【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年12月28日提出
【計算期間】	第19期(自 2019年10月1日至 2020年9月30日)
【ファンド名】	ＤＣマイセレクション７５
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

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

＜信託金限度額＞

上限　3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、短期金融資産）資産配分固定型）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他 （　）	グローバル（日本を含む） 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） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　） なし	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 （　　）	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ショート型/絶対収益追求型 その他 （　　）

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（http://www.toushin.or.jp/）でもご覧いただけます。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

(1)国内…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)海外…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［独立した区分］

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

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

［補足分類］

(1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

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

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］

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

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

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

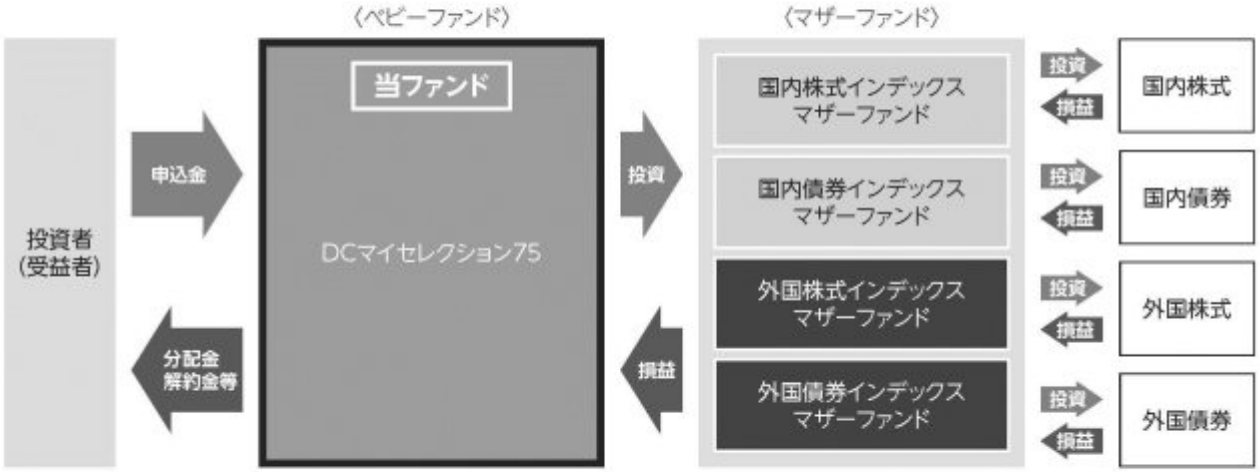
(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

＜ファンドの特色＞

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。

ファンドのしくみ



? ファミリーファンド方式とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

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

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

※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※2 「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。

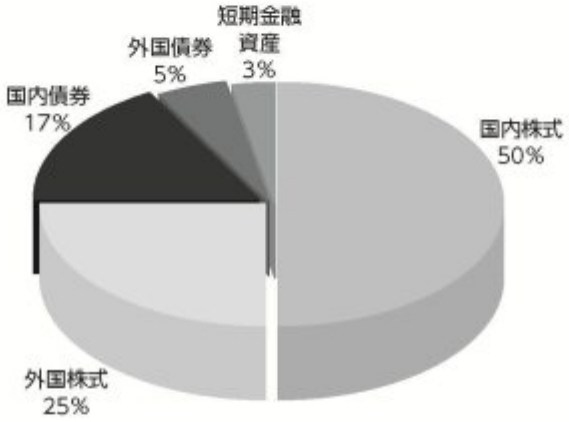
※3 「MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※4 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」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。

3. 期待リターンとリスクのバランスを勘案し、国内株式50%、外国株式25%、国内債券17%、外国債券5%、短期金融資産3%を基準ポートフォリオとして運用します。

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

基準ポートフォリオ



ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築	ファンドマネジャー	●基準ポートフォリオに従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分
リバランス実施	ファンドマネジャー	●資産配分比率が基準ポートフォリオから一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

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

主な投資制限

●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
●外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以下とします。

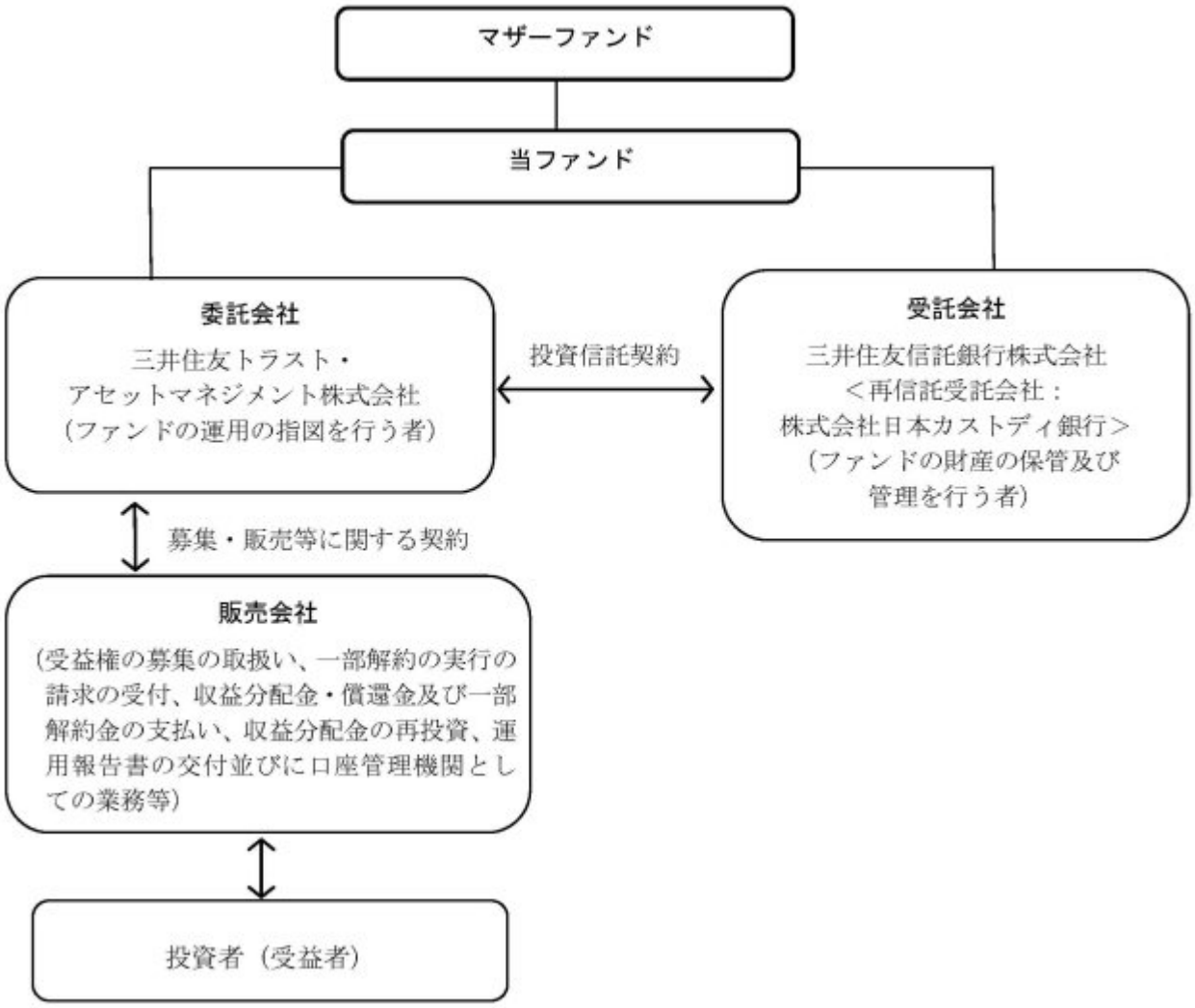
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2001年10月1日	**本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始**
2012年4月 1日	**本ファンドの名称を「すみしん DCマイセレクション75」から「DCマイセレクション75」に変更** **本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス　マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス　マザーファンド」に、「住信 国内債券インデックス　マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス　マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス　マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス　マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス　マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス　マザーファンド」にそれぞれ変更**

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2020年10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】

（イ）基本方針

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

（ロ）運用方法

①投資対象

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

②投資態度

1)主として、マザーファンド受益証券への投資を通して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。

2)基準ポートフォリオは、国内株式50%、国内債券17%、外国株式25%、外国債券5%および短期金融資産3%の比率で基準配分します。

3)各資産につき、上記の基本アロケーションにおける各資産毎の比率に一定の変動幅を設けます。市況動向等に応じて、基本アロケーションは1年に1回程度、若干の見直しを行う場合があります。

4)実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上をはかるため、為替のエクスポージャーのコントロールを行う場合があります。

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

6)投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

（2）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託会社は、信託金を主として次に掲げる第1号から第4号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに第5号から第26号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. **国内株式インデックス　マザーファンド**
2. **国内債券インデックス　マザーファンド**
3. **外国株式インデックス　マザーファンド**
4. **外国債券インデックス　マザーファンド**
5. **株券または新株引受権証書**
6. **国債証券**
7. **地方債証券**
8. **特別の法律により法人の発行する債券**
9. **社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）**
10. **資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）**
11. **特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）**
12. **協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）**
13. **資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）**
14. **コマーシャル・ペーパー**
15. **新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券**
16. **外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの**
17. **証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）**
18. **投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）**
19. **外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）**
20. **オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）**
21. **預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）**
22. **外国法人が発行する譲渡性預金証書**
23. **指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）**
24. **抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）**
25. **貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの**
26. **外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの**

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するもの、および第18号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

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

(参考)マザーファンドの概要

「国内株式インデックス　マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

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

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総

額の10%以下とします。
④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「国内債券インデックス　マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純

資産総額の10%以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国株式インデックス　マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国債券インデックス　マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

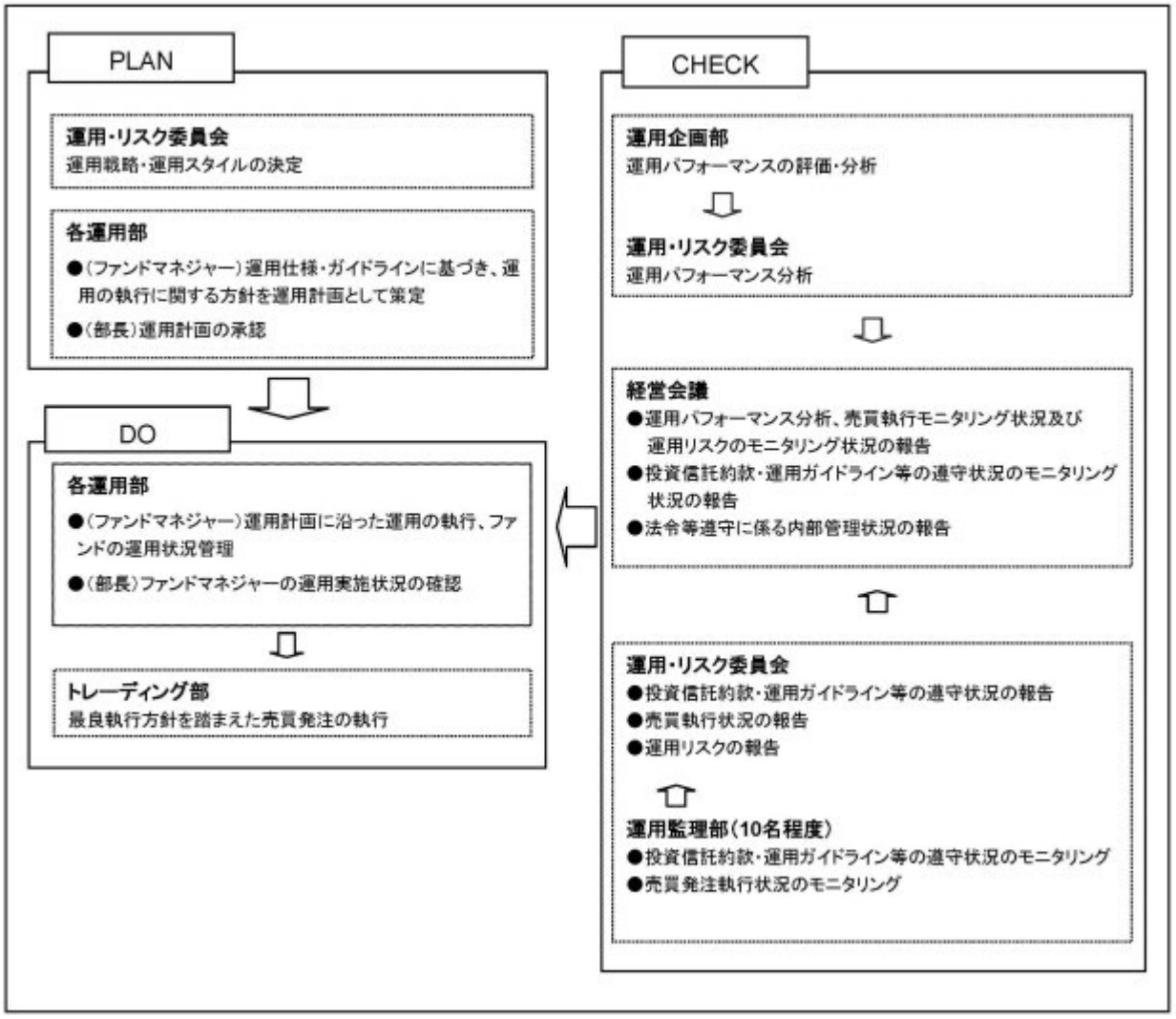
③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（３）【運用体制】

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



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

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

（4）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、収益分配を行います。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

①株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
④同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
⑥マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
⑦外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
⑧委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）
⑨委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しに

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

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

⑩委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。（投資信託約款第23条）

⑪委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第24条）

⑫委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財

産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。（投資信託約款第25条）

⑬委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第26条）

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

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

⑭委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第27条）

⑮委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第28条）

⑯委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第31条）

⑰委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第39条）

⑱一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑲デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

※前記①から⑦における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記①から⑦に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記⑪、⑫および⑯における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(イ)ファンドのリスク

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

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

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

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事

態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

③ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

④確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

(ロ)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

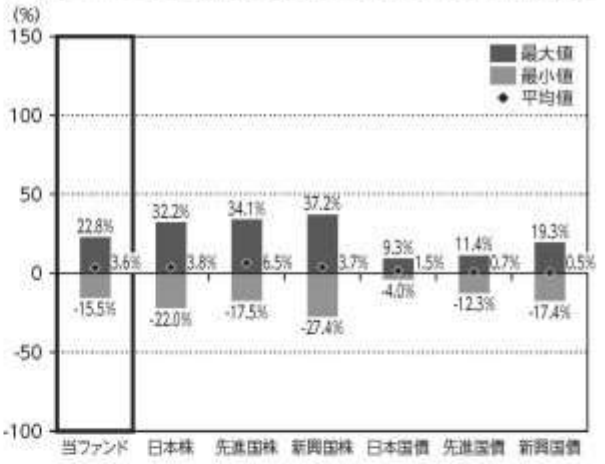
〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2015年11月～2020年10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 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

ご解約時に、信託財産留保額（※）の控除はありません。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.352%（税抜　0.32%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.187%　　（税抜　0.17%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.132%　　（税抜　0.12%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.033%　　（税抜　0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、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】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、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を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

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10月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。
※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

以下は、2020年10月30日現在の状況について記載してあります。

【ＤＣマイセレクション７５】

（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	52,771,148,069	97.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,492,675,996	2.75
合計(純資産総額)		54,263,824,065	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス　マザーファンド	18,201,910,292	1.5496	28,206,688,162	1.5059	27,410,256,708	50.51
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス　マザーファンド	5,022,642,742	2.8167	14,147,682,292	2.7382	13,753,000,356	25.34
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス　マザーファンド	6,388,096,461	1.4102	9,009,115,904	1.4082	8,995,717,436	16.58

日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス　マザーファンド	887,739,531	2.9852	2,650,140,227	2.9425	2,612,173,569	4.81

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.25
合計	97.25

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第10期計算期間末　(2011年 9月30日)	17,023,679,540	17,023,679,540	9,740	9,740
第11期計算期間末　(2012年10月 1日)	19,440,154,386	19,440,154,386	10,260	10,260
第12期計算期間末　(2013年 9月30日)	28,620,541,787	28,620,541,787	14,959	14,959
第13期計算期間末　(2014年 9月30日)	33,482,824,281	33,482,824,281	17,076	17,076
第14期計算期間末　(2015年 9月30日)	35,594,656,829	35,594,656,829	18,009	18,009
第15期計算期間末　(2016年 9月30日)	36,342,020,872	36,342,020,872	17,450	17,450
第16期計算期間末　(2017年10月 2日)	45,362,951,367	45,362,951,367	21,401	21,401
第17期計算期間末　(2018年10月 1日)	52,993,517,919	52,993,517,919	23,203	23,203
第18期計算期間末　(2019年 9月30日)	51,706,907,032	51,706,907,032	21,959	21,959
第19期計算期間末　(2020年 9月30日)	55,287,709,785	55,287,709,785	23,161	23,161
2019年10月末日	53,539,882,314	—	22,725	—
11月末日	54,437,653,044	—	23,149	—
12月末日	55,261,869,761	—	23,488	—
2020年 1月末日	54,843,048,766	—	23,257	—
2月末日	50,909,428,986	—	21,664	—
3月末日	47,197,542,441	—	20,229	—
4月末日	49,275,955,644	—	21,156	—

5月末日	52,031,951,358	—	22,101	—
6月末日	52,590,493,452	—	22,185	—
7月末日	52,196,573,413	—	21,937	—
8月末日	55,211,833,723	—	23,239	—
9月末日	55,287,709,785	—	23,161	—
10月末日	54,263,824,065	—	22,635	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	0
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	0
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	0
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	0
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	△5.8
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	5.3
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	45.8
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	14.2
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	5.5
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	△3.1
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	22.6
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	8.4
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	△5.4
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	5.5

(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10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	3,149,786,275	1,276,681,816	17,477,796,006
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	2,819,375,711	1,350,257,742	18,946,913,975
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	3,425,315,153	3,238,964,390	19,133,264,738
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	2,840,594,590	2,365,992,578	19,607,866,750
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	3,273,383,820	3,115,996,674	19,765,253,896
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	2,775,993,818	1,714,409,012	20,826,838,702
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	3,008,685,113	2,638,389,799	21,197,134,016
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	3,893,957,849	2,252,056,125	22,839,035,740
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	3,074,624,736	2,366,988,957	23,546,671,519
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	3,708,520,735	3,384,312,227	23,870,880,027

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

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	332,970,657,080	98.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	5,534,394,654	1.63
合計(純資産総額)		338,505,051,734	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	5,489,770,000	1.62

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,680,600	6,787.37	11,406,856,848	6,803.00	11,433,121,800	3.38
日本	株式	ソニー	電気機器	943,500	7,020.11	6,623,482,548	8,674.00	8,183,919,000	2.42
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,172,800	4,989.37	5,851,543,072	6,793.00	7,966,830,400	2.35
日本	株式	キーエンス	電気機器	136,500	44,423.06	6,063,749,046	47,250.00	6,449,625,000	1.91
日本	株式	任天堂	その他製品	92,400	44,954.11	4,153,759,922	56,980.00	5,264,952,000	1.56
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,975,800	2,438.29	4,817,590,122	2,196.00	4,338,856,800	1.28
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	10,162,200	444.34	4,515,568,988	410.20	4,168,534,440	1.23
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	1,056,900	2,946.51	3,114,168,972	3,887.00	4,108,170,300	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,031,100	3,750.75	3,867,405,990	3,970.00	4,093,467,000	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,253,200	4,155.65	5,207,865,936	3,239.00	4,059,114,800	1.20
日本	株式	日本電産	電気機器	362,600	6,866.33	2,489,733,740	10,500.00	3,807,300,000	1.12
日本	株式	ダイキン工業	機械	191,900	16,225.65	3,113,702,575	19,480.00	3,738,212,000	1.10
日本	株式	第一三共	医薬品	1,293,100	3,327.22	4,302,438,576	2,748.00	3,553,438,800	1.05
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	298,800	10,181.68	3,042,288,426	11,800.00	3,525,840,000	1.04
日本	株式	信越化学工業	化学	253,300	12,700.73	3,217,095,964	13,890.00	3,518,337,000	1.04
日本	株式	村田製作所	電気機器	442,500	6,086.78	2,693,402,508	7,267.00	3,215,647,500	0.95
日本	株式	ファナック	電気機器	141,600	19,312.76	2,734,687,446	22,050.00	3,122,280,000	0.92
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,077,600	3,119.61	3,361,702,266	2,792.50	3,009,198,000	0.89
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,027,400	3,124.23	3,209,840,427	2,881.00	2,959,939,400	0.87
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,185,900	2,779.44	3,296,139,690	2,435.00	2,887,666,500	0.85
日本	株式	花王	化学	360,600	8,599.94	3,101,140,176	7,420.00	2,675,652,000	0.79
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	95,600	22,122.78	2,114,938,518	27,900.00	2,667,240,000	0.79
日本	株式	ＳＭＣ	機械	47,300	54,743.84	2,589,383,780	55,300.00	2,615,690,000	0.77
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,037,600	2,348.49	2,436,800,745	2,500.00	2,594,000,000	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,018,600	1,352.10	2,729,359,725	1,281.50	2,586,835,900	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	723,800	3,473.38	2,514,039,259	3,502.00	2,534,747,600	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	525,200	4,694.85	2,465,736,064	4,659.00	2,446,906,800	0.72
日本	株式	三菱商事	卸売業	972,700	2,516.63	2,447,931,021	2,325.50	2,262,013,850	0.67
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	153,100	15,492.96	2,371,973,600	14,585.00	2,232,963,500	0.66
日本	株式	エムスリー	サービス業	317,400	4,517.47	1,433,845,896	7,027.00	2,230,369,800	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.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.14

		建設業	2.35
		食料品	3.57
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.33
		医薬品	5.75
		石油・石炭製品	0.38
		ゴム製品	0.56
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.56
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.59
		機械	5.44
		電気機器	15.91
		輸送用機器	7.02
		精密機器	2.66
		その他製品	2.73
		電気・ガス業	1.38
		陸運業	3.43
		海運業	0.16
		空運業	0.31
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	10.34
		卸売業	4.48
		小売業	4.94
		銀行業	4.66
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	1.93
		その他金融業	1.07
		不動産業	1.89
		サービス業	5.66
		小計	98.37
合計			98.37

(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	349	円	5,697,757,600	5,489,770,000	1.62

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

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

国内債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	497,283,822,300	83.53
地方債証券	日本	32,377,931,081	5.44
特殊債券	日本	39,575,557,443	6.65
社債券	日本	22,977,254,250	3.86
	フランス	1,390,455,000	0.23
	オーストラリア	400,928,000	0.07
	アメリカ	203,920,000	0.03
	小計	24,972,557,250	4.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,100,380,193	0.18
合計(純資産総額)		595,310,248,267	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	9,420,000,000	100.91	9,505,816,200	100.72	9,488,106,600	0.100	2023/12/20	1.59
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	7,420,000,000	100.99	7,494,153,800	100.87	7,485,073,400	0.100	2024/9/20	1.26
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	7,300,000,000	100.99	7,372,854,000	100.82	7,359,860,000	0.100	2024/6/20	1.24
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,900,000,000	100.86	6,959,547,000	100.67	6,946,851,000	0.100	2023/9/20	1.17
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	6,820,000,000	100.98	6,887,405,200	100.97	6,886,631,400	0.100	2025/6/20	1.16
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	6,640,000,000	101.42	6,734,288,000	101.18	6,718,551,200	0.100	2026/9/20	1.13
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	102.83	6,498,856,000	102.45	6,475,029,600	0.400	2025/9/20	1.09

日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	6,380,000,000	101.31	6,463,833,200	101.08	6,448,967,800	0.100	2026/3/20	1.08
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	5,850,000,000	100.67	5,889,195,000	100.51	5,880,010,500	0.100	2022/12/20	0.99
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	5,790,000,000	101.53	5,878,702,800	101.29	5,865,154,200	0.100	2028/3/20	0.99
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	5,670,000,000	101.07	5,730,669,000	100.93	5,722,957,800	0.100	2024/12/20	0.96
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	5,200,000,000	101.47	5,276,596,000	101.25	5,265,052,000	0.100	2027/3/20	0.88
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	5,050,000,000	102.72	5,187,360,000	102.37	5,169,836,500	0.400	2025/6/20	0.87
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	5,090,000,000	100.88	5,135,160,200	100.93	5,137,489,700	0.100	2029/9/20	0.86
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	5,030,000,000	101.24	5,092,514,500	101.09	5,084,877,300	0.100	2029/3/20	0.85
日本	国債証券	第１３１回利付国債（５年）	4,990,000,000	100.46	5,013,403,100	100.31	5,005,818,300	0.100	2022/3/20	0.84
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	4,890,000,000	101.48	4,962,391,100	101.26	4,951,858,500	0.100	2028/6/20	0.83
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	4,870,000,000	101.22	4,929,414,000	101.03	4,920,501,900	0.100	2029/6/20	0.83
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	4,840,000,000	101.50	4,912,987,200	101.28	4,901,952,000	0.100	2027/9/20	0.82
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	4,760,000,000	100.93	4,804,713,200	100.76	4,796,318,800	0.100	2024/3/20	0.81
日本	国債証券	第１３２回利付国債（５年）	4,770,000,000	100.54	4,795,996,500	100.38	4,788,269,100	0.100	2022/6/20	0.80
日本	国債証券	第３２０回利付国債（１０年）	4,570,000,000	101.81	4,652,899,800	101.27	4,628,221,800	1.000	2021/12/20	0.78
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	4,470,000,000	101.37	4,531,462,500	101.14	4,521,047,400	0.100	2028/12/20	0.76
日本	国債証券	第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	100.61	4,406,805,600	100.46	4,400,235,600	0.100	2022/9/20	0.74
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	4,250,000,000	102.61	4,360,940,300	102.27	4,346,857,500	0.600	2023/12/20	0.73
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	4,260,000,000	101.46	4,322,272,100	101.22	4,312,270,200	0.100	2028/9/20	0.72
日本	国債証券	第４１７回利付国債（２年）	4,100,000,000	100.46	4,119,077,400	100.45	4,118,450,000	0.100	2022/10/1	0.69
日本	国債証券	第１３５回利付国債（５年）	4,080,000,000	100.75	4,110,967,200	100.56	4,102,848,000	0.100	2023/3/20	0.69
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	4,050,000,000	101.33	4,104,206,000	101.13	4,095,846,000	0.100	2026/6/20	0.69
日本	国債証券	第４１６回利付国債（２年）	3,990,000,000	100.47	4,009,041,900	100.44	4,007,556,000	0.100	2022/9/1	0.67

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.53
地方債証券	5.44
特殊債券	6.65
社債券	4.19
合計	99.82

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	273,160,714,510	65.79
	イギリス	16,440,014,441	3.96
	スイス	14,331,230,766	3.45
	カナダ	13,468,363,883	3.24
	フランス	12,656,371,097	3.05
	ドイツ	11,611,435,924	2.80
	オーストラリア	8,001,187,866	1.93
	オランダ	7,706,925,765	1.86
	アイルランド	7,162,758,590	1.73
	スウェーデン	4,024,150,156	0.97
	デンマーク	3,381,464,519	0.81
	香港	3,246,398,748	0.78
	スペイン	2,910,784,325	0.70
	イタリア	2,242,995,768	0.54
	フィンランド	1,545,383,492	0.37
	バミューダ	1,306,122,027	0.31
	ベルギー	1,142,943,739	0.28
	シンガポール	1,140,846,010	0.27
	ジャージー	915,595,785	0.22
	イスラエル	781,635,698	0.19
	ケイマン	766,155,484	0.18
	ノルウェー	692,933,395	0.17
	ニュージーランド	443,156,127	0.11
	ルクセンブルク	290,444,144	0.07
	ポルトガル	222,352,322	0.05
	オーストリア	210,935,234	0.05
	キュラソー	199,432,421	0.05
	リベリア	87,854,533	0.02

	マン島	78,022,901	0.02
	パナマ	54,771,298	0.01
	パプアニューギニア	27,577,126	0.01
	小計	390,250,958,094	93.99
投資信託受益証券	オーストラリア	182,198,192	0.04
	香港	74,242,575	0.02
	小計	256,440,767	0.06
投資証券	アメリカ	7,766,149,315	1.87
	オーストラリア	533,912,477	0.13
	イギリス	205,978,764	0.05
	シンガポール	194,235,252	0.05
	フランス	182,969,582	0.04
	香港	161,592,975	0.04
	カナダ	68,624,165	0.02
	小計	9,113,462,530	2.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	15,600,865,711	3.76
合計(純資産総額)		415,221,727,102	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,277,981,937	2.72
	買建	カナダ	760,470,828	0.18
	買建	ドイツ	2,307,939,809	0.56
	買建	イギリス	878,087,632	0.21
	買建	オーストラリア	447,629,308	0.11

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

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

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	―	931,892,800	0.22

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,632,757	8,432.99	13,769,024,931	12,062.47	19,695,085,595	4.74
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	678,610	19,056.20	12,931,732,045	21,413.71	14,531,559,100	3.50
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	39,938	253,585.34	10,127,691,316	335,871.64	13,414,041,798	3.23
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	226,861	23,728.47	5,383,065,569	29,374.81	6,664,000,586	1.60
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	28,424	148,538.51	4,222,058,703	163,933.30	4,659,640,233	1.12
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	28,190	148,678.21	4,191,238,782	162,849.64	4,590,731,577	1.11
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	247,547	15,379.88	3,807,243,693	14,350.07	3,552,317,768	0.86
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	232,638	12,213.39	2,841,300,812	14,389.82	3,347,619,410	0.81
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	280,020	11,783.20	3,299,532,144	11,783.29	3,299,559,386	0.79
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	57,796	36,160.00	2,089,903,819	54,492.41	3,149,443,675	0.76
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	158,538	20,356.40	3,227,263,095	19,337.40	3,065,713,038	0.74
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	69,867	17,925.20	1,252,380,304	42,972.81	3,002,381,875	0.72
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	286,357	10,444.81	2,990,946,119	10,163.98	2,910,527,394	0.70
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	101,081	25,770.33	2,604,891,383	28,203.29	2,850,817,565	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	89,134	31,805.11	2,834,917,389	31,764.92	2,831,335,092	0.68
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	130,701	19,482.33	2,546,360,521	21,077.94	2,754,908,620	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	83,996	31,754.23	2,667,228,338	30,666.62	2,575,874,085	0.62
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	388,985	5,846.81	2,274,324,276	5,937.09	2,309,441,288	0.56
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	66,166	38,972.67	2,578,665,918	33,589.83	2,222,504,758	0.54

アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	45,295	40,078.68	1,815,364,186	48,232.10	2,184,673,241	0.53
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	41,353	43,508.55	1,799,209,324	52,740.36	2,180,972,355	0.53
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	169,806	12,266.70	2,082,959,348	12,713.08	2,158,757,942	0.52
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	104,882	15,688.12	1,645,401,511	20,401.18	2,139,716,980	0.52
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	84,561	19,570.33	1,654,887,276	24,804.84	2,097,522,413	0.51
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	133,237	12,984.21	1,729,977,471	14,635.63	1,950,007,701	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	428,273	4,163.43	1,783,086,791	4,504.07	1,928,974,141	0.46
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	522,315	3,988.53	2,083,274,116	3,690.28	1,927,492,777	0.46
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	383,648	4,938.13	1,894,504,049	5,022.89	1,927,022,470	0.46
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	237,327	8,292.24	1,967,974,605	7,938.09	1,883,924,035	0.45
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	669,946	3,242.27	2,172,146,895	2,799.09	1,875,243,169	0.45

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別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	2.44
		素材	4.22
		資本財	5.94
		商業・専門サービス	1.17
		運輸	2.00
		自動車・自動車部品	1.53
		耐久消費財・アパレル	1.84
		消費者サービス	1.49
		メディア・娯楽	6.82
		小売	6.21
		食品・生活必需品小売り	1.51
		食品・飲料・タバコ	4.18
		家庭用品・パーソナル用品	2.14
		ヘルスケア機器・サービス	5.25
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.89

		銀行	4.87
		各種金融	4.00
		保険	2.85
		不動産	0.46
		ソフトウェア・サービス	11.80
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.10
		電気通信サービス	1.90
		公益事業	3.42
		半導体・半導体製造装置	3.96
		小計	93.99
投資信託受益証券	—	—	0.06
投資証券	—	—	2.19
合計			96.24

(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	653	アメリカドル	110,113,198.5	11,517,840,563	107,820,095	11,277,981,937	2.72
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	52	カナダドル	10,067,922	790,835,273	9,681,360	760,470,828	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	58	スイスフラン	5,968,246	682,110,835	5,539,000	633,052,310	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	465	ユーロ	15,051,652.5	1,838,408,836	13,712,850	1,674,887,499	0.40
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	41	オーストラリアドル	6,077,837	447,146,468	6,084,400	447,629,308	0.11
	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	117	イギリスポンド	6,962,973.75	941,742,199	6,492,330	878,087,632	0.21

(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	6,550,000.00	684,014,500	685,064,500	0.16
	カナダドル	買建	500,000.00	39,231,200	39,270,000	0.01
	ユーロ	買建	850,000.00	104,168,600	103,819,000	0.03
	イギリスポンド	買建	400,000.00	54,226,400	54,096,000	0.01
	スイスフラン	買建	370,000.00	42,391,290	42,287,300	0.01
	オーストラリアドル	買建	100,000.00	7,357,000	7,356,000	0.00

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

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

外国債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	119,040,542,762	43.18
	フランス	28,612,362,785	10.38
	イタリア	25,359,153,908	9.20
	ドイツ	20,844,569,336	7.56
	イギリス	17,646,734,566	6.40
	スペイン	16,405,154,561	5.95
	オーストラリア	6,906,192,850	2.51
	ベルギー	6,781,669,287	2.46
	オランダ	5,288,077,207	1.92
	カナダ	5,044,555,567	1.83
	オーストリア	4,045,025,459	1.47
	アイルランド	2,235,157,652	0.81
	メキシコ	2,066,497,816	0.75
	フィンランド	1,691,785,139	0.61
	ポーランド	1,677,957,520	0.61
	デンマーク	1,496,254,391	0.54
	マレーシア	1,334,629,039	0.48
	シンガポール	1,253,504,285	0.45
	イスラエル	1,082,408,332	0.39
	スウェーデン	843,721,340	0.31
	ノルウェー	573,636,603	0.21
	小計	270,229,590,405	98.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,448,052,020	1.98
合計(純資産総額)		275,677,642,425	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,285,726,048	0.47
	買建	ドイツ	1,670,665,729	0.61

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	2,715,287,900	0.98

(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 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,412.41	1,468,151,145	10,285.93	1,450,317,415	0.625	2030/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,789.56	1,267,378,142	11,689.05	1,256,572,875	2.375	2027/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,231.66	1,221,943,083	12,072.31	1,206,023,867	2.625	2029/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,463.91	1,171,612,095	11,395.67	1,164,638,469	2.000	2026/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,357.68	1,152,804,564	11,286.99	1,145,629,865	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.125% 09/30/21	10,300,000	10,731.71	1,105,366,626	10,651.22	1,097,075,853	2.125	2021/9/30	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	13,041.68	1,107,238,777	12,896.51	1,094,914,406	3.000	2022/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,370.58	1,103,456,126	12,209.59	1,089,096,184	2.875	2028/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	10,916.80	1,091,680,787	10,846.52	1,084,652,974	2.000	2022/10/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,764.40	1,076,440,232	10,713.73	1,071,373,669	1.500	2022/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,480.71	1,063,792,146	10,480.83	1,063,805,087	0.250	2023/4/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,618.73	1,061,873,866	10,577.26	1,057,726,643	1.250	2021/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,627.18	1,060,683,226	12,452.30	1,045,993,463	3.125	2028/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,453.51	1,045,351,480	10,411.37	1,041,137,732	0.250	2025/7/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,666.98	1,044,195,245	11,579.13	1,036,332,878	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,788.50	1,030,302,645	10,725.17	1,024,254,433	1.750	2022/5/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,761.33	1,027,707,764	10,697.80	1,021,640,053	1.750	2022/3/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	10,739.85	1,020,286,602	10,724.76	1,018,853,031	1.500	2022/9/15	0.37

フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,330,000	22,021.87	953,546,979	23,297.47	1,008,780,544	4.500	2041/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,733.17	1,003,186,729	11,628.57	994,243,429	2.250	2027/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	10,974.73	987,726,294	10,935.19	984,167,510	1.375	2025/1/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/31/26	8,600,000	11,497.41	988,778,081	11,431.63	983,120,694	2.125	2026/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,410.10	988,960,051	10,318.62	980,269,528	0.375	2027/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,218.35	984,971,130	11,162.37	980,056,321	1.625	2026/11/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	7,000,000	14,299.96	1,000,997,488	13,910.16	973,711,594	3.000	2049/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,200,000	15,339.76	951,065,291	15,693.76	973,013,653	2.500	2030/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	10,842.85	975,856,708	10,775.63	969,807,479	1.875	2022/7/31	0.35
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000	18,376.69	950,075,175	18,576.76	960,418,552	5.500	2029/4/25	0.35
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	15,011.79	953,249,293	15,061.32	956,394,307	3.500	2026/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	8,010,000	12,039.46	964,360,746	11,884.35	951,937,064	2.375	2029/5/15	0.35

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.02
合計	98.02

(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	37	アメリカドル	4,658,659.51	487,295,784	4,648,992.28	486,284,592	0.18
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	24	アメリカドル	3,341,251.16	349,494,871	3,321,750	347,455,050	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	25	アメリカドル	4,384,205.8	458,587,927	4,321,093.75	451,986,406	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	17	ユーロ	1,909,812.1	233,264,449	1,912,245	233,561,604	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	23	ユーロ	3,114,383.5	380,390,801	3,126,850	381,913,459	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	49	ユーロ	8,574,187.1	1,047,251,212	8,639,190	1,055,190,666	0.38

(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	11,540,000.00	1,213,212,942	1,206,737,800	0.44
	カナダドル	買建	1,800,000.00	143,893,553	141,354,000	0.05
	ユーロ	買建	9,510,000.00	1,178,954,058	1,161,646,500	0.42
	イギリスポンド	買建	1,520,000.00	207,902,058	205,549,600	0.07

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

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

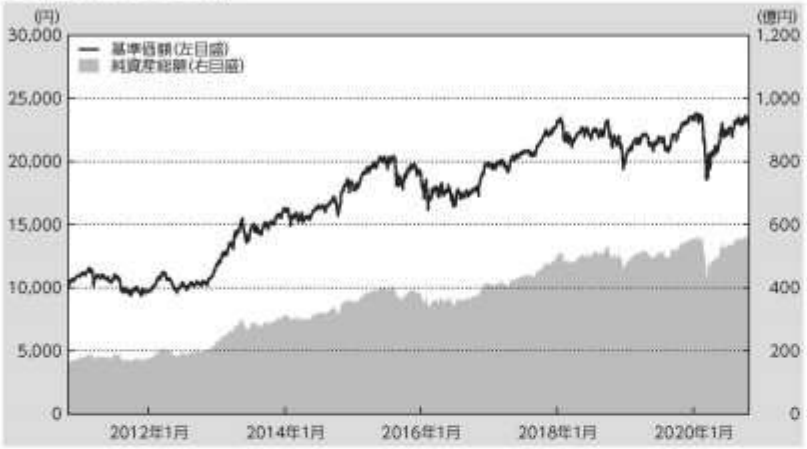
≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2001年10月１日
作成基準日：2020年10月30日

