

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年11月22日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCバランスファンド30 DCバランスファンド50 DCバランスファンド70
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	DCバランスファンド30 10兆円を上限とします。 DCバランスファンド50 10兆円を上限とします。 DCバランスファンド70 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DCバランスファンド30

DCバランスファンド50

DCバランスファンド70

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

2021年11月23日から2022年 5月20日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

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

国内外の株式・公社債へ分散投資します。

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



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

<投資対象とするマザーファンド>

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

ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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

日本株式マザーファンド

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

日本債券マザーファンド

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

外国株式マザーファンド

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

外国債券マザーファンド

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

2022年4月4日に東京証券取引所(以下「東証」といいます。)は、「市場第一部・市場第二部・マザーズ・JASDAQ(スタンダード・グロース)」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロース市場」の3つの市場区分に見直すこととしております。これに伴い東証の市場区分に関する記載内容を変更する予定です。詳細は日本取引所グループのホームページをご確認ください。

●複合指数について

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

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、取得時において以下の通りとします。

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

- 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下の通りとします。

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

◆各マザーファンドが対象とする指数は次の通りです。

日本株式マザーファンド【TOPIX(東証株価指数、配当込み)】

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

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

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

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

日本債券マザーファンド【NOMURA-BPI総合】

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2)【ファンドの沿革】

2006年9月29日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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

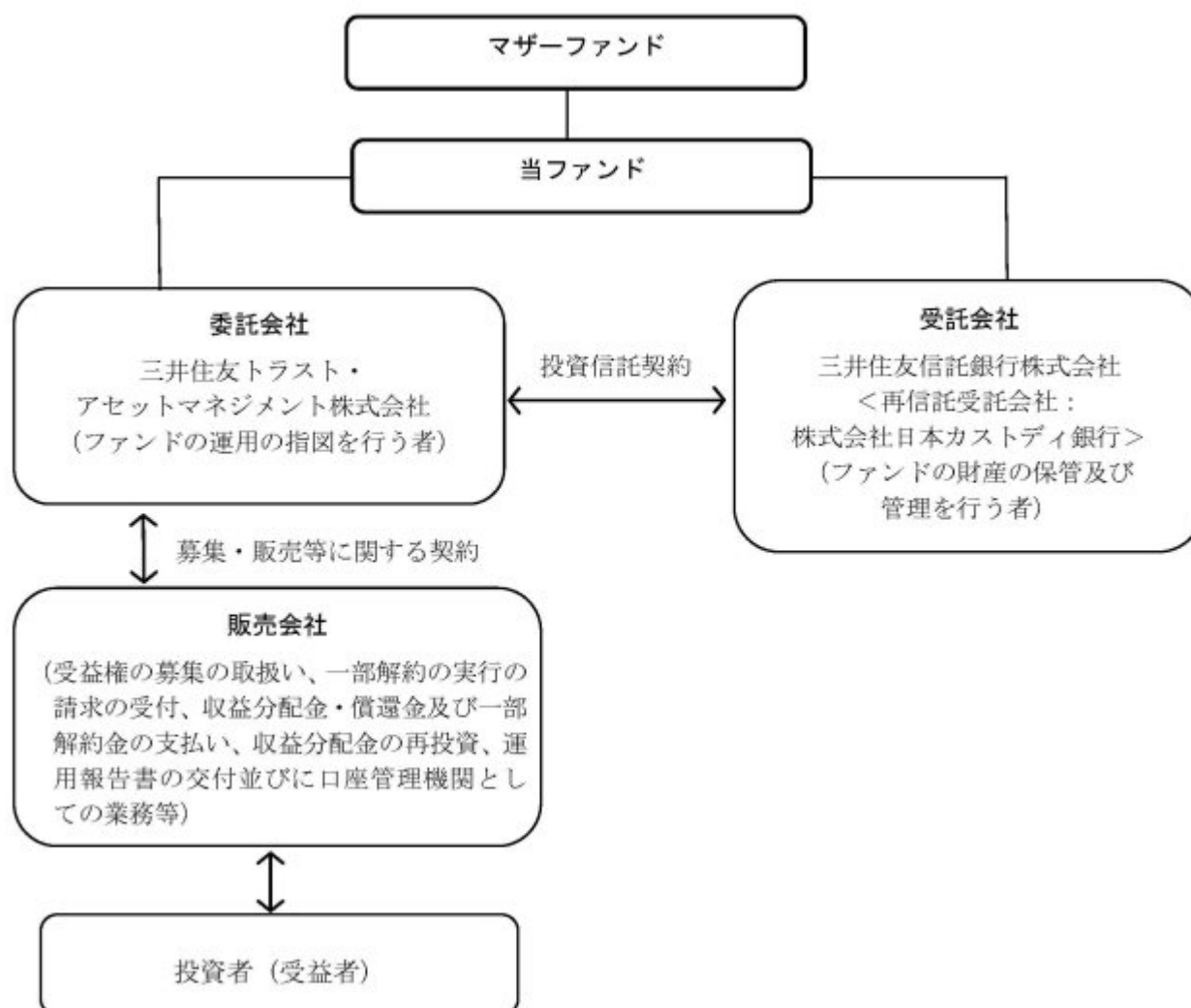
ファンドの名称を中央三井DCバランスファンド30からDCバランスファンド30、中央三井DCバランスファンド50からDCバランスファンド50、中央三井DCバランスファンド70からDCバランスファンド70に変更

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

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

（３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年 9月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

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

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

めるものをいいます。以下同じ。)

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

B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

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

益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

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

（2）投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「日本債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「外国債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

A．株式への投資割合

委託会社は、株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

DCバランスファンド30.....信託財産の純資産総額の40%以下

DCバランスファンド50.....信託財産の純資産総額の60%以下

DCバランスファンド70.....信託財産の純資産総額の80%以下

B．外貨建資産の投資割合

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

DCバランスファンド30.....信託財産の純資産総額の30%以下

DCバランスファンド50.....信託財産の純資産総額の40%以下

DCバランスファンド70.....信託財産の純資産総額の45%以下

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資制限

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資制限

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の指図範囲

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

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

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

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

Ｊ．先物取引等の運用指図

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

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

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

Ｋ．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

Ｌ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

Ｍ．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

a．及びb．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

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

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

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

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

T. 資金の借入れ

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

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

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

ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U. 受託会社による資金の立替え

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

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

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

V. 受託会社の自己又は利害関係人等との取引

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

（２）リスクの管理体制

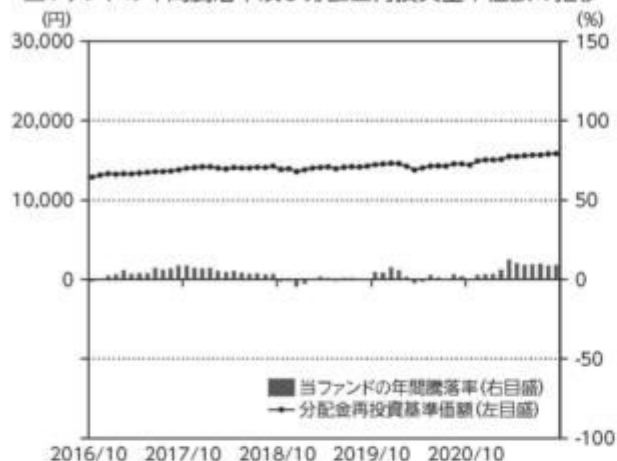
委託会社におけるリスク管理体制

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

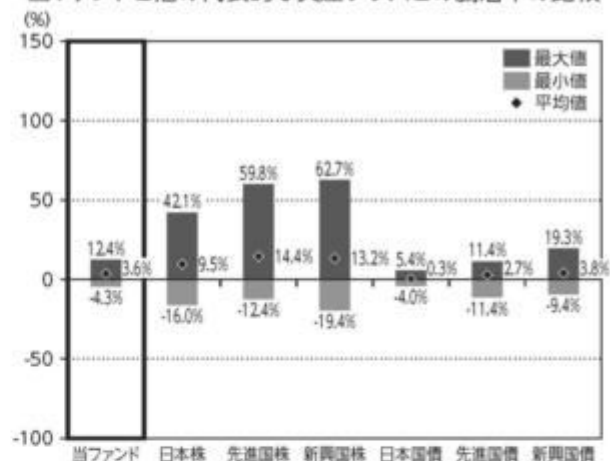
【参考情報】

DCバランスファンド30

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

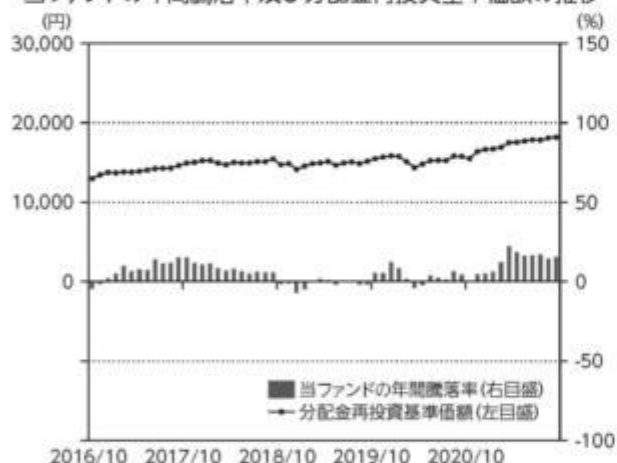


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

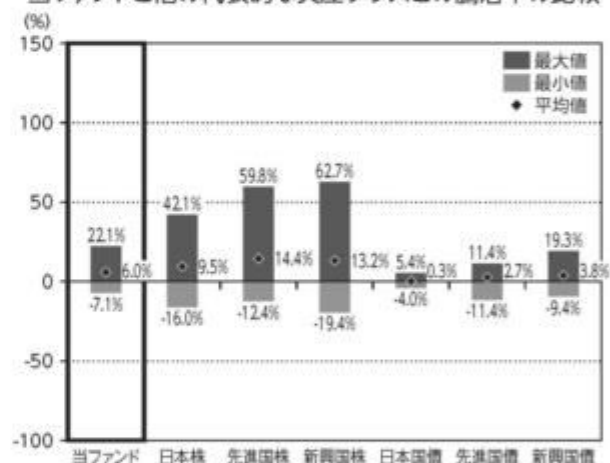


DCバランスファンド50

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

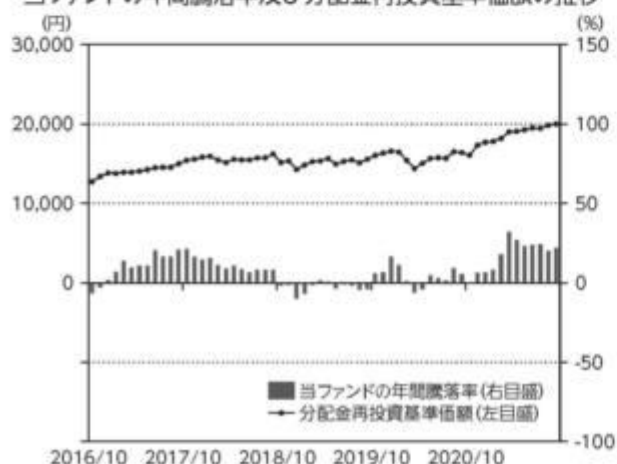


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

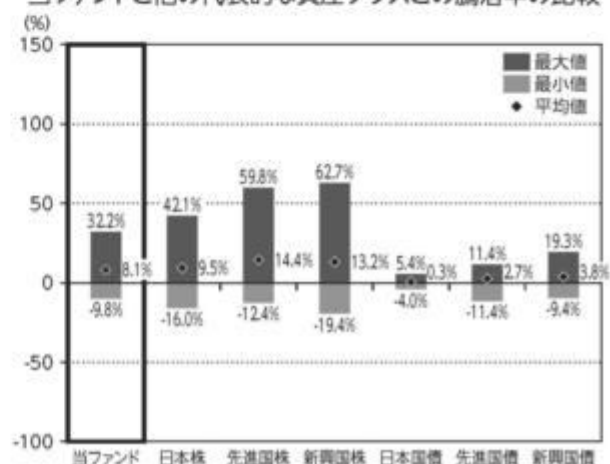


DCバランスファンド70

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



【参考情報】

- *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。

- *2016年10月～2021年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI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いません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・グローバル・デバインデックス・エマージング・ マーケット・グローバル・デバインデックス(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

DCバランスファンド30：年率 0.231%（税抜 0.21%）（ ）

DCバランスファンド50：年率 0.242%（税抜 0.22%）

DCバランスファンド70：年率 0.253%（税抜 0.23%）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2021年 9月30日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2021年9月30日現在の状況について記載してあります。

【DCバランスファンド30】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	24,812,152,391	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		95,637,260	0.38
合計(純資産総額)		24,907,789,651	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	10,685,497,917	1.3681	14,619,561,652	1.3777	14,721,410,480	59.10

日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,239,862,855	2.1470	4,808,985,550	2.2922	5,134,213,636	20.61
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	632,615,779	3.5914	2,271,976,309	4.1705	2,638,324,106	10.59
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	875,322,523	2.5719	2,251,241,997	2.6484	2,318,204,169	9.31

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.62
合計	99.62

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第6期計算期間末	(2012年 2月21日)	1,662,222,385	1,662,222,385	9,432	9,432
第7期計算期間末	(2013年 2月21日)	2,268,392,887	2,268,392,887	10,435	10,435
第8期計算期間末	(2014年 2月21日)	4,826,567,334	4,826,567,334	11,618	11,618
第9期計算期間末	(2015年 2月23日)	9,609,384,153	9,609,384,153	12,811	12,811
第10期計算期間末	(2016年 2月22日)	12,153,839,606	12,153,839,606	12,527	12,527
第11期計算期間末	(2017年 2月21日)	14,214,751,693	14,214,751,693	13,306	13,306
第12期計算期間末	(2018年 2月21日)	16,338,867,196	16,338,867,196	13,983	13,983
第13期計算期間末	(2019年 2月21日)	18,205,085,029	18,205,085,029	14,025	14,025
第14期計算期間末	(2020年 2月21日)	20,310,903,852	20,310,903,852	14,687	14,687
第15期計算期間末	(2021年 2月22日)	22,717,128,952	22,717,128,952	15,283	15,283
	2020年 9月末日	21,344,208,203		14,557	
	10月末日	21,198,933,921		14,397	
	11月末日	21,870,922,094		14,899	
	12月末日	22,215,528,844		15,039	

2021年 1月末日	22,452,591,914		15,052
2月末日	22,458,187,132		15,108
3月末日	23,294,277,489		15,482
4月末日	23,401,028,177		15,483
5月末日	23,850,276,603		15,572
6月末日	24,342,277,342		15,651
7月末日	24,398,497,330		15,659
8月末日	24,675,660,729		15,789
9月末日	24,907,789,651		15,843

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	0
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	0
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	1.2
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	10.6
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	11.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	10.3
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2.2
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	6.2
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	5.1
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.3
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	4.7
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	4.1
第16期中間計算期間	2021年 2月23日～2021年 8月22日	2.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	544,218,204	82,011,582	1,762,332,605
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	548,368,354	136,959,287	2,173,741,672
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	2,244,075,796	263,589,279	4,154,228,189
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	3,774,064,767	427,446,160	7,500,846,796
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2,707,951,316	506,368,389	9,702,429,723
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	1,522,635,571	541,752,943	10,683,312,351
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	1,622,030,510	620,753,783	11,684,589,078
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	1,853,591,536	558,077,052	12,980,103,562
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	1,679,276,139	830,050,924	13,829,328,777
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	2,046,783,461	1,012,273,788	14,863,838,450
第16期中間計算期間	2021年 2月23日～2021年 8月22日	1,123,953,368	470,318,275	15,517,473,543

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

【DCバランスファンド50】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	26,032,635,295	99.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		92,270,492	0.35
合計(純資産総額)		26,124,905,787	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	7,457,544,281	1.3684	10,205,054,601	1.3777	10,274,258,755	39.33
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,498,032,131	2.1470	7,510,274,986	2.2922	8,018,189,250	30.69
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,285,961,048	3.5821	4,606,513,165	4.1705	5,363,100,550	20.53
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	897,555,785	2.5712	2,307,802,430	2.6484	2,377,086,740	9.10

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□ 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.65
合計	99.65

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第6期計算期間末	(2012年 2月21日)	2,507,016,786	2,507,016,786	8,507	8,507
第7期計算期間末	(2013年 2月21日)	3,400,936,257	3,400,936,257	9,831	9,831
第8期計算期間末	(2014年 2月21日)	4,833,869,383	4,833,869,383	11,529	11,529
第9期計算期間末	(2015年 2月23日)	10,264,606,984	10,264,606,984	13,252	13,252
第10期計算期間末	(2016年 2月22日)	12,016,092,940	12,016,092,940	12,499	12,499
第11期計算期間末	(2017年 2月21日)	14,533,410,562	14,533,410,562	13,835	13,835
第12期計算期間末	(2018年 2月21日)	16,857,871,211	16,857,871,211	14,889	14,889
第13期計算期間末	(2019年 2月21日)	18,131,125,571	18,131,125,571	14,866	14,866
第14期計算期間末	(2020年 2月21日)	20,696,734,917	20,696,734,917	15,946	15,946
第15期計算期間末	(2021年 2月22日)	23,693,213,025	23,693,213,025	17,177	17,177
	2020年 9月末日	21,447,739,436		15,758	
	10月末日	21,207,227,664		15,499	
	11月末日	22,304,793,590		16,392	
	12月末日	22,769,163,537		16,644	
	2021年 1月末日	23,098,618,157		16,706	
	2月末日	23,310,606,447		16,905	
	3月末日	24,420,479,829		17,511	
	4月末日	24,553,343,263		17,542	

5月末日	24,968,897,409		17,690	
6月末日	25,294,972,651		17,845	
7月末日	25,363,721,146		17,825	
8月末日	25,826,704,306		18,075	
9月末日	26,124,905,787		18,183	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	0
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	0
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	3.6
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	15.6
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	17.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	14.9
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	5.7
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	10.7
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	7.6
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.2
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	7.3
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	7.7
第16期中間計算期間	2021年 2月23日～2021年 8月22日	3.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	858,899,500	150,985,019	2,947,079,082
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	737,283,783	225,124,733	3,459,238,132
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	1,127,761,819	394,119,618	4,192,880,333
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	3,890,146,207	337,276,922	7,745,749,618
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2,389,338,964	521,486,140	9,613,602,442
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	1,427,316,438	535,903,642	10,505,015,238
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	1,604,824,267	787,711,888	11,322,127,617
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	1,487,203,756	613,284,585	12,196,046,788
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	1,542,536,422	759,460,983	12,979,122,227
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	1,929,479,800	1,115,407,432	13,793,194,595
第16期中間計算期間	2021年 2月23日～2021年 8月22日	861,587,153	449,461,424	14,205,320,324

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

【DCバランスファンド70】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	11,347,461,629	99.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		41,393,470	0.36
合計(純資産総額)		11,388,855,099	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,022,377,677	2.1467	4,341,573,884	2.2922	4,635,694,111	40.70
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	812,292,256	3.5903	2,916,401,024	4.1705	3,387,664,853	29.75
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	2,016,324,687	1.3684	2,759,223,727	1.3777	2,777,890,521	24.39
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	206,242,314	2.5796	532,039,288	2.6484	546,212,144	4.80

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.64
合計	99.64

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第6期計算期間末 (2012年 2月21日)	1,010,509,539	1,010,509,539	7,652	7,652
第7期計算期間末 (2013年 2月21日)	1,396,043,467	1,396,043,467	9,146	9,146
第8期計算期間末 (2014年 2月21日)	2,259,670,200	2,259,670,200	11,186	11,186
第9期計算期間末 (2015年 2月23日)	4,376,661,860	4,376,661,860	13,325	13,325
第10期計算期間末 (2016年 2月22日)	4,382,407,791	4,382,407,791	12,156	12,156
第11期計算期間末 (2017年 2月21日)	5,465,018,584	5,465,018,584	14,000	14,000
第12期計算期間末 (2018年 2月21日)	6,554,623,946	6,554,623,946	15,405	15,405
第13期計算期間末 (2019年 2月21日)	7,105,425,421	7,105,425,421	15,276	15,276
第14期計算期間末 (2020年 2月21日)	8,349,294,464	8,349,294,464	16,706	16,706
第15期計算期間末 (2021年 2月22日)	10,072,849,421	10,072,849,421	18,545	18,545
2020年 9月末日	8,747,153,976		16,405	
10月末日	8,628,258,620		16,061	
11月末日	9,237,903,426		17,332	
12月末日	9,524,259,766		17,695	
2021年 1月末日	9,692,238,060		17,808	
2月末日	9,881,360,431		18,172	
3月末日	10,449,226,191		19,008	
4月末日	10,554,324,393		19,074	
5月末日	10,715,746,482		19,268	
6月末日	10,941,406,215		19,502	
7月末日	10,987,670,853		19,442	
8月末日	11,266,132,500		19,823	

9月末日	11,388,855,099		19,999	
------	----------------	--	--------	--

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	0
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	0
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	6.3
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	19.5
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	22.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	19.1
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	8.8
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	15.2
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	10.0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.8
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	9.4
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	11.0
第16期中間計算期間	2021年 2月23日～2021年 8月22日	4.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第6期計算期間	2011年 2月22日～2012年 2月21日	324,628,476	90,057,030	1,320,604,352
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	336,941,132	131,115,473	1,526,430,011
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	749,827,425	256,234,473	2,020,022,963

第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	1,564,258,884	299,743,427	3,284,538,420
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	721,489,462	400,760,508	3,605,267,374
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	578,597,748	280,214,854	3,903,650,268
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	820,305,427	469,118,909	4,254,836,786
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	752,735,309	356,104,678	4,651,467,417
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	795,085,220	448,783,440	4,997,769,197
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	1,035,869,348	602,091,038	5,431,547,507
第16期中間計算期間	2021年 2月23日～2021年 8月22日	494,968,600	274,828,325	5,651,687,782

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

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	300,883,217,330	98.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,904,846,515	1.60
合計(純資産総額)		305,788,063,845	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,791,980,000	1.57

(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	5,475,500	1,540.39	8,434,449,249	2,000.00	10,951,000,000	3.58

日本	株式	ソニーグループ	電気機器	677,200	10,486.83	7,101,681,276	12,455.00	8,434,526,000	2.76
日本	株式	キーエンス	電気機器	106,100	57,596.84	6,111,024,724	67,000.00	7,108,700,000	2.32
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	841,700	8,767.49	7,379,596,333	6,480.00	5,454,216,000	1.78
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	740,000	4,691.58	3,471,769,200	6,832.00	5,055,680,000	1.65
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,293,300	485.64	3,541,918,212	657.90	4,798,262,070	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,240,700	2,703.69	3,354,468,183	3,085.00	3,827,559,500	1.25
日本	株式	信越化学工業	化学	195,800	19,256.65	3,770,452,070	18,900.00	3,700,620,000	1.21
日本	株式	HOYA	精密機器	210,900	13,649.61	2,878,702,749	17,475.00	3,685,477,500	1.21
日本	株式	日立製作所	電気機器	519,700	4,399.13	2,286,227,861	6,640.00	3,450,808,000	1.13
日本	株式	ダイキン工業	機械	137,700	23,108.08	3,181,982,616	24,460.00	3,368,142,000	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	61,900	63,901.49	3,955,502,231	54,310.00	3,361,789,000	1.10
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	899,400	3,591.36	3,230,069,184	3,699.00	3,326,880,600	1.09
日本	株式	日本電産	電気機器	260,200	14,166.54	3,686,133,708	12,420.00	3,231,684,000	1.06
日本	株式	村田製作所	電気機器	317,600	10,450.34	3,319,027,984	9,960.00	3,163,296,000	1.03
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	63,300	43,604.39	2,760,157,887	49,670.00	3,144,111,000	1.03
日本	株式	KDDI	情報・通信業	850,700	3,245.17	2,760,666,119	3,691.00	3,139,933,700	1.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	851,100	2,864.70	2,438,146,170	3,455.00	2,940,550,500	0.96
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	737,800	3,350.06	2,471,674,268	3,944.00	2,909,883,200	0.95
日本	株式	第一三共	医薬品	849,500	3,552.69	3,018,010,155	2,979.50	2,531,085,250	0.83
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	744,700	3,144.80	2,341,932,560	3,277.00	2,440,381,900	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	94,900	27,039.93	2,566,089,357	24,565.00	2,331,218,500	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,448,800	1,411.86	2,045,502,768	1,584.50	2,295,623,600	0.75
日本	株式	三菱商事	卸売業	648,200	2,692.20	1,745,084,040	3,536.00	2,292,035,200	0.75
日本	株式	S M C	機械	31,700	68,192.40	2,161,699,080	70,080.00	2,221,536,000	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	416,500	3,974.79	1,655,500,035	5,085.00	2,117,902,500	0.69
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	351,100	5,417.81	1,902,193,091	6,021.00	2,113,973,100	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	826,800	2,068.78	1,710,467,304	2,464.00	2,037,235,200	0.67
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	109,900	15,999.83	1,758,381,317	18,130.00	1,992,487,000	0.65
日本	株式	富士通	電気機器	97,300	17,005.48	1,654,633,204	20,310.00	1,976,163,000	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.20
		建設業	2.28
		食料品	3.38
		繊維製品	0.47

パルプ・紙	0.22
化学	6.94
医薬品	5.07
石油・石炭製品	0.40
ゴム製品	0.71
ガラス・土石製品	0.76
鉄鋼	0.80
非鉄金属	0.66
金属製品	0.59
機械	5.29
電気機器	18.30
輸送用機器	7.58
精密機器	2.92
その他製品	2.17
電気・ガス業	1.12
陸運業	3.24
海運業	0.47
空運業	0.48
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	8.30
卸売業	4.69
小売業	4.43
銀行業	4.93
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	1.99
その他金融業	1.12
不動産業	1.97
サービス業	5.93
小計	98.40
合計	98.40

(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	236円		4,874,026,800	4,791,980,000	1.57

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

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

日本債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	323,770,752,600	83.87
地方債証券	日本	20,954,089,652	5.43
特殊債証券	日本	23,606,213,182	6.11
社債券	日本	16,230,000,000	4.20
	フランス	500,588,000	0.13
	オーストラリア	200,214,000	0.05
	スペイン	100,210,000	0.03
	小計	17,031,012,000	4.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		690,630,700	0.18
合計(純資産総額)		386,052,698,134	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145回利付国債(5年)	5,280,000,000	101.05	5,335,440,000	100.81	5,323,137,600	0.100	2025/9/20	1.38
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	4,460,000,000	100.84	4,497,464,000	100.64	4,488,544,000	0.100	2024/9/20	1.16
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	4,035,000,000	100.96	4,074,055,000	100.90	4,071,315,000	0.100	2026/6/20	1.05
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	3,790,000,000	101.19	3,835,101,000	100.92	3,824,981,700	0.100	2026/9/20	0.99
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	3,800,000,000	100.68	3,825,874,100	100.33	3,812,806,000	0.100	2031/6/20	0.99
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	3,770,000,000	100.72	3,797,144,000	100.71	3,796,993,200	0.100	2030/9/20	0.98
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	3,660,000,000	100.68	3,684,888,000	100.48	3,677,897,400	0.100	2023/12/20	0.95
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	3,620,000,000	100.44	3,635,928,000	100.26	3,629,484,400	0.100	2022/12/20	0.94
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,460,000,000	102.45	3,544,770,000	102.03	3,530,341,800	0.400	2025/9/20	0.91

日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	3,490,000,000	101.30	3,535,370,000	101.04	3,526,610,100	0.100	2027/9/20	0.91
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	3,450,000,000	101.09	3,487,872,000	101.03	3,485,811,000	0.100	2028/3/20	0.90
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	3,410,000,000	102.18	3,484,338,000	101.77	3,470,493,400	0.400	2025/3/20	0.90
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	3,425,000,000	101.20	3,466,192,500	100.98	3,458,839,000	0.100	2027/3/20	0.90
日本	国債証券	第347回利付国債（10年）	3,415,000,000	101.28	3,458,985,200	101.03	3,450,276,950	0.100	2027/6/20	0.89
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	3,250,000,000	99.80	3,243,500,000	100.59	3,269,402,500	0.100	2030/12/20	0.85
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	3,190,000,000	101.11	3,225,504,700	100.87	3,217,880,600	0.100	2026/3/20	0.83
日本	国債証券	第148回利付国債（5年）	3,200,000,000	100.56	3,218,179,600	100.42	3,213,632,000	0.005	2026/6/20	0.83
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	3,180,000,000	101.17	3,217,399,700	100.97	3,210,909,600	0.100	2029/3/20	0.83
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	3,140,000,000	102.47	3,217,715,000	101.96	3,201,638,200	0.600	2024/6/20	0.83
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	3,160,000,000	101.23	3,198,868,000	101.01	3,192,010,800	0.100	2028/12/20	0.83
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	3,140,000,000	100.49	3,155,386,000	100.32	3,150,142,200	0.100	2023/3/20	0.82
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	2,775,000,000	102.34	2,840,073,750	101.90	2,827,808,250	0.400	2025/6/20	0.73
日本	国債証券	第327回利付国債（10年）	2,740,000,000	101.56	2,782,942,800	101.11	2,770,414,000	0.800	2022/12/20	0.72
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	2,735,000,000	101.29	2,770,386,150	101.06	2,764,018,350	0.100	2027/12/20	0.72
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	2,730,000,000	100.53	2,744,719,300	100.37	2,740,319,400	0.100	2023/6/20	0.71
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	2,680,000,000	102.23	2,740,018,200	101.76	2,727,382,400	0.600	2024/3/20	0.71
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	2,650,000,000	100.76	2,670,156,500	100.59	2,665,873,500	0.100	2024/6/20	0.69
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	2,590,000,000	101.13	2,619,284,000	100.96	2,615,019,400	0.100	2029/6/20	0.68
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	2,590,000,000	101.07	2,617,747,500	100.91	2,613,750,300	0.100	2029/9/20	0.68
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	2,580,000,000	101.24	2,612,172,600	100.94	2,604,329,400	0.100	2026/12/20	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	83.87
地方債証券	5.43
特殊債券	6.11
社債券	4.41
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	198,349,125,593	66.33
	イギリス	12,306,096,255	4.12
	カナダ	10,149,105,599	3.39
	スイス	9,409,527,364	3.15
	フランス	9,252,205,756	3.09
	ドイツ	8,163,084,852	2.73
	オランダ	5,976,560,387	2.00
	アイルランド	5,467,952,593	1.83
	オーストラリア	5,369,066,670	1.80
	スウェーデン	3,005,423,920	1.01
	デンマーク	2,378,448,998	0.80
	スペイン	2,191,708,198	0.73
	香港	1,979,788,507	0.66
	イタリア	1,650,178,988	0.55
	フィンランド	1,121,343,174	0.37
	ジャージー	895,939,530	0.30
	シンガポール	797,122,589	0.27
	ベルギー	774,728,771	0.26
	バミューダ	680,113,537	0.23
	ノルウェー	598,808,543	0.20
	ケイマン	577,230,234	0.19
	イスラエル	574,969,058	0.19
	ニュージーランド	291,626,595	0.10
	ルクセンブルク	289,365,817	0.10
キュラソー	220,641,289	0.07	
オーストリア	191,474,758	0.06	

	ポルトガル	141,180,081	0.05
	パナマ	122,242,435	0.04
	リベリア	107,779,639	0.04
	マン島	87,751,475	0.03
	パプアニューギニア	38,209,894	0.01
	小計	283,158,801,099	94.69
投資信託受益証券	オーストラリア	117,393,816	0.04
	香港	42,731,608	0.01
	小計	160,125,424	0.05
投資証券	アメリカ	5,508,247,287	1.84
	オーストラリア	370,118,370	0.12
	イギリス	163,965,599	0.05
	フランス	133,704,407	0.04
	シンガポール	120,332,994	0.04
	香港	101,148,201	0.03
	カナダ	43,497,573	0.01
	小計	6,441,014,431	2.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,272,838,148	3.10
合計(純資産総額)		299,032,779,102	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	6,766,853,878	2.26
	買建	カナダ	527,782,005	0.18
	買建	ドイツ	1,299,321,611	0.43
	買建	イギリス	276,715,985	0.09
	買建	オーストラリア	360,863,100	0.12

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,402,245,564	0.47

(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	796,612	15,330.53	12,212,492,091	15,985.53	12,734,267,892	4.26
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	341,478	27,232.24	9,299,211,221	31,785.28	10,853,973,844	3.63
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	21,677	376,178.67	8,154,425,140	369,461.35	8,008,813,693	2.68
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	114,351	30,209.78	3,454,518,923	38,009.15	4,346,384,449	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	14,353	235,609.09	3,381,697,385	300,736.87	4,316,476,358	1.44
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	13,900	235,559.46	3,274,276,604	301,111.80	4,185,454,109	1.40
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	39,117	94,129.05	3,682,046,148	87,444.21	3,420,555,366	1.14
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	118,952	15,475.85	1,840,883,679	22,962.62	2,731,450,336	0.91
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	144,686	15,476.99	2,239,304,528	18,573.12	2,687,271,019	0.90
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	125,898	18,428.42	2,320,101,685	18,357.11	2,311,124,492	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	80,933	23,406.69	1,894,373,808	25,370.02	2,053,272,282	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	45,143	36,497.78	1,647,619,409	44,813.88	2,023,033,310	0.68
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	63,292	26,319.10	1,665,788,933	31,034.29	1,964,222,713	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	50,551	31,210.01	1,577,697,276	37,709.20	1,906,238,052	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	117,178	14,526.77	1,702,218,304	15,894.87	1,862,530,061	0.62
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	137,866	12,053.04	1,661,704,441	13,481.70	1,858,668,714	0.62

アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	369,268	3,640.07	1,344,162,833	4,820.39	1,780,017,399	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	20,078	60,526.39	1,215,249,049	84,110.32	1,688,767,045	0.56
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	86,899	20,275.78	1,761,945,846	19,326.34	1,679,440,106	0.56
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	42,363	37,931.04	1,606,872,798	39,529.02	1,674,568,078	0.56
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	53,450	30,203.81	1,614,393,835	28,987.28	1,549,370,116	0.52
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	22,891	55,391.04	1,267,956,301	64,656.18	1,480,044,708	0.49
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	21,238	61,692.97	1,310,235,380	67,046.79	1,423,939,836	0.48
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	46,394	26,730.84	1,240,151,053	30,274.36	1,404,548,658	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	219,639	5,746.08	1,262,064,354	6,259.68	1,374,871,085	0.46
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	33,666	37,152.95	1,250,791,282	40,525.43	1,364,329,261	0.46
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	203,119	5,602.09	1,137,891,415	6,701.76	1,361,256,739	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	268,324	3,942.92	1,057,981,383	4,871.87	1,307,241,685	0.44
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	202,087	5,403.86	1,092,050,760	6,209.32	1,254,823,174	0.42
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	18,865	55,299.13	1,043,218,210	64,868.83	1,223,750,516	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.26
		素材	3.91
		資本財	6.12
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	2.07
		耐久消費財・アパレル	1.82
		消費者サービス	1.85
		メディア・娯楽	7.30
		小売	5.56

	食品・生活必需品小売り	1.38
	食品・飲料・タバコ	3.65
	家庭用品・パーソナル用品	1.66
	ヘルスケア機器・サービス	5.03
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.35
	銀行	6.04
	各種金融	4.57
	保険	2.93
	不動産	0.45
	ソフトウェア・サービス	12.07
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.78
	電気通信サービス	1.59
	公益事業	2.72
	半導体・半導体製造装置	4.53
	小計	94.69
投資信託受益証券		0.05
投資証券		2.15
合計		96.90

(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	278	アメリカドル	61,887,661	6,926,467,019	60,461,525	6,766,853,878	2.26
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	25	カナダドル	6,136,998.5	538,889,838	6,010,500	527,782,005	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	33	スイスフラン	3,968,141	475,700,743	3,840,540	460,403,935	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	159	ユーロ	6,599,030.5	856,950,101	6,460,170	838,917,676	0.28
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	25	オーストラリアドル	4,624,725	372,105,374	4,485,000	360,863,100	0.12
	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	26	イギリスポンド	1,821,152.5	273,955,971	1,839,500	276,715,985	0.09

(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	9,692,000.00	1,069,763,953	1,084,613,504	0.36
	カナダドル	買建	200,000.00	17,613,760	17,561,800	0.01
	ユーロ	買建	1,500,000.00	194,975,910	194,808,900	0.07
	イギリスポンド	買建	500,000.00	75,869,230	75,210,150	0.03
	スイスフラン	買建	150,000.00	18,016,950	17,982,210	0.01
	オーストラリアドル	買建	150,000.00	12,124,125	12,069,000	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	66,852,253,598	44.84
	フランス	14,665,882,224	9.84
	イタリア	13,602,642,689	9.12
	ドイツ	10,719,548,695	7.19
	イギリス	8,709,109,950	5.84
	スペイン	8,562,132,831	5.74
	ベルギー	3,418,120,354	2.29
	カナダ	2,827,277,174	1.90
	オランダ	2,684,859,263	1.80
	オーストラリア	2,634,657,228	1.77
	オーストリア	2,136,871,490	1.43
	アイルランド	1,193,694,545	0.80
	メキシコ	1,002,849,880	0.67
	フィンランド	888,994,080	0.60
	ポーランド	825,236,770	0.55
	デンマーク	730,046,417	0.49
	マレーシア	690,237,475	0.46
	イスラエル	660,539,324	0.44
	シンガポール	651,505,248	0.44
	スウェーデン	423,705,429	0.28
ノルウェー	356,324,150	0.24	
小計		144,236,488,814	96.74

現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,855,909,104	3.26
合計(純資産総額)		149,092,397,918	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	1,597,416,672	1.07
	買建	ドイツ	1,903,739,808	1.28

(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		3,526,842,310	2.37
	売建		23,509,245	0.02

(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 0.25% 06/15/24	10,610,000	11,157.97	1,183,861,287	11,126.42	1,180,513,366	0.250	2024/6/15	0.79
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	10,658.63	973,133,033	10,405.93	950,062,042	0.625	2030/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	7,250,000	12,032.71	872,371,589	11,760.78	852,656,615	2.125	2025/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	10,696.22	791,520,978	10,440.03	772,562,775	0.625	2030/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/25	7,000,000	11,105.43	777,380,585	10,947.61	766,332,851	0.250	2025/9/30	0.51
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	11,617.38	755,129,921	11,475.51	745,908,545	2.000	2023/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	6,500,000	11,216.73	729,087,731	11,200.52	728,034,136	0.250	2023/4/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/23	6,000,000	12,040.58	722,434,854	11,807.12	708,427,370	2.875	2023/11/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	11,944.83	722,662,634	11,706.13	708,221,016	2.000	2025/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/23	6,000,000	11,766.48	705,989,122	11,658.26	699,495,631	2.625	2023/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	11,343.42	680,605,666	11,168.39	670,103,516	1.250	2028/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	11,829.85	680,216,753	11,544.37	663,801,457	1.625	2026/2/15	0.45

アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	5,800,000	11,564.48	670,740,057	11,442.72	663,678,165	1.625	2023/4/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	5,390,000	12,624.22	680,445,794	12,194.03	657,258,418	2.625	2029/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	10,729.61	660,944,179	10,614.91	653,878,610	0.875	2030/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	12,154.24	668,483,731	11,835.10	650,930,656	2.250	2025/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.5% 06/30/27	6,000,000	11,035.92	662,155,445	10,796.34	647,780,720	0.500	2027/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	5,460,000	12,030.28	656,853,332	11,792.69	643,881,184	2.375	2024/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/22	5,500,000	11,575.19	636,635,715	11,437.04	629,037,396	2.000	2022/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	12,277.97	645,821,418	11,895.43	625,699,862	2.250	2027/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	11,833.35	639,001,121	11,540.87	623,207,287	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	11,759.03	623,228,704	11,469.61	607,889,546	1.500	2026/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	5,600,000	10,720.50	600,348,057	10,832.63	606,627,387	1.125	2031/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 07/31/25	5,000,000	12,428.36	621,418,313	12,084.29	604,214,983	2.875	2025/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/31/25	5,000,000	12,378.08	618,904,483	12,042.32	602,116,483	2.750	2025/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	5,090,000	11,879.25	604,654,270	11,683.83	594,707,247	2.250	2024/1/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.5% 05/31/27	5,500,000	10,843.30	596,382,031	10,806.40	594,352,037	0.500	2027/5/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	5,300,000	11,208.29	594,039,481	11,185.87	592,851,609	1.250	2028/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	5,000,000	12,017.84	600,892,358	11,780.89	589,044,580	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.125% 10/15/23	5,200,000	11,181.07	581,415,657	11,152.21	579,915,227	0.125	2023/10/15	0.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.74
合計	96.74

(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	44	アメリカドル	5,430,545.15	607,786,613	5,396,875	604,018,250	0.41
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	30	アメリカドル	3,992,099.7	446,795,799	3,944,062.5	441,419,475	0.30
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	31	アメリカドル	5,044,774.3	564,611,139	4,931,906.25	551,978,947	0.37
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	19	ユーロ	2,133,004.9	276,992,016	2,131,990	276,860,221	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	26	ユーロ	3,525,334.6	457,799,951	3,510,000	455,808,600	0.31

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	53	ユーロ	9,109,321.3	1,182,936,464	9,017,950	1,171,070,987	0.79
-----	-----------------------	-----------	----	----	-----	-------------	---------------	-----------	---------------	------

(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	14,930,000.00	1,642,755,781	1,670,734,185	1.12
	カナダドル	買建	1,920,000.00	166,905,917	168,565,440	0.11
	ユーロ	買建	11,210,000.00	1,455,290,026	1,455,904,355	0.98
	イギリスポンド	買建	1,540,000.00	234,001,683	231,638,330	0.16
	カナダドル	売建	267,744.42	23,509,459	23,509,245	0.02

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2021年9月30日

DCバランスファンド30

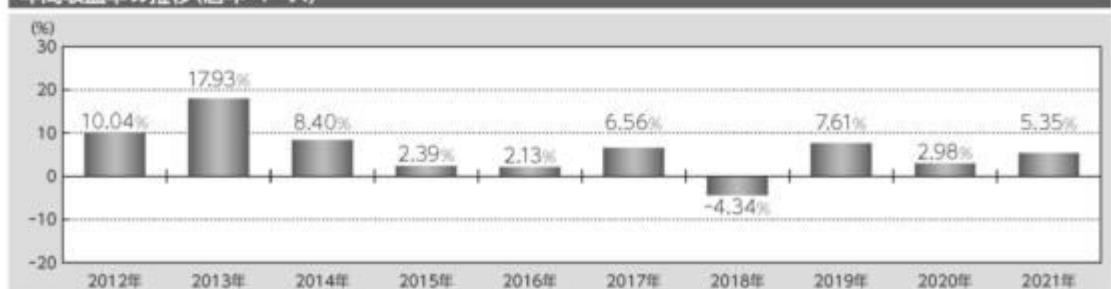
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	59.1%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.8%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.7%
		第343回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2026/06/20	0.6%
日本株式 マザーファンド	20.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
外国株式 マザーファンド	10.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.3%
外国債券 マザーファンド	9.3%	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.1%
		T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 2.125% 05/15/25	アメリカ	国債	-	2.125%	2025/05/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。


年間収益率の推移(暦年ベース)

※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンド内には、ベンチマークはありません。

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

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


運用実績

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2021年9月30日

DCバランスファンド50**基準価額・純資産の推移**

※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 18,183円

純資産総額 261.25億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

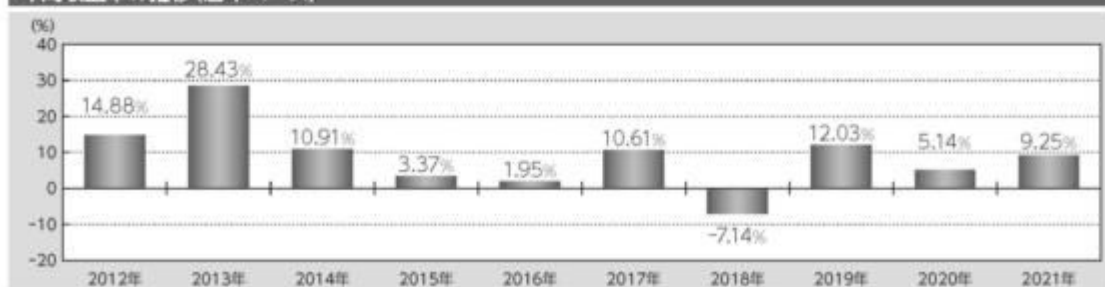
決算期	分配金
2017年2月	0円
2018年2月	0円
2019年2月	0円
2020年2月	0円
2021年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	39.3%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.5%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.5%
		第343回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2026/06/20	0.4%
日本株式 マザーファンド	30.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
外国株式 マザーファンド	20.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.9%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.7%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.5%
外国債券 マザーファンド	9.1%	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.1%
		T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 2.125% 05/15/25	アメリカ	国債	-	2.125%	2025/05/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンド内には、ベンチマークはありません。

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

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

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2021年9月30日

DCバランスファンド70

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 19,999円

純資産総額 113.89億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年2月	0円
2018年2月	0円
2019年2月	0円
2020年2月	0円
2021年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

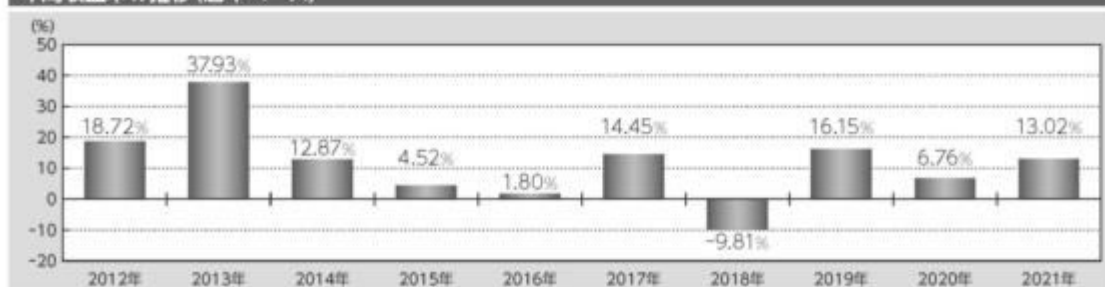
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式マザーファンド	40.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.5%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.1%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.9%
外国株式マザーファンド	29.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/ハードウェア	-	-	1.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	1.1%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.8%
日本債券マザーファンド	24.4%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.3%
		第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2024/09/20	0.3%
		第343回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2026/06/20	0.3%
外国債券マザーファンド	4.8%	T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.0%
		T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.0%
		T 2.125% 05/15/25	アメリカ	国債	-	2.125%	2025/05/15	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

< 一部解約の制限 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3 【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

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

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

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

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

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2006年9月29日設定）

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

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

【DCバランスファンド30】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(2020年2月22日から2021年2月22日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2020年 2月21日現在)	第15期 (2021年 2月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	73,580,659	125,750,521
親投資信託受益証券	20,248,119,071	22,592,800,568
未収入金	21,402,662	31,812,612
流動資産合計	20,343,102,392	22,750,363,701
資産合計	20,343,102,392	22,750,363,701
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,796,279	7,121,376
未払受託者報酬	4,353,927	4,858,297
未払委託者報酬	18,504,123	20,647,746
未払利息	32	102
その他未払費用	544,179	607,228
流動負債合計	32,198,540	33,234,749
負債合計	32,198,540	33,234,749
純資産の部		
元本等		
元本	13,829,328,777	14,863,838,450
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,481,575,075	7,853,290,502
(分配準備積立金)	2,904,019,781	3,643,228,795
元本等合計	20,310,903,852	22,717,128,952
純資産合計	20,310,903,852	22,717,128,952
負債純資産合計	20,343,102,392	22,750,363,701

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	2019年 2月22日	自	2020年 2月22日
	至	2020年 2月21日	至	2021年 2月22日
営業収益				
受取利息		81		795
有価証券売買等損益		939,535,803		960,224,011
営業収益合計		939,535,884		960,224,806
営業費用				
支払利息		40,654		55,864
受託者報酬		8,347,791		9,259,667
委託者報酬		35,477,991		39,353,501
その他費用		1,043,800		1,157,535
営業費用合計		44,910,236		49,826,567
営業利益又は営業損失（ ）		894,625,648		910,398,239
経常利益又は経常損失（ ）		894,625,648		910,398,239
当期純利益又は当期純損失（ ）		894,625,648		910,398,239
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（ ）		20,090,192		23,782,260
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,224,981,467		6,481,575,075
剰余金増加額又は欠損金減少額		715,556,623		907,140,214
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		715,556,623		907,140,214
剰余金減少額又は欠損金増加額		333,498,471		469,605,286
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		333,498,471		469,605,286
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,481,575,075		7,853,290,502

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第15期計算期間は2020年 2月22日から2021年 2月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第14期 (2020年 2月21日現在)	第15期 (2021年 2月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	13,829,328,777口	14,863,838,450口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4687円 (14,687円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5283円 (15,283円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日	第15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日																																																												
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>263,784,123円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>466,783,938円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>4,264,411,028円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,173,451,720円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>7,168,430,809円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>13,829,328,777口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>5,183円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	263,784,123円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	466,783,938円	収益調整金額	C	4,264,411,028円	分配準備積立金額	D	2,173,451,720円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,168,430,809円	当ファンドの期末残存口数	F	13,829,328,777口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,183円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>262,799,454円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>671,381,045円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>4,999,720,156円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,709,048,296円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>8,642,948,951円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>14,863,838,450口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>5,814円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	262,799,454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	671,381,045円	収益調整金額	C	4,999,720,156円	分配準備積立金額	D	2,709,048,296円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,642,948,951円	当ファンドの期末残存口数	F	14,863,838,450口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,814円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	263,784,123円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	466,783,938円																																																											
収益調整金額	C	4,264,411,028円																																																											
分配準備積立金額	D	2,173,451,720円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,168,430,809円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	13,829,328,777口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,183円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	262,799,454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	671,381,045円																																																											
収益調整金額	C	4,999,720,156円																																																											
分配準備積立金額	D	2,709,048,296円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,642,948,951円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	14,863,838,450口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,814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15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22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15期 (2021年 2月22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14期	第15期
	自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日	自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	12,980,103,562円	13,829,328,777円
期中追加設定元本額	1,679,276,139円	2,046,783,461円
期中一部解約元本額	830,050,924円	1,012,273,788円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 (2020年 2月21日現在)	第15期 (2021年 2月22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	925,149,782	1,008,792,625
合計	925,149,782	1,008,792,625

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,209,310,832	4,743,169,425	
	日本債券マザーファンド	9,684,934,610	13,246,085,066	
	外国株式マザーファンド	672,689,485	2,406,681,170	
	外国債券マザーファンド	855,410,368	2,196,864,907	
合計		13,422,345,295	22,592,800,568	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【DCバランスファンド50】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(2020年2月22日から2021年2月22日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2020年 2月21日現在)	第15期 (2021年 2月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	71,708,931	130,221,320
親投資信託受益証券	20,632,324,073	23,567,577,711
未収入金	39,473,889	32,944,564
流動資産合計	20,743,506,893	23,730,743,595
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,056,432	9,708,179
未払受託者報酬	4,393,890	4,946,208
未払委託者報酬	19,772,444	22,257,867
未払利息	31	105
その他未払費用	549,179	618,211
流動負債合計	46,771,976	37,530,570
純資産の部		
元本等		
元本	12,979,122,227	13,793,194,595
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	7,717,612,690	9,900,018,430
(分配準備積立金)	4,368,969,027	5,788,761,649
元本等合計	20,696,734,917	23,693,213,025
純資産合計	20,696,734,917	23,693,213,025
負債純資産合計	20,743,506,893	23,730,743,595

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自 2019年 2月22日	至 2020年 2月21日	自 2020年 2月22日	至 2021年 2月22日
営業収益				
受取利息		81		865
有価証券売買等損益		1,424,443,495		1,770,756,091
営業収益合計		1,424,443,576		1,770,756,956
営業費用				
支払利息		41,417		58,570
受託者報酬		8,374,767		9,271,915
委託者報酬		37,686,329		41,723,485
その他費用		1,047,178		1,159,105
営業費用合計		47,149,691		52,213,075
営業利益又は営業損失（ ）		1,377,293,885		1,718,543,881
経常利益又は経常損失（ ）		1,377,293,885		1,718,543,881
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,377,293,885		1,718,543,881
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（ ）		25,702,410		49,206,265
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,935,078,783		7,717,612,690
剰余金増加額又は欠損金減少額		799,773,260		1,070,164,323
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		799,773,260		1,070,164,323
剰余金減少額又は欠損金増加額		368,830,828		655,508,729
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		368,830,828		655,508,729
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,717,612,690		9,900,018,430

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第15期計算期間は2020年 2月22日から2021年 2月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第14期 (2020年 2月21日現在)	第15期 (2021年 2月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	12,979,122,227口	13,793,194,595口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5946円 (15,946円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7177円 (17,177円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日	第15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日																																																												
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>322,344,820円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>772,288,530円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>5,493,363,535円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>3,274,335,677円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>9,862,332,562円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>12,979,122,227口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>7,598円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	322,344,820円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	772,288,530円	収益調整金額	C	5,493,363,535円	分配準備積立金額	D	3,274,335,677円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,862,332,562円	当ファンドの期末残存口数	F	12,979,122,227口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,598円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>316,242,881円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>1,451,507,265円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>6,465,247,784円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>4,021,011,503円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>12,254,009,433円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>13,793,194,595口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>8,884円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	316,242,881円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,451,507,265円	収益調整金額	C	6,465,247,784円	分配準備積立金額	D	4,021,011,503円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,254,009,433円	当ファンドの期末残存口数	F	13,793,194,595口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,884円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	322,344,820円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	772,288,530円																																																											
収益調整金額	C	5,493,363,535円																																																											
分配準備積立金額	D	3,274,335,677円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,862,332,562円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	12,979,122,227口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,598円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	316,242,881円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,451,507,265円																																																											
収益調整金額	C	6,465,247,784円																																																											
分配準備積立金額	D	4,021,011,503円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,254,009,433円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	13,793,194,595口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,884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15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22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15期 (2021年 2月22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14期	第15期
	自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日	自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	12,196,046,788円	12,979,122,227円
期中追加設定元本額	1,542,536,422円	1,929,479,800円
期中一部解約元本額	759,460,983円	1,115,407,432円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期	第15期
	(2020年 2月21日現在)	(2021年 2月22日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	1,403,731,036	1,835,273,251
合計	1,403,731,036	1,835,273,251

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,413,747,915	7,328,975,398	
	日本債券マザーファンド	6,628,892,142	9,066,335,782	
	外国株式マザーファンド	1,383,168,041	4,948,560,300	
	外国債券マザーファンド	865,861,783	2,223,706,231	
合計		12,291,669,881	23,567,577,711	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【DCバランスファンド70】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(2020年2月22日から2021年2月22日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2020年 2月21日現在)	第15期 (2021年 2月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	35,232,651	76,047,001
親投資信託受益証券	8,324,796,087	10,022,653,303
未収入金	5,297,790	447,319
流動資産合計	8,365,326,528	10,099,147,623
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,830,056	14,261,819
未払受託者報酬	1,736,537	2,048,759
未払委託者報酬	8,248,452	9,731,530
未払利息	15	61
その他未払費用	217,004	256,033
流動負債合計	16,032,064	26,298,202
負債合計	16,032,064	26,298,202
純資産の部		
元本等		
元本	4,997,769,197	5,431,547,507
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,351,525,267	4,641,301,914
(分配準備積立金)	1,901,546,131	2,742,201,556
元本等合計	8,349,294,464	10,072,849,421
純資産合計	8,349,294,464	10,072,849,421
負債純資産合計	8,365,326,528	10,099,147,623

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	2019年 2月22日	自	2020年 2月22日
	至	2020年 2月21日	至	2021年 2月22日
営業収益				
受取利息		32		372
有価証券売買等損益		715,062,580		1,039,930,398
営業収益合計		715,062,612		1,039,930,770
営業費用				
支払利息		15,625		23,380
受託者報酬		3,286,221		3,762,922
委託者報酬		15,609,368		17,873,758
その他費用		410,823		470,296
営業費用合計		19,322,037		22,130,356
営業利益又は営業損失（ ）		695,740,575		1,017,800,414
経常利益又は経常損失（ ）		695,740,575		1,017,800,414
当期純利益又は当期純損失（ ）		695,740,575		1,017,800,414
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（ ）		18,284,576		28,956,331
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,453,958,004		3,351,525,267
剰余金増加額又は欠損金減少額		456,519,616		639,422,322
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		456,519,616		639,422,322
剰余金減少額又は欠損金増加額		236,408,352		396,402,420
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		236,408,352		396,402,420
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,351,525,267		4,641,301,914

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第15期計算期間は2020年 2月22日から2021年 2月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第14期 (2020年 2月21日現在)	第15期 (2021年 2月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,997,769,197口	5,431,547,507口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6706円 (16,706円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8545円 (18,545円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日			第15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	142,533,260円	費用控除後の配当等収益額	A	143,577,709円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	383,275,319円	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	903,179,036円
収益調整金額	C	2,488,049,473円	収益調整金額	C	3,078,538,862円
分配準備積立金額	D	1,375,737,552円	分配準備積立金額	D	1,695,444,811円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,389,595,604円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,820,740,418円
当ファンドの期末残存口数	F	4,997,769,197口	当ファンドの期末残存口数	F	5,431,547,507口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,783円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	10,716円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第15期 (2021年 2月22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14期	第15期
	自 2019年 2月22日 至 2020年 2月21日	自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,651,467,417円	4,997,769,197円
期中追加設定元本額	795,085,220円	1,035,869,348円
期中一部解約元本額	448,783,440円	602,091,038円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期	第15期
	(2020年 2月21日現在)	(2021年 2月22日現在)
	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	707,955,891	1,085,524,179
合計	707,955,891	1,085,524,179

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,920,070,604	4,122,199,579	
	日本債券マザーファンド	1,723,964,216	2,357,865,858	
	外国株式マザーファンド	871,140,012	3,116,677,620	
	外国債券マザーファンド	165,839,984	425,910,246	
合計		4,681,014,816	10,022,653,303	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2021年 2月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,660,922,561
株式	285,691,981,360
派生商品評価勘定	71,694,700
未収配当金	387,244,109
差入委託証拠金	152,975,000
流動資産合計	288,964,817,730
資産合計	288,964,817,730
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,666,000
前受金	62,028,700
未払解約金	295,602,877
未払利息	2,159
流動負債合計	367,299,736
負債合計	367,299,736
純資産の部	
元本等	

	2021年 2月22日現在
項目	金額（円）
元本	134,423,726,662
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,173,791,332
元本等合計	288,597,517,994
純資産合計	288,597,517,994
負債純資産合計	288,964,817,730

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 2月22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)

	2021年 2月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	134,423,726,662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 2.1469円 (1万口当たり純資産額) (21,469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

	2021年 2月22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

	2021年 2月22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。

	2021年 2月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 2月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 2月22日
期首元本額	138,817,553,099円
期中追加設定元本額	17,082,126,375円
期中一部解約元本額	21,475,952,812円
期末元本額	134,423,726,662円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	613,656,008円
D C 日本株式インデックスファンド	315,548,273円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,225,570,504円
D C 日本株式インデックスファンド A	872,569,232円
D C バランスファンド 3 0	2,209,310,832円
D C バランスファンド 5 0	3,413,747,915円
D C バランスファンド 7 0	1,920,070,604円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	553,402,655円
日本株式インデックス e	1,521,531,809円
インデックスコレクション（国内株式）	18,818,263,362円

区分	2021年 2月22日現在
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,039,553,005円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,298,031,161円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,909,143,348円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,618,143,979円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,804,287,706円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,185,660,113円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	63,446,493円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	695,870,429円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	80,881,845円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	166,542,006円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	2,495,023円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	368,391,828円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	957,421,549円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	505,211,573円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	8,642,992,000円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	787,789,453円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	98,597,938円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,383,111,363円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	34,211,321円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	172,223,098円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,249,579,635円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	64,645,163円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	69,498,687円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	27,714,585円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	719,569,938円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	330,007,574円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	5,385,261,961円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	96,635,848円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	43,676,764円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	10,041,429円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	145,363,233円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	4,055,420円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 2月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	12,168,544,976
合計	12,168,544,976

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 2月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,750,246,300	-	2,812,275,000	62,028,700
合計		2,750,246,300	-	2,812,275,000	62,028,700

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	4,800	3,050.00	14,640,000	
日本水産	135,800	502.00	68,171,600	
マルハニチロ	22,900	2,480.00	56,792,000	
雪国まいたけ	9,000	1,768.00	15,912,000	
カネコ種苗	4,400	1,597.00	7,026,800	
サカタのタネ	17,400	3,880.00	67,512,000	
ホクト	12,300	2,145.00	26,383,500	
ホクリヨウ	2,300	679.00	1,561,700	
住石ホールディングス	25,600	124.00	3,174,400	
日鉄鉱業	3,400	5,990.00	20,366,000	
三井松島ホールディングス	6,100	932.00	5,685,200	
国際石油開発帝石	538,000	776.00	417,488,000	
石油資源開発	19,100	2,239.00	42,764,900	
K&Oエナジーグループ	7,100	1,464.00	10,394,400	
ヒノキヤグループ	3,600	2,191.00	7,887,600	
ショーボンドホールディングス	20,900	4,730.00	98,857,000	
ミライト・ホールディングス	50,700	1,712.00	86,798,400	
タマホーム	8,900	1,898.00	16,892,200	
サンヨーホームズ	1,700	818.00	1,390,600	

日本アクア	5,800	632.00	3,665,600
ファーストコーポレーション	4,500	698.00	3,141,000
ベステラ	2,800	1,749.00	4,897,200
TATERU	27,400	179.00	4,904,600
キャンディル	2,500	541.00	1,352,500
スペースバリューホールディングス	17,800	814.00	14,489,200
ダイセキ環境ソリューション	2,800	846.00	2,368,800
第一カッター興業	3,600	1,307.00	4,705,200
安藤・間	93,800	782.00	73,351,600
東急建設	42,800	544.00	23,283,200
コムシスホールディングス	51,900	3,250.00	168,675,000
ビーアールホールディングス	17,300	684.00	11,833,200
高松コンストラクショングループ	9,100	2,127.00	19,355,700
東建コーポレーション	4,500	8,570.00	38,565,000
ソネック	1,500	832.00	1,248,000
ヤマウラ	6,400	953.00	6,099,200
大成建設	105,100	3,790.00	398,329,000
大林組	337,800	936.00	316,180,800
清水建設	316,500	817.00	258,580,500
飛鳥建設	9,700	1,119.00	10,854,300
長谷工コーポレーション	110,700	1,354.00	149,887,800
松井建設	13,300	716.00	9,522,800
銭高組	1,500	4,575.00	6,862,500
鹿島建設	247,500	1,421.00	351,697,500
不動テトラ	8,300	1,805.00	14,981,500
大末建設	4,300	926.00	3,981,800
鉄建建設	6,800	1,966.00	13,368,800
西松建設	24,200	2,596.00	62,823,200
三井住友建設	81,600	460.00	37,536,000
大豊建設	7,400	3,680.00	27,232,000
前田建設工業	84,600	998.00	84,430,800
佐田建設	7,600	427.00	3,245,200
ナカノフドー建設	8,100	371.00	3,005,100
奥村組	18,600	2,682.00	49,885,200
東鉄工業	14,500	2,648.00	38,396,000
イチケン	2,400	2,093.00	5,023,200
富士ピー・エス	4,400	609.00	2,679,600
浅沼組	4,100	4,530.00	18,573,000
戸田建設	140,300	743.00	104,242,900
熊谷組	15,700	2,800.00	43,960,000
北野建設	2,100	2,478.00	5,203,800
植木組	1,500	2,910.00	4,365,000

矢作建設工業	14,900	847.00	12,620,300
ピーエス三菱	11,100	685.00	7,603,500
日本ハウスホールディングス	23,100	336.00	7,761,600
大東建託	36,900	12,350.00	455,715,000
新日本建設	14,400	846.00	12,182,400
N I P P O	28,000	2,832.00	79,296,000
東亜道路工業	2,100	4,140.00	8,694,000
前田道路	20,900	2,003.00	41,862,700
日本道路	3,300	8,010.00	26,433,000
東亜建設工業	9,000	2,170.00	19,530,000
日本国土開発	32,900	558.00	18,358,200
若築建設	6,100	1,277.00	7,789,700
東洋建設	37,900	553.00	20,958,700
五洋建設	143,500	795.00	114,082,500
世紀東急工業	16,200	890.00	14,418,000
福田組	3,900	5,020.00	19,578,000
住友林業	79,500	2,099.00	166,870,500
日本基礎技術	10,300	498.00	5,129,400
巴コーポレーション	15,000	397.00	5,955,000
大和ハウス工業	312,000	3,200.00	998,400,000
ライト工業	19,300	1,647.00	31,787,100
積水ハウス	366,400	2,081.00	762,478,400
日特建設	8,800	785.00	6,908,000
北陸電気工事	5,800	1,192.00	6,913,600
ユアテック	19,300	816.00	15,748,800
日本リーテック	7,100	2,494.00	17,707,400
四電工	1,800	2,804.00	5,047,200
中電工	15,600	2,211.00	34,491,600
関電工	54,900	884.00	48,531,600
きんでん	73,000	1,776.00	129,648,000
東京エネシス	11,200	918.00	10,281,600
トーエネック	3,400	3,735.00	12,699,000
住友電設	9,500	2,434.00	23,123,000
日本電設工業	18,500	1,932.00	35,742,000
協和エクシオ	51,200	2,722.00	139,366,400
新日本空調	8,900	2,270.00	20,203,000
九電工	23,700	3,390.00	80,343,000
三機工業	23,900	1,296.00	30,974,400
日揮ホールディングス	112,700	1,355.00	152,708,500
中外炉工業	3,700	1,744.00	6,452,800
ヤマト	10,800	669.00	7,225,200
太平電業	7,500	2,663.00	19,972,500

高砂熱学工業	30,500	1,596.00	48,678,000
三晃金属工業	1,300	3,095.00	4,023,500
朝日工業社	2,500	3,010.00	7,525,000
明星工業	21,800	806.00	17,570,800
大気社	16,400	2,947.00	48,330,800
ダイダン	7,500	2,809.00	21,067,500
日比谷総合設備	10,900	1,878.00	20,470,200
フィル・カンパニー	1,900	2,076.00	3,944,400
OSJBホールディングス	49,200	273.00	13,431,600
東洋エンジニアリング	14,200	506.00	7,185,200
レイズネクスト	18,100	1,177.00	21,303,700
ニッポン	31,600	1,609.00	50,844,400
日清製粉グループ本社	122,200	1,727.00	211,039,400
日東富士製粉	800	6,860.00	5,488,000
昭和産業	9,100	3,245.00	29,529,500
鳥越製粉	9,600	859.00	8,246,400
中部飼料	13,200	1,443.00	19,047,600
フィード・ワン	14,500	914.00	13,253,000
東洋精糖	1,800	1,225.00	2,205,000
日本甜菜製糖	5,600	1,685.00	9,436,000
三井製糖	8,500	1,938.00	16,473,000
塩水港精糖	12,900	228.00	2,941,200
日新製糖	5,100	1,870.00	9,537,000
森永製菓	25,400	3,980.00	101,092,000
中村屋	2,600	3,970.00	10,322,000
江崎グリコ	29,800	4,480.00	133,504,000
名糖産業	4,800	1,515.00	7,272,000
井村屋グループ	6,100	2,516.00	15,347,600
不二家	6,900	2,278.00	15,718,200
山崎製パン	81,000	1,887.00	152,847,000
第一屋製パン	2,100	971.00	2,039,100
モロゾフ	1,700	5,650.00	9,605,000
亀田製菓	6,200	4,810.00	29,822,000
寿スピリッツ	10,400	6,820.00	70,928,000
カルビー	49,300	2,903.00	143,117,900
森永乳業	20,000	4,830.00	96,600,000
六甲バター	7,200	1,738.00	12,513,600
ヤクルト本社	74,400	5,530.00	411,432,000
明治ホールディングス	71,500	6,970.00	498,355,000
雪印メグミルク	26,000	2,189.00	56,914,000
プリマハム	15,200	3,340.00	50,768,000
日本ハム	41,300	4,665.00	192,664,500

林兼産業	3,600	626.00	2,253,600	
丸大食品	10,600	1,698.00	17,998,800	
S Foods	9,700	3,465.00	33,610,500	
柿安本店	3,700	2,724.00	10,078,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	69,600	745.00	51,852,000	
サッポロホールディングス	36,900	2,244.00	82,803,600	
アサヒグループホールディングス	236,200	4,548.00	1,074,237,600	
キリンホールディングス	458,500	2,115.00	969,727,500	
宝ホールディングス	80,100	1,499.00	120,069,900	
オエノンホールディングス	30,700	400.00	12,280,000	
養命酒製造	3,300	1,924.00	6,349,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	82,800	1,832.00	151,689,600	
サントリー食品インターナショナル	72,300	3,770.00	272,571,000	
ダイトーグループホールディングス	6,100	5,410.00	33,001,000	
伊藤園	32,800	6,310.00	206,968,000	
キーコーヒー	10,600	2,157.00	22,864,200	
ユニカフェ	3,200	1,004.00	3,212,800	
ジャパンフーズ	1,500	1,264.00	1,896,000	
日清オイリオグループ	13,900	3,195.00	44,410,500	
不二製油グループ本社	26,400	3,190.00	84,216,000	
かどや製油	1,200	4,095.00	4,914,000	
J - オイルミルズ	5,000	3,805.00	19,025,000	
キッコーマン	77,800	7,400.00	575,720,000	
味の素	257,100	2,267.50	582,974,250	
キューピー	60,200	2,394.00	144,118,800	
ハウス食品グループ本社	40,400	3,720.00	150,288,000	
カゴメ	44,200	3,340.00	147,628,000	
焼津水産化学工業	5,200	993.00	5,163,600	
アリアケジャパン	9,900	6,800.00	67,320,000	
ピエトロ	1,400	1,780.00	2,492,000	
エバラ食品工業	2,400	2,647.00	6,352,800	
やまみ	1,200	2,105.00	2,526,000	
ニチレイ	51,500	2,807.00	144,560,500	
東洋水産	55,600	4,615.00	256,594,000	
イーランドホールディングス	3,700	1,940.00	7,178,000	
大冷	1,200	1,962.00	2,354,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,000	957.00	5,742,000	
日清食品ホールディングス	42,400	8,340.00	353,616,000	
永谷園ホールディングス	5,300	2,358.00	12,497,400	
一正蒲鉾	4,200	1,157.00	4,859,400	
フジッコ	11,700	2,003.00	23,435,100	
ロック・フィールド	11,600	1,555.00	18,038,000	

日本たばこ産業	579,700	1,936.50	1,122,589,050
ケンコーマヨネーズ	6,600	2,024.00	13,358,400
わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,716.00	12,183,600
なとり	6,000	2,019.00	12,114,000
イフジ産業	1,700	936.00	1,591,200
ピクルスコーポレーション	2,600	3,580.00	9,308,000
北の達人コーポレーション	37,700	636.00	23,977,200
ユーグレナ	46,700	990.00	46,233,000
ミヨシ油脂	3,800	1,200.00	4,560,000
理研ビタミン	10,200	1,363.00	13,902,600
片倉工業	14,400	1,391.00	20,030,400
ゲンゼ	7,800	3,790.00	29,562,000
東洋紡	41,900	1,342.00	56,229,800
ユニチカ	31,600	446.00	14,093,600
富士紡ホールディングス	5,200	4,290.00	22,308,000
倉敷紡績	9,900	1,920.00	19,008,000
シキボウ	5,900	1,013.00	5,976,700
日本毛織	35,000	958.00	33,530,000
トーア紡コーポレーション	4,200	479.00	2,011,800
帝国繊維	12,000	2,275.00	27,300,000
帝人	99,500	1,873.00	186,363,500
東レ	764,400	706.80	540,277,920
サカイオーベックス	2,900	2,851.00	8,267,900
住江織物	2,300	2,048.00	4,710,400
日本フェルト	6,700	444.00	2,974,800
イチカワ	1,600	1,328.00	2,124,800
日東製網	1,100	1,569.00	1,725,900
アツギ	8,400	546.00	4,586,400
ダイニック	4,000	801.00	3,204,000
セーレン	26,100	1,909.00	49,824,900
ソトー	4,400	830.00	3,652,000
東海染工	1,500	1,128.00	1,692,000
小松マテーレ	17,500	1,024.00	17,920,000
ワコールホールディングス	26,400	2,223.00	58,687,200
ホギメディカル	14,300	3,185.00	45,545,500
T S Iホールディングス	32,600	278.00	9,062,800
マツオカコーポレーション	3,400	1,916.00	6,514,400
ワールド	13,900	1,381.00	19,195,900
三陽商会	5,500	728.00	4,004,000
ナイガイ	4,300	330.00	1,419,000
オンワードホールディングス	63,900	276.00	17,636,400
ルックホールディングス	3,700	1,155.00	4,273,500

ゴールドウイン	17,500	7,380.00	129,150,000
デサント	18,100	1,771.00	32,055,100
キング	5,800	570.00	3,306,000
ヤマトインターナショナル	9,700	336.00	3,259,200
特種東海製紙	6,500	4,735.00	30,777,500
王子ホールディングス	475,000	709.00	336,775,000
日本製紙	46,700	1,406.00	65,660,200
三菱製紙	15,000	361.00	5,415,000
北越コーポレーション	75,500	514.00	38,807,000
中越パルプ工業	4,000	1,202.00	4,808,000
巴川製紙所	3,500	770.00	2,695,000
大王製紙	50,900	2,224.00	113,201,600
阿波製紙	2,700	451.00	1,217,700
レンゴー	108,800	879.00	95,635,200
トーモク	6,500	1,869.00	12,148,500
ザ・パック	8,000	2,737.00	21,896,000
クラレ	166,200	1,196.00	198,775,200
旭化成	699,300	1,147.50	802,446,750
共和レザー	5,700	667.00	3,801,900
昭和電工	80,100	2,592.00	207,619,200
住友化学	830,500	522.00	433,521,000
住友精化	5,100	4,020.00	20,502,000
日産化学	58,200	6,240.00	363,168,000
ラサ工業	3,500	2,248.00	7,868,000
クレハ	9,000	7,190.00	64,710,000
多木化学	4,100	6,390.00	26,199,000
テイカ	7,700	1,440.00	11,088,000
石原産業	18,900	821.00	15,516,900
片倉コープアグリ	2,700	1,289.00	3,480,300
日本曹達	14,700	3,385.00	49,759,500
東ソー	163,100	1,989.00	324,405,900
トクヤマ	31,300	2,682.00	83,946,600
セントラル硝子	20,100	2,301.00	46,250,100
東亜合成	64,400	1,243.00	80,049,200
大阪ソーダ	10,700	2,643.00	28,280,100
関東電化工業	25,000	887.00	22,175,000
デンカ	38,500	4,120.00	158,620,000
信越化学工業	195,100	18,740.00	3,656,174,000
日本カーバイド工業	3,700	1,338.00	4,950,600
堺化学工業	7,400	1,976.00	14,622,400
第一稀元素化学工業	10,600	1,046.00	11,087,600
エア・ウォーター	107,600	1,743.00	187,546,800

日本酸素ホールディングス	86,900	2,009.00	174,582,100
日本化学工業	3,000	3,310.00	9,930,000
東邦アセチレン	1,600	1,369.00	2,190,400
日本パーカラライジング	53,200	1,101.00	58,573,200
高压ガス工業	16,700	739.00	12,341,300
チタン工業	1,300	2,145.00	2,788,500
四国化成工業	14,000	1,261.00	17,654,000
戸田工業	2,200	2,171.00	4,776,200
ステラ ケミファ	5,700	3,275.00	18,667,500
保土谷化学工業	3,100	4,930.00	15,283,000
日本触媒	19,100	5,790.00	110,589,000
大日精化工業	8,700	2,404.00	20,914,800
カネカ	27,300	4,275.00	116,707,500
三菱瓦斯化学	105,700	2,597.00	274,502,900
三井化学	91,100	3,240.00	295,164,000
J S R	105,900	3,390.00	359,001,000
東京応化工業	18,100	6,810.00	123,261,000
大阪有機化学工業	9,700	3,840.00	37,248,000
三菱ケミカルホールディングス	705,300	731.50	515,926,950
K Hネオケム	17,400	2,508.00	43,639,200
ダイセル	141,800	775.00	109,895,000
住友ベークライト	16,600	4,435.00	73,621,000
積水化学工業	223,100	2,021.00	450,885,100
日本ゼオン	95,100	1,654.00	157,295,400
アイカ工業	29,400	3,840.00	112,896,000
宇部興産	53,300	2,141.00	114,115,300
積水樹脂	17,400	2,066.00	35,948,400
タキロンシーアイ	22,800	691.00	15,754,800
旭有機材	6,000	1,473.00	8,838,000
ニチバン	5,500	1,822.00	10,021,000
リケンテクノス	25,700	495.00	12,721,500
大倉工業	5,000	2,000.00	10,000,000
積水化成成品工業	14,100	561.00	7,910,100
群栄化学工業	2,400	2,502.00	6,004,800
タイガースポリマー	5,500	467.00	2,568,500
ミライアル	3,400	1,216.00	4,134,400
ダイキアクシス	3,800	983.00	3,735,400
ダイキョーニシカワ	22,200	799.00	17,737,800
竹本容器	3,800	867.00	3,294,600
森六ホールディングス	5,700	2,047.00	11,667,900
恵和	1,500	1,933.00	2,899,500
日本化薬	65,300	1,060.00	69,218,000

