	94.88	512,352.00
THOMSON REUTERS CORP	9,046	108.36	980,224.56
AIR CANADA	6,737	44.45	299,459.65
CANADIAN NATL RAILWAY CO	34,237	124.14	4,250,181.18
CP RAILWAY LIMITED	6,333	358.30	2,269,113.90
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,428	69.63	1,004,621.64
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	36.92	369,200.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,911	88.03	1,136,555.33
STARS GROUP INC/THE	9,180	33.42	306,795.60
QUEBECOR INC -CL B	11,279	33.13	373,673.27
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,409	25.74	551,067.66
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,526	149.53	377,712.78
DOLLARAMA INC	12,978	40.83	529,891.74
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	42,069	44.21	1,859,870.49
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	31.68	232,214.40
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	69.92	634,034.56
METRO INC	11,606	55.05	638,910.30
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	110.91	410,921.55
SAPUTO INC	10,742	41.27	443,322.34
AURORA CANNABIS INC	30,000	2.23	66,900.00
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	34.94	508,167.36
CANOPY GROWTH CORP	8,800	29.59	260,392.00
CRONOS GROUP INC	8,200	9.72	79,704.00
BANK MONTREAL	30,524	101.25	3,090,555.00
BANK NOVA SCOTIA	58,767	74.63	4,385,781.21
CANADIAN IMPERIAL BANK	21,347	109.24	2,331,946.28
NATIONAL BANK OF CANADA	16,271	74.69	1,215,280.99
ROYAL BANK OF CANADA	68,673	108.00	7,416,684.00
TORONTO-DOMINION BANK	87,325	75.98	6,634,953.50
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	43,240	90.52	3,914,084.80
CI FINANCIAL CORP	9,872	25.46	251,341.12
IGM FINANCIAL INC	3,890	40.36	157,000.40
ONEX CORP	3,102	85.99	266,740.98
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,189	632.67	752,244.63
GREAT-WEST LIFE CO INC	11,567	34.40	397,904.80
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	70.64	382,515.60
INTACT FINANCIAL CORP	6,633	154.71	1,026,191.43

	MANULIFE FINANCIAL CORP	93,725	26.59	2,492,147.75	
	POWER CORP OF CANADA	26,652	34.29	913,897.08	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	26,701	65.65	1,752,920.65	
	BLACKBERRY LIMITED	25,075	8.16	204,612.00	
	CGI INC - CL A	10,929	100.21	1,095,195.09	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	975	1,457.08	1,420,653.00	
	OPEN TEXT CORP	13,214	62.76	829,310.64	
	SHOPIFY INC - CLASS A	4,803	711.04	3,415,125.12	
	BCE INC	7,663	64.87	497,098.81	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	17,504	66.00	1,155,264.00	
	TELUS CORP	11,560	52.01	601,235.60	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,086	21.94	572,326.84	
	ALTAGAS INCOME LTD	14,516	22.48	326,319.68	
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	54.40	237,836.80	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	42.24	252,510.72	
	EMERA INC	11,783	59.94	706,273.02	
	FORTIS INC	19,700	58.34	1,149,298.00	
	HYDRO ONE LTD	14,740	29.00	427,460.00	
	カナダドル 小計	1,894,782		96,849,670.88	(8,193,482,156)
ユーロ	ENI	122,760	12.90	1,583,604.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	14.54	345,036.49	
	NESTE OIL OYJ	19,663	38.91	765,087.33	
	OMV AG	5,641	43.89	247,583.49	
	REPSOL SA	65,374	12.29	803,773.33	
	TENARIS SA	19,529	9.81	191,579.49	
	TOTAL SA	114,130	44.75	5,107,317.50	
	VOPAK	3,661	50.20	183,782.20	
	AIR LIQUIDE	22,602	138.50	3,130,377.00	
	AKZO NOBEL	10,923	85.50	933,916.50	
	ARCELORMITTAL	30,928	15.33	474,188.09	
	ARKEMA	3,446	86.50	298,079.00	
	BASF SE	43,808	61.40	2,689,811.20	
	COVESTRO AG	8,327	41.18	342,905.86	
	CRH PLC	36,044	34.87	1,256,854.28	
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	26.54	254,863.62	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	40.40	131,138.40	
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,759	61.44	415,272.96	
	KONINKLIJKE DSM NV	8,697	115.10	1,001,024.70	
	LANXESS	3,921	56.54	221,693.34	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,350	34.20	353,970.00	
	SOLVAY SA	3,676	95.66	351,646.16	

STORA ENSO OYJ R	23,291	12.19	284,033.74
SYMRISE AG	6,316	98.36	621,241.76
THYSSEN KRUPP	18,959	9.80	185,911.95
UMICORE	9,946	44.57	443,293.22
UPM KYMMENE OYJ	23,447	30.63	718,181.61
VOESTALPINE AG	5,948	22.47	133,651.56
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,774	30.77	331,515.98
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	10,774	0.45	4,907.55
AIRBUS SE	28,211	131.78	3,717,645.58
ALSTOM	9,679	46.65	451,525.35
ANDRITZ AG	3,617	34.84	126,016.28
BOUYGUES ORD	11,344	41.20	467,372.80
BRENTAG AG	7,062	49.33	348,368.46
CNH INDUSTRIAL NV	43,124	8.79	379,232.45
DASSAULT AVIATION SA	121	1,065.00	128,865.00
EIFFAGE	3,707	110.05	407,955.35
FERROVIAL SA	26,165	29.76	778,670.40
GEA GROUP AG	7,649	27.90	213,407.10
HOCHTIEF AG	998	108.40	108,183.20
KINGSPAN GROUP PLC	7,126	63.60	453,213.60
KION GROUP AG	3,430	58.60	200,998.00
KNORR-BREMSE AG	1,738	98.39	171,001.82
KONE OYJ-B	17,409	54.90	955,754.10
LEGRAND SA	12,078	77.24	932,904.72
LEONARDO SPA	22,011	11.05	243,221.55
METSO OYJ	4,950	33.05	163,597.50
MTU AERO ENGINES AG	2,433	264.10	642,555.30
PRYSMIAN SPA	11,275	24.08	271,502.00
SAFRAN SA	15,664	145.55	2,279,895.20
SAINT-GOBAIN	22,629	35.78	809,665.62
SCHNEIDER ELECTRIC SE	25,207	102.90	2,593,800.30
SIEMENS	36,734	106.24	3,902,620.16
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	16.07	198,076.15
THALES SA	4,691	96.98	454,933.18
VINCI S.A.	24,504	105.20	2,577,820.80
WARTSILA OYJ	18,738	10.61	198,810.18
BUREAU VERITAS SA	13,374	24.82	331,942.68
EDENRED	10,133	49.77	504,319.41
RANDSTAD NV	5,866	54.82	321,574.12
TELEPERFORMANCE	2,616	241.00	630,456.00
WOLTERS KLUWER	12,729	70.06	891,793.74
ADP	1,532	166.50	255,078.00

AENA SME SA	3,518	167.95	590,848.10
ATLANTIA SPA	21,349	22.07	471,172.43
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,748	15.01	146,366.22
DEUTSCHE POST AG-REG	48,564	32.28	1,567,888.74
FRAPORT AG	1,934	69.34	134,103.56
GETLINK	18,631	16.75	312,069.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,965	65.31	1,042,674.15
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	51.90	134,005.80
CONTINENTAL AG	4,832	112.70	544,566.40
DAIMLER AG	43,491	43.74	1,902,513.79
FAURECIA	3,558	45.84	163,098.72
FERRARI NV	5,923	164.15	972,260.45
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	50,762	12.27	623,154.31
MICHELIN	7,746	110.35	854,771.10
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,157	26.97	166,054.29
PEUGEOT SA	26,059	19.43	506,456.66
PIRELLI & C SPA	20,549	4.84	99,559.90
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	7,141	64.16	458,166.56
RENAULT SA	8,523	32.66	278,361.18
VALEO SA	10,585	27.55	291,616.75
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,907	169.44	1,509,202.08
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	170.45	282,435.65
ADIDAS AG	8,614	285.00	2,454,990.00
ESSILORLUXOTTICA	13,599	141.40	1,922,898.60
HERMES INTERNATIONAL	1,552	699.80	1,086,089.60
KERING	3,636	566.50	2,059,794.00
LVMH	13,235	409.80	5,423,703.00
MONCLER SPA	7,343	38.25	280,869.75
PUMA SE	3,490	80.45	280,770.50
SEB SA	1,191	117.20	139,585.20
ACCOR	7,846	38.99	305,915.54
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	3,702	108.00	399,816.00
SODEXO	3,785	101.45	383,988.25
ALTICE NV -A	27,649	6.49	179,497.30
BOLLORE	37,200	3.74	139,351.20
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,675	12.99	112,688.25
JC DECAUX SA	3,750	22.86	85,725.00
PUBLICIS GROUPE	9,131	41.75	381,219.25
SES	16,206	10.70	173,404.20
TELENET GROUP HOLDING NV	2,831	39.60	112,107.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,479	74.84	260,368.36
VIVENDI	41,830	24.92	1,042,403.60

DELIVERY HERO SE	4,800	78.16	375,168.00
INDITEX	53,773	31.58	1,698,151.34
JUST EAT TAKEAWAY	5,500	89.85	494,175.00
PROSUS	23,267	71.47	1,662,892.49
ZALANDO SE	7,076	47.51	336,180.76
CARREFOUR	30,831	16.12	497,149.87
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	35.81	118,101.38
COLRUYT SA	2,228	46.13	102,777.64
JERONIMO MARTINS	13,062	16.87	220,355.94
KONINKLIJKE AHOLD NV	56,607	23.56	1,333,660.92
METRO AG	8,880	12.20	108,336.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	36,314	67.48	2,450,468.72
DANONE (GROUPE)	29,636	71.46	2,117,788.56
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	26,648	8.52	227,040.96
HEINEKEN HOLDING NV	4,955	93.55	463,540.25
HEINEKEN NV	12,404	104.00	1,290,016.00
KERRY GROUP PLC-A	7,519	123.90	931,604.10
PERNOD-RICARD	9,782	165.35	1,617,453.70
REMY COINTREAU	1,020	103.10	105,162.00
BEIERSDORF AG	4,768	107.05	510,414.40
HENKEL AG & CO KGAA	4,514	84.45	381,207.30
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	7,927	93.04	737,528.08
LOREAL	12,000	265.70	3,188,400.00
UNILEVER NV	69,738	54.05	3,769,338.90
BIOMERIEUX	1,835	95.15	174,600.25
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	110.40	230,846.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,583	77.58	743,449.14
FRESENIUS SE&CO KGAA	18,774	49.74	933,818.76
KONINKLIJKE PHILIPS	43,154	44.38	1,915,174.52
SARTORIUS AG-VORZUG	1,793	239.40	429,244.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,294	40.32	253,805.55
BAYER	44,452	74.66	3,318,786.32
EUROFINS SCIENTIFIC	389	477.00	185,553.00
GALAPAGOS NV	1,800	242.70	436,860.00
GRIFOLS SA	14,240	33.91	482,878.40
IPSEN	1,866	66.35	123,809.10
MERCK KGAA	6,193	122.75	760,190.75
ORION OYJ-CLASS B	5,393	38.45	207,360.85
QIAGEN N.V.	11,006	34.20	376,405.20
RECORDATI SPA	5,195	41.00	212,995.00
SANOFI	53,694	93.50	5,020,389.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,200	186.70	224,040.00

UCB (GROUPE)	6,228	92.28	574,719.84
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	15.00	295,770.00
AIB GROUP PLC	37,786	2.27	85,774.22
BANCO BILBAO VIZCAYA	326,492	5.10	1,666,415.16
BANCO DE SABADELL SA	291,051	0.86	251,933.74
BANCO SANTANDER SA	798,951	3.84	3,075,162.39
BANK OF IRELAND GROUP PLC	46,790	3.97	186,130.62
BANKIA SA	59,546	1.70	101,645.02
BANKINTER SA	24,407	6.13	149,712.53
BNP PARIBAS	53,894	53.26	2,870,394.44
CAIXABANK	152,587	2.70	411,984.90
COMMERZBANK AG	46,733	6.75	315,447.75
CREDIT AGRICOLE SA	51,640	13.15	679,324.20
ERSTE GROUP BANK AG	14,009	34.78	487,233.02
FINECOBANK SPA	28,289	11.09	313,725.01
ING GROEP NV-CVA	191,659	10.05	1,926,556.26
INTESA SANPAOLO	718,556	2.55	1,832,317.80
KBC GROEP NV	12,075	70.14	846,940.50
MEDIOBANCA	29,447	9.59	282,396.73
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	22.05	173,445.30
SOCIETE GENERALE	39,271	31.22	1,226,040.62
UNICREDIT SPA	97,609	13.71	1,339,000.26
AMUNDI SA	2,812	77.10	216,805.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	87,471	9.86	862,988.88
DEUTSCHE BOERSE	9,148	154.40	1,412,451.20
EURAZEO SA	2,340	65.30	152,802.00
EXOR NV	4,379	73.34	321,155.86
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,728	93.66	349,164.48
NATIXIS	40,748	4.33	176,561.08
WENDEL	1,047	124.80	130,665.60
AEGON	76,385	3.71	283,464.73
AGEAS	7,693	48.78	375,264.54
ALLIANZ SE-REG	20,297	228.00	4,627,716.00
ASSICURAZIONI GENERALI	51,245	18.59	952,900.77
AXA	92,689	24.48	2,269,490.16
CNP ASSURANCES	8,406	16.15	135,756.90
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	189.90	565,142.40
MAPFRE SA	56,454	2.37	134,078.25
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,914	274.50	1,897,893.00
NN GROUP NV	14,216	37.41	531,820.56
POSTE ITALIANE SPA	25,777	11.28	290,893.44
SAMPO OYJ-A SHS	19,591	41.20	807,149.20