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	22,635円
純資産総額	542.64億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2016年９月	0円
2017年10月	0円
2018年10月	0円
2019年９月	0円
2020年９月	0円
設定来分配金合計額	0円

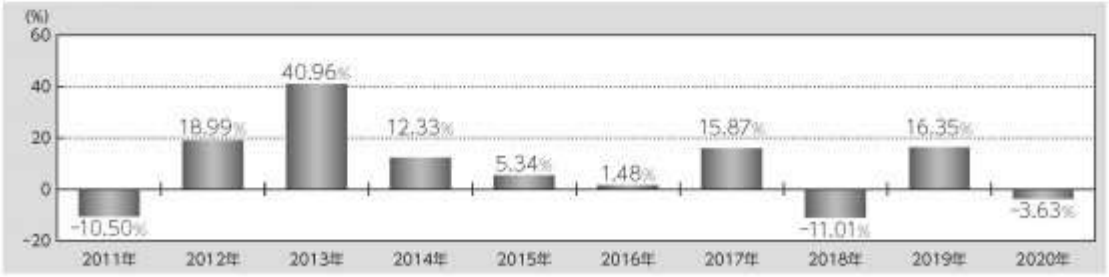
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

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
国内株式インデックスマザーファンド	50.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.7%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	1.2%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	1.2%
外国株式インデックスマザーファンド	25.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	1.2%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.9%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.8%
国内債券インデックスマザーファンド	16.6%	第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2023/12/20	0.3%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.2%
		第140回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/06/20	0.2%
外国債券インデックスマザーファンド	4.8%	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/05/15	0.0%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.0%
		T 2.625% 02/15/29	アメリカ	国債	-	2.625%	2029/02/15	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＞
ありません。

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

＜その他＞
取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。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（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞

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

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

＜受付不可日＞

ありません。

＜一部解約受付の中止等＞

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

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

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

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

＜問い合わせ先＞
上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

＜基準価額の算出頻度＞
基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞
①本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法
原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。
②マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

・株式

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

・公社債

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

a.日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）

b.価格情報会社の提供する価額

c.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

③外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2001年10月 1日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。

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

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、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。

②上記①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。

③上記②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。

④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。

⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④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②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いて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

①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。

②上記①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。

③上記②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。

④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＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

＜反対者の買取請求権＞

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をするこ

ととします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

②収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期計算期間(2019年10月1日から2020年9月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＤＣマイセレクション７５】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 （2019年 9月30日現在）	第19期 （2020年 9月30日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,545,372,507	1,569,638,692
親投資信託受益証券	50,216,372,731	53,780,997,420
未収入金	93,760,000	90,000,000
流動資産合計	51,855,505,238	55,440,636,112
資産合計	51,855,505,238	55,440,636,112
負債の部		
流動負債		
未払解約金	59,846,062	59,499,145
未払受託者報酬	8,158,631	8,592,201
未払委託者報酬	78,866,646	83,057,791
未払利息	3,754	3,626
その他未払費用	1,723,113	1,773,564
流動負債合計	148,598,206	152,926,327
負債合計	148,598,206	152,926,327
純資産の部		
元本等		
元本	23,546,671,519	23,870,880,027
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	28,160,235,513	31,416,829,758
（分配準備積立金）	14,500,076,105	13,258,970,919
元本等合計	51,706,907,032	55,287,709,785
純資産合計	51,706,907,032	55,287,709,785
負債純資産合計	51,855,505,238	55,440,636,112

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自　2018年10月 2日 至　2019年 9月30日	第19期 自　2019年10月 1日 至　2020年 9月30日
営業収益		
受取利息	782	6,507
有価証券売買等損益	△2,607,572,144	3,001,754,689
営業収益合計	△2,607,571,362	3,001,761,196
営業費用		
支払利息	1,165,864	738,051
受託者報酬	16,134,184	17,325,378
委託者報酬	155,963,586	167,478,414
その他費用	1,784,753	1,776,245
営業費用合計	175,048,387	187,318,088
営業利益又は営業損失（△）	△2,782,619,749	2,814,443,108
経常利益又は経常損失（△）	△2,782,619,749	2,814,443,108
当期純利益又は当期純損失（△）	△2,782,619,749	2,814,443,108
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（△）	△371,913,516	22,178,548
期首剰余金又は期首欠損金（△）	30,154,482,179	28,160,235,513
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,513,651,590	4,519,494,593
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,513,651,590	4,519,494,593
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,097,192,023	4,055,164,908
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,097,192,023	4,055,164,908
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	28,160,235,513	31,416,829,758

（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18期 (2019年 9月30日現在)	第19期 (2020年 9月30日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	23,546,671,519口	23,870,880,027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 2.1959円 (1万口当たり純資産額) (21,959円)	1口当たり純資産額 2.3161円 (1万口当たり純資産額) (23,161円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第18期 自 2018年10月 2日 至 2019年 9月30日	第19期 自 2019年10月 1日 至 2020年 9月30日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	18,476,411,305円
分配準備積立金額	D	14,500,076,105円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	32,976,487,410円
当ファンドの期末残存口数	F	23,546,671,519口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,004円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	704,949,758円
収益調整金額	C	20,876,450,779円
分配準備積立金額	D	12,554,021,161円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	34,135,421,698円
当ファンドの期末残存口数	F	23,870,880,027口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,300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19期 自 2019年10月 1日 至 2020年 9月30日
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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19期 (2020年 9月30日現在)
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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18期 自 2018年10月 2日 至 2019年 9月30日	第19期 自 2019年10月 1日 至 2020年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	22,839,035,740円	23,546,671,519円
期中追加設定元本額	3,074,624,736円	3,708,520,735円
期中一部解約元本額	2,366,988,957円	3,384,312,227円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第18期 (2019年 9月30日現在)	第19期 (2020年 9月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	△2,402,877,354	3,139,710,991
合計	△2,402,877,354	3,139,710,991

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考

親投資信託受益証券	国内株式インデックス　マザーファンド	18,119,850,660	28,082,144,552	
	外国株式インデックス　マザーファンド	5,011,034,169	14,115,081,047	
	国内債券インデックス　マザーファンド	6,345,329,144	8,950,086,757	
	外国債券インデックス　マザーファンド	882,129,242	2,633,685,064	
合計		30,358,343,215	53,780,997,420	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,507,313,955
株式	350,000,638,400
派生商品評価勘定	25,007,550
未収入金	82,228,001
未収配当金	3,038,322,579
前払金	32,857,800
差入委託証拠金	130,822,300
流動資産合計	356,817,190,585
資産合計	356,817,190,585
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	57,874,700
未払金	17,681,367
未払解約金	479,085,377
未払利息	8,103
流動負債合計	554,649,547
負債合計	554,649,547
純資産の部	
元本等	
元本	229,881,049,283
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	126,381,491,755

	2020年 9月30日現在
項目	金額（円）
元本等合計	356,262,541,038
純資産合計	356,262,541,038
負債純資産合計	356,817,190,585

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 9月30日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 9月30日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	229,881,049,283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 1.5498円 (1万口当たり純資産額) (15,498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 9月30日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、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 9月30日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2020年 9月30日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。

（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 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月 1日
期首元本額	207,951,200,444円
期中追加設定元本額	66,314,677,581円
期中一部解約元本額	44,384,828,742円
期末元本額	229,881,049,283円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	523,183,117円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	4,098,005,229円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	14,344,896円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	9,398,303,108円
世界経済インデックスファンド	2,374,241,929円
日本株式インデックス・オープン	4,016,443,827円
ＤＣマイセレクション２５	6,937,388,520円
ＤＣマイセレクション５０	19,586,419,026円
ＤＣマイセレクション７５	18,119,850,660円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,855,992,001円

区分	2020年 9月30日現在
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,983,209,103円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,354,836,848円
ＤＣマイセレクションＳ７５	5,417,385,993円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	7,228,253,640円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	311,603,506円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	698,127,851円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	479,038,187円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,022,934,188円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,776,512,825円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	15,312,268円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	34,076,346円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	30,422,250円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	247,712,189円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,628,611円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	65,129,861円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	224,174,249円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	50,913,407円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	226,094,043円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,451,703,899円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	627,972,542円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,682,628,080円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	616,415,281円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	37,860,266円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	685,477,630円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	390,606,570円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	494,006,980円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	47,613,679円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	828,534,716円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	4,431,058,451円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,949,640,706円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,687,113,627円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,132,578,799円
分散投資コア戦略ファンドＡ	3,723,001,730円
分散投資コア戦略ファンドＳ	11,522,375,395円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	348,696,584円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	359,959,550円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,476,493,092円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	210,135,167円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,681,987円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	65,532,256円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	28,580,315,052円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	495,066,105円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	26,572,587円

区分	2020年 9月30日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	85,547,073円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	15,002,678円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,291,627円
グローバル経済コア	255,506,794円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	20,330,235円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	46,695,034円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	5,522,288円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,199,222,599円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	117,182,858円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	325,015円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	389,446円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	205,560円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	209,288円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	49,582,735,556円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,785,055,699円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	76,455,795円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,902,376円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	689,890,953円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	12,030,514,732
合計	12,030,514,732

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,258,522,800	－	6,225,665,000	△32,857,800
合計		6,258,522,800	－	6,225,665,000	△32,857,800

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	7,300	2,798.00	20,425,400	
日本水産	208,600	447.00	93,244,200	
マルハニチロ	30,100	2,412.00	72,601,200	
カネコ種苗	6,300	1,622.00	10,218,600	
サカタのタネ	24,900	3,770.00	93,873,000	
ホクト	15,900	2,243.00	35,663,700	
ホクリヨウ	3,200	709.00	2,268,800	
住石ホールディングス	42,100	123.00	5,178,300	
日鉄鉱業	4,800	4,635.00	22,248,000	
三井松島ホールディングス	8,100	737.00	5,969,700	
国際石油開発帝石	767,300	563.50	432,373,550	
石油資源開発	27,300	1,631.00	44,526,300	
K＆Oエナジーグループ	10,100	1,499.00	15,139,900	
ヒノキヤグループ	5,200	1,964.00	10,212,800	
ショーボンドホールディングス	32,500	5,220.00	169,650,000	
ミライト・ホールディングス	62,000	1,608.00	99,696,000	
タマホーム	11,200	1,381.00	15,467,200	
サンヨーホームズ	1,800	665.00	1,197,000	
日本アクア	8,300	703.00	5,834,900	
ファーストコーポレーション	6,400	691.00	4,422,400	
ベステラ	3,600	1,279.00	4,604,400	
ＴＡＴＥＲＵ	38,700	195.00	7,546,500	
キャンディル	3,500	677.00	2,369,500	
スペースバリューホールディングス	25,400	505.00	12,827,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,000	708.00	2,832,000	
第一カッター興業	2,600	2,258.00	5,870,800	
明豊ファシリティワークス	6,700	649.00	4,348,300	
安藤・間	124,200	726.00	90,169,200	
東急建設	61,100	459.00	28,044,900	
コムシスホールディングス	74,000	2,921.00	216,154,000	
ビーアールホールディングス	22,700	780.00	17,706,000	
高松コンストラクショングループ	13,000	2,302.00	29,926,000	
東建コーポレーション	6,400	7,770.00	49,728,000	

ソネック	2,100	890.00	1,869,000	
ヤマウラ	9,100	908.00	8,262,800	
大成建設	160,700	3,550.00	570,485,000	
大林組	481,800	955.00	460,119,000	
清水建設	489,000	789.00	385,821,000	
飛島建設	13,800	1,088.00	15,014,400	
長谷工コーポレーション	186,500	1,380.00	257,370,000	
松井建設	19,000	720.00	13,680,000	
錢高組	2,100	4,765.00	10,006,500	
鹿島建設	378,300	1,262.00	477,414,600	
不動テトラ	12,600	1,521.00	19,164,600	
大末建設	5,600	940.00	5,264,000	
鉄建建設	10,500	2,104.00	22,092,000	
西松建設	37,100	2,087.00	77,427,700	
三井住友建設	116,400	427.00	49,702,800	
大豊建設	10,800	3,005.00	32,454,000	
前田建設工業	120,700	769.00	92,818,300	
佐田建設	10,400	466.00	4,846,400	
ナカノフドー建設	13,200	410.00	5,412,000	
奥村組	22,700	2,638.00	59,882,600	
東鉄工業	20,700	2,834.00	58,663,800	
イチケン	3,500	1,677.00	5,869,500	
富士ピー・エス	7,100	647.00	4,593,700	
淺沼組	5,400	4,105.00	22,167,000	
戸田建設	200,100	720.00	144,072,000	
熊谷組	22,300	2,711.00	60,455,300	
北野建設	2,900	2,771.00	8,035,900	
植木組	2,100	2,938.00	6,169,800	
矢作建設工業	21,300	929.00	19,787,700	
ピーエス三菱	15,900	606.00	9,635,400	
日本ハウスホールディングス	32,900	281.00	9,244,900	
大東建託	52,600	9,320.00	490,232,000	
新日本建設	20,500	916.00	18,778,000	
ＮＩＰＰＯ	39,900	2,904.00	115,869,600	
東亜道路工業	3,000	3,625.00	10,875,000	
前田道路	42,500	1,921.00	81,642,500	
日本道路	4,700	7,690.00	36,143,000	
東亜建設工業	15,000	1,681.00	25,215,000	
日本国土開発	46,900	619.00	29,031,100	
若築建設	8,700	1,204.00	10,474,800	
東洋建設	54,000	410.00	22,140,000	
五洋建設	191,000	687.00	131,217,000	

世紀東急工業	23,100	800.00	18,480,000	
福田組	5,600	5,110.00	28,616,000	
住友林業	122,000	1,670.00	203,740,000	
日本基礎技術	16,200	476.00	7,711,200	
巴コーポレーション	21,400	395.00	8,453,000	
大和ハウス工業	476,700	2,697.50	1,285,898,250	
ライト工業	27,600	1,578.00	43,552,800	
積水ハウス	522,600	1,857.50	970,729,500	
日特建設	12,600	774.00	9,752,400	
北陸電気工事	8,300	1,201.00	9,968,300	
ユアテック	27,600	645.00	17,802,000	
日本リーテック	10,100	2,919.00	29,481,900	
四電工	2,600	2,396.00	6,229,600	
中電工	19,400	2,298.00	44,581,200	
関電工	68,500	860.00	58,910,000	
きんでん	114,500	1,853.00	212,168,500	
東京エネシス	16,000	747.00	11,952,000	
トーエネック	4,800	3,570.00	17,136,000	
住友電設	13,600	2,460.00	33,456,000	
日本電設工業	26,400	2,198.00	58,027,200	
協和エクシオ	73,100	2,742.00	200,440,200	
新日本空調	12,700	2,294.00	29,133,800	
九電工	33,800	3,035.00	102,583,000	
三機工業	34,700	1,152.00	39,974,400	
日揮ホールディングス	148,300	1,088.00	161,350,400	
中外炉工業	5,200	1,520.00	7,904,000	
ヤマト	15,400	704.00	10,841,600	
太平電業	11,600	2,349.00	27,248,400	
高砂熱学工業	40,500	1,509.00	61,114,500	
三晃金属工業	2,100	2,660.00	5,586,000	
朝日工業社	3,200	3,070.00	9,824,000	
明星工業	31,200	853.00	26,613,600	
大氣社	23,400	2,902.00	67,906,800	
ダイダン	11,500	2,769.00	31,843,500	
日比谷総合設備	15,500	1,790.00	27,745,000	
フィル・カンパニー	2,800	1,792.00	5,017,600	
ＯＳＪＢホールディングス	76,000	245.00	18,620,000	
東洋エンジニアリング	20,200	339.00	6,847,800	
レイズネクスト	25,800	1,313.00	33,875,400	
日本製粉	45,100	1,733.00	78,158,300	
日清製粉グループ本社	174,200	1,667.00	290,391,400	
日東富士製粉	1,100	6,490.00	7,139,000	

昭和産業	14,200	3,510.00	49,842,000	
鳥越製粉	13,700	1,059.00	14,508,300	
中部飼料	18,800	1,768.00	33,238,400	
フィード・ワン	20,720	930.00	19,269,600	
東洋精糖	2,600	1,282.00	3,333,200	
日本甜菜製糖	8,000	1,860.00	14,880,000	
三井製糖	13,500	1,951.00	26,338,500	
塩水港精糖	16,700	230.00	3,841,000	
日新製糖	7,300	1,877.00	13,702,100	
森永製菓	36,200	4,145.00	150,049,000	
中村屋	4,000	4,200.00	16,800,000	
江崎グリコ	42,500	4,715.00	200,387,500	
名糖産業	7,400	1,560.00	11,544,000	
井村屋グループ	8,700	2,538.00	22,080,600	
不二家	9,800	2,407.00	23,588,600	
山崎製パン	115,600	1,839.00	212,588,400	
第一屋製パン	3,000	995.00	2,985,000	
モロゾフ	2,600	6,190.00	16,094,000	
亀田製菓	8,800	5,400.00	47,520,000	
寿スピリッツ	14,800	5,390.00	79,772,000	
カルビー	70,300	3,465.00	243,589,500	
森永乳業	28,500	5,540.00	157,890,000	
六甲バター	10,200	1,884.00	19,216,800	
ヤクルト本社	106,100	5,850.00	620,685,000	
明治ホールディングス	102,000	8,040.00	820,080,000	
雪印メグミルク	37,100	2,549.00	94,567,900	
プリマハム	24,100	3,235.00	77,963,500	
日本ハム	58,900	4,690.00	276,241,000	
林兼産業	5,100	603.00	3,075,300	
丸大食品	16,400	1,739.00	28,519,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	12,300	2,930.00	36,039,000	
柿安本店	5,300	2,603.00	13,795,900	
伊藤ハム米久ホールディングス	99,300	753.00	74,772,900	
サッポロホールディングス	52,600	1,887.00	99,256,200	
アサヒグループホールディングス	336,900	3,656.00	1,231,706,400	
キリンホールディングス	654,000	1,973.50	1,290,669,000	
宝ホールディングス	114,300	1,166.00	133,273,800	
オエノンホールディングス	43,800	459.00	20,104,200	
養命酒製造	4,700	1,867.00	8,774,900	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	118,100	1,759.00	207,737,900	
サントリー食品インターナショナル	103,200	3,950.00	407,640,000	
ダイドーグループホールディングス	7,900	5,340.00	42,186,000	

伊藤園	46,800	7,510.00	351,468,000	
キーコーヒー	15,200	2,216.00	33,683,200	
ユニカフェ	4,600	1,053.00	4,843,800	
ジャパンフーズ	2,200	1,300.00	2,860,000	
日清オイリオグループ	19,800	3,175.00	62,865,000	
不二製油グループ本社	37,600	3,310.00	124,456,000	
かどや製油	1,700	3,985.00	6,774,500	
Ｊ－オイルミルズ	8,000	3,950.00	31,600,000	
キッコーマン	111,000	5,820.00	646,020,000	
味の素	340,500	2,159.00	735,139,500	
キユーピー	85,900	2,166.00	186,059,400	
ハウス食品グループ本社	57,700	3,740.00	215,798,000	
カゴメ	63,000	3,680.00	231,840,000	
焼津水産化学工業	7,500	1,030.00	7,725,000	
アリアケジャパン	14,100	7,130.00	100,533,000	
ピエトロ	2,000	1,746.00	3,492,000	
エバラ食品工業	3,700	2,457.00	9,090,900	
やまみ	1,300	2,252.00	2,927,600	
ニチレイ	73,400	2,783.00	204,272,200	
東洋水産	79,300	5,560.00	440,908,000	
イートアンド	5,300	1,971.00	10,446,300	
大冷	2,000	2,245.00	4,490,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,600	1,033.00	8,883,800	
日清食品ホールディングス	65,500	9,900.00	648,450,000	
永谷園ホールディングス	7,500	2,480.00	18,600,000	
一正蒲鉾	6,000	1,210.00	7,260,000	
フジッコ	16,700	2,083.00	34,786,100	
ロック・フィールド	16,600	1,475.00	24,485,000	
日本たばこ産業	826,800	1,920.00	1,587,456,000	
ケンコーマヨネーズ	8,600	1,840.00	15,824,000	
わらべや日洋ホールディングス	10,100	1,560.00	15,756,000	
なとり	8,600	2,111.00	18,154,600	
イフジ産業	2,700	995.00	2,686,500	
ピックルスコーポレーション	3,400	3,280.00	11,152,000	
北の達人コーポレーション	53,800	543.00	29,213,400	
ユーグレナ	66,700	880.00	58,696,000	
ミヨシ油脂	5,400	1,174.00	6,339,600	
理研ビタミン	14,600	2,147.00	31,346,200	
片倉工業	20,500	1,231.00	25,235,500	
グンゼ	11,200	3,925.00	43,960,000	
東洋紡	59,800	1,447.00	86,530,600	
ユニチカ	45,400	358.00	16,253,200	

富士紡ホールディングス	7,400	3,660.00	27,084,000	
倉敷紡績	15,200	1,928.00	29,305,600	
シキボウ	7,900	980.00	7,742,000	
日本毛織	50,000	1,015.00	50,750,000	
トーア紡コーポレーション	6,000	507.00	3,042,000	
帝国繊維	17,100	2,664.00	45,554,400	
帝人	123,000	1,629.00	200,367,000	
東レ	1,090,500	479.30	522,676,650	
サカイオーベックス	4,200	2,115.00	8,883,000	
住江織物	3,300	2,194.00	7,240,200	
日本フエルト	9,500	496.00	4,712,000	
イチカワ	2,500	1,534.00	3,835,000	
日東製網	1,700	1,484.00	2,522,800	
アツギ	12,800	568.00	7,270,400	
ダイニック	5,700	876.00	4,993,200	
セーレン	37,300	1,547.00	57,703,100	
ソトー	6,200	951.00	5,896,200	
東海染工	2,300	1,145.00	2,633,500	
小松マテーレ	24,900	892.00	22,210,800	
ワコールホールディングス	37,600	1,987.00	74,711,200	
ホギメディカル	17,200	3,605.00	62,006,000	
ＴＳＩホールディングス	46,300	324.00	15,001,200	
マツオカコーポレーション	4,400	2,297.00	10,106,800	
ワールド	21,500	1,418.00	30,487,000	
三陽商会	7,800	601.00	4,687,800	
ナイガイ	6,000	400.00	2,400,000	
オンワードホールディングス	91,200	272.00	24,806,400	
ルックホールディングス	5,400	827.00	4,465,800	
ゴールドウイン	27,300	8,340.00	227,682,000	
デサント	29,500	1,713.00	50,533,500	
キング	7,400	578.00	4,277,200	
ヤマトインターナショナル	13,800	350.00	4,830,000	
特種東海製紙	9,200	4,990.00	45,908,000	
王子ホールディングス	629,000	482.00	303,178,000	
日本製紙	66,500	1,303.00	86,649,500	
三菱製紙	17,100	347.00	5,933,700	
北越コーポレーション	89,700	361.00	32,381,700	
中越パルプ工業	6,400	1,522.00	9,740,800	
巴川製紙所	4,500	992.00	4,464,000	
大王製紙	66,400	1,502.00	99,732,800	
阿波製紙	3,900	510.00	1,989,000	
レンゴー	142,200	794.00	112,906,800	

トーモク	9,200	1,675.00	15,410,000	
ザ・パック	11,400	3,095.00	35,283,000	
クラレ	237,000	1,018.00	241,266,000	
旭化成	997,400	914.70	912,321,780	
共和レザー	8,200	649.00	5,321,800	
昭和電工	114,300	1,922.00	219,684,600	
住友化学	1,105,500	347.00	383,608,500	
住友精化	6,700	3,400.00	22,780,000	
日産化学	83,600	5,600.00	468,160,000	
ラサ工業	5,300	2,084.00	11,045,200	
クレハ	12,900	4,550.00	58,695,000	
多木化学	5,900	7,230.00	42,657,000	
テイカ	11,000	1,441.00	15,851,000	
石原産業	27,000	721.00	19,467,000	
片倉コープアグリ	3,900	1,300.00	5,070,000	
日本曹達	22,300	3,010.00	67,123,000	
東ソー	232,600	1,705.00	396,583,000	
トクヤマ	43,400	2,524.00	109,541,600	
セントラル硝子	30,700	2,183.00	67,018,100	
東亞合成	94,400	1,127.00	106,388,800	
大阪ソーダ	15,300	2,559.00	39,152,700	
関東電化工業	35,700	723.00	25,811,100	
デンカ	54,900	3,195.00	175,405,500	
信越化学工業	258,400	13,685.00	3,536,204,000	
日本カーバイド工業	5,300	1,279.00	6,778,700	
堺化学工業	9,700	2,051.00	19,894,700	
第一稀元素化学工業	16,300	726.00	11,833,800	
エア・ウォーター	140,000	1,420.00	198,800,000	
大陽日酸	144,600	1,615.00	233,529,000	
日本化学工業	4,700	2,308.00	10,847,600	
東邦アセチレン	2,300	1,258.00	2,893,400	
日本パーカライジング	75,900	1,029.00	78,101,100	
高圧ガス工業	23,900	839.00	20,052,100	
チタン工業	1,900	1,764.00	3,351,600	
四国化成工業	22,000	1,165.00	25,630,000	
戸田工業	3,500	2,413.00	8,445,500	
ステラ　ケミファ	8,200	2,971.00	24,362,200	
保土谷化学工業	5,600	4,810.00	26,936,000	
日本触媒	23,400	5,600.00	131,040,000	
大日精化工業	13,300	2,252.00	29,951,600	
カネカ	38,900	2,945.00	114,560,500	
三菱瓦斯化学	140,000	1,946.00	272,440,000	

三井化学	139,600	2,536.00	354,025,600	
ＪＳＲ	140,200	2,489.00	348,957,800	
東京応化工業	25,800	5,430.00	140,094,000	
大阪有機化学工業	13,900	2,788.00	38,753,200	
三菱ケミカルホールディングス	1,005,900	605.70	609,273,630	
ＫＨネオケム	24,800	2,460.00	61,008,000	
ダイセル	195,900	757.00	148,296,300	
住友ベークライト	23,700	2,882.00	68,303,400	
積水化学工業	318,200	1,677.00	533,621,400	
日本ゼオン	135,700	1,101.00	149,405,700	
アイカ工業	45,100	3,730.00	168,223,000	
宇部興産	76,000	1,771.00	134,596,000	
積水樹脂	27,100	2,197.00	59,538,700	
タキロンシーアイ	32,600	698.00	22,754,800	
旭有機材	8,500	1,356.00	11,526,000	
ニチバン	7,900	1,644.00	12,987,600	
リケンテクノス	37,800	422.00	15,951,600	
大倉工業	7,100	1,586.00	11,260,600	
積水化成品工業	20,200	607.00	12,261,400	
群栄化学工業	3,400	2,795.00	9,503,000	
タイガースポリマー	7,900	430.00	3,397,000	
ミライアル	5,300	1,155.00	6,121,500	
ダイキアクシス	5,300	897.00	4,754,100	
ダイキョーニシカワ	31,700	556.00	17,625,200	
竹本容器	5,400	1,067.00	5,761,800	
森六ホールディングス	8,100	1,816.00	14,709,600	
日本化薬	93,100	928.00	86,396,800	
カーリットホールディングス	16,100	556.00	8,951,600	
日本精化	12,100	1,687.00	20,412,700	
扶桑化学工業	15,200	3,725.00	56,620,000	
トリケミカル研究所	3,400	12,170.00	41,378,000	
ＡＤＥＫＡ	69,300	1,511.00	104,712,300	
日油	56,700	4,140.00	234,738,000	
新日本理化	24,900	169.00	4,208,100	
ハリマ化成グループ	12,400	1,106.00	13,714,400	
花王	367,900	7,887.00	2,901,627,300	
第一工業製薬	5,600	4,270.00	23,912,000	
石原ケミカル	4,100	2,373.00	9,729,300	
日華化学	5,100	985.00	5,023,500	
ニイタカ	3,100	3,385.00	10,493,500	
三洋化成工業	9,000	4,900.00	44,100,000	
有機合成薬品工業	11,500	354.00	4,071,000	

大日本塗料	17,000	993.00	16,881,000	
日本ペイントホールディングス	124,200	10,810.00	1,342,602,000	
関西ペイント	169,100	2,608.00	441,012,800	
神東塗料	11,800	179.00	2,112,200	
中国塗料	42,800	993.00	42,500,400	
日本特殊塗料	11,300	978.00	11,051,400	
藤倉化成	20,300	518.00	10,515,400	
太陽ホールディングス	11,100	5,500.00	61,050,000	
ＤＩＣ	63,500	2,618.00	166,243,000	
サカタインクス	32,800	1,051.00	34,472,800	
東洋インキＳＣホールディングス	31,800	2,010.00	63,918,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	11,700	885.00	10,354,500	
富士フイルムホールディングス	294,600	5,185.00	1,527,501,000	
資生堂	305,300	6,035.00	1,842,485,500	
ライオン	199,800	2,163.00	432,167,400	
高砂香料工業	9,600	2,178.00	20,908,800	
マンダム	34,500	1,765.00	60,892,500	
ミルボン	20,500	5,580.00	114,390,000	
ファンケル	62,200	3,425.00	213,035,000	
コーセー	28,900	12,850.00	371,365,000	
コタ	8,900	1,398.00	12,442,200	
シーボン	2,000	2,014.00	4,028,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	65,600	1,983.00	130,084,800	
ノエビアホールディングス	13,000	4,920.00	63,960,000	
アジュバンコスメジャパン	3,400	1,011.00	3,437,400	
エステー	9,900	2,264.00	22,413,600	
アグロ　カネショウ	5,800	1,808.00	10,486,400	
コニシ	25,200	1,540.00	38,808,000	
長谷川香料	26,500	2,113.00	55,994,500	
星光ＰＭＣ	8,800	700.00	6,160,000	
小林製薬	43,100	10,170.00	438,327,000	
荒川化学工業	13,800	1,266.00	17,470,800	
メック	10,500	1,954.00	20,517,000	
日本高純度化学	4,200	2,721.00	11,428,200	
タカラバイオ	40,200	2,856.00	114,811,200	
ＪＣＵ	18,600	3,460.00	64,356,000	
新田ゼラチン	9,600	726.00	6,969,600	
ＯＡＴアグリオ	2,900	1,336.00	3,874,400	
デクセリアルズ	39,700	1,104.00	43,828,800	
アース製薬	10,600	7,830.00	82,998,000	
北興化学工業	14,300	711.00	10,167,300	
大成ラミック	5,000	2,813.00	14,065,000	

クミアイ化学工業	63,500	1,058.00	67,183,000	
日本農薬	27,400	512.00	14,028,800	
アキレス	10,600	1,757.00	18,624,200	
有沢製作所	24,300	964.00	23,425,200	
日東電工	106,000	6,840.00	725,040,000	
レック	16,400	1,677.00	27,502,800	
三光合成	17,600	293.00	5,156,800	
きもと	26,100	169.00	4,410,900	
藤森工業	13,800	4,340.00	59,892,000	
前澤化成工業	9,800	976.00	9,564,800	
未来工業	8,200	2,008.00	16,465,600	
ウェーブロックホールディングス	5,300	754.00	3,996,200	
ＪＳＰ	9,000	1,607.00	14,463,000	
エフピコ	33,800	4,430.00	149,734,000	
天馬	10,200	1,774.00	18,094,800	
信越ポリマー	27,600	894.00	24,674,400	
東リ	38,300	276.00	10,570,800	
ニフコ	56,400	2,862.00	161,416,800	
バルカー	12,500	1,897.00	23,712,500	
ユニ・チャーム	325,800	4,712.00	1,535,169,600	
ショーエイコーポレーション	2,300	1,245.00	2,863,500	
協和キリン	154,500	2,986.00	461,337,000	
武田薬品工業	1,278,300	3,744.00	4,785,955,200	
アステラス製薬	1,332,100	1,567.00	2,087,400,700	
大日本住友製薬	113,900	1,383.00	157,523,700	
塩野義製薬	193,200	5,629.00	1,087,522,800	
わかもと製薬	18,300	277.00	5,069,100	
あすか製薬	17,500	1,417.00	24,797,500	
日本新薬	40,200	8,640.00	347,328,000	
ビオフェルミン製薬	2,600	2,549.00	6,627,400	
中外製薬	480,600	4,715.00	2,266,029,000	
科研製薬	26,300	4,820.00	126,766,000	
エーザイ	183,900	9,584.00	1,762,497,600	
ロート製薬	78,900	3,455.00	272,599,500	
小野薬品工業	352,800	3,304.00	1,165,651,200	
久光製薬	40,600	5,370.00	218,022,000	
持田製薬	21,300	4,155.00	88,501,500	
参天製薬	286,300	2,149.00	615,258,700	
扶桑薬品工業	5,400	2,909.00	15,708,600	
日本ケミファ	2,000	2,639.00	5,278,000	
ツムラ	47,600	3,275.00	155,890,000	
日医工	43,500	1,195.00	51,982,500	

キッセイ薬品工業	27,200	2,371.00	64,491,200	
生化学工業	29,800	1,105.00	32,929,000	
栄研化学	27,000	2,116.00	57,132,000	
日水製薬	6,500	1,141.00	7,416,500	
鳥居薬品	9,600	2,978.00	28,588,800	
ＪＣＲファーマ	43,200	3,070.00	132,624,000	
東和薬品	19,700	2,109.00	41,547,300	
富士製薬工業	10,400	1,249.00	12,989,600	
沢井製薬	31,500	5,310.00	167,265,000	
ゼリア新薬工業	27,900	2,010.00	56,079,000	
第一三共	1,319,100	3,229.00	4,259,373,900	
キョーリン製薬ホールディングス	33,900	2,132.00	72,274,800	
大幸薬品	18,900	2,252.00	42,562,800	
ダイト	9,600	3,535.00	33,936,000	
大塚ホールディングス	319,300	4,448.00	1,420,246,400	
大正製薬ホールディングス	32,500	6,920.00	224,900,000	
ペプチドリーム	78,100	4,920.00	384,252,000	
日本コークス工業	129,800	62.00	8,047,600	
ニチレキ	18,100	1,699.00	30,751,900	
ユシロ化学工業	8,600	1,326.00	11,403,600	
ビーピー・カストロール	5,500	1,225.00	6,737,500	
富士石油	41,000	178.00	7,298,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,600	1,002.00	5,611,200	
出光興産	170,500	2,242.00	382,261,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,311,300	375.00	866,737,500	
コスモエネルギーホールディングス	44,500	1,501.00	66,794,500	
横浜ゴム	89,000	1,491.00	132,699,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	80,900	1,692.00	136,882,800	
ブリヂストン	408,500	3,317.00	1,354,994,500	
住友ゴム工業	138,000	973.00	134,274,000	
藤倉コンポジット	13,400	370.00	4,958,000	
オカモト	9,300	4,105.00	38,176,500	
フコク	6,700	705.00	4,723,500	
ニッタ	17,300	2,328.00	40,274,400	
住友理工	29,800	560.00	16,688,000	
三ツ星ベルト	20,200	1,707.00	34,481,400	
バンドー化学	27,000	601.00	16,227,000	
日東紡績	22,900	4,475.00	102,477,500	
ＡＧＣ	141,100	3,070.00	433,177,000	
日本板硝子	73,500	380.00	27,930,000	
石塚硝子	2,800	2,012.00	5,633,600	
日本山村硝子	6,600	906.00	5,979,600	

日本電気硝子	57,100	1,958.00	111,801,800	
オハラ	6,200	1,311.00	8,128,200	
住友大阪セメント	29,100	3,395.00	98,794,500	
太平洋セメント	97,100	2,674.00	259,645,400	
日本ヒューム	15,600	799.00	12,464,400	
日本コンクリート工業	33,600	340.00	11,424,000	
三谷セキサン	7,200	6,080.00	43,776,000	
アジアパイルホールディングス	22,200	489.00	10,855,800	
東海カーボン	150,400	1,122.00	168,748,800	
日本カーボン	8,500	3,730.00	31,705,000	
東洋炭素	9,100	1,768.00	16,088,800	
ノリタケカンパニーリミテド	8,500	3,305.00	28,092,500	
ＴＯＴＯ	109,800	4,825.00	529,785,000	
日本碍子	184,600	1,495.00	275,977,000	
日本特殊陶業	117,000	1,830.00	214,110,000	
ＭＡＲＵＷＡ	5,900	9,720.00	57,348,000	
品川リフラクトリーズ	4,100	2,444.00	10,020,400	
黒崎播磨	3,100	2,984.00	9,250,400	
ヨータイ	12,400	793.00	9,833,200	
イソライト工業	8,300	472.00	3,917,600	
東京窯業	20,100	341.00	6,854,100	
ニッカトー	7,200	755.00	5,436,000	
フジミインコーポレーテッド	13,700	3,655.00	50,073,500	
クニミネ工業	6,400	1,073.00	6,867,200	
エーアンドエーマテリアル	2,600	1,071.00	2,784,600	
ニチアス	42,100	2,482.00	104,492,200	
ニチハ	21,400	3,160.00	67,624,000	
日本製鉄	680,000	989.50	672,860,000	
神戸製鋼所	278,300	399.00	111,041,700	
中山製鋼所	21,300	356.00	7,582,800	
合同製鐵	8,200	2,013.00	16,506,600	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	410,400	732.00	300,412,800	
東京製鐵	74,100	715.00	52,981,500	
共英製鋼	17,200	1,347.00	23,168,400	
大和工業	32,300	2,565.00	82,849,500	
東京鐵鋼	6,300	1,767.00	11,132,100	
大阪製鐵	8,100	1,052.00	8,521,200	
淀川製鋼所	20,600	1,879.00	38,707,400	
丸一鋼管	49,300	2,626.00	129,461,800	
モリ工業	4,600	2,539.00	11,679,400	
大同特殊鋼	24,900	3,260.00	81,174,000	
日本高周波鋼業	5,800	374.00	2,169,200	