カーリットホールディングス	10,500	728.00	7,644,000
日本精化	7,600	1,417.00	10,769,200
扶桑化学工業	8,300	3,970.00	32,951,000
トリケミカル研究所	9,200	4,250.00	39,100,000
A D E K A	48,600	1,863.00	90,541,800
日油	39,700	5,850.00	232,245,000
新日本理化	17,500	279.00	4,882,500
ハリマ化成グループ	7,900	948.00	7,489,200
花王	257,900	7,270.00	1,874,933,000
第一工業製薬	3,600	3,770.00	13,572,000
石原ケミカル	2,700	2,210.00	5,967,000
日華化学	3,600	888.00	3,196,800
ニイタカ	2,200	2,704.00	5,948,800
三洋化成工業	6,300	5,230.00	32,949,000
有機合成薬品工業	8,100	296.00	2,397,600
大日本塗料	11,900	924.00	10,995,600
日本ペイントホールディングス	87,100	8,710.00	758,641,000
関西ペイント	118,500	2,917.00	345,664,500
神東塗料	8,300	201.00	1,668,300
中国塗料	25,400	936.00	23,774,400
日本特殊塗料	7,900	1,154.00	9,116,600
藤倉化成	14,200	525.00	7,455,000
太陽ホールディングス	7,800	5,890.00	45,942,000
D I C	44,600	2,860.00	127,556,000
サカタインクス	23,000	1,103.00	25,369,000
東洋インキS Cホールディングス	22,300	2,007.00	44,756,100
T & K T O K A	8,200	828.00	6,789,600
富士フイルムホールディングス	189,300	6,333.00	1,198,836,900
資生堂	214,100	8,150.00	1,744,915,000
ライオン	140,100	2,175.00	304,717,500
高砂香料工業	6,700	2,609.00	17,480,300
マンダム	22,600	1,870.00	42,262,000
ミルボン	14,400	6,400.00	92,160,000
ファンケル	39,200	4,080.00	159,936,000
コーセー	20,300	18,100.00	367,430,000
コタ	6,200	1,828.00	11,333,600
シーボン	1,400	1,995.00	2,793,000
ポーラ・オルビスホールディングス	46,000	2,476.00	113,896,000
ノエビアホールディングス	9,100	4,865.00	44,271,500
アジュバンコスメジャパン	2,400	1,099.00	2,637,600
新日本製薬	2,200	2,485.00	5,467,000
エステー	6,900	1,973.00	13,613,700

アグロ カネショウ	4,000	1,623.00	6,492,000	
コニシ	17,700	1,678.00	29,700,600	
長谷川香料	18,600	1,951.00	36,288,600	
星光PMC	6,200	773.00	4,792,600	
小林製薬	30,200	10,990.00	331,898,000	
荒川化学工業	9,000	1,295.00	11,655,000	
メック	7,400	2,073.00	15,340,200	
日本高純度化学	3,000	2,688.00	8,064,000	
タカラバイオ	28,200	3,085.00	86,997,000	
JCU	12,100	3,410.00	41,261,000	
新田ゼラチン	6,800	680.00	4,624,000	
OATアグリオ	2,000	1,384.00	2,768,000	
デクセリアルズ	30,000	1,538.00	46,140,000	
アース製薬	8,100	6,070.00	49,167,000	
北興化学工業	10,000	1,046.00	10,460,000	
大成ラミック	3,300	2,935.00	9,685,500	
クミアイ化学工業	44,500	882.00	39,249,000	
日本農薬	19,200	530.00	10,176,000	
アキレス	7,400	1,487.00	11,003,800	
有沢製作所	15,000	982.00	14,730,000	
日東電工	69,000	9,430.00	650,670,000	
レック	12,800	1,356.00	17,356,800	
三光合成	11,300	444.00	5,017,200	
きもと	16,500	197.00	3,250,500	
藤森工業	9,700	4,630.00	44,911,000	
前澤化成工業	6,800	968.00	6,582,400	
未来工業	3,900	1,736.00	6,770,400	
ウェーブロックホールディングス	3,700	734.00	2,715,800	
JSP	6,300	1,815.00	11,434,500	
エフピコ	19,800	4,250.00	84,150,000	
天馬	8,100	2,150.00	17,415,000	
信越ポリマー	16,600	1,027.00	17,048,200	
東リ	26,800	245.00	6,566,000	
ニフコ	39,600	3,795.00	150,282,000	
バルカー	8,800	2,123.00	18,682,400	
ユニ・チャーム	228,400	4,644.00	1,060,689,600	
ショーエイコーポレーション	2,400	1,012.00	2,428,800	
協和キリン	108,400	3,085.00	334,414,000	
武田薬品工業	896,300	3,687.00	3,304,658,100	
アステラス製薬	934,000	1,779.00	1,661,586,000	
大日本住友製薬	79,800	1,701.00	135,739,800	
塩野義製薬	135,500	5,811.00	787,390,500	

わかもと製薬	12,800	245.00	3,136,000
あすか製薬	12,300	1,411.00	17,355,300
日本新薬	30,500	7,810.00	238,205,000
ピオフェルミン製薬	1,800	2,726.00	4,906,800
中外製薬	336,900	5,250.00	1,768,725,000
科研製薬	18,400	4,155.00	76,452,000
エーザイ	119,000	7,625.00	907,375,000
ロート製薬	51,300	2,967.00	152,207,100
小野薬品工業	247,400	3,055.00	755,807,000
久光製薬	31,300	7,070.00	221,291,000
持田製薬	14,900	4,145.00	61,760,500
参天製薬	187,400	1,572.00	294,592,800
扶桑薬品工業	3,500	2,654.00	9,289,000
日本ケミファ	1,300	2,295.00	2,983,500
ツムラ	35,900	3,435.00	123,316,500
日医工	30,500	1,106.00	33,733,000
キッセイ薬品工業	19,100	2,237.00	42,726,700
生化学工業	19,000	1,061.00	20,159,000
栄研化学	18,900	2,142.00	40,483,800
日水製薬	4,000	997.00	3,988,000
鳥居薬品	6,700	3,005.00	20,133,500
JCRファーマ	30,400	3,270.00	99,408,000
東和薬品	15,500	2,230.00	34,565,000
富士製薬工業	7,300	1,280.00	9,344,000
沢井製薬	23,600	4,895.00	115,522,000
ゼリア新薬工業	19,500	2,024.00	39,468,000
第一三共	924,800	3,261.00	3,015,772,800
キョーリン製薬ホールディングス	23,800	1,931.00	45,957,800
大幸薬品	13,200	1,322.00	17,450,400
ダイト	6,900	3,590.00	24,771,000
大塚ホールディングス	223,900	4,469.00	1,000,609,100
大正製薬ホールディングス	25,600	6,920.00	177,152,000
ペプチドリーム	54,700	5,420.00	296,474,000
日本コークス工業	91,000	104.00	9,464,000
ニチレキ	12,700	1,538.00	19,532,600
ユシロ化学工業	6,000	1,085.00	6,510,000
ビーピー・カストロール	3,800	1,237.00	4,700,600
富士石油	26,100	211.00	5,507,100
MORESCO	3,900	1,150.00	4,485,000
出光興産	119,500	2,742.00	327,669,000
Eneosホールディングス	1,620,600	462.90	750,175,740
コスモエネルギーホールディングス	34,000	2,485.00	84,490,000

横浜ゴム	62,400	1,961.00	122,366,400	
TOYO TIRE	56,700	1,906.00	108,070,200	
ブリヂストン	286,400	4,199.00	1,202,593,600	
住友ゴム工業	96,800	1,194.00	115,579,200	
藤倉コンポジット	9,400	435.00	4,089,000	
オカモト	6,600	4,115.00	27,159,000	
フコク	4,700	711.00	3,341,700	
ニッタ	11,100	2,396.00	26,595,600	
住友理工	20,900	641.00	13,396,900	
三ツ星ベルト	13,100	1,726.00	22,610,600	
バンドー化学	18,900	737.00	13,929,300	
日東紡績	16,100	4,390.00	70,679,000	
A G C	98,900	3,905.00	386,204,500	
日本板硝子	54,700	552.00	30,194,400	
石塚硝子	1,800	1,929.00	3,472,200	
日本山村硝子	4,600	918.00	4,222,800	
日本電気硝子	40,000	2,502.00	100,080,000	
オハラ	4,300	2,052.00	8,823,600	
住友大阪セメント	19,400	3,560.00	69,064,000	
太平洋セメント	63,800	2,748.00	175,322,400	
日本ヒューム	10,000	769.00	7,690,000	
日本コンクリート工業	23,500	386.00	9,071,000	
三谷セキサン	5,000	4,820.00	24,100,000	
アジアパイルホールディングス	16,800	530.00	8,904,000	
東海カーボン	105,400	1,515.00	159,681,000	
日本カーボン	6,000	4,095.00	24,570,000	
東洋炭素	6,400	1,987.00	12,716,800	
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	3,615.00	21,690,000	
T O T O	77,000	6,850.00	527,450,000	
日本碍子	118,600	1,881.00	223,086,600	
日本特殊陶業	82,000	1,868.00	153,176,000	
M A R U W A	3,700	10,570.00	39,109,000	
品川リフラクトリーズ	2,600	2,762.00	7,181,200	
黒崎播磨	1,900	4,825.00	9,167,500	
ヨータイ	7,800	1,038.00	8,096,400	
イソライト工業	4,900	649.00	3,180,100	
東京窯業	14,000	324.00	4,536,000	
ニッカトー	5,000	717.00	3,585,000	
フジミインコーポレーテッド	8,700	4,225.00	36,757,500	
クニミネ工業	3,500	1,211.00	4,238,500	
エーアンドエーマテリアル	2,100	1,070.00	2,247,000	
ニチアス	27,300	2,486.00	67,867,800	

ニチハ	15,000	3,045.00	45,675,000
日本製鉄	508,600	1,551.50	789,092,900
神戸製鋼所	195,100	636.00	124,083,600
中山製鋼所	14,900	401.00	5,974,900
合同製鐵	5,800	2,080.00	12,064,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	308,300	1,113.00	343,137,900
東京製鐵	41,600	722.00	30,035,200
共英製鋼	12,100	1,432.00	17,327,200
大和工業	22,700	2,712.00	61,562,400
東京鐵鋼	4,100	2,007.00	8,228,700
大阪製鐵	5,700	1,256.00	7,159,200
淀川製鋼所	14,400	2,303.00	33,163,200
丸一鋼管	34,600	2,502.00	86,569,200
モリ工業	3,200	2,333.00	7,465,600
大同特殊鋼	17,500	4,695.00	82,162,500
日本高周波鋼業	4,100	364.00	1,492,400
日本冶金工業	8,300	2,119.00	17,587,700
山陽特殊製鋼	12,800	1,749.00	22,387,200
愛知製鋼	6,000	3,275.00	19,650,000
日立金属	100,400	1,722.00	172,888,800
日本金属	2,700	1,144.00	3,088,800
大平洋金属	7,200	2,500.00	18,000,000
新日本電工	68,900	298.00	20,532,200
栗本鐵工所	4,900	1,765.00	8,648,500
虹技	1,500	1,172.00	1,758,000
三菱製鋼	8,000	764.00	6,112,000
日亜鋼業	15,800	294.00	4,645,200
日本精線	1,500	3,655.00	5,482,500
エンビプロ・ホールディングス	4,600	755.00	3,473,000
シンニッタン	13,100	219.00	2,868,900
新家工業	2,700	1,477.00	3,987,900
大紀アルミニウム工業所	16,200	802.00	12,992,400
日本輕金属ホールディングス	29,100	2,167.00	63,059,700
三井金属鋁業	28,800	3,885.00	111,888,000
東邦亜鉛	5,900	2,415.00	14,248,500
三菱マテリアル	70,400	2,598.00	182,899,200
住友金属鋁山	136,200	5,578.00	759,723,600
D O W A ホールディングス	27,000	4,175.00	112,725,000
古河機械金属	17,700	1,352.00	23,930,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,200	818.00	9,161,600
東邦チタニウム	19,200	981.00	18,835,200
U A C J	16,200	2,507.00	40,613,400

C Kサンエツ	2,200	3,955.00	8,701,000
古河電気工業	33,100	2,871.00	95,030,100
住友電気工業	371,800	1,549.50	576,104,100
フジクラ	128,600	525.00	67,515,000
昭和電線ホールディングス	10,400	1,753.00	18,231,200
東京特殊電線	1,400	2,596.00	3,634,400
タツタ電線	18,900	651.00	12,303,900
カナレ電気	1,800	1,758.00	3,164,400
平河ヒューテック	6,000	1,189.00	7,134,000
リョービ	13,200	1,306.00	17,239,200
アーレスティ	13,300	405.00	5,386,500
アサヒホールディングス	20,000	4,315.00	86,300,000
稲葉製作所	6,000	1,427.00	8,562,000
宮地エンジニアリンググループ	3,500	2,221.00	7,773,500
トーカロ	27,500	1,403.00	38,582,500
アルファC o	3,800	1,096.00	4,164,800
SUMCO	136,300	2,520.00	343,476,000
川田テクノロジーズ	2,200	4,680.00	10,296,000
RS Technologies	3,500	6,330.00	22,155,000
ジェイテックコーポレーション	900	3,595.00	3,235,500
信和	5,700	767.00	4,371,900
東洋製罐グループホールディングス	67,800	1,361.00	92,275,800
ホッカンホールディングス	5,400	1,430.00	7,722,000
コロナ	5,900	951.00	5,610,900
横河ブリッジホールディングス	18,300	1,912.00	34,989,600
駒井ハルテック	2,200	2,089.00	4,595,800
高田機工	1,000	2,640.00	2,640,000
三和ホールディングス	100,400	1,315.00	132,026,000
文化シャッター	31,400	1,000.00	31,400,000
三協立山	13,700	828.00	11,343,600
アルインコ	7,000	974.00	6,818,000
東洋シャッター	2,300	703.00	1,616,900
LIXIL	146,700	3,025.00	443,767,500
日本フィルコン	7,400	500.00	3,700,000
ノーリツ	22,100	1,675.00	37,017,500
長府製作所	10,800	2,108.00	22,766,400
リンナイ	20,700	11,460.00	237,222,000
ダイニチ工業	5,100	852.00	4,345,200
日東精工	13,400	667.00	8,937,800
三洋工業	1,300	1,852.00	2,407,600
岡部	21,600	789.00	17,042,400
ジーテクト	13,200	1,448.00	19,113,600

東プレ	19,900	1,586.00	31,561,400
高周波熱錬	20,500	540.00	11,070,000
東京製綱	7,600	1,445.00	10,982,000
サンコール	9,100	487.00	4,431,700
モリテック スチール	8,300	420.00	3,486,000
パイオラックス	15,800	1,594.00	25,185,200
エイチワン	10,400	772.00	8,028,800
日本発條	106,100	812.00	86,153,200
中央発條	1,300	2,830.00	3,679,000
アドバネクス	1,500	1,599.00	2,398,500
立川ブラインド工業	4,700	1,271.00	5,973,700
三益半導体工業	8,300	2,649.00	21,986,700
日本ドライケミカル	2,700	1,582.00	4,271,400
日本製鋼所	32,400	2,887.00	93,538,800
三浦工業	46,100	6,140.00	283,054,000
タクマ	36,100	2,023.00	73,030,300
ツガミ	22,100	1,635.00	36,133,500
オークマ	12,400	5,970.00	74,028,000
芝浦機械	11,100	2,956.00	32,811,600
アマダ	156,200	1,289.00	201,341,800
アイダエンジニアリング	28,000	957.00	26,796,000
滝澤鉄工所	3,200	1,059.00	3,388,800
F U J I	42,600	2,667.00	113,614,200
牧野フライス製作所	12,500	4,025.00	50,312,500
オーエスジー	52,600	1,973.00	103,779,800
ダイジェット工業	1,300	1,382.00	1,796,600
旭ダイヤモンド工業	28,200	510.00	14,382,000
D M G 森精機	67,500	1,599.00	107,932,500
ソディック	23,300	991.00	23,090,300
ディスコ	14,500	35,500.00	514,750,000
日東工器	5,100	1,858.00	9,475,800
日進工具	4,200	2,746.00	11,533,200
パンチ工業	9,000	599.00	5,391,000
富士ダイス	5,400	657.00	3,547,800
豊和工業	6,000	858.00	5,148,000
O K K	4,100	468.00	1,918,800
東洋機械金属	7,800	458.00	3,572,400
津田駒工業	2,000	887.00	1,774,000
エンシュウ	2,700	880.00	2,376,000
島精機製作所	15,600	2,304.00	35,942,400
オプトラン	13,400	2,775.00	37,185,000
N C ホールディングス	3,300	661.00	2,181,300

イワキポンプ	6,900	836.00	5,768,400	
フリー	10,500	1,120.00	11,760,000	
ヤマシンフィルタ	21,600	890.00	19,224,000	
日阪製作所	13,200	841.00	11,101,200	
やまびこ	20,700	1,177.00	24,363,900	
平田機工	5,000	7,280.00	36,400,000	
ペガサスミシン製造	11,000	460.00	5,060,000	
マルマエ	4,000	1,304.00	5,216,000	
タツモ	4,600	1,644.00	7,562,400	
ナブテスコ	62,800	4,860.00	305,208,000	
三井海洋開発	11,400	1,752.00	19,972,800	
レオン自動機	10,500	1,135.00	11,917,500	
S M C	31,500	65,860.00	2,074,590,000	
ホソカワミクロン	3,800	6,550.00	24,890,000	
ユニオンツール	4,000	3,480.00	13,920,000	
オイレス工業	15,000	1,697.00	25,455,000	
日精エー・エス・ピー機械	3,100	5,630.00	17,453,000	
サトーホールディングス	14,000	2,497.00	34,958,000	
技研製作所	9,400	5,190.00	48,786,000	
日本エアージェット	3,500	1,260.00	4,410,000	
カワタ	3,000	905.00	2,715,000	
日精樹脂工業	8,300	921.00	7,644,300	
オカダアイヨン	3,400	1,190.00	4,046,000	
ワイエイシイホールディングス	4,200	1,004.00	4,216,800	
小松製作所	488,100	3,253.00	1,587,789,300	
住友重機械工業	61,700	2,901.00	178,991,700	
日立建機	50,400	3,325.00	167,580,000	
日工	16,200	727.00	11,777,400	
巴工業	4,300	2,054.00	8,832,200	
井関農機	10,800	1,541.00	16,642,800	
T O W A	10,100	2,179.00	22,007,900	
丸山製作所	2,300	1,648.00	3,790,400	
北川鉄工所	4,900	1,478.00	7,242,200	
ローツェ	4,700	8,110.00	38,117,000	
タカキタ	3,900	685.00	2,671,500	
クボタ	566,000	2,471.50	1,398,869,000	
荏原実業	2,700	4,650.00	12,555,000	
三菱化工機	3,500	2,966.00	10,381,000	
月島機械	19,900	1,293.00	25,730,700	
帝国電機製作所	7,600	1,210.00	9,196,000	
新東工業	25,700	759.00	19,506,300	
澁谷工業	9,400	3,530.00	33,182,000	

アイチ コーポレーション	18,700	897.00	16,773,900
小森コーポレーション	27,500	721.00	19,827,500
鶴見製作所	8,300	1,727.00	14,334,100
住友精密工業	1,600	2,047.00	3,275,200
日本ギア工業	4,500	308.00	1,386,000
酒井重工業	1,900	2,088.00	3,967,200
荏原製作所	44,700	4,110.00	183,717,000
石井鐵工所	1,600	2,938.00	4,700,800
西島製作所	11,000	836.00	9,196,000
北越工業	11,200	1,118.00	12,521,600
ダイキン工業	137,300	22,100.00	3,034,330,000
オルガノ	3,500	6,190.00	21,665,000
トーヨーカネツ	4,100	2,777.00	11,385,700
栗田工業	58,300	4,430.00	258,269,000
椿本チエイン	15,400	2,941.00	45,291,400
大同工業	5,300	775.00	4,107,500
木村化工機	9,200	657.00	6,044,400
アネスト岩田	18,200	1,087.00	19,783,400
ダイフク	59,300	11,310.00	670,683,000
サムコ	2,700	3,695.00	9,976,500
加藤製作所	6,000	1,002.00	6,012,000
油研工業	1,900	1,632.00	3,100,800
タダノ	52,100	1,013.00	52,777,300
フジテック	37,100	2,536.00	94,085,600
C K D	25,000	2,475.00	61,875,000
キトー	9,100	1,472.00	13,395,200
平和	30,100	1,601.00	48,190,100
理想科学工業	8,400	1,365.00	11,466,000
S A N K Y O	25,600	2,954.00	75,622,400
日本金銭機械	12,100	553.00	6,691,300
マースグループホールディングス	6,900	1,595.00	11,005,500
フクシマガリレイ	7,400	4,195.00	31,043,000
オーイズミ	4,700	410.00	1,927,000
ダイコク電機	5,000	944.00	4,720,000
竹内製作所	18,100	2,779.00	50,299,900
アマノ	28,200	2,418.00	68,187,600
J U K I	15,000	830.00	12,450,000
蛇の目マシン工業	9,900	813.00	8,048,700
マックス	14,800	1,614.00	23,887,200
グローリー	27,700	2,290.00	63,433,000
新晃工業	10,000	1,975.00	19,750,000
大和冷機工業	17,400	1,085.00	18,879,000

セガサミーホールディングス	98,000	1,832.00	179,536,000
日本ピストンリング	4,000	1,040.00	4,160,000
リケン	5,000	2,249.00	11,245,000
T P R	14,500	1,523.00	22,083,500
ツバキ・ナカシマ	20,700	1,274.00	26,371,800
ホシザキ	33,900	9,650.00	327,135,000
大豊工業	8,900	753.00	6,701,700
日本精工	221,300	1,014.00	224,398,200
N T N	249,300	315.00	78,529,500
ジェイテクト	103,400	1,146.00	118,496,400
不二越	10,000	4,685.00	46,850,000
日本トムソン	29,600	569.00	16,842,400
T H K	67,200	3,640.00	244,608,000
ユーシン精機	7,200	945.00	6,804,000
前澤給装工業	3,900	2,233.00	8,708,700
イーグル工業	13,400	1,153.00	15,450,200
前澤工業	6,600	572.00	3,775,200
日本ピラー工業	10,900	1,723.00	18,780,700
キッツ	33,400	582.00	19,438,800
マキタ	140,500	4,695.00	659,647,500
日立造船	85,600	707.00	60,519,200
三菱重工業	169,300	3,055.00	517,211,500
I H I	72,500	1,899.00	137,677,500
スター精密	16,600	1,618.00	26,858,800
日清紡ホールディングス	66,000	804.00	53,064,000
イビデン	52,000	4,820.00	250,640,000
コニカミノルタ	219,700	550.00	120,835,000
ブラザー工業	131,800	2,262.00	298,131,600
ミネベアミツミ	185,900	2,670.00	496,353,000
日立製作所	518,000	4,934.00	2,555,812,000
三菱電機	1,077,300	1,601.50	1,725,295,950
富士電機	64,900	4,665.00	302,758,500
東洋電機製造	4,300	1,210.00	5,203,000
安川電機	116,000	5,670.00	657,720,000
シンフォニアテクノロジー	14,000	1,339.00	18,746,000
明電舎	18,300	2,372.00	43,407,600
オリジン	3,000	1,373.00	4,119,000
山洋電気	5,300	6,040.00	32,012,000
デンヨー	9,200	2,117.00	19,476,400
東芝テック	11,600	3,860.00	44,776,000
芝浦メカトロニクス	2,000	5,070.00	10,140,000
マブチモーター	29,900	4,885.00	146,061,500

日本電産	259,300	14,650.00	3,798,745,000
トレックス・セミコンダクター	6,200	1,609.00	9,975,800
東光高岳	5,900	1,560.00	9,204,000
ダイヘン	11,800	4,680.00	55,224,000
ヤーマン	17,900	1,935.00	34,636,500
JVCケンウッド	96,700	193.00	18,663,100
ミマキエンジニアリング	10,900	569.00	6,202,100
I-PEX	5,300	2,024.00	10,727,200
日新電機	25,300	1,270.00	32,131,000
大崎電気工業	21,600	609.00	13,154,400
オムロン	89,700	9,420.00	844,974,000
日東工業	15,900	2,094.00	33,294,600
I D E C	14,500	1,881.00	27,274,500
正興電機製作所	2,800	2,253.00	6,308,400
不二電機工業	2,300	1,271.00	2,923,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	38,900	3,370.00	131,093,000
サクサホールディングス	2,600	1,495.00	3,887,000
メルコホールディングス	3,900	3,910.00	15,249,000
テクノメディカ	2,800	1,615.00	4,522,000
日本電気	136,900	6,290.00	861,101,000
富士通	96,900	15,905.00	1,541,194,500
沖電気工業	43,800	1,050.00	45,990,000
岩崎通信機	4,700	873.00	4,103,100
電気興業	5,200	2,943.00	15,303,600
サンケン電気	12,600	5,580.00	70,308,000
ナカヨ	2,200	1,440.00	3,168,000
アイホン	6,100	1,753.00	10,693,300
ルネサスエレクトロニクス	463,900	1,255.00	582,194,500
セイコーエプソン	133,700	1,768.00	236,381,600
ワコム	78,800	796.00	62,724,800
アルバック	19,800	5,110.00	101,178,000
アクセル	5,400	800.00	4,320,000
E I Z O	9,100	3,830.00	34,853,000
日本信号	25,200	957.00	24,116,400
京三製作所	23,300	426.00	9,925,800
能美防災	14,500	2,256.00	32,712,000
ホーチキ	8,300	1,294.00	10,740,200
星和電機	6,400	616.00	3,942,400
エレコム	12,500	4,980.00	62,250,000
パナソニック	1,148,900	1,441.50	1,656,139,350
シャープ	124,700	2,140.00	266,858,000
アンリツ	64,800	2,380.00	154,224,000

富士通ゼネラル	32,900	2,986.00	98,239,400
ソニー	674,800	11,980.00	8,084,104,000
T D K	52,100	16,260.00	847,146,000
帝国通信工業	5,300	1,143.00	6,057,900
タムラ製作所	38,900	556.00	21,628,400
アルプスアルパイン	88,500	1,437.00	127,174,500
池上通信機	3,400	833.00	2,832,200
鈴木	5,400	1,071.00	5,783,400
日本トリム	2,500	4,390.00	10,975,000
ローランド ディー . ジー .	6,700	1,909.00	12,790,300
フォスター電機	11,400	1,307.00	14,899,800
S M K	2,800	3,015.00	8,442,000
ヨコオ	8,100	2,997.00	24,275,700
ホシデン	30,100	1,087.00	32,718,700
ヒロセ電機	16,600	16,780.00	278,548,000
日本航空電子工業	24,800	1,696.00	42,060,800
T O A	12,800	903.00	11,558,400
マクセルホールディングス	21,900	1,444.00	31,623,600
古野電気	14,500	1,144.00	16,588,000
ユニデンホールディングス	2,800	2,356.00	6,596,800
スミダコーポレーション	9,900	1,027.00	10,167,300
アイコム	4,500	2,780.00	12,510,000
リオン	4,700	2,935.00	13,794,500
本多通信工業	9,700	523.00	5,073,100
横河電機	107,900	2,143.00	231,229,700
新電元工業	4,200	3,160.00	13,272,000
アズビル	72,900	5,010.00	365,229,000
東亜ディーケーケー	6,100	832.00	5,075,200
日本光電工業	44,700	3,020.00	134,994,000
チノー	3,500	1,393.00	4,875,500
共和電業	11,500	385.00	4,427,500
日本電子材料	4,000	1,903.00	7,612,000
堀場製作所	21,400	6,740.00	144,236,000
アドバンテスト	80,100	9,670.00	774,567,000
小野測器	5,700	545.00	3,106,500
エスペック	9,900	1,927.00	19,077,300
キーエンス	105,700	56,750.00	5,998,475,000
日置電機	5,300	3,810.00	20,193,000
シスメックス	84,100	11,760.00	989,016,000
日本マイクロニクス	19,100	1,888.00	36,060,800
メガチップス	11,000	3,445.00	37,895,000
O B A R A G R O U P	6,500	3,970.00	25,805,000

澤藤電機	1,500	2,319.00	3,478,500
原田工業	5,100	914.00	4,661,400
コーセル	13,700	1,164.00	15,946,800
イリソ電子工業	9,200	5,040.00	46,368,000
オブテックスグループ	18,000	1,762.00	31,716,000
千代田インテグレ	4,900	1,800.00	8,820,000
アイ・オー・データ機器	4,600	1,003.00	4,613,800
レーザーテック	47,300	14,580.00	689,634,000
スタンレー電気	75,700	3,440.00	260,408,000
岩崎電気	4,400	1,521.00	6,692,400
ウシオ電機	55,700	1,377.00	76,698,900
岡谷電機産業	9,400	375.00	3,525,000
ハリオス テクノ ホールディング	11,900	344.00	4,093,600
エノモト	3,400	1,868.00	6,351,200
日本セラミック	11,200	2,740.00	30,688,000
遠藤照明	6,600	647.00	4,270,200
古河電池	8,100	1,588.00	12,862,800
双信電機	6,800	447.00	3,039,600
山一電機	7,500	1,480.00	11,100,000
図研	7,200	2,950.00	21,240,000
日本電子	19,800	4,315.00	85,437,000
カシオ計算機	86,700	2,055.00	178,168,500
ファナック	94,600	27,585.00	2,609,541,000
日本シイエムケイ	24,800	437.00	10,837,600
エンプラス	5,000	4,645.00	23,225,000
大真空	3,900	2,680.00	10,452,000
ローム	44,800	11,470.00	513,856,000
浜松ホトニクス	77,400	6,820.00	527,868,000
三井ハイテック	10,700	4,535.00	48,524,500
新光電気工業	36,400	3,035.00	110,474,000
京セラ	164,300	6,944.00	1,140,899,200
太陽誘電	48,000	5,840.00	280,320,000
村田製作所	316,500	9,882.00	3,127,653,000
双葉電子工業	19,100	968.00	18,488,800
北陸電気工業	4,700	937.00	4,403,900
ニチコン	34,500	1,147.00	39,571,500
日本ケミコン	10,900	1,847.00	20,132,300
K O A	15,300	1,520.00	23,256,000
市光工業	17,000	763.00	12,971,000
小糸製作所	64,600	7,750.00	500,650,000
ミツバ	19,800	624.00	12,355,200
S C R E E Nホールディングス	18,700	9,370.00	175,219,000

キヤノン電子	10,300	1,692.00	17,427,600
キヤノン	535,300	2,338.50	1,251,799,050
リコー	274,200	948.00	259,941,600
象印マホービン	29,500	1,824.00	53,808,000
MUTOHホールディングス	1,800	1,590.00	2,862,000
東京エレクトロン	63,100	46,300.00	2,921,530,000
トヨタ紡織	31,400	1,733.00	54,416,200
芦森工業	2,100	1,031.00	2,165,100
ユニプレス	17,700	962.00	17,027,400
豊田自動織機	87,200	9,520.00	830,144,000
モリタホールディングス	17,300	1,813.00	31,364,900
三櫻工業	14,900	940.00	14,006,000
デンソー	237,200	6,672.00	1,582,598,400
東海理化電機製作所	28,400	1,806.00	51,290,400
三井E & Sホールディングス	41,700	441.00	18,389,700
川崎重工業	83,800	2,307.00	193,326,600
名村造船所	32,400	193.00	6,253,200
日本車輛製造	3,900	2,491.00	9,714,900
三菱ロジスネクスト	14,300	1,154.00	16,502,200
近畿車輛	1,800	1,254.00	2,257,200
日産自動車	1,270,500	587.20	746,037,600
いすゞ自動車	312,100	1,124.00	350,800,400
トヨタ自動車	1,091,300	8,060.00	8,795,878,000
日野自動車	134,500	1,017.00	136,786,500
三菱自動車工業	398,700	293.00	116,819,100
エフテック	7,600	667.00	5,069,200
レシップホールディングス	4,300	600.00	2,580,000
GMB	2,000	921.00	1,842,000
ファルテック	2,000	821.00	1,642,000
武蔵精密工業	24,000	1,897.00	45,528,000
日産車体	15,800	808.00	12,766,400
新明和工業	30,400	961.00	29,214,400
極東開発工業	18,600	1,605.00	29,853,000
トピー工業	8,900	1,448.00	12,887,200
ティラド	3,400	1,849.00	6,286,600
曙ブレーキ工業	59,100	164.00	9,692,400
タチエス	16,600	1,101.00	18,276,600
NOK	52,200	1,473.00	76,890,600
フタバ産業	27,100	540.00	14,634,000
KYB	12,100	3,010.00	36,421,000
大同メタル工業	22,400	558.00	12,499,200
プレス工業	53,600	332.00	17,795,200

ミクニ	13,900	287.00	3,989,300
太平洋工業	22,600	1,214.00	27,436,400
河西工業	14,700	418.00	6,144,600
アイシン精機	78,900	3,640.00	287,196,000
マツダ	338,100	859.00	290,427,900
今仙電機製作所	9,500	770.00	7,315,000
本田技研工業	848,200	2,977.50	2,525,515,500
スズキ	213,500	4,918.00	1,049,993,000
S U B A R U	308,700	2,035.00	628,204,500
安永	5,200	1,186.00	6,167,200
ヤマハ発動機	152,200	2,410.00	366,802,000
T B K	12,900	438.00	5,650,200
エクセディ	14,700	1,645.00	24,181,500
豊田合成	34,800	2,856.00	99,388,800
愛三工業	17,000	578.00	9,826,000
盟和産業	1,700	888.00	1,509,600
日本プラスト	9,200	596.00	5,483,200
ヨロズ	9,300	1,309.00	12,173,700
エフ・シー・シー	17,600	1,743.00	30,676,800
シマノ	40,300	25,405.00	1,023,821,500
テイ・エス テック	25,000	3,050.00	76,250,000
ジャムコ	6,300	888.00	5,594,400
テルモ	330,200	4,278.00	1,412,595,600
クリエートメディック	3,600	970.00	3,492,000
日機装	34,800	1,075.00	37,410,000
日本エム・ディ・エム	6,200	2,006.00	12,437,200
島津製作所	138,600	4,365.00	604,989,000
J M S	9,100	983.00	8,945,300
長野計器	7,800	1,006.00	7,846,800
ブイ・テクノロジー	5,100	5,940.00	30,294,000
東京計器	6,900	927.00	6,396,300
愛知時計電機	1,400	4,395.00	6,153,000
インターアクション	5,400	2,691.00	14,531,400
オーバル	9,700	305.00	2,958,500
東京精密	18,100	5,130.00	92,853,000
マニー	42,900	2,695.00	115,615,500
ニコン	164,500	919.00	151,175,500
トプコン	54,300	1,270.00	68,961,000
オリンパス	596,100	2,240.50	1,335,562,050
理研計器	9,500	2,791.00	26,514,500
タムロン	8,700	1,969.00	17,130,300
H O Y A	213,700	13,060.00	2,790,922,000

シード	4,600	656.00	3,017,600
ノーリツ銅機	9,700	2,385.00	23,134,500
エー・アンド・デイ	9,100	1,223.00	11,129,300
朝日インテック	113,400	3,280.00	371,952,000
シチズン時計	136,800	388.00	53,078,400
リズム	3,400	790.00	2,686,000
大研医器	8,600	573.00	4,927,800
メニコン	16,500	6,810.00	112,365,000
シンシア	1,200	772.00	926,400
松風	5,000	1,808.00	9,040,000
セイコーホールディングス	15,300	1,680.00	25,704,000
ニプロ	80,300	1,388.00	111,456,400
中本パックス	2,700	1,758.00	4,746,600
スノーピーク	6,400	3,170.00	20,288,000
パラマウントベッドホールディングス	10,300	4,540.00	46,762,000
トランザクション	5,900	1,168.00	6,891,200
粧美堂	3,100	404.00	1,252,400
ニホンフラッシュ	9,200	1,226.00	11,279,200
前田工織	11,900	2,966.00	35,295,400
永大産業	14,100	302.00	4,258,200
アートネイチャー	10,400	670.00	6,968,000
バンダイナムコホールディングス	89,100	8,744.00	779,090,400
アイフィスジャパン	2,700	707.00	1,908,900
共立印刷	18,000	126.00	2,268,000
S H O E I	9,400	4,260.00	40,044,000
フランスベッドホールディングス	13,800	962.00	13,275,600
パイロットコーポレーション	19,100	3,305.00	63,125,500
萩原工業	6,000	1,496.00	8,976,000
トッパン・フォームズ	19,200	1,040.00	19,968,000
フジシールインターナショナル	22,100	2,149.00	47,492,900
タカラトミー	48,300	999.00	48,251,700
廣濟堂	7,500	936.00	7,020,000
エステールホールディングス	2,900	646.00	1,873,400
タカノ	3,700	609.00	2,253,300
プロネクサス	9,200	1,208.00	11,113,600
ホクシン	6,600	118.00	778,800
ウッドワン	3,600	1,075.00	3,870,000
大建工業	7,200	2,012.00	14,486,400
凸版印刷	163,700	1,681.00	275,179,700
大日本印刷	130,100	1,943.00	252,784,300
共同印刷	3,300	3,100.00	10,230,000
N I S S H A	22,100	1,441.00	31,846,100