SCOR SE	6,580	36.77	241,946.60
AROUNDTOWN SA	51,069	8.70	444,606.71
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,109	38.72	623,740.48
VONOVIA SE	25,426	53.36	1,356,731.36
ADYEN NV	508	869.80	441,858.40
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	20,473	71.62	1,466,276.26
ATOS SE	4,174	74.72	311,881.28
CAPGEMINI SA	7,143	113.35	809,659.05
DASSAULT SYSTEMES SA	6,434	155.75	1,002,095.50
SAP SE	46,717	127.80	5,970,432.60
WIRECARD AG	5,219	135.40	706,652.60
WORLDLINE SA	4,377	75.45	330,244.65
INGENICO GROUP	3,351	139.60	467,799.60
NOKIA OYJ	251,415	3.80	957,639.73
CELLNEX TELECOM SA	11,952	48.36	577,998.72
DEUTSCHE TELEKOM	159,274	16.62	2,648,089.52
ELISA A	8,257	57.82	477,419.74
ILIAD SA	637	136.10	86,695.70
KPN (KON.)	173,861	2.53	441,085.35
ORANGE	96,916	13.44	1,302,551.04
PROXIMUS	7,531	26.16	197,010.96
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.51	252,073.81
TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.50	175,018.42
TELEFONICA	221,869	6.29	1,395,556.01
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.60	106,653.31
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	32.05	188,742.45
E.ON SE	108,520	11.24	1,219,764.80
ELECTRICITE DE FRANCE	24,433	13.40	327,524.36
ENAGAS	11,944	25.61	305,885.84
ENDESA	12,358	25.82	319,083.56
ENEL	389,648	8.43	3,285,901.58
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	118,885	4.87	579,445.49
ENGIE	88,520	16.48	1,458,809.60
FORTUM OYJ	19,008	22.08	419,696.64
IBERDROLA SA	294,624	11.03	3,251,175.84
NATURGY ENERGY GROUP SA	14,147	24.28	343,489.16
RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,346	19.55	339,201.03
RWE STAMM	28,435	34.05	968,211.75
SNAM SPA	91,077	5.01	456,660.07
SUEZ	17,194	15.84	272,352.96
TERNA SPA	66,644	6.67	445,048.63
UNIPER SE	8,984	29.54	265,387.36

	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,851	28.87	717,448.37
	VERBUND AG	3,100	48.32	149,792.00
	ASML HOLDING NV	20,205	287.70	5,812,978.50
	INFINEON TECHNOLOGIES	60,232	21.72	1,308,540.20
	STMICROELECTRONICS	35,439	28.71	1,017,453.69
	ユーロ 小計	9,385,082		203,793,214.29 (24,644,713,404)
イギリスポンド	BP PLC	969,629	4.66	4,520,410.39
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	203,673	19.26	3,924,371.36
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	177,963	19.21	3,418,669.23
	ANGLO AMERICAN PLC	50,063	21.22	1,062,587.17
	ANTOFAGASTA PLC	16,971	8.56	145,305.70
	BHP GROUP PLC	101,259	16.77	1,698,315.94
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,497	51.00	280,347.00
	EVRAZ PLC	16,686	3.87	64,691.62
	GLENCORE PLC	520,278	2.28	1,191,176.48
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,385	27.78	232,935.30
	MONDI PLC	22,326	16.96	378,760.59
	RIO TINTO PLC REG	53,966	42.09	2,271,698.77
	ASHTED GROUP PLC	22,351	27.74	620,016.74
	BAE SYSTEMS PLC	144,528	6.56	948,681.79
	BUNZL PLC	14,890	19.27	287,004.75
	DCC PLC	4,508	62.62	282,290.96
	FERGUSON PLC	10,326	75.80	782,710.80
	MEGGITT PLC	31,622	6.12	193,526.64
	MELROSE INDUSTRIES PLC	238,890	2.44	583,847.16
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	84,095	6.64	558,895.37
	SMITHS GROUP PLC	20,046	17.57	352,208.22
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	94.15	345,718.80
	WEIR GROUP PLC/THE	12,587	13.67	172,064.29
	EXPERIAN PLC	45,181	28.69	1,296,242.89
	G4S PLC	77,964	2.04	159,748.23
	INTERTEK GROUP PLC	7,061	58.86	415,610.46
	RELX PLC	93,206	20.82	1,940,548.92
	RENTOKIL INITIAL PLC	84,919	5.03	427,312.40
	EASYJET PLC	9,909	15.17	150,319.53
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	8.63	440,144.05
	BURBERRY GROUP PLC	18,236	19.20	350,131.20
	PERSIMMON PLC	13,492	32.61	439,974.12
	TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	2.30	382,076.44
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	53.52	350,556.00
	CARNIVAL PLC	8,185	30.62	250,624.70

COMPASS GROUP PLC	76,230	19.48	1,485,341.55
GVC HOLDINGS PLC	33,300	8.50	283,050.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	7,472	51.21	382,641.12
TUI AG-DI	17,558	8.53	149,839.97
WHITBREAD PLC	6,780	47.32	320,829.60
AUTO TRADER GROUP PLC	42,371	5.69	241,260.47
INFORMA PLC	54,925	7.79	428,305.15
ITV PLC	154,979	1.31	204,339.81
PEARSON	33,153	5.84	193,613.52
WPP PLC	56,653	9.84	557,578.82
JD SPORTS FASHION PLC	22,866	8.67	198,339.68
KINGFISHER PLC	90,095	2.19	197,308.05
MARKS & SPENCER GROUP PLC	82,369	1.86	153,412.26
NEXT PLC	6,461	71.26	460,410.86
OCADO GROUP PLC	23,500	11.45	269,075.00
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	1.86	208,305.66
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.09	171,417.62
TESCO	471,556	2.54	1,201,996.24
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,323	26.34	403,607.82
BRITISH AMERICAN TOBACCO	109,348	33.43	3,656,050.38
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	28.06	255,766.90
DIAGEO	112,779	31.23	3,522,088.17
IMPERIAL BRANDS PLC	45,832	17.09	783,268.88
RECKITT BENCKISER PLC	33,980	64.92	2,205,981.60
UNILEVER PLC	52,997	45.96	2,435,742.12
NMC HEALTH PLC	4,750	8.57	40,726.50
SMITH & NEPHEW PLC	39,534	19.79	782,377.86
ASTRAZENECA	62,441	75.74	4,729,281.34
GLAXOSMITHKLINE	237,596	16.50	3,920,334.00
BARCLAYS	781,080	1.81	1,416,254.25
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	960,194	5.59	5,374,205.81
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,358,638	0.56	1,899,309.78
ROYAL BANK OF SCOTLAND	205,762	2.07	427,367.67
STANDARD CHARTERED PLC	125,164	6.21	777,518.76
3I GROUP PLC	42,422	11.74	498,034.28
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,976	17.10	204,789.60
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	15,221	84.16	1,280,999.36
M&G PLC	112,358	2.49	280,670.28
SCHRODERS PLC	5,525	33.87	187,131.75
ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	11.68	312,183.04
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	105,646	3.25	343,560.79
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	22.98	226,858.56

	AVIVA PIC	181,949	4.06	739,076.83
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	3.36	231,359.52
	LEGAL & GENERAL GROUP	269,808	3.14	849,625.39
	PRUDENTIAL	124,358	15.00	1,865,370.00
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	51,693	5.70	295,063.64
	AVEVA GROUP PLC	3,423	49.92	170,876.16
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,136	7.96	120,603.64
	SAGE GROUP PLC	46,955	7.79	365,779.45
	HALMA PLC	16,936	22.17	375,471.12
	BT GROUP PLC	382,244	1.56	596,759.33
	VODAFONE GROUP PLC	1,281,443	1.55	1,986,236.65
	CENTRICA PLC	239,385	0.78	186,720.30
	NATIONAL GRID PLC	166,381	10.57	1,758,647.17
	SEVERN TRENT PLC	11,927	26.83	320,001.41
	SSE PLC	45,896	16.76	769,216.96
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.46	363,302.94
	イギリスポンド 小計	14,115,486		84,984,809.40 (12,275,205,869)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	23.37	204,440.76
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	408	636.00	259,488.00
	GIVAUDAN-REG	442	3,387.00	1,497,054.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	23,593	49.08	1,157,944.44
	SIKA AG-BR	5,812	187.75	1,091,203.00
	ABB LTD	89,364	23.90	2,135,799.60
	GEBERIT AG-REG	1,662	537.40	893,158.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	227.40	207,161.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	234.40	473,722.40
	ADECCO GROUP AG-REG	6,618	58.42	386,623.56
	SGS SA	261	2,644.00	690,084.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,431	158.85	386,164.35
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	24,901	72.22	1,798,350.22
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,228	247.20	303,561.60
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	47.70	143,290.80
	DUFREY AG-REG	1,811	84.50	153,029.50
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	149	2,222.00	331,078.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	93,500.00	467,500.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	48	8,600.00	412,800.00
	NESTLE SA - REGISTERED	141,068	109.36	15,427,196.48
	ALCON INC	19,922	62.17	1,238,550.74
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,672	256.40	685,100.80
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	480	1,039.50	498,960.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,566	420.40	1,499,146.40

	NOVARTIS	101,888	94.56	9,634,529.28
	ROCHE HOLDING GENUSS	33,316	345.65	11,515,675.40
	VIFOR PHARMA AG	2,126	181.15	385,124.90
	CREDIT SUISSE GROUP AG	124,429	13.56	1,687,879.38
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,752	48.36	519,966.72
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	79.90	182,891.10
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	841	958.00	805,678.00
	UBS GROUP AG	183,875	13.02	2,394,971.87
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	177.60	414,518.40
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,587	512.60	813,496.20
	SWISS RE LTD	14,081	107.30	1,510,891.30
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,220	434.30	3,135,646.00
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	123.00	445,506.00
	TEMENOS AG - REG	2,930	159.65	467,774.50
	SWISSCOM	1,253	574.40	719,723.20
	スイスフラン 小計	833,668		66,975,681.10 (7,631,209,104)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,250	312.90	2,894,325.00
	BOLIDEN AB	13,081	230.90	3,020,402.90
	ALFA LAVAL AB	14,233	252.70	3,596,679.10
	ASSA ABLOY AB-B	48,306	246.50	11,907,429.00
	ATLAS COPCO A	32,478	368.20	11,958,399.60
	ATLAS COPCO B	18,786	323.90	6,084,785.40
	EPIROC AB-A	26,536	119.70	3,176,359.20
	EPIROC AB-B	21,132	116.20	2,455,538.40
	SANDVIK AB	54,851	183.20	10,048,703.20
	SKANSKA B	13,987	237.70	3,324,709.90
	SKF AB-B	18,340	191.15	3,505,691.00
	VOLVO B	71,585	173.45	12,416,418.25
	SECURITAS B	15,577	149.30	2,325,646.10
	ELECTROLUX AB-SER B	8,955	219.20	1,962,936.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	72.54	1,584,346.14
	HENNES & MAURITZ B	38,673	203.90	7,885,424.70
	ICA GRUPPEN AB	4,719	393.40	1,856,454.60
	SWEDISH MATCH AB	8,284	618.00	5,119,512.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,112	316.20	9,205,214.40
	NORDEA BANK ABP	154,985	86.38	13,387,604.30
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	78,404	104.05	8,157,936.20
	SVENSKA HANDELSBK A	73,908	110.95	8,200,092.60
	SWEDBANK AB-A	39,241	161.90	6,353,117.90
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	252.60	2,180,190.60
	INVESTOR AB-B SHS	21,801	563.60	12,287,043.60

	KINNEVIK AB - B	11,182	230.10	2,572,978.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,360	441.80	1,042,648.00	
	ERICSSON (LM) B	146,947	87.50	12,857,862.50	
	HEXAGON AB-B SHS	12,400	573.20	7,107,680.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,759	458.00	2,179,622.00	
	TELE2 AB-B SHS	24,520	154.10	3,778,532.00	
	TELIA CO AB	133,145	42.34	5,637,359.30	
	スウェーデンクローナ 小計	1,182,009		190,071,642.09 (2,170,618,152)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	5,500	256.50	1,410,750.00	
	EQUINOR ASA	51,412	160.40	8,246,484.80	
	NORSK HYDRO	61,358	29.96	1,838,285.68	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,407	384.50	2,847,991.50	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	252.00	1,185,912.00	
	MOWI ASA	18,884	226.60	4,279,114.40	
	ORKLA	33,665	87.14	2,933,568.10	
	DNB ASA	43,059	177.00	7,621,443.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	206.80	2,306,440.40	
	TELENOR ASA	32,710	162.55	5,317,010.50	
	ノルウェークローネ 小計	269,854		37,987,000.38 (456,983,614)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	546.20	2,902,506.80	
	NOVOZYMES A/S	9,595	376.00	3,607,720.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	9,608	717.20	6,890,857.60	
	ISS A/S	6,102	164.95	1,006,524.90	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	199	7,715.00	1,535,285.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	270	8,228.00	2,221,560.00	
	DSV PANALPINA A S	9,845	782.40	7,702,728.00	
	PANDORA A/S	5,549	335.50	1,861,689.50	
	CARLSBERG AS-B	5,005	1,027.50	5,142,637.50	
	COLOPLAST-B	5,071	980.00	4,969,580.00	
	DEMANT A/S	4,463	232.50	1,037,647.50	
	GENMAB A/S	3,194	1,698.00	5,423,412.00	
	H LUNDBECK A/S	3,647	268.50	979,219.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	84,236	442.65	37,287,065.40	
	DANSKE BANK A/S	32,879	122.25	4,019,457.75	
	TRYG A/S	5,192	209.60	1,088,243.20	
ORSTED A/S	8,810	761.00	6,704,410.00		
	デンマーククローネ 小計	198,979		94,380,544.65 (1,528,021,017)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,821	34.70	444,888.70	
	OIL SEARCH LTD	70,127	6.38	447,410.26	

ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	7.97	700,427.51
SANTOS	83,906	8.07	677,121.42
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,845	23.07	111,774.15
WOODSIDE PETROLEUM LTD	41,887	33.25	1,392,742.75
WORLEY LTD	14,417	14.40	207,604.80
ALUMINA LIMITED	118,688	2.21	262,300.48
BHP GROUP LTD	140,494	38.52	5,411,828.88
BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	14.01	301,901.49
BORAL LIMITED	42,845	4.83	206,941.35
FORTESCUE METALS GROUP LTD	57,536	11.34	652,458.24
INCITEC PIVOT LTD	81,242	3.05	247,788.10
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	20,708	30.39	629,316.12
NEWCREST MINING LIMITED	35,104	28.31	993,794.24
ORICA LTD	19,570	21.50	420,755.00
RIO TINTO LTD	16,920	98.14	1,660,528.80
SOUTH32 LTD	216,184	2.61	564,240.24
CIMIC GROUP LIMITED	2,943	27.19	80,020.17
BRAMBLES LTD	73,383	12.95	950,309.85
SEEK LTD	17,113	23.16	396,337.08
AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	5.54	518,566.16
QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	6.67	266,453.16
TRANSURBAN GROUP	130,980	16.26	2,129,734.80
ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,733	37.69	969,876.77
CROWN RESORTS LTD	18,801	11.90	223,731.90
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,988	39.47	117,936.36
TABCORP HOLDINGS LTD	90,583	4.27	386,789.41
REA GROUP LTD	3,000	113.96	341,880.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,021	4.78	176,960.38
WESFARMERS LTD	54,617	46.94	2,563,721.98
COLES GROUP LTD	50,229	16.15	811,198.35
WOOLWORTHS GROUP LTD	60,668	43.60	2,645,124.80
COCA-COLA AMATIL LIMITED	22,146	13.07	289,448.22
TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	12.13	418,242.40
COCHLEAR LIMITED	2,908	242.35	704,753.80
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,186	79.37	649,722.82
SONIC HEALTHCARE LTD	19,089	31.29	597,294.81
CSL LIMITED	21,604	338.68	7,316,842.72
AUST AND NZ BANKING GROUP	135,798	27.03	3,670,619.94
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	23,879	10.00	238,790.00
COMMONWEALTH BANK OF AUST	85,315	87.85	7,494,922.75
NATIONAL AUSTRALIA BANK	138,092	27.40	3,783,720.80
WESTPAC BANKING	166,857	25.69	4,286,556.33

	AMP LTD	182,052	2.05	373,206.60
	ASX LTD	8,927	81.47	727,282.69
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,531	10.38	316,911.78
	MACQUARIE GROUP LIMITED	15,592	151.77	2,366,397.84
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,690	71.90	481,011.00
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	6.67	763,748.35
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	2.92	377,415.84
	QBE INSURANCE GROUP	65,230	15.11	985,625.30
	SUNCORP GROUP LIMITED	58,518	12.33	721,526.94
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	17.40	382,278.00
	WISETECH GLOBAL LTD	10,764	18.88	203,224.32
	TELSTRA CORP	186,467	3.79	706,709.93
	TPG TELECOM LTD	22,697	8.10	183,845.70
	AGL ENERGY LTD	32,928	21.13	695,768.64
	AUSNET SERVICES	47,066	1.76	83,071.49
	オーストラリアドル 小計	3,379,880		66,731,402.71 (4,952,137,395)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	49,092	5.59	274,424.28
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,114	8.60	422,380.40
	A2 MILK CO LTD	28,382	16.58	470,573.56
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	26,518	25.20	668,253.60
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	16.94	372,680.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	66,673	4.84	322,697.32
	MERCURY NZ LTD	15,053	5.46	82,189.38
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	5.64	361,471.93
	ニュージーランドドル 小計	320,866		2,974,670.47 (211,320,590)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	134,948	69.95	9,439,612.60
	NWS HOLDINGS LTD	73,500	10.12	743,820.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	73,000	70.00	5,110,000.00
	MTR CORP	68,000	44.65	3,036,200.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	47,000	21.25	998,750.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	112,000	57.35	6,423,200.00
	SANDS CHINA LTD	104,600	39.85	4,168,310.00
	SJM HOLDINGS LTD	150,000	9.32	1,398,000.00
	WYNN MACAU LTD	60,800	17.32	1,053,056.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	53,600	24.85	1,331,960.00
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	24,000	31.00	744,000.00
	WH GROUP LTD	516,000	8.65	4,463,400.00
	BANK EAST ASIA	46,964	17.28	811,537.92
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	162,500	27.65	4,493,125.00
	HANG SENG BANK	33,700	164.40	5,540,280.00



	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	58,600	271.40	15,904,040.00	
	AIA GROUP LTD	578,000	79.65	46,037,700.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	131,948	50.75	6,696,361.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	72,000	18.06	1,300,320.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	56,761	36.45	2,068,938.45	
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	22.95	849,150.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	305,000	10.18	3,104,900.00	
	SINO LAND CO	128,600	10.92	1,404,312.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,000	113.70	9,096,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	73.70	1,474,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	40,600	24.85	1,008,910.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	61,000	41.15	2,510,150.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	40,000	48.20	1,928,000.00	
	PCCW LTD	212,000	4.80	1,017,600.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	54.75	1,752,000.00	
	CLP HOLDINGS	72,500	82.35	5,970,375.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	515,457	15.14	7,804,018.98	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	59,000	56.55	3,336,450.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	98.55	1,153,035.00	
	香港ドル 小計	4,172,778		164,171,511.95 (2,364,069,772)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	57,500	6.70	385,250.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	2.02	125,240.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	4.27	319,396.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	117,400	1.04	122,096.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	113,900	2.05	233,495.00	
	SINGAPORE AIRLINES	17,500	8.55	149,625.00	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	14,600	4.51	65,846.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.88	281,336.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	84,550	2.01	169,945.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,600	29.15	134,090.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	76,800	4.04	310,272.00	
	DBS GROUP	87,800	25.10	2,203,780.00	
	OCBC BANK	160,050	11.04	1,766,952.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	58,100	25.87	1,503,047.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.26	393,550.00	
	CAPITALAND LTD	118,900	3.73	443,497.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	10.88	239,360.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	8.13	201,624.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	16.92	241,956.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	408,180	3.13	1,277,603.40	
		1,879,980		10,567,960.90	

シンガポールドル 小計				(846,176,629)
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	12.98	369,722.32
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	547.30	683,030.40
	BANK HAPOLIM BM	46,803	28.60	1,338,565.80
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	23.93	1,691,659.56
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	15.32	983,957.64
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	92.32	579,031.04
	AZRIELI GROUP	1,471	278.40	409,526.40
	NICE LTD	3,165	612.00	1,936,980.00
イスラエルシェケル 小計		222,362		7,992,473.16 (261,433,797)
合 計		52,086,273		218,517,371,834 (218,517,371,834)

## (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	54,789	626,238.27		
		LENDLEASE GROUP	27,483	511,183.80		
		SYDNEY AIRPORT	53,915	447,494.50		
	オーストラリアドル 小計		136,187		1,584,916.57 (117,616,658)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000		1,023,100.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000		2,220,000.00	
	香港ドル 小計		315,000		3,243,100.00 (46,700,640)	
	投資信託受益証券合計			451,187		164,317,298 (164,317,298)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	23,507	461,207.34		
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,697	961,197.84		
		AMERICAN TOWER CORPORATION	21,254	5,261,215.16		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	746,581.50		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,110	1,615,036.50		
		BOSTON PROPERTIES	6,944	1,020,212.48		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,103	491,129.10		
		CROWN CASTLE INTL CORP	20,231	3,378,374.69		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,268	1,263,228.40		
		DUKE REALTY CORP	15,871	613,731.57		
		EQUINIX INC	4,131	2,678,499.09		
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	693,897.12		
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,153	1,568,419.20		

ESSEX PROPERTY TRUST	2,962	965,937.82		
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,625	603,618.75		
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,090	394,438.50		
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,568	916,140.72		
HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,932	565,771.76		
INVITATION HOMES INC	27,833	877,852.82		
IRON MOUNTAIN INC	12,039	413,298.87		
KIMCO REALTY CORP	17,599	333,677.04		
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	21,857	527,627.98		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,069	748,691.30		
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,300	424,276.00		
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9,317	415,072.35		
PROLOGIS INC	35,032	3,466,416.40		
PUBLIC STORAGE	7,836	1,742,569.68		
REALTY INCOME CORP	14,473	1,185,483.43		
REGENCY CENTERS CORP	6,825	437,209.50		
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,697	1,664,264.61		
SIMON PROPERTY GROUP	14,926	2,097,550.78		
SL GREEN REALTY CORP	4,007	377,299.12		
SUN COMMUNITIES INC	4,728	815,580.00		
UDR INC	14,820	751,818.60		
VENTAS INC	18,598	1,160,515.20		
VEREIT INC	55,232	553,424.64		
VICI PROPERTIES INC	19,819	557,508.47		
VORNADO REALTY TRUST	7,639	491,034.92		
WELLTOWER INC	18,410	1,620,448.20		
WP CAREY INC	7,387	626,786.95		
アメリカドル 小計	621,971	45,487,044.40	(5,099,552,547)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,489	148,568.41	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	7,000	153,580.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,812	169,364.16	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	247,060.90	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,942	91,878.66	
カナダドル 小計	29,188	810,452.13	(68,564,250)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	
	COVIVIO(FP)	1,902	209,980.80	
	GECINA SA	1,960	356,328.00	
	ICADE	1,843	191,672.00	
	KLEPIERRE	8,356	259,788.04	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,283	788,516.50	

	ユーロ 小計		1,625,928	1,806,285.34 (218,434,086)	
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC		39,175	222,278.95	
	LAND SECURITIES GROUP PLC		32,132	310,909.23	
	SEGRO PLC		50,186	461,711.20	
	イギリスポンド 小計		121,493	994,899.38 (143,703,266)	
オーストラ リアドル	DEXUS		47,933	643,260.86	
	GOODMAN GROUP		73,073	1,203,512.31	
	GPT GROUP		84,564	525,142.44	
	MIRVAC GROUP		176,235	595,674.30	
	SCENTRE GROUP		228,183	851,122.59	
	STOCKLAND		121,481	658,427.02	
	VICINITY CENTERS		163,023	387,994.74	
	オーストラリアドル 小計		894,492	4,865,134.26 (361,041,613)	
香港ドル	LINK REIT		96,000	7,478,400.00	
	香港ドル 小計		96,000	7,478,400.00 (107,688,960)	
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		139,548	460,508.40	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		110,000	226,600.00	
	CAPITALAND MALL TRUST		117,100	295,092.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		55,800	132,804.00	
	SUNTEC REIT		113,000	205,660.00	
	シンガポールドル 小計		535,448	1,320,664.40 (105,745,598)	
	投資証券合計		3,924,520	6,104,730,320 (6,104,730,320)	
	合計			6,269,047,618 (6,269,047,618)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 609銘柄	96.8%			68.1%
	投資証券 40銘柄			3.2%	2.3%

カナダドル	株式	84銘柄	99.2%			3.6%
	投資証券	5銘柄			0.8%	0.0%
ユーロ	株式	237銘柄	99.1%			11.0%
	投資証券	6銘柄			0.9%	0.1%
イギリスポンド	株式	93銘柄	98.8%			5.5%
	投資証券	3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%			0.2%
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	59銘柄	91.2%			2.2%
	投資信託受益証券	3銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券	7銘柄			6.6%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	34銘柄	93.9%			1.1%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.9%		0.0%
	投資証券	1銘柄			4.3%	0.0%
シンガポールドル	株式	20銘柄	88.9%			0.4%
	投資証券	5銘柄			11.1%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	296,205,276
コール・ローン	2,386,086,367
国債証券	140,296,245,700
派生商品評価勘定	60,148,182

	2020年 2月21日現在
項目	金額（円）
未収入金	703,318
未収利息	898,318,840
前払費用	52,016,245
差入委託証拠金	228,075,055
流動資産合計	144,217,798,983
資産合計	144,217,798,983
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	172,910
前受金	23,813,657
未払金	646,652
未払解約金	157,861,298
未払利息	1,043
流動負債合計	182,495,560
負債合計	182,495,560
純資産の部	
元本等	
元本	56,765,977,261
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	87,269,326,162
元本等合計	144,035,303,423
純資産合計	144,035,303,423
負債純資産合計	144,217,798,983

## 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21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）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>

2020年 2月21日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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)