日本冶金工業	12,600	1,553.00	19,567,800	
山陽特殊製鋼	10,500	1,002.00	10,521,000	
愛知製鋼	8,600	2,599.00	22,351,400	
日立金属	163,700	1,615.00	264,375,500	
日本金属	3,500	598.00	2,093,000	
大平洋金属	10,300	1,565.00	16,119,500	
新日本電工	98,300	212.00	20,839,600	
栗本鐵工所	7,500	1,903.00	14,272,500	
虹技	2,300	1,400.00	3,220,000	
三菱製鋼	11,400	574.00	6,543,600	
日亜鋼業	22,400	311.00	6,966,400	
日本精線	2,500	3,455.00	8,637,500	
エンビプロ・ホールディングス	6,600	578.00	3,814,800	
シンニッタン	23,900	228.00	5,449,200	
新家工業	3,500	1,160.00	4,060,000	
大紀アルミニウム工業所	25,200	559.00	14,086,800	
日本軽金属ホールディングス	38,520	1,663.00	64,058,760	
三井金属鉱業	41,100	2,545.00	104,599,500	
東邦亜鉛	7,900	2,008.00	15,863,200	
三菱マテリアル	100,400	2,070.00	207,828,000	
住友金属鉱山	194,300	3,245.00	630,503,500	
ＤＯＷＡホールディングス	38,500	3,080.00	118,580,000	
古河機械金属	27,100	1,135.00	30,758,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,000	891.00	14,256,000	
東邦チタニウム	27,400	673.00	18,440,200	
ＵＡＣＪ	23,100	1,728.00	39,916,800	
ＣＫサンエツ	3,200	3,385.00	10,832,000	
古河電気工業	47,200	2,502.00	118,094,400	
住友電気工業	568,200	1,179.00	669,907,800	
フジクラ	183,500	290.00	53,215,000	
昭和電線ホールディングス	17,800	1,212.00	21,573,600	
東京特殊電線	2,300	2,494.00	5,736,200	
タツタ電線	30,400	612.00	18,604,800	
カナレ電気	2,600	1,779.00	4,625,400	
平河ヒューテック	7,700	1,033.00	7,954,100	
リョービ	18,800	1,178.00	22,146,400	
アーレスティ	20,300	332.00	6,739,600	
アサヒホールディングス	26,700	3,400.00	90,780,000	
稲葉製作所	8,500	1,368.00	11,628,000	
宮地エンジニアリンググループ	4,600	1,650.00	7,590,000	
トーカロ	42,200	1,105.00	46,631,000	
アルファＣｏ	5,400	1,047.00	5,653,800	

ＳＵＭＣＯ	194,500	1,475.00	286,887,500	
川田テクノロジーズ	3,100	4,850.00	15,035,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	4,900	3,345.00	16,390,500	
信和	8,700	708.00	6,159,600	
東洋製罐グループホールディングス	96,800	1,042.00	100,865,600	
ホッカンホールディングス	8,400	1,439.00	12,087,600	
コロナ	8,400	987.00	8,290,800	
横河ブリッジホールディングス	28,300	1,950.00	55,185,000	
駒井ハルテック	2,800	1,619.00	4,533,200	
高田機工	1,400	2,525.00	3,535,000	
三和ホールディングス	143,200	1,111.00	159,095,200	
文化シヤッター	44,800	833.00	37,318,400	
三協立山	19,600	983.00	19,266,800	
アルインコ	11,000	971.00	10,681,000	
東洋シヤッター	3,700	786.00	2,908,200	
ＬＩＸＩＬグループ	224,200	2,110.00	473,062,000	
日本フイルコン	10,600	597.00	6,328,200	
ノーリツ	31,500	1,512.00	47,628,000	
長府製作所	15,400	2,199.00	33,864,600	
リンナイ	29,500	10,250.00	302,375,000	
ダイニチ工業	8,200	780.00	6,396,000	
日東精工	19,100	492.00	9,397,200	
三洋工業	2,000	2,018.00	4,036,000	
岡部	30,800	813.00	25,040,400	
ジーテクト	18,900	1,194.00	22,566,600	
東プレ	28,300	1,130.00	31,979,000	
高周波熱錬	29,200	532.00	15,534,400	
東京製綱	10,900	520.00	5,668,000	
サンコール	11,400	468.00	5,335,200	
モリテック　スチール	11,800	313.00	3,693,400	
パイオラックス	22,500	1,560.00	35,100,000	
エイチワン	14,900	563.00	8,388,700	
日本発條	163,000	671.00	109,373,000	
中央発條	1,800	3,165.00	5,697,000	
アドバネクス	2,200	1,427.00	3,139,400	
立川ブラインド工業	6,700	1,309.00	8,770,300	
三益半導体工業	11,900	2,401.00	28,571,900	
日本ドライケミカル	3,800	1,513.00	5,749,400	
日本製鋼所	46,200	1,840.00	85,008,000	
三浦工業	65,800	5,140.00	338,212,000	
タクマ	51,600	1,792.00	92,467,200	
ツガミ	31,600	1,227.00	38,773,200	

オークマ	17,700	4,915.00	86,995,500	
芝浦機械	17,200	2,176.00	37,427,200	
アマダ	188,600	982.00	185,205,200	
アイダエンジニアリング	40,000	722.00	28,880,000	
滝澤鉄工所	4,800	1,061.00	5,092,800	
ＦＵＪＩ	65,400	2,077.00	135,835,800	
牧野フライス製作所	17,900	3,680.00	65,872,000	
オーエスジー	75,000	1,685.00	126,375,000	
ダイジェット工業	1,800	1,475.00	2,655,000	
旭ダイヤモンド工業	40,200	487.00	19,577,400	
ＤＭＧ森精機	96,200	1,452.00	139,682,400	
ソディック	33,200	738.00	24,501,600	
ディスコ	20,600	25,410.00	523,446,000	
日東工器	8,400	2,083.00	17,497,200	
日進工具	6,000	2,283.00	13,698,000	
パンチ工業	13,900	416.00	5,782,400	
冨士ダイス	6,800	670.00	4,556,000	
豊和工業	8,600	856.00	7,361,600	
ＯＫＫ	6,200	388.00	2,405,600	
東洋機械金属	11,000	435.00	4,785,000	
津田駒工業	2,900	904.00	2,621,600	
エンシュウ	3,800	991.00	3,765,800	
島精機製作所	24,000	1,656.00	39,744,000	
オプトラン	19,100	2,123.00	40,549,300	
ＮＣホールディングス	4,700	666.00	3,130,200	
イワキポンプ	9,700	950.00	9,215,000	
フリュー	14,900	1,193.00	17,775,700	
ヤマシンフィルタ	33,100	1,074.00	35,549,400	
日阪製作所	18,800	894.00	16,807,200	
やまびこ	29,500	1,283.00	37,848,500	
平田機工	7,200	6,280.00	45,216,000	
ペガサスミシン製造	15,700	295.00	4,631,500	
マルマエ	5,700	966.00	5,506,200	
タツモ	6,500	1,462.00	9,503,000	
ナブテスコ	89,600	3,815.00	341,824,000	
三井海洋開発	16,200	1,633.00	26,454,600	
レオン自動機	15,000	1,132.00	16,980,000	
ＳＭＣ	48,200	58,460.00	2,817,772,000	
ホソカワミクロン	5,400	5,460.00	29,484,000	
ユニオンツール	5,700	3,210.00	18,297,000	
オイレス工業	19,700	1,528.00	30,101,600	
日精エー・エス・ビー機械	4,400	4,250.00	18,700,000	

サトーホールディングス	21,700	2,237.00	48,542,900	
技研製作所	13,400	4,030.00	54,002,000	
日本エアーテック	5,000	1,405.00	7,025,000	
カワタ	4,600	938.00	4,314,800	
日精樹脂工業	12,900	908.00	11,713,200	
オカダアイヨン	4,900	1,027.00	5,032,300	
ワイエイシイホールディングス	6,500	644.00	4,186,000	
小松製作所	696,000	2,310.00	1,607,760,000	
住友重機械工業	88,000	2,442.00	214,896,000	
日立建機	61,600	3,800.00	234,080,000	
日工	21,200	697.00	14,776,400	
巴工業	6,100	2,101.00	12,816,100	
井関農機	15,500	1,414.00	21,917,000	
ＴＯＷＡ	15,600	1,154.00	18,002,400	
丸山製作所	3,200	1,398.00	4,473,600	
北川鉄工所	7,000	1,456.00	10,192,000	
ローツェ	6,700	4,955.00	33,198,500	
タカキタ	5,500	713.00	3,921,500	
クボタ	815,200	1,877.50	1,530,538,000	
荏原実業	3,900	3,120.00	12,168,000	
三菱化工機	5,400	1,888.00	10,195,200	
月島機械	28,400	1,272.00	36,124,800	
帝国電機製作所	12,700	1,086.00	13,792,200	
新東工業	36,700	705.00	25,873,500	
澁谷工業	13,500	3,635.00	49,072,500	
アイチ　コーポレーション	26,700	878.00	23,442,600	
小森コーポレーション	39,200	734.00	28,772,800	
鶴見製作所	11,900	1,819.00	21,646,100	
住友精密工業	2,300	2,199.00	5,057,700	
日本ギア工業	6,400	297.00	1,900,800	
酒井重工業	2,900	2,401.00	6,962,900	
荏原製作所	63,700	2,843.00	181,099,100	
石井鐵工所	2,000	2,851.00	5,702,000	
酉島製作所	15,700	816.00	12,811,200	
北越工業	15,900	1,116.00	17,744,400	
ダイキン工業	195,700	19,300.00	3,777,010,000	
オルガノ	5,600	5,700.00	31,920,000	
トーヨーカネツ	6,700	2,269.00	15,202,300	
栗田工業	83,200	3,460.00	287,872,000	
椿本チエイン	22,000	2,469.00	54,318,000	
大同工業	7,600	633.00	4,810,800	
木村化工機	13,200	426.00	5,623,200	

アネスト岩田	24,000	863.00	20,712,000	
ダイフク	78,500	10,580.00	830,530,000	
サムコ	3,900	2,689.00	10,487,100	
加藤製作所	8,600	1,120.00	9,632,000	
油研工業	2,700	1,528.00	4,125,600	
タダノ	74,300	864.00	64,195,200	
フジテック	55,900	2,245.00	125,495,500	
ＣＫＤ	42,200	1,714.00	72,330,800	
キトー	11,700	1,231.00	14,402,700	
平和	42,900	1,730.00	74,217,000	
理想科学工業	13,600	1,453.00	19,760,800	
ＳＡＮＫＹＯ	34,200	2,755.00	94,221,000	
日本金銭機械	17,100	591.00	10,106,100	
マースグループホールディングス	9,800	1,774.00	17,385,200	
フクシマガリレイ	9,500	3,910.00	37,145,000	
オーイズミ	6,600	410.00	2,706,000	
ダイコク電機	7,100	1,011.00	7,178,100	
竹内製作所	25,700	2,082.00	53,507,400	
アマノ	40,300	2,445.00	98,533,500	
ＪＵＫＩ	21,400	454.00	9,715,600	
蛇の目ミシン工業	14,100	612.00	8,629,200	
マックス	23,500	1,576.00	37,036,000	
グローリー	39,500	2,348.00	92,746,000	
新晃工業	14,300	1,465.00	20,949,500	
大和冷機工業	24,800	943.00	23,386,400	
セガサミーホールディングス	152,400	1,278.00	194,767,200	
日本ピストンリング	5,700	1,031.00	5,876,700	
リケン	7,100	2,697.00	19,148,700	
ＴＰＲ	20,700	1,275.00	26,392,500	
ツバキ・ナカシマ	29,500	796.00	23,482,000	
ホシザキ	48,400	8,380.00	405,592,000	
大豊工業	12,700	562.00	7,137,400	
日本精工	289,300	801.00	231,729,300	
ＮＴＮ	355,600	197.00	70,053,200	
ジェイテクト	147,500	820.00	120,950,000	
不二越	14,300	3,690.00	52,767,000	
日本トムソン	45,800	373.00	17,083,400	
ＴＨＫ	95,800	2,629.00	251,858,200	
ユーシン精機	12,000	698.00	8,376,000	
前澤給装工業	5,600	2,300.00	12,880,000	
イーグル工業	19,100	791.00	15,108,100	
前澤工業	10,400	496.00	5,158,400	

日本ピラー工業	15,600	1,594.00	24,866,400	
キッツ	62,400	598.00	37,315,200	
マキタ	200,400	5,020.00	1,006,008,000	
日立造船	122,200	444.00	54,256,800	
三菱重工業	257,500	2,330.50	600,103,750	
ＩＨＩ	110,800	1,395.00	154,566,000	
スター精密	23,700	1,392.00	32,990,400	
日清紡ホールディングス	94,100	715.00	67,281,500	
イビデン	94,300	3,550.00	334,765,000	
コニカミノルタ	338,100	296.00	100,077,600	
ブラザー工業	188,100	1,666.00	313,374,600	
ミネベアミツミ	285,600	1,990.00	568,344,000	
日立製作所	738,300	3,543.00	2,615,796,900	
三菱電機	1,536,400	1,421.50	2,183,992,600	
富士電機	92,600	3,310.00	306,506,000	
東洋電機製造	5,700	1,148.00	6,543,600	
安川電機	165,400	4,095.00	677,313,000	
シンフォニアテクノロジー	20,000	1,196.00	23,920,000	
明電舎	28,300	1,615.00	45,704,500	
オリジン	4,200	1,411.00	5,926,200	
山洋電気	7,600	4,790.00	36,404,000	
デンヨー	13,100	2,468.00	32,330,800	
東芝テック	19,300	4,395.00	84,823,500	
芝浦メカトロニクス	3,000	3,110.00	9,330,000	
マブチモーター	42,700	4,075.00	174,002,500	
日本電産	369,800	9,805.00	3,625,889,000	
トレックス・セミコンダクター	9,400	1,279.00	12,022,600	
東光高岳	9,200	1,069.00	9,834,800	
ダイヘン	16,800	4,255.00	71,484,000	
ヤーマン	25,500	1,567.00	39,958,500	
ＪＶＣケンウッド	130,000	146.00	18,980,000	
ミマキエンジニアリング	15,300	529.00	8,093,700	
Ｉ－ＰＥＸ	7,500	2,169.00	16,267,500	
日新電機	36,100	1,117.00	40,323,700	
大崎電気工業	30,800	611.00	18,818,800	
オムロン	137,700	8,180.00	1,126,386,000	
日東工業	22,600	2,085.00	47,121,000	
ＩＤＥＣ	22,300	1,904.00	42,459,200	
正興電機製作所	4,300	1,150.00	4,945,000	
不二電機工業	3,100	1,328.00	4,116,800	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	51,700	1,808.00	93,473,600	
サクサホールディングス	3,700	1,211.00	4,480,700	

メルコホールディングス	5,600	2,388.00	13,372,800	
テクノメディカ	3,800	1,681.00	6,387,800	
日本電気	186,400	6,140.00	1,144,496,000	
富士通	148,100	14,340.00	2,123,754,000	
沖電気工業	62,500	1,130.00	70,625,000	
岩崎通信機	6,700	850.00	5,695,000	
電気興業	7,400	2,606.00	19,284,400	
サンケン電気	16,800	2,454.00	41,227,200	
ナカヨ	3,100	1,513.00	4,690,300	
アイホン	8,800	1,518.00	13,358,400	
ルネサスエレクトロニクス	657,700	765.00	503,140,500	
セイコーエプソン	190,700	1,205.00	229,793,500	
ワコム	104,300	691.00	72,071,300	
アルバック	28,300	3,805.00	107,681,500	
アクセル	7,200	888.00	6,393,600	
ＥＩＺＯ	12,000	4,095.00	49,140,000	
日本信号	39,200	1,036.00	40,611,200	
京三製作所	36,200	483.00	17,484,600	
能美防災	20,600	2,403.00	49,501,800	
ホーチキ	11,700	1,282.00	14,999,400	
星和電機	8,800	621.00	5,464,800	
エレコム	17,500	5,160.00	90,300,000	
パナソニック	1,755,400	888.80	1,560,199,520	
シャープ	177,900	1,298.00	230,914,200	
アンリツ	99,000	2,393.00	236,907,000	
富士通ゼネラル	41,700	3,050.00	127,185,000	
ソニー	962,500	8,032.00	7,730,800,000	
ＴＤＫ	74,200	11,410.00	846,622,000	
帝国通信工業	7,400	1,200.00	8,880,000	
タムラ製作所	51,600	532.00	27,451,200	
アルプスアルパイン	136,500	1,408.00	192,192,000	
池上通信機	4,900	866.00	4,243,400	
鈴木	8,600	685.00	5,891,000	
日本トリム	2,300	3,795.00	8,728,500	
ローランド　ディー．ジー．	9,600	1,364.00	13,094,400	
フォスター電機	16,200	1,127.00	18,257,400	
ＳＭＫ	4,000	2,841.00	11,364,000	
ヨコオ	10,200	2,747.00	28,019,400	
ホシデン	42,700	946.00	40,394,200	
ヒロセ電機	23,700	13,530.00	320,661,000	
日本航空電子工業	35,300	1,442.00	50,902,600	
ＴＯＡ	16,600	853.00	14,159,800	

マクセルホールディングス	33,700	1,085.00	36,564,500	
古野電気	20,500	997.00	20,438,500	
ユニデンホールディングス	4,300	1,750.00	7,525,000	
スミダコーポレーション	14,100	738.00	10,405,800	
アイコム	8,500	2,750.00	23,375,000	
リオン	6,800	2,403.00	16,340,400	
本多通信工業	14,600	538.00	7,854,800	
横河電機	141,000	1,665.00	234,765,000	
新電元工業	5,500	2,003.00	11,016,500	
アズビル	97,000	3,920.00	380,240,000	
東亜ディーケーケー	8,400	906.00	7,610,400	
日本光電工業	63,700	3,460.00	220,402,000	
チノー	5,400	1,400.00	7,560,000	
共和電業	16,300	440.00	7,172,000	
日本電子材料	6,100	1,916.00	11,687,600	
堀場製作所	30,500	5,480.00	167,140,000	
アドバンテスト	114,300	5,090.00	581,787,000	
小野測器	7,800	551.00	4,297,800	
エスペック	14,000	1,870.00	26,180,000	
キーエンス	139,200	48,980.00	6,818,016,000	
日置電機	7,500	4,130.00	30,975,000	
シスメックス	109,900	10,030.00	1,102,297,000	
日本マイクロニクス	27,400	1,099.00	30,112,600	
メガチップス	14,600	2,870.00	41,902,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	9,200	3,535.00	32,522,000	
澤藤電機	2,200	1,932.00	4,250,400	
原田工業	8,000	918.00	7,344,000	
コーセル	21,100	1,074.00	22,661,400	
イリソ電子工業	13,100	4,240.00	55,544,000	
オプテックスグループ	25,700	1,689.00	43,407,300	
千代田インテグレ	6,900	1,629.00	11,240,100	
アイ・オー・データ機器	5,600	1,076.00	6,025,600	
レーザーテック	67,500	8,610.00	581,175,000	
スタンレー電気	108,000	3,015.00	325,620,000	
岩崎電気	6,500	1,434.00	9,321,000	
ウシオ電機	85,400	1,336.00	114,094,400	
岡谷電機産業	14,000	381.00	5,334,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	16,400	362.00	5,936,800	
エノモト	5,300	1,086.00	5,755,800	
日本セラミック	15,900	2,622.00	41,689,800	
遠藤照明	8,800	679.00	5,975,200	
古河電池	11,700	1,057.00	12,366,900	

双信電機	9,100	460.00	4,186,000	
山一電機	11,700	1,286.00	15,046,200	
図研	10,200	2,828.00	28,845,600	
日本電子	30,500	3,615.00	110,257,500	
カシオ計算機	136,000	1,694.00	230,384,000	
ファナック	144,500	20,120.00	2,907,340,000	
日本シイエムケイ	37,600	482.00	18,123,200	
エンプラス	8,200	2,240.00	18,368,000	
大真空	6,000	1,895.00	11,370,000	
ローム	64,000	8,100.00	518,400,000	
浜松ホトニクス	110,300	5,290.00	583,487,000	
三井ハイテック	17,300	2,091.00	36,174,300	
新光電気工業	52,000	1,835.00	95,420,000	
京セラ	216,300	5,997.00	1,297,151,100	
太陽誘電	68,500	3,290.00	225,365,000	
村田製作所	451,400	6,773.00	3,057,332,200	
双葉電子工業	25,000	938.00	23,450,000	
北陸電気工業	6,900	1,024.00	7,065,600	
ニチコン	53,000	803.00	42,559,000	
日本ケミコン	11,700	1,408.00	16,473,600	
ＫＯＡ	23,800	1,130.00	26,894,000	
市光工業	24,500	460.00	11,270,000	
小糸製作所	92,200	5,350.00	493,270,000	
ミツバ	28,300	366.00	10,357,800	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	26,700	5,570.00	148,719,000	
キヤノン電子	14,600	1,469.00	21,447,400	
キヤノン	763,500	1,746.50	1,333,452,750	
リコー	391,000	706.00	276,046,000	
象印マホービン	42,000	1,741.00	73,122,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,400	1,525.00	3,660,000	
東京エレクトロン	97,500	27,330.00	2,664,675,000	
トヨタ紡織	44,800	1,485.00	66,528,000	
芦森工業	3,300	888.00	2,930,400	
ユニプレス	29,900	856.00	25,594,400	
豊田自動織機	124,400	6,640.00	826,016,000	
モリタホールディングス	26,900	2,051.00	55,171,900	
三櫻工業	19,600	569.00	11,152,400	
デンソー	338,300	4,597.00	1,555,165,100	
東海理化電機製作所	40,500	1,565.00	63,382,500	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	55,500	377.00	20,923,500	
川崎重工業	119,500	1,417.00	169,331,500	
名村造船所	49,400	160.00	7,904,000	

日本車輌製造	5,600	2,805.00	15,708,000	
三菱ロジスネクスト	20,300	951.00	19,305,300	
近畿車輛	2,300	1,369.00	3,148,700	
日産自動車	1,812,000	371.80	673,701,600	
いすゞ自動車	445,200	917.40	408,426,480	
トヨタ自動車	1,714,300	6,932.00	11,883,527,600	
日野自動車	191,900	679.00	130,300,100	
三菱自動車工業	568,700	231.00	131,369,700	
エフテック	10,900	502.00	5,471,800	
レシップホールディングス	6,000	607.00	3,642,000	
ＧＭＢ	2,900	681.00	1,974,900	
ファルテック	2,800	622.00	1,741,600	
武蔵精密工業	34,300	1,105.00	37,901,500	
日産車体	30,000	920.00	27,600,000	
新明和工業	41,400	905.00	37,467,000	
極東開発工業	28,500	1,394.00	39,729,000	
日信工業	31,300	2,243.00	70,205,900	
トピー工業	12,700	1,142.00	14,503,400	
ティラド	5,600	1,313.00	7,352,800	
曙ブレーキ工業	84,300	147.00	12,392,100	
タチエス	25,300	970.00	24,541,000	
ＮＯＫ	82,700	1,091.00	90,225,700	
フタバ産業	42,900	533.00	22,865,700	
ＫＹＢ	17,200	2,171.00	37,341,200	
大同メタル工業	29,600	510.00	15,096,000	
プレス工業	76,400	298.00	22,767,200	
ミクニ	19,800	286.00	5,662,800	
太平洋工業	32,300	962.00	31,072,600	
ケーヒン	35,300	2,591.00	91,462,300	
河西工業	21,000	354.00	7,434,000	
アイシン精機	126,500	3,350.00	423,775,000	
マツダ	452,100	611.00	276,233,100	
今仙電機製作所	14,400	685.00	9,864,000	
本田技研工業	1,209,700	2,473.50	2,992,192,950	
スズキ	304,500	4,483.00	1,365,073,500	
ＳＵＢＡＲＵ	477,000	2,032.00	969,264,000	
安永	7,500	1,283.00	9,622,500	
ヤマハ発動機	217,100	1,522.00	330,426,200	
ショーワ	36,500	2,292.00	83,658,000	
ＴＢＫ	18,400	500.00	9,200,000	
エクセディ	20,900	1,366.00	28,549,400	
豊田合成	49,600	2,405.00	119,288,000	

愛三工業	24,200	468.00	11,325,600	
盟和産業	2,400	1,002.00	2,404,800	
日本プラスト	12,200	429.00	5,233,800	
ヨロズ	14,400	1,048.00	15,091,200	
エフ・シー・シー	25,200	1,932.00	48,686,400	
シマノ	57,500	20,720.00	1,191,400,000	
テイ・エス　テック	35,700	2,963.00	105,779,100	
ジャムコ	7,800	664.00	5,179,200	
テルモ	434,800	4,180.00	1,817,464,000	
クリエートメディック	5,100	1,088.00	5,548,800	
日機装	49,600	1,066.00	52,873,600	
日本エム・ディ・エム	8,900	2,161.00	19,232,900	
島津製作所	183,600	3,190.00	585,684,000	
ＪＭＳ	13,000	913.00	11,869,000	
長野計器	11,200	850.00	9,520,000	
ブイ・テクノロジー	7,200	4,415.00	31,788,000	
東京計器	9,800	938.00	9,192,400	
愛知時計電機	2,000	4,565.00	9,130,000	
インターアクション	8,300	1,940.00	16,102,000	
オーバル	13,900	239.00	3,322,100	
東京精密	27,900	3,330.00	92,907,000	
マニー	61,200	2,867.00	175,460,400	
ニコン	234,700	708.00	166,167,600	
トプコン	77,400	959.00	74,226,600	
オリンパス	850,100	2,182.00	1,854,918,200	
理研計器	13,600	2,902.00	39,467,200	
タムロン	12,400	1,658.00	20,559,200	
ＨＯＹＡ	304,800	11,860.00	3,614,928,000	
シード	6,600	745.00	4,917,000	
ノーリツ鋼機	10,400	1,624.00	16,889,600	
エー・アンド・デイ	14,100	650.00	9,165,000	
朝日インテック	174,000	3,300.00	574,200,000	
シチズン時計	180,100	294.00	52,949,400	
リズム時計工業	4,900	666.00	3,263,400	
大研医器	10,700	545.00	5,831,500	
メニコン	21,800	7,020.00	153,036,000	
シンシア	1,700	415.00	705,500	
松風	6,900	1,428.00	9,853,200	
セイコーホールディングス	21,800	1,417.00	30,890,600	
ニプロ	106,400	1,225.00	130,340,000	
中本パックス	3,900	1,628.00	6,349,200	
スノーピーク	9,100	1,845.00	16,789,500	

パラマウントベッドホールディングス	16,200	4,340.00	70,308,000	
トランザクション	8,400	1,170.00	9,828,000	
粧美堂	4,500	390.00	1,755,000	
ニホンフラッシュ	14,300	1,390.00	19,877,000	
前田工繊	16,900	2,735.00	46,221,500	
永大産業	20,100	323.00	6,492,300	
アートネイチャー	16,400	668.00	10,955,200	
バンダイナムコホールディングス	158,800	7,689.00	1,221,013,200	
アイフィスジャパン	3,900	780.00	3,042,000	
共立印刷	25,700	139.00	3,572,300	
ＳＨＯＥＩ	13,400	3,490.00	46,766,000	
フランスベッドホールディングス	21,700	883.00	19,161,100	
パイロットコーポレーション	27,200	3,090.00	84,048,000	
萩原工業	8,500	1,604.00	13,634,000	
トッパン・フォームズ	32,900	1,000.00	32,900,000	
フジシールインターナショナル	34,400	2,023.00	69,591,200	
タカラトミー	68,900	905.00	62,354,500	
廣済堂	10,700	666.00	7,126,200	
エステールホールディングス	4,100	682.00	2,796,200	
タカノ	6,000	602.00	3,612,000	
プロネクサス	13,200	1,243.00	16,407,600	
ホクシン	9,500	119.00	1,130,500	
ウッドワン	5,200	1,290.00	6,708,000	
大建工業	10,300	1,833.00	18,879,900	
凸版印刷	216,900	1,478.00	320,578,200	
大日本印刷	201,100	2,126.00	427,538,600	
共同印刷	4,700	2,640.00	12,408,000	
ＮＩＳＳＨＡ	31,500	1,307.00	41,170,500	
光村印刷	1,300	1,827.00	2,375,100	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	7,400	2,205.00	16,317,000	
アシックス	135,900	1,464.00	198,957,600	
ツツミ	4,800	2,508.00	12,038,400	
小松ウオール工業	4,700	1,795.00	8,436,500	
ヤマハ	91,400	5,020.00	458,828,000	
河合楽器製作所	4,700	2,730.00	12,831,000	
クリナップ	14,300	513.00	7,335,900	
ピジョン	98,600	4,700.00	463,420,000	
オリバー	3,200	2,829.00	9,052,800	
兼松サステック	1,000	1,602.00	1,602,000	
キングジム	12,800	906.00	11,596,800	
リンテック	36,500	2,444.00	89,206,000	
イトーキ	30,500	361.00	11,010,500	

任天堂	94,200	59,660.00	5,619,972,000	
三菱鉛筆	25,300	1,371.00	34,686,300	
タカラスタンダード	31,700	1,413.00	44,792,100	
コクヨ	73,700	1,320.00	97,284,000	
ナカバヤシ	15,100	666.00	10,056,600	
グローブライド	6,900	3,095.00	21,355,500	
オカムラ	53,600	741.00	39,717,600	
美津濃	13,900	1,896.00	26,354,400	
東京電力ホールディングス	1,226,500	289.00	354,458,500	
中部電力	470,000	1,281.00	602,070,000	
関西電力	582,100	1,020.00	593,742,000	
中国電力	221,600	1,319.00	292,290,400	
北陸電力	140,500	789.00	110,854,500	
東北電力	383,800	1,056.00	405,292,800	
四国電力	138,300	804.00	111,193,200	
九州電力	316,700	957.00	303,081,900	
北海道電力	143,800	450.00	64,710,000	
沖縄電力	29,900	1,648.00	49,275,200	
電源開発	122,200	1,623.00	198,330,600	
エフオン	8,300	644.00	5,345,200	
イーレックス	21,900	1,090.00	23,871,000	
レノバ	25,700	1,121.00	28,809,700	
東京瓦斯	295,500	2,406.00	710,973,000	
大阪瓦斯	298,100	2,050.00	611,105,000	
東邦瓦斯	75,600	5,220.00	394,632,000	
北海道瓦斯	8,200	1,544.00	12,660,800	
広島ガス	31,600	379.00	11,976,400	
西部瓦斯	17,300	2,642.00	45,706,600	
静岡ガス	43,600	934.00	40,722,400	
メタウォーター	14,800	2,293.00	33,936,400	
ＳＢＳホールディングス	11,400	2,189.00	24,954,600	
東武鉄道	160,100	3,245.00	519,524,500	
相鉄ホールディングス	49,200	2,835.00	139,482,000	
東急	387,500	1,363.00	528,162,500	
京浜急行電鉄	197,300	1,614.00	318,442,200	
小田急電鉄	228,500	2,644.00	604,154,000	
京王電鉄	79,700	6,500.00	518,050,000	
京成電鉄	106,900	2,969.00	317,386,100	
富士急行	20,900	3,930.00	82,137,000	
新京成電鉄	3,900	2,430.00	9,477,000	
東日本旅客鉄道	270,400	6,480.00	1,752,192,000	
西日本旅客鉄道	136,900	5,191.00	710,647,900	

東海旅客鉄道	127,700	15,090.00	1,926,993,000	
西武ホールディングス	200,600	1,130.00	226,678,000	
鴻池運輸	24,400	1,156.00	28,206,400	
西日本鉄道	42,600	3,045.00	129,717,000	
ハマキョウレックス	11,800	3,185.00	37,583,000	
サカイ引越センター	8,100	5,130.00	41,553,000	
近鉄グループホールディングス	145,500	4,485.00	652,567,500	
阪急阪神ホールディングス	194,100	3,380.00	656,058,000	
南海電気鉄道	69,000	2,330.00	160,770,000	
京阪ホールディングス	64,800	4,360.00	282,528,000	
神戸電鉄	3,500	3,755.00	13,142,500	
名古屋鉄道	119,600	2,882.00	344,687,200	
山陽電気鉄道	10,400	2,203.00	22,911,200	
日本通運	50,400	6,140.00	309,456,000	
ヤマトホールディングス	255,100	2,761.00	704,331,100	
山九	40,400	4,135.00	167,054,000	
丸運	8,300	274.00	2,274,200	
丸全昭和運輸	11,800	3,585.00	42,303,000	
センコーグループホールディングス	80,200	980.00	78,596,000	
トナミホールディングス	3,500	6,510.00	22,785,000	
ニッコンホールディングス	52,100	2,279.00	118,735,900	
日本石油輸送	1,600	2,700.00	4,320,000	
福山通運	18,600	5,110.00	95,046,000	
セイノーホールディングス	109,000	1,526.00	166,334,000	
エスライン	4,400	1,004.00	4,417,600	
神奈川中央交通	3,600	4,000.00	14,400,000	
日立物流	26,700	3,325.00	88,777,500	
丸和運輸機関	15,300	4,155.00	63,571,500	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	14,700	1,775.00	26,092,500	
九州旅客鉄道	127,600	2,247.00	286,717,200	
ＳＧホールディングス	152,700	5,450.00	832,215,000	
日本郵船	122,300	1,817.00	222,219,100	
商船三井	92,600	2,058.00	190,570,800	
川崎汽船	44,800	1,168.00	52,326,400	
ＮＳユナイテッド海運	8,800	1,441.00	12,680,800	
飯野海運	71,800	374.00	26,853,200	
共栄タンカー	4,000	772.00	3,088,000	
乾汽船	8,400	876.00	7,358,400	
日本航空	257,300	1,966.00	505,851,800	
ＡＮＡホールディングス	266,000	2,430.00	646,380,000	
パスコ	2,800	1,413.00	3,956,400	
トランコム	4,100	7,580.00	31,078,000	

日新	12,600	1,589.00	20,021,400	
三菱倉庫	46,200	2,988.00	138,045,600	
三井倉庫ホールディングス	16,600	1,831.00	30,394,600	
住友倉庫	52,300	1,330.00	69,559,000	
澁澤倉庫	8,000	2,346.00	18,768,000	
東陽倉庫	26,300	352.00	9,257,600	
日本トランスシティ	32,000	584.00	18,688,000	
ケイヒン	2,800	1,418.00	3,970,400	
中央倉庫	8,900	1,250.00	11,125,000	
川西倉庫	2,700	1,151.00	3,107,700	
安田倉庫	11,900	943.00	11,221,700	
ファイズホールディングス	3,100	1,222.00	3,788,200	
東洋埠頭	4,400	1,519.00	6,683,600	
宇徳	12,400	520.00	6,448,000	
上組	81,200	2,068.00	167,921,600	
サンリツ	3,400	631.00	2,145,400	
キムラユニティー	3,900	1,085.00	4,231,500	
キユーソー流通システム	3,600	1,586.00	5,709,600	
近鉄エクスプレス	30,900	2,228.00	68,845,200	
東海運	8,300	311.00	2,581,300	
エーアイテイー	10,300	1,123.00	11,566,900	
内外トランスライン	5,100	1,287.00	6,563,700	
日本コンセプト	4,600	1,469.00	6,757,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	42,900	2,013.00	86,357,700	
クロスキャット	4,200	1,530.00	6,426,000	
システナ	54,000	1,824.00	98,496,000	
デジタルアーツ	7,500	8,570.00	64,275,000	
日鉄ソリューションズ	22,700	3,240.00	73,548,000	
キューブシステム	8,300	1,403.00	11,644,900	
エイジア	2,900	2,380.00	6,902,000	
コア	6,600	1,413.00	9,325,800	
ラクーンホールディングス	7,200	2,102.00	15,134,400	
ソリトンシステムズ	7,700	2,132.00	16,416,400	
ソフトクリエイトホールディングス	6,700	3,330.00	22,311,000	
ＴＩＳ	150,900	2,228.00	336,205,200	
ＪＮＳホールディングス	6,000	744.00	4,464,000	
電算システム	5,400	3,675.00	19,845,000	
グリー	93,300	510.00	47,583,000	
コーエーテクモホールディングス	30,900	5,060.00	156,354,000	
三菱総合研究所	6,600	4,430.00	29,238,000	
電算	1,800	2,437.00	4,386,600	
ＡＧＳ	8,900	941.00	8,374,900	

ファインデックス	13,000	1,344.00	17,472,000	
ブレインパッド	4,000	4,255.00	17,020,000	
ＫＬａｂ	27,400	940.00	25,756,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	18,600	946.00	17,595,600	
イーブックイニシアティブジャパン	2,300	3,455.00	7,946,500	
ネクソン	380,000	2,622.00	996,360,000	
アイスタイル	43,500	320.00	13,920,000	
エムアップホールディングス	4,500	3,055.00	13,747,500	
エイチーム	10,900	785.00	8,556,500	
エニグモ	14,500	1,670.00	24,215,000	
テクノスジャパン	12,100	931.00	11,265,100	
コロプラ	49,900	898.00	44,810,200	
ブロードリーフ	75,400	545.00	41,093,000	
クロス・マーケティンググループ	7,700	360.00	2,772,000	
デジタルハーツホールディングス	8,300	1,090.00	9,047,000	
システム情報	11,600	1,386.00	16,077,600	
メディアドゥ	4,800	7,610.00	36,528,000	
じげん	38,500	344.00	13,244,000	
エンカレッジ・テクノロジ	3,700	881.00	3,259,700	
サイバーリンクス	2,600	2,820.00	7,332,000	
フィックスターズ	16,400	1,130.00	18,532,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,400	1,302.00	8,332,800	
オプティム	8,000	3,190.00	25,520,000	
セレス	5,100	2,133.00	10,878,300	
ＳＨＩＦＴ	6,100	15,760.00	96,136,000	
ティーガイア	13,600	1,972.00	26,819,200	
セック	2,300	3,145.00	7,233,500	
日本アジアグループ	15,900	298.00	4,738,200	
テクマトリックス	21,400	2,285.00	48,899,000	
プロシップ	4,600	1,597.00	7,346,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,500	2,257.00	82,380,500	
GMOペイメントゲートウェイ	31,900	11,240.00	358,556,000	
ザッパラス	7,400	477.00	3,529,800	
システムリサーチ	4,200	1,908.00	8,013,600	
インターネットイニシアティブ	22,400	4,720.00	105,728,000	
さくらインターネット	16,600	789.00	13,097,400	
ヴィンクス	4,500	1,269.00	5,710,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,400	10,040.00	34,136,000	
ＳＲＡホールディングス	8,200	2,412.00	19,778,400	
システムインテグレータ	5,300	721.00	3,821,300	
朝日ネット	11,100	951.00	10,556,100	
ｅＢＡＳＥ	18,300	1,369.00	25,052,700	

アバント	14,700	1,043.00	15,332,100	
アドソル日進	5,500	2,685.00	14,767,500	
フリービット	8,200	951.00	7,798,200	
コムチュア	17,100	2,631.00	44,990,100	
サイバーコム	2,900	1,860.00	5,394,000	
アステリア	9,700	832.00	8,070,400	
アイル	8,600	1,546.00	13,295,600	
マークラインズ	6,500	2,364.00	15,366,000	
メディカル・データ・ビジョン	17,400	2,170.00	37,758,000	
ショーケース	3,600	991.00	3,567,600	
モバイルファクトリー	3,700	1,272.00	4,706,400	
テラスカイ	5,500	5,020.00	27,610,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,200	1,333.00	8,264,600	
ＰＣＩホールディングス	6,000	1,216.00	7,296,000	
パイプドＨＤ	2,100	1,803.00	3,786,300	
アイビーシー	2,800	1,140.00	3,192,000	
ネオジャパン	3,000	2,290.00	6,870,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,700	2,818.00	7,608,600	
ランドコンピュータ	2,700	1,176.00	3,175,200	
ダブルスタンダード	2,000	5,070.00	10,140,000	
オープンドア	7,800	1,363.00	10,631,400	
マイネット	4,900	1,490.00	7,301,000	
アカツキ	5,400	4,620.00	24,948,000	
ベネフィットジャパン	1,300	1,888.00	2,454,400	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3,500	2,644.00	9,254,000	
ＬＩＮＥ	34,700	5,360.00	185,992,000	
カナミックネットワーク	14,300	808.00	11,554,400	
ノムラシステムコーポレーション	7,500	426.00	3,195,000	
チェンジ	10,600	8,380.00	88,828,000	
シンクロ・フード	7,600	338.00	2,568,800	
オークネット	8,300	1,465.00	12,159,500	
セグエグループ	4,100	1,611.00	6,605,100	
エイトレッド	2,700	2,781.00	7,508,700	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	16,200	418.00	6,771,600	
マクロミル	31,300	755.00	23,631,500	
ビーグリー	3,200	1,874.00	5,996,800	
オロ	4,900	3,485.00	17,076,500	
ユーザーローカル	1,600	4,430.00	7,088,000	
テモナ	3,500	1,359.00	4,756,500	
ニーズウェル	3,300	985.00	3,250,500	
サインポスト	3,400	1,367.00	4,647,800	
ソルクシーズ	6,100	1,091.00	6,655,100	