光村印刷	900	1,790.00	1,611,000
TAKARA & COMPANY	5,300	1,745.00	9,248,500
アシックス	95,300	1,777.00	169,348,100
ツツミ	2,700	2,094.00	5,653,800
ローランド	6,200	3,500.00	21,700,000
小松ウオール工業	3,300	1,934.00	6,382,200
ヤマハ	64,100	5,770.00	369,857,000
河合楽器製作所	3,000	3,650.00	10,950,000
クリナップ	10,000	510.00	5,100,000
ピジョン	69,200	4,090.00	283,028,000
オリバー	2,300	2,573.00	5,917,900
兼松サステック	700	1,759.00	1,231,300
キングジム	9,000	887.00	7,983,000
リンテック	23,100	2,415.00	55,786,500
イトーキ	21,400	364.00	7,789,600
任天堂	61,700	68,030.00	4,197,451,000
三菱鉛筆	17,700	1,400.00	24,780,000
タカラスタANDARD	22,300	1,571.00	35,033,300
コクヨ	51,700	1,423.00	73,569,100
ナカバヤシ	10,600	620.00	6,572,000
グローブライド	5,200	4,060.00	21,112,000
オカムラ	41,300	1,073.00	44,314,900
美津濃	10,700	2,228.00	23,839,600
東京電力ホールディングス	913,700	358.00	327,104,600
中部電力	329,600	1,322.50	435,896,000
関西電力	408,200	1,072.50	437,794,500
中国電力	155,400	1,304.00	202,641,600
北陸電力	98,500	674.00	66,389,000
東北電力	252,300	945.00	238,423,500
四国電力	89,500	761.00	68,109,500
九州電力	237,900	930.00	221,247,000
北海道電力	100,800	465.00	46,872,000
沖縄電力	20,900	1,457.00	30,451,300
電源開発	85,700	1,761.00	150,917,700
エフオン	6,500	1,048.00	6,812,000
イーレックス	15,800	1,735.00	27,413,000
レノバ	18,100	3,375.00	61,087,500
東京瓦斯	207,200	2,313.00	479,253,600
大阪瓦斯	195,100	1,964.00	383,176,400
東邦瓦斯	53,000	6,470.00	342,910,000
北海道瓦斯	5,800	1,607.00	9,320,600
広島ガス	22,200	381.00	8,458,200

西部瓦斯	12,100	2,936.00	35,525,600
静岡ガス	30,600	957.00	29,284,200
メタウォーター	12,100	2,180.00	26,378,000
SBSホールディングス	8,000	2,541.00	20,328,000
東武鉄道	112,300	3,040.00	341,392,000
相鉄ホールディングス	36,900	2,473.00	91,253,700
東急	271,700	1,453.00	394,780,100
京浜急行電鉄	138,300	1,807.00	249,908,100
小田急電鉄	172,500	3,225.00	556,312,500
京王電鉄	60,200	8,380.00	504,476,000
京成電鉄	80,700	3,790.00	305,853,000
富士急行	14,700	5,790.00	85,113,000
新京成電鉄	2,800	2,245.00	6,286,000
東日本旅客鉄道	189,600	7,625.00	1,445,700,000
西日本旅客鉄道	96,000	6,312.00	605,952,000
東海旅客鉄道	89,600	17,600.00	1,576,960,000
西武ホールディングス	129,800	1,298.00	168,480,400
鴻池運輸	17,100	1,090.00	18,639,000
西日本鉄道	29,900	3,015.00	90,148,500
ハマキョウレックス	8,300	3,345.00	27,763,500
サカイ引越センター	5,000	4,900.00	24,500,000
近鉄グループホールディングス	102,000	4,560.00	465,120,000
阪急阪神ホールディングス	136,100	3,625.00	493,362,500
南海電気鉄道	48,400	2,611.00	126,372,400
京阪ホールディングス	45,400	4,910.00	222,914,000
神戸電鉄	2,400	3,680.00	8,832,000
名古屋鉄道	83,900	2,763.00	231,815,700
山陽電気鉄道	7,300	1,995.00	14,563,500
日本通運	35,300	7,990.00	282,047,000
ヤマトホールディングス	143,000	2,854.00	408,122,000
山九	26,200	4,470.00	117,114,000
丸運	5,800	256.00	1,484,800
丸全昭和運輸	8,300	3,130.00	25,979,000
センコーグループホールディングス	56,300	1,040.00	58,552,000
トナミホールディングス	2,400	5,440.00	13,056,000
ニッコンホールディングス	34,200	2,154.00	73,666,800
日本石油輸送	1,100	2,661.00	2,927,100
福山通運	13,100	4,335.00	56,788,500
セイノーホールディングス	76,400	1,534.00	117,197,600
エスライン	2,800	883.00	2,472,400
神奈川中央交通	2,500	3,825.00	9,562,500
日立物流	22,400	3,355.00	75,152,000

丸和運輸機関	21,500	2,177.00	46,805,500
C & F ロジホールディングス	10,300	1,796.00	18,498,800
九州旅客鉄道	78,900	2,553.00	201,431,700
S Gホールディングス	192,800	2,655.00	511,884,000
日本郵船	85,600	3,055.00	261,508,000
商船三井	60,800	3,355.00	203,984,000
川崎汽船	31,400	2,065.00	64,841,000
N S ユナイテッド海運	5,400	1,607.00	8,677,800
飯野海運	49,300	453.00	22,332,900
共栄タンカー	2,600	1,011.00	2,628,600
乾汽船	5,200	935.00	4,862,000
日本航空	248,500	2,416.00	600,376,000
A N Aホールディングス	275,400	2,550.50	702,407,700
パスコ	2,000	1,370.00	2,740,000
トランコム	3,100	8,170.00	25,327,000
日新	8,100	1,391.00	11,267,100
三菱倉庫	35,300	3,390.00	119,667,000
三井倉庫ホールディングス	10,800	2,240.00	24,192,000
住友倉庫	36,700	1,463.00	53,692,100
澁澤倉庫	5,600	2,290.00	12,824,000
東陽倉庫	17,100	332.00	5,677,200
日本トランスシティ	22,500	569.00	12,802,500
ケイヒン	2,000	1,367.00	2,734,000
中央倉庫	6,200	1,183.00	7,334,600
川西倉庫	1,900	1,198.00	2,276,200
安田倉庫	8,400	946.00	7,946,400
ファイズホールディングス	1,800	1,002.00	1,803,600
東洋埠頭	3,100	1,428.00	4,426,800
宇徳	7,300	466.00	3,401,800
上組	56,900	2,008.00	114,255,200
サンリツ	2,600	701.00	1,822,600
キムラユニティー	2,700	1,127.00	3,042,900
キューソー流通システム	2,500	1,573.00	3,932,500
近鉄エクスプレス	19,300	2,771.00	53,480,300
東海運	5,800	320.00	1,856,000
エーアイティー	6,400	1,072.00	6,860,800
内外トランスライン	3,600	1,293.00	4,654,800
日本コンセプト	3,200	1,653.00	5,289,600
N E C ネットズエスアイ	35,000	1,889.00	66,115,000
クロスキャット	2,900	1,144.00	3,317,600
システナ	37,800	1,947.00	73,596,600
デジタルアーツ	6,200	10,990.00	68,138,000

日鉄ソリューションズ	15,900	3,225.00	51,277,500
キューブシステム	5,800	1,172.00	6,797,600
エイジア	1,700	1,730.00	2,941,000
コア	4,600	1,541.00	7,088,600
ラクーンホールディングス	7,600	2,231.00	16,955,600
ソリトンシステムズ	5,400	1,862.00	10,054,800
ソフトクリエイイトホールディングス	4,200	2,498.00	10,491,600
T I S	105,800	2,264.00	239,531,200
J N Sホールディングス	5,100	624.00	3,182,400
電算システム	4,000	3,270.00	13,080,000
グリー	65,100	603.00	39,255,300
G M Oペパボ	700	7,090.00	4,963,000
コーエーテクモホールディングス	21,600	6,370.00	137,592,000
三菱総合研究所	4,600	4,105.00	18,883,000
電算	1,200	2,549.00	3,058,800
A G S	5,600	835.00	4,676,000
ファインデックス	9,000	1,222.00	10,998,000
ブレインパッド	2,800	5,080.00	14,224,000
K L a b	19,300	867.00	16,733,100
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	14,200	1,166.00	16,557,200
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	2,262.00	4,071,600
ネクソン	267,000	3,490.00	931,830,000
アイスタイル	32,600	551.00	17,962,600
エムアップホールディングス	2,800	2,695.00	7,546,000
エイチーム	7,400	1,238.00	9,161,200
エニグモ	10,100	1,242.00	12,544,200
テクノスジャパン	8,400	693.00	5,821,200
コロプラ	34,900	910.00	31,759,000
ブロードリーフ	52,700	513.00	27,035,100
クロス・マーケティンググループ	5,100	408.00	2,080,800
デジタルハーツホールディングス	4,900	1,461.00	7,158,900
システム情報	8,100	1,065.00	8,626,500
メディアドゥ	4,000	6,220.00	24,880,000
じげん	26,600	406.00	10,799,600
ブイキューブ	5,800	2,769.00	16,060,200
エンカレッジ・テクノロジー	2,100	610.00	1,281,000
サイバーリンクス	3,500	2,007.00	7,024,500
フィックスターズ	11,400	1,003.00	11,434,200
C A R T A H O L D I N G S	4,400	1,567.00	6,894,800
オブティム	7,400	3,180.00	23,532,000
セレス	3,500	4,355.00	15,242,500
S H I F T	4,700	14,750.00	69,325,000

ティーガイア	11,300	1,877.00	21,210,100
セック	1,600	2,822.00	4,515,200
日本アジアグループ	10,200	1,246.00	12,709,200
テクマトリックス	16,500	1,751.00	28,891,500
プロシップ	3,200	1,356.00	4,339,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,500	2,363.00	60,256,500
GMOペイメントゲートウェイ	22,400	15,830.00	354,592,000
ザッパラス	4,500	464.00	2,088,000
システムリサーチ	3,200	1,842.00	5,894,400
インターネットイニシアティブ	28,200	2,311.00	65,170,200
さくらインターネット	11,600	681.00	7,899,600
ヴィンクス	3,100	1,138.00	3,527,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,400	8,460.00	20,304,000
SRAホールディングス	5,700	2,602.00	14,831,400
システムインテグレータ	3,200	667.00	2,134,400
朝日ネット	8,800	838.00	7,374,400
eBASE	12,800	930.00	11,904,000
アバント	11,400	1,409.00	16,062,600
アドソル日進	3,800	2,738.00	10,404,400
ODKソリューションズ	1,900	716.00	1,360,400
フリービット	6,400	998.00	6,387,200
コムチュア	9,800	2,887.00	28,292,600
サイバーコム	2,000	1,589.00	3,178,000
アステリア	7,800	916.00	7,144,800
アイル	6,000	1,644.00	9,864,000
マークライنز	4,500	2,400.00	10,800,000
メディカル・データ・ビジョン	12,100	2,158.00	26,111,800
gumi	14,800	989.00	14,637,200
ショーケース	2,400	997.00	2,392,800
モバイルファクトリー	2,500	1,041.00	2,602,500
テラスカイ	3,500	3,900.00	13,650,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,800	1,644.00	7,891,200
PCIホールディングス	4,100	1,300.00	5,330,000
パイプドHD	2,300	1,508.00	3,468,400
アイビーシー	1,900	1,034.00	1,964,600
ネオジャパン	2,100	1,795.00	3,769,500
PR TIMES	2,300	3,410.00	7,843,000
ランドコンピュータ	1,700	1,127.00	1,915,900
ダブルスタンダード	1,400	4,155.00	5,817,000
オープンドア	6,300	2,335.00	14,710,500
マイネット	3,500	787.00	2,754,500
アカツキ	4,300	4,340.00	18,662,000

ベネフィットジャパン	900	1,787.00	1,608,300
Ubicomホールディングス	2,800	3,110.00	8,708,000
カナミックネットワーク	9,900	777.00	7,692,300
ノムラシステムコーポレーション	5,100	325.00	1,657,500
チェンジ	14,800	3,465.00	51,282,000
シンクロ・フード	6,800	363.00	2,468,400
オークネット	5,700	1,348.00	7,683,600
キャピタル・アセット・プランニング	1,400	1,002.00	1,402,800
セグエグループ	2,800	1,224.00	3,427,200
エイトレッド	2,100	2,346.00	4,926,600
AOI TYO Holdings	11,100	477.00	5,294,700
マクロミル	21,800	873.00	19,031,400
ビーグリー	2,200	1,469.00	3,231,800
オロ	3,400	3,950.00	13,430,000
ユーザーローカル	1,600	4,620.00	7,392,000
テモナ	2,500	946.00	2,365,000
ニーズウェル	2,300	676.00	1,554,800
サインポスト	2,600	1,017.00	2,644,200
ソルクシーズ	4,200	1,043.00	4,380,600
フェイス	3,500	809.00	2,831,500
プロトコーポレーション	9,600	1,171.00	11,241,600
ハイマックス	2,600	1,727.00	4,490,200
野村総合研究所	192,900	3,565.00	687,688,500
サイバネットシステム	7,700	856.00	6,591,200
CEホールディングス	5,900	547.00	3,227,300
日本システム技術	2,000	1,578.00	3,156,000
インテージホールディングス	13,300	1,197.00	15,920,100
東邦システムサイエンス	3,000	927.00	2,781,000
ソースネクスト	50,700	337.00	17,085,900
インフォコム	9,700	2,808.00	27,237,600
HEROZ	3,000	3,540.00	10,620,000
ラクスル	8,600	3,810.00	32,766,000
IPS	1,900	3,095.00	5,880,500
FIG	12,100	269.00	3,254,900
システムサポート	3,200	1,450.00	4,640,000
イーソル	5,900	1,412.00	8,330,800
アルテリア・ネットワークス	11,800	1,567.00	18,490,600
EduLab	1,000	7,210.00	7,210,000
東海ソフト	1,400	1,139.00	1,594,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,900	2,016.00	3,830,400
東名	700	1,124.00	786,800
ヴィッツ	500	2,285.00	1,142,500

トピラシステムズ	1,200	1,608.00	1,929,600	
Link-U	800	1,405.00	1,124,000	
ギフトィ	4,800	4,450.00	21,360,000	
ベース	900	5,710.00	5,139,000	
フォーカスシステムズ	7,300	933.00	6,810,900	
クレスコ	7,300	1,386.00	10,117,800	
フジ・メディア・ホールディングス	109,800	1,320.00	144,936,000	
オービック	33,300	19,350.00	644,355,000	
ジャストシステム	15,100	6,970.00	105,247,000	
TDCソフト	9,400	949.00	8,920,600	
Zホールディングス	1,452,300	661.00	959,970,300	
トレンドマイクロ	56,500	5,640.00	318,660,000	
IDホールディングス	4,200	1,218.00	5,115,600	
日本オラクル	21,500	11,930.00	256,495,000	
アルファシステムズ	2,900	3,600.00	10,440,000	
フューチャー	12,800	1,900.00	24,320,000	
CAC Holdings	7,000	1,437.00	10,059,000	
S Bテクノロジー	3,900	3,000.00	11,700,000	
トーセ	3,100	814.00	2,523,400	
オービックビジネスコンサルタント	10,800	6,340.00	68,472,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	48,200	3,435.00	165,567,000	
アイティフォー	14,000	863.00	12,082,000	
東計電算	1,600	4,285.00	6,856,000	
エクスネット	1,800	992.00	1,785,600	
大塚商会	57,200	5,140.00	294,008,000	
サイボウズ	12,400	2,497.00	30,962,800	
電通国際情報サービス	13,100	3,830.00	50,173,000	
ACCESS	10,100	835.00	8,433,500	
デジタルガレージ	17,500	4,445.00	77,787,500	
EMシステムズ	17,600	856.00	15,065,600	
ウェザーニューズ	3,200	5,300.00	16,960,000	
CIJ	7,400	872.00	6,452,800	
ビジネスエンジニアリング	1,100	3,230.00	3,553,000	
日本エンタープライズ	11,500	255.00	2,932,500	
WOWOW	5,100	2,872.00	14,647,200	
スカラ	9,600	723.00	6,940,800	
インテリジェント ウェイブ	6,400	688.00	4,403,200	
IMAGICA GROUP	9,300	513.00	4,770,900	
ネットワンシステムズ	43,200	3,300.00	142,560,000	
システムソフト	24,200	135.00	3,267,000	
アルゴグラフィックス	8,300	3,050.00	25,315,000	
マーベラス	16,800	947.00	15,909,600	

エイベックス	18,300	1,493.00	27,321,900
日本ユニシス	36,700	3,245.00	119,091,500
兼松エレクトロニクス	5,800	3,655.00	21,199,000
都築電気	4,000	1,536.00	6,144,000
TBSホールディングス	70,200	2,053.00	144,120,600
日本テレビホールディングス	88,400	1,417.00	125,262,800
朝日放送グループホールディングス	10,700	723.00	7,736,100
テレビ朝日ホールディングス	32,700	2,164.00	70,762,800
スカパーJSAホールディングス	70,000	460.00	32,200,000
テレビ東京ホールディングス	7,800	2,482.00	19,359,600
日本BS放送	3,700	1,168.00	4,321,600
ビジョン	13,300	989.00	13,153,700
スマートバリュー	2,900	912.00	2,644,800
ワイヤレスゲート	4,600	519.00	2,387,400
コネクシオ	6,100	1,396.00	8,515,600
クロップス	2,100	795.00	1,669,500
日本電信電話	1,236,500	2,818.50	3,485,075,250
KDDI	847,800	3,391.00	2,874,889,800
ソフトバンク	960,800	1,448.00	1,391,238,400
光通信	12,500	21,200.00	265,000,000
エムティーアイ	10,400	859.00	8,933,600
GMOインターネット	37,900	3,645.00	138,145,500
ファイバーゲート	3,500	2,132.00	7,462,000
アйдママーケティングコミュニケーション	3,100	485.00	1,503,500
KADOKAWA	28,500	4,180.00	119,130,000
学研ホールディングス	14,300	1,585.00	22,665,500
ゼンリン	19,300	1,355.00	26,151,500
昭文社ホールディングス	4,600	468.00	2,152,800
インプレスホールディングス	8,700	197.00	1,713,900
アイネット	5,500	1,508.00	8,294,000
松竹	7,000	15,630.00	109,410,000
東宝	62,400	4,230.00	263,952,000
東映	3,500	21,300.00	74,550,000
エヌ・ティ・ティ・データ	281,500	1,617.00	455,185,500
ピー・シー・エー	1,600	4,230.00	6,768,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,700	1,709.00	6,323,300
DTS	22,000	2,406.00	52,932,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,100	6,510.00	293,601,000
シーイーシー	11,400	1,465.00	16,701,000
カブコン	45,300	6,700.00	303,510,000
アイ・エス・ビー	5,000	1,239.00	6,195,000
ジャステック	6,900	1,252.00	8,638,800

S C S K	24,400	6,560.00	160,064,000
日本システムウエア	3,600	2,053.00	7,390,800
アイネス	10,500	1,397.00	14,668,500
T K C	9,000	6,660.00	59,940,000
富士ソフト	11,300	5,620.00	63,506,000
N S D	34,100	1,914.00	65,267,400
コナミホールディングス	38,400	7,460.00	286,464,000
福井コンピュータホールディングス	4,900	3,625.00	17,762,500
J B C Cホールディングス	7,300	1,459.00	10,650,700
ミロク情報サービス	10,600	2,246.00	23,807,600
ソフトバンクグループ	838,800	10,530.00	8,832,564,000
ハウスイ	900	963.00	866,700
高千穂交易	4,100	1,214.00	4,977,400
オルバヘルスケアホールディングス	1,700	1,560.00	2,652,000
伊藤忠食品	2,600	5,270.00	13,702,000
エレマテック	8,500	988.00	8,398,000
J A L U X	3,000	1,685.00	5,055,000
あらた	8,400	4,635.00	38,934,000
トーメンデバイス	1,400	3,970.00	5,558,000
東京エレクトロン デバイス	3,500	3,915.00	13,702,500
フィールズ	9,300	615.00	5,719,500
双日	586,000	281.00	164,666,000
アルフレッサ ホールディングス	110,100	2,171.00	239,027,100
横浜冷凍	27,800	901.00	25,047,800
ラサ商事	5,600	913.00	5,112,800
アルコニックス	11,300	1,633.00	18,452,900
神戸物産	73,200	2,924.00	214,036,800
ハイパー	1,700	522.00	887,400
あい ホールディングス	15,200	2,041.00	31,023,200
ディーブイエックス	3,400	1,044.00	3,549,600
ダイワボウホールディングス	9,700	8,130.00	78,861,000
マクニカ・富士エレホールディングス	25,300	2,111.00	53,408,300
ラクト・ジャパン	4,600	2,643.00	12,157,800
グリムス	2,400	1,752.00	4,204,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,500	790.00	14,615,000
八洲電機	8,200	951.00	7,798,200
メディアスホールディングス	6,000	841.00	5,046,000
レスターホールディングス	11,100	2,055.00	22,810,500
ジュテックホールディングス	2,400	1,057.00	2,536,800
大光	4,100	671.00	2,751,100
O C H Iホールディングス	3,100	1,347.00	4,175,700
T O K A Iホールディングス	51,400	956.00	49,138,400

黒谷	2,900	789.00	2,288,100
C o m i n i x	1,900	772.00	1,466,800
三洋貿易	10,700	1,078.00	11,534,600
ビューティガレージ	1,700	2,531.00	4,302,700
ウイン・パートナーズ	7,700	1,165.00	8,970,500
ミタチ産業	3,000	601.00	1,803,000
シップヘルスケアホールディングス	18,700	5,880.00	109,956,000
明治電機工業	3,600	1,413.00	5,086,800
デリカフーズホールディングス	4,200	626.00	2,629,200
スターティアホールディングス	2,100	1,067.00	2,240,700
コメダホールディングス	23,100	1,938.00	44,767,800
ピーバンドットコム	1,400	863.00	1,208,200
アセンテック	2,700	1,689.00	4,560,300
富士興産	3,200	1,287.00	4,118,400
協栄産業	1,200	1,386.00	1,663,200
小野建	9,500	1,323.00	12,568,500
南陽	2,200	1,652.00	3,634,400
佐島電機	6,600	807.00	5,326,200
エコートレーディング	2,300	693.00	1,593,900
伯東	6,500	1,282.00	8,333,000
コンドーテック	8,200	1,068.00	8,757,600
中山福	6,100	517.00	3,153,700
ナガイレーベン	14,100	2,785.00	39,268,500
三菱食品	11,700	2,962.00	34,655,400
松田産業	7,800	1,941.00	15,139,800
第一興商	15,800	4,115.00	65,017,000
メディバルホールディングス	106,300	2,236.00	237,686,800
S P K	4,600	1,268.00	5,832,800
萩原電気ホールディングス	3,900	2,585.00	10,081,500
アズワン	7,600	14,760.00	112,176,000
スズデン	3,700	1,268.00	4,691,600
尾家産業	3,100	1,397.00	4,330,700
シモジマ	6,500	1,399.00	9,093,500
ドウシシャ	10,000	1,832.00	18,320,000
小津産業	2,300	1,919.00	4,413,700
高速	5,600	1,544.00	8,646,400
たけびし	3,700	1,540.00	5,698,000
リックス	2,400	1,544.00	3,705,600
丸文	9,400	529.00	4,972,600
ハピネット	8,900	1,535.00	13,661,500
橋本総業ホールディングス	2,100	2,597.00	5,453,700
日本ライフライン	34,300	1,320.00	45,276,000

タカショー	6,900	806.00	5,561,400
マルカ	3,400	2,017.00	6,857,800
I D O M	35,800	634.00	22,697,200
進和	6,300	2,147.00	13,526,100
エスケイジャパン	2,600	464.00	1,206,400
ダイトロン	4,500	1,567.00	7,051,500
シークス	13,500	1,756.00	23,706,000
田中商事	3,300	702.00	2,316,600
オーハシテクニカ	5,400	1,445.00	7,803,000
白銅	3,800	1,393.00	5,293,400
ダイコー通産	1,000	1,518.00	1,518,000
伊藤忠商事	742,100	3,250.00	2,411,825,000
丸紅	1,046,300	786.60	823,019,580
高島	1,700	1,713.00	2,912,100
長瀬産業	59,700	1,740.00	103,878,000
蝶理	6,800	1,581.00	10,750,800
豊田通商	106,600	4,605.00	490,893,000
三共生興	16,100	499.00	8,033,900
兼松	42,400	1,388.00	58,851,200
ツカモトコーポレーション	1,800	1,511.00	2,719,800
三井物産	861,400	2,214.50	1,907,570,300
日本紙パルプ商事	5,500	3,665.00	20,157,500
カメイ	13,900	1,193.00	16,582,700
東都水産	1,200	3,890.00	4,668,000
O U Gホールディングス	1,700	2,821.00	4,795,700
スターゼン	3,900	4,310.00	16,809,000
山善	41,500	1,010.00	41,915,000
椿本興業	2,000	3,780.00	7,560,000
住友商事	669,600	1,565.50	1,048,258,800
内田洋行	4,200	4,555.00	19,131,000
三菱商事	646,000	2,982.50	1,926,695,000
第一実業	4,800	4,145.00	19,896,000
キャノンマーケティングジャパン	26,300	2,387.00	62,778,100
西華産業	5,600	1,398.00	7,828,800
佐藤商事	8,800	999.00	8,791,200
菱洋エレクトロ	8,100	2,831.00	22,931,100
東京産業	9,600	673.00	6,460,800
ユアサ商事	10,900	3,080.00	33,572,000
神鋼商事	2,400	1,919.00	4,605,600
トルク	6,400	257.00	1,644,800
阪和興業	21,200	2,857.00	60,568,400
正栄食品工業	6,900	3,910.00	26,979,000

カナデン	8,600	1,266.00	10,887,600
菱電商事	7,700	1,573.00	12,112,100
フルサト工業	5,400	1,322.00	7,138,800
岩谷産業	25,500	6,360.00	162,180,000
ナイス	4,200	1,794.00	7,534,800
昭光通商	3,400	752.00	2,556,800
ニチモウ	1,700	1,934.00	3,287,800
極東貿易	3,100	1,415.00	4,386,500
イワキ	14,000	620.00	8,680,000
三愛石油	26,100	1,077.00	28,109,700
稲畑産業	25,500	1,532.00	39,066,000
G S I クレオス	2,600	2,511.00	6,528,600
明和産業	9,800	472.00	4,625,600
クワザワホールディングス	3,800	672.00	2,553,600
ヤマエ久野	7,800	1,063.00	8,291,400
ワキタ	20,900	1,018.00	21,276,200
東邦ホールディングス	34,000	1,969.00	66,946,000
サンゲツ	28,700	1,604.00	46,034,800
ミツウロコグループホールディングス	15,700	1,252.00	19,656,400
シナネンホールディングス	3,900	3,230.00	12,597,000
伊藤忠エネクス	23,500	1,033.00	24,275,500
サンリオ	29,800	1,722.00	51,315,600
サンワテクノス	7,000	1,047.00	7,329,000
リョーサン	11,700	2,274.00	26,605,800
新光商事	14,300	777.00	11,111,100
トーホー	4,800	1,830.00	8,784,000
三信電気	5,700	2,029.00	11,565,300
東陽テクニカ	11,400	1,131.00	12,893,400
モスフードサービス	15,000	3,120.00	46,800,000
加賀電子	9,600	2,388.00	22,924,800
ソーダニッカ	10,200	541.00	5,518,200
立花エレテック	7,900	1,574.00	12,434,600
フォーバル	3,700	843.00	3,119,100
P A L T A C	17,000	5,690.00	96,730,000
三谷産業	14,000	432.00	6,048,000
西本Wismettacホールディングス	2,400	2,911.00	6,986,400
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,541.00	1,541,000
コア商事ホールディングス	3,000	1,258.00	3,774,000
国際紙パルプ商事	22,700	244.00	5,538,800
ヤマタネ	4,600	1,442.00	6,633,200
丸紅建材リース	1,000	1,870.00	1,870,000
日鉄物産	7,600	3,935.00	29,906,000

泉州電業	3,000	3,675.00	11,025,000
トラスコ中山	24,300	2,667.00	64,808,100
オートバックスセブン	39,400	1,431.00	56,381,400
モリト	7,800	614.00	4,789,200
加藤産業	15,300	3,695.00	56,533,500
北恵	2,700	909.00	2,454,300
イノテック	6,000	1,243.00	7,458,000
イエローハット	20,100	1,745.00	35,074,500
J Kホールディングス	9,600	813.00	7,804,800
日伝	8,800	2,199.00	19,351,200
北沢産業	7,300	270.00	1,971,000
杉本商事	5,300	2,424.00	12,847,200
因幡電機産業	28,300	2,550.00	72,165,000
東テク	3,500	2,781.00	9,733,500
ミスミグループ本社	133,000	3,455.00	459,515,000
アルテック	7,900	290.00	2,291,000
タキヒヨー	3,500	1,889.00	6,611,500
蔵王産業	2,100	1,390.00	2,919,000
スズケン	44,900	4,265.00	191,498,500
ジェコス	7,300	960.00	7,008,000
グローセル	11,600	509.00	5,904,400
ローソン	26,900	5,150.00	138,535,000
サンエー	8,100	4,220.00	34,182,000
カワチ薬品	7,500	2,974.00	22,305,000
エービーシー・マート	16,600	6,130.00	101,758,000
ハードオフコーポレーション	5,000	808.00	4,040,000
アスクル	9,300	3,735.00	34,735,500
ゲオホールディングス	14,400	1,172.00	16,876,800
アダストリア	14,800	2,056.00	30,428,800
くら寿司	6,300	7,640.00	48,132,000
キャンドゥ	5,200	1,915.00	9,958,000
アイケイ	2,600	837.00	2,176,200
パルグループホールディングス	9,400	1,640.00	15,416,000
エディオン	45,200	1,076.00	48,635,200
サーラコーポレーション	21,900	584.00	12,789,600
ワッツ	4,900	846.00	4,145,400
ハローズ	4,100	3,000.00	12,300,000
フジオフードグループ本社	8,900	1,296.00	11,534,400
あみやき亭	2,400	2,934.00	7,041,600
大黒天物産	2,600	6,170.00	16,042,000
ハニーズホールディングス	8,600	1,033.00	8,883,800
ファーマライズホールディングス	2,900	782.00	2,267,800

アルペン	8,200	2,320.00	19,024,000
ハブ	3,700	703.00	2,601,100
クオールホールディングス	14,500	1,445.00	20,952,500
ジーンズホールディングス	5,600	7,320.00	40,992,000
ビックカメラ	63,100	1,184.00	74,710,400
D C Mホールディングス	65,700	1,101.00	72,335,700
MonotaRO	75,500	6,860.00	517,930,000
東京一番フーズ	3,100	596.00	1,847,600
きちりホールディングス	3,200	608.00	1,945,600
アークランドサービスホールディングス	9,000	2,146.00	19,314,000
J.フロント リテイリング	126,900	1,012.00	128,422,800
ドトール・日レスホールディングス	16,900	1,655.00	27,969,500
マツモトキヨシホールディングス	43,900	4,280.00	187,892,000
ブロンコビリー	5,700	2,319.00	13,218,300
Z O Z O	62,600	3,590.00	224,734,000
トレジャー・ファクトリー	3,400	808.00	2,747,200
物語コーポレーション	2,800	12,300.00	34,440,000
ココカラファイン	9,500	7,440.00	70,680,000
三越伊勢丹ホールディングス	185,900	732.00	136,078,800
Hamee	2,800	1,672.00	4,681,600
ウエルシアホールディングス	56,200	3,615.00	203,163,000
クリエイトSDホールディングス	15,700	3,395.00	53,301,500
丸善CHIホールディングス	12,400	379.00	4,699,600
ティーライフ	1,800	1,223.00	2,201,400
チムニー	3,400	1,400.00	4,760,000
シュッピン	7,500	1,103.00	8,272,500
オイシックス・ラ・大地	10,600	2,921.00	30,962,600
ネクステージ	18,300	1,721.00	31,494,300
ジョイフル本田	31,200	1,415.00	44,148,000
鳥貴族ホールディングス	3,300	1,759.00	5,804,700
ホットランド	8,100	1,227.00	9,938,700
すかいらーくホールディングス	119,000	1,638.00	194,922,000
SFPホールディングス	5,200	1,446.00	7,519,200
綿半ホールディングス	8,100	1,262.00	10,222,200
ヨシックス	2,200	2,220.00	4,884,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,000	1,127.00	34,937,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,700	1,264.00	7,204,800
B E E N O S	5,000	2,613.00	13,065,000
あさひ	8,000	1,514.00	12,112,000
日本調剤	6,600	1,595.00	10,527,000
コスモス薬品	10,700	15,860.00	169,702,000
トーエル	5,400	831.00	4,487,400

オンリー	2,300	466.00	1,071,800
セブン&アイ・ホールディングス	415,100	4,202.00	1,744,250,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	57,000	840.00	47,880,000
ツルハホールディングス	23,200	14,110.00	327,352,000
サンマルクホールディングス	8,500	1,626.00	13,821,000
フェリシモ	2,500	1,354.00	3,385,000
トリドールホールディングス	26,400	1,505.00	39,732,000
TOKYO BASE	9,900	722.00	7,147,800
ウイルプラスホールディングス	1,900	1,090.00	2,071,000
JMホールディングス	8,100	2,005.00	16,240,500
サツドラホールディングス	1,700	2,033.00	3,456,100
アレンザホールディングス	6,200	1,376.00	8,531,200
串カツ田中ホールディングス	2,900	1,900.00	5,510,000
バロックジャパンリミテッド	7,700	817.00	6,290,900
クスリのアオキホールディングス	10,600	8,840.00	93,704,000
力の源ホールディングス	4,800	624.00	2,995,200
スシローグローバルホールディングス	58,300	4,275.00	249,232,500
メディカルシステムネットワーク	9,600	732.00	7,027,200
はるやまホールディングス	5,300	713.00	3,778,900
ノジマ	19,000	2,911.00	55,309,000
カッパ・クリエイト	14,900	1,511.00	22,513,900
ライトオン	7,900	634.00	5,008,600
良品計画	141,000	2,515.00	354,615,000
三城ホールディングス	13,500	303.00	4,090,500
アドヴァン	11,000	1,119.00	12,309,000
アルビス	3,500	2,456.00	8,596,000
コナカ	12,500	364.00	4,550,000
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,700.00	2,380,000
G - 7ホールディングス	6,300	2,315.00	14,584,500
イオン北海道	14,100	1,154.00	16,271,400
コジマ	18,600	645.00	11,997,000
ヒマラヤ	4,000	973.00	3,892,000
コーナン商事	15,200	3,015.00	45,828,000
エコス	4,000	1,955.00	7,820,000
ワタミ	14,200	1,007.00	14,299,400
マルシェ	3,300	515.00	1,699,500
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	212,100	2,550.00	540,855,000
西松屋チェーン	23,400	1,542.00	36,082,800
ゼンショーホールディングス	57,100	2,885.00	164,733,500
幸楽苑ホールディングス	6,700	1,799.00	12,053,300
ハークスレイ	2,500	904.00	2,260,000

サイゼリヤ	15,800	2,195.00	34,681,000
V Tホールディングス	40,500	424.00	17,172,000
魚力	3,400	1,878.00	6,385,200
フジ・コーポレーション	2,900	2,235.00	6,481,500
ユナイテッドアローズ	12,300	2,032.00	24,993,600
ハイデイ日高	15,400	1,802.00	27,750,800
京都きもの友禅	7,700	251.00	1,932,700
コロワイド	35,300	1,994.00	70,388,200
ピーシーデポコーポレーション	12,800	532.00	6,809,600
壱番屋	7,500	4,990.00	37,425,000
P L A N T	3,000	769.00	2,307,000
スギホールディングス	21,200	7,450.00	157,940,000
薬王堂ホールディングス	4,700	2,716.00	12,765,200
スクロール	15,300	1,251.00	19,140,300
ヨンドシーホールディングス	9,900	1,957.00	19,374,300
木曽路	14,000	2,454.00	34,356,000
S R Sホールディングス	13,500	870.00	11,745,000
リテールパートナーズ	13,000	1,483.00	19,279,000
ケーヨー	19,800	756.00	14,968,800
上新電機	12,500	3,100.00	38,750,000
日本瓦斯	17,500	5,020.00	87,850,000
ロイヤルホールディングス	18,500	1,885.00	34,872,500
いなげや	11,900	1,685.00	20,051,500
島忠	7,200	5,480.00	39,456,000
チヨダ	11,400	1,001.00	11,411,400
ライフコーポレーション	8,100	3,310.00	26,811,000
リンガーハット	13,100	2,405.00	31,505,500
M r M a x H D	14,900	768.00	11,443,200
A O K Iホールディングス	21,600	653.00	14,104,800
オークワ	16,700	1,195.00	19,956,500
コメリ	16,500	2,949.00	48,658,500
青山商事	23,900	778.00	18,594,200
しまむら	12,400	11,430.00	141,732,000
はせがわ	6,400	293.00	1,875,200
高島屋	77,400	1,052.00	81,424,800
松屋	23,300	964.00	22,461,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,400	842.00	42,436,800
近鉄百貨店	4,100	3,375.00	13,837,500
丸井グループ	89,800	2,062.00	185,167,600
アクシアル リテイリング	8,800	4,790.00	42,152,000
イオン	408,300	3,550.00	1,449,465,000
イズミ	21,600	3,910.00	84,456,000

平和堂	19,600	2,059.00	40,356,400
フジ	12,900	1,984.00	25,593,600
ヤオコー	12,100	6,670.00	80,707,000
ゼビオホールディングス	13,100	931.00	12,196,100
ケーズホールディングス	94,700	1,523.00	144,228,100
Olympicグループ	5,700	940.00	5,358,000
日産東京販売ホールディングス	16,500	253.00	4,174,500
シルバーライフ	1,500	2,119.00	3,178,500
Genky DrugStores	4,700	3,595.00	16,896,500
ナルミヤ・インターナショナル	2,300	1,019.00	2,343,700
ブックオフグループホールディングス	6,200	886.00	5,493,200
ギフト	1,100	2,070.00	2,277,000
アインホールディングス	15,400	7,140.00	109,956,000
元気寿司	3,100	2,516.00	7,799,600
ヤマダホールディングス	356,000	542.00	192,952,000
アークランドサカモト	16,800	1,613.00	27,098,400
ニトリホールディングス	42,100	20,685.00	870,838,500
グルメ杵屋	7,800	985.00	7,683,000
愛眼	8,500	230.00	1,955,000
ケーユーホールディングス	5,800	873.00	5,063,400
吉野家ホールディングス	35,000	2,205.00	77,175,000
松屋フーズホールディングス	5,200	3,675.00	19,110,000
サガミホールディングス	14,500	1,167.00	16,921,500
関西スーパーマーケット	8,200	1,145.00	9,389,000
王将フードサービス	7,100	5,850.00	41,535,000
プレナス	12,000	1,923.00	23,076,000
ミニストップ	8,000	1,429.00	11,432,000
アークス	20,300	2,404.00	48,801,200
パローホールディングス	21,800	2,347.00	51,164,600
ベルク	5,300	5,710.00	30,263,000
大庄	5,900	1,035.00	6,106,500
ファーストリテイリング	14,200	104,900.00	1,489,580,000
サンドラッグ	40,000	4,060.00	162,400,000
サクスパー ホールディングス	9,400	639.00	6,006,600
ヤマザワ	2,600	1,749.00	4,547,400
やまや	2,200	2,245.00	4,939,000
ベルーナ	23,000	1,037.00	23,851,000
島根銀行	3,600	679.00	2,444,400
じもとホールディングス	7,200	797.00	5,738,400
めぶきフィナンシャルグループ	552,100	234.00	129,191,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,300	1,231.00	16,372,300
九州フィナンシャルグループ	217,000	451.00	97,867,000