2020年 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,765,977,261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 2.5374円 (1万口当たり純資産額) (25,374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

2020年 2月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2020年 2月21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

	2020年 2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )



該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 2月22日
期首元本額	56,992,555,742円
期中追加設定元本額	10,407,595,785円
期中一部解約元本額	10,634,174,266円
期末元本額	56,765,977,261円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,233,777,247円
DC外国債券インデックスファンド	2,054,082,560円
DC外国債券インデックスファンドL	12,856,824,305円
DCバランスファンド30	745,597,121円
DCバランスファンド50	762,740,107円
DCバランスファンド70	146,069,724円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	442,966,105円
外国債券インデックスe	1,285,444,956円
インデックスコレクション(外国債券)	6,712,799,783円
インデックスコレクション(バランス株式30)	4,389,967,009円
インデックスコレクション(バランス株式50)	492,852,410円
インデックスコレクション(バランス株式70)	137,440,826円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	3,984,427,590円
外国債券パッシブファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,506,982,564円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	620,355,291円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	158,330,951円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	711,487,991円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	388,345,542円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	572,836,255円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	834,613円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	1,440,477,891円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,976,883,865円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	696,614,432円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	7,281,083,792円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	352,525,904円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	350,081,403円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	1,804,284,513円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	125,984,064円

区分	2020年 2月21日現在
バランスVA40(適格機関投資家専用)	223,302,898円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	115,152,470円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	58,929,661円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	113,482,063円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	280,259,548円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	84,242,226円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	1,631,508,036円
私募外国債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	27,001,545円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2020年 2月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		1,015,989,272
合計		1,015,989,272

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 債券関連

(2020年 2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	債券先物取引 買建	2,181,024,241	うち1年超	23,813,657
			-	
合計		2,181,024,241	-	23,813,657

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

(2020年 2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	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				
	買建	2,199,540,685	-	2,235,702,300	36,161,615
	アメリカドル	1,145,987,490	-	1,170,086,500	24,099,010
	カナダドル	91,559,950	-	93,783,900	2,223,950
	ユーロ	811,244,175	-	818,831,500	7,587,325
	イギリスポンド	150,749,070	-	153,000,400	2,251,330
	合計	2,199,540,685	-	2,235,702,300	36,161,615

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 02/28/21	4,550,000.00	4,534,003.92	
		T 1.125% 06/30/21	4,000,000.00	3,982,031.24	
		T 1.25% 03/31/21	8,500,000.00	8,479,414.10	
		T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	3,936,113.30	
		T 1.25% 10/31/21	4,950,000.00	4,935,691.43	
		T 1.375% 01/31/21	1,600,000.00	1,598,156.25	
		T 1.375% 04/30/21	3,000,000.00	2,996,601.57	
		T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,452,830.06	
		T 1.375% 09/30/23	7,100,000.00	7,104,992.22	
		T 1.375% 10/15/22	2,250,000.00	2,250,175.79	
		T 1.5% 01/31/22	3,000,000.00	3,005,507.82	
		T 1.5% 02/28/23	1,760,000.00	1,767,287.50	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,017,812.52	
		T 1.5% 08/15/26	8,300,000.00	8,332,746.07	
		T 1.5% 09/30/24	8,000,000.00	8,046,250.00	
		T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,818,056.65	
		T 1.625% 04/30/23	5,800,000.00	5,848,484.40	
		T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,463,914.07	

T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,387,212.90	
T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,409,078.13	
T 1.625% 08/15/29	6,260,000.00	6,318,198.46	
T 1.625% 08/31/22	500,000.00	503,144.53	
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,175,195.31	
T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	4,027,500.00	
T 1.625% 11/30/26	5,030,000.00	5,088,552.36	
T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,679,708.99	
T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,676,091.80	
T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,518,945.32	
T 1.75% 04/30/22	2,000,000.00	2,015,703.12	
T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,638,093.75	
T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,771,601.56	
T 1.75% 05/31/22	2,650,000.00	2,671,841.80	
T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,521,972.65	
T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	2,032,031.26	
T 1.75% 07/15/22	7,300,000.00	7,364,445.34	
T 1.75% 09/30/22	6,750,000.00	6,816,181.65	
T 1.875% 01/31/22	1,550,000.00	1,564,077.14	
T 1.875% 03/31/22	5,100,000.00	5,150,800.79	
T 1.875% 04/30/22	2,800,000.00	2,829,640.63	
T 1.875% 05/31/22	2,350,000.00	2,376,070.31	
T 1.875% 06/30/26	8,000,000.00	8,216,562.48	
T 1.875% 07/31/22	2,880,000.00	2,914,537.50	
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,849,007.80	
T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,632,601.55	
T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,519,511.71	
T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	2,026,640.62	
T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,528,164.08	
T 2.125% 01/31/21	6,000,000.00	6,034,804.68	
T 2.125% 02/29/24	1,400,000.00	1,441,507.81	
T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,236,187.50	
T 2.125% 05/15/25	7,250,000.00	7,519,609.37	
T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	3,026,894.52	
T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,119,121.09	
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,548,691.41	
T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,928,716.78	
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,021,796.88	
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,273,992.18	
T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,776,148.45	
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,448,562.50	
T 2.125% 12/31/22	3,800,000.00	3,880,898.42	

T 2.25% 01/31/24	8,100,000.00	8,376,222.63
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	4,107,187.50
T 2.25% 03/31/21	900,000.00	907,593.75
T 2.25% 04/15/22	2,680,000.00	2,728,575.00
T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,743,052.75
T 2.25% 04/30/24	7,600,000.00	7,871,640.64
T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,551,328.12
T 2.25% 08/15/27	6,330,000.00	6,685,073.43
T 2.25% 08/15/46	6,680,000.00	7,051,053.15
T 2.25% 08/15/49	1,440,000.00	1,530,900.00
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,599,609.37
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,200,976.55
T 2.25% 11/15/25	6,500,000.00	6,800,371.11
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	5,561,217.21
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,617,441.41
T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	3,019,285.14
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,922,517.19
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,828,093.76
T 2.375% 05/15/29	3,890,000.00	4,177,799.23
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	6,992,863.29
T 2.5% 01/15/22	4,000,000.00	4,081,328.12
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	4,215,000.00
T 2.5% 02/15/45	5,350,000.00	5,900,882.81
T 2.5% 02/15/46	6,850,000.00	7,571,390.62
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	690,599.61
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,871,703.12
T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,584,496.11
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,442,970.70
T 2.625% 02/15/29	5,390,000.00	5,894,891.43
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,653,027.35
T 2.625% 05/15/21	6,000,000.00	6,084,492.18
T 2.75% 02/15/24	8,900,000.00	9,378,375.00
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	5,118,757.81
T 2.75% 04/30/23	4,200,000.00	4,381,289.05
T 2.75% 08/15/42	1,450,000.00	1,667,046.87
T 2.75% 08/15/47	4,700,000.00	5,475,132.83
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,674,759.75
T 2.75% 11/15/42	2,740,000.00	3,149,287.50
T 2.75% 11/15/47	4,700,000.00	5,479,171.87
T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,471,421.87
T 2.875% 05/15/28	2,260,000.00	2,503,303.12
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,042,398.43
T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	5,289,968.77

T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,662,328.14	
T 2.875% 08/15/45	6,180,000.00	7,291,434.37	
T 2.875% 10/15/21	4,250,000.00	4,349,526.37	
T 2.875% 11/15/21	7,000,000.00	7,173,222.63	
T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,137,054.70	
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,621,875.00	
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	6,231,500.00	
T 2% 02/28/21	3,150,000.00	3,166,303.70	
T 2% 04/30/24	8,000,000.00	8,206,562.48	
T 2% 05/31/21	5,500,000.00	5,536,738.29	
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,539,023.44	
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	1,026,835.94	
T 2% 07/31/22	3,900,000.00	3,958,957.04	
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,869,824.23	
T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,234,945.30	
T 2% 10/31/21	4,200,000.00	4,239,785.17	
T 2% 10/31/22	4,500,000.00	4,574,707.02	
T 2% 11/15/21	1,300,000.00	1,313,025.38	
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,795,765.62	
T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,594,316.42	
T 2% 12/31/21	3,380,000.00	3,416,308.60	
T 3.125% 02/15/42	1,300,000.00	1,585,796.87	
T 3.125% 02/15/43	2,100,000.00	2,561,179.69	
T 3.125% 05/15/21	6,250,000.00	6,376,098.62	
T 3.125% 08/15/44	2,600,000.00	3,185,406.25	
T 3.125% 11/15/28	7,060,000.00	7,997,104.72	
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	1,060,040.62	
T 3.375% 05/15/44	3,000,000.00	3,818,906.25	
T 3.5% 02/15/39	1,100,000.00	1,404,734.37	
T 3.625% 02/15/21	7,050,000.00	7,196,370.12	
T 3.625% 02/15/44	2,650,000.00	3,499,035.16	
T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	2,108,000.00	
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,462,226.56	
T 3.75% 11/15/43	2,500,000.00	3,356,835.95	
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	915,396.87	
T 3% 02/15/48	4,400,000.00	5,373,843.77	
T 3% 02/15/49	1,940,000.00	2,383,623.44	
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,315,960.94	
T 3% 05/15/45	200,000.00	240,734.37	
T 3% 05/15/47	3,400,000.00	4,137,375.00	
T 3% 08/15/48	6,910,000.00	8,464,210.19	
T 3% 09/30/25	3,660,000.00	3,975,246.08	

	T 3% 10/31/25	5,950,000.00	6,468,068.34
	T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,463,203.12
	T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,191,128.91
	T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,271,390.62
	T 4.375% 02/15/38	500,000.00	704,101.56
	T 4.375% 05/15/40	750,000.00	1,073,437.50
	T 4.375% 05/15/41	1,350,000.00	1,942,945.31
	T 4.375% 11/15/39	1,050,000.00	1,497,398.43
	T 4.5% 02/15/36	1,000,000.00	1,393,750.00
	T 4.5% 08/15/39	750,000.00	1,083,925.78
	T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	2,209,101.57
	T 4.75% 02/15/41	350,000.00	526,476.56
	T 5.0% 05/15/37	650,000.00	969,363.28
	T 5.25% 02/15/29	500,000.00	657,929.69
	T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,177,312.50
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	1,040,039.06
	T 5.5% 08/15/28	250,000.00	330,253.90
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	759,140.62
	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,411,429.68
	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	1,042,593.75
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,574,279.29
	T 6.5% 11/15/26	450,000.00	597,375.00
	T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	2,891,839.83
	アメリカドル 小計	577,740,000.00	613,579,260.17 (68,788,370,857)
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	1,110,000.00	1,089,137.55
	CAN 0.75% 03/01/21	1,980,000.00	1,963,863.00
	CAN 0.75% 09/01/21	1,740,000.00	1,720,816.50
	CAN 1.25% 06/01/30	180,000.00	179,088.30
	CAN 1.5% 02/01/22	1,220,000.00	1,221,244.40
	CAN 1.5% 06/01/23	2,010,000.00	2,016,673.20
	CAN 1.5% 06/01/26	840,000.00	849,004.80
	CAN 1% 06/01/27	1,060,000.00	1,036,722.40
	CAN 1% 09/01/22	1,150,000.00	1,138,086.00
	CAN 2.25% 02/01/21	1,580,000.00	1,589,756.50
	CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	693,081.50
	CAN 2.25% 06/01/25	1,530,000.00	1,602,338.40
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	422,089.20
	CAN 2.5% 06/01/24	2,410,000.00	2,524,932.90
	CAN 2.75% 06/01/22	1,490,000.00	1,533,426.05
	CAN 2.75% 12/01/48	870,000.00	1,142,688.45
	CAN 2.75% 12/01/64	290,000.00	420,917.60
	CAN 2% 06/01/28	530,000.00	558,251.65

	CAN 2% 12/01/51	290,000.00	334,394.65
	CAN 3.25% 06/01/21	1,400,000.00	1,430,121.00
	CAN 3.5% 12/01/45	1,630,000.00	2,357,843.90
	CAN 4.0% 06/01/41	1,000,000.00	1,472,170.00
	CAN 5.75% 06/01/29	960,000.00	1,327,291.20
	CAN 5.75% 06/01/33	1,060,000.00	1,623,527.80
	CAN 5% 06/01/37	800,000.00	1,240,312.00
	CAN 8.0% 06/01/27	480,000.00	700,485.60
	カナダドル 小計	28,670,000.00	32,188,264.55 (2,723,127,180)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	8,517,696.00
	MBONO 10% 12/05/24	24,100,000.00	27,620,528.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	13,280,000.00	12,804,443.20
	MBONO 6.5% 06/09/22	17,400,000.00	17,419,053.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	23,300,000.00	23,300,815.50
	MBONO 6.75% 03/09/23	3,040,000.00	3,064,973.60
	MBONO 7.25% 12/09/21	9,500,000.00	9,626,350.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	24,590,000.00	25,998,269.30
	MBONO 7.75% 05/29/31	10,950,000.00	11,939,168.25
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	15,497,249.40
	MBONO 7.75% 11/23/34	7,650,000.00	8,437,758.75
	MBONO 8.5% 05/31/29	13,140,000.00	14,919,944.40
	MBONO 8.5% 11/18/38	8,200,000.00	9,722,043.00
	MBONO 8% 09/05/24	5,910,000.00	6,271,160.10
	MBONO 8% 11/07/47	7,400,000.00	8,484,618.00
	MBONO 8% 12/07/23	11,600,000.00	12,199,894.00
	メキシコペソ 小計	200,440,000.00	215,823,964.50 (1,284,152,588)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	90,000.00	92,343.60
	BGB 0.2% 10/22/23	1,040,000.00	1,069,832.40
	BGB 0.5% 10/22/24	350,000.00	366,724.75
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,175,564.50
	BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	813,660.00
	BGB 0.8% 06/22/28	1,430,000.00	1,562,046.20
	BGB 0.9% 06/22/29	790,000.00	873,925.65
	BGB 1.25% 04/22/33	140,000.00	163,333.80
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	483,772.00
	BGB 1.6% 06/22/47	700,000.00	899,692.50
	BGB 1.7% 06/22/50	490,000.00	646,023.35
	BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	660,829.95
	BGB 1% 06/22/26	740,000.00	806,788.70
	BGB 1% 06/22/31	1,140,000.00	1,282,562.70