フェイス	5,700	995.00	5,671,500	
プロトコーポレーション	13,800	1,269.00	17,512,200	
ハイマックス	3,800	1,315.00	4,997,000	
野村総合研究所	213,800	3,095.00	661,711,000	
サイバネットシステム	11,200	884.00	9,900,800	
ＣＥホールディングス	8,500	670.00	5,695,000	
日本システム技術	2,600	1,859.00	4,833,400	
インテージホールディングス	19,200	994.00	19,084,800	
東邦システムサイエンス	4,400	977.00	4,298,800	
ソースネクスト	72,700	317.00	23,045,900	
インフォコム	16,600	4,040.00	67,064,000	
ＨＥＲＯＺ	2,200	3,540.00	7,788,000	
ラクスル	12,200	4,290.00	52,338,000	
ＦＩＧ	17,800	278.00	4,948,400	
システムサポート	3,700	1,707.00	6,315,900	
イーソル	8,500	1,221.00	10,378,500	
アルテリア・ネットワークス	16,900	1,825.00	30,842,500	
東海ソフト	1,300	1,379.00	1,792,700	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,900	1,374.00	3,984,600	
東名	1,100	1,427.00	1,569,700	
ヴィッツ	700	3,330.00	2,331,000	
トビラシステムズ	1,700	1,976.00	3,359,200	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	1,200	2,055.00	2,466,000	
フォーカスシステムズ	9,700	1,016.00	9,855,200	
クレスコ	9,500	1,373.00	13,043,500	
フジ・メディア・ホールディングス	145,600	1,011.00	147,201,600	
オービック	52,300	18,440.00	964,412,000	
ジャストシステム	24,600	7,430.00	182,778,000	
ＴＤＣソフト	13,500	1,067.00	14,404,500	
Ｚホールディングス	2,071,000	699.00	1,447,629,000	
トレンドマイクロ	80,500	6,410.00	516,005,000	
ＩＤホールディングス	6,000	1,485.00	8,910,000	
日本オラクル	30,600	11,320.00	346,392,000	
アルファシステムズ	4,800	3,640.00	17,472,000	
フューチャー	18,400	2,180.00	40,112,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10,100	1,400.00	14,140,000	
ＳＢテクノロジー	5,500	3,680.00	20,240,000	
トーセ	4,500	963.00	4,333,500	
オービックビジネスコンサルタント	15,500	6,100.00	94,550,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	68,800	3,985.00	274,168,000	
アイティフォー	18,700	904.00	16,904,800	
東計電算	2,300	4,890.00	11,247,000	

エックスネット	2,800	1,115.00	3,122,000	
大塚商会	81,600	5,380.00	439,008,000	
サイボウズ	17,700	3,310.00	58,587,000	
ソフトブレーン	12,300	868.00	10,676,400	
電通国際情報サービス	9,400	6,620.00	62,228,000	
ＡＣＣＥＳＳ	14,500	887.00	12,861,500	
デジタルガレージ	27,300	3,570.00	97,461,000	
ＥＭシステムズ	21,800	866.00	18,878,800	
ウェザーニューズ	5,100	5,970.00	30,447,000	
ＣＩＪ	10,700	930.00	9,951,000	
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,665.00	6,597,000	
日本エンタープライズ	16,700	290.00	4,843,000	
WOWOW	7,400	2,791.00	20,653,400	
スカラ	10,500	1,061.00	11,140,500	
インテリジェント　ウェイブ	9,300	830.00	7,719,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	13,800	400.00	5,520,000	
ネットワンシステムズ	57,500	4,780.00	274,850,000	
システムソフト	36,400	103.00	3,749,200	
アルゴグラフィックス	12,900	3,605.00	46,504,500	
マーベラス	23,500	800.00	18,800,000	
エイベックス	26,300	981.00	25,800,300	
日本ユニシス	47,200	3,300.00	155,760,000	
兼松エレクトロニクス	8,300	4,260.00	35,358,000	
都築電気	5,000	1,658.00	8,290,000	
東京放送ホールディングス	91,900	1,806.00	165,971,400	
日本テレビホールディングス	126,200	1,129.00	142,479,800	
朝日放送グループホールディングス	15,500	713.00	11,051,500	
テレビ朝日ホールディングス	41,600	1,666.00	69,305,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	100,000	459.00	45,900,000	
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,401.00	30,012,500	
日本ＢＳ放送	5,400	1,166.00	6,296,400	
ビジョン	19,200	815.00	15,648,000	
スマートバリュー	4,300	1,085.00	4,665,500	
ワイヤレスゲート	6,600	762.00	5,029,200	
コネクシオ	8,900	1,176.00	10,466,400	
クロップス	3,300	756.00	2,494,800	
日本電信電話	2,015,400	2,150.00	4,333,110,000	
ＫＤＤＩ	1,099,200	2,656.00	2,919,475,200	
ソフトバンク	1,370,400	1,177.50	1,613,646,000	
光通信	15,600	24,980.00	389,688,000	
ＮＴＴドコモ	1,078,200	3,885.00	4,188,807,000	
エムティーアイ	15,000	882.00	13,230,000	

GMOインターネット	54,200	2,741.00	148,562,200	
ファイバーゲート	5,100	1,869.00	9,531,900	
アイドママーケティングコミュニケーション	5,400	422.00	2,278,800	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	40,700	2,772.00	112,820,400	
学研ホールディングス	20,500	1,624.00	33,292,000	
ゼンリン	30,400	1,125.00	34,200,000	
昭文社ホールディングス	7,700	503.00	3,873,100	
インプレスホールディングス	12,500	182.00	2,275,000	
アイネット	8,000	1,669.00	13,352,000	
松竹	10,000	15,370.00	153,700,000	
東宝	89,000	4,335.00	385,815,000	
東映	5,700	17,490.00	99,693,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	401,700	1,342.00	539,081,400	
ピー・シー・エー	2,700	4,760.00	12,852,000	
ビジネスブレイン太田昭和	5,400	1,515.00	8,181,000	
ＤＴＳ	33,900	2,235.00	75,766,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	64,400	6,960.00	448,224,000	
シーイーシー	16,400	1,623.00	26,617,200	
カプコン	71,100	5,860.00	416,646,000	
アイ・エス・ビー	3,600	2,732.00	9,835,200	
ジャステック	9,900	1,405.00	13,909,500	
ＳＣＳＫ	34,900	5,870.00	204,863,000	
日本システムウエア	5,200	2,035.00	10,582,000	
アイネス	15,100	1,630.00	24,613,000	
ＴＫＣ	12,800	6,810.00	87,168,000	
富士ソフト	16,200	5,410.00	87,642,000	
ＮＳＤ	48,600	2,058.00	100,018,800	
コナミホールディングス	54,800	4,540.00	248,792,000	
福井コンピュータホールディングス	6,100	3,065.00	18,696,500	
ＪＢＣＣホールディングス	10,400	1,696.00	17,638,400	
ミロク情報サービス	13,500	2,192.00	29,592,000	
ソフトバンクグループ	1,196,300	6,469.00	7,738,864,700	
ホウスイ	1,200	911.00	1,093,200	
高千穂交易	5,900	1,028.00	6,065,200	
カワニシホールディングス	1,800	1,449.00	2,608,200	
伊藤忠食品	3,700	5,650.00	20,905,000	
エレマテック	14,200	991.00	14,072,200	
ＪＡＬＵＸ	4,300	1,554.00	6,682,200	
あらた	12,000	5,250.00	63,000,000	
トーメンデバイス	2,300	4,070.00	9,361,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,500	3,140.00	17,270,000	
フィールズ	11,600	338.00	3,920,800	

双日	835,800	238.00	198,920,400	
アルフレッサ　ホールディングス	168,200	2,298.00	386,523,600	
横浜冷凍	39,600	913.00	36,154,800	
ラサ商事	8,000	927.00	7,416,000	
アルコニックス	16,100	1,521.00	24,488,100	
神戸物産	52,200	5,780.00	301,716,000	
ハイパー	2,300	572.00	1,315,600	
あい　ホールディングス	21,600	1,933.00	41,752,800	
ディーブイエックス	5,400	1,037.00	5,599,800	
ダイワボウホールディングス	12,900	6,770.00	87,333,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	36,100	1,915.00	69,131,500	
ラクト・ジャパン	6,600	3,830.00	25,278,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,500	1,089.00	31,036,500	
八洲電機	11,700	968.00	11,325,600	
メディアスホールディングス	8,600	930.00	7,998,000	
レスターホールディングス	15,800	2,162.00	34,159,600	
ジューテックホールディングス	3,500	1,040.00	3,640,000	
大光	6,500	700.00	4,550,000	
ＯＣＨＩホールディングス	4,400	1,892.00	8,324,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	80,000	1,036.00	82,880,000	
黒谷	4,200	522.00	2,192,400	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,700	732.00	1,976,400	
三洋貿易	15,300	994.00	15,208,200	
ビューティガレージ	2,400	2,928.00	7,027,200	
ウイン・パートナーズ	10,900	1,029.00	11,216,100	
ミタチ産業	4,600	628.00	2,888,800	
シップヘルスケアホールディングス	24,300	5,130.00	124,659,000	
明治電機工業	4,800	1,414.00	6,787,200	
デリカフーズホールディングス	5,400	643.00	3,472,200	
スターティアホールディングス	3,500	716.00	2,506,000	
コメダホールディングス	33,000	1,964.00	64,812,000	
ピーバンドットコム	1,500	971.00	1,456,500	
アセンテック	3,200	2,299.00	7,356,800	
富士興産	4,600	716.00	3,293,600	
協栄産業	1,700	1,431.00	2,432,700	
小野建	13,600	1,120.00	15,232,000	
南陽	3,300	1,764.00	5,821,200	
佐鳥電機	10,300	853.00	8,785,900	
エコートレーディング	3,500	652.00	2,282,000	
伯東	9,200	1,121.00	10,313,200	
コンドーテック	11,700	1,219.00	14,262,300	
中山福	8,700	509.00	4,428,300	

ナガイレーベン	20,100	2,974.00	59,777,400	
三菱食品	16,600	2,771.00	45,998,600	
松田産業	11,100	1,541.00	17,105,100	
第一興商	22,500	3,375.00	75,937,500	
メディパルホールディングス	163,300	2,105.00	343,746,500	
ＳＰＫ	6,500	1,530.00	9,945,000	
萩原電気ホールディングス	5,600	2,282.00	12,779,200	
アズワン	9,900	15,090.00	149,391,000	
スズデン	5,300	1,234.00	6,540,200	
尾家産業	4,400	1,654.00	7,277,600	
シモジマ	9,300	1,412.00	13,131,600	
ドウシシャ	14,300	2,113.00	30,215,900	
小津産業	3,300	1,883.00	6,213,900	
高速	9,000	1,711.00	15,399,000	
たけびし	5,300	1,595.00	8,453,500	
リックス	3,400	1,690.00	5,746,000	
丸文	13,400	530.00	7,102,000	
ハピネット	12,600	1,416.00	17,841,600	
橋本総業ホールディングス	3,100	2,534.00	7,855,400	
日本ライフライン	44,800	1,391.00	62,316,800	
タカショー	9,900	671.00	6,642,900	
マルカ	4,900	2,282.00	11,181,800	
ＩＤＯＭ	40,800	633.00	25,826,400	
進和	9,000	2,231.00	20,079,000	
エスケイジャパン	3,300	349.00	1,151,700	
ダイトロン	6,400	1,528.00	9,779,200	
シークス	19,300	1,234.00	23,816,200	
田中商事	4,700	722.00	3,393,400	
オーハシテクニカ	7,800	1,463.00	11,411,400	
白銅	5,400	1,348.00	7,279,200	
ダイコー通産	1,000	1,435.00	1,435,000	
伊藤忠商事	1,058,400	2,685.00	2,841,804,000	
丸紅	1,575,100	594.50	936,396,950	
高島	2,400	1,936.00	4,646,400	
長瀬産業	85,100	1,468.00	124,926,800	
蝶理	9,700	1,612.00	15,636,400	
豊田通商	168,900	2,942.00	496,903,800	
三共生興	23,000	450.00	10,350,000	
兼松	56,400	1,285.00	72,474,000	
ツカモトコーポレーション	2,700	1,340.00	3,618,000	
三井物産	1,310,200	1,803.00	2,362,290,600	
日本紙パルプ商事	8,600	3,730.00	32,078,000	

カメイ	19,800	1,090.00	21,582,000	
東都水産	1,900	3,575.00	6,792,500	
ＯＵＧホールディングス	2,400	2,763.00	6,631,200	
スターゼン	5,600	4,155.00	23,268,000	
山善	59,100	1,061.00	62,705,100	
椿本興業	2,800	3,690.00	10,332,000	
住友商事	954,700	1,258.50	1,201,489,950	
内田洋行	6,000	5,210.00	31,260,000	
三菱商事	992,200	2,512.50	2,492,902,500	
第一実業	7,400	3,705.00	27,417,000	
キヤノンマーケティングジャパン	37,500	2,102.00	78,825,000	
西華産業	8,600	1,478.00	12,710,800	
佐藤商事	12,500	1,049.00	13,112,500	
菱洋エレクトロ	15,400	2,921.00	44,983,400	
東京産業	13,700	568.00	7,781,600	
ユアサ商事	14,400	3,270.00	47,088,000	
神鋼商事	3,800	1,788.00	6,794,400	
トルク	9,100	324.00	2,948,400	
阪和興業	28,300	2,100.00	59,430,000	
正栄食品工業	9,800	4,350.00	42,630,000	
カナデン	12,300	1,493.00	18,363,900	
菱電商事	10,900	1,533.00	16,709,700	
フルサト工業	8,400	1,480.00	12,432,000	
岩谷産業	33,800	3,945.00	133,341,000	
ナイス	6,400	1,470.00	9,408,000	
昭光通商	4,800	637.00	3,057,600	
ニチモウ	2,400	2,019.00	4,845,600	
極東貿易	4,400	1,498.00	6,591,200	
イワキ	19,900	507.00	10,089,300	
三愛石油	37,300	1,002.00	37,374,600	
稲畑産業	33,300	1,339.00	44,588,700	
ＧＳＩクレオス	3,700	1,763.00	6,523,100	
明和産業	14,000	445.00	6,230,000	
クワザワ	5,400	549.00	2,964,600	
ヤマエ久野	11,000	1,231.00	13,541,000	
ワキタ	32,300	1,052.00	33,979,600	
東邦ホールディングス	48,500	2,262.00	109,707,000	
サンゲツ	40,900	1,615.00	66,053,500	
ミツウロコグループホールディングス	22,300	1,351.00	30,127,300	
シナネンホールディングス	6,200	3,185.00	19,747,000	
伊藤忠エネクス	33,500	968.00	32,428,000	
サンリオ	42,500	1,894.00	80,495,000	

サンワテクノス	10,700	885.00	9,469,500	
リョーサン	16,700	2,105.00	35,153,500	
新光商事	23,700	913.00	21,638,100	
トーホー	6,800	2,101.00	14,286,800	
三信電気	8,100	2,034.00	16,475,400	
東陽テクニカ	16,200	997.00	16,151,400	
モスフードサービス	19,900	2,905.00	57,809,500	
加賀電子	15,100	2,234.00	33,733,400	
ソーダニッカ	15,700	576.00	9,043,200	
立花エレテック	11,200	1,885.00	21,112,000	
フォーバル	6,600	1,031.00	6,804,600	
ＰＡＬＴＡＣ	24,300	5,310.00	129,033,000	
三谷産業	20,000	387.00	7,740,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,400	1,878.00	6,385,200	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,400	1,485.00	2,079,000	
コーア商事ホールディングス	1,400	2,471.00	3,459,400	
国際紙パルプ商事	35,900	305.00	10,949,500	
ヤマタネ	7,600	1,333.00	10,130,800	
丸紅建材リース	1,500	1,780.00	2,670,000	
日鉄物産	10,800	2,995.00	32,346,000	
泉州電業	4,300	3,250.00	13,975,000	
トラスコ中山	34,600	2,658.00	91,966,800	
オートバックスセブン	56,200	1,366.00	76,769,200	
モリト	11,100	713.00	7,914,300	
加藤産業	21,800	3,770.00	82,186,000	
北恵	3,800	1,198.00	4,552,400	
イノテック	7,900	1,052.00	8,310,800	
イエローハット	28,600	1,757.00	50,250,200	
ＪＫホールディングス	13,700	875.00	11,987,500	
日伝	13,700	2,311.00	31,660,700	
北沢産業	11,500	292.00	3,358,000	
杉本商事	8,200	1,962.00	16,088,400	
因幡電機産業	43,100	2,629.00	113,309,900	
東テク	5,000	2,555.00	12,775,000	
ミスミグループ本社	189,700	2,935.00	556,769,500	
アルテック	11,200	264.00	2,956,800	
タキヒヨー	4,600	1,903.00	8,753,800	
蔵王産業	2,900	1,478.00	4,286,200	
スズケン	64,100	4,005.00	256,720,500	
ジェコス	10,500	939.00	9,859,500	
グローセル	15,200	424.00	6,444,800	
ローソン	38,300	5,020.00	192,266,000	

サンエー	12,600	4,635.00	58,401,000	
カワチ薬品	11,800	2,920.00	34,456,000	
エービーシー・マート	23,700	5,470.00	129,639,000	
ハードオフコーポレーション	6,400	704.00	4,505,600	
アスクル	15,900	4,285.00	68,131,500	
ゲオホールディングス	27,400	1,667.00	45,675,800	
アダストリア	21,100	1,652.00	34,857,200	
ジーフット	9,100	537.00	4,886,700	
くら寿司	8,900	5,720.00	50,908,000	
キャンドゥ	7,300	2,172.00	15,855,600	
パルグループホールディングス	15,700	1,117.00	17,536,900	
エディオン	69,700	1,100.00	76,670,000	
サーラコーポレーション	31,200	593.00	18,501,600	
ワッツ	6,900	937.00	6,465,300	
ハローズ	5,700	4,155.00	23,683,500	
フジオフードグループ本社	12,800	1,419.00	18,163,200	
あみやき亭	3,400	2,931.00	9,965,400	
ひらまつ	27,800	199.00	5,532,200	
大黒天物産	3,700	5,870.00	21,719,000	
ハニーズホールディングス	13,600	1,025.00	13,940,000	
ファーマライズホールディングス	4,000	830.00	3,320,000	
アルペン	11,700	1,983.00	23,201,100	
ハブ	4,700	695.00	3,266,500	
クオールホールディングス	22,500	1,205.00	27,112,500	
ジンズホールディングス	8,000	8,280.00	66,240,000	
ビックカメラ	90,000	1,165.00	104,850,000	
ＤＣＭホールディングス	87,600	1,448.00	126,844,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	107,600	5,220.00	561,672,000	
東京一番フーズ	4,300	586.00	2,519,800	
きちりホールディングス	4,400	664.00	2,921,600	
アークランドサービスホールディングス	12,800	2,113.00	27,046,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	181,100	758.00	137,273,800	
ドトール・日レスホールディングス	21,900	1,600.00	35,040,000	
マツモトキヨシホールディングス	62,600	3,840.00	240,384,000	
ブロンコビリー	8,000	2,403.00	19,224,000	
ＺＯＺＯ	104,100	2,928.00	304,804,800	
トレジャー・ファクトリー	4,800	786.00	3,772,800	
物語コーポレーション	4,100	10,370.00	42,517,000	
ココカラファイン	15,800	6,800.00	107,440,000	
三越伊勢丹ホールディングス	265,100	556.00	147,395,600	
Ｈａｍｅｅ	5,500	2,471.00	13,590,500	
ウエルシアホールディングス	90,100	4,625.00	416,712,500	

クリエイトＳＤホールディングス	25,600	3,685.00	94,336,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	17,700	381.00	6,743,700	
ティーライフ	2,400	1,271.00	3,050,400	
チムニー	4,800	1,373.00	6,590,400	
シュッピン	10,600	816.00	8,649,600	
オイシックス・ラ・大地	15,000	3,395.00	50,925,000	
ネクステージ	25,600	1,144.00	29,286,400	
ジョイフル本田	44,500	1,714.00	76,273,000	
鳥貴族	4,600	1,477.00	6,794,200	
キリン堂ホールディングス	6,000	3,500.00	21,000,000	
ホットランド	11,500	1,189.00	13,673,500	
すかいらーくホールディングス	169,700	1,500.00	254,550,000	
ＳＦＰホールディングス	8,800	1,366.00	12,020,800	
綿半ホールディングス	11,400	1,608.00	18,331,200	
ヨシックス	2,600	1,700.00	4,420,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,200	1,268.00	56,045,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,200	703.00	5,764,600	
ＢＥＥＮＯＳ	7,100	1,797.00	12,758,700	
あさひ	11,400	1,847.00	21,055,800	
日本調剤	9,300	1,701.00	15,819,300	
コスモス薬品	13,400	18,350.00	245,890,000	
トーエル	7,600	855.00	6,498,000	
オンリー	3,100	526.00	1,630,600	
セブン&アイ・ホールディングス	592,000	3,250.00	1,924,000,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	81,300	604.00	49,105,200	
ツルハホールディングス	33,000	14,910.00	492,030,000	
サンマルクホールディングス	12,100	1,543.00	18,670,300	
フェリシモ	3,600	1,157.00	4,165,200	
トリドールホールディングス	37,600	1,424.00	53,542,400	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	14,300	395.00	5,648,500	
ウイルプラスホールディングス	2,300	554.00	1,274,200	
ＪＭホールディングス	11,500	2,815.00	32,372,500	
サツドラホールディングス	2,400	2,071.00	4,970,400	
アレンザホールディングス	7,700	1,724.00	13,274,800	
串カツ田中ホールディングス	4,100	1,736.00	7,117,600	
バロックジャパンリミテッド	10,900	634.00	6,910,600	
クスリのアオキホールディングス	13,600	8,580.00	116,688,000	
力の源ホールディングス	6,900	645.00	4,450,500	
スシローグローバルホールディングス	83,100	2,648.00	220,048,800	
メディカルシステムネットワーク	15,200	462.00	7,022,400	
はるやまホールディングス	7,400	756.00	5,594,400	

ノジマ	27,000	2,830.00	76,410,000	
カッパ・クリエイト	21,200	1,568.00	33,241,600	
ライトオン	11,300	565.00	6,384,500	
良品計画	201,000	1,740.00	349,740,000	
三城ホールディングス	16,900	294.00	4,968,600	
アドヴァン	23,300	1,321.00	30,779,300	
アルビス	5,800	2,808.00	16,286,400	
コナカ	18,700	287.00	5,366,900	
ハウス　オブ　ローゼ	2,000	1,661.00	3,322,000	
Ｇ－７ホールディングス	9,000	2,562.00	23,058,000	
イオン北海道	20,100	875.00	17,587,500	
コジマ	26,500	550.00	14,575,000	
ヒマラヤ	5,600	976.00	5,465,600	
コーナン商事	21,600	4,090.00	88,344,000	
エコス	5,700	2,264.00	12,904,800	
ワタミ	18,100	994.00	17,991,400	
マルシェ	4,400	576.00	2,534,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	332,700	2,450.00	815,115,000	
西松屋チェーン	33,400	1,428.00	47,695,200	
ゼンショーホールディングス	72,600	2,481.00	180,120,600	
幸楽苑ホールディングス	9,600	1,843.00	17,692,800	
ハークスレイ	3,400	987.00	3,355,800	
サイゼリヤ	22,600	2,141.00	48,386,600	
ＶＴホールディングス	63,300	406.00	25,699,800	
魚力	4,300	1,701.00	7,314,300	
フジ・コーポレーション	4,100	2,307.00	9,458,700	
ユナイテッドアローズ	16,000	1,521.00	24,336,000	
ハイデイ日高	22,000	1,914.00	42,108,000	
京都きもの友禅	10,700	244.00	2,610,800	
コロワイド	50,300	1,787.00	89,886,100	
ピーシーデポコーポレーション	20,500	690.00	14,145,000	
壱番屋	10,700	5,620.00	60,134,000	
ＰＬＡＮＴ	4,200	864.00	3,628,800	
スギホールディングス	30,200	7,440.00	224,688,000	
薬王堂ホールディングス	6,700	2,633.00	17,641,100	
スクロール	23,500	912.00	21,432,000	
ヨンドシーホールディングス	15,500	1,757.00	27,233,500	
ファミリーマート	121,000	2,370.00	286,770,000	
木曽路	19,900	2,540.00	50,546,000	
ＳＲＳホールディングス	18,100	919.00	16,633,900	
タカキュー	11,700	162.00	1,895,400	
リテールパートナーズ	20,200	1,755.00	35,451,000	

ケーヨー	31,200	877.00	27,362,400	
上新電機	17,900	2,619.00	46,880,100	
日本瓦斯	24,000	5,330.00	127,920,000	
ロイヤルホールディングス	26,400	1,818.00	47,995,200	
いなげや	18,800	1,977.00	37,167,600	
島忠	28,500	3,555.00	101,317,500	
チヨダ	16,100	980.00	15,778,000	
ライフコーポレーション	11,500	4,845.00	55,717,500	
リンガーハット	18,700	2,581.00	48,264,700	
ＭｒＭａｘＨＤ	21,100	954.00	20,129,400	
テンアライド	13,900	391.00	5,434,900	
ＡＯＫＩホールディングス	30,700	526.00	16,148,200	
オークワ	23,800	1,502.00	35,747,600	
コメリ	23,400	3,315.00	77,571,000	
青山商事	31,700	551.00	17,466,700	
しまむら	17,600	10,230.00	180,048,000	
はせがわ	8,800	322.00	2,833,600	
高島屋	110,400	831.00	91,742,400	
松屋	30,700	751.00	23,055,700	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	71,900	683.00	49,107,700	
近鉄百貨店	5,900	3,260.00	19,234,000	
丸井グループ	138,800	2,011.00	279,126,800	
アクシアル　リテイリング	12,600	4,935.00	62,181,000	
イオン	582,300	2,826.00	1,645,579,800	
イズミ	30,800	3,825.00	117,810,000	
平和堂	30,800	2,267.00	69,823,600	
フジ	18,400	1,894.00	34,849,600	
ヤオコー	17,200	7,810.00	134,332,000	
ゼビオホールディングス	18,600	760.00	14,136,000	
ケーズホールディングス	146,200	1,420.00	207,604,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	8,100	1,065.00	8,626,500	
日産東京販売ホールディングス	23,200	256.00	5,939,200	
シルバーライフ	2,200	1,996.00	4,391,200	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,700	3,760.00	25,192,000	
ナルミヤ・インターナショナル	3,800	586.00	2,226,800	
ブックオフグループホールディングス	8,800	899.00	7,911,200	
アインホールディングス	18,600	7,360.00	136,896,000	
元気寿司	3,900	2,380.00	9,282,000	
ヤマダ電機	461,500	524.00	241,826,000	
アークランドサカモト	23,800	2,151.00	51,193,800	
ニトリホールディングス	65,500	21,850.00	1,431,175,000	
グルメ杵屋	11,000	1,002.00	11,022,000	

愛眼	12,100	233.00	2,819,300	
ケーユーホールディングス	8,200	903.00	7,404,600	
吉野家ホールディングス	49,800	1,970.00	98,106,000	
松屋フーズホールディングス	7,300	3,650.00	26,645,000	
サガミホールディングス	20,400	1,336.00	27,254,400	
関西スーパーマーケット	12,800	1,359.00	17,395,200	
王将フードサービス	11,100	5,940.00	65,934,000	
プレナス	17,100	1,818.00	31,087,800	
ミニストップ	11,300	1,478.00	16,701,400	
アークス	31,000	2,694.00	83,514,000	
バローホールディングス	33,600	2,906.00	97,641,600	
ベルク	7,500	7,770.00	58,275,000	
大庄	8,300	1,251.00	10,383,300	
ファーストリテイリング	20,200	65,860.00	1,330,372,000	
サンドラッグ	57,000	3,965.00	226,005,000	
サックスバー　ホールディングス	13,300	577.00	7,674,100	
ヤマザワ	3,700	1,817.00	6,722,900	
やまや	3,100	2,118.00	6,565,800	
ベルーナ	32,700	952.00	31,130,400	
島根銀行	4,000	702.00	2,808,000	
じもとホールディングス	10,240	1,132.00	11,591,680	
めぶきフィナンシャルグループ	787,400	238.00	187,401,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	20,500	1,131.00	23,185,500	
九州フィナンシャルグループ	331,500	493.00	163,429,500	
ゆうちょ銀行	429,300	821.00	352,455,300	
富山第一銀行	36,100	311.00	11,227,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	865,500	365.00	315,907,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	100,800	732.00	73,785,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	88,900	431.00	38,315,900	
三十三フィナンシャルグループ	14,000	1,372.00	19,208,000	
第四北越フィナンシャルグループ	26,300	2,171.00	57,097,300	
新生銀行	111,200	1,294.00	143,892,800	
あおぞら銀行	90,300	1,743.00	157,392,900	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	10,365,900	416.10	4,313,250,990	
りそなホールディングス	1,647,500	357.60	589,146,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	286,400	2,792.50	799,772,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,053,900	2,917.50	3,074,753,250	
千葉銀行	505,700	579.00	292,800,300	
群馬銀行	291,100	350.00	101,885,000	
武蔵野銀行	22,600	1,565.00	35,369,000	
千葉興業銀行	41,600	249.00	10,358,400	
筑波銀行	63,000	201.00	12,663,000	

七十七銀行	51,200	1,620.00	82,944,000	
青森銀行	11,700	2,501.00	29,261,700	
秋田銀行	9,700	1,581.00	15,335,700	
山形銀行	17,000	1,361.00	23,137,000	
岩手銀行	9,900	2,534.00	25,086,600	
東邦銀行	135,500	231.00	31,300,500	
東北銀行	7,300	1,212.00	8,847,600	
みちのく銀行	9,700	1,350.00	13,095,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	127,600	1,764.00	225,086,400	
静岡銀行	369,000	726.00	267,894,000	
十六銀行	19,000	2,002.00	38,038,000	
スルガ銀行	155,000	379.00	58,745,000	
八十二銀行	365,700	413.00	151,034,100	
山梨中央銀行	17,600	824.00	14,502,400	
大垣共立銀行	29,900	2,379.00	71,132,100	
福井銀行	13,000	1,771.00	23,023,000	
北國銀行	15,100	3,085.00	46,583,500	
清水銀行	6,200	1,890.00	11,718,000	
富山銀行	2,900	3,550.00	10,295,000	
滋賀銀行	30,400	2,462.00	74,844,800	
南都銀行	25,200	1,945.00	49,014,000	
百五銀行	136,400	329.00	44,875,600	
京都銀行	54,300	5,070.00	275,301,000	
紀陽銀行	53,700	1,621.00	87,047,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	100,900	1,057.00	106,651,300	
広島銀行	223,700	600.00	134,220,000	
山陰合同銀行	89,900	565.00	50,793,500	
中国銀行	130,400	1,007.00	131,312,800	
鳥取銀行	5,200	1,280.00	6,656,000	
伊予銀行	216,200	696.00	150,475,200	
百十四銀行	16,100	1,780.00	28,658,000	
四国銀行	23,000	743.00	17,089,000	
阿波銀行	24,800	2,585.00	64,108,000	
大分銀行	8,700	2,435.00	21,184,500	
宮崎銀行	10,100	2,400.00	24,240,000	
佐賀銀行	9,200	1,307.00	12,024,400	
沖縄銀行	13,900	3,140.00	43,646,000	
琉球銀行	35,000	912.00	31,920,000	
セブン銀行	506,300	255.00	129,106,500	
みずほフィナンシャルグループ	2,059,100	1,310.50	2,698,450,550	
高知銀行	5,500	861.00	4,735,500	
山口フィナンシャルグループ	189,100	683.00	129,155,300	

長野銀行	5,000	1,458.00	7,290,000	
名古屋銀行	11,300	2,553.00	28,848,900	
北洋銀行	228,400	229.00	52,303,600	
愛知銀行	5,500	3,035.00	16,692,500	
中京銀行	6,200	2,120.00	13,144,000	
大光銀行	5,200	1,582.00	8,226,400	
愛媛銀行	21,200	1,180.00	25,016,000	
トマト銀行	5,800	1,222.00	7,087,600	
京葉銀行	64,600	486.00	31,395,600	
栃木銀行	73,200	182.00	13,322,400	
北日本銀行	4,700	2,059.00	9,677,300	
東和銀行	26,600	722.00	19,205,200	
福島銀行	14,300	244.00	3,489,200	
大東銀行	7,900	677.00	5,348,300	
トモニホールディングス	117,100	340.00	39,814,000	
フィデアホールディングス	147,100	110.00	16,181,000	
池田泉州ホールディングス	174,300	175.00	30,502,500	
ＦＰＧ	47,100	532.00	25,057,200	
マーキュリアインベストメント	6,200	664.00	4,116,800	
ＳＢＩホールディングス	169,300	2,713.00	459,310,900	
ジャフコ	23,300	4,415.00	102,869,500	
大和証券グループ本社	1,216,400	440.70	536,067,480	
野村ホールディングス	2,666,700	478.60	1,276,282,620	
岡三証券グループ	129,700	346.00	44,876,200	
丸三証券	45,500	450.00	20,475,000	
東洋証券	56,000	115.00	6,440,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	174,800	272.00	47,545,600	
光世証券	4,000	676.00	2,704,000	
水戸証券	44,800	212.00	9,497,600	
いちよし証券	28,800	469.00	13,507,200	
松井証券	86,800	942.00	81,765,600	
マネックスグループ	112,000	265.00	29,680,000	
極東証券	20,700	608.00	12,585,600	
岩井コスモホールディングス	14,500	1,284.00	18,618,000	
藍澤證券	27,500	691.00	19,002,500	
マネーパートナーズグループ	17,100	212.00	3,625,200	
スパークス・グループ	71,000	225.00	15,975,000	
かんぽ生命保険	53,700	1,651.00	88,658,700	
ＳＯＭＰＯホールディングス	284,900	3,629.00	1,033,902,100	
アニコム　ホールディングス	50,400	1,068.00	53,827,200	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	396,200	2,824.00	1,118,868,800	
第一生命ホールディングス	857,500	1,477.00	1,266,527,500	

東京海上ホールディングス	535,800	4,600.00	2,464,680,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	452,900	1,032.00	467,392,800	
アドバンスクリエイト	3,100	2,135.00	6,618,500	
全国保証	42,700	4,135.00	176,564,500	
イントラスト	5,400	902.00	4,870,800	
日本モーゲージサービス	6,200	1,119.00	6,937,800	
Ｃａｓａ	5,400	1,225.00	6,615,000	
アルヒ	24,100	1,840.00	44,344,000	
プレミアグループ	8,300	2,104.00	17,463,200	
クレディセゾン	106,200	1,112.00	118,094,400	
芙蓉総合リース	15,900	6,500.00	103,350,000	
みずほリース	23,400	2,702.00	63,226,800	
東京センチュリー	30,500	5,710.00	174,155,000	
日本証券金融	66,900	510.00	34,119,000	
アイフル	231,500	271.00	62,736,500	
リコーリース	12,000	2,842.00	34,104,000	
イオンフィナンシャルサービス	92,800	953.00	88,438,400	
アコム	304,800	455.00	138,684,000	
ジャックス	16,800	1,700.00	28,560,000	
オリエントコーポレーション	410,700	113.00	46,409,100	
日立キャピタル	35,800	2,463.00	88,175,400	
アプラスフィナンシャル	73,900	76.00	5,616,400	
オリックス	940,200	1,305.00	1,226,961,000	
三菱ＵＦＪリース	384,800	485.00	186,628,000	
九州リースサービス	7,600	661.00	5,023,600	
日本取引所グループ	435,000	2,938.00	1,278,030,000	
イー・ギャランティ	16,600	2,395.00	39,757,000	
アサックス	8,000	782.00	6,256,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	6,200	1,876.00	11,631,200	
いちご	199,800	305.00	60,939,000	
日本駐車場開発	165,500	131.00	21,680,500	
スター・マイカ・ホールディングス	9,500	1,335.00	12,682,500	
ＡＤワークスグループ	28,100	158.00	4,439,800	
ヒューリック	323,600	984.00	318,422,400	
三栄建築設計	7,500	1,483.00	11,122,500	
野村不動産ホールディングス	93,100	1,994.00	185,641,400	
三重交通グループホールディングス	35,100	440.00	15,444,000	
サムティ	22,900	1,579.00	36,159,100	
ディア・ライフ	25,900	417.00	10,800,300	
日本商業開発	10,800	1,680.00	18,144,000	
ハウスコム	4,200	1,310.00	5,502,000	
日本管理センター	9,700	1,427.00	13,841,900	

サンセイランディック	7,300	763.00	5,569,900	
フージャースホールディングス	30,200	659.00	19,901,800	
オープンハウス	48,300	3,800.00	183,540,000	
東急不動産ホールディングス	416,600	451.00	187,886,600	
飯田グループホールディングス	127,400	2,123.00	270,470,200	
イーグランド	5,100	794.00	4,049,400	
ムゲンエステート	13,700	483.00	6,617,100	
ハウスドゥ	7,400	1,140.00	8,436,000	
シーアールイー	5,400	1,389.00	7,500,600	
グッドコムアセット	4,500	2,623.00	11,803,500	
ジェイ・エス・ビー	3,500	2,954.00	10,339,000	
テンポイノベーション	6,300	770.00	4,851,000	
パーク２４	82,500	1,697.00	140,002,500	
パラカ	5,100	1,630.00	8,313,000	
三井不動産	737,600	1,826.50	1,347,226,400	
三菱地所	1,063,000	1,587.00	1,686,981,000	
平和不動産	28,500	2,900.00	82,650,000	
東京建物	151,300	1,283.00	194,117,900	
ダイビル	40,800	1,220.00	49,776,000	
京阪神ビルディング	25,500	1,707.00	43,528,500	
住友不動産	341,300	3,102.00	1,058,712,600	
テーオーシー	32,900	651.00	21,417,900	
東京楽天地	3,000	4,660.00	13,980,000	
スターツコーポレーション	21,500	2,306.00	49,579,000	
フジ住宅	21,500	535.00	11,502,500	
空港施設	19,700	464.00	9,140,800	
明和地所	12,600	502.00	6,325,200	
ゴールドクレスト	13,400	1,375.00	18,425,000	
エスリード	7,400	1,354.00	10,019,600	
日神グループホールディングス	27,500	417.00	11,467,500	
日本エスコン	27,400	867.00	23,755,800	
タカラレーベン	69,300	311.00	21,552,300	
ＡＶＡＮＴＩＡ	11,200	808.00	9,049,600	
イオンモール	77,400	1,476.00	114,242,400	
毎日コムネット	6,500	817.00	5,310,500	
ファースト住建	8,500	1,107.00	9,409,500	
カチタス	38,300	2,971.00	113,789,300	
トーセイ	23,100	978.00	22,591,800	
穴吹興産	4,600	1,593.00	7,327,800	
サンフロンティア不動産	23,400	879.00	20,568,600	
エフ・ジェー・ネクスト	15,600	895.00	13,962,000	
インテリックス	4,300	490.00	2,107,000	