ゆうちょ銀行	301,000	1,006.00	302,806,000
富山第一銀行	25,300	297.00	7,514,100
コンコルディア・フィナンシャルグループ	647,300	426.00	275,749,800
西日本フィナンシャルホールディングス	70,700	710.00	50,197,000
関西みらいフィナンシャルグループ	49,900	611.00	30,488,900
三十三フィナンシャルグループ	9,200	1,369.00	12,594,800
第四北越フィナンシャルグループ	17,300	2,334.00	40,378,200
ひろぎんホールディングス	156,700	650.00	101,855,000
新生銀行	86,600	1,541.00	133,450,600
あおぞら銀行	63,300	2,301.00	145,653,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,268,100	563.30	4,094,120,730
りそなホールディングス	1,155,300	436.30	504,057,390
三井住友トラスト・ホールディングス	200,800	3,613.00	725,490,400
三井住友フィナンシャルグループ	735,300	3,763.00	2,766,933,900
千葉銀行	354,600	711.00	252,120,600
群馬銀行	218,700	348.00	76,107,600
武蔵野銀行	15,800	1,609.00	25,422,200
千葉興業銀行	27,100	272.00	7,371,200
筑波銀行	44,200	187.00	8,265,400
七十七銀行	33,300	1,442.00	48,018,600
青森銀行	8,200	2,462.00	20,188,400
秋田銀行	6,400	1,433.00	9,171,200
山形銀行	11,900	1,115.00	13,268,500
岩手銀行	7,000	2,142.00	14,994,000
東邦銀行	95,000	213.00	20,235,000
東北銀行	5,100	1,087.00	5,543,700
みちのく銀行	6,800	1,066.00	7,248,800
ふくおかフィナンシャルグループ	95,900	2,028.00	194,485,200
静岡銀行	258,800	798.00	206,522,400
十六銀行	13,300	2,000.00	26,600,000
スルガ銀行	93,200	361.00	33,645,200
八十二銀行	239,300	366.00	87,583,800
山梨中央銀行	12,300	906.00	11,143,800
大垣共立銀行	21,000	2,077.00	43,617,000
福井銀行	9,100	1,939.00	17,644,900
北國銀行	9,900	2,690.00	26,631,000
清水銀行	4,400	1,657.00	7,290,800
富山銀行	2,000	2,943.00	5,886,000
滋賀銀行	21,300	2,056.00	43,792,800
南都銀行	15,500	1,836.00	28,458,000
百五銀行	95,600	311.00	29,731,600
京都銀行	38,000	6,610.00	251,180,000

紀陽銀行	37,600	1,446.00	54,369,600
ほくほくフィナンシャルグループ	70,700	976.00	69,003,200
山陰合同銀行	66,900	497.00	33,249,300
中国銀行	91,400	870.00	79,518,000
鳥取銀行	3,400	1,127.00	3,831,800
伊予銀行	140,800	641.00	90,252,800
百十四銀行	11,300	1,599.00	18,068,700
四国銀行	15,100	736.00	11,113,600
阿波銀行	16,300	2,297.00	37,441,100
大分銀行	6,100	2,155.00	13,145,500
宮崎銀行	6,600	2,289.00	15,107,400
佐賀銀行	6,000	1,416.00	8,496,000
沖縄銀行	9,700	2,819.00	27,344,300
琉球銀行	23,100	789.00	18,225,900
セブン銀行	355,000	243.00	86,265,000
みずほフィナンシャルグループ	1,443,800	1,588.50	2,293,476,300
高知銀行	3,900	852.00	3,322,800
山口フィナンシャルグループ	132,600	673.00	89,239,800
長野銀行	3,500	1,307.00	4,574,500
名古屋銀行	8,500	2,842.00	24,157,000
北洋銀行	160,200	237.00	37,967,400
愛知銀行	3,600	2,933.00	10,558,800
中京銀行	3,800	1,785.00	6,783,000
大光銀行	3,600	1,379.00	4,964,400
愛媛銀行	14,800	1,001.00	14,814,800
トマト銀行	4,100	1,070.00	4,387,000
京葉銀行	45,300	436.00	19,750,800
栃木銀行	51,300	180.00	9,234,000
北日本銀行	3,300	1,932.00	6,375,600
東和銀行	18,700	695.00	12,996,500
福島銀行	12,200	275.00	3,355,000
大東銀行	5,100	660.00	3,366,000
トモニホールディングス	82,100	312.00	25,615,200
フィデアホールディングス	103,200	125.00	12,900,000
池田泉州ホールディングス	122,200	163.00	19,918,600
F P G	33,000	614.00	20,262,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,500	1,313.00	7,221,500
マーキュリアインベストメント	4,300	703.00	3,022,900
S B Iホールディングス	130,300	3,120.00	406,536,000
ジャフコ グループ	16,400	6,860.00	112,504,000
大和証券グループ本社	796,000	529.00	421,084,000
野村ホールディングス	1,622,500	632.10	1,025,582,250

岡三証券グループ	90,900	418.00	37,996,200
丸三証券	31,800	625.00	19,875,000
東洋証券	35,900	187.00	6,713,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	113,700	388.00	44,115,600
光世証券	2,800	703.00	1,968,400
水戸証券	28,900	305.00	8,814,500
いちよし証券	21,500	637.00	13,695,500
松井証券	52,200	926.00	48,337,200
マネックスグループ	95,400	974.00	92,919,600
極東証券	14,400	831.00	11,966,400
岩井コスモホールディングス	11,000	1,597.00	17,567,000
藍澤証券	19,200	880.00	16,896,000
マネーパートナーズグループ	12,000	333.00	3,996,000
スパークス・グループ	49,500	337.00	16,681,500
かんぽ生命保険	131,700	2,172.00	286,052,400
S O M P Oホールディングス	187,300	4,124.00	772,425,200
アニコム ホールディングス	29,900	1,078.00	32,232,200
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	258,000	3,133.00	808,314,000
第一生命ホールディングス	561,300	1,902.00	1,067,592,600
東京海上ホールディングス	352,200	5,351.00	1,884,622,200
T & Dホールディングス	317,600	1,467.00	465,919,200
アドバンスクリエイト	2,200	1,818.00	3,999,600
全国保証	27,700	5,160.00	142,932,000
イントラスト	3,100	721.00	2,235,100
日本モーゲージサービス	5,500	1,115.00	6,132,500
C a s a	3,100	1,012.00	3,137,200
アルヒ	15,800	1,641.00	25,927,800
プレミアグループ	4,900	2,432.00	11,916,800
クレディセゾン	62,100	1,323.00	82,158,300
芙蓉総合リース	11,200	7,190.00	80,528,000
みずほリース	16,400	3,375.00	55,350,000
東京センチュリー	24,700	7,350.00	181,545,000
日本証券金融	45,100	611.00	27,556,100
アイフル	178,700	279.00	49,857,300
リコーリース	8,400	3,300.00	27,720,000
イオンフィナンシャルサービス	65,100	1,397.00	90,944,700
アコム	213,800	473.00	101,127,400
ジャックス	11,800	2,083.00	24,579,400
オリエントコーポレーション	288,200	154.00	44,382,800
日立キャピタル	25,100	2,904.00	72,890,400
オリックス	659,200	1,784.00	1,176,012,800
三菱UFJリース	239,900	573.00	137,462,700

九州リースサービス	5,400	643.00	3,472,200
日本取引所グループ	287,100	2,405.50	690,619,050
イー・ギャランティ	12,200	2,172.00	26,498,400
アサックス	5,700	739.00	4,212,300
N E C キャピタルソリューション	4,400	2,000.00	8,800,000
いちご	122,300	338.00	41,337,400
日本駐車場開発	114,300	142.00	16,230,600
スター・マイカ・ホールディングス	6,600	1,194.00	7,880,400
S R E ホールディングス	1,400	4,910.00	6,874,000
A D ワークスグループ	20,300	157.00	3,187,100
ヒューリック	226,500	1,199.00	271,573,500
三栄建築設計	5,000	1,793.00	8,965,000
野村不動産ホールディングス	65,100	2,415.00	157,216,500
三重交通グループホールディングス	24,200	487.00	11,785,400
サムティ	15,800	1,771.00	27,981,800
ディア・ライフ	18,000	428.00	7,704,000
日本商業開発	7,500	1,650.00	12,375,000
ハウスコム	2,800	1,301.00	3,642,800
日本管理センター	6,800	1,222.00	8,309,600
サンセイランディック	4,900	768.00	3,763,200
フージャースホールディングス	17,300	692.00	11,971,600
オープンハウス	33,800	4,100.00	138,580,000
東急不動産ホールディングス	290,800	678.00	197,162,400
飯田グループホールディングス	89,200	2,449.00	218,450,800
イーランド	3,200	866.00	2,771,200
ムゲンエステート	9,300	488.00	4,538,400
ハウズドゥ	5,200	1,170.00	6,084,000
シーアールイー	3,700	1,236.00	4,573,200
グッドコムアセット	6,100	1,410.00	8,601,000
ジェイ・エス・ビー	2,300	3,470.00	7,981,000
テンポイノベーション	4,400	958.00	4,215,200
パーク24	57,600	2,234.00	128,678,400
パラカ	3,600	1,620.00	5,832,000
三井不動産	484,800	2,395.00	1,161,096,000
三菱地所	698,700	1,849.50	1,292,245,650
平和不動産	18,600	3,575.00	66,495,000
東京建物	105,800	1,560.00	165,048,000
ダイビル	28,400	1,304.00	37,033,600
京阪神ビルディング	19,200	1,535.00	29,472,000
住友不動産	239,200	3,675.00	879,060,000
テオオーシー	22,500	780.00	17,550,000
東京楽天地	2,000	4,430.00	8,860,000

スターツコーポレーション	13,100	2,896.00	37,937,600
フジ住宅	14,300	654.00	9,352,200
空港施設	13,200	524.00	6,916,800
明和地所	7,100	645.00	4,579,500
ゴールドクレスト	10,300	1,719.00	17,705,700
エスリード	5,000	1,594.00	7,970,000
日神グループホールディングス	18,700	441.00	8,246,700
日本エスコン	19,300	769.00	14,841,700
タカラレーベン	44,500	350.00	15,575,000
A V A N T I A	7,500	889.00	6,667,500
イオンモール	54,000	1,863.00	100,602,000
毎日コムネット	4,600	690.00	3,174,000
ファースト住建	5,700	1,110.00	6,327,000
カチタス	26,700	3,025.00	80,767,500
トーセイ	15,900	1,027.00	16,329,300
穴吹興産	3,100	1,725.00	5,347,500
サンフロンティア不動産	14,500	928.00	13,456,000
エフ・ジェー・ネクスト	11,600	1,126.00	13,061,600
インテリックス	2,400	578.00	1,387,200
ランドビジネス	3,600	368.00	1,324,800
サンネクスタグループ	4,700	970.00	4,559,000
グランディハウス	10,100	457.00	4,615,700
日本空港ビルデング	34,200	5,230.00	178,866,000
明豊ファシリティワークス	5,000	630.00	3,150,000
日本工営	6,500	2,891.00	18,791,500
L I F U L L	36,400	422.00	15,360,800
ミクシィ	19,700	2,747.00	54,115,900
ジェイエシーリクルートメント	7,000	1,665.00	11,655,000
日本M&Aセンター	84,400	6,090.00	513,996,000
メンバーズ	3,100	2,785.00	8,633,500
中広	2,000	343.00	686,000
UTグループ	14,900	3,285.00	48,946,500
アイティメディア	3,500	1,908.00	6,678,000
タケエイ	11,600	1,272.00	14,755,200
E・Jホールディングス	4,200	997.00	4,187,400
ビーネックスグループ	13,100	1,407.00	18,431,700
コシダカホールディングス	25,200	551.00	13,885,200
アルトナー	2,700	838.00	2,262,600
パソナグループ	11,300	1,923.00	21,729,900
C D S	2,700	1,389.00	3,750,300
リンクアンドモチベーション	18,900	531.00	10,035,900
G C A	13,700	796.00	10,905,200

エス・エム・エス	35,000	3,700.00	129,500,000
サニーサイドアップグループ	3,800	744.00	2,827,200
パーソルホールディングス	103,000	2,169.00	223,407,000
リニカル	6,100	792.00	4,831,200
クックパッド	33,000	311.00	10,263,000
アイ・ケイ・ケイ	5,300	610.00	3,233,000
学情	3,800	1,416.00	5,380,800
スタジオアリス	5,300	2,139.00	11,336,700
シミックホールディングス	5,200	1,717.00	8,928,400
エプロ	2,700	926.00	2,500,200
N J S	2,600	1,883.00	4,895,800
総合警備保障	41,000	4,970.00	203,770,000
カカクコム	76,100	3,530.00	268,633,000
アイロムグループ	3,700	1,932.00	7,148,400
セントケア・ホールディング	7,700	940.00	7,238,000
サイネックス	2,000	722.00	1,444,000
ルネサンス	6,600	1,174.00	7,748,400
ディップ	16,200	3,025.00	49,005,000
デジタルホールディングス	7,300	1,971.00	14,388,300
ツクイホールディングス	24,500	924.00	22,638,000
キャリアデザインセンター	2,600	942.00	2,449,200
ベネフィット・ワン	37,500	2,931.00	109,912,500
エムスリー	181,600	8,800.00	1,598,080,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,200	354.00	2,902,800
アウトソーシング	59,100	1,483.00	87,645,300
ウェルネット	10,800	529.00	5,713,200
ワールドホールディングス	3,600	2,465.00	8,874,000
ディー・エヌ・エー	43,600	2,253.00	98,230,800
博報堂D Yホールディングス	143,400	1,818.00	260,701,200
ぐるなび	18,200	637.00	11,593,400
タカミヤ	12,800	510.00	6,528,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,100	886.00	7,176,600
ファンコミュニケーションズ	28,800	406.00	11,692,800
ライク	2,800	1,966.00	5,504,800
ビジネス・ブレークスルー	4,800	435.00	2,088,000
エスプール	26,600	1,018.00	27,078,800
W D Bホールディングス	4,800	2,700.00	12,960,000
手間いらず	1,000	5,260.00	5,260,000
ティア	6,400	529.00	3,385,600
C D G	1,100	1,559.00	1,714,900
アドウェイズ	12,800	965.00	12,352,000
バリューコマース	7,000	3,080.00	21,560,000

インフォマート	104,300	1,048.00	109,306,400
J Pホールディングス	30,100	293.00	8,819,300
エコナックホールディングス	20,700	99.00	2,049,300
E P Sホールディングス	14,100	1,201.00	16,934,100
レグス	2,700	1,685.00	4,549,500
プレステージ・インターナショナル	38,800	764.00	29,643,200
アミューズ	5,700	2,516.00	14,341,200
ドリームインキュベータ	3,300	1,215.00	4,009,500
クイック	6,600	1,194.00	7,880,400
T A C	6,300	276.00	1,738,800
電通グループ	115,800	3,670.00	424,986,000
イオンファンタジー	4,000	2,456.00	9,824,000
シーティーエス	11,800	880.00	10,384,000
ネクシィーズグループ	3,300	1,075.00	3,547,500
H . U . グループホールディングス	28,900	3,290.00	95,081,000
アルプス技研	9,200	2,027.00	18,648,400
ダイオーズ	2,200	972.00	2,138,400
日本空調サービス	11,000	736.00	8,096,000
オリエンタルランド	109,500	18,040.00	1,975,380,000
ダスキン	23,900	2,802.00	66,967,800
明光ネットワークジャパン	13,400	569.00	7,624,600
ファルコホールディングス	5,000	1,616.00	8,080,000
ラウンドワン	35,300	1,110.00	39,183,000
リゾートトラスト	47,300	1,747.00	82,633,100
ビー・エム・エル	13,300	3,650.00	48,545,000
りらいあコミュニケーションズ	15,800	1,396.00	22,056,800
リソー教育	52,800	334.00	17,635,200
早稲田アカデミー	4,100	997.00	4,087,700
ユー・エス・エス	115,300	2,100.00	242,130,000
東京個別指導学院	9,400	675.00	6,345,000
サイバーエージェント	63,500	6,990.00	443,865,000
楽天	480,000	1,145.00	549,600,000
クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,294.00	7,117,000
モーニングスター	11,700	495.00	5,791,500
テー・オー・ダブリュー	18,700	304.00	5,684,800
山田コンサルティンググループ	6,200	1,004.00	6,224,800
セントラルスポーツ	3,900	2,429.00	9,473,100
フルキャストホールディングス	9,100	1,980.00	18,018,000
エン・ジャパン	18,300	3,370.00	61,671,000
リソルホールディングス	1,200	4,165.00	4,998,000
テクノプロ・ホールディングス	20,600	8,100.00	166,860,000
アトラ	2,400	394.00	945,600

インターワークス	3,400	381.00	1,295,400
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	13,980.00	58,716,000
K e e P e r 技研	6,700	1,954.00	13,091,800
ファーストロジック	2,200	766.00	1,685,200
三機サービス	2,200	1,010.00	2,222,000
G u n o s y	6,700	808.00	5,413,600
デザインワン・ジャパン	4,000	232.00	928,000
イー・ガーディアン	4,600	3,210.00	14,766,000
リブセンス	6,500	234.00	1,521,000
ジャパンマテリアル	31,800	1,464.00	46,555,200
ベクトル	13,000	1,198.00	15,574,000
ウチヤマホールディングス	5,600	365.00	2,044,000
チャーム・ケア・コーポレーション	7,800	1,427.00	11,130,600
キャリアリンク	3,400	2,767.00	9,407,800
I B J	8,600	1,024.00	8,806,400
アサンテ	3,800	1,733.00	6,585,400
N・フィールド	7,200	1,197.00	8,618,400
バリューHR	4,200	1,995.00	8,379,000
M&Aキャピタルパートナーズ	8,500	4,890.00	41,565,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,721.00	7,056,100
E R Iホールディングス	3,200	618.00	1,977,600
アビスト	1,700	2,972.00	5,052,400
シグマクシス	5,800	1,780.00	10,324,000
ウィルグループ	7,700	981.00	7,553,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,900	304.00	4,833,600
メドピア	4,900	6,150.00	30,135,000
レアジョブ	1,500	2,077.00	3,115,500
リクルートホールディングス	737,400	5,475.00	4,037,265,000
エラン	14,300	1,400.00	20,020,000
土木管理総合試験所	5,600	351.00	1,965,600
ネットマーケティング	5,300	609.00	3,227,700
日本郵政	779,000	900.00	701,100,000
ベルシステム24ホールディングス	17,400	1,847.00	32,137,800
鎌倉新書	10,600	903.00	9,571,800
S M N	2,500	752.00	1,880,000
L I T A L I C O	4,200	3,825.00	16,065,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	848.00	1,780,800
エアトリ	5,500	1,995.00	10,972,500
アトラエ	3,200	3,270.00	10,464,000
ストライク	3,900	4,715.00	18,388,500
ソラスト	25,400	1,495.00	37,973,000
セラク	3,300	1,782.00	5,880,600

インソース	8,600	2,249.00	19,341,400
ペイカレント・コンサルティング	6,800	21,270.00	144,636,000
Orchestra Holdings	2,400	2,904.00	6,969,600
アイモバイル	3,800	1,382.00	5,251,600
キャリアインデックス	4,600	606.00	2,787,600
MS - Japan	4,400	1,146.00	5,042,400
船場	2,300	864.00	1,987,200
グレイステクノロジー	5,300	5,760.00	30,528,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	29,700	2,241.00	66,557,700
フルテック	1,600	1,377.00	2,203,200
グリーンズ	3,900	573.00	2,234,700
GameWith	3,400	606.00	2,060,400
ソウルドアウト	2,600	1,601.00	4,162,600
MS&Consulting	2,000	596.00	1,192,000
エル・ティー・エス	800	3,615.00	2,892,000
ミダック	2,300	4,480.00	10,304,000
日総工産	8,200	837.00	6,863,400
キュービーネットホールディングス	4,800	1,734.00	8,323,200
RPAホールディングス	12,100	639.00	7,731,900
スプリックス	3,200	839.00	2,684,800
マネジメントソリューションズ	5,100	1,990.00	10,149,000
プロレド・パートナーズ	1,500	3,520.00	5,280,000
テノ・ホールディングス	1,000	1,094.00	1,094,000
フロンティア・マネジメント	1,800	1,903.00	3,425,400
ピアラ	600	1,824.00	1,094,400
コプロ・ホールディングス	600	2,832.00	1,699,200
ギークス	1,400	1,636.00	2,290,400
カーブスホールディングス	28,500	972.00	27,702,000
フォーラムエンジニアリング	5,600	1,059.00	5,930,400
ダイレクトマーケティングミックス	4,100	3,315.00	13,591,500
ポピンズホールディングス	2,100	3,215.00	6,751,500
アドバンテッジリスクマネジメント	5,500	736.00	4,048,000
リログループ	56,300	2,572.00	144,803,600
東祥	6,500	1,990.00	12,935,000
エイチ・アイ・エス	15,000	2,353.00	35,295,000
ラックランド	3,000	2,366.00	7,098,000
共立メンテナンス	17,100	3,890.00	66,519,000
イチネンホールディングス	10,900	1,330.00	14,497,000
建設技術研究所	6,700	2,384.00	15,972,800
スペース	6,900	883.00	6,092,700
長大	4,200	1,532.00	6,434,400
燦ホールディングス	4,700	1,121.00	5,268,700

スバル興業	600	8,230.00	4,938,000	
東京テアトル	4,200	1,305.00	5,481,000	
タナベ経営	2,100	1,395.00	2,929,500	
ナガワ	3,300	10,480.00	34,584,000	
東京都競馬	6,800	4,810.00	32,708,000	
カナモト	18,200	2,398.00	43,643,600	
西尾レントオール	9,600	2,704.00	25,958,400	
トランス・コスモス	9,900	2,772.00	27,442,800	
乃村工藝社	44,400	822.00	36,496,800	
藤田観光	4,100	1,825.00	7,482,500	
KNT-CTホールディングス	5,500	1,117.00	6,143,500	
日本管財	11,100	2,127.00	23,609,700	
トーカイ	10,000	2,232.00	22,320,000	
セコム	101,500	9,677.00	982,215,500	
セントラル警備保障	5,000	3,435.00	17,175,000	
丹青社	19,700	823.00	16,213,100	
メイテック	12,600	5,830.00	73,458,000	
応用地質	12,100	1,267.00	15,330,700	
船井総研ホールディングス	21,200	2,299.00	48,738,800	
進学会ホールディングス	4,500	472.00	2,124,000	
オオバ	7,500	742.00	5,565,000	
いであ	2,600	1,729.00	4,495,400	
学究社	3,200	1,329.00	4,252,800	
ベネッセホールディングス	37,800	2,149.00	81,232,200	
イオンディライト	12,700	3,135.00	39,814,500	
ナック	5,100	979.00	4,992,900	
ダイセキ	17,300	3,465.00	59,944,500	
ステップ	3,900	1,505.00	5,869,500	
合 計	111,547,700		285,691,981,360	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2021年 2月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	397,731,443
国債証券	312,000,786,900
地方債証券	20,674,929,692
特殊債券	24,745,903,730
社債券	16,683,200,000
未収入金	201,606,000
未収利息	889,118,232
前払費用	12,699,739
流動資産合計	375,605,975,736
資産合計	375,605,975,736
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	248,121,567
未払利息	322
流動負債合計	448,121,889
負債合計	448,121,889
純資産の部	
元本等	
元本	274,296,462,926
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	100,861,390,921
元本等合計	375,157,853,847
純資産合計	375,157,853,847
負債純資産合計	375,605,975,736

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 2月22日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>

	2021年 2月22日現在
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)

	2021年 2月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	274,296,462,926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 100,742,000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 1.3677円 (1万口当たり純資産額) (13,677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

	2021年 2月22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

	2021年 2月22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	2021年 2月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 2月22日
期首元本額	264,459,131,890円
期中追加設定元本額	33,234,491,567円
期中一部解約元本額	23,397,160,531円
期末元本額	274,296,462,926円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	866,380,497円

区分	2021年 2月22日現在
DC日本債券インデックスファンド	2,463,438,219円
DC日本債券インデックスファンドL	42,481,760,680円
DCバランスファンド30	9,684,934,610円
DCバランスファンド50	6,628,892,142円
DCバランスファンド70	1,723,964,216円
日本債券インデックスe	1,262,791,094円
インデックスコレクション（国内債券）	37,027,539,635円
インデックスコレクション（バランス株式30）	52,812,863,454円
インデックスコレクション（バランス株式50）	4,801,060,139円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,721,079,945円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	48,276,601,616円
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	3,890,359,840円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	211,404,408円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,023,687,053円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	140,618,460円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	94,674,099円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	831,231,488円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	3,618,960,860円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,066,193,506円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	12,004,324,178円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	135,422,677円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	369,399,449円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	3,106,559,299円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	204,963,756円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	374,472,289円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,135,014,291円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	387,315,373円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	936,962,228円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	83,024,094円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	3,480,791,912円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,546,270,988円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	26,566,724,168円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	483,394,291円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	149,444,646円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	44,845,856円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	653,326,343円
私募日本債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	5,771,127円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

2021年 2月22日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,156,629,550
地方債証券	93,386,056
特殊債券	90,506,074
社債券	55,160,000
合計	2,395,681,680

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

(デリバティブ取引に関する注記)

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410回利付国債(2年)	210,000,000	210,468,300	
	第412回利付国債(2年)	170,000,000	170,452,200	
	第413回利付国債(2年)	730,000,000	732,029,400	
	第414回利付国債(2年)	380,000,000	381,151,400	
	第415回利付国債(2年)	2,340,000,000	2,347,534,800	
	第416回利付国債(2年)	3,700,000,000	3,712,654,000	
	第417回利付国債(2年)	2,110,000,000	2,117,596,000	
	第418回利付国債(2年)	700,000,000	702,653,000	
	第419回利付国債(2年)	400,000,000	401,556,000	
	第420回利付国債(2年)	1,010,000,000	1,014,120,800	
	第131回利付国債(5年)	1,840,000,000	1,844,213,600	
	第132回利付国債(5年)	1,125,000,000	1,128,262,500	
	第133回利付国債(5年)	1,670,000,000	1,675,778,200	
	第134回利付国債(5年)	3,700,000,000	3,714,467,000	
	第135回利付国債(5年)	3,200,000,000	3,213,888,000	
	第136回利付国債(5年)	1,670,000,000	1,678,132,900	
	第137回利付国債(5年)	2,580,000,000	2,593,957,800	
	第138回利付国債(5年)	4,250,000,000	4,275,840,000	

第139回利付国債(5年)	2,410,000,000	2,425,544,500	
第140回利付国債(5年)	1,800,000,000	1,812,276,000	
第141回利付国債(5年)	6,600,000,000	6,647,256,000	
第142回利付国債(5年)	1,390,000,000	1,400,119,200	
第143回利付国債(5年)	2,290,000,000	2,307,266,600	
第144回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,128,724,800	
第145回利付国債(5年)	5,980,000,000	6,029,335,000	
第1回利付国債(40年)	230,000,000	329,465,800	
第2回利付国債(40年)	350,000,000	486,265,500	
第3回利付国債(40年)	380,000,000	531,133,600	
第4回利付国債(40年)	665,000,000	934,817,100	
第5回利付国債(40年)	455,000,000	619,364,200	
第6回利付国債(40年)	430,000,000	577,219,100	
第7回利付国債(40年)	1,480,000,000	1,913,344,000	
第8回利付国債(40年)	960,000,000	1,160,803,200	
第9回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,021,610,400	
第10回利付国債(40年)	970,000,000	1,028,820,800	
第11回利付国債(40年)	1,120,000,000	1,152,950,400	
第12回利付国債(40年)	640,000,000	595,264,000	
第13回利付国債(40年)	750,000,000	695,445,000	
第321回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,558,310,600	
第322回利付国債(10年)	860,000,000	869,313,800	
第323回利付国債(10年)	980,000,000	993,122,200	
第324回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,680,036,200	
第325回利付国債(10年)	2,245,000,000	2,277,305,550	
第326回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,278,597,600	
第327回利付国債(10年)	1,740,000,000	1,768,849,200	
第328回利付国債(10年)	2,010,000,000	2,039,547,000	
第329回利付国債(10年)	2,035,000,000	2,077,775,700	
第330回利付国債(10年)	2,130,000,000	2,179,671,600	
第331回利付国債(10年)	130,000,000	132,360,800	
第332回利付国債(10年)	2,270,000,000	2,315,241,100	
第333回利付国債(10年)	2,290,000,000	2,339,647,200	
第334回利付国債(10年)	3,140,000,000	3,213,162,000	
第335回利付国債(10年)	1,655,000,000	1,690,268,050	
第336回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,083,754,600	
第337回利付国債(10年)	1,870,000,000	1,897,582,500	
第338回利付国債(10年)	3,560,000,000	3,629,669,200	
第339回利付国債(10年)	2,775,000,000	2,832,692,250	
第340回利付国債(10年)	3,850,000,000	3,934,738,500	
第341回利付国債(10年)	2,050,000,000	2,086,674,500	
第342回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,215,902,800	

第343回利付国債(10年)	2,455,000,000	2,475,278,300	
第344回利付国債(10年)	3,880,000,000	3,911,389,200	
第345回利付国債(10年)	2,580,000,000	2,601,052,800	
第346回利付国債(10年)	2,495,000,000	2,515,459,000	
第347回利付国債(10年)	3,415,000,000	3,441,978,500	
第348回利付国債(10年)	3,900,000,000	3,930,771,000	
第349回利付国債(10年)	2,055,000,000	2,071,131,750	
第350回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,266,695,000	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	2,370,000,000	2,385,594,600	
第352回利付国債(10年)	1,590,000,000	1,599,603,600	
第353回利付国債(10年)	3,600,000,000	3,619,656,000	
第354回利付国債(10年)	3,130,000,000	3,145,086,600	
第355回利付国債(10年)	2,580,000,000	2,590,681,200	
第356回利付国債(10年)	2,940,000,000	2,950,025,400	
第357回利付国債(10年)	2,620,000,000	2,626,864,400	
第358回利付国債(10年)	3,090,000,000	3,095,562,000	
第359回利付国債(10年)	2,430,000,000	2,431,117,800	
第360回利付国債(10年)	4,300,000,000	4,297,936,000	
第361回利付国債(10年)	490,000,000	489,284,600	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	61,654,000	
第2回利付国債(30年)	100,000,000	120,813,000	
第3回利付国債(30年)	140,000,000	168,484,400	
第4回利付国債(30年)	190,000,000	241,300,000	
第5回利付国債(30年)	180,000,000	217,737,000	
第6回利付国債(30年)	20,000,000	24,755,000	
第7回利付国債(30年)	790,000,000	975,468,300	
第9回利付国債(30年)	180,000,000	204,939,000	
第10回利付国債(30年)	170,000,000	187,804,100	
第11回利付国債(30年)	460,000,000	541,972,000	
第12回利付国債(30年)	370,000,000	455,081,500	
第13回利付国債(30年)	330,000,000	402,732,000	
第14回利付国債(30年)	350,000,000	446,054,000	
第15回利付国債(30年)	370,000,000	477,603,400	
第16回利付国債(30年)	150,000,000	194,167,500	
第17回利付国債(30年)	420,000,000	539,536,200	
第18回利付国債(30年)	340,000,000	433,234,800	
第19回利付国債(30年)	300,000,000	383,157,000	
第20回利付国債(30年)	290,000,000	379,592,600	
第21回利付国債(30年)	780,000,000	1,000,623,000	
第22回利付国債(30年)	380,000,000	499,779,800	
第23回利付国債(30年)	170,000,000	224,114,400	
第24回利付国債(30年)	75,000,000	99,101,250	

第25回利付国債(30年)	185,000,000	239,432,550
第26回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,928,360,700
第27回利付国債(30年)	890,000,000	1,186,895,100
第28回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,405,614,000
第29回利付国債(30年)	490,000,000	650,342,700
第30回利付国債(30年)	555,000,000	729,586,350
第31回利付国債(30年)	670,000,000	872,433,800
第32回利付国債(30年)	955,000,000	1,265,222,200
第33回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,466,641,000
第34回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,608,472,400
第35回利付国債(30年)	1,210,000,000	1,554,317,600
第36回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,790,778,700
第37回利付国債(30年)	1,295,000,000	1,647,991,100
第38回利付国債(30年)	975,000,000	1,224,453,750
第39回利付国債(30年)	970,000,000	1,238,913,100
第40回利付国債(30年)	545,000,000	685,904,300
第41回利付国債(30年)	585,000,000	725,072,400
第42回利付国債(30年)	960,000,000	1,190,851,200
第43回利付国債(30年)	885,000,000	1,098,745,200
第44回利付国債(30年)	710,000,000	882,203,400
第45回利付国債(30年)	740,000,000	888,051,800
第46回利付国債(30年)	1,030,000,000	1,236,638,600
第47回利付国債(30年)	975,000,000	1,193,302,500
第48回利付国債(30年)	810,000,000	955,913,400
第49回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,357,529,000
第50回利付国債(30年)	830,000,000	865,225,200
第51回利付国債(30年)	935,000,000	864,790,850
第52回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,368,123,000
第53回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,031,919,200
第54回利付国債(30年)	915,000,000	950,886,300
第55回利付国債(30年)	930,000,000	965,684,100
第56回利付国債(30年)	820,000,000	850,758,200
第57回利付国債(30年)	720,000,000	746,366,400
第58回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,460,351,100
第59回利付国債(30年)	520,000,000	525,418,400
第60回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,502,999,000
第61回利付国債(30年)	760,000,000	765,342,800
第62回利付国債(30年)	360,000,000	343,915,200
第63回利付国債(30年)	880,000,000	816,640,000
第64回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,130,159,200
第65回利付国債(30年)	900,000,000	832,248,000
第66回利付国債(30年)	720,000,000	665,416,800
第67回利付国債(30年)	950,000,000	926,886,500

第68回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,102,315,000	
第69回利付国債(30年)	90,000,000	90,110,700	
第55回利付国債(20年)	490,000,000	501,083,800	
第56回利付国債(20年)	410,000,000	421,443,100	
第57回利付国債(20年)	360,000,000	369,572,400	
第58回利付国債(20年)	250,000,000	257,920,000	
第59回利付国債(20年)	440,000,000	454,515,600	
第60回利付国債(20年)	570,000,000	585,686,400	
第61回利付国債(20年)	390,000,000	398,962,200	
第62回利付国債(20年)	250,000,000	255,255,000	
第63回利付国債(20年)	570,000,000	595,228,200	
第64回利付国債(20年)	410,000,000	431,180,600	
第65回利付国債(20年)	370,000,000	390,975,300	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	347,773,800	
第67回利付国債(20年)	310,000,000	329,114,600	
第68回利付国債(20年)	230,000,000	246,304,700	
第69回利付国債(20年)	530,000,000	565,939,300	
第70回利付国債(20年)	490,000,000	530,777,800	
第71回利付国債(20年)	400,000,000	430,624,000	
第72回利付国債(20年)	710,000,000	765,820,200	
第73回利付国債(20年)	540,000,000	583,135,200	
第74回利付国債(20年)	310,000,000	335,953,200	
第75回利付国債(20年)	360,000,000	392,011,200	
第76回利付国債(20年)	340,000,000	367,458,400	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	314,603,600	
第78回利付国債(20年)	20,000,000	21,711,000	
第79回利付国債(20年)	100,000,000	108,988,000	
第80回利付国債(20年)	250,000,000	273,552,500	
第81回利付国債(20年)	180,000,000	197,127,000	
第82回利付国債(20年)	485,000,000	533,369,050	
第83回利付国債(20年)	70,000,000	77,326,200	
第84回利付国債(20年)	190,000,000	208,965,800	
第85回利付国債(20年)	360,000,000	399,510,000	
第86回利付国債(20年)	240,000,000	268,778,400	
第87回利付国債(20年)	170,000,000	189,521,100	
第88回利付国債(20年)	340,000,000	382,704,000	
第89回利付国債(20年)	320,000,000	358,483,200	
第90回利付国債(20年)	420,000,000	472,647,000	
第91回利付国債(20年)	310,000,000	350,591,400	
第92回利付国債(20年)	790,000,000	888,607,800	
第93回利付国債(20年)	260,000,000	292,162,000	
第94回利付国債(20年)	445,000,000	502,747,650	

第95回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,261,832,000
第96回利付国債(20年)	200,000,000	226,892,000
第97回利付国債(20年)	210,000,000	240,668,400
第98回利付国債(20年)	370,000,000	421,600,200
第99回利付国債(20年)	660,000,000	755,284,200
第100回利付国債(20年)	760,000,000	878,446,000
第101回利付国債(20年)	360,000,000	421,196,400
第102回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,256,993,200
第103回利付国債(20年)	1,335,000,000	1,558,545,750
第104回利付国債(20年)	260,000,000	299,735,800
第105回利付国債(20年)	730,000,000	844,763,300
第106回利付国債(20年)	270,000,000	314,487,900
第107回利付国債(20年)	270,000,000	313,596,900
第108回利付国債(20年)	725,000,000	830,755,750
第109回利付国債(20年)	290,000,000	333,366,600
第110回利付国債(20年)	515,000,000	600,294,300
第111回利付国債(20年)	450,000,000	530,140,500
第112回利付国債(20年)	550,000,000	643,390,000
第113回利付国債(20年)	905,000,000	1,062,859,150
第114回利付国債(20年)	610,000,000	718,848,400
第115回利付国債(20年)	370,000,000	439,267,700
第116回利付国債(20年)	260,000,000	309,748,400
第117回利付国債(20年)	240,000,000	283,761,600
第118回利付国債(20年)	450,000,000	529,420,500
第119回利付国債(20年)	320,000,000	370,560,000
第120回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,515,561,600
第121回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,229,151,000
第122回利付国債(20年)	490,000,000	568,958,600
第123回利付国債(20年)	400,000,000	477,324,000
第124回利付国債(20年)	320,000,000	378,748,800
第125回利付国債(20年)	500,000,000	603,430,000
第126回利付国債(20年)	450,000,000	534,136,500
第127回利付国債(20年)	400,000,000	470,812,000
第128回利付国債(20年)	600,000,000	707,760,000
第129回利付国債(20年)	260,000,000	304,051,800
第130回利付国債(20年)	890,000,000	1,043,338,100
第131回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,301,305,600
第132回利付国債(20年)	600,000,000	698,634,000
第133回利付国債(20年)	620,000,000	728,524,800
第134回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,248,340,800
第135回利付国債(20年)	155,000,000	180,855,550
第136回利付国債(20年)	450,000,000	520,173,000
第137回利付国債(20年)	210,000,000	245,540,400