BGB 2.15% 06/22/66	330,000.00	517,789.80
BGB 2.25% 06/22/23	970,000.00	1,062,921.15
BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	582,059.30
BGB 2.6% 06/22/24	1,200,000.00	1,365,258.00
BGB 3.75% 06/22/45	620,000.00	1,115,256.00
BGB 3% 06/22/34	500,000.00	712,310.00
BGB 4.25% 03/28/41	1,070,000.00	1,923,474.80
BGB 4.25% 09/28/21	1,130,000.00	1,218,100.45
BGB 4.25% 09/28/22	940,000.00	1,059,948.70
BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	979,447.50
BGB 4% 03/28/22	790,000.00	867,246.20
BGB 4% 03/28/32	450,000.00	673,330.50
BGB 5.5% 03/28/28	1,190,000.00	1,759,034.20
BGB 5% 03/28/35	1,340,000.00	2,327,921.70
BKO 0% 03/12/21	850,000.00	855,665.25
BKO 0% 06/11/21	900,000.00	907,438.50
BTPS 0.05% 04/15/21	1,720,000.00	1,726,303.80
BTPS 0.35% 02/01/25	460,000.00	461,363.90
BTPS 0.35% 11/01/21	800,000.00	807,648.00
BTPS 0.45% 06/01/21	820,000.00	827,400.50
BTPS 0.65% 10/15/23	560,000.00	572,216.40
BTPS 0.9% 08/01/22	1,500,000.00	1,536,907.50
BTPS 0.95% 03/01/23	1,720,000.00	1,769,097.40
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,226,604.60
BTPS 1.35% 04/15/22	1,000,000.00	1,031,545.00
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,132,290.05
BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,611,000.25
BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	634,278.00
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,591,515.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,445,890.50
BTPS 1.65% 03/01/32	1,340,000.00	1,428,118.40
BTPS 1.75% 07/01/24	990,000.00	1,056,344.85
BTPS 1.85% 05/15/24	1,340,000.00	1,435,006.00
BTPS 2.05% 08/01/27	1,430,000.00	1,577,125.55
BTPS 2.1% 07/15/26	300,000.00	330,348.00
BTPS 2.15% 12/15/21	1,700,000.00	1,772,454.00
BTPS 2.2% 06/01/27	1,840,000.00	2,047,073.60
BTPS 2.25% 09/01/36	990,000.00	1,115,155.80
BTPS 2.45% 09/01/33	1,380,000.00	1,593,796.50
BTPS 2.45% 09/01/50	410,000.00	461,223.35
BTPS 2.45% 10/01/23	870,000.00	943,958.70
BTPS 2.5% 11/15/25	1,650,000.00	1,845,467.25
BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,438,352.50

BTPS 2.7% 03/01/47	1,560,000.00	1,856,509.20
BTPS 2.8% 03/01/67	600,000.00	722,151.00
BTPS 2.8% 12/01/28	1,970,000.00	2,308,780.90
BTPS 2.95% 09/01/38	860,000.00	1,054,888.90
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,145,886.00
BTPS 3.1% 03/01/40	460,000.00	575,220.80
BTPS 3.25% 09/01/46	680,000.00	886,199.80
BTPS 3.35% 03/01/35	1,170,000.00	1,488,737.25
BTPS 3.45% 03/01/48	1,120,000.00	1,514,251.20
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	2,435,062.50
BTPS 3.75% 03/01/21	340,000.00	354,110.00
BTPS 3.75% 05/01/21	1,550,000.00	1,623,989.25
BTPS 3.75% 08/01/21	1,900,000.00	2,009,022.00
BTPS 3.75% 09/01/24	1,740,000.00	2,015,633.40
BTPS 3.85% 09/01/49	830,000.00	1,197,810.35
BTPS 3% 08/01/29	600,000.00	718,017.00
BTPS 4.5% 03/01/24	1,810,000.00	2,126,541.85
BTPS 4.5% 03/01/26	2,250,000.00	2,793,015.00
BTPS 4.5% 05/01/23	1,050,000.00	1,199,614.50
BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,870,208.20
BTPS 4.75% 09/01/21	2,630,000.00	2,829,419.75
BTPS 4.75% 09/01/28	1,650,000.00	2,196,785.25
BTPS 4.75% 09/01/44	1,020,000.00	1,621,417.50
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	2,484,954.00
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	2,264,940.00
BTPS 5.25% 11/01/29	2,300,000.00	3,235,260.50
BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	1,939,445.00
BTPS 5.5% 11/01/22	2,200,000.00	2,529,032.00
BTPS 5.75% 02/01/33	1,410,000.00	2,180,409.90
BTPS 5% 03/01/22	1,450,000.00	1,602,018.00
BTPS 5% 03/01/25	1,740,000.00	2,148,047.40
BTPS 5% 08/01/34	1,800,000.00	2,680,101.00
BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	2,529,784.00
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,972,437.20
BTPS 6% 05/01/31	1,940,000.00	2,963,175.40
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	504,372.75
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,390,805.00
DBR 0.25% 02/15/27	2,350,000.00	2,491,634.50
DBR 0.25% 02/15/29	2,010,000.00	2,150,649.75
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,388,471.50
DBR 0.5% 02/15/25	1,140,000.00	1,206,581.70
DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,457,998.50

DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,640,124.25
DBR 0.5% 08/15/27	900,000.00	973,935.00
DBR 0% 08/15/26	2,050,000.00	2,132,676.50
DBR 0% 08/15/29	1,030,000.00	1,077,802.30
DBR 0% 08/15/50	260,000.00	256,553.70
DBR 1.25% 08/15/48	1,350,000.00	1,823,337.00
DBR 1.5% 02/15/23	950,000.00	1,012,324.75
DBR 1.5% 05/15/23	1,960,000.00	2,099,346.20
DBR 1.5% 05/15/24	1,020,000.00	1,114,890.60
DBR 1.5% 09/04/22	1,620,000.00	1,710,177.30
DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,372,206.25
DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,744,710.00
DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,731,820.65
DBR 1% 08/15/25	760,000.00	829,574.20
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,036,736.00
DBR 2.5% 07/04/44	1,750,000.00	2,850,216.25
DBR 2.5% 08/15/46	1,740,000.00	2,904,721.20
DBR 2% 01/04/22	1,370,000.00	1,438,993.20
DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	2,068,236.45
DBR 3.25% 07/04/21	2,210,000.00	2,327,693.55
DBR 3.25% 07/04/42	920,000.00	1,619,048.20
DBR 4.0% 01/04/37	1,590,000.00	2,748,394.50
DBR 4.25% 07/04/39	870,000.00	1,629,296.85
DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	1,017,313.50
DBR 4.75% 07/04/34	1,360,000.00	2,377,280.00
DBR 4.75% 07/04/40	1,120,000.00	2,259,650.40
DBR 5.5% 01/04/31	1,290,000.00	2,143,896.15
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,246,610.00
DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,740,872.70
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	1,025,480.15
DBR 6.5% 07/04/27	200,000.00	306,457.00
FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	2,142,772.75
FRTR 0.5% 05/25/25	1,800,000.00	1,897,173.00
FRTR 0.5% 05/25/26	2,250,000.00	2,384,696.25
FRTR 0.5% 05/25/29	2,510,000.00	2,688,398.25
FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	3,227,110.40
FRTR 0.75% 11/25/28	1,450,000.00	1,584,792.00
FRTR 0% 02/25/22	2,970,000.00	3,007,778.40
FRTR 0% 03/25/23	1,880,000.00	1,915,889.20
FRTR 0% 03/25/24	2,050,000.00	2,099,128.25
FRTR 0% 03/25/25	2,850,000.00	2,924,313.75
FRTR 0% 05/25/21	550,000.00	554,259.75
FRTR 0% 05/25/22	1,350,000.00	1,369,514.25

FRTR 0% 11/25/29	1,000,000.00	1,021,520.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	1,830,000.00	2,147,953.35	
FRTR 1.25% 05/25/36	2,010,000.00	2,369,870.40	
FRTR 1.5% 05/25/31	2,950,000.00	3,496,517.00	
FRTR 1.5% 05/25/50	1,050,000.00	1,330,985.25	
FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,802,150.00	
FRTR 1.75% 05/25/66	920,000.00	1,310,894.20	
FRTR 1.75% 06/25/39	1,620,000.00	2,081,157.30	
FRTR 1.75% 11/25/24	3,000,000.00	3,331,695.00	
FRTR 1% 05/25/27	2,480,000.00	2,732,451.60	
FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,432,841.60	
FRTR 2.25% 05/25/24	2,040,000.00	2,288,798.40	
FRTR 2.25% 10/25/22	1,700,000.00	1,832,056.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	2,450,000.00	3,135,534.50	
FRTR 2.75% 10/25/27	2,400,000.00	2,985,564.00	
FRTR 2% 05/25/48	1,360,000.00	1,899,872.40	
FRTR 3.25% 05/25/45	2,600,000.00	4,367,506.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,120,000.00	4,388,768.20	
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,893,682.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	3,200,000.00	3,364,000.00	
FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	4,048,500.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	2,870,000.00	3,388,164.15	
FRTR 4.5% 04/25/41	2,430,000.00	4,535,473.50	
FRTR 4.75% 04/25/35	1,810,000.00	3,099,661.20	
FRTR 4% 04/25/55	970,000.00	2,021,421.80	
FRTR 4% 04/25/60	920,000.00	2,021,534.40	
FRTR 4% 10/25/38	1,610,000.00	2,734,705.75	
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,846,912.50	
FRTR 5.75% 10/25/32	2,220,000.00	3,876,552.90	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,991,792.50	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,422,998.50	
IRISH 0.8% 03/15/22	750,000.00	770,595.00	
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	482,156.40	
IRISH 1.1% 05/15/29	600,000.00	671,160.00	
IRISH 1.3% 05/15/33	320,000.00	372,377.60	
IRISH 1.35% 03/18/31	30,000.00	34,704.45	
IRISH 1.5% 05/15/50	260,000.00	324,498.20	
IRISH 1.7% 05/15/37	570,000.00	708,943.20	
IRISH 1% 05/15/26	730,000.00	791,856.55	
IRISH 2.4% 05/15/30	770,000.00	969,861.20	
IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	845,903.20	
IRISH 3.4% 03/18/24	420,000.00	486,924.90	

IRISH 3.9% 03/20/23	580,000.00	659,477.40
IRISH 5.4% 03/13/25	800,000.00	1,037,396.00
NETHER 0.25% 07/15/25	630,000.00	657,833.40
NETHER 0.25% 07/15/29	800,000.00	846,516.00
NETHER 0.5% 01/15/40	540,000.00	595,198.80
NETHER 0.5% 07/15/26	1,170,000.00	1,247,342.85
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	982,215.00
NETHER 0.75% 07/15/28	1,210,000.00	1,331,677.60
NETHER 0% 01/15/22	1,100,000.00	1,113,145.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,170,000.00	1,266,273.45
NETHER 2.25% 07/15/22	910,000.00	973,672.70
NETHER 2.5% 01/15/33	810,000.00	1,099,566.90
NETHER 2.75% 01/15/47	1,040,000.00	1,798,092.40
NETHER 2% 07/15/24	1,560,000.00	1,740,905.40
NETHER 3.25% 07/15/21	1,330,000.00	1,402,232.30
NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	338,674.50
NETHER 3.75% 01/15/42	1,010,000.00	1,849,527.15
NETHER 4% 01/15/37	970,000.00	1,650,857.55
NETHER 5.5% 01/15/28	740,000.00	1,093,956.80
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	867,464.50
OBL 0% 04/05/24	210,000.00	215,801.25
OBL 0% 04/08/22	1,270,000.00	1,287,913.35
OBL 0% 04/09/21	960,000.00	966,854.40
OBL 0% 04/14/23	600,000.00	612,768.00
OBL 0% 10/07/22	520,000.00	529,076.60
OBL 0% 10/08/21	1,120,000.00	1,131,804.80
OBL 0% 10/18/24	1,390,000.00	1,432,846.75
RAGB 0.5% 02/20/29	700,000.00	750,298.50
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	948,254.95
RAGB 0.75% 02/20/28	620,000.00	675,390.80
RAGB 0.75% 10/20/26	600,000.00	647,745.00
RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	663,312.00
RAGB 0% 07/15/24	260,000.00	266,433.70
RAGB 0% 09/20/22	430,000.00	437,034.80
RAGB 1.2% 10/20/25	750,000.00	822,836.25
RAGB 1.5% 02/20/47	410,000.00	539,326.30
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	398,879.10
RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	618,167.20
RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	815,208.75
RAGB 2.1% 09/20/17	340,000.00	664,319.20
RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	714,127.30
RAGB 3.15% 06/20/44	470,000.00	799,246.75
RAGB 3.4% 11/22/22	960,000.00	1,067,174.40