ランドビジネス	5,100	363.00	1,851,300	
サンネクスタグループ	6,900	1,026.00	7,079,400	
グランディハウス	17,300	373.00	6,452,900	
日本空港ビルデング	48,800	4,630.00	225,944,000	
日本工営	10,000	2,848.00	28,480,000	
ＬＩＦＵＬＬ	51,900	443.00	22,991,700	
ミクシィ	28,100	2,830.00	79,523,000	
ジェイエイシーリクルートメント	10,100	1,312.00	13,251,200	
日本M&Aセンター	112,400	5,980.00	672,152,000	
メンバーズ	4,500	1,723.00	7,753,500	
中広	2,600	495.00	1,287,000	
ＵＴグループ	23,200	3,560.00	82,592,000	
アイティメディア	6,000	2,792.00	16,752,000	
タケエイ	16,400	1,005.00	16,482,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	2,700	2,638.00	7,122,600	
ビーネックスグループ	18,700	1,131.00	21,149,700	
コシダカホールディングス	36,000	430.00	15,480,000	
アルトナー	3,900	904.00	3,525,600	
パソナグループ	16,100	1,599.00	25,743,900	
ＣＤＳ	3,900	1,388.00	5,413,200	
リンクアンドモチベーション	27,000	394.00	10,638,000	
ＧＣＡ	19,300	671.00	12,950,300	
エス・エム・エス	45,800	3,040.00	139,232,000	
サニーサイドアップグループ	5,500	716.00	3,938,000	
パーソルホールディングス	147,000	1,703.00	250,341,000	
リニカル	7,400	845.00	6,253,000	
クックパッド	46,900	372.00	17,446,800	
アイ・ケイ・ケイ	7,600	618.00	4,696,800	
学情	5,500	1,112.00	6,116,000	
スタジオアリス	7,600	1,680.00	12,768,000	
シミックホールディングス	7,400	1,350.00	9,990,000	
エプコ	3,900	1,006.00	3,923,400	
ＮＪＳ	3,800	1,934.00	7,349,200	
綜合警備保障	58,500	5,000.00	292,500,000	
カカクコム	108,600	2,767.00	300,496,200	
アイロムグループ	5,300	2,025.00	10,732,500	
セントケア・ホールディング	9,900	809.00	8,009,100	
サイネックス	2,800	923.00	2,584,400	
ルネサンス	8,500	942.00	8,007,000	
ディップ	20,200	2,154.00	43,510,800	
デジタルホールディングス	10,500	1,412.00	14,826,000	
ツクイ	35,100	587.00	20,603,700	

キャリアデザインセンター	3,700	964.00	3,566,800	
ベネフィット・ワン	53,500	2,652.00	141,882,000	
エムスリー	323,800	6,500.00	2,104,700,000	
ツカダ・グローバルホールディング	11,700	274.00	3,205,800	
アウトソーシング	84,400	968.00	81,699,200	
ウェルネット	15,300	598.00	9,149,400	
ワールドホールディングス	5,200	2,091.00	10,873,200	
ディー・エヌ・エー	62,300	1,932.00	120,363,600	
博報堂ＤＹホールディングス	204,400	1,355.00	276,962,000	
ぐるなび	26,000	720.00	18,720,000	
タカミヤ	16,100	614.00	9,885,400	
ジャパンベストレスキューシステム	11,600	1,045.00	12,122,000	
ファンコミュニケーションズ	41,000	482.00	19,762,000	
ライク	5,000	2,007.00	10,035,000	
ビジネス・ブレークスルー	6,900	392.00	2,704,800	
エスプール	38,100	837.00	31,889,700	
ＷＤＢホールディングス	6,800	3,065.00	20,842,000	
手間いらず	1,000	5,590.00	5,590,000	
ティア	9,200	437.00	4,020,400	
ＣＤＧ	1,700	1,669.00	2,837,300	
バリューコマース	10,000	3,515.00	35,150,000	
インフォマート	148,800	930.00	138,384,000	
ＪＰホールディングス	47,000	315.00	14,805,000	
エコナックホールディングス	29,700	99.00	2,940,300	
ＥＰＳホールディングス	20,200	1,040.00	21,008,000	
レッグス	3,900	1,150.00	4,485,000	
プレステージ・インターナショナル	55,300	952.00	52,645,600	
アミューズ	8,100	2,421.00	19,610,100	
ドリームインキュベータ	4,700	1,500.00	7,050,000	
クイック	9,400	1,235.00	11,609,000	
ＴＡＣ	10,200	225.00	2,295,000	
ケネディクス	126,800	552.00	69,993,600	
電通グループ	165,200	3,095.00	511,294,000	
イオンファンタジー	5,800	1,637.00	9,494,600	
シーティーエス	16,900	954.00	16,122,600	
ネクシィーズグループ	4,700	1,074.00	5,047,800	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	41,200	2,812.00	115,854,400	
アルプス技研	13,100	2,047.00	26,815,700	
ダイオーズ	3,200	990.00	3,168,000	
日本空調サービス	15,800	740.00	11,692,000	
オリエンタルランド	156,200	14,740.00	2,302,388,000	
ダスキン	36,600	2,868.00	104,968,800	

明光ネットワークジャパン	19,000	735.00	13,965,000	
ファルコホールディングス	8,300	1,562.00	12,964,600	
ラウンドワン	41,400	846.00	35,024,400	
リゾートトラスト	67,500	1,602.00	108,135,000	
ビー・エム・エル	19,000	3,165.00	60,135,000	
りらいあコミュニケーションズ	26,700	1,323.00	35,324,100	
リソー教育	68,100	288.00	19,612,800	
早稲田アカデミー	6,700	1,007.00	6,746,900	
ユー・エス・エス	164,500	1,879.00	309,095,500	
東京個別指導学院	5,700	579.00	3,300,300	
サイバーエージェント	90,500	6,470.00	585,535,000	
楽天	684,500	1,132.00	774,854,000	
クリーク・アンド・リバー社	7,900	1,407.00	11,115,300	
テー・オー・ダブリュー	24,300	328.00	7,970,400	
山田コンサルティンググループ	9,700	1,208.00	11,717,600	
セントラルスポーツ	5,600	2,386.00	13,361,600	
フルキャストホールディングス	13,000	1,711.00	22,243,000	
エン・ジャパン	26,200	2,641.00	69,194,200	
リソルホールディングス	1,700	3,900.00	6,630,000	
テクノプロ・ホールディングス	29,400	6,520.00	191,688,000	
アトラ	3,400	274.00	931,600	
インターワークス	3,700	339.00	1,254,300	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,000	13,220.00	79,320,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	11,000	1,328.00	14,608,000	
ファーストロジック	3,200	805.00	2,576,000	
三機サービス	3,100	1,127.00	3,493,700	
Ｇｕｎｏｓｙ	9,400	925.00	8,695,000	
デザインワン・ジャパン	5,400	274.00	1,479,600	
イー・ガーディアン	6,500	3,305.00	21,482,500	
リブセンス	9,100	290.00	2,639,000	
ジャパンマテリアル	45,300	1,467.00	66,455,100	
ベクトル	18,600	1,064.00	19,790,400	
ウチヤマホールディングス	8,200	323.00	2,648,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,700	1,191.00	15,125,700	
キャリアリンク	5,100	1,749.00	8,919,900	
ＩＢＪ	12,300	1,085.00	13,345,500	
アサンテ	6,100	1,605.00	9,790,500	
Ｎ・フィールド	10,500	699.00	7,339,500	
バリューＨＲ	6,000	1,750.00	10,500,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	12,000	4,910.00	58,920,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,700	2,590.00	14,763,000	
ＥＲＩホールディングス	4,600	671.00	3,086,600	

アビスト	2,400	2,982.00	7,156,800	
シグマクシス	10,200	1,725.00	17,595,000	
ウィルグループ	9,900	858.00	8,494,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	22,600	347.00	7,842,200	
リクルートホールディングス	1,051,700	4,160.00	4,375,072,000	
エラン	10,200	2,605.00	26,571,000	
土木管理総合試験所	7,900	390.00	3,081,000	
ネットマーケティング	6,100	635.00	3,873,500	
日本郵政	1,203,700	715.80	861,608,460	
ベルシステム２４ホールディングス	24,800	1,767.00	43,821,600	
鎌倉新書	11,400	920.00	10,488,000	
ＳＭＮ	3,400	946.00	3,216,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	5,200	2,897.00	15,064,400	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,000	920.00	2,760,000	
エアトリ	7,700	1,402.00	10,795,400	
ハイアス・アンド・カンパニー	9,200	222.00	2,042,400	
アトラエ	4,500	3,075.00	13,837,500	
ストライク	5,600	6,150.00	34,440,000	
ソラスト	40,700	1,374.00	55,921,800	
セラク	4,700	2,095.00	9,846,500	
インソース	6,200	2,989.00	18,531,800	
ベイカレント・コンサルティング	8,900	14,600.00	129,940,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,200	2,276.00	7,283,200	
アイモバイル	5,400	1,326.00	7,160,400	
キャリアインデックス	6,500	577.00	3,750,500	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	5,100	838.00	4,273,800	
船場	3,200	959.00	3,068,800	
グレイステクノロジー	6,800	5,280.00	35,904,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	16,500	3,655.00	60,307,500	
フルテック	2,300	1,449.00	3,332,700	
グリーンズ	3,700	517.00	1,912,900	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	4,800	638.00	3,062,400	
ソウルドアウト	3,700	1,560.00	5,772,000	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	3,200	714.00	2,284,800	
エル・ティー・エス	1,100	5,220.00	5,742,000	
ミダック	2,000	2,194.00	4,388,000	
日総工産	10,200	802.00	8,180,400	
キュービーネットホールディングス	6,200	1,851.00	11,476,200	
ＲＰＡホールディングス	11,500	846.00	9,729,000	
スプリックス	4,500	818.00	3,681,000	
マネジメントソリューションズ	7,300	1,634.00	11,928,200	
プロレド・パートナーズ	2,000	6,060.00	12,120,000	

ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	1,400	1,085.00	1,519,000	
ピアラ	900	2,660.00	2,394,000	
ギークス	1,700	1,324.00	2,250,800	
カーブスホールディングス	40,700	675.00	27,472,500	
フォーラムエンジニアリング	8,000	803.00	6,424,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,800	767.00	5,982,600	
リログループ	80,400	2,516.00	202,286,400	
東祥	9,400	1,295.00	12,173,000	
エイチ・アイ・エス	22,900	1,851.00	42,387,900	
ラックランド	4,300	2,333.00	10,031,900	
共立メンテナンス	24,400	3,895.00	95,038,000	
イチネンホールディングス	16,700	1,259.00	21,025,300	
建設技術研究所	9,600	2,017.00	19,363,200	
スペース	9,900	845.00	8,365,500	
長大	6,100	1,316.00	8,027,600	
燦ホールディングス	6,600	1,293.00	8,533,800	
スバル興業	900	7,800.00	7,020,000	
東京テアトル	6,000	1,283.00	7,698,000	
タナベ経営	3,000	1,490.00	4,470,000	
ナガワ	4,700	8,540.00	40,138,000	
よみうりランド	3,300	4,205.00	13,876,500	
東京都競馬	9,700	5,330.00	51,701,000	
カナモト	26,000	2,393.00	62,218,000	
東京ドーム	59,800	756.00	45,208,800	
西尾レントオール	13,700	2,233.00	30,592,100	
トランス・コスモス	14,100	2,856.00	40,269,600	
乃村工藝社	63,300	779.00	49,310,700	
藤田観光	5,800	1,567.00	9,088,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	9,100	1,113.00	10,128,300	
日本管財	15,900	1,992.00	31,672,800	
トーカイ	14,300	2,078.00	29,715,400	
セコム	155,800	9,606.00	1,496,614,800	
セントラル警備保障	7,200	3,550.00	25,560,000	
丹青社	28,100	708.00	19,894,800	
メイテック	18,000	5,350.00	96,300,000	
応用地質	17,300	1,244.00	21,521,200	
船井総研ホールディングス	30,500	2,476.00	75,518,000	
進学会ホールディングス	6,400	464.00	2,969,600	
オオバ	10,800	860.00	9,288,000	
いであ	3,700	1,938.00	7,170,600	
学究社	4,500	1,097.00	4,936,500	
ベネッセホールディングス	49,000	2,705.00	132,545,000	

イオンディライト	18,200	2,911.00	52,980,200	
ナック	8,400	1,029.00	8,643,600	
ダイセキ	24,700	2,621.00	64,738,700	
ステップ	5,600	1,594.00	8,926,400	
合　計	161,800,380		350,000,638,400	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,528,128,942
国債証券	481,970,791,000
地方債証券	31,396,337,778
特殊債券	38,577,990,407
社債券	24,175,218,450
未収入金	2,388,371,200
未収利息	566,593,600
前払費用	20,035,812
流動資産合計	582,623,467,189
資産合計	582,623,467,189
負債の部	
流動負債	
未払金	5,601,109,600
未払解約金	113,310,380
未払利息	8,151
流動負債合計	5,714,428,131
負債合計	5,714,428,131
純資産の部	
元本等	
元本	409,009,122,769
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	167,899,916,289
元本等合計	576,909,039,058
純資産合計	576,909,039,058

	2020年 9月30日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	582,623,467,189

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 9月30日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 9月30日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	409,009,122,769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　101,466,000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　1.4105円
		(1万口当たり純資産額)　(14,105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 9月30日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、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 9月30日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2020年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月 1日
期首元本額	379,521,438,312円
期中追加設定元本額	68,425,034,033円
期中一部解約元本額	38,937,349,576円
期末元本額	409,009,122,769円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,688,950,325円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	12,363,119円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	19,430,492,001円
世界経済インデックスファンド	2,101,672,127円
ＤＣマイセレクション２５	22,300,230,597円
ＤＣマイセレクション５０	23,929,104,123円
ＤＣマイセレクション７５	6,345,329,144円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	453,615,716円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	91,524,737,636円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	68,863,628,749円
ＤＣマイセレクションＳ２５	9,598,572,076円
ＤＣマイセレクションＳ５０	10,176,206,278円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,010,612,261円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	1,020,410,384円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	1,581,346,783円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	553,814,196円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	2,697,022,309円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	23,633,300円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,240,824円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	41,067,263円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,325,153円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	894,939円

区分	2020年 9月30日現在
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	143,719,685円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	197,215,198円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	52,746,664円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	68,308,685円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,741,457,369円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	836,444,540円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,386,366,089円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	798,796,977円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	89,885,722円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,121,557,314円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,275,320,118円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,625,300,454円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	150,720,479円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	5,900,878,639円
日本債券ファンド・シリーズ１	11,800,813,706円
分散投資コア戦略ファンドＡ	19,668,955,126円
分散投資コア戦略ファンドＳ	16,290,445,848円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	97,448,360円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,031,497,814円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	46,981,450円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,650,806円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	54,194,004円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	16,979,030円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	29,722,751円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	44,412,708円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,129,355円
グローバル経済コア	212,321,702円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	17,750,354円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	2,984,207円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	460,963円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	395,166円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	147,818円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	65,477円
ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	73,867,329,969円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	30,221,679円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2020年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△2,412,308,200

地方債証券	△24,363,252
特殊債券	△79,349,791
社債券	21,356,360
合計	△2,494,664,883

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第４０６回利付国債（２年）	480,000,000	481,300,800	
	第４０７回利付国債（２年）	360,000,000	361,051,200	
	第４０８回利付国債（２年）	690,000,000	692,159,700	
	第４０９回利付国債（２年）	2,610,000,000	2,618,717,400	
	第４１０回利付国債（２年）	330,000,000	331,214,400	
	第４１２回利付国債（２年）	780,000,000	783,580,200	
	第４１３回利付国債（２年）	1,640,000,000	1,647,527,600	
	第４１４回利付国債（２年）	2,400,000,000	2,411,136,000	
	第４１５回利付国債（２年）	100,000,000	100,468,000	
	第４１６回利付国債（２年）	3,990,000,000	4,009,152,000	
	第４１７回利付国債（２年）	1,040,000,000	1,045,002,400	
	第１３０回利付国債（５年）	3,160,000,000	3,169,258,800	
	第１３１回利付国債（５年）	4,990,000,000	5,007,914,100	
	第１３２回利付国債（５年）	4,770,000,000	4,790,081,700	
	第１３３回利付国債（５年）	4,380,000,000	4,400,761,200	
	第１３４回利付国債（５年）	5,850,000,000	5,881,239,000	
	第１３５回利付国債（５年）	4,080,000,000	4,104,194,400	
	第１３６回利付国債（５年）	2,840,000,000	2,858,573,600	
	第１３７回利付国債（５年）	6,900,000,000	6,948,300,000	
	第１３８回利付国債（５年）	9,420,000,000	9,491,497,800	

第１３９回利付国債（５年）	4,760,000,000	4,798,936,800	
第１４０回利付国債（５年）	7,300,000,000	7,364,094,000	
第１４１回利付国債（５年）	7,420,000,000	7,489,525,400	
第１４２回利付国債（５年）	5,870,000,000	5,928,523,900	
第１４３回利付国債（５年）	3,950,000,000	3,990,803,500	
第１４４回利付国債（５年）	6,820,000,000	6,889,495,800	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	589,224,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,614,724,800	
第３回利付国債（４０年）	550,000,000	790,124,500	
第４回利付国債（４０年）	1,200,000,000	1,734,756,000	
第５回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,498,224,700	
第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,740,551,400	
第７回利付国債（４０年）	830,000,000	1,104,456,100	
第８回利付国債（４０年）	800,000,000	997,016,000	
第９回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,054,651,600	
第１０回利付国債（４０年）	2,370,000,000	2,594,367,900	
第１１回利付国債（４０年）	1,790,000,000	1,902,412,000	
第１２回利付国債（４０年）	1,710,000,000	1,643,703,300	
第１３回利付国債（４０年）	870,000,000	834,251,700	
第３１９回利付国債（１０年）	1,710,000,000	1,735,889,400	
第３２０回利付国債（１０年）	4,570,000,000	4,633,614,400	
第３２１回利付国債（１０年）	2,600,000,000	2,643,706,000	
第３２２回利付国債（１０年）	750,000,000	761,505,000	
第３２３回利付国債（１０年）	1,930,000,000	1,964,720,700	
第３２４回利付国債（１０年）	2,740,000,000	2,784,579,800	
第３２５回利付国債（１０年）	2,920,000,000	2,974,195,200	
第３２６回利付国債（１０年）	3,120,000,000	3,177,969,600	
第３２７回利付国債（１０年）	3,190,000,000	3,256,383,900	
第３２８回利付国債（１０年）	3,400,000,000	3,461,812,000	
第３２９回利付国債（１０年）	2,250,000,000	2,307,375,000	
第３３０回利付国債（１０年）	1,900,000,000	1,952,953,000	
第３３１回利付国債（１０年）	900,000,000	919,719,000	
第３３２回利付国債（１０年）	4,250,000,000	4,350,257,500	
第３３３回利付国債（１０年）	2,330,000,000	2,389,205,300	
第３３４回利付国債（１０年）	1,790,000,000	1,838,813,300	
第３３５回利付国債（１０年）	2,450,000,000	2,511,568,500	
第３３６回利付国債（１０年）	510,000,000	523,739,400	
第３３７回利付国債（１０年）	2,950,000,000	3,004,427,500	
第３３８回利付国債（１０年）	3,060,000,000	3,132,828,000	
第３３９回利付国債（１０年）	5,050,000,000	5,173,321,000	
第３４０回利付国債（１０年）	6,320,000,000	6,482,676,800	
第３４１回利付国債（１０年）	2,160,000,000	2,207,066,400	

第３４２回利付国債（１０年）	6,380,000,000	6,455,411,600	
第３４３回利付国債（１０年）	3,250,000,000	3,290,202,500	
第３４４回利付国債（１０年）	6,940,000,000	7,029,664,800	
第３４５回利付国債（１０年）	2,290,000,000	2,320,113,500	
第３４６回利付国債（１０年）	5,200,000,000	5,271,084,000	
第３４７回利付国債（１０年）	3,380,000,000	3,428,029,800	
第３４８回利付国債（１０年）	4,840,000,000	4,909,647,600	
第３４９回利付国債（１０年）	3,630,000,000	3,682,780,200	
第３５０回利付国債（１０年）	5,790,000,000	5,874,881,400	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	4,890,000,000	4,960,269,300	
第３５２回利付国債（１０年）	4,260,000,000	4,319,767,800	
第３５３回利付国債（１０年）	4,470,000,000	4,530,926,100	
第３５４回利付国債（１０年）	4,580,000,000	4,640,364,400	
第３５５回利付国債（１０年）	4,870,000,000	4,929,608,800	
第３５６回利付国債（１０年）	4,640,000,000	4,692,107,200	
第３５７回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,698,328,700	
第３５８回利付国債（１０年）	3,620,000,000	3,655,982,800	
第３５９回利付国債（１０年）	3,170,000,000	3,197,674,100	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	137,749,700	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	196,145,600	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	146,515,200	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	141,832,900	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	61,337,000	
第６回利付国債（３０年）	350,000,000	439,631,500	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	225,536,400	
第８回利付国債（３０年）	140,000,000	168,148,400	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	276,828,000	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	178,928,000	
第１１回利付国債（３０年）	260,000,000	310,486,800	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	237,135,200	
第１３回利付国債（３０年）	290,000,000	359,075,100	
第１４回利付国債（３０年）	300,000,000	388,323,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	445,896,400	
第１６回利付国債（３０年）	200,000,000	263,050,000	
第１７回利付国債（３０年）	570,000,000	743,889,900	
第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	446,540,400	
第１９回利付国債（３０年）	380,000,000	493,031,000	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	638,606,400	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	652,190,000	
第２２回利付国債（３０年）	400,000,000	535,204,000	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	576,754,700	
第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	511,297,600	

第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	461,118,000	
第２６回利付国債（３０年）	990,000,000	1,323,471,600	
第２７回利付国債（３０年）	1,510,000,000	2,054,717,400	
第２８回利付国債（３０年）	2,140,000,000	2,926,193,200	
第２９回利付国債（３０年）	1,520,000,000	2,062,488,000	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,381,039,400	
第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,467,213,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,560,000,000	2,118,230,400	
第３３回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,376,082,800	
第３４回利付国債（３０年）	1,735,000,000	2,341,278,400	
第３５回利付国債（３０年）	2,130,000,000	2,800,161,900	
第３６回利付国債（３０年）	1,950,000,000	2,571,855,000	
第３７回利付国債（３０年）	2,040,000,000	2,657,956,800	
第３８回利付国債（３０年）	1,430,000,000	1,838,879,900	
第３９回利付国債（３０年）	1,200,000,000	1,571,580,000	
第４０回利付国債（３０年）	1,170,000,000	1,509,814,800	
第４１回利付国債（３０年）	730,000,000	927,676,700	
第４２回利付国債（３０年）	1,520,000,000	1,933,516,000	
第４３回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,604,395,800	
第４４回利付国債（３０年）	1,220,000,000	1,554,987,600	
第４５回利付国債（３０年）	820,000,000	1,009,133,000	
第４６回利付国債（３０年）	1,750,000,000	2,154,967,500	
第４７回利付国債（３０年）	1,350,000,000	1,695,330,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,890,000,000	2,287,901,700	
第４９回利付国債（３０年）	1,240,000,000	1,501,689,600	
第５０回利付国債（３０年）	1,520,000,000	1,624,834,400	
第５１回利付国債（３０年）	1,840,000,000	1,744,209,600	
第５２回利付国債（３０年）	1,900,000,000	1,891,298,000	
第５３回利付国債（３０年）	690,000,000	702,730,500	
第５４回利付国債（３０年）	2,200,000,000	2,348,764,000	
第５５回利付国債（３０年）	1,040,000,000	1,109,607,200	
第５６回利付国債（３０年）	1,940,000,000	2,068,466,800	
第５７回利付国債（３０年）	1,550,000,000	1,651,509,500	
第５８回利付国債（３０年）	1,890,000,000	2,012,339,700	
第５９回利付国債（３０年）	90,000,000	93,471,300	
第６０回利付国債（３０年）	2,530,000,000	2,754,664,000	
第６１回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,459,871,700	
第６２回利付国債（３０年）	20,000,000	19,657,000	
第６３回利付国債（３０年）	1,080,000,000	1,030,870,800	
第６４回利付国債（３０年）	2,100,000,000	2,001,279,000	
第６５回利付国債（３０年）	860,000,000	818,255,600	
第６６回利付国債（３０年）	1,030,000,000	978,417,600	
第６７回利付国債（３０年）	1,560,000,000	1,563,931,200	

第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	82,188,000	
第５４回利付国債（２０年）	200,000,000	205,714,000	
第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	144,418,400	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	155,539,500	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	248,450,400	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	312,087,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	208,168,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	361,956,000	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	246,736,800	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	328,160,000	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	210,556,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	339,366,400	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	234,436,400	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	350,588,700	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	139,187,100	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	205,410,900	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	420,275,700	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	437,804,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	217,408,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	686,057,400	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	392,529,600	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	218,920,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	142,989,600	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	294,551,100	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	317,671,800	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	186,248,600	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	297,086,400	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	243,113,200	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	431,121,600	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	666,258,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	323,640,000	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	522,057,200	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	325,330,700	
第８６回利付国債（２０年）	210,000,000	237,894,300	
第８７回利付国債（２０年）	550,000,000	620,031,500	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	478,375,800	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	396,634,000	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	717,664,500	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	515,322,000	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	1,001,466,400	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	466,182,300	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	697,559,400	

第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	709,253,100	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,827,180,300	
第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	464,572,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	507,940,400	
第９９回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,333,482,500	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	562,617,600	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	848,812,250	
第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,502,663,400	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	473,928,000	
第１０４回利付国債（２０年）	360,000,000	420,944,400	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,385,213,800	
第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	449,133,400	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	306,386,600	
第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	766,847,400	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	606,205,600	
第１１０回利付国債（２０年）	950,000,000	1,123,641,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,160,081,200	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	937,895,900	
第１１３回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,726,993,500	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,784,932,500	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	843,136,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,801,126,900	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,295,287,200	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	787,505,400	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	622,098,100	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,812,345,200	
第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,779,705,000	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,105,928,800	
第１２３回利付国債（２０年）	1,430,000,000	1,729,799,500	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	731,682,800	
第１２５回利付国債（２０年）	820,000,000	1,003,548,800	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	878,197,300	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,216,452,000	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,160,061,800	
第１２９回利付国債（２０年）	890,000,000	1,054,908,100	
第１３０回利付国債（２０年）	1,285,000,000	1,526,168,800	
第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,176,800,000	
第１３２回利付国債（２０年）	950,000,000	1,120,496,500	
第１３３回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,464,425,700	
第１３４回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,348,519,400	
第１３５回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,217,501,200	
第１３６回利付国債（２０年）	1,470,000,000	1,720,929,000	
第１３７回利付国債（２０年）	1,120,000,000	1,326,774,400	

	第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	720,111,400	
	第１３９回利付国債（２０年）	580,000,000	680,369,000	
	第１４０回利付国債（２０年）	2,150,000,000	2,552,351,000	
	第１４１回利付国債（２０年）	1,780,000,000	2,117,399,000	
	第１４２回利付国債（２０年）	640,000,000	769,017,600	
	第１４３回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,332,948,000	
	第１４４回利付国債（２０年）	1,740,000,000	2,031,171,600	
	第１４５回利付国債（２０年）	2,515,000,000	3,003,362,700	
	第１４６回利付国債（２０年）	2,260,000,000	2,703,931,800	
	第１４７回利付国債（２０年）	2,100,000,000	2,489,844,000	
	第１４８回利付国債（２０年）	1,760,000,000	2,066,785,600	
	第１４９回利付国債（２０年）	3,010,000,000	3,539,519,200	
	第１５０回利付国債（２０年）	3,370,000,000	3,922,241,900	
	第１５１回利付国債（２０年）	1,255,000,000	1,427,524,850	
	第１５２回利付国債（２０年）	2,800,000,000	3,186,904,000	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,570,000,000	2,963,569,800	
	第１５４回利付国債（２０年）	2,920,000,000	3,327,456,800	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,050,000,000	2,277,078,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	1,960,000,000	1,999,298,000	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,820,000,000	2,786,019,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,320,000,000	2,397,998,400	
	第１５９回利付国債（２０年）	2,920,000,000	3,062,583,600	
	第１６０回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,575,920,600	
	第１６１回利付国債（２０年）	2,240,000,000	2,346,960,000	
	第１６２回利付国債（２０年）	580,000,000	607,115,000	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,610,000,000	2,729,250,900	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,780,000,000	1,829,964,600	
	第１６５回利付国債（２０年）	1,640,000,000	1,685,247,600	
	第１６６回利付国債（２０年）	900,000,000	954,864,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,690,000,000	2,756,738,900	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,390,000,000	1,398,409,500	
	第１６９回利付国債（２０年）	760,000,000	750,028,800	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,410,000,000	2,375,874,400	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,270,366,200	
	第１７２回利付国債（２０年）	1,360,000,000	1,362,448,000	
	第１７３回利付国債（２０年）	2,970,000,000	2,972,702,700	
国債証券合計		446,940,000,000	481,970,791,000	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	107,758,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	108,835,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	134,069,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	132,627,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	127,589,000	

第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	126,523,000	
第１６回東京都公募公債（２０年）	300,000,000	347,577,000	
第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	116,513,000	
第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	117,698,000	
第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	235,120,000	
第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	234,752,000	
第７０２回東京都公募公債	100,000,000	101,234,000	
第７１６回東京都公募公債	100,000,000	101,654,000	
第７１７回東京都公募公債	100,000,000	101,505,000	
第７２０回東京都公募公債	100,000,000	102,311,000	
第７２８回東京都公募公債	100,000,000	102,028,000	
第７５１回東京都公募公債	100,000,000	101,665,000	
第７６５回東京都公募公債	100,000,000	100,998,000	
第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,869,000	
第７８１回東京都公募公債	300,000,000	302,304,000	
第８００回東京都公募公債	200,000,000	199,452,000	
平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,854,000	
平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,808,000	
平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,083,000	
平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,051,000	
平成３０年度第１４回北海道公募公債	200,000,000	201,724,000	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	274,250,000	
第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	117,376,000	
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	117,171,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,724,000	
第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	203,630,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,754,000	
第２２６回神奈川県公募公債	100,000,000	100,902,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,869,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	199,360,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	235,394,000	
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,550,000	
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,425,000	
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,358,000	
第３７７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,169,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,058,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	153,828,230	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,471,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,226,000	
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	156,258,960	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,314,000	
第４３９回大阪府公募公債（１０年）	500,000,000	504,640,000	

第４４０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,970,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	118,582,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	117,438,000	
平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	102,316,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	102,512,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	99,178,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	103,800,000	
第１回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	104,013,000	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	116,020,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	102,427,000	
第６回兵庫県公募公債（１５年）	400,000,000	439,648,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,511,000	
第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,475,000	
平成２４年度第１５回兵庫県公募公債	200,000,000	202,700,000	
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	100,000,000	102,290,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	101,914,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	102,514,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	300,816,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	120,236,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	104,386,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	117,441,000	
第１８回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	115,670,000	
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	101,627,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,936,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	101,070,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	101,145,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	118,997,000	
平成２３年度第１４回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,140,000	
平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,540,000	
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	102,307,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,752,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,114,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	202,312,000	
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	310,164,000	
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,942,000	

平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	103,119,000	
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	199,524,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	118,097,000	
平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	101,696,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	127,971,284	
平成２９年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,818,000	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	115,861,000	
第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	117,007,000	
第６回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	234,924,000	
第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	107,488,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	235,848,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	198,462,000	
平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,608,000	
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,918,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	102,211,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	102,187,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,206,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	101,237,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,938,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	115,993,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,186,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	108,309,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	119,278,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	108,823,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	131,668,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	112,865,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,161,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	103,119,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	103,645,000	
令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	301,155,000	
第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	234,924,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	118,566,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	117,441,000	
平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	102,378,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	101,799,000	

平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	102,454,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,207,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	120,944,400	
令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	299,001,000	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	101,022,000	
第１０５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,282,000	
第１０７回共同発行市場公募地方債	800,000,000	811,056,000	
第１０８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,459,000	
第１０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,605,000	
第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,426,000	
第１１２回共同発行市場公募地方債	220,000,000	223,253,800	
第１１３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,830,000	
第１１６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,668,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,094,000	
第１１９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,740,000	
第１２５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,320,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,025,000	
第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,015,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,910,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,681,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,253,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,125,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,011,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,522,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,944,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,615,256	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,292,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,273,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,166,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,228,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,000,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,232,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,977,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,787,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,212,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,812,000	
第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,584,323	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,090,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,709,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	200,000,000	203,208,000	
平成２９年度第１回熊本県公募公債（５年）	100,000,000	99,972,000	

平成２３年度第１回浜松市公募公債	100,000,000	101,172,000	
平成２３年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,172,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	101,139,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	237,934,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	298,755,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	104,365,000	
平成２９年度第１回大阪市公募公債（５年）	100,000,000	99,975,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	130,922,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	136,252,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	116,349,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	125,519,000	
第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,596,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	101,100,000	
第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	301,152,000	
平成２３年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,273,000	
平成２４年度第２回京都市公募公債	122,500,000	124,429,375	
平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,596,000	
平成２４年度第５回京都市公募公債	100,000,000	101,942,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	201,576,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	137,036,400	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	235,342,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	119,656,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	117,734,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	100,476,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	110,140,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	117,991,000	
平成２３年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	101,306,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,754,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	101,286,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	101,013,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	203,504,000	
第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	229,022,000	
令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	301,149,000	
平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	109,129,000	
平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,721,000	
平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,727,000	
第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	116,888,000	
第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,651,000	

	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,777,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,151,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	100,055,000	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	118,126,000	
	平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	115,954,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	204,226,000	
	平成２８年度第１０回福岡市公募公債（５年）	100,000,000	99,992,000	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,760,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	153,312,000	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,843,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,717,150	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	172,130,100	
	令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	549,961,500	
	平成２３年度第２回千葉市公募公債	200,000,000	202,378,000	
	令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	199,334,000	
	平成２４年度第１回岡山市公募公債（１０年）	100,000,000	101,918,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	202,682,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	115,609,000	
地方債証券合計		29,809,430,000	31,396,337,778	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	104,507,160	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	416,871,600	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,021,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,436,000	
	第１１９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,784,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	98,257,000	
	第１４回道路債券	100,000,000	104,163,000	
	第１７回道路債券	100,000,000	103,341,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	130,499,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	264,686,000	
	第３３回道路債券	200,000,000	268,612,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,871,000	
	第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	153,688,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,684,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	109,730,000	

第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,435,000	
第８１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,234,000	
第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,543,000	
第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	145,884,000	
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	236,386,000	
第９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,506,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,761,000	
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	915,201,000	
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,486,000	
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	133,048,000	
第１１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,687,000	
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,074,000	
第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,031,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,711,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,835,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,287,000	
第１５５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	304,732,400	
第１５７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,626,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,688,000	
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,102,000	
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,617,000	
第１７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,594,000	
第１８０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,010,000	
第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,448,000	
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,977,000	
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,003,000	
	200,000,000	203,360,000	

第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	617,952,000	
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	302,000,000	306,324,640	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	638,380,840	
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,930,000	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	151,621,560	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,561,000	
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,236,000	
第２１４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,992,000	
第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	104,425,560	
第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,391,000	
第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,284,000	
第２２８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	230,684,000	
第２２９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,180,000	
第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,953,000	
第２３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,092,000	
第２３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,191,000	
第２４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,076,000	
第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,304,000	
第２６９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,730,000	
第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,216,000	
第２９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,941,150	
第２９７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	317,377,760	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	206,295,600	
第３０６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,847,000	
第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,672,000	
	100,000,000	101,002,000	

	第３２１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
	第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	121,554,000	
	第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,912,000	
	第３６１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,598,000	
	第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	217,173,620	
	第２回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	100,000,000	100,650,000	
	第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	380,463,000	
	第３回政府保証地方公共団体金融機構債券（８年）	100,000,000	100,687,000	
	第３回公営企業債券（２０年）	210,000,000	215,243,700	
	第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	108,765,000	
	第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	397,128,000	
	第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	107,568,000	
	第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	132,850,000	
	第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	43,096,400	
	第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	130,686,000	
	第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	236,346,000	
	第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年）	200,000,000	198,170,000	
	第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	235,532,000	
	第２１回地方公共団体金融機構債券（５年）	400,000,000	399,968,000	
	第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	117,045,000	
	第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,672,000	
	第３８回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	507,480,000	
	第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,676,000	
	第４４回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,902,000	
	第４４回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,570,000	
	第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,974,000	
	第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,360,000	
	第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,421,000	
	第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,627,000	
	第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,441,000	
	第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,428,000	
	第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,507,000	
	第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,165,000	
	Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,595,000	
	第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,918,000	
	第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,054,000	
	第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,907,000	

第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,436,000	
第９２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,629,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	253,073,260	
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,018,000	
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,995,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,417,900	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,254,200	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,475,000	
第１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,388,000	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,112,000	
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,764,000	
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,193,000	
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,433,000	
第７回阪神高速道路債券	100,000,000	109,405,000	
第１９回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,988,000	
第２２回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,876,000	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	120,511,000	
第２５回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	203,982,000	
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,068,040	
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,019,000	
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	211,171,800	
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,732,070	
第８５回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,919,000	
第１１７回都市再生債券	200,000,000	212,570,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	173,992,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	95,171,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	109,090,000	
第３４４回東京交通債券	100,000,000	103,828,000	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,578,400	
第５９回政府保証関西国際空港債券	500,000,000	506,895,000	
第５９回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,924,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,454,000	12,876,066	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,918,000	13,358,891	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,234,000	13,738,215	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	200,754,000	200,774,075	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	142,058,000	142,168,805	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,136,000	13,598,255	
	14,074,000	14,632,034	