第138回利付国債（20年）	260,000,000	298,230,400	
第139回利付国債（20年）	800,000,000	926,512,000	
第140回利付国債（20年）	985,000,000	1,154,035,850	
第141回利付国債（20年）	830,000,000	974,312,100	
第142回利付国債（20年）	540,000,000	640,126,800	
第143回利付国債（20年）	830,000,000	966,327,500	
第144回利付国債（20年）	1,080,000,000	1,244,667,600	
第145回利付国債（20年）	1,110,000,000	1,307,802,000	
第146回利付国債（20年）	1,300,000,000	1,534,390,000	
第147回利付国債（20年）	1,190,000,000	1,392,133,400	
第148回利付国債（20年）	1,350,000,000	1,564,488,000	
第149回利付国債（20年）	2,120,000,000	2,459,963,200	
第150回利付国債（20年）	1,790,000,000	2,054,758,900	
第151回利付国債（20年）	1,220,000,000	1,369,328,000	
第152回利付国債（20年）	1,150,000,000	1,291,427,000	
第153回利付国債（20年）	2,510,000,000	2,854,572,800	
第154回利付国債（20年）	1,770,000,000	1,989,586,200	
第155回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,347,378,900	
第156回利付国債（20年）	1,490,000,000	1,501,726,300	
第157回利付国債（20年）	1,490,000,000	1,455,387,300	
第158回利付国債（20年）	1,900,000,000	1,937,772,000	
第159回利付国債（20年）	1,780,000,000	1,839,790,200	
第160回利付国債（20年）	600,000,000	628,590,000	
第161回利付国債（20年）	1,065,000,000	1,097,620,950	
第162回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,080,943,500	
第163回利付国債（20年）	1,445,000,000	1,485,850,150	
第164回利付国債（20年）	20,000,000	20,206,400	
第165回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,674,674,400	
第166回利付国債（20年）	2,020,000,000	2,102,214,000	
第167回利付国債（20年）	1,650,000,000	1,658,134,500	
第168回利付国債（20年）	1,970,000,000	1,942,183,600	
第169回利付国債（20年）	410,000,000	396,236,300	
第170回利付国債（20年）	2,510,000,000	2,422,626,900	
第171回利付国債（20年）	250,000,000	240,985,000	
第172回利付国債（20年）	270,000,000	264,608,100	
第173回利付国債（20年）	2,390,000,000	2,339,642,700	
第174回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,261,374,900	
第175回利付国債（20年）	320,000,000	318,848,000	
国債証券合計	292,965,000,000	312,000,786,900	
地方債証券	第1回東京都公募公債（東京グリーンbond（30年））	100,000,000	105,845,000
	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	106,853,000

第7回東京都公募公債（30年）	200,000,000	266,070,000	
第11回東京都公募公債（20年）	200,000,000	225,380,000	
第13回東京都公募公債（20年）	100,000,000	113,670,000	
第16回東京都公募公債（20年）	150,000,000	171,388,500	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,877,000	
第18回東京都公募公債（20年）	200,000,000	232,834,000	
第20回東京都公募公債（20年）	100,000,000	116,138,000	
第21回東京都公募公債（20年）	100,000,000	117,368,000	
第714回東京都公募公債	100,000,000	101,304,000	
第740回東京都公募公債	100,000,000	101,654,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	101,637,000	
第786回東京都公募公債	200,000,000	199,998,000	
第800回東京都公募公債	300,000,000	296,742,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,875,000	
第3回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	133,255,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	300,000,000	350,154,000	
第16回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	118,341,000	
第21回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	116,266,000	
第190回神奈川県公募公債	100,000,000	101,131,000	
第196回神奈川県公募公債	100,000,000	101,351,000	
第243回神奈川県公募公債	100,000,000	98,871,000	
第2回大阪府公募公債（20年）	300,000,000	352,440,000	
第376回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,021,000	
第403回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	306,039,000	
第417回大阪府公募公債（10年）	108,000,000	108,922,320	
第423回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	300,864,000	
平成25年度第2回京都府公募公債（15年）	100,000,000	106,473,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,257,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	105,860,000	105,965,860	
平成29年度第3回京都府公募公債	100,000,000	99,980,000	
令和元年度第3回京都府公募公債	100,000,000	99,950,000	
第3回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	114,187,000	
第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	107,888,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	107,308,000	
第11回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	209,088,000	
平成26年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	101,908,000	
平成28年度第30回兵庫県公募公債	100,000,000	100,511,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	101,840,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	115,956,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,355,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	101,196,000	
平成27年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,003,000	

平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	118,225,000	
平成24年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,419,000	
平成25年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,768,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	203,444,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,569,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,794,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,572,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,940,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,304,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	116,373,000	
平成24年度第2回広島県公募公債	100,000,000	101,156,000	
平成27年度第2回広島県公募公債	162,000,000	166,087,260	
平成29年度第7回広島県公募公債	131,440,000	131,992,048	
第5回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	231,088,000	
第7回埼玉県公募公債（15年）	400,000,000	395,548,000	
第9回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	102,360,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	196,520,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,298,000	
平成27年度第8回埼玉県公募公債	200,000,000	203,742,000	
平成29年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	100,569,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	133,829,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	258,390,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	108,536,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	108,002,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	101,576,000	
平成29年度第6回福岡県公募公債	170,000,000	170,804,100	
平成29年度第8回福岡県公募公債	200,000,000	201,318,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	233,738,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,914,000	
第9回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	115,620,000	
平成24年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	101,566,000	
平成26年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	101,775,000	
平成28年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	99,947,000	
平成29年度第5回千葉県公募公債	120,000,000	120,608,400	
令和元年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,848,000	

平成24年度第2回新潟県公募公債	200,000,000	203,078,000	
平成27年度第3回新潟県公募公債	200,000,000	200,302,000	
平成24年度第1回岐阜県公募公債（10年）	139,630,000	141,401,904	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,198,000	
第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,246,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,306,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,360,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,271,000	
第118回共同発行市場公募地方債	550,000,000	558,613,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,363,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,978,000	
第130回共同発行市場公募地方債	350,000,000	357,514,500	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,103,000	
第134回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,107,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,891,000	
第139回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,792,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,787,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,566,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,121,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,445,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,896,000	
第175回共同発行市場公募地方債	150,000,000	150,792,000	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,250,000	
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,345,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	101,296,000	
平成29年度第1回熊本県公募公債（5年）	100,000,000	99,978,000	
第7回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	105,644,000	
第10回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	117,770,000	
平成24年度第8回大阪市公募公債	300,000,000	304,905,000	
平成29年度第1回大阪市公募公債（5年）	200,000,000	199,962,000	
第3回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	131,869,000	
第13回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	105,733,000	
第25回名古屋市公募公債（5年）	100,000,000	100,009,000	
第482回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,271,000	
第488回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,047,000	
第495回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,100,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	109,545,000	
第6回京都市公募公債（20年）	100,000,000	114,694,000	
平成27年度第5回京都市公募公債	200,000,000	201,750,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	116,100,000	

	平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	116,232,000	
	平成26年度第3回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	114,454,000	
	令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	97,705,000	
	第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	109,241,000	
	第5回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	133,556,000	
	第7回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	133,061,000	
	平成25年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	101,960,000	
	第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	115,965,000	
	第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,071,000	
	平成24年度第7回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,141,000	
	第8回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	117,068,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	150,000,000	173,476,500	
	第88回川崎市公募公債	100,000,000	102,090,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	400,000,000	458,520,000	
	平成29年度第12回福岡市公募公債	130,000,000	130,547,300	
	平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	100,940,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,097,000	
	平成26年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	204,142,000	
	平成27年度第1回三重県公募公債	100,000,000	102,097,000	
	平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	101,296,000	
	平成24年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	101,301,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	102,175,000	
	地方債証券合計	19,516,930,000	20,674,929,692	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	204,084,000	
	第69回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,490,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	94,649,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	149,308,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	167,949,000	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,499,000	
	第21回道路債券	100,000,000	128,740,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	288,310,000	
	第27回道路債券	100,000,000	107,317,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,631,000	
	第28回道路債券	300,000,000	391,581,000	
	第33回道路債券	100,000,000	132,429,000	

第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,248,000	
第38回道路債券	100,000,000	107,946,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,287,000	
第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,609,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,651,000	
第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,467,000	
第87回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,322,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,511,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,938,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,462,000	
第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,327,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	700,000,000	709,996,000	
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	129,844,000	
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,898,000	
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,270,000	
第128回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,826,000	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,162,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,155,000	
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,213,000	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,702,000	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	405,768,000	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,148,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,274,000	
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,775,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	211,836,130	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,312,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,349,000	

第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,194,000	
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	116,000,000	118,411,640	
第235回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,534,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,480,000	
第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,592,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,793,000	
第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,581,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	300,441,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	243,000,000	244,521,180	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,638,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	116,820,000	
第4回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,597,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,366,000	
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	235,262,000	
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	117,936,000	
第9回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,258,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,460,000	
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	118,000,000	
第15回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,686,000	
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	353,673,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,723,000	
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,534,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	100,000,000	100,013,000	
第22回公営企業債券(20年)	200,000,000	227,658,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	345,738,000	
第24回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,067,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,916,000	
第35回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,145,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	219,580,130	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,296,000	
第41回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,322,000	
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,349,000	
第43回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,301,000	

第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,611,000	
第46回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,732,000	
第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,016,000	
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,173,520	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,041,000	
第56回政府保証地方公共団体金融機構債券	193,000,000	197,134,060	
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,988,000	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,995,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,396,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	428,249,620	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,646,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,999,000	
第96回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,585,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,106,000	
第107回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,072,000	
第110回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,061,500	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,587,000	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,635,000	
F190回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,804,000	
第21回首都高速道路株式会社社債	300,000,000	300,354,000	
第85回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,979,000	
第159回都市再生債券	100,000,000	84,340,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	92,612,000	
第169回都市再生債券	100,000,000	98,886,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	101,366,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,309,000	10,376,730	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,815,000	61,443,762	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,746,000	25,456,705	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,617,000	13,023,267	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,155,000	31,415,767	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,800,000	10,909,188	
第5回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	244,746,000	244,200,216	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,243,000	11,454,031	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,707,000	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	44,996,000	45,820,776	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	89,955,000	89,754,400	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,850,000	12,144,828	

第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,184,000	26,959,831	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,845,000	12,141,125	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,774,000	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,294,000	12,641,674	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,950,000	15,750,423	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	36,537,000	36,983,482	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,127,000	12,256,152	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,469,000	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,680,000	22,013,655	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,006,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,534,000	19,734,447	
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,220,000	11,366,982	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,889,000	22,369,194	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,524,000	39,733,413	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,488,000	12,833,542	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,948,000	34,528,850	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,919,000	12,179,787	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,824,000	38,711,351	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,270,000	14,777,013	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,509,000	29,337,523	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,606,000	27,198,181	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,053,000	12,335,642	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,152,000	26,593,712	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,789,000	13,179,192	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,591,000	37,473,209	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,506,000	57,214,403	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,224,000	29,421,826	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,221,000	13,711,366	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,014,000	12,370,695	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,940,000	34,641,680	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,708,000	34,650,855	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,256,000	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,027,000	102,294,682	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,896,000	115,400,358	
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,423,000	12,828,610	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,975,000	28,527,141	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,782,000	29,325,567	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,441,000	37,529,857	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,958,000	31,647,032	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,917,000	13,353,723	

第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,959,000	35,806,030	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,794,000	37,779,135	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,020,000	42,236,707	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,903,000	39,968,713	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,928,000	46,770,946	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,679,000	48,001,777	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,638,000	41,492,662	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,706,000	40,198,890	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,612,000	41,168,751	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,185,000	47,517,449	
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,321,000	
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,954,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,621,000	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,310,000	72,502,968	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,338,000	156,569,380	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,777,000	79,035,073	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,101,000	81,233,194	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,181,000	81,135,538	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,392,000	81,689,894	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,932,000	82,643,989	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,406,000	82,995,202	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,528,000	83,179,971	
第121回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,472,000	83,897,707	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,413,000	85,797,358	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,213,000	86,413,876	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,545,000	85,872,637	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,812,000	88,123,732	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,752,000	88,845,189	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,503,000	89,967,520	
第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,945,000	90,526,944	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,156,000	90,214,601	
	92,043,000	91,700,600	

第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,538,000	92,026,264	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,638,000	92,401,978	
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	286,854,000	284,019,882	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	287,166,000	285,928,314	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,189,000	95,821,558	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,134,000	191,772,405	
第157回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,527,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,571,000	98,404,415	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,991,000	98,656,410	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,518,000	99,149,783	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,872,000	99,354,663	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,944,000	
第59回日本学生支援債券	100,000,000	99,981,000	
第60回日本学生支援債券	100,000,000	99,977,000	
第62回日本学生支援債券	100,000,000	99,972,000	
い第829号商工債	100,000,000	100,183,000	
い第832号商工債	100,000,000	99,944,000	
い第835号商工債	200,000,000	199,654,000	
い第845号商工債	200,000,000	200,138,000	
第328回信金中金債（5年）	100,000,000	100,031,000	
第331回信金中金債（5年）	100,000,000	100,060,000	
第339回信金中金債（5年）	100,000,000	100,140,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,157,000	
第231号商工債（3年）	100,000,000	100,046,000	
第236号商工債（3年）	400,000,000	399,872,000	
第48回東日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,354,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,384,000	
第74回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,951,000	
第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,384,000	
第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,010,000	
第18回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	203,550,000	
第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,089,000	
第54回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,998,000	
第66回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	107,074,000	

特殊債券合計		23,574,911,000	24,745,903,730	
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	100,136,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,465,000	
	第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,984,000	
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,266,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,187,000	
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,884,000	
	第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,904,000	
	第1回バンコ・サンタンデール・エセ・アー非上位円貨社債	100,000,000	99,976,000	
	第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	199,802,000	
	第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	101,800,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,507,000	
	第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	100,000,000	99,870,000	
	第5回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,937,000	
	第3回高砂熟学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,056,000	
	第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,859,000	
	第13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	200,000,000	199,784,000	
	第2回株式会社伊藤園無担保社債	100,000,000	99,682,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,917,000	
	第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,769,000	
	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	99,980,000	
	第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	101,259,000	
	第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,221,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,838,000	
	第11回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,665,000	
	第22回レンゴー株式会社無担保社債	100,000,000	100,174,000	
	第22回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,052,000	
	第22回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,135,000	
	第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,326,000	
	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	100,000,000	100,007,000	
	第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,774,000	

第 6 回株式会社電通無担保社債	100,000,000	99,978,000	
第 1 回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	99,960,000	
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	99,831,000	
第 1 3 回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,423,000	
第 1 4 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	199,830,000	
第 1 回 J X T G ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第 1 4 回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,872,000	
第 9 回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	100,386,000	
第 1 4 回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	101,960,000	
第 1 1 回日本電気硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,309,000	
第 9 回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	98,975,000	
第 3 1 回 J F E ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,595,000	
第 3 4 回 J F E ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,920,000	
第 1 回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	100,000,000	99,941,000	
第 1 0 回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	99,752,000	
第 1 6 回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,880,000	
第 2 0 回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,734,000	
第 8 回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,502,000	
第 1 6 回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,405,000	
第 2 0 回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	299,727,000	
第 1 9 回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,514,000	
第 1 回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	99,238,000	
第 1 回明治安田生命 2 0 1 7 基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,149,000	
第 3 0 回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,784,000	
第 1 2 回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,426,000	
第 1 回明治安田生命 2 0 1 8 基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,149,000	
第 6 回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	94,834,000	
第 6 9 回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	116,624,000	
第 2 2 回三菱 U F J フィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	99,651,000	
第 9 回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	109,042,000	
第 5 7 回株式会社三菱東京 U F J 銀行無担保社債	100,000,000	103,592,000	
第 1 回三井住友 F G 無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	101,121,000	
第 1 1 回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,532,000	
	100,000,000	108,901,000	

第25回株式会社三井住友銀行無担保社債 (劣後特約付)			
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,464,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,938,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,149,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,721,000	
第29回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	99,591,000	
第42回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,826,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,272,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,843,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,961,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,883,000	
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	100,000,000	99,810,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,763,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,216,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,694,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,863,000	
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	200,292,000	
第69回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,872,000	
第82回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,689,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	115,093,000	
第78回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,059,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	113,069,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,529,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,132,000	
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	101,917,000	
第3回東急株式会社無担保社債	100,000,000	99,754,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,461,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,667,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,151,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,474,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,052,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,117,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,440,000	
	100,000,000	117,386,000	

第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債			
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,889,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,313,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,509,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,293,000	
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,773,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,219,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	122,969,000	
第83回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	199,644,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	113,981,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	117,203,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	114,140,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,117,000	
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	204,672,000	
第58回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,956,000	
第4回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,294,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	200,000,000	199,688,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,460,000	
第535回中部電力株式会社社債	200,000,000	198,550,000	
第509回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,038,000	
第510回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,127,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,054,000	
第377回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,563,000	
第393回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,084,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,952,000	
第426回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,633,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,431,000	
第321回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,634,000	
第479回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,381,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,912,000	
第521回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,623,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,117,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,457,000	
第426回九州電力株式会社社債	200,000,000	205,678,000	
第431回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,464,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,733,000	
第482回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,086,000	
第323回北海道電力株式会社社債	100,000,000	108,217,000	

第357回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,758,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	107,965,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,453,000	
第56回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,115,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,142,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	303,006,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,694,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,936,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,641,000	
第38回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	123,912,000	
第6回SCSK株式会社無担保社債	100,000,000	99,934,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,855,000	
社債券合計	16,400,000,000	16,683,200,000	
合計		374,104,820,322	

(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。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2021年 2月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,669,144,335
コール・ローン	1,428,331,228
株式	266,207,819,353
投資信託受益証券	154,350,667
投資証券	5,666,902,587
派生商品評価勘定	174,728,367
未収入金	969,162
未収配当金	293,956,342
差入委託証拠金	1,068,575,913
流動資産合計	278,664,777,954
資産合計	278,664,777,954

	2021年 2月22日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,330,501
前受金	147,459,961
未払解約金	294,477,537
未払利息	1,159
流動負債合計	460,269,158
負債合計	460,269,158
純資産の部	
元本等	
元本	77,760,045,092
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	200,444,463,704
元本等合計	278,204,508,796
純資産合計	278,204,508,796
負債純資産合計	278,664,777,954

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 2月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

	2021年 2月22日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 2月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	77,760,045,092口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.5777円 (1万口当たり純資産額) (35,777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

	2021年 2月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 2月22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。

	2021年 2月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 2月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 2月22日
期首元本額	73,774,978,389円
期中追加設定元本額	19,060,030,796円
期中一部解約元本額	15,074,964,093円
期末元本額	77,760,045,092円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,582,930,316円
D C 外国株式インデックスファンド	4,577,388,304円
D C 外国株式インデックスファンド L	23,221,883,367円
D C バランスファンド 3 0	672,689,485円
D C バランスファンド 5 0	1,383,168,041円
D C バランスファンド 7 0	871,140,012円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	332,092,089円
外国株式インデックス e	4,897,422,267円
インデックスコレクション（外国株式）	10,948,865,950円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	3,632,292,527円

区分	2021年 2月22日現在
インデックスコレクション（バランス株式50）	925,610,636円
インデックスコレクション（バランス株式70）	862,573,139円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	11,578,167,692円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,591,768,932円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	583,736,645円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	36,476,938円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	417,607,922円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	48,333,808円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	99,496,476円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	736,188円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,102,062,894円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	394,036,444円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	267,442,137円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,205,683,054円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	532,260,850円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	176,825,724円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	826,089,086円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	20,432,627円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	103,667,333円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	115,852,543円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	373,577,067円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	16,552,478円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	89,511,233円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	260,444,235円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	11,226,653円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 2月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,003,290,439
投資信託受益証券	5,930,685
投資証券	27,232,247
合計	1,970,127,507

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 2月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,013,635,767	-	6,161,095,728	147,459,961
合計		6,013,635,767	-	6,161,095,728	147,459,961

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2021年 2月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,140,403,615	-	1,149,341,520	8,937,905
	アメリカドル	906,495,385	-	912,968,320	6,472,935
	ユーロ	152,160,000	-	153,516,000	1,356,000
	イギリスポンド	81,748,230	-	82,857,200	1,108,970
合計		1,140,403,615	-	1,149,341,520	8,937,905

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	34,920	23.40	817,128.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	18,624	18.56	345,661.44	
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	69.10	778,480.60	

CHEVRON CORP	99,564	95.80	9,538,231.20
CONOCOPHILLIPS	71,533	48.42	3,463,627.86
DEVON ENERGY CORPORATION	32,000	20.83	666,560.00
EOG RESOURCES INC	29,076	62.51	1,817,540.76
EXXON MOBIL	219,052	52.37	11,471,753.24
HALLIBURTON CO	47,020	20.20	949,804.00
HESS CORP	14,572	63.58	926,487.76
KINDER MORGAN INC	101,023	14.96	1,511,304.08
MARATHON PETROLEUM CORP	32,394	53.00	1,716,882.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,778	25.42	1,265,356.76
ONEOK INC	24,302	45.82	1,113,517.64
PHILLIPS 66	21,780	82.31	1,792,711.80
PIONEER NATURAL RESOURCES	10,109	133.94	1,353,999.46
SCHLUMBERGER	69,490	26.12	1,815,078.80
VALERO ENERGY CORP	20,072	71.53	1,435,750.16
WILLIAMS COS	59,847	22.64	1,354,936.08
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	11,606	263.88	3,062,591.28
ALBEMARLE CORP	5,890	156.17	919,841.30
AMCOR PLC	86,465	11.42	987,430.30
AVERY DENNISON CORP	4,144	175.41	726,899.04
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,844	28.46	308,620.24
BALL CORP	16,159	90.48	1,462,066.32
CELANESE CORP-SERIES A	6,028	135.22	815,106.16
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	45.76	474,943.04
CORTEVA INC	37,279	45.47	1,695,076.13
CROWN HOLDINGS INC	7,458	101.01	753,332.58
DOW INC	38,931	60.39	2,351,043.09
DUPONT DE NEMOURS INC	28,298	69.79	1,974,917.42
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,527	111.92	842,421.84
ECOLAB INC	13,495	208.08	2,808,039.60
FMC CORP	6,680	105.25	703,070.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	76,272	37.49	2,859,437.28
INT'L PAPER CO	19,784	48.95	968,426.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,824	139.50	1,649,448.00
LINDE PLC	27,610	250.88	6,926,796.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,116	100.22	1,314,485.52
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,199	336.34	1,075,951.66
MOSAIC CO/THE	20,003	29.08	581,687.24
NEWMONT CORPORATION	42,188	56.67	2,390,793.96
NUCOR CORP	16,038	58.04	930,845.52
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,079	134.08	680,992.32
PPG INDUSTRIES INC	12,394	136.67	1,693,887.98

RPM INTERNATIONAL INC	6,943	83.11	577,032.73
SEALED AIR CORP	7,368	43.66	321,686.88
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,306	716.91	3,087,014.46
STEEL DYNAMICS INC	11,755	40.84	480,074.20
VULCAN MATERIALS CO	6,788	164.38	1,115,811.44
WESTROCK CO	13,827	43.95	607,696.65
3 M COMPANY	30,271	176.54	5,344,042.34
ALLEGION PLC	4,638	109.06	505,820.28
AMETEK INC	11,342	120.86	1,370,794.12
BOEING CO	28,180	217.47	6,128,304.60
CARRIER GLOBAL CORP	43,215	37.64	1,626,612.60
CATERPILLAR	28,456	209.91	5,973,198.96
CUMMINS INC	7,757	246.76	1,914,117.32
DEERE&CO	15,644	330.00	5,162,520.00
DOVER CORP	7,651	122.25	935,334.75
EATON CORP	21,019	127.80	2,686,228.20
EMERSON ELECTRIC CO	31,394	85.45	2,682,617.30
FASTENAL CO	28,283	47.23	1,335,806.09
FORTIVE CORP	16,607	67.19	1,115,824.33
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	7,622	87.55	667,306.10
GENERAC HOLDINGS INC	3,294	363.47	1,197,270.18
GENERAL DYNAMICS CORP	12,811	164.78	2,110,996.58
GENERAL ELECTRIC CO	459,975	12.02	5,528,899.50
GRAINGER (WW) INC	2,498	379.40	947,741.20
HEICO CORP	2,252	132.16	297,624.32
HEICO CORP-CLASS A	4,064	121.14	492,312.96
HONEYWELL INTL INC	36,883	203.56	7,507,903.48
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	28.68	522,750.36
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	182.13	362,985.09
IDEX CORP	4,155	196.75	817,496.25
ILLINOIS TOOL WORKS	16,613	201.40	3,345,858.20
INGERSOLL-RAND INC	19,538	43.89	857,522.82
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,714	112.41	754,720.74
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,500	49.60	570,400.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	9,400	24.60	231,240.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	39,079	56.02	2,189,205.58
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,357	189.09	2,147,495.13
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,882	293.68	552,705.76
LOCKHEED MARTIN CORP	13,221	335.42	4,434,587.82
MASCO CORP	14,508	54.60	792,136.80
NORDSON CORP	2,944	187.88	553,118.72
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,321	297.24	2,473,334.04

OTIS WORLDWIDE CORP	20,243	63.04	1,276,118.72
OWENS CORNING	6,022	85.08	512,351.76
PACCAR INC	17,270	95.19	1,643,931.30
PARKER HANNIFIN CORP	6,753	279.73	1,889,016.69
PENTAIR PLC	9,170	56.65	519,480.50
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	80,282	74.26	5,961,741.32
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,734	248.23	1,423,350.82
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,501	388.91	2,139,393.91
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	59.31	450,874.62
SMITH (A.O.) CORP	6,846	59.64	408,295.44
SNAP-ON INC	2,819	194.96	549,592.24
STANLEY BLACK&DECKER	8,433	175.07	1,476,365.31
SUNRUN INC	6,400	68.50	438,400.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,889	405.91	766,763.99
TEXTRON	10,911	50.81	554,387.91
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,572	153.96	1,935,585.12
TRANSDIGM GROUP INC	2,550	600.50	1,531,275.00
UNITED RENTALS INC	3,773	290.01	1,094,207.73
WABTEC CORP	9,979	73.96	738,046.84
XYLEM INC	9,287	99.74	926,285.38
CINTAS CORP	4,621	343.49	1,587,267.29
COPART INC	11,576	117.07	1,355,202.32
COSTAR GROUP INC	2,068	913.25	1,888,601.00
EQUIFAX INC	6,655	176.54	1,174,873.70
IHS MARKIT LTD	19,800	93.20	1,845,360.00
REPUBLIC SERVICES INC	11,640	90.59	1,054,467.60
ROBERT HALF INTL INC	6,315	78.43	495,285.45
ROLLINS INC	10,710	35.81	383,525.10
TRANSUNION	9,966	89.27	889,664.82
VERISK ANALYTICS INC	7,635	190.49	1,454,391.15
WASTE CONNECTIONS INC	12,929	99.80	1,290,314.20
WASTE MANAGEMENT INC	22,195	111.63	2,477,627.85
AMERCO	564	536.01	302,309.64
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,206	90.78	654,160.68
CSX CORP	40,199	92.09	3,701,925.91
DELTA AIR LINES INC	7,841	45.67	358,098.47
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,161	93.44	856,003.84
FEDEX CORP	13,079	254.64	3,330,436.56
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,552	146.56	667,141.12
KANSAS CITY SOUTHERN	5,219	212.59	1,109,507.21
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	44.12	308,840.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,404	258.03	3,458,634.12

OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,177	215.64	1,116,368.28
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,049	52.81	425,067.69
UBER TECHNOLOGIES INC	50,640	58.39	2,956,869.60
UNION PACIFIC CORP	35,677	209.06	7,458,633.62
UNITED PARCEL SERVICE B	37,160	160.54	5,965,666.40
XPO LOGISTICS INC	5,001	119.49	597,569.49
APTIV PLC	13,577	153.80	2,088,142.60
AUTOLIV INC	3,858	93.51	360,761.58
BORGWARNER INC	11,533	43.56	502,377.48
FORD MOTOR COMPANY	205,234	11.58	2,376,609.72
GENERAL MOTORS CO	67,670	52.57	3,557,411.90
LEAR CORP	2,989	167.66	501,135.74
TESLA INC	39,287	781.30	30,694,933.10
DR HORTON INC	17,096	79.21	1,354,174.16
GARMIN LTD	7,602	128.01	973,132.02
HASBRO INC	7,206	90.00	648,540.00
LENNAR CORP-CL A	14,276	87.46	1,248,578.96
LULULEMON ATHLETICA INC	6,498	332.23	2,158,830.54
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	171.90	486,477.00
NEWELL BRANDS INC	20,391	24.32	495,909.12
NIKE B	65,426	142.02	9,291,800.52
NVR INC	193	4,705.45	908,151.85
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,762	139.71	1,503,559.02
PULTE GROUP INC	14,805	46.39	686,803.95
VF CORP	16,318	80.40	1,311,967.20
WHIRLPOOL CORP	3,060	195.34	597,740.40
ARAMARK	11,643	38.01	442,550.43
CARNIVAL CORPORATION	26,748	24.59	657,733.32
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,336	1,473.09	1,968,048.24
DARDEN RESTAURANTS INC	7,182	134.01	962,459.82
DOMINO'S PIZZA INC	2,006	371.46	745,148.76
DRAFTKINGS INC - CL A	8,917	60.91	543,134.47
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,760	116.91	1,608,681.60
LAS VEGAS SANDS CORP	18,124	60.18	1,090,702.32
MARRIOTT INTL A	14,479	136.28	1,973,198.12
MCDONALD'S CORP	39,108	212.24	8,300,281.92
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	18.68	196,345.48
MGM RESORTS INTERNATIONAL	25,221	36.42	918,548.82
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,553	78.87	753,445.11
STARBUCKS CORP	61,434	103.37	6,350,432.58
VAIL RESORTS INC	2,150	304.26	654,159.00
WYNN RESORTS LTD	5,210	123.66	644,268.60

YUM BRANDS INC	14,990	105.13	1,575,898.70
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,554	100.80	4,087,843.20
ALPHABET INC-CL A	15,642	2,088.81	32,673,166.02
ALPHABET INC-CL C	15,628	2,101.14	32,836,615.92
ALTICE USA INC- A	12,390	33.83	419,153.70
CABLE ONE INC	247	2,037.05	503,151.35
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,538	607.29	4,577,752.02
COMCAST CORP-CL A	236,400	52.10	12,316,440.00
DISCOVERY INC - A	7,886	50.79	400,529.94
DISCOVERY INC-C	18,339	42.80	784,909.20
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	33.67	424,343.01
ELECTRONIC ARTS INC	15,169	145.95	2,213,915.55
FACEBOOK INC-A	125,157	261.56	32,736,064.92
FOX CORP - CLASS A	18,452	33.78	623,308.56
FOX CORP- CLASS B	9,450	32.37	305,896.50
IAC/INTERACTIVECORP	3,853	262.15	1,010,063.95
INTERPUBLIC GROUP OF COS	20,801	25.56	531,673.56
LIBERTY BROADBAND-A	1,450	145.89	211,540.50
LIBERTY BROADBAND-C	8,693	148.99	1,295,170.07
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	45.20	446,802.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	43.25	342,886.00
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	43.98	139,460.58
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,966	88.09	789,814.94
MATCH GROUP INC	13,449	160.95	2,164,616.55
NETFLIX INC	22,869	540.22	12,354,291.18
NEWS CORP-CLASS A	21,881	22.50	492,322.50
OMNICOM GROUP	11,546	67.65	781,086.90
PINTEREST INC- CLASS A	24,298	85.90	2,087,198.20
ROKU INC	5,586	467.31	2,610,393.66
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,402	6.01	363,016.02
SNAP INC - A	48,691	65.52	3,190,234.32
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,950	194.86	1,159,417.00
THE WALT DISNEY CO	93,874	183.65	17,239,960.10
TWITTER INC	40,140	72.28	2,901,319.20
VIACOMCBS INC-CLASS B	28,056	62.69	1,758,830.64
ZILLOW GROUP INC-A	3,140	191.46	601,184.40
ZILLOW GROUP INC-C	7,027	181.22	1,273,432.94
ADVANCE AUTO PARTS	3,825	165.98	634,873.50
AMAZON.COM	22,205	3,249.90	72,164,029.50
AUTOZONE INC	1,146	1,205.73	1,381,766.58
BEST BUY COMPANY INC	11,475	118.00	1,354,050.00
BOOKING HOLDINGS INC	2,152	2,293.05	4,934,643.60

BURLINGTON STORES INC	3,511	264.81	929,747.91
CARMAX INC	8,938	121.32	1,084,358.16
CARVANA CO	3,278	308.74	1,012,049.72
CHEWY INC - CLASS A	3,947	113.95	449,760.65
DOLLAR GENERAL CORP	13,084	201.16	2,631,977.44
DOLLAR TREE INC	11,666	107.90	1,258,761.40
EBAY	36,760	61.98	2,278,384.80
ETSY INC	6,262	227.27	1,423,164.74
EXPEDIA GROUP INC	7,468	158.92	1,186,814.56
GENUINE PARTS CO	7,736	102.36	791,856.96
HOME DEPOT	55,880	279.64	15,626,283.20
LKQ CORP	15,761	38.79	611,369.19
LOWES COMPANIES	39,716	177.54	7,051,178.64
MERCADOLIBRE INC	2,351	1,910.39	4,491,326.89
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,890	460.41	1,790,994.90
POOL CORP	2,102	326.08	685,420.16
ROSS STORES INC	18,696	118.95	2,223,889.20
TARGET (DAYTON HUDSON)	26,307	188.82	4,967,287.74
TJX COMPANIES INC	63,005	67.69	4,264,808.45
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,352	171.34	1,088,351.68
ULTA BEAUTY INC	2,953	321.79	950,245.87
WAYFAIR INC- CLASS A	3,526	292.73	1,032,165.98
COSTCO WHOLESALE CORP	23,205	354.77	8,232,437.85
KROGER CO	40,845	34.02	1,389,546.90
SYSCO CORP	25,374	76.71	1,946,439.54
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	38,679	48.86	1,889,855.94
WALMART INC	73,342	138.34	10,146,132.28
ALTRIA GROUP INC	97,650	43.80	4,277,070.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	27,576	56.12	1,547,565.12
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	16,931	75.43	1,277,105.33
BUNGE LIMITED	7,974	76.38	609,054.12
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	46.32	451,249.44
COCA-COLA CO	211,373	50.11	10,591,901.03
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	10,990	52.30	574,777.00
CONAGRA BRANDS INC	25,534	34.10	870,709.40
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,825	223.21	1,969,828.25
GENERAL MILLS INC	30,508	56.50	1,723,702.00
HERSHEY FOODS CORPORATION	8,076	148.85	1,202,112.60
HORMEL FOODS CORP	16,280	47.10	766,788.00
JM SMUCKER CO	5,955	113.76	677,440.80
KELLOGG CO	13,372	57.91	774,372.52
KEURIG DR PEPPER INC	29,538	31.24	922,767.12

KRAFT HEINZ CO/THE	36,802	37.48	1,379,338.96
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,853	78.09	613,240.77
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,530	84.12	1,138,143.60
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	10,321	44.40	458,252.40
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	75,055	54.31	4,076,237.05
MONSTER BEVERAGE CORP	19,772	89.65	1,772,559.80
PEPSICO INC	71,664	132.51	9,496,196.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	81,840	85.45	6,993,228.00
TYSON FOODS INC	16,155	67.52	1,090,785.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	13,463	81.45	1,096,561.35
CLOROX COMPANY	6,885	187.05	1,287,839.25
COLGATE-PALMOLIVE CO	42,799	77.20	3,304,082.80
ESTEE LAUDER CO-CL A	11,809	285.16	3,367,454.44
KIMBERLY-CLARK CORP	17,917	130.63	2,340,497.71
PROCTER & GAMBLE CO	129,289	127.12	16,435,217.68
ABBOTT LABORATORIES	91,765	123.04	11,290,765.60
ABIOMED INC	2,477	331.97	822,289.69
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,932	599.25	2,356,251.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,402	105.87	889,519.74
ANTHEM INC	13,216	294.97	3,898,323.52
BAXTER INTERNATIONAL	26,591	78.44	2,085,798.04
BECTON DICKINSON & CO	15,231	247.93	3,776,221.83
BOSTON SCIENTIFIC CORP	75,159	38.03	2,858,296.77
CARDINAL HEALTH	15,354	52.00	798,408.00
CENTENE CORP	30,436	57.97	1,764,374.92
CERNER CORP	16,674	71.56	1,193,191.44
CIGNA CORP	19,295	204.26	3,941,196.70
CVS HEALTH CORP	68,770	70.42	4,842,783.40
DANAHER CORP	33,555	231.24	7,759,258.20
DAVITA INC	4,396	102.07	448,699.72
DENTSPLY SIRONA INC	11,899	52.76	627,791.24
DEXCOM INC	5,037	418.94	2,110,200.78
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,664	84.31	2,753,901.84
HCA HEALTHCARE INC	14,206	177.37	2,519,718.22
HENRY SCHEIN INC	7,927	63.75	505,346.25
HOLOGIC INC	13,047	75.69	987,527.43
HUMANA INC	6,951	376.91	2,619,901.41
IDEXX LABORATORIES INC	4,468	544.13	2,431,172.84
INSULET CORP	3,604	274.03	987,604.12
INTUITIVE SURGICAL INC	6,150	750.15	4,613,422.50
LABORATORY CRP OF AMER	5,131	246.38	1,264,175.78
MASIMO CORP	2,735	259.35	709,322.25