RAGB 3.5% 09/15/21	950,000.00	1,011,503.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	500,000.00	546,490.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	220,000.00	504,830.70	
RAGB 4.15% 03/15/37	860,000.00	1,461,204.50	
RAGB 4.85% 03/15/26	760,000.00	1,008,725.20	
RAGB 6.25% 07/15/27	370,000.00	555,105.45	
RFGB 0.5% 04/15/26	390,000.00	413,316.15	
RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	405,524.60	
RFGB 0.5% 09/15/28	60,000.00	64,301.10	
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	311,384.60	
RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	298,278.45	
RFGB 0.875% 09/15/25	390,000.00	420,228.90	
RFGB 0% 04/15/22	250,000.00	253,422.50	
RFGB 0% 09/15/23	100,000.00	102,198.50	
RFGB 0% 09/15/24	60,000.00	61,539.00	
RFGB 1.125% 04/15/34	360,000.00	419,205.60	
RFGB 1.375% 04/15/47	230,000.00	300,147.70	
RFGB 1.5% 04/15/23	590,000.00	629,760.10	
RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	402,108.40	
RFGB 2.625% 07/04/42	280,000.00	434,036.40	
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	479,903.90	
RFGB 2% 04/15/24	410,000.00	454,544.45	
RFGB 3.5% 04/15/21	380,000.00	398,069.00	
RFGB 4% 07/04/25	320,000.00	399,003.20	
SPGB 0.05% 01/31/21	500,000.00	502,490.00	
SPGB 0.05% 10/31/21	1,850,000.00	1,865,910.00	
SPGB 0.25% 07/30/24	810,000.00	828,565.20	
SPGB 0.35% 07/30/23	210,000.00	215,049.45	
SPGB 0.4% 04/30/22	1,040,000.00	1,059,552.00	
SPGB 0.45% 10/31/22	800,000.00	818,996.00	
SPGB 0.5% 04/30/30	520,000.00	534,391.00	
SPGB 0.6% 10/31/29	1,200,000.00	1,248,636.00	
SPGB 0.75% 07/30/21	500,000.00	508,982.50	
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,593,473.20	
SPGB 1.4% 04/30/28	1,420,000.00	1,574,936.20	
SPGB 1.4% 07/30/28	1,810,000.00	2,009,833.05	
SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	839,088.75	
SPGB 1.45% 10/31/27	1,840,000.00	2,041,489.20	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,040,000.00	1,153,266.40	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,367,150.00	
SPGB 1.85% 07/30/35	750,000.00	892,590.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,510,367.60	

	SPGB 1.95% 07/30/30	1,700,000.00	2,000,900.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,800,000.00	2,035,926.00	
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,290,000.00	1,612,796.70	
	SPGB 2.7% 10/31/48	990,000.00	1,401,359.85	
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,780,576.20	
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,594,653.50	
	SPGB 3.45% 07/30/66	750,000.00	1,315,845.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,757,460.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,440,000.00	2,277,936.00	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,550,736.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,780,054.50	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	2,299,947.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,381,627.25	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,320,000.00	2,358,312.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	750,000.00	1,077,018.75	
	SPGB 5.15% 10/31/44	890,000.00	1,729,051.95	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,710,000.00	3,173,599.70	
	SPGB 5.5% 04/30/21	2,740,000.00	2,933,183.70	
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	2,410,900.50	
	SPGB 5.85% 01/31/22	1,780,000.00	1,998,646.30	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,883,518.40	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,579,602.25	
	ユーロ 小計	348,860,000.00	427,012,988.75 (51,638,680,729)	
イギリスボ ンド	UKT 0.5% 07/22/22	1,450,000.00	1,451,957.50	
	UKT 0.625% 06/07/25	810,000.00	816,658.20	
	UKT 0.75% 07/22/23	1,950,000.00	1,969,480.50	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,330,000.00	1,367,406.25	
	UKT 1.25% 07/22/27	1,190,000.00	1,258,252.45	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,060,000.00	1,131,550.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	1,310,000.00	1,450,667.80	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,940,000.00	2,123,087.50	
	UKT 1.625% 10/22/54	730,000.00	865,064.60	
	UKT 1.625% 10/22/71	340,000.00	443,108.40	
	UKT 1.75% 01/22/49	400,000.00	470,034.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	850,000.00	1,062,542.50	
	UKT 1.75% 09/07/22	1,640,000.00	1,694,046.20	
	UKT 1.75% 09/07/37	1,540,000.00	1,740,469.50	
	UKT 1% 04/22/24	2,030,000.00	2,075,786.65	
	UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,233,317.80	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,260,000.00	1,994,170.50	
	UKT 2.75% 09/07/24	420,000.00	463,402.80	
	UKT 2% 09/07/25	420,000.00	456,716.40	

	UKT 3.25% 01/22/44	1,430,000.00	2,095,164.50	
	UKT 3.5% 01/22/45	1,550,000.00	2,381,435.50	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,270,000.00	2,543,848.10	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,110,000.00	1,952,401.20	
	UKT 3.75% 09/07/21	1,650,000.00	1,731,996.75	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,490,000.00	2,242,829.95	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,120,000.00	1,587,986.40	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,290,000.00	2,046,288.30	
	UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	966,967.50	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,130,000.00	1,819,446.90	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,260,000.00	2,200,527.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,060,000.00	1,930,662.80	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,350,000.00	2,684,927.25	
	UKT 4.5% 09/07/34	910,000.00	1,372,007.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,380,000.00	2,355,577.20	
	UKT 4.75% 12/07/30	900,000.00	1,290,226.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	620,000.00	1,029,079.10	
	UKT 4% 01/22/60	1,000,000.00	2,017,230.00	
	UKT 4% 03/07/22	910,000.00	975,251.55	
	UKT 5% 03/07/25	1,600,000.00	1,962,360.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	662,733.00	
	UKT 8% 06/07/21	50,000.00	54,794.00	
	イギリスポンド 小計	46,110,000.00	61,971,460.05 (8,951,157,689)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	2,800,000.00	3,022,110.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	3,690,000.00	3,997,118.70	
	SGB 1.5% 11/13/23	6,290,000.00	6,734,671.55	
	SGB 1% 11/12/26	3,560,000.00	3,871,250.80	
	SGB 2.5% 05/12/25	4,150,000.00	4,772,977.25	
	SGB 3.5% 03/30/39	2,910,000.00	4,653,613.80	
	SGB 3.5% 06/01/22	6,340,000.00	6,906,383.90	
	スウェーデンクローナ 小計	29,740,000.00	33,958,126.00 (387,801,798)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.5% 02/19/26	3,460,000.00	3,494,150.20	
	NGB 1.75% 02/17/27	2,900,000.00	2,980,388.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	2,040,000.00	2,083,411.20	
	NGB 1.75% 09/06/29	1,550,000.00	1,603,723.00	
	NGB 2% 04/26/28	2,160,000.00	2,269,371.60	
	NGB 2% 05/24/23	5,000,000.00	5,107,400.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	5,520,000.00	5,679,942.00	
	NGB 3% 03/14/24	3,320,000.00	3,539,634.60	
	ノルウェークローネ 小計	25,950,000.00	26,758,020.60	



			(321,898,987)
デンマーク クローネ	DGB 0.5% 11/15/27	5,450,000.00	5,892,076.75
	DGB 0.5% 11/15/29	2,680,000.00	2,926,774.40
	DGB 1.5% 11/15/23	4,930,000.00	5,331,400.60
	DGB 1.75% 11/15/25	3,880,000.00	4,411,734.60
	DGB 3% 11/15/21	5,670,000.00	6,034,439.25
	DGB 4.5% 11/15/39	8,920,000.00	17,356,357.60
デンマーククローネ 小計		31,530,000.00	41,952,783.20 (679,215,560)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	2,050,000.00	2,059,266.00
	POLGB 2.25% 04/25/22	1,780,000.00	1,806,477.50
	POLGB 2.25% 10/25/24	450,000.00	459,693.00
	POLGB 2.5% 01/25/23	1,550,000.00	1,589,835.00
	POLGB 2.5% 04/25/24	2,180,000.00	2,248,506.50
	POLGB 2.5% 07/25/26	2,780,000.00	2,866,624.80
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,910,000.00	1,968,484.20
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,920,000.00	2,011,353.60
	POLGB 2.75% 10/25/29	910,000.00	960,391.25
	POLGB 2% 04/25/21	2,550,000.00	2,569,813.50
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,580,000.00	2,762,702.70
	POLGB 4% 10/25/23	2,870,000.00	3,107,349.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,185,516.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	1,500,000.00	1,657,560.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,130,000.00	1,210,258.25
ポーランドズロチ 小計		27,060,000.00	28,463,831.30 (804,672,510)
オーストラ リアドル	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,253,801.85
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,450,000.00	1,605,795.25
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,300,000.00	1,494,356.50
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,400,000.00	1,518,895.00
	ACGB 2.75% 05/21/41	290,000.00	358,792.35
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	769,491.45
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,900,000.00	2,168,014.00
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,750,000.00	2,018,843.75
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,440,000.00	1,680,674.40
	ACGB 2% 12/21/21	690,000.00	706,508.25
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,750,000.00	1,973,947.50
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,330,000.00	2,802,477.40
	ACGB 3.25% 06/21/39	550,000.00	726,737.00
	ACGB 3.75% 04/21/37	810,000.00	1,120,861.80
	ACGB 3% 03/21/47	950,000.00	1,252,750.75
ACGB 4.25% 04/21/26	2,150,000.00	2,599,167.25	
ACGB 4.5% 04/21/33	1,220,000.00	1,736,383.30	

	ACGB 4.75% 04/21/27	2,100,000.00	2,672,218.50	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,110,000.00	2,429,295.75	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,730,000.00	2,896,994.10	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,000,000.00	2,240,910.00	
オーストラリアドル 小計		30,740,000.00	36,026,916.15 (2,673,557,447)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	290,000.00	288,950.20	
	SIGB 1.75% 02/01/23	320,000.00	322,387.20	
	SIGB 1.75% 04/01/22	160,000.00	160,876.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	200,000.00	206,937.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	730,000.00	737,154.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	400,000.00	425,874.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	250,000.00	260,798.75	
	SIGB 2.375% 07/01/39	100,000.00	109,221.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	70,000.00	75,404.70	
	SIGB 2.75% 03/01/46	390,000.00	448,854.90	
	SIGB 2.75% 04/01/42	340,000.00	391,639.20	
	SIGB 2.75% 07/01/23	650,000.00	676,601.25	
	SIGB 2.875% 07/01/29	480,000.00	530,949.60	
	SIGB 2.875% 09/01/30	370,000.00	412,501.90	
	SIGB 2% 02/01/24	220,000.00	224,170.10	
	SIGB 3.125% 09/01/22	320,000.00	332,928.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	270,000.00	322,276.05	
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	597,492.85	
SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	543,193.35		
シンガポールドル 小計		6,600,000.00	7,068,210.85 (565,951,642)	
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,220,000.00	1,241,203.60	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,329,022.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	100,000.00	104,087.50	
	MGS 3.62% 11/30/21	950,000.00	966,126.25	
	MGS 3.733% 06/15/28	300,000.00	317,242.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	550,000.00	568,933.75	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	923,382.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,360,000.00	1,428,244.80	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,200,000.00	1,276,104.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	360,000.00	382,149.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	150,000.00	159,009.75	
	MGS 4.059% 09/30/24	750,000.00	790,181.25	
	MGS 4.127% 04/15/32	690,000.00	754,414.95	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,040,000.00	2,080,902.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,360,000.00	1,440,620.80	
MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	943,236.50		

	MGS 4.254% 05/31/35	890,000.00	996,355.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,650,000.00	1,790,959.50	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,740,000.00	1,955,838.30	
	MGS 4.642% 11/07/33	180,000.00	209,435.40	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,090,000.00	1,288,489.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,385,109.60	
	MGS 4.921% 07/06/48	290,000.00	354,145.10	
	MGS 4.935% 09/30/43	640,000.00	780,099.20	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,732,066.20	
	マレーシアリングット 小計	23,160,000.00	25,197,358.45	(674,029,338)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	19,160,000.00	21,704,448.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	10,300,000.00	7,407,657.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	6,800,000.00	4,748,508.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	3,370,000.00	3,382,940.80	
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,760,000.00	6,984,770.00	
	SAGB 7% 02/28/31	8,030,000.00	6,889,298.35	
	SAGB 8.25% 03/31/32	8,160,000.00	7,568,073.60	
	SAGB 8.5% 01/31/37	9,000,000.00	7,996,680.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	12,170,000.00	10,734,852.75	
	SAGB 8.75% 02/28/48	16,180,000.00	14,195,684.80	
	SAGB 8.875% 02/28/35	2,800,000.00	2,625,364.00	
	SAGB 8% 01/31/30	10,200,000.00	9,633,747.00	
	SAGB 9% 01/31/40	4,850,000.00	4,433,821.50	
	南アフリカランド 小計	117,780,000.00	108,305,845.80	(803,629,375)
	合計		140,296,245,700	(140,296,245,700)

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 168銘柄	100.0%	49.0%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 291銘柄	100.0%	36.8%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.4%