	第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券			
	第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	256,281,000	255,771,000	
	第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	11,418,000	11,598,404	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	23,654,000	24,252,209	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,814,000	14,334,097	
	第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	273,945,000	273,073,854	
	第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	96,984,000	96,970,422	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	12,463,000	12,847,732	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,618,000	15,257,391	
	第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	12,449,000	12,834,919	
	第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,571,000	15,229,463	
	第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,661,000	
	第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,963,000	11,038,535	
	第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,260,000	11,338,707	
	第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,167,000	20,402,504	
	第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,683,000	21,044,276	
	第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,096,000	23,794,961	
	第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,672,000	25,319,334	
	第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,206,000	28,158,347	
	第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,083,000	29,045,163	
	第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,132,000	62,317,504	
	第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,692,000	13,060,575	
	第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,860,000	28,457,095	
	第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,781,000	13,154,333	
	第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,580,000	13,040,553	
	第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,991,000	31,915,222	
	第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,786,000	12,089,489	
	第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,569,000	32,611,926	
	第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,585,000	30,438,737	
	第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,803,000	14,466,786	
	第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,416,000	61,835,088	
	第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,659,000	33,538,911	
	第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,380,000	13,882,151	
	第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,826,000	44,286,623	
	第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,643,000	41,899,479	
	第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,733,000	42,029,567	
	第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,956,000	89,622,633	

	第６４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,194,000	
	第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,848,000	96,106,991	
	第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,990,000	49,113,008	
	第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,955,000	49,467,562	
	第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,633,000	50,251,386	
	第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,476,000	43,579,662	
	第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,452,000	43,246,457	
	第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,833,000	49,450,496	
	第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	179,512,500	
	第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,690,000	132,154,139	
	第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,896,000	177,223,614	
	第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,958,000	49,965,042	
	第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,560,000	51,672,247	
	第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,295,000	52,290,705	
	第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,920,000	
	第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,476,000	166,790,730	
	第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,686,000	56,615,868	
	第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,260,000	117,538,119	
	第９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,271,000	
	第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,894,000	65,937,330	
	第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,346,000	69,297,687	
	第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,878,000	69,155,195	
	第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	206,880,000	214,762,128	
	第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,396,000	143,530,491	
	第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,005,000	70,400,136	
	第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,852,000	75,486,328	
	第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,476,000	78,884,859	
	第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,087,000	83,673,594	
	第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,339,000	83,746,527	
	第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,385,000	84,152,975	
	第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,902,000	85,105,154	
	第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,341,000	85,424,781	
	第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,504,000	87,504,851	
	第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,139,000	88,250,893	
	第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,867,000	87,737,407	
		87,120,000	87,990,328	

第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,647,000	88,573,428	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,702,000	178,189,830	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,941,000	88,808,098	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,232,000	180,445,641	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,058,000	89,950,361	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,842,000	180,346,061	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,927,000	90,810,083	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,324,000	183,680,490	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,362,000	183,706,007	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	130,825,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,047,000	93,314,487	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,460,000	93,931,038	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,540,000	93,197,034	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,944,000	188,408,221	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,040,000	94,181,060	
第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,109,000	94,388,503	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,766,000	189,997,514	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,669,000	95,046,194	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,438,000	285,071,928	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,202,000	190,914,488	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,947,000	98,280,999	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,297,000	98,310,761	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	201,018,000	
第１６８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,256,000	
第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,467,000	
第５８回日本学生支援債券	100,000,000	99,978,000	
第５９回日本学生支援債券	200,000,000	199,950,000	
第６０回日本学生支援債券	200,000,000	199,944,000	

	第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	109,423,000	
	い第８００号商工債	200,000,000	200,044,000	
	い第８０２号商工債	100,000,000	99,992,000	
	い第８０４号商工債	300,000,000	299,997,000	
	い第８２９号商工債	200,000,000	200,260,000	
	い第８３２号商工債	200,000,000	199,720,000	
	い第８３３号商工債	100,000,000	99,776,000	
	第３３７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,135,000	
	第３３８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,144,000	
	第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	200,306,000	
	第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,158,000	
	第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,082,000	
	第３６０回信金中金債（５年）	200,000,000	199,540,000	
	第２３６号商工債（３年）	300,000,000	299,670,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	102,237,000	
	第２１回国際協力機構債券	100,000,000	117,979,000	
	第３９回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,000,000	
	第４８回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,732,000	
	第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,594,000	
	第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,542,000	
	第７３回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,765,000	
	第４２回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,340,000	
	第５９回中日本高速道路株式会社社債	400,000,000	401,364,000	
	第８３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,025,000	
	第２７回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,502,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,916,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,853,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	198,616,000	
特殊債券合計		36,996,260,000	38,577,990,407	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	98,725,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	295,167,000	
	第１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,313,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,402,000	
	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	99,570,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,375,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,618,000	

第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,584,000	
第１２回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,812,000	
第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,622,000	
第１０回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	200,000,000	203,702,000	
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	400,000,000	401,092,000	
第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,695,000	
第３９回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,160,000	
第２１回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,260,000	
第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,770,000	
第７回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	99,716,000	
第７回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,847,000	
第１１回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,803,000	
第１０回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,545,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,738,000	
第１０回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,442,000	
第５回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,311,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,969,000	
第２回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,127,000	
第１１回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,993,000	
第１８回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,730,000	
第２５回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,701,000	
第１３回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,046,000	
第３５回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,372,000	
第５７回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,694,000	
第９回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,613,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,862,000	
第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,267,000	
第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	198,890,000	
第３５回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,288,000	
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,051,000	
第５回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	398,776,000	
第４回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,122,000	
第６回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,253,000	

第２回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,713,000	
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	99,813,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,932,000	
第１４回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,378,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,533,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,951,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,851,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,089,000	
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,892,000	
第２８回ジェイ　エフ　イー　ホールディングス株式会社無担保社	100,000,000	98,525,000	
第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,225,000	
第１０回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,379,000	
第３３回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,649,000	
第８回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,981,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,171,000	
第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,052,000	
第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,113,000	
第１３回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,312,000	
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,345,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,126,000	
第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,709,000	
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,404,000	
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,429,000	
第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,845,000	
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	100,148,000	
第１６回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	198,020,000	
第１２回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,330,000	
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	100,139,000	
第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,089,000	
第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	95,720,000	
第１４回株式会社岡村製作所無担保社債	200,000,000	199,848,000	
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,225,000	
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,453,000	
第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,517,000	
第７３回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	200,000,000	
第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,247,000	

第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,713,000	
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	97,553,000	
第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	118,845,000	
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	113,672,000	
第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,632,000	
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	101,238,000	
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,495,000	
第１回みずほＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	304,131,000	
第３回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,933,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,166,000	
第６４回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	200,076,000	
第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,128,000	
第３７回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	298,944,000	
第７回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,272,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,652,000	
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,957,000	
第１９３回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,219,000	
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	200,010,000	
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,960,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	200,556,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,834,000	
第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,868,000	
第３１回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,081,000	
第１回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,518,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,638,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,842,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,460,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,192,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,987,000	
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	102,180,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,160,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,112,000	

第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,070,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,794,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,697,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,001,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,850,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,791,000	
第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,243,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,728,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	235,204,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,566,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,926,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,738,000	
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	19,628,900	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,584,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,539,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,790,000	
第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	200,138,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	20,694,200	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,772,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,858,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,992,000	
第８３回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	199,770,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	109,465,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	95,673,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	95,460,000	
第５３回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	194,912,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,351,000	
第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,694,000	
第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,129,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	102,050,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,412,000	
第２０回株式会社ＮＴＴドコモ無担保社債	100,000,000	101,467,000	
第４９９回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,033,000	
第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,023,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,318,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,143,000	

第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,109,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	97,764,000	
第５０５回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,318,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,847,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	202,064,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,476,000	
第５２４回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,969,000	
第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,714,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,273,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,652,000	
第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,484,000	
第４１６回中国電力株式会社社債	200,000,000	201,266,000	
第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,472,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,758,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,894,000	
第３３０回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,464,000	
第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	130,276,440	
第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,024,000	
第４８７回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,194,000	
第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,720,000	
第５２１回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,072,000	
第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,505,000	
第３０９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,935,000	
第４２６回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,144,000	
第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,020,000	
第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,534,000	
第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,925,000	
第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,354,000	
第３１７回北海道電力株式会社社債	200,000,000	206,268,000	
第３２０回北海道電力株式会社社債	201,000,000	202,187,910	
第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,838,000	
第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,170,000	
第３４４回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,334,000	
第３５１回北海道電力株式会社社債	200,000,000	200,280,000	
第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,660,000	
第３８回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,726,000	
第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,505,000	
第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,914,000	
第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,358,000	
第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,206,000	
第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,002,000	

	第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,130,000	
	第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	199,718,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,990,000	
	第６回ＳＣＳＫ株式会社無担保社債	100,000,000	99,813,000	
	第３回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,709,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	200,478,000	
社債券合計		23,866,000,000	24,175,218,450	
合計			576,120,337,635	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,051,690,559
コール・ローン	1,236,672,142
株式	400,236,888,126
投資信託受益証券	264,159,999
投資証券	9,421,084,342
派生商品評価勘定	57,265,569
未収入金	4,346,911
未収配当金	436,940,079
前払金	112,658,155
差入委託証拠金	2,011,930,007
流動資産合計	422,833,635,889
資産合計	422,833,635,889
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	164,557,384
未払金	75,405,512
未払解約金	40,604,336
未払利息	2,857
流動負債合計	280,570,089
負債合計	280,570,089
純資産の部	
元本等	

	2020年 9月30日現在
項目	金額（円）
元本	150,010,636,596
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	272,542,429,204
元本等合計	422,553,065,800
純資産合計	422,553,065,800
負債純資産合計	422,833,635,889

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 9月30日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (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。 (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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。

	2020年 9月30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)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 9月30日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		150,010,636,596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	2.8168円
	(1万口当たり純資産額)	(28,168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 9月30日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2020年 9月30日現在
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2020年 9月30日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。

（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 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月 1日
期首元本額	139,822,058,208円
期中追加設定元本額	42,217,056,567円
期中一部解約元本額	32,028,478,179円
期末元本額	150,010,636,596円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,315,078,193円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,637,569円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	27,090,166,628円
世界経済インデックスファンド	8,077,737,491円
外国株式インデックス・オープン	801,492,029円
ＤＣマイセレクション２５	1,005,238,742円
ＤＣマイセレクション５０	4,745,915,835円
ＤＣマイセレクション７５	5,011,034,169円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	9,966,750,163円
ＤＣマイセレクションＳ２５	423,667,205円
ＤＣマイセレクションＳ５０	2,018,943,845円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,484,407,013円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	83,603,593円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	185,610,026円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	127,365,480円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	10,412,681,367円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	2,098,498,792円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	8,134,886円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	8,576,295円

区分	2020年 9月30日現在
外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	34,753,475円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	35,083,590円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	123,570,736円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	26,151,396円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	115,962,302円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	530,943,512円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	301,191,838円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,968,903,039円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,591,759,947円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	58,621,813円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	282,714,909円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	95,768,483円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,657,830,069円
ＦＯＦｓ用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,748,384,194円
外国株式ファンド・シリーズ１	978,046,603円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,101,459,102円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,294,488,038円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,334,032,247円
分散投資コア戦略ファンドＳ	8,488,780,542円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,187,697,299円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,191,346,447円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,417,970,768円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	727,295,547円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	37,221,363円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	207,472,908円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,096,141,084円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	32,789,443,109円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	135,159,449円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	437,117,120円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	78,815,204円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,509,989円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	78,217,788円
グローバル経済コア	898,243,824円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,381,060円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,469,951円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	805,116,914円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	78,664,464円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	1,026,097円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	1,222,831円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	657,994円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	673,177円
ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,015,148,269円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,481,663,486円

区分	2020年 9月30日現在
外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,326,657,731円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	376,626,111円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	107,988,632円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	368,096,231円
ＳＭＴＡＭバランスファンド２００２（適格機関投資家専用）	794,988,771円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	364,516,757円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	349,101,065円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	31,287,552,368
投資信託受益証券	△18,487,169
投資証券	16,937,227
合計	31,286,002,426

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	12,809,731,033	－	12,697,072,878	△112,658,155
合計		12,809,731,033	－	12,697,072,878	△112,658,155

(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 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,318,643,960	－	1,324,010,300	5,366,340
	アメリカドル	966,587,500	－	970,094,300	3,506,800
	カナダドル	30,743,310	－	30,817,800	74,490
	ユーロ	210,059,900	－	211,089,000	1,029,100
	イギリスポンド	47,473,650	－	47,628,000	154,350
	スイスフラン	37,633,200	－	37,963,200	330,000
	オーストラリアドル	26,146,400	－	26,418,000	271,600
合計		1,318,643,960	－	1,324,010,300	5,366,340

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	13.13	761,277.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	17.64	632,905.56	
	CHENIERE ENERGY INC	21,976	48.54	1,066,715.04	
	CHEVRON CORP	175,665	71.90	12,630,313.50	
	CONCHO RESOURCES INC	19,245	44.40	854,478.00	
	CONOCOPHILLIPS	100,048	32.46	3,247,558.08	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	16,913	31.20	527,685.60	
	EOG RESOURCES INC	55,405	36.19	2,005,106.95	
	EXXON MOBIL	397,774	34.28	13,635,692.72	
	HALLIBURTON CO	77,539	12.07	935,895.73	
	HESS CORP	24,844	40.69	1,010,902.36	
	KINDER MORGAN INC	193,367	12.45	2,407,419.15	
	MARATHON PETROLEUM CORP	61,979	29.43	1,824,041.97	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,162	9.21	342,262.02	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	80,482	9.99	804,015.18	
	ONEOK INC	41,832	26.67	1,115,659.44	
	PHILLIPS 66	39,493	52.19	2,061,139.67	

PIONEER NATURAL RESOURCES	15,844	86.40	1,368,921.60	
SCHLUMBERGER	131,946	15.60	2,058,357.60	
VALERO ENERGY CORP	38,903	43.41	1,688,779.23	
WILLIAMS COS	114,214	20.26	2,313,975.64	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	20,949	293.86	6,156,073.14	
ALBEMARLE CORP	10,180	86.86	884,234.80	
AMCOR PLC	151,315	10.85	1,641,767.75	
AVERY DENNISON CORP	7,457	124.59	929,067.63	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	22.09	388,916.54	
BALL CORP	29,987	82.36	2,469,729.32	
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	106.88	1,181,344.64	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	29.86	569,460.06	
CORTEVA INC	70,180	28.59	2,006,446.20	
CROWN HOLDINGS INC	12,992	76.36	992,069.12	
DOW INC	70,527	46.57	3,284,442.39	
DUPONT DE NEMOURS INC	69,779	55.19	3,851,103.01	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,891	77.15	917,390.65	
ECOLAB INC	24,220	197.45	4,782,239.00	
FMC CORP	12,118	105.31	1,276,146.58	
FREEPORT-MCMORAN INC	138,927	15.32	2,128,361.64	
INT'L PAPER CO	33,803	40.28	1,361,584.84	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,504	121.50	911,736.00	
LINDE PLC	49,702	236.43	11,751,043.86	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,513	70.28	1,793,053.64	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,981	231.06	1,381,969.86	
MOSAIC CO/THE	31,911	17.98	573,759.78	
NEWMONT CORPORATION	76,214	62.77	4,783,952.78	
NUCOR CORP	29,015	44.74	1,298,131.10	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	108.75	966,787.50	
PPG INDUSTRIES INC	22,118	120.33	2,661,458.94	
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	82.31	1,023,113.30	
SEALED AIR CORP	14,689	37.83	555,684.87	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,757	705.67	5,473,882.19	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	28.66	523,704.18	
VULCAN MATERIALS CO	12,657	132.70	1,679,583.90	
WESTROCK CO	24,734	34.25	847,139.50	
3 M COMPANY	54,179	159.81	8,658,345.99	
AERCAP HOLDINGS NV	10,498	25.06	263,079.88	
ALLEGION PLC	8,963	99.17	888,860.71	
AMETEK INC	20,674	99.89	2,065,125.86	
BOEING CO	50,512	163.60	8,263,763.20	
CARRIER GLOBAL CORP	75,551	30.50	2,304,305.50	

CATERPILLAR	51,008	147.41	7,519,089.28	
CUMMINS INC	13,804	212.90	2,938,871.60	
DEERE&CO	28,040	220.18	6,173,847.20	
DOVER CORP	13,872	108.24	1,501,505.28	
EATON CORP	37,842	101.18	3,828,853.56	
EMERSON ELECTRIC CO	56,530	65.16	3,683,494.80	
FASTENAL CO	51,828	45.33	2,349,363.24	
FORTIVE CORP	28,503	76.21	2,172,213.63	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	85.25	1,092,052.50	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,742	138.55	3,150,904.10	
GENERAL ELECTRIC CO	826,055	6.12	5,055,456.60	
GRAINGER (WW) INC	4,351	352.08	1,531,900.08	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	40.45	615,891.70	
HEICO CORP	3,640	104.44	380,161.60	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	88.70	572,026.30	
HONEYWELL INTL INC	66,069	164.51	10,869,011.19	
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	17.30	632,315.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	141.21	497,341.62	
IDEX CORP	6,916	181.75	1,256,983.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	29,811	193.47	5,767,534.17	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	35.87	1,132,128.94	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	92.98	1,118,177.48	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	40.29	809,829.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	20,500	20.27	415,535.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	69,045	40.96	2,828,083.20	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	20,431	175.75	3,590,748.25	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	272.65	834,854.30	
LOCKHEED MARTIN CORP	23,771	388.74	9,240,738.54	
MASCO CORP	23,467	56.12	1,316,968.04	
NORDSON CORP	4,880	191.42	934,129.60	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,956	325.28	4,864,887.68	
OTIS WORLDWIDE CORP	37,519	62.41	2,341,560.79	
OWENS CORNING	10,458	67.63	707,274.54	
PACCAR INC	32,395	86.15	2,790,829.25	
PARKER HANNIFIN CORP	11,596	202.18	2,344,479.28	
PENTAIR PLC	14,533	45.79	665,466.07	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	142,554	57.60	8,211,110.40	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,474	221.23	2,317,163.02	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,876	401.36	3,963,831.36	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	42.69	590,317.32	
SMITH (A.O.) CORP	12,146	53.73	652,604.58	
SNAP-ON INC	4,900	145.40	712,460.00	

STANLEY BLACK&DECKER	14,654	161.48	2,366,327.92	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,501	311.94	1,092,101.94	
TEXTRON	21,534	36.77	791,805.18	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,896	121.22	2,654,233.12	
TRANSDIGM GROUP INC	4,664	489.08	2,281,069.12	
UNITED RENTALS INC	6,643	174.21	1,157,277.03	
WABTEC CORP	17,764	62.47	1,109,717.08	
XYLEM INC	17,545	83.77	1,469,744.65	
CINTAS CORP	8,272	330.28	2,732,076.16	
COPART INC	19,784	105.74	2,091,960.16	
COSTAR GROUP INC	3,584	856.85	3,070,950.40	
EQUIFAX INC	11,579	157.84	1,827,629.36	
IHS MARKIT LTD	35,672	77.42	2,761,726.24	
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,849	14.01	488,234.49	
REPUBLIC SERVICES INC	20,007	93.92	1,879,057.44	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	52.57	502,884.62	
ROLLINS INC	14,566	54.50	793,847.00	
TRANSUNION	17,091	84.62	1,446,240.42	
VERISK ANALYTICS INC	14,560	184.38	2,684,572.80	
WASTE CONNECTIONS INC	24,629	104.24	2,567,326.96	
WASTE MANAGEMENT INC	39,877	113.41	4,522,450.57	
AMERCO	1,000	351.98	351,980.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,186	103.70	1,367,388.20	
CSX CORP	72,242	77.60	5,605,979.20	
DELTA AIR LINES INC	12,549	30.61	384,124.89	
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,868	91.63	1,453,984.84	
FEDEX CORP	23,427	253.50	5,938,744.50	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,319	128.63	1,070,072.97	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,711	182.77	1,592,109.47	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	41.31	442,017.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,186	215.81	5,219,580.66	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,013	185.11	1,668,396.43	
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	37.61	431,198.65	
UBER TECHNOLOGIES INC	87,546	35.43	3,101,754.78	
UNION PACIFIC CORP	63,856	197.24	12,594,957.44	
UNITED PARCEL SERVICE B	66,291	168.50	11,170,033.50	
XPO LOGISTICS INC	8,001	85.93	687,525.93	
APTIV PLC	24,462	91.92	2,248,547.04	
AUTOLIV INC	6,776	72.87	493,767.12	
BORGWARNER INC	19,890	38.03	756,416.70	
FORD MOTOR COMPANY	370,912	6.60	2,448,019.20	
GENERAL MOTORS CO	119,364	28.74	3,430,521.36	

LEAR CORP	5,287	108.01	571,048.87	
TESLA INC	69,867	419.07	29,279,163.69	
DR HORTON INC	32,171	74.02	2,381,297.42	
GARMIN LTD	12,854	95.01	1,221,258.54	
HASBRO INC	12,468	81.24	1,012,900.32	
LENNAR CORP-CL A	24,928	78.97	1,968,564.16	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,527	323.67	3,730,944.09	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	96.27	487,318.74	
NEWELL BRANDS INC	37,563	17.12	643,078.56	
NIKE B	116,668	126.35	14,741,001.80	
NVR INC	337	4,001.56	1,348,525.72	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	17,278	100.47	1,735,920.66	
PULTE GROUP INC	23,283	45.27	1,054,021.41	
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	67.34	308,282.52	
VF CORP	31,438	69.66	2,189,971.08	
WHIRLPOOL CORP	6,079	180.75	1,098,779.25	
ARAMARK	24,034	26.42	634,978.28	
CARNIVAL CORPORATION	40,341	15.07	607,938.87	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,444	1,261.61	3,083,374.84	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,347	100.80	1,143,777.60	
DOMINO'S PIZZA INC	3,721	423.46	1,575,694.66	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	25,491	86.60	2,207,520.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,100	46.72	1,546,432.00	
MARRIOTT INTL A	26,161	93.21	2,438,597.61	
MCDONALD'S CORP	69,943	218.68	15,295,135.24	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	16.60	293,189.20	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,847	21.72	887,196.84	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,603	64.40	1,004,833.20	
STARBUCKS CORP	110,010	84.80	9,328,848.00	
VAIL RESORTS INC	3,574	214.09	765,157.66	
WYNN RESORTS LTD	9,302	70.98	660,255.96	
YUM BRANDS INC	27,266	90.71	2,473,298.86	
ACTIVISION BLIZZARD INC	72,713	80.78	5,873,756.14	
ALPHABET INC-CL A	28,190	1,466.02	41,327,103.80	
ALPHABET INC-CL C	28,424	1,469.33	41,764,235.92	
ALTICE USA INC- A	29,505	26.30	775,981.50	
CABLE ONE INC	401	1,805.00	723,805.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,617	626.50	8,531,050.50	
COMCAST CORP-CL A	428,273	46.20	19,786,212.60	
DISCOVERY INC - A	12,804	21.75	278,487.00	
DISCOVERY INC-C	28,190	19.47	548,859.30	
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,103	29.65	714,653.95	

ELECTRONIC ARTS INC	26,822	130.02	3,487,396.44	
FACEBOOK INC-A	225,961	261.79	59,154,330.19	
FOX CORP - CLASS A	33,968	27.77	943,291.36	
FOX CORP- CLASS B	15,092	27.82	419,859.44	
IAC/INTERACTIVECORP	7,821	118.96	930,386.16	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	16.62	562,321.08	
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	142.28	366,940.12	
LIBERTY BROADBAND-C	10,201	143.08	1,459,559.08	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	35.37	661,171.41	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	33.24	573,855.36	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	33.11	211,374.24	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	53.29	741,157.32	
MATCH GROUP INC	23,371	109.12	2,550,243.52	
NETFLIX INC	41,353	493.48	20,406,878.44	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.89	465,023.31	
OMNICOM GROUP	20,835	48.85	1,017,789.75	
PINTEREST INC- CLASS A	35,703	40.56	1,448,113.68	
ROKU INC	9,741	187.87	1,830,041.67	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	89,917	5.25	472,064.25	
SNAP INC - A	84,912	25.99	2,206,862.88	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	10,751	164.34	1,766,819.34	
THE WALT DISNEY CO	169,806	125.40	21,293,672.40	
TWITTER INC	71,690	44.74	3,207,410.60	
VIACOMCBS INC-CLASS B	53,976	28.96	1,563,144.96	
ZILLOW GROUP INC-C	12,368	101.42	1,254,362.56	
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	151.71	938,478.06	
AMAZON.COM	39,828	3,144.88	125,254,280.64	
AUTOZONE INC	2,216	1,154.92	2,559,302.72	
BEST BUY COMPANY INC	21,012	110.08	2,313,000.96	
BOOKING HOLDINGS INC	3,859	1,672.98	6,456,029.82	
BURLINGTON STORES INC	5,808	204.75	1,189,188.00	
CARMAX INC	15,563	93.08	1,448,604.04	
DOLLAR GENERAL CORP	23,780	209.64	4,985,239.20	
DOLLAR TREE INC	22,651	89.87	2,035,645.37	
EBAY	66,540	52.65	3,503,331.00	
EXPEDIA GROUP INC	13,028	91.78	1,195,709.84	
GENUINE PARTS CO	13,937	94.74	1,320,391.38	
HOME DEPOT	101,081	272.11	27,505,150.91	
LKQ CORP	29,351	27.65	811,555.15	
LOWES COMPANIES	71,063	162.26	11,530,682.38	
MERCADOLIBRE INC	4,293	1,082.87	4,648,760.91	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,031	453.32	3,187,292.92	

ROSS STORES INC	33,683	91.03	3,066,163.49	
TARGET (DAYTON HUDSON)	47,144	156.94	7,398,779.36	
TIFFANY & CO	10,426	116.44	1,214,003.44	
TJX COMPANIES INC	112,998	54.16	6,119,971.68	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,212	140.98	1,580,667.76	
ULTA BEAUTY INC	5,150	222.88	1,147,832.00	
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	294.66	1,767,960.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	41,539	352.14	14,627,543.46	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	3.76	127,464.00	
KROGER CO	71,185	33.77	2,403,917.45	
SYSCO CORP	45,437	61.17	2,779,381.29	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,566	35.38	2,390,485.08	
WALMART INC	133,237	137.14	18,272,122.18	
ALTRIA GROUP INC	175,164	38.36	6,719,291.04	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,189	45.98	2,399,650.22	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	29,010	75.23	2,182,422.30	
BUNGE LIMITED	13,606	45.18	614,719.08	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	48.02	762,029.38	
COCA-COLA CO	383,648	48.92	18,768,060.16	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,884	38.79	810,090.36	
CONAGRA BRANDS INC	45,992	35.48	1,631,796.16	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,911	187.52	2,983,630.72	
GENERAL MILLS INC	55,196	59.86	3,304,032.56	
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,896	141.19	1,961,976.24	
HORMEL FOODS CORP	27,157	48.51	1,317,386.07	
INGREDION INC	5,835	75.03	437,800.05	
JM SMUCKER CO	10,802	113.01	1,220,734.02	
KELLOGG CO	24,092	63.44	1,528,396.48	
KEURIG DR PEPPER INC	31,200	27.11	845,832.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	58,798	29.59	1,739,832.82	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	65.29	843,807.96	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,757	189.89	2,232,536.73	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	33.53	610,346.59	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	134,530	56.48	7,598,254.40	
MONSTER BEVERAGE CORP	37,118	79.79	2,961,645.22	
PEPSICO INC	130,482	137.16	17,896,911.12	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	146,553	74.34	10,894,750.02	
TYSON FOODS INC	28,214	58.96	1,663,497.44	
CHURCH & DWIGHT CO INC	23,454	92.85	2,177,703.90	
CLOROX COMPANY	11,960	210.41	2,516,503.60	
COLGATE-PALMOLIVE CO	76,780	76.22	5,852,171.60	
ESTEE LAUDER CO-CL A	21,239	214.78	4,561,712.42	

KIMBERLY-CLARK CORP	32,173	146.34	4,708,196.82	
PROCTER & GAMBLE CO	232,638	137.26	31,931,891.88	
ABBOTT LABORATORIES	166,348	105.19	17,498,146.12	
ABIOMED INC	4,421	272.46	1,204,545.66	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,113	320.17	2,277,369.21	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,604	96.16	1,404,320.64	
ANTHEM INC	23,782	259.79	6,178,325.78	
BAXTER INTERNATIONAL	47,484	79.09	3,755,509.56	
BECTON DICKINSON & CO	27,332	225.43	6,161,452.76	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	134,860	37.76	5,092,313.60	
CARDINAL HEALTH	27,968	46.89	1,311,419.52	
CENTENE CORP	54,883	55.86	3,065,764.38	
CERNER CORP	27,382	71.19	1,949,324.58	
CIGNA CORP	34,815	164.31	5,720,452.65	
CVS HEALTH CORP	123,229	57.54	7,090,596.66	
DANAHER CORP	60,004	211.01	12,661,444.04	
DAVITA INC	7,259	84.14	610,772.26	
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	42.75	863,037.00	
DEXCOM INC	8,490	402.18	3,414,508.20	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	58,536	78.31	4,583,954.16	
HCA HEALTHCARE INC	25,577	120.18	3,073,843.86	
HENRY SCHEIN INC	14,096	58.57	825,602.72	
HOLOGIC INC	24,459	66.12	1,617,229.08	
HUMANA INC	12,486	401.50	5,013,129.00	
IDEXX LABORATORIES INC	7,712	385.06	2,969,582.72	
INSULET CORP	5,923	231.97	1,373,958.31	
INTUITIVE SURGICAL INC	10,990	692.93	7,615,300.70	
LABORATORY CRP OF AMER	8,614	186.47	1,606,252.58	
MASIMO CORP	4,504	232.31	1,046,324.24	
MCKESSON CORP	15,393	146.56	2,255,998.08	
MEDTRONIC PLC	126,184	102.69	12,957,834.96	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,724	171.80	983,383.20	
QUEST DIAGNOSTICS	12,894	113.65	1,465,403.10	
RESMED INC	13,491	172.66	2,329,356.06	
STERIS PLC	8,111	172.82	1,401,743.02	
STRYKER CORP	31,863	204.74	6,523,630.62	
TELADOC HEALTH INC	6,315	217.34	1,372,502.10	
TELEFLEX INC	4,427	335.54	1,485,435.58	
THE COOPER COS INC	5,096	333.59	1,699,974.64	
UNITEDHEALTH GROUP INC	89,134	304.15	27,110,106.10	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	102.53	743,137.44	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,237	172.00	1,416,764.00	

VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,325	280.99	3,463,201.75	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,017	273.65	1,920,202.05	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,627	133.40	2,618,241.80	
ABBVIE INC	166,147	86.89	14,436,512.83	
AGILENT TECHNOLOGIES	29,371	100.22	2,943,561.62	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,726	112.46	2,330,845.96	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	145.01	1,546,531.65	
AMGEN	55,348	248.30	13,742,908.40	
AVANTOR INC	44,570	22.50	1,002,825.00	
BEIGENE LTD-ADR	3,859	281.46	1,086,154.14	
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,141	515.10	1,102,829.10	
BIOGEN INC	15,428	282.35	4,356,095.80	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	76.00	1,304,996.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	212,929	59.90	12,754,447.10	
CATALENT INC	13,739	85.19	1,170,425.41	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	26.76	964,992.36	
EXACT SCIENCES CORP	13,278	102.01	1,354,488.78	
GILEAD SCIENCES INC	118,215	62.10	7,341,151.50	
ILLUMINA INC	13,885	305.50	4,241,867.50	
INCYTE CORP	17,504	87.43	1,530,374.72	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,817	48.48	621,368.16	
IQVIA HOLDINGS INC	17,736	154.78	2,745,178.08	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	139.74	694,647.54	
JOHNSON & JOHNSON	247,547	147.06	36,404,261.82	
LILLY (ELI) & CO	81,065	146.26	11,856,566.90	
MERCK & CO	237,327	81.90	19,437,081.30	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,261	968.59	2,189,981.99	
MODERNA INC	25,034	70.52	1,765,397.68	
MYLAN NV	49,481	14.57	720,938.17	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	97.70	827,909.80	
PERKINELMER INC	10,645	123.26	1,312,102.70	
PERRIGO CO PLC	13,392	45.67	611,612.64	
PFIZER	522,315	36.17	18,892,133.55	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,523	573.61	5,462,488.03	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,147	141.28	1,009,728.16	
SEATTLE GENETICS INC	11,471	190.96	2,190,502.16	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	108,484	8.85	960,083.40	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,148	434.34	16,134,862.32	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,454	270.31	6,610,160.74	
WATERS CORP	5,957	193.39	1,152,024.23	
ZOETIS INC	44,775	162.48	7,275,042.00	
BANK OF AMERICA CORP	734,208	23.77	17,452,124.16	

CITIGROUP	196,067	42.42	8,317,162.14	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	24.78	991,447.80	
COMERICA INC	14,360	37.73	541,802.80	
EAST WEST BANCORP INC	13,827	32.46	448,824.42	
FIFTH THIRD BANCORP	67,941	20.99	1,426,081.59	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,872	107.67	1,708,938.24	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,012	9.05	896,058.60	
JPMORGAN CHASE & CO	286,357	95.35	27,304,139.95	
KEY CORP	94,322	11.83	1,115,829.26	
M & T BANK CORP	11,721	91.13	1,068,134.73	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	36,720	10.17	373,442.40	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,092	106.93	4,287,037.56	
REGIONS FINL CORP	92,434	11.37	1,050,974.58	
SIGNATURE BANK	5,223	82.49	430,845.27	
SVB FINANCIAL GROUP	4,943	237.09	1,171,935.87	
TRUIST FINANCIAL CORP	127,255	37.01	4,709,707.55	
US BANCORP	128,061	35.30	4,520,553.30	
WELLS FARGO & CO	366,879	23.26	8,533,605.54	
ZIONS BANCORPORATION	15,186	28.97	439,938.42	
ALLY FINANCIAL INC	36,028	24.45	880,884.60	
AMERICAN EXPRESS	64,516	97.75	6,306,439.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,676	150.38	1,755,836.88	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	45.35	687,188.55	
BANK NEW YORK CO	73,913	33.87	2,503,433.31	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	130,701	210.44	27,504,718.44	
BLACKROCK INC	14,366	554.80	7,970,256.80	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	62,438	52.71	3,291,106.98	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,052	70.45	2,962,563.40	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,087	24.61	395,901.07	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,612	86.89	922,076.68	
CME GROUP INC	33,845	166.12	5,622,331.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,704	55.64	1,541,450.56	
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	48.93	1,032,814.44	
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,215	18.34	737,543.10	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,633	333.96	1,213,276.68	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	20.04	522,442.80	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,819	196.79	6,064,871.01	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	51,672	99.17	5,124,312.24	
INVESCO LTD	44,943	11.43	513,698.49	
KKR & CO INC	47,403	34.19	1,620,708.57	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,593	485.43	1,744,149.99	
MOODY'S CORP	15,637	285.73	4,467,960.01	

MORGAN STANLEY	111,529	47.24	5,268,629.96	
MSCI INC	7,815	356.03	2,782,374.45	
NASDAQ INC	10,979	121.38	1,332,631.02	
NORTHERN TRUST CORP	17,625	77.46	1,365,232.50	
PRICE T ROWE GROUP INC	21,597	127.49	2,753,401.53	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,968	72.30	865,286.40	
S&P GLOBAL INC	22,701	356.98	8,103,802.98	
SCHWAB (CHARLES) CORP	109,614	35.78	3,921,988.92	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	51.07	626,169.27	
STATE STREET CORP	31,754	59.89	1,901,747.06	
SYNCHRONY FINANCIAL	46,378	25.55	1,184,957.90	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,877	38.74	1,002,474.98	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	58.03	525,809.83	
VOYA FINANCIAL INC	12,505	47.60	595,238.00	
AFLAC	62,907	36.02	2,265,910.14	
ALLEGHANY CORP	1,276	520.28	663,877.28	
ALLSTATE CORP	29,185	93.44	2,727,046.40	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	66.15	418,001.85	
AMERICAN INT'L GROUP	77,792	27.29	2,122,943.68	
AON PLC	21,468	205.09	4,402,872.12	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,796	28.87	1,120,040.52	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,833	104.77	1,868,363.41	
ASSURANT INC	5,819	120.59	701,713.21	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	34.00	347,038.00	
BROWN & BROWN INC	22,945	45.17	1,036,425.65	
CHUBB LTD	42,622	114.34	4,873,399.48	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,851	77.89	1,156,744.39	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	210.07	455,011.62	
EVEREST RE GROUP LTD	3,926	199.78	784,336.28	
FNF GROUP	24,961	30.99	773,541.39	
GLOBE LIFE INC	9,867	79.01	779,591.67	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	34,481	36.53	1,259,590.93	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	30.94	506,302.16	
LOEWS CORP	25,707	34.20	879,179.40	
MARKEL CORP	1,312	968.65	1,270,868.80	
MARSH & MCLENNAN COS	48,155	114.05	5,492,077.75	
METLIFE INC	73,194	36.77	2,691,343.38	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,615	40.06	1,066,196.90	
PROGRESSIVE CORP	55,260	94.15	5,202,729.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,511	63.09	2,366,568.99	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	95.28	633,802.56	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	168.50	819,584.00	

TRAVELERS COS INC/THE	23,997	107.44	2,578,237.68	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,016	208.09	2,500,409.44	
WR BERKLEY CORP	14,085	60.97	858,762.45	
CBRE GROUP INC-A	30,111	46.77	1,408,291.47	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.65	360,255.00	
JONES LANG LASALLE INC	4,484	96.12	431,002.08	
WEYERHAEUSER CO	69,607	28.05	1,952,476.35	
ACCENTURE PLC-CL A	59,931	224.08	13,429,338.48	
ADOBE INC	45,295	489.33	22,164,202.35	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	15,447	111.21	1,717,860.87	
ANSYS INC	8,044	319.51	2,570,138.44	
AUTODESK INC	20,707	232.92	4,823,074.44	
AUTOMATIC DATA PROCESS	40,567	137.54	5,579,585.18	
AVALARA INC	7,698	131.43	1,011,748.14	
BLACK KNIGHT INC	14,413	86.96	1,253,354.48	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,438	84.24	1,132,017.12	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	10,971	131.72	1,445,100.12	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	26,500	105.78	2,803,170.00	
CDK GLOBAL INC	10,687	43.59	465,846.33	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	120.73	1,265,974.78	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	136.95	1,430,305.80	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	51,182	69.00	3,531,558.00	
COUPA SOFTWARE INC	6,059	274.41	1,662,650.19	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	12,709	136.35	1,732,872.15	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	102.14	316,634.00	
DATADOG INC - CLASS A	11,555	90.92	1,050,580.60	
DOCUSIGN INC	16,480	212.93	3,509,086.40	
DROPBOX INC-CLASS A	24,217	19.13	463,271.21	
DYNATRACE INC	17,890	41.22	737,425.80	
EPAM SYSTEMS INC	5,266	325.56	1,714,398.96	
FAIR ISAAC CORP	2,615	427.21	1,117,154.15	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	58,208	148.80	8,661,350.40	
FISERV INC	53,732	103.59	5,566,097.88	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,994	240.75	1,924,555.50	
FORTINET INC	12,295	117.10	1,439,744.50	
GARTNER INC	8,569	125.23	1,073,095.87	
GLOBAL PAYMENTS INC	27,817	177.50	4,937,517.50	
GODADDY INC - CLASS A	15,914	76.14	1,211,691.96	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	105.53	836,114.19	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	83,603	120.94	10,110,946.82	
INTUIT INC	24,576	323.64	7,953,776.64	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,360	162.13	1,193,276.80	