MCKESSON CORP	8,029	177.62	1,426,110.98
MEDTRONIC PLC	70,598	113.33	8,000,871.34
MOLINA HEALTHCARE INC	3,275	220.83	723,218.25
NOVOCURE LTD	4,504	190.17	856,525.68
QUEST DIAGNOSTICS	7,363	119.23	877,890.49
RESMED INC	7,174	201.18	1,443,265.32
STERIS PLC	4,682	178.73	836,813.86
STRYKER CORP	17,763	242.09	4,300,244.67
TELADOC HEALTH INC	5,748	292.51	1,681,347.48
TELEFLEX INC	2,448	390.43	955,772.64
THE COOPER COS INC	2,931	388.51	1,138,722.81
UNITEDHEALTH GROUP INC	49,350	324.58	16,018,023.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	129.67	505,453.66
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,835	176.35	852,652.25
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,091	313.82	2,225,297.62
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,035	281.55	1,136,054.25
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,323	156.67	1,617,304.41
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,216	190.73	613,387.68
ABBVIE INC	91,335	105.01	9,591,088.35
AGILENT TECHNOLOGIES	16,218	126.87	2,057,577.66
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,509	155.51	1,789,764.59
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,952	155.06	922,917.12
AMGEN	30,781	231.69	7,131,649.89
AVANTOR INC	27,161	28.69	779,249.09
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,201	637.01	765,049.01
BIOGEN INC	8,316	278.35	2,314,758.60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,468	81.76	774,103.68
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	118,455	60.60	7,178,373.00
CATALENT INC	8,308	117.99	980,260.92
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	30.10	625,417.80
EXACT SCIENCES CORP	8,333	147.81	1,231,700.73
GILEAD SCIENCES INC	65,877	64.37	4,240,502.49
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,561	88.87	1,027,426.07
ILLUMINA INC	7,670	486.26	3,729,614.20
INCYTE CORP	9,706	80.54	781,721.24
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,654	57.69	383,869.26
IQVIA HOLDINGS INC	9,571	188.70	1,806,047.70
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	160.60	427,677.80
JOHNSON & JOHNSON	136,903	162.98	22,312,450.94
LILLY (ELI) & CO	44,529	200.92	8,946,766.68
MERCK & CO	130,922	74.31	9,728,813.82
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,179	1,165.45	1,374,065.55

MODERNA INC	13,982	174.74	2,443,214.68
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	113.24	533,133.92
PERKINELMER INC	6,142	136.79	840,164.18
PERRIGO CO PLC	7,371	42.10	310,319.10
PFIZER	287,688	34.44	9,907,974.72
PPD INC	6,368	36.90	234,979.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,491	470.37	2,582,801.67
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	5,941	47.51	282,256.91
SAREPTA THERAPEUTICS INC	4,016	85.38	342,886.08
SEAGEN INC	6,223	157.75	981,678.25
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	11.04	627,701.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,481	478.86	9,807,531.66
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,685	207.02	2,833,068.70
VIATRIS INC	65,242	18.21	1,188,056.82
WATERS CORP	3,249	281.72	915,308.28
ZOETIS INC	24,967	160.00	3,994,720.00
BANK OF AMERICA CORP	404,496	34.54	13,971,291.84
CITIGROUP	109,408	65.78	7,196,858.24
CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,598	42.51	1,003,150.98
FIFTH THIRD BANCORP	37,592	34.54	1,298,427.68
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,506	166.94	1,419,991.64
HUNTINGTON BANCSHARES INC	49,512	15.30	757,533.60
JPMORGAN CHASE & CO	158,455	148.02	23,454,509.10
KEY CORP	48,707	20.15	981,446.05
M & T BANK CORP	7,073	149.97	1,060,737.81
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,304	170.41	3,800,824.64
REGIONS FINL CORP	53,084	20.37	1,081,321.08
SVB FINANCIAL GROUP	2,758	540.40	1,490,423.20
TRUIST FINANCIAL CORP	70,807	57.58	4,077,067.06
US BANCORP	71,231	50.02	3,562,974.62
WELLS FARGO & CO	205,690	37.83	7,781,252.70
ALLY FINANCIAL INC	18,129	42.80	775,921.20
AMERICAN EXPRESS	35,963	131.71	4,736,686.73
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,314	224.49	1,417,429.86
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	9,341	51.83	484,144.03
BANK NEW YORK CO	41,872	42.32	1,772,023.04
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	72,789	241.85	17,604,019.65
BLACKROCK INC	8,014	710.11	5,690,821.54
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	35,249	69.97	2,466,372.53
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,987	119.56	2,867,885.72
CARLYLE GROUP INC/THE	7,865	36.50	287,072.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,888	96.22	566,543.36

CME GROUP INC	18,843	195.07	3,675,704.01
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,150	93.92	1,422,888.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,238	28.69	638,008.22
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,088	313.68	654,963.84
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	27.51	405,717.48
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,176	315.62	5,421,089.12
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,529	113.35	3,233,762.15
INVESCO LTD	19,405	22.47	436,030.35
KKR & CO INC	24,952	46.77	1,167,005.04
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,975	550.21	1,086,664.75
MOODY'S CORP	8,875	280.42	2,488,727.50
MORGAN STANLEY	71,230	76.00	5,413,480.00
MSCI INC	4,393	432.97	1,902,037.21
NASDAQ INC	6,318	144.43	912,508.74
NORTHERN TRUST CORP	10,269	96.31	989,007.39
PRICE T ROWE GROUP INC	11,922	162.77	1,940,543.94
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,565	118.25	776,311.25
S&P GLOBAL INC	12,664	339.24	4,296,135.36
SCHWAB (CHARLES) CORP	80,336	61.91	4,973,601.76
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	58.02	364,887.78
STATE STREET CORP	19,265	71.93	1,385,731.45
SYNCHRONY FINANCIAL	28,151	38.08	1,071,990.08
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,522	69.30	313,374.60
VOYA FINANCIAL INC	6,370	58.43	372,199.10
AFLAC	35,568	48.08	1,710,109.44
ALLEGHANY CORP	778	609.03	473,825.34
ALLSTATE CORP	16,403	103.45	1,696,890.35
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	107.49	408,784.47
AMERICAN INT'L GROUP	45,244	42.58	1,926,489.52
AON PLC	12,170	228.34	2,778,897.80
ARCH CAPITAL GROUP LTD	22,382	35.09	785,384.38
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,925	120.18	1,192,786.50
ASSURANT INC	3,282	123.31	404,703.42
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,517	45.39	295,806.63
BROWN & BROWN INC	12,618	45.59	575,254.62
CHUBB LTD	23,717	164.70	3,906,189.90
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,964	96.26	766,614.64
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	256.16	369,895.04
EVEREST RE GROUP LTD	2,144	239.30	513,059.20
FNF GROUP	14,864	40.47	601,546.08
GLOBE LIFE INC	5,519	95.30	525,960.70
HARTFORD FINANCIAL SVCS	19,714	49.86	982,940.04

LINCOLN NATIONAL CORP	9,779	55.56	543,321.24
LOEWS CORP	12,517	48.06	601,567.02
MARKEL CORP	699	1,091.18	762,734.82
MARSH & MCLENNAN COS	26,613	117.07	3,115,583.91
METLIFE INC	40,523	56.07	2,272,124.61
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,665	55.10	808,041.50
PROGRESSIVE CORP	30,755	87.06	2,677,530.30
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,744	84.10	1,744,570.40
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,361	123.42	414,814.62
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,776	158.55	440,134.80
TRAVELERS COS INC/THE	13,298	145.91	1,940,311.18
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,380	224.98	1,435,372.40
WR BERKLEY CORP	7,737	67.88	525,187.56
CBRE GROUP INC-A	16,391	72.74	1,192,281.34
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	4.57	293,851.00
WEYERHAEUSER CO	36,674	34.99	1,283,223.26
ACCENTURE PLC-CL A	33,436	254.29	8,502,440.44
ADOBE INC	24,871	479.12	11,916,193.52
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	8,444	98.86	834,773.84
ANSYS INC	4,278	395.37	1,691,392.86
AUTODESK INC	11,517	305.40	3,517,291.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	22,593	169.29	3,824,768.97
AVALARA INC	4,011	175.66	704,572.26
BLACK KNIGHT INC	8,009	81.73	654,575.57
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,617	78.71	599,534.07
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	6,056	149.54	905,614.24
CADENCE DESIGN SYSTEMS	14,642	139.66	2,044,901.72
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	96.23	670,049.49
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	115.88	657,734.88
CITRIX SYSTEMS INC	6,139	132.96	816,241.44
CLOUDFLARE INC - CLASS A	8,083	82.17	664,180.11
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	28,484	73.64	2,097,561.76
COUPA SOFTWARE INC	3,649	369.64	1,348,816.36
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,821	239.20	1,870,783.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	163.76	343,896.00
DATADOG INC - CLASS A	7,301	105.05	766,970.05
DOCUSIGN INC	9,158	265.16	2,428,335.28
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	23.45	387,124.77
DYNATRACE INC	8,780	52.88	464,286.40
EPAM SYSTEMS INC	2,881	376.00	1,083,256.00
FAIR ISAAC CORP	1,555	473.82	736,790.10
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,560	130.99	4,265,034.40

FISERV INC	29,908	111.36	3,330,554.88
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,593	273.38	1,255,634.34
FORTINET INC	7,545	171.93	1,297,211.85
GARTNER INC	4,660	183.95	857,207.00
GLOBAL PAYMENTS INC	15,723	194.18	3,053,092.14
GODADDY INC - CLASS A	8,747	84.61	740,083.67
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,453	125.96	560,899.88
HUBSPOT INC	2,271	543.49	1,234,265.79
INTL BUSINESS MACHINES CORP	46,802	118.99	5,568,969.98
INTUIT INC	13,704	411.35	5,637,140.40
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,229	150.89	638,113.81
LEIDOS HOLDINGS	7,121	103.76	738,874.96
MASTERCARD INC-CLASS A	46,381	333.17	15,452,757.77
MICROSOFT CORP	375,183	240.97	90,407,847.51
MONGODB INC	2,429	418.30	1,016,050.70
NORTONLIFELOCK INC	30,049	20.46	614,802.54
OKTA INC	6,353	288.36	1,831,951.08
ORACLE CORP	104,823	61.13	6,407,829.99
PALO ALTO NETWORKS INC	4,829	396.90	1,916,630.10
PAYCHEX INC	15,989	90.25	1,443,007.25
PAYCOM SOFTWARE INC	2,631	400.13	1,052,742.03
PAYPAL HOLDINGS INC	57,921	286.92	16,618,693.32
PTC INC	5,381	146.73	789,554.13
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,007	427.39	1,712,551.73
SALESFORCE.COM INC	47,159	246.56	11,627,523.04
SERVICENOW INC	10,080	570.73	5,752,958.40
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	21,120	43.30	914,496.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,600	290.00	464,000.00
SPLUNK INC	8,669	169.66	1,470,782.54
SQUARE INC - A	19,761	276.57	5,465,299.77
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	12,712	66.44	844,585.28
SYNOPSYS INC	7,642	268.07	2,048,590.94
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	2,242	903.35	2,025,310.70
TWILIO INC - A	6,677	425.55	2,841,397.35
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	473.88	961,028.64
VERISIGN INC	5,696	197.95	1,127,523.20
VISA INC-CLASS A SHARES	87,768	204.73	17,968,742.64
VMWARE INC-CLASS A	4,372	144.68	632,540.96
WESTERN UNION CO	20,387	23.91	487,453.17
WIX.COM LTD	3,010	353.09	1,062,800.90
WORKDAY INC-CLASS A	9,488	276.34	2,621,913.92
ZENDESK INC	6,056	157.69	954,970.64

ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,090	417.26	3,792,893.40
ZSCALER INC	3,969	226.03	897,113.07
AMPHENOL CORPORATION	14,978	132.43	1,983,536.54
APPLE INC	892,563	129.87	115,917,156.81
ARISTA NETWORKS INC	2,873	310.95	893,359.35
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	105.35	405,702.85
CDW CORP/DE	7,547	160.75	1,213,180.25
CISCO SYSTEMS	221,911	45.68	10,136,894.48
COGNEX CORP	9,214	87.43	805,580.02
CORNING	41,640	38.06	1,584,818.40
DELL TECHNOLOGIES -C	13,249	80.77	1,070,121.73
F5 NETWORKS INC	3,275	198.81	651,102.75
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	70,802	14.13	1,000,432.26
HP INC	75,098	27.10	2,035,155.80
IPG PHOTONICS CORP	1,782	234.56	417,985.92
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	23.97	390,902.76
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,591	142.19	1,363,744.29
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,433	182.75	1,541,130.75
NETAPP INC	10,843	71.35	773,648.05
SEAGATE TECHNOLOGY	11,767	73.14	860,638.38
TE CONNECTIVITY LTD	17,336	132.22	2,292,165.92
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,321	72.99	972,299.79
WESTERN DIGITAL CORP	15,203	68.88	1,047,182.64
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,921	490.94	1,434,035.74
AT&T INC	369,056	29.00	10,702,624.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	26.57	208,069.67
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,877	26.26	495,710.02
LUMEN TECHNOLOGIES INC	51,725	11.94	617,596.50
T-MOBILE US INC	29,268	120.10	3,515,086.80
VERIZON COMMUNICATIONS	214,484	56.45	12,107,621.80
AES CORP	36,734	28.31	1,039,939.54
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	47.63	603,138.69
AMEREN CORPORATION	13,544	72.33	979,637.52
AMERICAN ELECTRIC POWER	26,063	79.08	2,061,062.04
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,984	156.66	1,407,433.44
ATMOS ENERGY CORP	6,189	93.56	579,042.84
CENTERPOINT ENERGY INC	27,008	21.43	578,781.44
CMS ENERGY CORP	15,724	55.98	880,229.52
CONSOLIDATED EDISON INC	18,294	68.18	1,247,284.92
DOMINION ENERGY INC	44,143	71.15	3,140,774.45
DTE ENERGY COMPANY	10,549	120.18	1,267,778.82
DUKE ENERGY CORP	38,643	88.43	3,417,200.49

EDISON INTL	20,731	55.22	1,144,765.82
ENERGY CORP	10,980	93.18	1,023,116.40
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,385	45.57	518,814.45
EVERGY INC	12,526	54.23	679,284.98
EVERSOURCE ENERGY	18,392	81.46	1,498,212.32
EXELON CORP	51,190	41.38	2,118,242.20
FIRSTENERGY CORP	28,016	34.03	953,384.48
NEXTERA ENERGY INC	102,934	78.10	8,039,145.40
NISOURCE INC	20,005	22.84	456,914.20
NRG ENERGY INC	12,298	39.58	486,754.84
OGE ENERGY CORP	10,926	31.92	348,757.92
PG&E CORP	76,420	11.64	889,528.80
PINNACLE WEST CAPITAL	6,029	76.26	459,771.54
PPL CORPORATION	42,135	27.68	1,166,296.80
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	25,061	57.75	1,447,272.75
SEMPRA ENERGY	15,194	124.57	1,892,716.58
SOUTHERN CO	55,491	59.31	3,291,171.21
UGI CORP	11,353	40.29	457,412.37
VISTRA CORP	23,603	22.91	540,744.73
WEC ENERGY GROUP INC	15,528	83.23	1,292,395.44
XCEL ENERGY INC	27,593	62.07	1,712,697.51
ADVANCED MICRO DEVICES	61,698	89.58	5,526,906.84
ANALOG DEVICES	19,395	163.80	3,176,901.00
APPLIED MATERIALS	47,989	119.46	5,732,765.94
BROADCOM INC	21,138	489.96	10,356,774.48
ENPHASE ENERGY INC	6,281	189.74	1,191,756.94
INTEL CORP	220,628	63.01	13,901,770.28
KLA CORP	8,166	330.67	2,700,251.22
LAM RESEARCH CORP	7,652	598.41	4,579,033.32
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	33,482	51.89	1,737,380.98
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	14,635	98.15	1,436,425.25
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,414	162.35	2,177,762.90
MICRON TECHNOLOGY	58,376	90.96	5,309,880.96
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,238	393.75	881,212.50
NVIDIA CORP	32,130	597.06	19,183,537.80
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,668	191.59	2,810,242.12
ON SEMICONDUCTOR CORP	22,791	41.87	954,259.17
QORVO INC	6,314	179.39	1,132,668.46
QUALCOMM	59,298	144.94	8,594,652.12
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,301	192.17	1,595,203.17
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	2,629	321.99	846,511.71
TERADYNE INC	9,132	142.59	1,302,131.88

	TEXAS INSTRUMENTS	48,138	178.35	8,585,412.30
	XILINX INC	12,203	138.71	1,692,678.13
	アメリカドル 小計	16,337,618		1,810,693,109.55 (191,028,123,057)
カナダドル	CAMECO CORP	19,186	20.92	401,371.12
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	61,923	34.98	2,166,066.54
	CENOVUS ENERGY INC	50,155	8.72	437,351.60
	ENBRIDGE	106,337	43.70	4,646,926.90
	IMPERIAL OIL	11,645	26.70	310,921.50
	INTER PIPELINE LTD	18,856	17.91	337,710.96
	KEYERA CORP	10,963	26.23	287,559.49
	PARKLAND CORP	8,544	37.50	320,400.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	30,421	34.36	1,045,265.56
	SUNCOR ENERGY	83,740	23.94	2,004,735.60
	TC ENERGY CORP	49,328	56.39	2,781,605.92
	AGNICO EAGLE MINES	12,637	75.47	953,714.39
	B2GOLD CORP	61,440	5.99	368,025.60
	BARRICK GOLD CORP	93,299	24.93	2,325,944.07
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	65.15	475,725.30
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,228	29.08	966,270.24
	FRANCO-NEVADA CORP	9,313	140.38	1,307,358.94
	KINROSS GOLD CORP	69,899	8.28	578,763.72
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	14,569	45.09	656,916.21
	LUNDIN MINING CORP	30,173	15.21	458,931.33
	NUTRIEN LTD	29,840	71.27	2,126,696.80
	PAN AMERICAN SILVER CORP	12,397	41.01	508,400.97
	SSR MINING INC	12,000	19.01	228,120.00
	TECK RESOURCES LTD-CL B	20,669	29.01	599,607.69
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,500	87.68	394,560.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,487	47.46	1,114,693.02
	YAMANA GOLD INC	57,051	5.56	317,203.56
	CAE INC	11,940	32.45	387,453.00
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	92.10	393,174.90
	WSP GLOBAL INC	5,400	119.03	642,762.00
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,771	37.78	369,148.38
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,665	67.06	379,894.90
	THOMSON REUTERS CORP	9,604	103.51	994,110.04
	AIR CANADA	6,737	24.02	161,822.74
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,282	137.85	5,139,323.70
	CP RAILWAY LIMITED	7,113	463.75	3,298,653.75
	MAGNA INTERNATIONAL INC	14,428	105.12	1,516,671.36
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	34.84	348,400.00

RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,739	76.92	1,210,643.88
QUEBECOR INC -CL B	5,999	32.16	192,927.84
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,673	22.16	591,073.68
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,260	179.04	583,670.40
DOLLARAMA INC	16,037	48.20	772,983.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	42,324	38.09	1,612,121.16
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	36.77	269,524.10
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	61.88	561,127.84
METRO INC	13,499	54.32	733,265.68
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	94.03	348,381.15
SAPUTO INC	13,904	36.96	513,891.84
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	40.29	585,977.76
CANOPY GROWTH CORP	9,718	48.77	473,946.86
BANK MONTREAL	33,739	101.25	3,416,073.75
BANK NOVA SCOTIA	63,604	71.51	4,548,322.04
CANADIAN IMPERIAL BANK	23,401	114.76	2,685,498.76
NATIONAL BANK OF CANADA	16,160	75.13	1,214,100.80
ROYAL BANK OF CANADA	74,761	109.77	8,206,514.97
TORONTO-DOMINION BANK	94,707	76.38	7,233,720.66
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	67,442	54.94	3,705,263.48
CI FINANCIAL CORP	9,872	18.00	177,696.00
IGM FINANCIAL INC	3,890	34.93	135,877.70
ONEX CORP	4,872	72.52	353,317.44
TMX GROUP LTD	3,330	125.75	418,747.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,399	514.90	720,345.10
GREAT-WEST LIFECO INC	15,840	31.36	496,742.40
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	64.75	350,621.25
INTACT FINANCIAL CORP	7,896	144.33	1,139,629.68
MANULIFE FINANCIAL CORP	101,728	24.91	2,534,044.48
POWER CORP OF CANADA	31,081	31.02	964,132.62
SUN LIFE FINANCIAL INC	28,937	62.93	1,821,005.41
FIRSTSERVICE CORP	2,028	194.40	394,243.20
BLACKBERRY LIMITED	25,075	13.75	344,781.25
CGI INC - CL A	11,043	96.54	1,066,091.22
CONSTELLATION SOFTWARE INC	985	1,724.27	1,698,405.95
OPEN TEXT CORP	15,059	58.92	887,276.28
SHOPIFY INC - CLASS A	5,687	1,810.58	10,296,768.46
BCE INC	7,663	55.00	421,465.00
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	19,582	55.77	1,092,088.14
TELUS CORP	23,120	26.06	602,507.20
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	33,008	21.80	719,574.40
ALTAGAS INCOME LTD	14,516	19.64	285,094.24

	ATCO LTD -CLASS I	4,372	37.76	165,086.72
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	62.19	389,558.16
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	31.69	189,442.82
	EMERA INC	13,640	50.12	683,636.80
	FORTIS INC	22,342	50.31	1,124,026.02
	HYDRO ONE LTD	18,533	28.04	519,665.32
	NORTHLAND POWER INC	9,907	48.41	479,597.87
	カナダドル 小計	2,073,787		111,682,760.48 (9,350,080,707)
ユーロ	ENI	133,957	9.19	1,232,136.48
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	9.49	225,216.66
	NESTE OIL OYJ	22,227	56.12	1,247,379.24
	OMV AG	8,201	38.96	319,510.96
	REPSOL SA	81,655	9.94	811,650.70
	TENARIS SA	19,529	7.23	141,311.84
	TOTAL SE	132,496	36.95	4,895,727.20
	VOPAK	3,661	40.85	149,551.85
	AIR LIQUIDE	24,892	132.15	3,289,477.80
	AKZO NOBEL	10,744	86.24	926,562.56
	ARCELORMITTAL	35,308	19.77	698,109.77
	ARKEMA	3,446	90.50	311,863.00
	BASF SE	48,271	68.00	3,282,428.00
	COVESTRO AG	9,636	58.66	565,247.76
	CRH PLC	41,453	36.16	1,498,940.48
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	28.06	269,460.18
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	47.00	152,562.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,372	65.60	549,203.20
	KONINKLIJKE DSM NV	8,550	142.40	1,217,520.00
	LANXESS	3,921	62.76	246,081.96
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,335	41.60	471,536.00
	SOLVAY SA	3,676	96.42	354,439.92
	STORA ENSO OYJ R	31,971	16.37	523,365.27
	SYMRISE AG	7,119	101.05	719,374.95
	UMICORE	9,946	48.02	477,606.92
	UPM KYMMENE OYJ	27,357	31.97	874,603.29
	VOESTALPINE AG	5,948	32.19	191,466.12
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,743	25.22	371,818.46
	AIRBUS SE	30,914	91.77	2,836,977.78
	ALSTOM	12,580	41.00	515,780.00
	BOUYGUES ORD	11,344	33.39	378,776.16
	BRENTAG SE	8,461	66.08	559,102.88
	CNH INDUSTRIAL NV	54,274	12.26	665,670.61

DASSAULT AVIATION SA	121	899.00	108,779.00
EIFFAGE	4,629	82.40	381,429.60
FERROVIAL SA	27,832	20.26	563,876.32
GEA GROUP AG	7,649	29.97	229,240.53
HOCHTIEF AG	998	74.95	74,800.10
KINGSPAN GROUP PLC	7,694	62.70	482,413.80
KION GROUP AG	3,430	74.38	255,123.40
KNORR-BREMSE AG	3,943	107.24	422,847.32
KONE OYJ-B	17,857	69.14	1,234,632.98
LEGRAND SA	13,075	74.64	975,918.00
MTU AERO ENGINES AG	2,894	191.55	554,345.70
PRYSMIAN SPA	11,275	26.74	301,493.50
RATIONAL AG	268	813.00	217,884.00
SAFRAN SA	16,847	112.05	1,887,706.35
SAINT-GOBAIN	25,490	43.25	1,102,442.50
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,320	128.60	3,641,952.00
SIEMENS	40,208	132.48	5,326,755.84
SIEMENS ENERGY AG	20,817	32.32	672,805.44
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	33.23	409,460.06
THALES SA	6,027	76.74	462,511.98
VINCI S.A.	27,366	85.02	2,326,657.32
WARTSILA OYJ	18,738	8.68	162,795.74
BUREAU VERITAS SA	16,777	22.10	370,771.70
RANDSTAD NV	5,866	54.90	322,043.40
TELEPERFORMANCE	3,026	286.10	865,738.60
WOLTERS KLUWER	14,206	69.50	987,317.00
ADP	1,532	95.70	146,612.40
AENA SME SA	3,518	130.80	460,154.40
ATLANTIA SPA	26,089	15.05	392,769.89
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	18,089	11.04	199,702.56
DEUTSCHE POST AG-REG	51,984	42.41	2,204,641.44
GETLINK	24,901	13.44	334,669.44
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,397	71.58	1,245,277.26
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	56.75	146,528.50
CONTINENTAL AG	5,742	120.35	691,049.70
DAIMLER AG	44,979	67.22	3,023,488.38
FAURECIA	3,558	46.65	165,980.70
FERRARI NV	6,638	163.75	1,086,972.50
MICHELIN	8,304	119.05	988,591.20
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,619	64.94	559,717.86
RENAULT SA	10,803	38.03	410,892.10
STELLANTIS NV	105,076	13.38	1,405,916.88

VALEO SA	13,052	32.18	420,013.36
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,752	170.54	1,663,106.08
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	189.10	313,338.70
ADIDAS AG	10,007	295.60	2,958,069.20
ESSILORLUXOTTICA	14,953	136.45	2,040,336.85
HERMES INTERNATIONAL	1,666	963.60	1,605,357.60
KERING	3,984	528.00	2,103,552.00
LVMH	14,364	541.80	7,782,415.20
MONCLER SPA	9,963	53.32	531,227.16
PUMA SE	4,644	89.04	413,501.76
SEB SA	1,191	164.80	196,276.80
ACCOR	10,837	31.46	340,932.02
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,492	158.10	1,342,585.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	37.60	200,483.20
SODEXO	5,008	75.24	376,801.92
BOLLORE	37,200	4.08	151,924.80
PUBLICIS GROUPE	11,844	47.71	565,077.24
SCOUT24 AG	5,889	67.50	397,507.50
SES	16,206	6.87	111,464.86
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	73.32	364,327.08
VIVENDI	40,838	29.34	1,198,186.92
DELIVERY HERO SE	6,869	121.70	835,957.30
HELLOFRESH SE	7,756	72.60	563,085.60
INDITEX	56,853	25.90	1,472,492.70
JUST EAT TAKEAWAY	6,525	86.68	565,587.00
PROSUS	25,688	108.20	2,779,441.60
ZALANDO SE	8,109	97.36	789,492.24
CARREFOUR	30,831	15.05	464,006.55
COLRUYT SA	2,228	50.16	111,756.48
JERONIMO MARTINS	13,062	13.00	169,806.00
KESKO OYJ-B SHS	14,326	21.22	303,997.72
KONINKLIJKE AHOLD NV	58,125	22.38	1,300,837.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	40,263	53.36	2,148,433.68
DANONE (GROUPE)	32,489	56.82	1,846,024.98
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	9.68	258,059.23
HEINEKEN HOLDING NV	6,065	75.15	455,784.75
HEINEKEN NV	13,695	86.36	1,182,700.20
JDE PEET'S BV	4,123	32.58	134,327.34
KERRY GROUP PLC-A	8,770	103.40	906,818.00
PERNOD-RICARD	11,015	163.35	1,799,300.25
REMY COINTREAU	1,020	165.90	169,218.00
BEIERSDORF AG	5,634	85.08	479,340.72

HENKEL AG & CO KGAA	5,620	75.20	422,624.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	8,553	84.78	725,123.34
LOREAL	13,231	316.10	4,182,319.10
AMPLIFON SPA	6,606	34.94	230,813.64
BIOMERIEUX	2,374	113.70	269,923.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	132.40	276,848.40
DIASORIN SPA	1,418	169.50	240,351.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	11,179	59.10	660,678.90
FRESENIUS SE&CO KGAA	20,026	36.00	720,936.00
KONINKLIJKE PHILIPS	48,035	46.65	2,241,072.92
ORPEA	2,927	108.65	318,018.55
SARTORIUS AG-VORZUG	1,715	466.00	799,190.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,610	46.80	683,748.00
ARGENX SE	2,207	302.80	668,279.60
BAYER	51,630	53.91	2,783,373.30
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	81.11	526,403.90
GALAPAGOS NV	2,380	70.88	168,694.40
GRIFOLS SA	14,240	22.02	313,564.80
IPSEN	1,866	70.25	131,086.50
MERCK KGAA	6,800	139.00	945,200.00
ORION OYJ-CLASS B	5,393	35.89	193,554.77
QIAGEN N.V.	11,006	45.97	505,945.82
RECORDATI SPA	5,195	43.80	227,541.00
SANOFI	59,562	77.01	4,586,869.62
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,536	387.60	595,353.60
UCB (GROUPE)	6,777	83.62	566,692.74
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	9.29	183,180.22
BANCO BILBAO VIZCAYA	346,883	4.50	1,562,707.91
BANCO SANTANDER SA	914,486	2.97	2,721,053.09
BNP PARIBAS	59,132	48.32	2,857,553.90
CAIXABANK	190,947	2.35	448,725.45
COMMERZBANK AG	55,963	5.32	298,170.86
CREDIT AGRICOLE SA	59,470	11.32	673,497.75
ERSTE GROUP BANK AG	14,009	26.41	369,977.69
FINECOBANK SPA	35,526	14.85	527,561.10
ING GROEP NV-CVA	205,776	8.95	1,841,695.20
INTESA SANPAOLO	870,305	2.10	1,835,038.09
KBC GROEP NV	13,328	58.86	784,486.08
MEDIOBANCA	29,447	9.08	267,378.76
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	17.08	134,351.28
SOCIETE GENERALE	38,744	19.80	767,363.66
UNICREDIT SPA	111,941	8.34	934,259.58

AMUNDI SA	2,812	65.60	184,467.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	95,207	9.56	910,178.92
DEUTSCHE BOERSE	9,984	136.70	1,364,812.80
EURAZEO SA	2,340	62.10	145,314.00
EXOR NV	5,889	66.10	389,262.90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	83.82	467,883.24
NATIXIS	40,748	4.05	165,396.13
SOFINA	752	286.50	215,448.00
WENDEL	1,047	94.05	98,470.35
AEGON	107,063	3.93	421,507.03
AGEAS	8,621	46.17	398,031.57
ALLIANZ SE-REG	21,926	195.38	4,283,901.88
ASSICURAZIONI GENERALI	57,446	15.58	895,008.68
AXA SA	101,683	19.85	2,019,017.64
CNP ASSURANCES	8,406	14.20	119,365.20
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	140.20	417,235.20
MUENCHENER RUECKVERSICH.	7,362	236.00	1,737,432.00
NN GROUP NV	16,355	36.67	599,737.85
POSTE ITALIANE SPA	25,777	9.39	242,252.24
SAMPO OYJ-A SHS	26,212	36.64	960,407.68
SCOR SE	9,309	27.76	258,417.84
AROUNDTOWN SA	52,418	5.83	306,016.28
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,289	39.86	649,279.54
LEG IMMOBILIEN AG	3,774	116.48	439,595.52
VONOVIA SE	28,209	53.82	1,518,208.38
ADYEN NV	959	2,211.00	2,120,349.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	23,459	55.16	1,293,998.44
ATOS SE	5,368	62.96	337,969.28
BECHTLE AG	1,432	165.20	236,566.40
CAPGEMINI SA	7,918	140.05	1,108,915.90
DASSAULT SYSTEMES SA	6,557	188.45	1,235,666.65
EDENRED	12,673	47.89	606,909.97
NEMETSCHKE SE	3,320	55.50	184,260.00
NEXI SPA	19,721	15.52	306,069.92
SAP SE	54,885	104.94	5,759,631.90
TEAMVIEWER AG	7,213	49.13	354,374.69
WORLDLINE SA	13,031	77.08	1,004,429.48
NOKIA OYJ	312,308	3.39	1,060,129.50
CELLNEX TELECOM SA	16,359	43.81	716,687.79
DEUTSCHE TELEKOM	175,163	14.83	2,597,667.29
ELISA A	8,166	50.52	412,546.32
ILIAD SA	637	152.50	97,142.50

	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	8.71	129,578.67
	KPN (KON.)	173,861	2.83	492,895.93
	ORANGE	97,536	9.76	952,341.50
	PROXIMUS	7,531	17.70	133,336.35
	TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.37	184,929.22
	TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.42	145,434.44
	TELEFONICA	265,383	3.73	990,940.12
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.39	98,027.84
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	39.03	229,847.67
	E.ON SE	109,829	8.68	953,755.03
	ELECTRICITE DE FRANCE	32,823	10.20	334,794.60
	ELIA GROUP SA/NV	1,959	94.30	184,733.70
	ENAGAS	11,944	17.11	204,361.84
	ENDESA	17,138	21.71	372,065.98
	ENEL	427,771	8.19	3,506,011.11
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	4.76	663,460.88
	ENGIE	90,430	12.89	1,166,094.85
	FORTUM OYJ	24,235	21.36	517,659.60
	IBERDROLA SA	320,404	10.51	3,367,446.04
	NATURGY ENERGY GROUP SA	14,147	20.61	291,569.67
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	14.82	345,246.72
	RWE STAMM	31,648	32.47	1,027,610.56
	SNAM SPA	108,807	4.36	474,724.94
	SUEZ	17,194	17.00	292,298.00
	TERNA SPA	81,545	5.93	483,888.03
	UNIPER SE	11,514	29.86	343,808.04
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	30,042	22.38	672,339.96
	VERBUND AG	3,100	67.05	207,855.00
	ASML HOLDING NV	22,073	494.00	10,904,062.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	68,542	36.60	2,508,637.20
	STMICROELECTRONICS	31,427	34.62	1,088,002.74
	ユーロ 小計	9,826,451		224,687,050.33 (28,739,720,607)
イギリスポンド	BP PLC	1,065,680	2.72	2,902,379.48
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	215,686	13.97	3,013,564.79
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	194,923	13.40	2,612,747.89
	ANGLO AMERICAN PLC	64,546	28.70	1,852,470.20
	ANTOFAGASTA PLC	22,848	18.38	419,946.24
	BHP GROUP PLC	111,101	22.77	2,530,325.27
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,013	64.62	453,180.06
	EVRAZ PLC	34,476	5.56	191,893.41
	FRESNILLO PLC	9,811	9.84	96,540.24

GLENCORE PLC	520,278	3.00	1,561,614.41
JOHNSON MATTHEY PLC	11,167	31.28	349,303.76
MONDI PLC	27,428	18.16	498,092.48
RIO TINTO PLC REG	59,008	63.52	3,748,188.16
ASHTED GROUP PLC	22,004	39.95	879,059.80
BAE SYSTEMS PLC	156,168	4.65	726,649.70
BUNZL PLC	18,924	22.82	431,845.68
DCC PLC	5,588	59.96	335,056.48
FERGUSON PLC	11,106	87.38	970,442.28
MELROSE INDUSTRIES PLC	238,890	1.70	406,590.78
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	441,096	0.98	435,185.31
SMITHS GROUP PLC	20,046	14.91	298,986.09
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	113.30	416,037.60
EXPERIAN PLC	45,647	24.89	1,136,153.83
INTERTEK GROUP PLC	8,461	56.94	481,769.34
RELX PLC	101,622	17.60	1,789,055.31
RENTOKIL INITIAL PLC	103,579	4.98	516,341.31
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	6.84	348,893.43
BURBERRY GROUP PLC	23,085	18.39	424,648.57
PERSIMMON PLC	16,612	27.73	460,650.76
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.62	269,661.95
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	43.40	284,270.00
COMPASS GROUP PLC	93,868	14.26	1,338,557.68
ENTAIN PLC	33,300	13.65	454,711.50
INTERCONTINENTAL HOTELS	9,162	51.10	468,178.20
WHITBREAD PLC	10,170	34.18	347,610.60
AUTO TRADER GROUP PLC	54,849	6.07	333,262.52
INFORMA PLC	85,530	5.09	435,347.70
PEARSON	43,729	7.50	327,967.50
WPP PLC	65,133	8.42	548,940.92
JD SPORTS FASHION PLC	22,866	8.50	194,361.00
KINGFISHER PLC	122,650	2.76	338,759.30
NEXT PLC	7,478	76.70	573,562.60
OCADO GROUP PLC	23,500	25.59	601,365.00
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	1.72	192,755.45
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.30	189,379.56
TESCO PLC	406,897	2.27	926,097.57
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,743	23.71	444,396.53
BRITISH AMERICAN TOBACCO	120,649	25.62	3,091,027.38
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	23.25	211,923.75
DIAGEO	122,917	29.96	3,683,207.90
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	13.94	635,900.98

	RECKITT BENCKISER PLC	37,408	60.72	2,271,413.76
	UNILEVER PLC	135,746	39.05	5,300,881.30
	SMITH & NEPHEW PLC	42,096	14.73	620,284.56
	ASTRAZENECA	68,999	72.26	4,985,867.74
	GLAXOSMITHKLINE	263,839	12.15	3,206,171.52
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	23.61	202,715.46
	BARCLAYS	912,838	1.53	1,402,484.30
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,070,947	4.23	4,540,279.80
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,724,621	0.38	1,422,432.75
	NATWEST GROUP PLC	252,932	1.80	455,656.99
	STANDARD CHARTERED PLC	142,008	4.92	699,389.40
	3I GROUP PLC	50,412	11.36	572,680.32
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	15.16	276,609.36
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,645	97.22	1,618,226.90
	M&G PLC	150,600	1.89	285,688.20
	SCHRODERS PLC	5,525	34.93	192,988.25
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	12.14	324,477.92
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	130,654	3.26	426,585.31
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	30.67	302,774.24
	AVIVA PIC	206,665	3.64	753,293.92
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	3.12	215,384.69
	LEGAL & GENERAL GROUP	289,782	2.64	766,763.17
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	29,063	7.06	205,242.90
	PRUDENTIAL	137,249	14.16	1,943,445.84
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	51,693	6.76	349,548.06
	AVEVA GROUP PLC	4,523	37.56	169,883.88
	SAGE GROUP PLC	58,775	5.95	350,063.90
	HALMA PLC	20,325	24.66	501,214.50
	BT GROUP PLC	498,277	1.31	654,735.97
	VODAFONE GROUP PLC	1,411,125	1.31	1,850,831.55
	NATIONAL GRID PLC	185,192	8.44	1,564,131.63
	SEVERN TRENT PLC	11,927	22.56	269,073.12
	SSE PLC	50,382	14.12	711,645.75
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	9.12	316,609.92
	イギリスポンド 小計	15,401,357		85,908,335.13 (12,712,715,432)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	19.71	172,466.82
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	408	854.50	348,636.00
	GIVAUDAN-REG	488	3,565.00	1,739,720.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	27,676	49.95	1,382,416.20
	SIKA AG-BR	7,487	248.60	1,861,268.20
	ABB LTD	97,185	27.08	2,631,769.80