スウェーデンクローナ	国債証券	7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	6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	21銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	25銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	0.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

## 【DCバランスファンド30】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間計算期間(2020年2月22日から2020年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2020年 2月21日現在)	第15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	73,580,659	119,455,707
親投資信託受益証券	20,248,119,071	20,907,227,523
未収入金	21,402,662	57,378,673
流動資産合計	20,343,102,392	21,084,061,903
<b>資産合計</b>	<b>20,343,102,392</b>	<b>21,084,061,903</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	8,796,279	11,880,594
未払受託者報酬	4,353,927	4,401,370
未払委託者報酬	18,504,123	18,705,755
未払利息	32	182
その他未払費用	544,179	550,115
流動負債合計	32,198,540	35,538,016
<b>負債合計</b>	<b>32,198,540</b>	<b>35,538,016</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	13,829,328,777	14,515,719,896
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,481,575,075	6,532,803,991
(分配準備積立金)	2,904,019,781	2,796,753,847
元本等合計	20,310,903,852	21,048,523,887
<b>純資産合計</b>	<b>20,310,903,852</b>	<b>21,048,523,887</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>20,343,102,392</b>	<b>21,084,061,903</b>

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自 2019年 2月22日 至 2019年 8月21日	第15期中間計算期間 自 2020年 2月22日 至 2020年 8月21日
営業収益		
受取利息	27	335
有価証券売買等損益	91,412,486	220,305,042
営業収益合計	91,412,513	220,304,707
営業費用		
支払利息	23,914	26,809
受託者報酬	3,993,864	4,401,370
委託者報酬	16,973,868	18,705,755
その他費用	499,601	550,307
営業費用合計	21,491,247	23,684,241
営業利益又は営業損失（ ）	69,921,266	243,988,948
経常利益又は経常損失（ ）	69,921,266	243,988,948
中間純利益又は中間純損失（ ）	69,921,266	243,988,948
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（ ）	1,955,934	32,950,824
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,224,981,467	6,481,575,075
剰余金増加額又は欠損金減少額	332,728,062	512,733,023
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	332,728,062	512,733,023
剰余金減少額又は欠損金増加額	147,749,825	250,465,983
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	147,749,825	250,465,983
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,477,925,036	6,532,803,991

## (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14期 (2020年 2月21日現在)	第15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	13,829,328,777口	14,515,719,896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) 1.4687円 (14,687円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4501円 (14,501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15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。



	第15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日	第15期中間計算期間 自 2020年 2月22日 至 2020年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	12,980,103,562円	13,829,328,777円
期中追加設定元本額	1,679,276,139円	1,225,472,740円
期中一部解約元本額	830,050,924円	539,081,621円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 【DCバランスファンド50】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間計算期間(2020年2月22日から2020年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2020年 2月21日現在)	第15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	71,708,931	122,636,471
親投資信託受益証券	20,632,324,073	20,973,248,820
未収入金	39,473,889	56,857,528
流動資産合計	20,743,506,893	21,152,742,819
<b>資産合計</b>	<b>20,743,506,893</b>	<b>21,152,742,819</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	22,056,432	14,783,017
未払受託者報酬	4,393,890	4,325,707
未払委託者報酬	19,772,444	19,465,618
未払利息	31	187
その他未払費用	549,179	540,654
流動負債合計	46,771,976	39,115,183
<b>負債合計</b>	<b>46,771,976</b>	<b>39,115,183</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	12,979,122,227	13,455,658,875
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	7,717,612,690	7,657,968,761
(分配準備積立金)	4,368,969,027	4,164,757,207
元本等合計	20,696,734,917	21,113,627,636
<b>純資産合計</b>	<b>20,696,734,917</b>	<b>21,113,627,636</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>20,743,506,893</b>	<b>21,152,742,819</b>

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自 2019年 2月22日 至 2019年 8月21日	第15期中間計算期間 自 2020年 2月22日 至 2020年 8月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	27	372
有価証券売買等損益	121,917,741	291,824,825
営業収益合計	121,917,714	291,824,453
<b>営業費用</b>		
支払利息	24,303	28,738
受託者報酬	3,980,877	4,325,707
委託者報酬	17,913,885	19,465,618
その他費用	497,979	540,894
営業費用合計	22,417,044	24,360,957
営業利益又は営業損失（ ）	144,334,758	316,185,410
経常利益又は経常損失（ ）	144,334,758	316,185,410
中間純利益又は中間純損失（ ）	144,334,758	316,185,410
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（ ）	989,014	70,310,743
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,935,078,783	7,717,612,690
剰余金増加額又は欠損金減少額	391,706,149	558,846,143
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	391,706,149	558,846,143
剰余金減少額又は欠損金増加額	163,898,159	372,615,405
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	163,898,159	372,615,405
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,017,563,001	7,657,968,761

## ( 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14期 (2020年 2月21日現在)	第15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	12,979,122,227口	13,455,658,875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) 1.5946円 (15,946円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5691円 (15,691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15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日	第15期中間計算期間 自 2020年 2月22日 至 2020年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	12,196,046,788円	12,979,122,227円
期中追加設定元本額	1,542,536,422円	1,109,011,050円
期中一部解約元本額	759,460,983円	632,474,402円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 【DCバランスファンド70】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間計算期間(2020年2月22日から2020年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けておりません。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2020年 2月21日現在)	第15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	35,232,651	50,928,651
親投資信託受益証券	8,324,796,087	8,505,495,056
未収入金	5,297,790	21,379,054
流動資産合計	8,365,326,528	8,577,802,761
<b>資産合計</b>	<b>8,365,326,528</b>	<b>8,577,802,761</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	5,830,056	4,453,435
未払受託者報酬	1,736,537	1,714,163
未払委託者報酬	8,248,452	8,142,228
未払利息	15	77
その他未払費用	217,004	214,209
流動負債合計	16,032,064	14,524,112
<b>負債合計</b>	<b>16,032,064</b>	<b>14,524,112</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	4,997,769,197	5,244,381,142
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,351,525,267	3,318,897,507
(分配準備積立金)	1,901,546,131	1,782,682,389
元本等合計	8,349,294,464	8,563,278,649
<b>純資産合計</b>	<b>8,349,294,464</b>	<b>8,563,278,649</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>8,365,326,528</b>	<b>8,577,802,761</b>

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自 2019年 2月22日 至 2019年 8月21日	第15期中間計算期間 自 2020年 2月22日 至 2020年 8月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	10	142
有価証券売買等損益	131,117,019	164,372,340
営業収益合計	131,117,009	164,372,198
<b>営業費用</b>		
支払利息	9,214	10,105
受託者報酬	1,549,684	1,714,163
委託者報酬	7,360,916	8,142,228
その他費用	193,814	214,263
営業費用合計	9,113,628	10,080,759
営業利益又は営業損失（ ）	140,230,637	174,452,957
経常利益又は経常損失（ ）	140,230,637	174,452,957
中間純利益又は中間純損失（ ）	140,230,637	174,452,957
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（ ）	1,319,162	51,467,080
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,453,958,004	3,351,525,267
剰余金増加額又は欠損金減少額	193,818,707	308,929,168
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	193,818,707	308,929,168
剰余金減少額又は欠損金増加額	122,364,280	218,571,051
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	122,364,280	218,571,051
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,383,862,632	3,318,897,507

## (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14期 (2020年 2月21日現在)	第15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,997,769,197口	5,244,381,142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) 1.6706円 (16,706円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6328円 (16,328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15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。



	第15期中間計算期間 (2020年 8月21日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日	第15期中間計算期間 自 2020年 2月22日 至 2020年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,651,467,417円	4,997,769,197円
期中追加設定元本額	795,085,220円	577,373,652円
期中一部解約元本額	448,783,440円	330,761,707円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2020年 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,914,840,059
株式	245,538,796,650

	2020年 8月21日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	36,885,450
未収入金	25,050,000
未収配当金	312,994,320
差入委託証拠金	83,510,000
流動資産合計	247,912,076,479
資産合計	247,912,076,479
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,052,000
前受金	28,843,900
未払解約金	250,224,001
未払利息	2,925
流動負債合計	287,122,826
負債合計	287,122,826
純資産の部	
元本等	
元本	140,861,457,567
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	106,763,496,086
元本等合計	247,624,953,653
純資産合計	247,624,953,653
負債純資産合計	247,912,076,479

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2020年 8月21日現在

## （貸借対照表に関する注記）

	2020年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	140,861,457,567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 1.7579円 (1万口当たり純資産額) (17,579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 8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。  また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 2月22日
期首元本額	138,817,553,099円
期中追加設定元本額	13,726,525,999円
期中一部解約元本額	11,682,621,531円
期末元本額	140,861,457,567円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	682,700,414円
DC日本株式インデックスファンド	314,344,014円
DC日本株式インデックスファンドL	53,708,404,798円
DC日本株式インデックスファンドA	1,033,826,663円
DCバランスファンド30	2,359,579,685円
DCバランスファンド50	3,592,934,438円
DCバランスファンド70	1,921,183,225円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	612,057,101円
日本株式インデックスe	1,632,667,448円
インデックスコレクション（国内株式）	18,763,277,190円
インデックスコレクション（バランス株式30）	13,004,975,360円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,406,684,750円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,853,070,056円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,566,964,866円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,832,815,700円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,361,621,987円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	76,009,228円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	881,589,503円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	107,170,658円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	357,081,811円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	3,538,484円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	779,721,410円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,091,328,200円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	576,530,358円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	9,631,128,635円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	843,303,135円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	134,001,608円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,654,785,958円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	43,867,555円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	190,469,932円

区分	2020年 8月21日現在
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	2,503,042,391円
V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	78,005,361円
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	80,918,831円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	38,865,324円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	883,554,775円
バランスV A 25 L（適格機関投資家専用）	388,654,715円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	6,508,016,080円
世界バランスV A 25（適格機関投資家専用）	122,664,055円
国内バランスV A 30（適格機関投資家専用）	49,884,939円
国内バランスV A 25（適格機関投資家専用）	11,571,949円
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	176,804,104円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	1,840,873円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,990,306,100	-	2,019,150,000	28,843,900
合計		1,990,306,100	-	2,019,150,000	28,843,900

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

項目	2020年 8月21日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	754,481,530
国債証券	304,114,220,600
地方債証券	19,962,329,787
特殊債証券	25,006,717,043
社債証券	15,814,353,000
未収入金	303,411,800
未収利息	861,661,029
前払金	160,000

	2020年 8月21日現在
項目	金額（円）
前払費用	20,463,717
流動資産合計	366,837,798,506
資産合計	366,837,798,506
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	160,660
未払金	300,142,000
未払解約金	254,134,804
未払利息	1,152
流動負債合計	554,438,616
負債合計	554,438,616
純資産の部	
元本等	
元本	266,532,078,179
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	99,751,281,711
元本等合計	366,283,359,890
純資産合計	366,283,359,890
負債純資産合計	366,837,798,506

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	266,532,078,179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 101,255,000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 1.3743円 (1万口当たり純資産額) (13,743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 8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 2月22日
期首元本額	264,459,131,890円
期中追加設定元本額	19,589,870,710円
期中一部解約元本額	17,516,924,421円
期末元本額	266,532,078,179円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	885,081,464円
D C日本債券インデックスファンド	2,649,203,462円
D C日本債券インデックスファンドL	41,793,158,560円
D Cバランスファンド30	9,053,233,519円
D Cバランスファンド50	5,893,759,410円
D Cバランスファンド70	1,498,345,511円
日本債券インデックスe	1,322,604,333円
インデックスコレクション（国内債券）	36,660,094,469円
インデックスコレクション（バランス株式30）	48,535,030,932円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,995,407,295円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,425,158,158円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	46,651,686,470円
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	3,902,438,032円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	223,959,825円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,107,247,054円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	153,146,114円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	167,342,412円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,440,528,653円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	3,714,388,538円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,088,650,822円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	12,119,282,379円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	139,098,660円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	412,404,064円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	3,053,831,224円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	215,852,410円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	360,987,794円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,138,268,790円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	384,180,509円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	895,841,446円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	95,664,647円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	3,640,602,245円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,637,345,530円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	26,943,237,172円



区分	2020年 8月21日現在
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	488,893,364円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	148,108,551円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	43,077,705円
V Aバランス2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	652,641,822円
私募日本債券インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	2,294,834円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（2020年 8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	303,860,000	-	303,700,000	160,000
	合計	303,860,000	-	303,700,000	160,000

（注）1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 外国株式マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	2020年 8月21日現在
	金額(円)
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
預金	4,663,600,688
コール・ローン	1,232,178,340
株式	216,004,110,295
投資信託受益証券	151,228,932
投資証券	5,117,143,177
派生商品評価勘定	638,454,199
未収入金	1,013,256
未収配当金	297,245,864
差入委託証拠金	3,301,922,737
流動資産合計	231,406,897,488
<b>資産合計</b>	231,406,897,488
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	25,475,271
前受金	618,074,405
未払解約金	267,568,614
未払利息	1,882

	2020年 8月21日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	911,120,172
負債合計	911,120,172
純資産の部	
元本等	
元本	75,708,862,792
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,786,914,524
元本等合計	230,495,777,316
純資産合計	230,495,777,316
負債純資産合計	231,406,897,488

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2020年 8月21日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2020年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	75,708,862,792口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0445円 (1万口当たり純資産額) (30,445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 8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