LEIDOS HOLDINGS	12,829	90.57	1,161,922.53	
MASTERCARD INC-CLASS A	83,996	336.23	28,241,975.08	
MICROSOFT CORP	676,810	207.26	140,275,640.60	
MONGODB INC	4,623	232.09	1,072,952.07	
NORTONLIFELOCK INC	50,376	20.86	1,050,843.36	
OKTA INC	11,056	213.56	2,361,119.36	
ORACLE CORP	192,947	59.47	11,474,558.09	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,711	246.49	2,147,174.39	
PAYCHEX INC	30,214	79.17	2,392,042.38	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,755	303.83	1,444,711.65	
PAYPAL HOLDINGS INC	104,882	194.50	20,399,549.00	
PTC INC	9,984	82.35	822,182.40	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,982	270.76	1,890,446.32	
SALESFORCE.COM INC	84,561	247.45	20,924,619.45	
SERVICENOW INC	17,969	487.98	8,768,512.62	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	37,111	26.97	1,000,883.67	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,750	259.13	712,607.50	
SPLUNK INC	14,752	187.18	2,761,279.36	
SQUARE INC - A	34,285	164.81	5,650,510.85	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	21,775	60.50	1,317,387.50	
SYNOPSYS INC	14,302	212.32	3,036,600.64	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3,705	498.30	1,846,201.50	
TWILIO INC - A	11,282	248.80	2,806,961.60	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	346.52	1,286,628.76	
VERISIGN INC	9,910	204.91	2,030,658.10	
VISA INC-CLASS A SHARES	158,538	199.44	31,618,818.72	
VMWARE INC-CLASS A	7,867	145.74	1,146,536.58	
WESTERN UNION CO	38,757	21.78	844,127.46	
WIX.COM LTD	5,010	255.50	1,280,055.00	
WORKDAY INC-CLASS A	16,479	220.78	3,638,233.62	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	15,018	465.50	6,990,879.00	
ZSCALER INC	6,234	140.49	875,814.66	
AMPHENOL CORPORATION	27,456	108.63	2,982,545.28	
APPLE INC	1,628,257	114.09	185,767,841.13	
ARISTA NETWORKS INC	5,179	210.46	1,089,972.34	
ARROW ELECTRONICS INC	7,839	78.54	615,675.06	
CDW CORP/DE	13,742	118.11	1,623,067.62	
CISCO SYSTEMS	397,144	39.06	15,512,444.64	
COGNEX CORP	16,230	64.96	1,054,300.80	
CORNING	72,399	31.97	2,314,596.03	
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	68.40	1,472,652.00	
F5 NETWORKS INC	5,350	124.01	663,453.50	

FLIR SYSTEMS INC	11,686	35.58	415,787.88	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	123,779	9.38	1,161,047.02	
HP INC	135,773	18.92	2,568,825.16	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	168.26	539,609.82	
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	21.86	684,305.44	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,624	99.60	1,755,350.40	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,158	157.65	2,547,308.70	
NETAPP INC	20,586	43.99	905,578.14	
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	50.07	1,143,398.52	
TE CONNECTIVITY LTD	31,267	97.45	3,046,969.15	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	23,884	48.92	1,168,405.28	
WESTERN DIGITAL CORP	28,454	39.32	1,118,811.28	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,162	258.92	1,336,545.04	
AT&T INC	669,946	28.30	18,959,471.80	
CENTURYLINK INC	93,962	10.22	960,291.64	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	21.39	331,887.24	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	20.90	703,912.00	
T-MOBILE US INC	51,428	113.52	5,838,106.56	
VERIZON COMMUNICATIONS	388,985	59.24	23,043,471.40	
AES CORP	61,761	18.00	1,111,698.00	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	24,156	51.08	1,233,888.48	
AMEREN CORPORATION	23,120	79.02	1,826,942.40	
AMERICAN ELECTRIC POWER	46,898	80.97	3,797,331.06	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,922	143.70	2,431,691.40	
ATMOS ENERGY CORP	11,419	95.10	1,085,946.90	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	19.00	915,078.00	
CMS ENERGY CORP	26,742	61.11	1,634,203.62	
CONSOLIDATED EDISON INC	31,745	76.98	2,443,730.10	
DOMINION ENERGY INC	79,161	77.88	6,165,058.68	
DTE ENERGY COMPANY	18,360	114.40	2,100,384.00	
DUKE ENERGY CORP	69,344	82.41	5,714,639.04	
EDISON INTL	33,630	51.02	1,715,802.60	
ENTERGY CORP	18,696	95.78	1,790,702.88	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	39.78	828,776.52	
EVERGY INC	21,330	50.15	1,069,699.50	
EVERSOURCE ENERGY	30,920	83.01	2,566,669.20	
EXELON CORP	92,303	35.32	3,260,141.96	
FIRSTENERGY CORP	50,559	28.60	1,445,987.40	
NEXTERA ENERGY INC	46,057	283.12	13,039,657.84	
NISOURCE INC	35,781	21.96	785,750.76	
NRG ENERGY INC	23,078	29.70	685,416.60	
OGE ENERGY CORP	19,225	29.67	570,405.75	

	PG&E CORP	92,713	9.39	870,575.07	
	PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	73.45	791,203.40	
	PPL CORPORATION	69,904	26.88	1,879,019.52	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	47,290	54.80	2,591,492.00	
	SEMPRA ENERGY	27,061	116.18	3,143,946.98	
	SOUTHERN CO	99,701	53.70	5,353,943.70	
	UGI CORP	18,019	32.49	585,437.31	
	VISTRA CORP	37,797	18.53	700,378.41	
	WEC ENERGY GROUP INC	29,921	96.66	2,892,163.86	
	XCEL ENERGY INC	49,733	68.64	3,413,921.78	
	ADVANCED MICRO DEVICES	110,338	81.77	9,022,338.26	
	ANALOG DEVICES	34,849	116.65	4,065,135.85	
	APPLIED MATERIALS	84,668	59.65	5,050,446.20	
	BROADCOM INC	37,616	364.26	13,702,004.16	
	INTEL CORP	398,108	51.19	20,379,148.52	
	KLA CORP	14,078	193.33	2,721,699.74	
	LAM RESEARCH CORP	13,726	337.71	4,635,407.46	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	61,408	39.40	2,419,475.20	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,481	67.84	1,728,631.04	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,844	102.74	2,346,992.56	
	MICRON TECHNOLOGY	105,024	50.71	5,325,767.04	
	NVIDIA CORP	57,796	529.03	30,575,817.88	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	25,742	123.29	3,173,731.18	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	21.78	783,992.88	
	QORVO INC	10,609	130.77	1,387,338.93	
	QUALCOMM	105,875	117.38	12,427,607.50	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,879	144.35	2,292,133.65	
	TERADYNE INC	16,048	79.86	1,281,593.28	
	TEXAS INSTRUMENTS	86,379	141.50	12,222,628.50	
	XILINX INC	21,957	103.63	2,275,403.91	
アメリカドル 小計		29,036,191		2,719,683,235.63 (287,742,486,329)	
カナダドル	CAMECO CORP	41,062	13.64	560,085.68	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	106,748	21.50	2,295,082.00	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	5.24	506,529.84	
	ENBRIDGE	192,558	39.60	7,625,296.80	
	IMPERIAL OIL	24,763	16.11	398,931.93	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	13.56	480,769.80	
	KEYERA CORP	18,607	20.54	382,187.78	
	PARKLAND CORP	17,004	36.46	619,965.84	
	PEMBINA PIPELINE CORP	53,816	28.87	1,553,667.92	
	SUNCOR ENERGY	137,891	16.49	2,273,822.59	

TC ENERGY CORP	86,686	57.90	5,019,119.40	
AGNICO EAGLE MINES	23,423	106.81	2,501,810.63	
B2GOLD CORP	90,243	8.88	801,357.84	
BARRICK GOLD CORP	170,376	37.87	6,452,139.12	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	51.71	679,417.69	
FRANCO-NEVADA CORP	18,443	187.01	3,449,025.43	
KINROSS GOLD CORP	125,340	11.96	1,499,066.40	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	65.52	1,535,002.56	
LUNDIN MINING CORP	62,243	7.06	439,435.58	
NUTRIEN LTD	55,624	51.55	2,867,417.20	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	43.33	797,748.63	
SSR MINING INC	21,000	24.86	522,060.00	
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	18.54	846,851.58	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	43,718	65.70	2,872,272.60	
YAMANA GOLD INC	81,672	7.65	624,790.80	
CAE INC	25,999	19.32	502,300.68	
WSP GLOBAL INC	9,471	87.48	828,523.08	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	9,110	79.22	721,694.20	
THOMSON REUTERS CORP	15,191	107.04	1,626,044.64	
AIR CANADA	19,591	15.28	299,350.48	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	67,468	142.59	9,620,262.12	
CP RAILWAY LIMITED	12,980	407.18	5,285,196.40	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	61.28	1,714,491.84	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,923	27.06	566,176.38	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,357	76.83	1,948,178.31	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.61	510,872.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	45,087	24.55	1,106,885.85	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	134.95	729,944.55	
DOLLARAMA INC	26,700	50.95	1,360,365.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	82,854	46.69	3,868,453.26	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	38.70	590,291.10	
LOBLAW COMPANIES LTD	17,907	70.27	1,258,324.89	
METRO INC	24,937	64.21	1,601,204.77	
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	98.64	678,939.12	
SAPUTO INC	24,489	33.72	825,769.08	
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	19.94	554,332.00	
CANOPY GROWTH CORP	25,606	19.38	496,244.28	
CRONOS GROUP INC	15,900	6.76	107,484.00	
BANK MONTREAL	61,268	78.17	4,789,319.56	
BANK NOVA SCOTIA	112,518	55.44	6,237,997.92	
CANADIAN IMPERIAL BANK	42,756	99.92	4,272,179.52	
NATIONAL BANK OF CANADA	29,995	66.54	1,995,867.30	

	ROYAL BANK OF CANADA	134,643	93.91	12,644,324.13	
	TORONTO-DOMINION BANK	171,416	61.57	10,554,083.12	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	127,786	44.08	5,632,806.88	
	CI FINANCIAL CORP	18,671	16.95	316,473.45	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	30.38	233,470.30	
	ONEX CORP	6,603	59.14	390,501.42	
	TMX GROUP LTD	4,685	135.63	635,426.55	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,663	385.00	1,025,255.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	26.15	622,056.20	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,230	46.54	383,024.20	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	141.77	1,849,106.11	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	178,574	18.64	3,328,619.36	
	POWER CORP OF CANADA	51,551	26.36	1,358,884.36	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	52,771	54.44	2,872,853.24	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.22	245,068.00	
	CGI INC - CL A	20,486	89.72	1,838,003.92	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,845	1,506.63	2,779,732.35	
	OPEN TEXT CORP	24,643	56.56	1,393,808.08	
	SHOPIFY INC - CLASS A	10,174	1,368.00	13,918,032.00	
	BCE INC	15,355	55.77	856,348.35	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	35,018	53.20	1,862,957.60	
	TELUS CORP	32,908	23.84	784,526.72	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.17	993,351.06	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	16.24	396,174.80	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	38.91	203,927.31	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.23	332,742.52	
	EMERA INC	23,704	55.17	1,307,749.68	
	FORTIS INC	42,633	54.70	2,332,025.10	
	HYDRO ONE LTD	32,299	28.47	919,552.53	
カナダドル 小計		3,590,975		173,711,432.31 (13,728,414,495)	
ユーロ	ENI	229,512	6.66	1,529,697.48	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	7.75	381,647.05	
	NESTE OIL OYJ	40,117	45.57	1,828,131.69	
	OMV AG	14,984	23.18	347,329.12	
	REPSOL SA	140,401	5.67	796,073.67	
	SIEMENS ENERGY AG	36,181	22.00	795,982.00	
	TENARIS SA	40,648	4.13	167,916.88	
	TOTAL SE	234,041	28.33	6,630,381.53	
	VOPAK	6,360	48.44	308,078.40	
	AIR LIQUIDE	44,893	137.50	6,172,787.50	
	AKZO NOBEL	17,285	86.36	1,492,732.60	

ARCELORMITTAL	66,229	11.48	760,838.75	
ARKEMA	5,949	90.82	540,288.18	
BASF SE	85,260	52.34	4,462,508.40	
COVESTRO AG	15,098	45.63	688,921.74	
CRH PLC	72,257	31.27	2,259,476.39	
EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	22.21	438,736.34	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	42.64	245,691.68	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,833	52.08	772,502.64	
KONINKLIJKE DSM NV	15,650	135.40	2,119,010.00	
LANXESS	7,293	49.87	363,701.91	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	33.84	662,079.60	
SOLVAY SA	6,906	74.18	512,287.08	
STORA ENSO OYJ R	54,792	13.63	746,814.96	
SYMRISE AG	12,620	118.65	1,497,363.00	
THYSSEN KRUPP	33,044	4.34	143,444.00	
UMICORE	17,605	36.46	641,878.30	
UPM KYMMENE OYJ	50,623	26.14	1,323,285.22	
VOESTALPINE AG	12,422	22.26	276,513.72	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	23,394	18.99	444,369.03	
AIRBUS SE	56,097	62.59	3,511,111.23	
ALSTOM	18,760	44.09	827,128.40	
ANDRITZ AG	5,242	27.56	144,469.52	
BOUYGUES ORD	19,381	29.28	567,475.68	
BRENNTAG AG	15,254	54.60	832,868.40	
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	6.70	623,460.25	
DASSAULT AVIATION SA	213	717.50	152,827.50	
EIFFAGE	7,209	71.00	511,839.00	
FERROVIAL SA	46,711	21.14	987,470.54	
GEA GROUP AG	13,382	29.99	401,326.18	
HOCHTIEF AG	2,222	65.10	144,652.20	
KINGSPAN GROUP PLC	15,358	77.35	1,187,941.30	
KION GROUP AG	5,887	74.80	440,347.60	
KNORR-BREMSE AG	7,434	100.20	744,886.80	
KONE OYJ-B	32,785	75.86	2,487,070.10	
LEGRAND SA	24,584	68.00	1,671,712.00	
LEONARDO SPA	35,425	5.00	177,125.00	
MTU AERO ENGINES AG	4,753	141.95	674,688.35	
PRYSMIAN SPA	21,155	24.87	526,124.85	
SAFRAN SA	29,413	85.30	2,508,928.90	
SAINT-GOBAIN	51,472	35.91	1,848,359.52	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	49,710	108.90	5,413,419.00	
SIEMENS	72,363	108.64	7,861,516.32	

SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	25,102	22.80	572,325.60	
THALES SA	9,665	63.22	611,021.30	
VINCI S.A.	49,191	72.44	3,563,396.04	
WARTSILA OYJ	34,386	6.62	227,704.09	
BUREAU VERITAS SA	25,073	19.44	487,419.12	
RANDSTAD NV	12,365	44.13	545,667.45	
TELEPERFORMANCE	5,757	265.20	1,526,756.40	
WOLTERS KLUWER	25,709	73.28	1,883,955.52	
ADP	2,382	84.60	201,517.20	
AENA SME SA	6,542	117.20	766,722.40	
ATLANTIA SPA	41,427	13.61	563,821.47	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	7.25	168,908.17	
DEUTSCHE POST AG-REG	91,113	39.48	3,597,141.24	
FRAPORT AG	3,561	33.30	118,581.30	
GETLINK	44,101	11.54	508,925.54	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,073	62.00	1,988,526.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	46.52	232,181.32	
CONTINENTAL AG	9,928	92.14	914,765.92	
DAIMLER AG	78,738	45.69	3,597,539.22	
FAURECIA	5,945	36.14	214,852.30	
FERRARI NV	11,392	156.15	1,778,860.80	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96,640	10.38	1,003,896.32	
MICHELIN	16,591	92.44	1,533,672.04	
PEUGEOT SA	52,883	15.34	811,489.63	
PIRELLI & C SPA	39,097	3.72	145,597.22	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	50.82	712,902.96	
RENAULT SA	17,362	22.24	386,130.88	
VALEO SA	19,350	26.67	516,064.50	
VOLKSWAGEN AG-PFD	17,850	138.74	2,476,509.00	
VOLKSWAGEN STAMM	3,251	150.30	488,625.30	
ADIDAS AG	17,675	281.20	4,970,210.00	
ESSILORLUXOTTICA	27,274	115.40	3,147,419.60	
HERMES INTERNATIONAL	3,059	738.00	2,257,542.00	
KERING	7,223	576.60	4,164,781.80	
LVMH	26,228	409.95	10,752,168.60	
MONCLER SPA	16,489	35.05	577,939.45	
PUMA SE	7,720	76.92	593,822.40	
SEB SA	2,075	144.70	300,252.50	
ACCOR	17,931	23.56	422,454.36	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,932	136.20	1,897,538.40	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	31.76	257,510.08	
SODEXO	8,135	60.72	493,957.20	

BOLLORE	61,805	3.20	197,776.00	
JC DECAUX SA	9,522	14.61	139,116.42	
PUBLICIS GROUPE	21,469	27.23	584,600.87	
SCOUT24 AG	9,470	74.00	700,780.00	
SES	31,369	5.94	186,457.33	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	32.76	163,734.48	
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,311	76.32	710,615.52	
VIVENDI	77,307	23.86	1,844,545.02	
DELIVERY HERO SE	11,471	99.08	1,136,546.68	
INDITEX	101,980	23.94	2,441,401.20	
JUST EAT TAKEAWAY	11,372	95.96	1,091,257.12	
PROSUS	45,138	77.28	3,488,264.64	
ZALANDO SE	13,985	78.12	1,092,508.20	
CARREFOUR	59,235	13.71	812,408.02	
COLRUYT SA	5,424	54.94	297,994.56	
JERONIMO MARTINS	24,901	13.84	344,629.84	
KONINKLIJKE AHOLD NV	103,264	25.53	2,636,329.92	
METRO AG	13,712	8.46	116,058.36	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,865	46.30	3,373,649.50	
DANONE (GROUPE)	59,079	55.08	3,254,071.32	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	9.33	457,937.48	
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	67.05	717,502.05	
HEINEKEN NV	24,387	76.52	1,866,093.24	
KERRY GROUP PLC-A	14,641	108.40	1,587,084.40	
PERNOD-RICARD	19,514	135.90	2,651,952.60	
REMY COINTREAU	2,382	154.60	368,257.20	
BEIERSDORF AG	9,190	96.64	888,121.60	
HENKEL AG & CO KGAA	10,190	79.65	811,633.50	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	17,429	89.34	1,557,106.86	
LOREAL	23,853	281.50	6,714,619.50	
UNILEVER NV	138,370	51.70	7,153,729.00	
BIOMERIEUX	4,175	132.40	552,770.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	108.90	373,527.00	
DIASORIN SPA	2,070	173.30	358,731.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	19,985	72.40	1,446,914.00	
FRESENIUS SE&CO KGAA	40,897	38.65	1,580,669.05	
KONINKLIJKE PHILIPS	84,867	40.34	3,423,959.11	
ORPEA	4,336	95.82	415,475.52	
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	351.40	1,140,644.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,546	38.21	938,025.39	
ARGENX SE	3,898	222.40	866,915.20	
BAYER	93,379	53.51	4,996,710.29	

EUROFINS SCIENTIFIC	1,158	675.80	782,576.40	
GALAPAGOS NV	4,368	121.95	532,677.60	
GRIFOLS SA	27,685	24.42	676,067.70	
IPSEN	2,722	88.75	241,577.50	
MERCK KGAA	12,078	125.20	1,512,165.60	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	38.19	376,324.26	
QIAGEN N.V.	21,801	44.35	966,874.35	
RECORDATI SPA	11,220	44.63	500,748.60	
SANOFI	106,863	86.18	9,209,453.34	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	296.20	716,507.80	
UCB (GROUPE)	12,531	97.64	1,223,526.84	
ABN AMRO BANK NV-CVA	47,345	6.98	330,468.10	
BANCO BILBAO VIZCAYA	651,448	2.33	1,518,525.28	
BANCO SANTANDER SA	1,595,095	1.59	2,539,710.25	
BANKINTER SA	58,881	3.68	216,682.08	
BNP PARIBAS	104,161	30.99	3,228,470.19	
CAIXABANK	328,697	1.81	597,406.79	
COMMERZBANK AG	107,299	4.10	440,676.99	
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	7.40	795,441.12	
ERSTE GROUP BANK AG	27,560	17.74	489,052.20	
FINECOBANK SPA	53,120	11.67	619,910.40	
ING GROEP NV-CVA	375,036	6.04	2,266,717.58	
INTESA SANPAOLO	1,588,144	1.60	2,551,829.77	
KBC GROEP NV	24,002	42.96	1,031,125.92	
MEDIOBANCA	53,990	6.68	360,977.14	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	12.90	161,121.00	
SOCIETE GENERALE	79,076	11.02	872,050.12	
UNICREDIT SPA	190,988	7.02	1,341,308.72	
AMUNDI SA	6,226	60.30	375,427.80	
DEUTSCHE BANK NAMEN	192,352	7.07	1,360,698.04	
DEUTSCHE BOERSE	18,256	151.20	2,760,307.20	
EURAZEO SA	3,357	45.82	153,817.74	
EXOR NV	10,345	46.74	483,525.30	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,855	76.56	754,498.80	
NATIXIS	114,996	1.87	215,789.99	
SOFINA	1,238	234.50	290,311.00	
WENDEL	2,023	75.20	152,129.60	
AEGON	166,267	2.16	360,134.32	
AGEAS	16,065	34.76	558,419.40	
ALLIANZ SE-REG	39,513	164.88	6,514,903.44	
ASSICURAZIONI GENERALI	98,533	11.93	1,175,991.35	
AXA SA	185,254	15.75	2,918,121.00	

CNP ASSURANCES	21,830	10.40	227,032.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	131.20	759,516.80	
MAPFRE SA	90,939	1.30	118,766.33	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,412	218.10	2,925,157.20	
NN GROUP NV	27,631	31.68	875,350.08	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.57	348,761.16	
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	33.91	1,460,673.25	
SCOR SE	13,354	22.52	300,732.08	
AROUNDTOWN SA	111,346	4.20	467,653.20	
DEUTSCHE WOHNEN SE	30,563	42.41	1,296,176.83	
LEG IMMOBILIEN AG	6,992	121.44	849,108.48	
VONOVIA SE	49,415	58.32	2,881,882.80	
ADYEN NV	1,648	1,602.50	2,640,920.00	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	41,884	47.70	1,997,866.80	
ATOS SE	9,750	69.00	672,750.00	
CAPGEMINI SA	15,649	110.85	1,734,691.65	
DASSAULT SYSTEMES SA	12,515	161.55	2,021,798.25	
EDENRED	22,756	38.52	876,561.12	
NEMETSCHEK SE	4,179	63.30	264,530.70	
NEXI SPA	36,670	16.86	618,256.20	
SAP SE	98,504	134.16	13,215,296.64	
TEAMVIEWER AG	10,974	42.95	471,333.30	
WORLDLINE SA	12,702	72.18	916,830.36	
INGENICO GROUP	5,266	135.75	714,859.50	
NOKIA OYJ	511,885	3.37	1,725,308.39	
ALTICE NV -A	50,000	4.11	205,500.00	
CELLNEX TELECOM SA	28,402	53.48	1,518,938.96	
DEUTSCHE TELEKOM	317,072	14.27	4,526,202.80	
ELISA A	11,943	50.40	601,927.20	
ILIAD SA	1,253	157.60	197,472.80	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.44	286,891.87	
KPN (KON.)	354,332	2.01	713,270.31	
ORANGE	188,105	8.80	1,656,076.42	
PROXIMUS	13,141	15.52	204,014.02	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.34	290,549.72	
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.34	160,555.20	
TELEFONICA	456,457	2.87	1,311,400.96	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	125,107	2.16	270,981.76	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	32.64	310,504.32	
E.ON SE	203,050	9.39	1,906,639.50	
ELECTRICITE DE FRANCE	61,319	8.74	536,418.61	
ELIA GROUP SA/NV	3,630	86.90	315,447.00	

	ENAGAS	25,299	20.04	506,991.96	
	ENDESA	31,750	22.98	729,615.00	
	ENEL	771,969	7.50	5,789,767.50	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275,734	4.14	1,141,814.49	
	ENGIE	171,054	11.28	1,929,489.12	
	FORTUM OYJ	41,901	17.14	718,183.14	
	IBERDROLA SA	563,697	10.53	5,935,729.41	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	30,185	17.22	519,785.70	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	16.19	641,642.08	
	RWE STAMM	62,324	32.00	1,994,368.00	
	SNAM SPA	203,694	4.48	912,752.81	
	SUEZ	28,043	14.92	418,401.56	
	TERNA SPA	130,230	6.03	785,807.82	
	UNIPER SE	20,192	27.50	555,280.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,667	18.32	964,859.44	
	VERBUND AG	7,463	47.02	350,910.26	
	ASML HOLDING NV	40,167	318.25	12,783,147.75	
	INFINEON TECHNOLOGIES	115,347	24.18	2,789,667.19	
	STMICROELECTRONICS	56,957	26.17	1,490,564.69	
ユーロ 小計		17,919,602		351,586,844.64 (43,656,538,498)	
イギリスポンド	BP PLC	1,924,816	2.29	4,413,603.08	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	390,521	9.83	3,841,945.59	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	353,674	9.56	3,382,891.81	
	ANGLO AMERICAN PLC	112,174	18.66	2,093,615.53	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	10.29	368,958.24	
	BHP GROUP PLC	195,828	16.69	3,269,544.28	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,371	62.56	711,369.76	
	EVRAZ PLC	43,000	3.39	146,114.00	
	GLENCORE PLC	901,837	1.62	1,462,418.87	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	23.63	398,118.24	
	MONDI PLC	47,780	16.57	791,714.60	
	RIO TINTO PLC REG	106,507	47.12	5,018,609.84	
	ASHTEAD GROUP PLC	42,021	28.33	1,190,454.93	
	BAE SYSTEMS PLC	313,092	4.88	1,528,202.05	
	BUNZL PLC	33,283	25.02	832,740.66	
	DCC PLC	9,127	60.20	549,445.40	
	FERGUSON PLC	20,559	78.62	1,616,348.58	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	508,486	1.15	586,284.35	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	205,244	1.40	288,162.57	
	SMITHS GROUP PLC	37,146	13.76	511,128.96	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,255	111.45	808,569.75	

EXPERIAN PLC	87,254	29.53	2,576,610.62	
INTERTEK GROUP PLC	15,404	64.08	987,088.32	
RELX PLC	184,573	17.23	3,181,115.65	
RENTOKIL INITIAL PLC	181,066	5.47	991,879.54	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	4.73	457,070.12	
BURBERRY GROUP PLC	40,410	15.91	643,125.15	
PERSIMMON PLC	31,506	24.50	771,897.00	
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.05	374,620.53	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	42.50	450,457.50	
COMPASS GROUP PLC	162,339	12.08	1,961,055.12	
GVC HOLDINGS PLC	59,240	10.14	600,693.60	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	41.02	658,001.82	
WHITBREAD PLC	17,434	20.99	365,939.66	
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	5.60	545,192.24	
INFORMA PLC	128,525	3.72	478,241.52	
PEARSON	66,305	5.51	365,473.16	
WPP PLC	113,065	6.02	681,329.69	
JD SPORTS FASHION PLC	32,000	7.95	254,400.00	
KINGFISHER PLC	218,634	2.95	645,626.20	
NEXT PLC	13,238	58.98	780,777.24	
OCADO GROUP PLC	44,612	28.95	1,291,517.40	
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	1.71	359,273.77	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.92	286,064.04	
TESCO	919,600	2.15	1,977,140.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,908	18.60	574,888.80	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	217,599	27.82	6,053,604.18	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	19.16	344,203.40	
DIAGEO	221,648	26.44	5,861,481.36	
IMPERIAL BRANDS PLC	91,416	13.70	1,252,399.20	
RECKITT BENCKISER PLC	67,469	76.18	5,139,788.42	
UNILEVER PLC	110,922	48.05	5,329,802.10	
SMITH & NEPHEW PLC	83,051	14.93	1,239,951.43	
ASTRAZENECA	123,893	85.39	10,579,223.27	
GLAXOSMITHKLINE	474,876	14.55	6,912,295.05	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	25.77	424,019.58	
BARCLAYS	1,684,065	0.97	1,637,753.21	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,930,170	2.98	5,761,557.45	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,637,108	0.26	1,734,276.32	
NATWEST GROUP PLC	479,086	1.04	501,842.58	
STANDARD CHARTERED PLC	254,760	3.51	895,990.92	
3I GROUP PLC	88,121	9.78	861,999.62	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	15.55	514,543.84	

	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	28,781	88.90	2,558,630.90	
	M&G PLC	229,107	1.57	359,812.54	
	SCHRODERS PLC	11,794	26.96	317,966.24	
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	9.35	418,770.50	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	233,327	2.24	523,119.13	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	25.90	421,004.50	
	AVIVA PIC	381,270	2.86	1,092,719.82	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.69	306,120.78	
	LEGAL & GENERAL GROUP	550,178	1.85	1,018,654.56	
	PRUDENTIAL	249,922	11.36	2,839,113.92	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	4.50	389,767.15	
	AVEVA GROUP PLC	6,717	48.63	326,647.71	
	SAGE GROUP PLC	95,210	7.34	699,031.82	
	HALMA PLC	37,159	23.35	867,662.65	
	BT GROUP PLC	817,227	0.97	799,738.34	
	VODAFONE GROUP PLC	2,475,816	1.03	2,551,575.96	
	NATIONAL GRID PLC	336,389	8.85	2,977,042.65	
	SEVERN TRENT PLC	24,757	24.65	610,260.05	
	SSE PLC	100,354	12.16	1,220,304.64	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,152	8.76	588,385.82	
イギリスポンド 小計		27,034,699		132,000,781.39 (17,963,986,339)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.19	316,556.61	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	813	836.00	679,668.00	
	GIVAUDAN-REG	849	3,961.00	3,362,889.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	47,484	41.79	1,984,356.36	
	SIKA AG-BR	13,625	224.30	3,056,087.50	
	ABB LTD	175,888	23.59	4,149,197.92	
	GEBERIT AG-REG	3,423	542.80	1,858,004.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	252.60	533,491.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	254.80	960,086.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	48.54	641,892.96	
	SGS SA	586	2,474.00	1,449,764.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,067	181.30	918,647.10	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	47,970	61.88	2,968,383.60	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	214.00	531,362.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	41.22	162,324.36	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,044.00	572,320.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	81,200.00	812,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	7,725.00	803,400.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	280,020	109.70	30,718,194.00	
	ALCON INC	44,953	52.70	2,369,023.10	

	SONOVA HOLDING AG-REG	5,138	233.10	1,197,667.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,014	905.40	918,075.60	
	LONZA GROUP AG-REG	6,876	570.40	3,922,070.40	
	NOVARTIS	209,288	80.50	16,847,684.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	66,166	320.20	21,186,353.20	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	126.40	567,030.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,550	93.40	331,570.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	220,884	9.07	2,003,859.64	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,177	38.33	811,714.41	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	850.60	1,559,149.80	
	UBS GROUP AG	338,963	10.12	3,432,000.37	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,805	135.70	652,038.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	346.90	988,318.10	
	SWISS RE LTD	28,565	68.50	1,956,702.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,901	321.40	4,467,781.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	82.60	616,030.80	
	TEMENOS AG - REG	6,511	125.70	818,432.70	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	70.66	1,037,712.76	
	SWISSCOM	2,441	492.20	1,201,460.20	
スイスフラン 小計		1,624,586		123,363,301.09 (14,191,714,157)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	178.90	3,081,015.80	
	BOLIDEN AB	23,903	266.20	6,362,978.60	
	SCA SV CELLULOSA B	51,834	124.75	6,466,291.50	
	ALFA LAVAL AB	27,268	204.10	5,565,398.80	
	ASSA ABLOY AB-B	90,383	211.50	19,116,004.50	
	ATLAS COPCO A	64,653	438.60	28,356,805.80	
	ATLAS COPCO B	36,538	387.20	14,147,513.60	
	EPIROC AB-A	58,039	133.95	7,774,324.05	
	EPIROC AB-B	37,972	128.95	4,896,489.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	11,162	212.60	2,373,041.20	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,906	232.50	6,255,645.00	
	SANDVIK AB	101,932	174.75	17,812,617.00	
	SKANSKA B	28,530	186.85	5,330,830.50	
	SKF AB-B	35,405	185.50	6,567,627.50	
	VOLVO B	143,889	174.15	25,058,269.35	
	SECURITAS B	25,130	137.95	3,466,683.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	210.60	3,826,602.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	96.94	3,752,741.28	
	EVOLUTION GAMING GROUP	11,183	611.80	6,841,759.40	
	HENNES & MAURITZ B	77,319	154.05	11,910,991.95	
	ICA GRUPPEN AB	7,959	464.40	3,696,159.60	

	SWEDISH MATCH AB	16,014	730.60	11,699,828.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,085	305.20	17,422,342.00	
	NORDEA BANK ABP	313,624	67.74	21,244,889.76	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	155,710	79.10	12,316,661.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	150,386	75.04	11,284,965.44	
	SWEDBANK AB-A	86,716	140.64	12,195,738.24	
	EQT AB	20,102	178.45	3,587,201.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,792	238.70	4,008,250.40	
	INVESTOR AB-B SHS	43,921	588.40	25,843,116.40	
	KINNEVIK AB - B	23,604	362.40	8,554,089.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	447.20	3,255,616.00	
	ERICSSON (LM) B	280,901	98.10	27,556,388.10	
	HEXAGON AB-B SHS	26,504	690.40	18,298,361.60	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	126.75	6,339,021.00	
	TELIA CO AB	212,811	36.50	7,767,601.50	
スウェーデンクローナ 小計		2,395,571		384,033,861.67 (4,535,439,906)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	92,158	134.45	12,390,643.10	
	NORSK HYDRO	106,150	25.79	2,737,608.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,470	358.70	6,625,189.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	164.40	3,142,834.80	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	372.80	2,598,788.80	
	MOWI ASA	40,968	158.70	6,501,621.60	
	ORKLA	69,804	94.32	6,583,913.28	
	DNB ASA	85,517	129.00	11,031,693.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	193.10	3,586,639.40	
	TELENOR ASA	71,821	154.00	11,060,434.00	
ノルウェークローネ 小計		529,550		66,259,365.48 (744,092,674)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	704.40	7,288,426.80	
	NOVOZYMES A/S	19,125	406.80	7,780,050.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,951	989.00	17,753,539.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	9,295.00	2,779,205.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	649	10,025.00	6,506,225.00	
	DSV PANALPINA A S	19,921	1,052.00	20,956,892.00	
	PANDORA A/S	8,431	461.00	3,886,691.00	
	CARLSBERG AS-B	9,141	852.20	7,789,960.20	
	AMBU A/S-B	13,555	179.90	2,438,544.50	
	COLOPLAST-B	11,223	1,010.00	11,335,230.00	
	DEMANT A/S	11,604	199.50	2,314,998.00	
	GN STORE NORD A/S	11,117	486.40	5,407,308.80	
	GENMAB A/S	5,888	2,354.00	13,860,352.00	

	H LUNDBECK A/S	4,871	207.60	1,011,219.60	
	NOVO NORDISK A/S-B	162,786	444.30	72,325,819.80	
	DANSKE BANK A/S	70,121	84.50	5,925,224.50	
	TRYG A/S	9,828	199.60	1,961,668.80	
	ORSTED A/S	17,372	887.60	15,419,387.20	
デンマーククローネ 小計		404,229		206,740,742.20 (3,448,435,579)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	24.28	500,872.12	
	OIL SEARCH LTD	144,170	2.79	402,234.30	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.52	748,489.40	
	SANTOS	156,437	5.08	794,699.96	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	24.11	308,921.43	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,829	18.49	1,679,428.21	
	BHP GROUP LTD	279,358	36.89	10,305,516.62	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	13.41	661,488.48	
	EVOLUTION MINING LTD	169,502	5.79	981,416.58	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	154,776	16.16	2,501,180.16	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	43,228	33.26	1,437,763.28	
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	31.78	2,354,834.44	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	64,628	13.93	900,268.04	
	ORICA LTD	44,211	15.98	706,491.78	
	RIO TINTO LTD	35,848	95.82	3,434,955.36	
	SOUTH32 LTD	481,840	2.16	1,040,774.40	
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	19.29	177,853.80	
	BRAMBLES LTD	137,883	10.70	1,475,348.10	
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	4.36	834,900.76	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.22	358,700.00	
	TRANSURBAN GROUP	264,114	14.59	3,853,423.26	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	30.68	1,618,431.36	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	8.91	270,222.48	
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	3.44	626,124.72	
	REA GROUP LTD	5,276	110.87	584,950.12	
	SEEK LTD	26,358	21.47	565,906.26	
	WESFARMERS LTD	109,782	45.66	5,012,646.12	
	COLES GROUP LTD	128,408	17.12	2,198,344.96	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	121,418	37.32	4,531,319.76	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.59	442,386.70	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	9.05	638,368.90	
	COCHLEAR LIMITED	6,220	202.71	1,260,856.20	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	67.87	1,102,751.76	
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	33.81	1,354,969.56	
	CSL LIMITED	42,995	295.54	12,706,742.30	

	AUST AND NZ BANKING GROUP	272,124	17.58	4,783,939.92	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	167,768	65.02	10,908,275.36	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	295,326	18.08	5,339,494.08	
	WESTPAC BANKING	334,568	17.16	5,741,186.88	
	AMP LTD	343,649	1.35	463,926.15	
	ASX LTD	16,798	84.02	1,411,367.96	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	30,997	122.42	3,794,652.74	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	58.04	633,332.48	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	209,355	4.54	950,471.70	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	2.55	688,143.00	
	QBE INSURANCE GROUP	127,160	8.79	1,117,736.40	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	8.77	1,046,734.58	
	AFTERPAY LTD	18,973	81.78	1,551,611.94	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	12.43	551,593.68	
	WISETECH GLOBAL LTD	18,000	26.71	480,780.00	
	TELSTRA CORP	403,126	2.83	1,140,846.58	
	TPG TELECOM LTD	31,475	7.58	238,580.50	
	AGL ENERGY LTD	64,235	14.10	905,713.50	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.91	358,382.67	
オーストラリアドル 小計		6,518,741		110,480,351.80 (8,340,161,757)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	136,010	7.23	983,352.30	
	A2 MILK CO LTD	66,854	15.84	1,058,967.36	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	33.50	1,826,420.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.09	511,706.53	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	198,932	4.63	921,055.16	
	MERCURY NZ LTD	85,000	5.03	427,550.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.86	537,796.56	
ニュージーランドドル 小計		688,177		6,266,847.91 (437,363,315)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,496	46.50	11,927,064.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	134,500	100.00	13,450,000.00	
	MTR CORP	151,000	38.40	5,798,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	217,000	52.30	11,349,100.00	
	SANDS CHINA LTD	242,800	30.00	7,284,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	9.13	1,205,160.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	12.46	1,754,368.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	22.65	3,304,635.00	
	WH GROUP LTD	936,500	6.29	5,890,585.00	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	54,000	30.20	1,630,800.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	14.42	1,574,087.20	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	360,500	20.30	7,318,150.00	