2020年 8月21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 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 2月22日
期首元本額	73,774,978,389円
期中追加設定元本額	9,458,482,953円
期中一部解約元本額	7,524,598,550円
期末元本額	75,708,862,792円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,644,679,973円
DC外国株式インデックスファンド	4,599,727,115円
DC外国株式インデックスファンドL	22,746,705,448円
DCバランスファンド30	715,104,324円
DCバランスファンド50	1,464,464,915円

区分	2020年 8月21日現在
DCバランスファンド70	868,014,697円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	362,901,058円
外国株式インデックスe	5,185,292,288円
インデックスコレクション（外国株式）	10,404,315,973円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,979,020,722円
インデックスコレクション（バランス株式50）	990,971,250円
インデックスコレクション（バランス株式70）	831,234,032円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	6,988,364,880円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,504,160,956円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	787,193,423円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	47,065,581円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	532,573,783円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	62,799,246円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	209,478,836円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	1,038,331円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,282,101,924円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	441,661,310円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	310,779,403円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,818,573,181円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	582,106,401円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	235,293,885円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	968,495,965円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	25,676,615円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	116,425,403円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	136,992,637円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	426,188,336円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	22,768,758円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	101,098,441円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	310,410,021円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	5,183,681円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,801,805,108	-	9,419,879,513	618,074,405
合計		8,801,805,108	-	9,419,879,513	618,074,405

## (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 8月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,243,886,501	-	1,238,664,368	5,222,133
	アメリカドル	937,622,611	-	931,342,023	6,280,588
	ユーロ	200,325,000	-	200,840,000	515,000
	イギリスポンド	105,938,890	-	106,482,345	543,455
	売建	33,947,456	-	33,820,800	126,656
	アメリカドル	33,947,456	-	33,820,800	126,656
合計		1,277,833,957	-	1,272,485,168	5,095,477

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2020年 8月21日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	274,136,793
コール・ローン	1,030,834,413
国債証券	143,130,292,067
派生商品評価勘定	2,511,004
未収入金	1,100,757
未収利息	795,944,265
前払金	1,649,608
前払費用	37,066,915
差入委託証拠金	360,495,077
流動資産合計	145,634,030,899
資産合計	145,634,030,899

	2020年 8月21日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,415,082
未払金	727,936
未払解約金	204,759,715
未払利息	1,574
流動負債合計	210,904,307
負債合計	210,904,307
純資産の部	
元本等	
元本	56,214,643,316
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,208,483,276
元本等合計	145,423,126,592
純資産合計	145,423,126,592
負債純資産合計	145,634,030,899

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)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>

	2020年 8月21日現在
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,214,643,316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 2.5869円 (1万口当たり純資産額) (25,869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 8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>



	2020年 8月21日現在

（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 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 2月22日
期首元本額	56,765,977,261円
期中追加設定元本額	5,749,978,135円
期中一部解約元本額	6,301,312,080円
期末元本額	56,214,643,316円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,175,011,442円
DC外国債券インデックスファンド	2,112,172,339円
DC外国債券インデックスファンドL	13,308,907,068円
DCバランスファンド30	827,371,934円
DCバランスファンド50	811,346,547円
DCバランスファンド70	164,830,525円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	417,587,099円
外国債券インデックスe	1,188,966,401円
インデックスコレクション（外国債券）	7,147,422,829円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,389,954,737円
インデックスコレクション（バランス株式50）	551,935,936円
インデックスコレクション（バランス株式70）	145,594,343円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,999,387,330円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,735,327,782円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	574,011,579円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	121,857,681円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	604,759,436円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	341,285,733円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	379,442,806円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	582,803円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,292,138,917円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,791,869,307円

区分	2020年 8月21日現在
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	642,548,172円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,741,319,683円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	337,219,731円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	310,845,670円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,644,468,788円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	116,240,977円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	197,047,176円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	103,420,548円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	53,600,861円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	102,992,766円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	273,353,503円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	78,559,345円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,522,792,397円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	8,469,125円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（2020年 8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,160,942,489	-	1,159,292,881	1,649,608
	合計	1,160,942,489	-	1,159,292,881	1,649,608

（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 8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	889,034,070	-	887,779,600	1,254,470
	アメリカドル	391,817,707	-	388,828,800	2,988,907
	カナダドル	48,806,074	-	48,934,200	128,126

	ユーロ	369,144,301	-	370,313,500	1,169,199
	イギリスポンド	79,265,988	-	79,703,100	437,112
	合計	889,034,070	-	887,779,600	1,254,470

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【DCバランスファンド30】

## 【純資産額計算書】

(2020年 9月30日現在)

資産総額	21,375,310,035円
負債総額	31,101,832円
純資産総額（ - ）	21,344,208,203円
発行済口数	14,662,169,835口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4557円
（1万口当たり純資産額）	（14,557円）

## 【DCバランスファンド50】

## 【純資産額計算書】

(2020年 9月30日現在)

資産総額	21,472,700,835円
負債総額	24,961,399円
純資産総額（ - ）	21,447,739,436円
発行済口数	13,611,092,882口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5758円
（1万口当たり純資産額）	（15,758円）

## 【DCバランスファンド70】

## 【純資産額計算書】

(2020年 9月30日現在)

資産総額	8,753,598,563円
負債総額	6,444,587円
純資産総額（ - ）	8,747,153,976円
発行済口数	5,332,108,967口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6405円
（1万口当たり純資産額）	（16,405円）

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 9月30日現在)

資産総額	253,025,251,946円
負債総額	92,640,314円
純資産総額（ - ）	252,932,611,632円
発行済口数	140,778,653,363口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7967円
（1万口当たり純資産額）	（17,967円）

## 日本債券マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 9月30日現在)

資産総額	374,586,845,685円
負債総額	4,110,868,696円
純資産総額（ - ）	370,475,976,989円
発行済口数	268,847,636,058口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3780円
（1万口当たり純資産額）	（13,780円）

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 9月30日現在)

資産総額	245,321,297,364円
負債総額	220,809,796円
純資産総額（ - ）	245,100,487,568円
発行済口数	81,653,808,444口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0017円
（1万口当たり純資産額）	（30,017円）

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 9月30日現在)

資産総額	145,414,887,724円
負債総額	94,848,876円
純資産総額（ - ）	145,320,038,848円
発行済口数	56,358,150,872口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5785円
（1万口当たり純資産額）	（25,785円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2020年9月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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



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

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2020年11月20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9月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	523	12,894,768
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	80	296,836
単位型公社債投資信託	38	268,815
合計	641	13,460,419

## 3【委託会社等の経理状況】

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

なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

- (2) 委託者の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、当事業年度より百万円単位で記載することに変更いたしました。
- (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、当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,830	24,869
金銭の信託	-	5,823
有価証券	2,268	-
前払費用	197	348
未収委託者報酬	6,351	7,284
未収運用受託報酬	5,525	5,842
未収収益	212	190
その他	2,261	4,624
流動資産合計	40,648	48,983
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 282	1 256
器具備品	1 564	1 576
その他	1 14	1 0
有形固定資産合計	861	832
無形固定資産		
ソフトウェア	1,487	3,030
その他	7	40
無形固定資産合計	1,494	3,070
投資その他の資産		
投資有価証券	11,334	8,469
関係会社株式	4,663	5,636
繰延税金資産	141	700
その他	32	35
投資その他の資産合計	16,171	14,842
固定資産合計	18,527	18,745
資産合計	59,176	67,729

（単位：百万円）

	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	38
未払金	5,327	7,988
未払収益分配金	0	0
未払手数料	2,718	3,355
その他未払金	2,608	4,632
未払費用	178	204
未払法人税等	1,992	897
賞与引当金	132	324
その他	395	1,070
流動負債合計	8,063	10,524
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	537	600
資産除去債務	131	132
その他	0	7
固定負債合計	669	740
負債合計	8,733	11,264
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	75	305
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	28,501	35,122
利益剰余金合計	30,676	37,528
株主資本合計	49,916	56,767
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	393	587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 自 2018年4月1日 至 2019年3月31日 )	当事業年度 ( 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	30,551	34,967
運用受託報酬	5,464	11,091
その他営業収益	283	500
営業収益合計	36,299	46,559
営業費用		
支払手数料	13,423	15,998
広告宣伝費	276	331
公告費	1	0
調査費	5,508	5,018
調査費	567	788
委託調査費	4,935	4,217
図書費	5	11
営業雑経費	2,315	3,434
通信費	45	52
印刷費	449	470
協会費	38	53
諸会費	5	16
情報機器関連費	1,657	2,726
その他営業雑経費	118	114
営業費用合計	21,525	24,783
一般管理費		
給料	3,931	5,756
役員報酬	161	244
給料・手当	3,425	4,962
賞与	343	549
退職給付費用	98	118
福利費	297	535
交際費	9	14
旅費交通費	141	190
租税公課	270	344
不動産賃借料	219	269
寄付金	8	7
減価償却費	152	334
業務委託費	657	864
諸経費	433	750
一般管理費合計	6,219	9,185
営業利益	8,554	12,589

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取利息	11	15
収益分配金	8	119
投資有価証券売却益	46	483
投資有価証券償還益	0	316
為替差益	-	273
デリバティブ利益	250	666
貸倒引当金戻入	17	-
その他	5	30
営業外収益合計	340	1,906
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	1,076
投資有価証券売却損	34	4
投資有価証券償還損	1	19
固定資産除却損	7	19
為替差損	198	-
その他	3	0
営業外費用合計	245	1,118
経常利益	8,649	13,377
特別損失		
統合関連費用	286	-
システム統合費用	49	149
特別損失合計	355	149
税引前当期純利益	8,313	13,227
法人税、住民税及び事業税	2,674	4,263
法人税等調整額	125	193
法人税等合計	2,549	4,070
当期純利益	5,764	9,157

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74	2,100	22,767	24,942	25,592
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
剰余金の配当	0		30	30	30
当期純利益			5,764	5,764	5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	0	-	5,734	5,734	24,323
当期末残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916

	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	0	-	0	25,592
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
剰余金の配当				30
当期純利益				5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393	133	526	526
当期変動額合計	393	133	526	24,850
当期末残高	393	133	526	50,442

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
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	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
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	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	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				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

## 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. 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、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。

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、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。

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。

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。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

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		当事業年度	
	(2019年3月31日)		(2020年3月31日)	
建 物	53	百万円	77	百万円
器具備品	351	"	285	"
そ の 他	3	"	4	"
計	408	"	367	"



## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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(百万円)	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	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

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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(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

## 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

2020年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益 剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

## （リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.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（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830	23,830	-
(2) 金銭の信託	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	6,351	6,351	-
(4) 未収運用受託報酬	5,525	5,525	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	13,602	13,602	-
(6) 未払金	(5,327)	(5,327)	-
(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	(0)	(0)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82	82	-
デリバティブ取引計	81	81	-

(\*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。

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(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	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

(\*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

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) 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。

(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) 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：百万円）

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

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、「(5)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（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830	-	-	-
未収委託者報酬	6,351	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

(有価証券関係)

#### 1. 子会社株式

前事業年度（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：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020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：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

#### 2. 其他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,405	3,432	973

小計	4,405	3,432	973
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	9,602	406
小計	9,196	9,602	406
合計	13,602	13,035	566

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

（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。

## 3．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（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 (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	887	-	3	3
	英ポンド	66	-	1	1
	カナダドル	3	-	0	0
	スイスフラン	7	-	0	0
	香港ドル	183	-	0	0
	ユーロ	183	-	2	2
	買建				
	米ドル	10	-	0	0
	スイスフラン	1	-	0	0
	香港ドル	0	-	0	0
ユーロ	2	-	0	0	
合計	1,346	-	7	7	

(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	6,739	-	8	8
合計		6,739	-	8	8

(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 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建					
	米ドル	有価証券 投資有価証券 子会社株式	3,432	-	13	
	英ポンド		2,575	-	50	
	カナダドル		40	-	0	
	スイスフラン		34	-	0	
	香港ドル		566	-	2	
	人民元		1,725	-	9	
	ユーロ		262	-	6	
	買建					
	ユーロ		6	-	0	
	合計		8,643	-	82	

(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。

当事業年度（2020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 (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	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(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	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

(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 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
合計			5,666	-	114

(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. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

## (2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度19百万円、当事業年度44百万円であります。

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	125	百万円	168	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40	"	99	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	164	"	183	"
有価証券評価差額	-		259	"
その他	82	"	151	"
繰延税金資産 合計	413	"	862	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	173	"	-	
繰延ヘッジ損益	58	"	125	"
その他	38	"	35	"
繰延税金負債 合計	271	"	161	"
繰延税金資産の純額	141	"	700	"

## 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。

## (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 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	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

## (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 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（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	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	未収運用受託報酬	4,903
							投信販売代行手数料等	9,564	未払手数料	1,774
							投資助言費用	3,357	その他未払金	182
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603 13,907 4,663 13 18,589 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。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

## (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（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）

当事業年度（2020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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常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。

と。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年11月20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（2020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） （2020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 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）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**

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 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

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の監査報告書

2020年4月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド30の2019年2月22日から2020年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド30の2020年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2020年4月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド50の2019年2月22日から2020年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド50の2020年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2020年4月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド70の2019年2月22日から2020年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド70の2020年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年10月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド30の2020年2月22日から2020年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド30の2020年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年2月22日から2020年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年10月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド50の2020年2月22日から2020年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド50の2020年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年2月22日から2020年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年10月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド70の2020年2月22日から2020年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド70の2020年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年2月22日から2020年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。