	HANG SENG BANK	74,200	112.90	8,377,180.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	111,400	359.00	39,992,600.00	
	AIA GROUP LTD	1,142,400	76.15	86,993,760.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	229,496	37.65	8,640,524.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	19.50	3,373,500.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	27.85	3,487,599.80	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	19.70	1,270,650.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	155,375	36.85	5,725,568.75	
	PACIFIC CENTURY PREMIUM DEVE	38,556	1.92	74,027.52	
	SINO LAND CO	315,400	9.10	2,870,140.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	97.25	11,524,125.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	37.05	1,500,525.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	19.80	1,904,760.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	143,000	31.30	4,475,900.00	
	PCCW LTD	357,000	4.58	1,635,060.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	36.25	2,446,875.00	
	CLP HOLDINGS	157,000	71.80	11,272,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,030,579	11.10	11,439,426.90	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	40.55	5,575,625.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	79.00	1,872,300.00	
香港ドル 小計		7,481,690		286,939,096.57 (3,916,718,668)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	116,500	4.30	500,950.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	179,500	3.44	617,480.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	199,900	1.00	199,900.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	3.42	370,495.44	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.67	415,125.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	18.15	179,685.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.42	789,412.00	
	DBS GROUP	162,400	19.98	3,244,752.00	
	OCBC BANK	315,600	8.45	2,666,820.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	105,200	19.13	2,012,476.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	9.13	714,879.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	2.67	596,745.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.62	326,136.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.61	313,975.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	19.45	499,865.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.10	1,579,710.30	
シンガポールドル 小計		3,160,975		15,028,405.74 (1,161,695,763)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	12.00	813,072.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	409.50	878,787.00	

	BANK HAPOALIM BM	98,310	18.17	1,786,292.70	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	140,655	15.00	2,109,825.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	9.15	910,425.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	60.46	755,931.38	
	AZRIELI GROUP	4,323	152.10	657,528.30	
	NICE LTD	5,312	777.70	4,131,142.40	
イスラエルシェケル 小計		430,505		12,043,003.78 (369,840,646)	
合　計		100,815,491		400,236,888,126 (400,236,888,126)	

(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	114,413	1,228,795.62	
		LENDLEASE GROUP	55,692	636,002.64	
		SYDNEY AIRPORT	107,308	640,628.76	
	オーストラリアドル 小計		277,413	2,505,427.02 (189,134,685)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,746,360.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,750,000.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,496,360.00 (75,025,314)	
投資信託受益証券合計			872,913	264,159,999 (264,159,999)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	643,939.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,030	1,923,957.90	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	41,737	10,021,888.44	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	892,328.24	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,345	1,968,654.40	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,045,968.12	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	785,822.96	
		CROWN CASTLE INTL CORP	39,312	6,454,244.16	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,091	3,701,424.32	
		DUKE REALTY CORP	35,040	1,295,078.40	
		EQUINIX INC	8,349	6,374,127.54	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,021,170.60	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35,477	1,812,519.93	
		ESSEX PROPERTY TRUST	6,320	1,261,472.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,327	1,321,947.48	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,257	529,688.43	

	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	51,571	1,394,995.55	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	726,517.57	
	INVITATION HOMES INC	51,458	1,440,824.00	
	IRON MOUNTAIN INC	27,546	737,130.96	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	880,133.24	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,915	1,258,936.10	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,505	572,723.50	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	623,733.64	
	PROLOGIS INC	69,633	6,936,143.13	
	PUBLIC STORAGE	14,902	3,292,000.82	
	REALTY INCOME CORP	32,696	1,997,725.60	
	REGENCY CENTERS CORP	17,800	672,306.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,576	3,319,489.12	
	SIMON PROPERTY GROUP	27,990	1,791,080.10	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,271,728.85	
	UDR INC	28,059	906,866.88	
	VENTAS INC	33,353	1,420,170.74	
	VEREIT INC	105,798	683,455.08	
	VICI PROPERTIES INC	44,224	1,034,399.36	
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	520,182.00	
	WELLTOWER INC	38,031	2,072,689.50	
	WP CAREY INC	16,500	1,074,645.00	
アメリカドル 小計		1,206,997	75,682,108.86 (8,007,167,117)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	408,268.78	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,465	159,801.30	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	216,705.10	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	111,437.49	
カナダドル 小計		42,473	896,212.67 (70,827,687)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	285,315.00	
	GECINA SA	4,459	484,693.30	
	ICADE	2,845	131,894.20	
	KLEPIERRE	17,225	188,613.75	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,695	409,069.65	
ユーロ 小計		43,186	1,499,585.90 (186,203,581)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	262,939.75	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	300,010.20	
	SEGRO PLC	106,999	996,374.68	
イギリスポンド 小計		244,963	1,559,324.63 (212,208,488)	
	DEXUS	94,090	844,928.20	

	オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	147,935	2,689,458.30	
		GPT GROUP	167,884	664,820.64	
		MIRVAC GROUP	392,919	868,350.99	
		SCENTRE GROUP	486,663	1,109,591.64	
		STOCKLAND	207,412	790,239.72	
		VICINITY CENTERS	291,115	413,383.30	
	オーストラリアドル 小計		1,788,018	7,380,772.79 (557,174,537)	
	香港ドル	LINK REIT	199,000	12,387,750.00	
	香港ドル 小計		199,000	12,387,750.00 (169,092,787)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	274,000	887,760.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	410,670.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	200,300	398,597.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	433,400.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	215,000	440,750.00	
		SUNTEC REIT	173,000	254,310.00	
	シンガポールドル 小計		1,325,300	2,825,487.00 (218,410,145)	
投資証券合計			4,849,937	9,421,084,342 (9,421,084,342)	
合計				9,685,244,341 (9,685,244,341)	

(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　593銘柄	97.3%	—	—	70.2%
	投資証券　38銘柄	—	—	2.7%	2.0%
カナダドル	株式　81銘柄	99.5%	—	—	3.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	0.5%	0.0%
ユーロ	株式　240銘柄	99.6%	—	—	10.6%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.4%	0.0%
イギリスポンド	株式　83銘柄	98.8%	—	—	4.4%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式　39銘柄	100.0%	—	—	3.5%

スウェーデンクローナ	株式　36銘柄	100.0%	—	—	1.1%
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　18銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　54銘柄	91.8%	—	—	2.0%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.1%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　32銘柄	94.1%	—	—	1.0%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.8%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式　16銘柄	84.2%	—	—	0.3%
	投資証券　6銘柄	—	—	15.8%	0.1%
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。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2020年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	125,092,234
コール・ローン	3,557,730,189
国債証券	280,554,608,424
派生商品評価勘定	17,859,085
未収利息	1,808,024,474
前払費用	88,521,508
差入委託証拠金	525,396,160
流動資産合計	286,677,232,074
資産合計	286,677,232,074
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,587,447
前受金	8,827,570
未払金	9,281,209

	2020年 9月30日現在
項目	金額（円）
未払解約金	82,848,909
未払利息	8,219
流動負債合計	116,553,354
負債合計	116,553,354
純資産の部	
元本等	
元本	95,980,753,365
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	190,579,925,355
元本等合計	286,560,678,720
純資産合計	286,560,678,720
負債純資産合計	286,677,232,074

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 9月30日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

	2020年 9月30日現在
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2020年 9月30日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		95,980,753,365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	2.9856円
	(1万口当たり純資産額)	(29,856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 9月30日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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 9月30日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。

（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 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月 1日
期首元本額	139,801,569,209円
期中追加設定元本額	18,373,623,080円

区分	2020年 9月30日現在
期中一部解約元本額	62,194,438,924円
期末元本額	95,980,753,365円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,555,829,892円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	615,923,072円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,055,377,559円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,998,748円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	6,686,780,080円
世界経済インデックスファンド	7,215,411,142円
ＤＣマイセレクション２５	1,792,355,826円
ＤＣマイセレクション５０	1,440,668,820円
ＤＣマイセレクション７５	882,129,242円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,048,941,421円
ＤＣマイセレクションＳ２５	764,593,151円
ＤＣマイセレクションＳ５０	613,639,727円
ＤＣマイセレクションＳ７５	281,335,157円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	39,896,353円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	70,973,882円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	34,798,377円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,205,470,102円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	683,203,405円
外国債券インデックス　為替ヘッジあり（ＳＭＡ専用）	8,352,960円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,486,344円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,584,618円
外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	38,312,424円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	77,604,821円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	113,830,012円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	123,764,662円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	183,040,621円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,741,817,404円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	506,710,946円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,910,259,089円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	781,134,345円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	67,106,286円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	528,378,048円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	200,591,504円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	253,772,136円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	854,072,067円
グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用）	764,160,071円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	763,704,356円
外国債券ファンド・シリーズ１	591,674,081円

区分	2020年 9月30日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,079,149,805円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,644,409,609円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,090,641,754円
分散投資コア戦略ファンドＳ	4,736,959,371円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	335,964,477円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,106,305,765円
コア投資戦略ファンド（切替型）	852,032,577円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	199,133,803円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	96,761,936円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,083,329,417円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	187,508,818円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	20,978,986,533円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	121,981,858円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	117,993,056円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	208,155,092円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	2,159,885円
グローバル経済コア	785,669,710円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	9,972,183円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	312,604円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	232,161,402円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	21,200,031円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	300,005円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	420,109円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	248,014円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	278,072円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	617,500,176円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	10,329,464,750円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	343,702,505円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	358,452,971円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	128,205,485円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	384,239,079円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,436,654,342
合計	2,436,654,342

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2020年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	3,549,360,966	－	3,558,188,536	8,827,570
合計		3,549,360,966	－	3,558,188,536	8,827,570

(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 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,507,567,332	－	3,501,011,400	△6,555,932
	アメリカドル	1,532,661,611	－	1,532,752,200	90,589
	カナダドル	174,142,084	－	172,263,600	△1,878,484
	ユーロ	1,540,336,437	－	1,534,741,200	△5,595,237
	イギリスポンド	260,427,200	－	261,254,400	827,200
合計		3,507,567,332	－	3,501,011,400	△6,555,932

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,497,949.20	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,180,132.81	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,023,750.00	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	1,000,546.88	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	8,054,687.52	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,310,250.00	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,958,604.70	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,520,507.83	
		T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	7,138,828.12	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	14,098,898.50	
		T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	8,000,809.37	
		T 1.125% 08/15/40	2,300,000.00	2,275,562.50	
		T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,828,054.68	
		T 1.25% 05/15/50	6,850,000.00	6,572,789.05	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,692,720.71	
		T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,122,070.30	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,169,726.55	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,589,648.45	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,147,031.24	
		T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,127,343.75	
		T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,582,441.39	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	7,001,247.68	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,057,460.91	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,136,406.24	
		T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,258,398.40	
		T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,968,312.50	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,942,597.63	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,675,542.98	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,634,257.83	
		T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,871,836.34	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,039,609.38	
		T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,570,507.82	
		T 1.625% 08/15/29	12,750,000.00	13,918,418.03	
		T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,143,652.35	
		T 1.625% 10/31/23	5,000,000.00	5,227,539.05	
		T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,857,765.62	
		T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,534,908.23	

		T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,456,677.32	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,834,009.78	
		T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,557,421.87	
		T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,782,594.73	
		T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,641,367.21	
		T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,899,972.64	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,845,816.00	
		T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,808,148.43	
		T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,198,515.66	
		T 1.75% 06/30/24	7,600,000.00	8,046,796.85	
		T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,561,637.51	
		T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,317,173.84	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,312,890.64	
		T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,164,619.12	
		T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,163,242.17	
		T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,561,816.40	
		T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,643,945.34	
		T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,573,070.31	
		T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,288,105.48	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,652,031.65	
		T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,133,750.00	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,394,453.14	
		T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,752,840.22	
		T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,720,644.56	
		T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,510,425.78	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,440,664.08	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,904,992.20	
		T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,912,804.86	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,609,156.25	
		T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,472,429.66	
		T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,209,414.04	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,155,500.00	
		T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,505,798.84	
		T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,615,937.52	
		T 2.125% 11/30/23	5,680,000.00	6,033,003.13	
		T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,587,226.58	
		T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,558,153.15	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,277,187.52	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	10,006,519.57	
		T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,130,703.12	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,519,804.67	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,608,730.51	

		T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	8,692,755.50	
		T 2.25% 08/15/49	9,500,000.00	11,423,750.00	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,824,917.95	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	11,002,837.91	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,842,921.86	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,619,398.43	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,804,804.71	
		T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,125,484.39	
		T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,261,328.15	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,193,350.02	
		T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,468,953.14	
		T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	12,139,101.56	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	9,240,911.75	
		T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,556,640.62	
		T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	9,259,570.35	
		T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,698,935.55	
		T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,789,726.59	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,493,164.05	
		T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,054,871.08	
		T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,477,013.30	
		T 2.5% 02/15/46	7,500,000.00	9,346,289.10	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,289,519.55	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,564,710.97	
		T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	6,297,507.81	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,857,835.93	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,270,570.69	
		T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,700,007.08	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,484,218.75	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	8,029,658.18	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,234,578.12	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,779,726.58	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,530,903.92	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,261,679.68	
		T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,663,437.52	
		T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,842,578.11	
		T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,149,781.25	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,151,406.25	
		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,073,710.94	
		T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,875,859.39	
		T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,486,046.87	
		T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	8,068,652.32	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,741,746.11	
		T 2.75% 09/15/21	7,000,000.00	7,176,093.75	

		T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,615,098.45	
		T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	5,423,578.14	
		T 2.75% 11/15/47	6,050,000.00	7,937,789.05	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,482,812.52	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,561,695.34	
		T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,779,492.18	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,535,165.62	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,288,696.08	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,149,538.26	
		T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,556,262.50	
		T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,699,851.58	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,137,236.34	
		T 2.875% 10/15/21	7,250,000.00	7,457,446.28	
		T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,709,277.35	
		T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,607,675.82	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,365,154.70	
		T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,564,355.47	
		T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,221,093.75	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,116,310.97	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,720,312.50	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,636,653.53	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,530,968.35	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,874,257.84	
		T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,102,890.64	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,474,035.19	
		T 2% 08/31/21	3,740,000.00	3,804,427.33	
		T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,764,875.96	
		T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,389,453.10	
		T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,450,625.00	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,236,410.98	
		T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,080,859.38	
		T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,251,390.63	
		T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,208,667.98	
		T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,780,507.83	
		T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,597,625.00	
		T 3.125% 08/15/44	2,490,000.00	3,417,914.06	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	10,143,000.00	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,383,281.25	
		T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	6,417,941.42	
		T 3.375% 11/15/48	7,300,000.00	10,728,718.75	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,088,106.25	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,535,500.00	

	T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,939,218.76	
	T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,957,812.50	
	T 3.75% 11/15/43	5,500,000.00	8,236,250.00	
	T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,161,746.10	
	T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,823,312.50	
	T 3% 02/15/48	4,450,000.00	6,106,929.68	
	T 3% 02/15/49	7,000,000.00	9,667,109.41	
	T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,171,179.69	
	T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,727,460.95	
	T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,808,871.12	
	T 3% 08/15/48	5,450,000.00	7,501,414.06	
	T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,772,085.94	
	T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,690,820.30	
	T 3% 11/15/44	4,050,000.00	5,458,957.05	
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,390,078.12	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,675,179.68	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,548,125.00	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	3,002,742.19	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	3,108,726.56	
	T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,982,137.50	
	T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,419,905.47	
	T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,514,875.00	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,706,187.50	
	T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,858,389.07	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,245,878.91	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,793,085.94	
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,735,644.53	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,792,984.37	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,882,343.75	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,666,312.50	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,216,308.59	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	2,032,039.06	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,607,156.25	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,939,910.16	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,850,509.77	
アメリカドル 小計		1,043,090,000.00	1,162,766,404.02 (123,020,685,545)	
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	4,030,000.00	4,047,752.15	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	4,020,683.10	
	CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,714,472.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	4,190,000.00	4,472,426.95	
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,901,855.00	
	CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,231,138.70	

	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,107,246.70	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,449,936.80	
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	628,620.00	
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,754,211.50	
	CAN 1% 06/01/27	500,000.00	520,860.00	
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,537,800.00	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,456,561.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,964,889.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,451,186.10	
	CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,935,766.80	
	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,827,626.50	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,980,000.00	2,794,027.50	
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	893,093.60	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,466,839.75	
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,217,546.70	
	CAN 2% 12/01/51	2,000,000.00	2,486,360.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,140,000.00	3,320,210.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,550,000.00	2,443,660.25	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,692,650.70	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,586,976.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,330,000.00	2,198,503.30	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,778,126.50	
カナダドル 小計		58,840,000.00	67,901,026.60 (5,366,218,132)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,411,471.25	
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	35,279,680.20	
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	26,283,821.30	
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	27,145,558.15	
	MBONO 6.75% 03/09/23	31,500,000.00	33,119,257.50	
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	31,191,482.70	
	MBONO 7.5% 06/03/27	39,490,000.00	43,927,886.20	
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	18,933,293.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	26,237,441.60	
	MBONO 7.75% 11/23/34	15,100,000.00	16,952,619.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	44,533,850.70	
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	26,069,127.00	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	38,312,026.20	
	MBONO 8% 11/07/47	21,480,000.00	23,770,949.40	
	MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,597,488.80	
メキシコペソ 小計		393,750,000.00	436,765,953.50 (2,061,535,300)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,426,471.40	

		BGB 0.2% 10/22/23	1,510,000.00	1,551,343.80	
		BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	721,336.35	
		BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,697,233.50	
		BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,330,125.70	
		BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,842,446.45	
		BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,715,071.80	
		BGB 0.9% 06/22/29	1,550,000.00	1,727,575.75	
		BGB 0% 10/22/27	2,310,000.00	2,390,699.85	
		BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	1,005,409.75	
		BGB 1.45% 06/22/37	530,000.00	655,901.50	
		BGB 1.6% 06/22/47	1,480,000.00	1,964,433.60	
		BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,377,955.00	
		BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,388,945.25	
		BGB 1% 06/22/26	2,380,000.00	2,598,365.00	
		BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,694,182.15	
		BGB 2.15% 06/22/66	940,000.00	1,594,963.80	
		BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	1,999,988.75	
		BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,251,904.50	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,404,279.30	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,300,000.00	2,381,210.00	
		BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,475,598.60	
		BGB 4.25% 03/28/41	2,310,000.00	4,202,871.75	
		BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,464,069.00	
		BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,308,582.50	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,464,415.50	
		BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,305,833.10	
		BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,613,314.80	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,049,487.00	
		BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,693,902.05	
		BKO 0% 03/11/22	6,040,000.00	6,100,460.40	
		BKO 0% 09/10/21	1,470,000.00	1,479,224.25	
		BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,039,997.75	
		BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	585,121.40	
		BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,598,356.70	
		BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,217,425.35	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,307,307.50	
		BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,245,969.10	
		BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,052,850.00	
		BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,648,060.40	
		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,261,443.00	
		BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,053,828.05	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,049,625.50	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	1,053,580.00	

		BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,970,832.50	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,250,000.00	1,294,143.75	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,432,595.00	
		BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,054,426.25	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,532,672.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,556,359.30	
		BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,404,062.80	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,241,634.55	
		BTPS 1.65% 12/01/30	1,820,000.00	1,961,650.60	
		BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,401,520.00	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,130,960.00	
		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,906,482.50	
		BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,208,243.60	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,022,589.90	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,515,536.00	
		BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,573,487.50	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,537,697.00	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,593,037.30	
		BTPS 2.3% 10/15/21	2,000,000.00	2,054,200.00	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,916,375.00	
		BTPS 2.45% 09/01/50	870,000.00	1,015,925.10	
		BTPS 2.45% 10/01/23	2,960,000.00	3,182,621.60	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,285,488.75	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,238,967.25	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	3,069,541.75	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,648,383.00	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,217,206.25	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,566,272.00	
		BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,820,626.50	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,276,072.70	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,813,247.70	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,606,769.75	
		BTPS 3.35% 03/01/35	1,360,000.00	1,751,646.00	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,945,029.80	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,946,574.60	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,455,730.00	
		BTPS 3.85% 09/01/49	2,590,000.00	3,849,374.55	
		BTPS 3% 08/01/29	4,960,000.00	5,938,632.80	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,170,255.00	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,544,963.20	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	4,008,329.10	
		BTPS 4.75% 08/01/23	5,790,000.00	6,583,230.00	

		BTPS 4.75% 09/01/21	1,040,000.00	1,088,464.00	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,782,034.95	
		BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,570,039.00	
		BTPS 4% 02/01/37	4,210,000.00	5,868,782.10	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,263,071.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,975,224.60	
		BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,387,262.50	
		BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,857,669.25	
		BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,760,186.20	
		BTPS 5% 03/01/22	3,250,000.00	3,493,880.00	
		BTPS 5% 03/01/25	4,400,000.00	5,334,494.00	
		BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	5,102,622.90	
		BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	5,123,778.00	
		BTPS 6.5% 11/01/27	5,240,000.00	7,390,391.20	
		BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,962,894.50	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,974,042.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,023,768.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,403,469.60	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,187,837.85	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,340,393.50	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,168,195.00	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,204,495.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,603,737.70	
		DBR 0.5% 08/15/27	4,690,000.00	5,088,040.30	
		DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,768,973.95	
		DBR 0% 05/15/35	810,000.00	852,836.85	
		DBR 0% 08/15/26	4,470,000.00	4,666,814.10	
		DBR 0% 08/15/29	4,640,000.00	4,897,682.40	
		DBR 0% 08/15/30	1,490,000.00	1,572,829.10	
		DBR 0% 08/15/50	1,980,000.00	2,053,913.40	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,270,000.00	4,568,239.05	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,119,914.00	
		DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,309,960.70	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,480,459.30	
		DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,920,918.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,791,933.00	
		DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,181,144.90	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,138,240.00	
		DBR 1% 08/15/25	4,120,000.00	4,477,925.00	
		DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,002,952.25	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,907,074.10	
		DBR 2.5% 08/15/46	4,020,000.00	6,881,094.30	
		DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,414,691.50	

		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,089,271.90	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,580,000.00	4,625,191.80	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	5,087,974.30	
		DBR 4.25% 07/04/39	3,010,000.00	5,688,448.50	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,655,514.25	
		DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,480,091.20	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,765,870.30	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,665,537.80	
		DBR 5.625% 01/04/28	4,360,000.00	6,417,593.00	
		DBR 6.25% 01/04/24	4,450,000.00	5,484,402.50	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,071,368.75	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,471,239.70	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,911,121.80	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,980,000.00	6,297,538.00	
		FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,402,526.00	
		FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,311,920.00	
		FRTR 0.5% 05/25/40	1,210,000.00	1,292,298.15	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,509,356.55	
		FRTR 0.75% 05/25/52	1,820,000.00	2,005,685.50	
		FRTR 0.75% 11/25/28	5,800,000.00	6,362,948.00	
		FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,018,830.00	
		FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,082,400.25	
		FRTR 0% 02/25/26	3,110,000.00	3,205,927.95	
		FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,380,273.85	
		FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,086,195.50	
		FRTR 0% 03/25/25	5,090,000.00	5,235,726.70	
		FRTR 0% 05/25/22	4,050,000.00	4,095,015.75	
		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,427,320.60	
		FRTR 0% 11/25/30	2,160,000.00	2,219,648.40	
		FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	6,061,558.65	
		FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,309,953.05	
		FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,453,648.20	
		FRTR 1.5% 05/25/50	3,690,000.00	4,876,704.00	
		FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,889,727.00	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	2,705,537.70	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,541,613.30	
		FRTR 1.75% 11/25/24	5,810,000.00	6,395,067.00	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,124,718.50	
		FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,940,347.40	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,540,053.00	
		FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,089,192.90	
		FRTR 2.5% 05/25/30	6,200,000.00	7,922,267.00	

		FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,803,677.50	
		FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	5,011,827.30	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,753,239.75	
		FRTR 3.25% 10/25/21	5,650,000.00	5,885,972.25	
		FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,823,962.00	
		FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	8,980,594.65	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,788,787.90	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000.00	9,123,676.80	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,306,029.60	
		FRTR 4% 04/25/55	2,170,000.00	4,685,008.30	
		FRTR 4% 04/25/60	1,960,000.00	4,475,317.00	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,784,891.45	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,842,217.90	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,515,795.00	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,550,959.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,238,225.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	1,040,000.00	1,081,865.20	
		IRISH 0.2% 10/18/30	830,000.00	862,660.50	
		IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	504,732.00	
		IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	836,547.60	
		IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,172,762.80	
		IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	536,367.95	
		IRISH 1.1% 05/15/29	920,000.00	1,031,439.60	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	786,013.85	
		IRISH 1.35% 03/18/31	630,000.00	731,326.05	
		IRISH 1.5% 05/15/50	630,000.00	820,256.85	
		IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	1,034,397.20	
		IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,541,104.70	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,400,000.00	1,759,016.00	
		IRISH 2% 02/18/45	1,170,000.00	1,644,066.45	
		IRISH 3.4% 03/18/24	1,160,000.00	1,322,579.80	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,123,306.85	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,916,023.90	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,400,000.00	2,507,328.00	
		NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,824,082.65	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,250,000.00	1,413,693.75	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,475,463.20	
		NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,303,877.35	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,786,471.20	
		NETHER 0% 01/15/22	1,490,000.00	1,502,292.50	
		NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,891,865.50	
		NETHER 0% 01/15/27	800,000.00	830,264.00	
		NETHER 0% 07/15/30	1,610,000.00	1,678,988.50	

		NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,270,436.20	
		NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	694,765.50	
		NETHER 2.5% 01/15/33	1,510,000.00	2,051,078.30	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,220,000.00	3,914,970.00	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,196,273.45	
		NETHER 3.75% 01/15/23	2,780,000.00	3,065,672.80	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,814,790.40	
		NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,602,297.50	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,510,489.50	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	238,006.00	
		OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,977,618.50	
		OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,678,196.00	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,878,418.75	
		OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,262,579.60	
		OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,221,235.20	
		OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,617,563.00	
		OBL 0% 10/10/25	2,240,000.00	2,323,764.80	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,545,273.60	
		OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,421,968.75	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,266,156.45	
		RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	952,406.80	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,774,766.70	
		RAGB 0.75% 03/20/51	560,000.00	660,640.40	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,140,000.00	2,317,480.90	
		RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,170,906.00	
		RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,528,282.50	
		RAGB 0% 07/15/24	1,740,000.00	1,783,917.60	
		RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	324,291.20	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,660,000.00	1,818,546.60	
		RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,272,881.70	
		RAGB 1.5% 11/02/86	370,000.00	608,855.35	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,084,960.80	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,429,563.80	
		RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,648,090.40	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,402,231.70	
		RAGB 3.15% 06/20/44	960,000.00	1,674,705.60	
		RAGB 3.4% 11/22/22	2,530,000.00	2,753,854.40	
		RAGB 3.5% 09/15/21	1,730,000.00	1,798,438.80	
		RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,238,282.60	
		RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,134,530.65	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	3,115,885.50	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,711,351.25	

		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,736,446.70	
		RFGB 0.125% 04/15/36	410,000.00	426,564.00	
		RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	422,248.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	658,886.40	
		RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,405,761.00	
		RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	723,409.05	
		RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	704,912.00	
		RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	558,635.00	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	742,805.70	
		RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	393,995.55	
		RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	551,029.50	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	431,127.90	
		RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	758,182.40	
		RFGB 1.375% 04/15/47	540,000.00	733,822.20	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	686,510.50	
		RFGB 1.625% 09/15/22	1,130,000.00	1,181,499.75	
		RFGB 2.625% 07/04/42	570,000.00	903,595.35	
		RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	528,108.00	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	800,324.55	
		RFGB 4% 07/04/25	1,050,000.00	1,287,231.75	
		SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,941,512.45	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,346,173.70	
		SPGB 0.35% 07/30/23	3,390,000.00	3,465,885.15	
		SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,424,834.25	
		SPGB 0.45% 10/31/22	2,360,000.00	2,406,669.00	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,995,772.50	
		SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,904,140.90	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,119,990.00	
		SPGB 0% 01/31/25	1,550,000.00	1,571,661.25	
		SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,406,953.50	
		SPGB 1.2% 10/31/40	1,700,000.00	1,831,648.00	
		SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,362,564.00	
		SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,764,864.25	
		SPGB 1.4% 04/30/28	3,320,000.00	3,679,605.80	
		SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,662,967.00	
		SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,196,164.40	
		SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,878,720.00	
		SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,380,757.25	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,319,696.25	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,110,000.00	2,506,764.40	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,155,166.35	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,510,000.00	2,944,330.40	
		SPGB 1% 10/31/50	1,600,000.00	1,588,728.00	

	SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,653,855.40	
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	3,032,932.20	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,631,273.50	
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,060,800.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,170,000.00	3,160,409.70	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,800,000.00	3,160,143.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,902,006.80	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,720,000.00	4,265,925.60	
	SPGB 4.4% 10/31/23	3,490,000.00	4,014,302.70	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,524,596.20	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,632,289.20	
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,820,012.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,350,000.00	4,170,075.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,630,000.00	6,544,574.45	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,575,060.25	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,389,317.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,259,725.10	
	SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,645,405.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,727,214.60	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,569,933.75	
ユーロ 小計		772,130,000.00	936,870,470.05 (116,331,206,266)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/31/23	2,790,000.00	2,801,690.10	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,250,000.00	1,255,350.00	
	UKT 0.375% 10/22/30	1,410,000.00	1,431,502.50	
	UKT 0.5% 07/22/22	3,540,000.00	3,575,718.60	
	UKT 0.5% 10/22/61	340,000.00	322,413.50	
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,513,764.00	
	UKT 0.625% 10/22/50	1,800,000.00	1,755,072.00	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,980,203.75	
	UKT 0.875% 10/22/29	2,760,000.00	2,942,905.20	
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,245,106.80	
	UKT 1.25% 10/22/41	1,500,000.00	1,665,907.50	
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,182,520.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,980,000.00	3,553,977.80	
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,478,047.00	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,100,000.00	1,410,398.00	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,150,000.00	1,689,769.75	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,647,574.50	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,180,000.00	2,943,534.10	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,229,309.20	
	UKT 1.75% 09/07/37	3,100,000.00	3,685,512.50	

	UKT 1% 04/22/24	3,100,000.00	3,222,915.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,672,375.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	2,130,000.00	3,661,917.30	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,802,549.70	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,966,321.50	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,910,000.00	4,505,742.15	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,800,000.00	4,547,676.00	
	UKT 3.5% 07/22/68	2,140,000.00	4,664,611.50	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,850,000.00	3,469,813.75	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,000,000.00	2,071,030.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,490,000.00	3,881,038.50	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,100,000.00	4,505,121.50	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,109,388.40	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,787,987.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,270,000.00	3,822,759.45	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	4,027,375.60	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,890,000.00	3,659,814.90	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,310,000.00	4,888,191.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,750,146.35	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,460,000.00	4,403,154.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,900,000.00	4,236,581.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,277,300.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,700,000.00	3,670,682.50	
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,063,470.50	
	UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,430,766.80	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,852,825.00	
イギリスポンド 小計		100,050,000.00	135,261,831.70 (18,407,782,676)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,570,000.00	3,633,010.50	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,600,918.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	6,700,000.00	7,232,348.50	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,235,562.50	
	SGB 1% 11/12/26	9,920,000.00	10,700,158.40	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,170,000.00	10,388,647.15	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,900,000.00	9,294,270.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	12,850,000.00	13,683,965.00	
スウェーデンクローナ 小計		66,760,000.00	74,768,880.05 (883,020,473)	
ノルウェークローネ	NGB 1.375% 08/19/30	4,130,000.00	4,440,121.70	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,222,570.60	
	NGB 1.75% 02/17/27	3,250,000.00	3,527,728.75	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,190,000.00	5,529,348.15	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,500,000.00	8,292,075.00	

	NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,458,649.00	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,807,686.40	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	8,073,883.20	
ノルウェークローネ 小計		48,500,000.00	52,352,062.80 (587,913,665)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	4,120,000.00	4,196,034.60	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,529,063.10	
	DGB 0.5% 11/15/29	12,460,000.00	13,566,261.10	
	DGB 1.5% 11/15/23	8,130,000.00	8,677,880.70	
	DGB 1.75% 11/15/25	8,030,000.00	9,012,751.55	
	DGB 3% 11/15/21	10,860,000.00	11,296,083.30	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,880,000.00	32,300,639.60	
デンマーククローネ 小計		71,210,000.00	90,578,713.95 (1,510,852,948)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	960,000.00	969,264.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	210,000.00	209,094.90	
	POLGB 2.25% 04/25/22	5,470,000.00	5,660,820.95	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,220,996.85	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,193,521.90	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,760,000.00	4,057,961.20	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,644,002.20	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,520,032.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,744,615.30	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,364,242.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,730,000.00	7,581,513.25	
	POLGB 4% 10/25/23	3,730,000.00	4,162,791.90	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	826,644.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,504,705.75	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,609,049.00	
ポーランドズロチ 小計		59,610,000.00	65,269,255.40 (1,788,377,597)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	4,370,000.00	4,369,781.50	
	ACGB 0.25% 11/21/25	3,590,000.00	3,570,506.30	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	2,010,810.00	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,850,000.00	3,036,347.25	
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,160,000.00	2,180,401.20	
	ACGB 1% 12/21/30	3,720,000.00	3,779,985.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	4,160,000.00	4,664,732.80	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,300,335.60	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,392,894.25	
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,581,066.00	
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	977,236.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,503,096.90	

	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,838,890.60	
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,960,000.00	4,611,598.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,468,795.25	
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,974,476.85	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,946,250.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,963,644.50	
	ACGB 3.25% 06/21/39	830,000.00	1,081,203.65	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,225,021.40	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,173,214.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,484,122.50	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,713,813.95	
	ACGB 4.75% 04/21/27	4,150,000.00	5,289,133.50	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,690,000.00	5,327,840.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,684,413.75	
オーストラリアドル 小計		79,350,000.00	90,149,611.75 (6,805,394,191)	
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	1,440,000.00	1,454,961.60	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	828,324.00	
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	296,854.15	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	805,342.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	730,000.00	844,741.40	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	533,908.90	
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	308,782.50	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,196,464.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,640,805.20	
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	778,610.10	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,143,177.30	
	SIGB 2.875% 07/01/29	570,000.00	669,636.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	905,604.60	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	432,927.20	
	SIGB 3.125% 09/01/22	640,000.00	675,648.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,100,000.00	1,416,954.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,038,171.20	
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,345,330.60	
シンガポールドル 小計		14,300,000.00	16,316,243.25 (1,261,245,603)	
マレーシアリンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,543,215.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	732,056.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,412,493.65	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,609,063.55	
	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,266,598.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,085,307.10	

		MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,137,474.95	
		MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	578,374.50	
		MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,557,855.00	
		MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,741,215.50	
		MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,526,684.75	
		MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	772,361.25	
		MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,099,844.30	
		MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	798,448.45	
		MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,224,179.85	
		MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,146,177.10	
		MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,562,054.40	
		MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	649,464.00	
		MGS 3.955% 09/15/25	1,630,000.00	1,754,173.40	
		MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,096,904.00	
		MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,031,869.50	
		MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	780,987.40	
		MGS 4.127% 04/15/32	430,000.00	474,631.85	
		MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,370,419.20	
		MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,255,600.00	
		MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	904,919.85	
		MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,692,479.00	
		MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,715,437.20	
		MGS 4.642% 11/07/33	1,980,000.00	2,295,849.60	
		MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,686,608.00	
		MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,671,453.20	
		MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	947,936.00	
		MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,225,896.00	
		MGS 4.935% 09/30/43	2,290,000.00	2,638,870.05	
		MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,751,624.40	
マレーシアリンギット 小計			51,050,000.00	55,738,526.50 (1,418,545,499)	
イスラエル シェケル		ILGOV 0.5% 04/30/25	630,000.00	636,082.07	
		ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,833,002.05	
		ILGOV 1.5% 05/31/37	1,100,000.00	1,131,994.93	
		ILGOV 1.75% 08/31/25	930,000.00	998,784.28	
		ILGOV 1% 03/31/30	1,770,000.00	1,819,358.73	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	1,610,000.00	1,822,198.00	
		ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,582,038.28	
		ILGOV 3.75% 03/31/47	2,420,000.00	3,471,728.61	
		ILGOV 5.5% 01/31/22	2,110,000.00	2,263,678.89	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,509,668.68	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	6,020,000.00	8,135,650.74	

	イスラエルシェケル 小計	30,000,000.00	36,204,185.26 (1,111,830,529)	
合計			280,554,608,424 (280,554,608,424)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　199銘柄	100.0%	43.8%
カナダドル	国債証券　28銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券　15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券　319銘柄	100.0%	41.5%
イギリスポンド	国債証券　46銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券　7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券　15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券　26銘柄	100.0%	2.4%
シンガポールドル	国債証券　18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　35銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　11銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

２【ファンドの現況】

【ＤＣマイセレクション７５】

【純資産額計算書】

（2020年10月30日現在）

Ⅰ　資産総額	54,308,430,378円
Ⅱ　負債総額	44,606,313円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	54,263,824,065円
Ⅳ　発行済口数	23,973,567,117口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2635円
（1万口当たり純資産額）	（22,635円）

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年10月30日現在）

Ⅰ　資産総額	339,593,622,913円
Ⅱ　負債総額	1,088,571,179円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	338,505,051,734円
Ⅳ　発行済口数	224,781,697,920口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5059円
（1万口当たり純資産額）	（15,059円）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年10月30日現在）

Ⅰ　資産総額	598,969,301,770円
Ⅱ　負債総額	3,659,053,503円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	595,310,248,267円
Ⅳ　発行済口数	422,738,656,817口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4082円
（1万口当たり純資産額）	（14,082円）

外国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年10月30日現在）

Ⅰ　資産総額	417,138,489,216円
Ⅱ　負債総額	1,916,762,114円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	415,221,727,102円
Ⅳ　発行済口数	151,640,101,751口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7382円
（1万口当たり純資産額）	（27,382円）

外国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2020年10月30日現在）

Ⅰ　資産総額	275,811,099,694円
Ⅱ　負債総額	133,457,269円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	275,677,642,425円
Ⅳ　発行済口数	93,686,738,501口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9425円
（1万口当たり純資産額）	（29,425円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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10月30日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：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

①会社の意思決定機構

会社に取締役（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、監査等委員以外の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発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2020年12月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年10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	525	13,242,450
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	81	298,985
単位型公社債投資信託	39	270,690
合計	645	13,812,125

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おりましたが、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）
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	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
評価・換算差額等		
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

（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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
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 （2019年3月31日）		当事業年度 （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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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 その他有価証券」には含めておりません。

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（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．その他有価証券

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	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	売建				
	米ドル		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	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		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

① 運用受託報酬

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

② 投信販売代行手数料等

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

③ 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。

④ 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

① 運用受託報酬

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

② 投信販売代行手数料等

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

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

前事業年度（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。

(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12月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

③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。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
第一生命保険株式会社	60,000	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2020年7月27日現在）
④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。
⑤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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年12月27日	有価証券届出書
2019年12月27日	有価証券報告書
2020年 6月30日	有価証券届出書
2020年 6月30日	半期報告書

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．ＸＢＲＬ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11月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　松崎雅則　　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、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCマイセレクション75の2019年10月1日から2020年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCマイセレクション75の2020年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以　上

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