	GEBERIT AG-REG	2,057	555.60	1,142,869.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	253.40	230,847.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	258.70	522,832.70
	ADECCO GROUP AG-REG	8,520	57.60	490,752.00
	SGS SA	311	2,705.00	841,255.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	210.10	573,573.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	27,428	88.52	2,427,926.56
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,586	267.80	424,730.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	51.60	155,006.40
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	149	1,974.00	294,126.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	85,200.00	426,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	8,055.00	443,025.00
	NESTLE SA - REGISTERED	149,633	98.21	14,695,456.93
	ALCON INC	25,978	64.48	1,675,061.44
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,088	242.20	747,913.60
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	589	1,154.00	679,706.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,929	600.80	2,360,543.20
	NOVARTIS	116,807	79.25	9,256,954.75
	ROCHE HOLDING GENUSS	36,436	303.15	11,045,573.40
	VIFOR PHARMA AG	2,126	115.50	245,553.00
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,566	98.50	154,251.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	122,108	12.58	1,536,729.18
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,425	54.18	564,826.50
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,041	1,096.00	1,140,936.00
	UBS GROUP AG	186,228	13.91	2,590,431.48
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	154.70	361,069.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,617	443.70	717,462.90
	SWISS RE LTD	15,110	82.52	1,246,877.20
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,929	375.00	2,973,375.00
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	87.40	316,562.80
	TEMENOS AG - REG	3,520	134.15	472,208.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	104.60	867,970.80
	SWISSCOM	1,455	464.80	676,284.00
	スイスフラン 小計	894,608		70,434,968.06 (8,285,969,642)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	9,250	259.20	2,397,600.00
	BOLIDEN AB	13,081	333.20	4,358,589.20
	SCA SV CELLULOSA B	31,928	153.70	4,907,333.60
	ALFA LAVAL AB	16,723	257.30	4,302,827.90
	ASSA ABLOY AB-B	52,153	216.80	11,306,770.40
	ATLAS COPCO A	35,391	510.40	18,063,566.40
	ATLAS COPCO B	20,378	436.70	8,899,072.60

EPIROC AB-A	35,996	181.50	6,533,274.00	
EPIROC AB-B	21,132	167.00	3,529,044.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	201.20	1,625,897.20	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,465	289.20	4,761,678.00	
SANDVIK AB	58,793	226.00	13,287,218.00	
SKANSKA B	18,477	206.90	3,822,891.30	
SKF AB-B	18,340	228.20	4,185,188.00	
VOLVO B	75,056	216.50	16,249,624.00	
SECURITAS B	15,577	127.20	1,981,394.40	
ELECTROLUX AB-SER B	12,053	208.60	2,514,255.80	
HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	103.55	2,261,635.55	
EVOLUTION GAMING GROUP	8,473	1,078.00	9,133,894.00	
HENNES & MAURITZ B	42,447	189.00	8,022,483.00	
ICA GRUPPEN AB	4,719	411.20	1,940,452.80	
SWEDISH MATCH AB	8,284	591.00	4,895,844.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	32,140	258.00	8,292,120.00	
NORDEA BANK ABP	170,849	75.05	12,822,217.45	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	84,995	97.00	8,244,515.00	
SVENSKA HANDELSBK A	81,197	87.00	7,064,139.00	
SWEDBANK AB-A	46,881	146.00	6,844,626.00	
EQT AB	12,798	253.20	3,240,453.60	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,765	294.00	1,694,910.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	278.80	2,406,322.80	
INVESTOR AB-B SHS	24,011	634.00	15,222,974.00	
KINNEVIK AB - B	12,818	412.05	5,281,656.90	
LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	427.80	1,750,985.40	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,413	401.40	2,172,778.20	
ERICSSON (LM) B	153,815	107.35	16,512,040.25	
HEXAGON AB-B SHS	14,685	730.00	10,720,050.00	
TELE2 AB-B SHS	24,520	107.15	2,627,318.00	
TELIA CO AB	133,145	34.65	4,613,474.25	
スウェーデンクローナ 小計	1,360,394		248,491,115.00 (3,170,746,627)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	51,412	151.85	7,806,912.20
	NORSK HYDRO	61,358	43.98	2,698,524.84
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,800	417.70	4,093,460.00
	ADEVINTA ASA	16,857	130.00	2,191,410.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	303.00	1,425,918.00
	SCHIBSTED ASA-CL A	4,047	359.30	1,454,087.10
	MOWI ASA	23,314	200.00	4,662,800.00
	ORKLA	39,803	79.16	3,150,805.48
	DNB ASA	48,569	168.40	8,179,019.60

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	202.80	2,261,828.40	
	TELENOR ASA	38,320	139.85	5,359,052.00	
	ノルウェークローネ 小計	309,339		43,283,817.62 (540,614,882)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	548.20	2,913,134.80	
	NOVOZYMES A/S	11,684	389.90	4,555,591.60	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	428	2,300.00	984,400.00	
	VESTAS WIND SYSEMS	10,361	1,274.50	13,205,094.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	11,900.00	1,808,800.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	324	12,830.00	4,156,920.00	
	DSV PANALPINA A S	10,892	1,135.00	12,362,420.00	
	PANDORA A/S	5,549	639.60	3,549,140.40	
	CARLSBERG AS-B	5,756	1,005.50	5,787,658.00	
	AMBU A/S-B	8,639	299.90	2,590,836.10	
	COLOPLAST-B	6,583	973.80	6,410,525.40	
	DEMANT A/S	4,463	258.60	1,154,131.80	
	GN STORE NORD A/S	6,740	548.80	3,698,912.00	
	GENMAB A/S	3,223	2,460.00	7,928,580.00	
	H LUNDBECK A/S	3,647	252.60	921,232.20	
	NOVO NORDISK A/S-B	90,541	455.25	41,218,790.25	
	DANSKE BANK A/S	31,666	113.15	3,583,007.90	
TRYG A/S	5,472	199.00	1,088,928.00		
ORSTED A/S	9,954	1,019.00	10,143,126.00		
	デンマーククローネ 小計	221,388		128,061,228.95 (2,202,653,137)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	12,821	26.49	339,628.29	
	OIL SEARCH LTD	110,184	4.05	446,245.20	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	4.45	391,079.35	
	SANTOS	83,906	6.82	572,238.92	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,845	28.75	139,293.75	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,027	24.00	1,152,648.00	
	BHP GROUP LTD	154,982	47.32	7,333,748.24	
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	17.28	372,366.72	
	EVOLUTION MINING LTD	88,310	4.13	364,720.30	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	89,297	23.97	2,140,449.09	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	23,436	39.10	916,347.60	
	NEWCREST MINING LIMITED	45,541	24.24	1,103,913.84	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	10.38	603,306.36	
	ORICA LTD	19,570	14.94	292,375.80	
	RIO TINTO LTD	19,564	123.26	2,411,458.64	
	SOUTH32 LTD	268,050	2.68	718,374.00	
CIMIC GROUP LIMITED	2,943	21.26	62,568.18		

BRAMBLES LTD	82,211	10.20	838,552.20	
AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.99	373,479.96	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	4.62	184,559.76	
TRANSURBAN GROUP	144,192	12.77	1,841,331.84	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,759	32.80	1,008,895.20	
CROWN RESORTS LTD	18,801	10.25	192,710.25	
TABCORP HOLDINGS LTD	98,817	4.59	453,570.03	
REA GROUP LTD	3,000	153.60	460,800.00	
SEEK LTD	17,113	30.37	519,721.81	
WESFARMERS LTD	59,706	54.01	3,224,721.06	
COLES GROUP LTD	75,451	16.41	1,238,150.91	
WOOLWORTHS GROUP LTD	66,533	39.52	2,629,384.16	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	22,146	13.38	296,313.48	
TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.18	385,486.40	
COCHLEAR LIMITED	3,460	221.68	767,012.80	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	62.16	599,284.56	
SONIC HEALTHCARE LTD	24,299	34.22	831,511.78	
CSL LIMITED	23,902	274.43	6,559,425.86	
AUST AND NZ BANKING GROUP	149,305	26.61	3,973,006.05	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	93,117	82.51	7,683,083.67	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	167,682	25.11	4,210,495.02	
WESTPAC BANKING	190,099	24.09	4,579,484.91	
AMP LTD	182,052	1.35	245,770.20	
ASX LTD	10,329	69.13	714,043.77	
MACQUARIE GROUP LIMITED	17,232	142.26	2,451,424.32	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,690	44.99	300,983.10	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	4.95	566,799.75	
MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	2.79	360,613.08	
QBE INSURANCE GROUP	78,439	8.99	705,166.61	
SUNCORP GROUP LIMITED	74,390	9.80	729,022.00	
AFTERPAY LTD	11,231	151.92	1,706,213.52	
COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	14.00	307,580.00	
WISETECH GLOBAL LTD	6,445	31.30	201,728.50	
XERO LTD	6,423	124.70	800,948.10	
TELSTRA CORP	199,810	3.31	661,371.10	
TPG TELECOM LTD	22,697	6.91	156,836.27	
AGL ENERGY LTD	32,928	10.10	332,572.80	
AUSNET SERVICES	80,543	1.68	135,714.95	
オーストラリアドル 小計	3,582,232		72,588,532.06 (6,038,639,982)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	6.75	436,461.75
	A2 MILK CO LTD	40,302	11.17	450,173.34

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	29,782	32.95	981,316.90	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	15.05	331,100.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.67	488,215.81	
	MERCURY NZ LTD	46,613	6.40	298,323.20	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	5.80	371,397.20	
	ニュージーランドドル 小計	371,935		3,356,988.20 (258,689,510)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	143,948	55.30	7,960,324.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	73,500	127.50	9,371,250.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	21.95	2,238,900.00	
	MTR CORP	82,500	45.20	3,729,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	112,000	66.90	7,492,800.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	35.45	4,502,150.00	
	SJM HOLDINGS LTD	92,000	9.88	908,960.00	
	WYNN MACAU LTD	60,800	14.06	854,848.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	27.20	2,257,600.00	
	WH GROUP LTD	516,000	6.49	3,348,840.00	
	BANK EAST ASIA	46,964	18.10	850,048.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	196,000	24.30	4,762,800.00	
	HANG SENG BANK	39,300	150.60	5,918,580.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	63,600	567.00	36,061,200.00	
	AIA GROUP LTD	636,800	101.50	64,635,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	131,948	42.60	5,620,984.80	
	ESR CAYMAN LTD	92,400	27.80	2,568,720.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	21.65	2,489,750.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	32.15	2,564,316.15	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	37.10	2,828,875.00	
	SINO LAND CO	204,600	11.82	2,418,372.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	69,500	113.90	7,916,050.00	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	56.00	1,120,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	23.35	1,611,150.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	45.85	3,713,850.00	
	PCCW LTD	212,000	4.56	966,720.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	42.85	1,371,200.00	
	CLP HOLDINGS	84,000	72.20	6,064,800.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	541,229	11.10	6,007,641.90	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	41.65	3,061,275.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	117.80	1,378,260.00	
	香港ドル 小計	4,269,300		206,594,465.65 (2,811,750,677)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,200	5.03	403,406.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.75	280,500.00	

	SINGAPORE AIRLINES	87,750	4.35	381,712.50	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.84	268,548.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	111,600	5.57	621,612.00	
	DBS GROUP	94,100	25.63	2,411,783.00	
	OCBC BANK	171,450	10.54	1,807,083.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	61,600	23.60	1,453,760.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.83	417,775.00	
	CAPITALAND LTD	118,900	3.11	369,779.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	7.13	156,860.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	7.31	181,288.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	20.21	289,003.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	426,280	2.35	1,001,758.00	
	シンガポールドル 小計	1,649,980		10,044,867.50	(801,078,183)
イスラエルシェケル	ICL LTD	28,484	19.39	552,304.76	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	455.90	568,963.20	
	BANK HAPOALIM BM	61,880	24.03	1,486,976.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	20.73	1,465,445.16	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	12.80	822,105.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	80.88	507,279.36	
	AZRIELI GROUP	1,471	208.00	305,968.00	
	NICE LTD	3,165	814.00	2,576,310.00	
	イスラエルシェケル 小計	237,439		8,285,352.48	(267,036,910)
	合 計	56,535,828		266,207,819,353	(266,207,819,353)

(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	63,405	586,496.25	
		LENLEASE GROUP	36,448	433,366.72	
		SYDNEY AIRPORT	64,383	354,106.50	
		オーストラリアドル 小計	164,236	1,373,969.47	(114,300,520)
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	985,400.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,957,300.00	
		香港ドル 小計	315,000	2,942,700.00	(40,050,147)
		投資信託受益証券合計	479,236	154,350,667	(154,350,667)
投資証券		AGNC INVESTMENT CORP	29,331	482,788.26	

アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,917	1,149,882.08	
	AMERICAN TOWER CORPORATION	23,310	5,276,684.70	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	592,999.02	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,909	1,229,871.09	
	BOSTON PROPERTIES	7,834	722,608.16	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	535,427.09	
	CROWN CASTLE INTL CORP	22,679	3,760,178.20	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	14,129	1,927,902.05	
	DUKE REALTY CORP	19,101	782,949.99	
	EQUINIX INC	4,653	3,165,063.66	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	558,404.01	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,276	1,223,943.72	
	ESSEX PROPERTY TRUST	3,352	884,559.28	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,715	803,315.45	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	29,633	882,470.74	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	39,300	657,882.00	
	INVITATION HOMES INC	27,833	834,433.34	
	IRON MOUNTAIN INC	15,540	499,921.80	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,097	592,340.42	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,042	831,197.94	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	12,315	459,349.50	
	PROLOGIS INC	38,819	4,087,640.70	
	PUBLIC STORAGE	8,263	1,939,326.10	
	REALTY INCOME CORP	18,819	1,149,652.71	
	REGENCY CENTERS CORP	8,875	468,600.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,544	1,451,252.88	
	SIMON PROPERTY GROUP	16,762	1,834,265.66	
	SUN COMMUNITIES INC	5,410	825,079.10	
	UDR INC	14,820	625,700.40	
	VENTAS INC	20,522	1,075,147.58	
VEREIT INC	11,046	403,841.76		
VICI PROPERTIES INC	27,993	782,684.28		
VORNADO REALTY TRUST	7,639	284,552.75		
WELLTOWER INC	20,601	1,408,902.39		
WP CAREY INC	8,887	607,248.71		
	アメリカドル 小計	620,141	44,798,067.52	(4,726,196,123)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	249,496.18	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	161,725.60	
	カナダドル 小計	14,014	411,221.78	(34,427,487)
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	

	COVIVIO(FP)	3,076	195,479.80
	GECINA SA	2,760	314,088.00
	KLEPIERRE	8,356	143,932.10
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,340	407,810.40
	ユーロ 小計	1,627,116	1,061,310.30 (135,752,200)
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	182,947.25
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	197,933.12
	SEGRO PLC	66,276	647,781.62
	イギリスポンド 小計	137,583	1,028,661.99 (152,221,401)
オーストラ リアドル	DEXUS	59,885	512,016.75
	GOODMAN GROUP	92,279	1,589,044.38
	GPT GROUP	120,265	496,694.45
	MIRVAC GROUP	176,235	387,717.00
	SCENTRE GROUP	274,323	748,901.79
	STOCKLAND	121,481	536,946.02
	VICINITY CENTERS	163,023	251,870.53
	オーストラリアドル 小計	1,007,491	4,523,190.92 (376,284,252)
香港ドル	LINK REIT	108,900	7,639,335.00
	香港ドル 小計	108,900	7,639,335.00 (103,971,349)
シンガポー ルドドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	189,509	578,002.45
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	196,300	404,378.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	132,200	261,756.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	168,542	321,915.22
	SUNTEC REIT	113,000	164,980.00
	シンガポールドドル 小計	799,551	1,731,031.67 (138,049,775)
	投資証券合計	4,314,796	5,666,902,587 (5,666,902,587)
	合計		5,821,253,254 (5,821,253,254)

(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	97.6%			70.2%
	投資証券 36銘柄			2.4%	1.7%
カナダドル	株式 87銘柄	99.6%			3.4%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	99.5%			10.6%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 85銘柄	98.8%			4.7%
	投資証券 3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 38銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 19銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 55銘柄	92.5%			2.2%
	投資信託受益証券 3銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.8%	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 31銘柄	95.1%			1.0%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.5%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	85.3%			0.3%
	投資証券 5銘柄			14.7%	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。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2021年 2月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	240,304,309
コール・ローン	1,457,737,514
国債証券	139,919,380,535
派生商品評価勘定	11,538,404
未収入金	862,678
未収利息	844,340,153
前払金	25,187,967
前払費用	18,396,536
差入委託証拠金	317,361,752
流動資産合計	142,835,109,848
資産合計	142,835,109,848
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,540,382
未払解約金	102,898,157
未払利息	1,182
流動負債合計	128,439,721
負債合計	128,439,721
純資産の部	
元本等	
元本	55,567,630,111
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	87,139,040,016
元本等合計	142,706,670,127
純資産合計	142,706,670,127
負債純資産合計	142,835,109,848

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 2月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2021年 2月22日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 2月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	55,567,630,111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 2.5682円 (1万口当たり純資産額) (25,682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

	2021年 2月22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。

	2021年 2月22日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 2月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 2月22日
期首元本額	56,765,977,261円
期中追加設定元本額	8,542,350,380円
期中一部解約元本額	9,740,697,530円
期末元本額	55,567,630,111円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,112,146,502円
DC外国債券インデックスファンド	2,028,146,947円
DC外国債券インデックスファンドL	13,652,926,275円
DCバランスファンド30	855,410,368円
DCバランスファンド50	865,861,783円
DCバランスファンド70	165,839,984円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	430,589,437円
外国債券インデックスe	1,116,405,478円
インデックスコレクション（外国債券）	7,518,350,241円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,608,749,439円
インデックスコレクション（バランス株式50）	644,373,212円
インデックスコレクション（バランス株式70）	154,161,558円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,727,577,968円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,758,159,654円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	512,834,722円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	113,020,262円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	551,362,816円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	311,115,135円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	213,337,663円

区分	2021年 2月22日現在
V Aバランス株式30（適格機関投資家専用）	460,444円
V Aバランスファンド（株60 / 100）（適格機関投資家専用）	738,135,489円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,685,232,540円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	623,783,204円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,492,606,103円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	337,885,317円
V Aバランスファンド（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	276,374,017円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,660,774,371円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	109,577,566円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	201,535,947円
V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	103,527,539円
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	55,651,159円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	88,773,810円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	242,526,416円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	75,486,047円
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	1,513,347,526円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	21,583,172円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 2月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		1,817,213,769
合計		1,817,213,769

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2021年 2月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
				うち1年超	
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,573,498,250	-	1,548,310,283	25,187,967
合計		1,573,498,250	-	1,548,310,283	25,187,967

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2021年 2月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,361,395,111	-	1,372,581,100	11,185,989
	アメリカドル	603,850,640	-	607,507,200	3,656,560
	カナダドル	78,327,450	-	79,505,500	1,178,050
	ユーロ	569,300,881	-	573,126,400	3,825,519
	イギリスポンド	109,916,140	-	112,442,000	2,525,860
	合計		1,361,395,111	-	1,372,581,100

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 10/15/23	5,200,000.00	5,193,500.00	
		T 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,170,135.94	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	4,270,435.53	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,177,742.18	
		T 0.25% 09/30/25	7,000,000.00	6,916,328.16	
		T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,872,812.52	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,860,937.52	
		T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,739,663.30	
		T 0.5% 03/15/23	3,980,000.00	4,011,093.75	

T 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	4,014,375.00	
T 0.5% 06/30/27	6,000,000.00	5,863,828.14	
T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	1,071,898.44	
T 0.5% 10/31/27	3,580,000.00	3,479,032.83	
T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,361,085.94	
T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	6,979,703.16	
T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	8,575,780.51	
T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,933,203.14	
T 0.875% 11/15/30	2,600,000.00	2,493,359.38	
T 1.125% 05/15/40	4,420,000.00	3,829,860.95	
T 1.125% 08/15/40	4,000,000.00	3,451,875.00	
T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	4,119,200.00	
T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	4,055,847.67	
T 1.375% 08/15/50	4,000,000.00	3,325,937.52	
T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,556,060.55	
T 1.375% 09/30/23	3,550,000.00	3,662,324.23	
T 1.375% 10/15/22	2,250,000.00	2,296,977.54	
T 1.375% 11/15/40	700,000.00	631,421.87	
T 1.5% 01/15/23	2,000,000.00	2,052,617.18	
T 1.5% 01/31/22	3,000,000.00	3,040,429.68	
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,860,807.82	
T 1.5% 02/28/23	1,760,000.00	1,809,018.74	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,115,625.00	
T 1.5% 08/15/22	5,800,000.00	5,920,757.79	
T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	5,531,046.87	
T 1.5% 09/15/22	4,000,000.00	4,087,187.52	
T 1.5% 09/30/24	8,000,000.00	8,338,125.04	
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	6,044,912.09	
T 1.625% 04/30/23	5,800,000.00	5,988,726.54	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,675,273.42	
T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,496,132.81	
T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,431,609.38	
T 1.625% 08/15/29	2,260,000.00	2,342,454.69	
T 1.625% 08/31/22	500,000.00	511,552.73	
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,257,667.97	
T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	4,104,687.52	
T 1.625% 11/15/50	2,600,000.00	2,304,859.38	
T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	3,180,198.03	
T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,734,158.19	
T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,712,449.23	
T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,546,044.92	
T 1.75% 04/30/22	2,000,000.00	2,039,648.44	

T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,694,156.25
T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,812,822.27
T 1.75% 05/31/22	2,650,000.00	2,705,846.68
T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,556,005.85
T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	2,098,828.12
T 1.75% 07/15/22	1,200,000.00	1,227,703.12
T 1.75% 09/30/22	1,050,000.00	1,077,706.05
T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	3,367,918.75
T 1.875% 01/31/22	3,800,000.00	3,864,421.89
T 1.875% 03/31/22	5,100,000.00	5,201,103.52
T 1.875% 04/30/22	2,800,000.00	2,859,609.36
T 1.875% 05/31/22	2,350,000.00	2,403,379.87
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	4,235,124.20
T 1.875% 07/31/22	2,880,000.00	2,953,743.75
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,915,382.80
T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,669,976.55
T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,542,568.36
T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	2,059,648.44
T 2.125% 02/29/24	1,400,000.00	1,480,281.25
T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,270,359.37
T 2.125% 05/15/22	5,400,000.00	5,534,789.07
T 2.125% 05/15/25	7,250,000.00	7,764,580.06
T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,130,271.48
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,594,453.12
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,342,484.38
T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,845,546.87
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,493,187.50
T 2.125% 12/31/22	3,800,000.00	3,941,906.25
T 2.25% 01/31/24	5,090,000.00	5,395,797.68
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	4,234,546.87
T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,624,101.57
T 2.25% 04/15/22	2,680,000.00	2,746,476.56
T 2.25% 04/30/24	2,600,000.00	2,765,648.44
T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,520,643.76
T 2.25% 08/15/46	4,180,000.00	4,302,787.50
T 2.25% 08/15/49	4,110,000.00	4,222,382.81
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,675,683.60
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,354,296.90
T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,941,718.75
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	5,716,140.62
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,705,078.12
T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	3,109,796.87
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,219,042.95

T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,982,946.87	
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,938,484.38	
T 2.375% 05/15/29	3,890,000.00	4,266,235.93	
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	7,184,703.12	
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	2,120,550.00	
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	4,333,281.24	
T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	2,325,191.41	
T 2.5% 02/15/46	4,750,000.00	5,132,226.56	
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	711,521.48	
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,969,117.20	
T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,650,800.79	
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,485,105.47	
T 2.625% 02/15/29	5,390,000.00	6,014,482.05	
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,725,488.27	
T 2.75% 02/15/24	3,900,000.00	4,194,937.50	
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	5,235,142.99	
T 2.75% 04/30/23	4,200,000.00	4,440,023.44	
T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	2,197,734.38	
T 2.75% 07/31/23	4,000,000.00	4,253,281.24	
T 2.75% 08/15/42	1,450,000.00	1,644,390.62	
T 2.75% 08/15/47	2,450,000.00	2,775,390.62	
T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	5,504,101.55	
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,762,195.31	
T 2.75% 11/15/42	1,040,000.00	1,178,775.00	
T 2.75% 11/15/47	2,500,000.00	2,832,812.50	
T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,534,042.96	
T 2.875% 05/15/28	2,260,000.00	2,555,918.75	
T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	1,214,226.56	
T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	5,122,218.77	
T 2.875% 07/31/25	5,000,000.00	5,527,734.40	
T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,755,843.75	
T 2.875% 08/15/45	1,480,000.00	1,710,440.63	
T 2.875% 09/30/23	1,650,000.00	1,766,337.88	
T 2.875% 11/30/23	6,000,000.00	6,446,953.14	
T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,158,609.37	
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,742,226.59	
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	6,437,341.81	
T 2% 02/15/50	3,370,000.00	3,276,008.61	
T 2% 04/30/24	3,000,000.00	3,167,343.75	
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,585,136.71	
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	1,057,851.56	
T 2% 07/31/22	3,900,000.00	4,007,021.49	

T 2% 08/15/25	3,750,000.00	4,003,710.93
T 2% 10/31/22	4,500,000.00	4,643,613.27
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,891,003.91
T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,684,013.66
T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	1,203,359.38
T 3.125% 02/15/43	2,100,000.00	2,524,757.82
T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,699,359.38
T 3.125% 08/15/44	2,600,000.00	3,127,515.63
T 3.125% 11/15/28	3,960,000.00	4,563,900.00
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	1,045,903.12
T 3.375% 05/15/44	2,000,000.00	2,500,000.00
T 3.5% 02/15/39	900,000.00	1,135,125.00
T 3.625% 02/15/44	1,600,000.00	2,075,000.00
T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	2,072,875.00
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,441,601.56
T 3.75% 11/15/43	2,000,000.00	2,638,750.00
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	902,646.87
T 3% 02/15/48	4,400,000.00	5,222,250.00
T 3% 02/15/49	1,940,000.00	2,309,509.37
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,297,312.50
T 3% 05/15/45	2,100,000.00	2,477,507.82
T 3% 05/15/47	3,400,000.00	4,029,000.00
T 3% 08/15/48	4,910,000.00	5,835,228.12
T 3% 09/30/25	3,660,000.00	4,075,324.20
T 3% 10/31/25	1,000,000.00	1,114,609.38
T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,417,238.29
T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,173,199.22
T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,252,406.25
T 4.375% 02/15/38	500,000.00	694,375.00
T 4.375% 05/15/40	750,000.00	1,056,621.09
T 4.375% 05/15/41	550,000.00	779,753.90
T 4.375% 11/15/39	650,000.00	912,640.62
T 4.5% 02/15/36	100,000.00	138,289.06
T 4.5% 05/15/38	970,000.00	1,367,245.31
T 4.5% 08/15/39	750,000.00	1,066,816.41
T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	2,172,421.87
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,110,234.37
T 5.0% 05/15/37	650,000.00	955,601.56
T 5.25% 02/15/29	500,000.00	659,531.25
T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,180,898.44
T 5.375% 02/15/31	750,000.00	1,038,808.59
T 5.5% 08/15/28	250,000.00	330,781.25
T 6.0% 02/15/26	600,000.00	760,031.25

	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,409,460.93
	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	1,038,712.50
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,554,609.37
アメリカドル 小計		539,020,000.00	570,726,090.03 (60,211,602,498)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	890,000.00	869,289.70
	CAN 0.25% 11/01/22	810,000.00	810,599.40
	CAN 0.5% 03/01/22	1,110,000.00	1,113,807.30
	CAN 0.5% 09/01/25	1,330,000.00	1,321,581.10
	CAN 0.5% 12/01/30	630,000.00	589,163.40
	CAN 1.25% 03/01/25	450,000.00	462,951.00
	CAN 1.25% 06/01/30	2,560,000.00	2,583,833.60
	CAN 1.5% 02/01/22	1,220,000.00	1,235,298.80
	CAN 1.5% 05/01/22	990,000.00	1,005,533.10
	CAN 1.5% 06/01/23	2,010,000.00	2,066,179.50
	CAN 1.5% 06/01/26	840,000.00	874,624.80
	CAN 1.75% 03/01/23	700,000.00	721,329.00
	CAN 1% 06/01/27	940,000.00	951,421.00
	CAN 1% 09/01/22	2,680,000.00	2,712,883.60
	CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	708,397.70
	CAN 2.25% 06/01/25	1,530,000.00	1,640,588.40
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	427,896.30
	CAN 2.5% 06/01/24	1,780,000.00	1,903,567.60
	CAN 2.75% 06/01/22	1,000,000.00	1,032,480.00
	CAN 2.75% 12/01/48	810,000.00	984,093.30
	CAN 2.75% 12/01/64	290,000.00	373,841.90
	CAN 2% 06/01/28	800,000.00	860,808.00
	CAN 2% 09/01/23	1,180,000.00	1,230,409.60
	CAN 2% 12/01/51	1,730,000.00	1,815,808.00
	CAN 3.5% 12/01/45	900,000.00	1,219,923.00
	CAN 4.0% 06/01/41	490,000.00	689,586.80
	CAN 5.75% 06/01/29	960,000.00	1,317,648.00
CAN 5.75% 06/01/33	670,000.00	1,002,614.80	
CAN 5% 06/01/37	520,000.00	782,787.20	
カナダドル 小計		30,880,000.00	33,308,945.90 (2,788,624,950)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	8,511,360.00
	MBONO 10% 12/05/24	24,100,000.00	28,587,420.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	10,710,000.00	11,075,318.10
	MBONO 6.5% 06/09/22	17,400,000.00	17,939,748.00
	MBONO 6.75% 03/09/23	20,920,000.00	22,002,819.20
	MBONO 7.5% 06/03/27	22,800,000.00	25,474,212.00

	MBONO 7.75% 05/29/31	10,950,000.00	12,361,236.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	15,180,183.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,320,000.00	4,852,872.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	20,040,000.00	23,717,740.80	
	MBONO 8.5% 11/18/38	9,870,000.00	11,577,608.70	
	MBONO 8% 09/05/24	5,910,000.00	6,571,329.00	
	MBONO 8% 11/07/47	11,460,000.00	12,708,681.60	
	MBONO 8% 12/07/23	15,420,000.00	16,923,912.60	
	メキシコペソ 小計	194,280,000.00	217,484,441.00 (1,120,044,871)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	730,000.00	744,607.30	
	BGB 0.2% 10/22/23	640,000.00	654,316.80	
	BGB 0.4% 06/22/40	290,000.00	286,792.60	
	BGB 0.5% 10/22/24	490,000.00	509,595.10	
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,164,746.00	
	BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	806,595.00	
	BGB 0.8% 06/22/28	980,000.00	1,059,076.20	
	BGB 0.9% 06/22/29	990,000.00	1,081,753.20	
	BGB 0% 10/22/27	790,000.00	808,628.20	
	BGB 1.25% 04/22/33	330,000.00	376,959.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	471,656.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	690,000.00	843,587.10	
	BGB 1.7% 06/22/50	490,000.00	616,091.70	
	BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	641,901.30	
	BGB 1% 06/22/26	1,080,000.00	1,165,590.00	
	BGB 1% 06/22/31	1,140,000.00	1,262,413.20	
	BGB 2.15% 06/22/66	440,000.00	641,854.40	
	BGB 2.25% 06/22/23	970,000.00	1,036,076.40	
	BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	549,670.00	
	BGB 2.6% 06/22/24	1,200,000.00	1,329,372.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	650,000.00	1,112,390.50	
	BGB 3% 06/22/34	680,000.00	936,060.80	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,110,000.00	1,912,918.50	
	BGB 4.25% 09/28/22	940,000.00	1,014,335.20	
	BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	943,132.50	
	BGB 4% 03/28/22	790,000.00	830,424.30	
	BGB 4% 03/28/32	620,000.00	896,191.40	
	BGB 5.5% 03/28/28	1,190,000.00	1,689,359.70	
	BGB 5% 03/28/35	1,270,000.00	2,126,627.70	
	BKO 0% 03/11/22	830,000.00	835,818.30	
	BKO 0% 06/10/22	2,150,000.00	2,168,619.00	
	BTPS 0.05% 01/15/23	330,000.00	332,491.50	
	BTPS 0.3% 08/15/23	1,100,000.00	1,115,785.00	

BTPS 0.35% 02/01/25	1,740,000.00	1,771,546.20	
BTPS 0.6% 06/15/23	720,000.00	735,213.60	
BTPS 0.65% 10/15/23	560,000.00	573,781.60	
BTPS 0.85% 01/15/27	1,100,000.00	1,144,352.00	
BTPS 0.9% 08/01/22	1,500,000.00	1,527,375.00	
BTPS 0.95% 03/01/23	1,720,000.00	1,764,582.40	
BTPS 0.95% 03/01/37	320,000.00	314,931.20	
BTPS 0.95% 03/15/23	860,000.00	882,729.80	
BTPS 0.95% 08/01/30	1,630,000.00	1,691,271.70	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	1,045,990.00	
BTPS 0% 01/15/24	300,000.00	301,908.00	
BTPS 1.2% 04/01/22	1,000,000.00	1,017,500.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,245,429.90	
BTPS 1.35% 04/01/30	350,000.00	376,253.50	
BTPS 1.35% 04/15/22	1,000,000.00	1,019,680.00	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,130,000.00	1,202,399.10	
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,138,019.90	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,594,082.00	
BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	635,418.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,599,870.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,458,864.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	1,340,000.00	1,474,844.20	
BTPS 1.65% 12/01/30	1,330,000.00	1,463,931.00	
BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	777,397.50	
BTPS 1.75% 07/01/24	990,000.00	1,053,765.90	
BTPS 1.8% 03/01/41	650,000.00	709,228.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	750,000.00	799,455.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	887,494.20	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	1,161,139.20	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,470,000.00	1,629,230.40	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,700,000.00	1,911,973.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	990,000.00	1,166,150.70	
BTPS 2.45% 09/01/33	990,000.00	1,180,099.80	
BTPS 2.45% 09/01/50	500,000.00	609,325.00	
BTPS 2.45% 10/01/23	870,000.00	931,996.20	
BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	738,309.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,428,544.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,240,000.00	1,576,226.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	600,000.00	778,440.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,493,364.60	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,100,000.00	1,417,878.00	
BTPS 2% 02/01/28	380,000.00	424,650.00	

BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,150,506.00
BTPS 3.1% 03/01/40	520,000.00	684,543.60
BTPS 3.25% 09/01/46	680,000.00	944,173.20
BTPS 3.35% 03/01/35	1,260,000.00	1,657,882.80
BTPS 3.45% 03/01/48	1,120,000.00	1,615,152.00
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	2,464,644.00
BTPS 3.75% 09/01/24	1,740,000.00	1,978,919.40
BTPS 3.85% 09/01/49	1,320,000.00	2,039,637.60
BTPS 3% 08/01/29	1,760,000.00	2,131,694.40
BTPS 4.5% 03/01/24	1,130,000.00	1,291,058.90
BTPS 4.5% 03/01/26	1,980,000.00	2,422,985.40
BTPS 4.5% 05/01/23	1,050,000.00	1,161,174.00
BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,810,348.40
BTPS 4.75% 09/01/28	1,810,000.00	2,398,087.10
BTPS 4.75% 09/01/44	1,230,000.00	2,064,124.50
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	2,572,794.00
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	2,356,588.80
BTPS 5.25% 11/01/29	2,300,000.00	3,238,791.00
BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	1,851,436.00
BTPS 5.5% 11/01/22	2,200,000.00	2,416,700.00
BTPS 5.75% 02/01/33	1,570,000.00	2,461,037.80
BTPS 5% 03/01/22	650,000.00	685,821.50
BTPS 5% 03/01/25	1,740,000.00	2,096,961.00
BTPS 5% 08/01/34	1,800,000.00	2,737,476.00
BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	2,642,496.00
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,923,419.60
BTPS 6% 05/01/31	1,940,000.00	2,967,424.00
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	491,704.50
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,250,630.00
DBR 0.25% 02/15/27	1,920,000.00	2,017,382.40
DBR 0.25% 02/15/29	1,880,000.00	1,987,630.00
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,373,346.00
DBR 0.5% 02/15/25	1,140,000.00	1,194,195.60
DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,431,537.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,620,471.60
DBR 0.5% 08/15/27	900,000.00	962,658.00
DBR 0% 02/15/30	2,060,000.00	2,132,182.40
DBR 0% 05/15/35	1,500,000.00	1,520,880.00
DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,674,804.60
DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,518,330.50
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,529,609.60
DBR 0% 08/15/50	1,160,000.00	1,091,954.40
DBR 0% 11/15/27	1,580,000.00	1,636,611.40

DBR 1.25% 08/15/48	1,560,000.00	2,009,888.40
DBR 1.5% 02/15/23	950,000.00	991,914.00
DBR 1.5% 05/15/23	2,290,000.00	2,403,675.60
DBR 1.5% 05/15/24	1,020,000.00	1,093,276.80
DBR 1.5% 09/04/22	920,000.00	951,105.20
DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,342,887.50
DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,704,796.50
DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,706,422.90
DBR 1% 08/15/25	2,250,000.00	2,419,245.00
DBR 2.5% 07/04/44	1,840,000.00	2,879,379.20
DBR 2.5% 08/15/46	1,980,000.00	3,164,871.60
DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	2,018,142.00
DBR 3.25% 07/04/42	1,240,000.00	2,095,513.20
DBR 4.0% 01/04/37	1,670,000.00	2,769,628.20
DBR 4.25% 07/04/39	1,240,000.00	2,224,200.40
DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	977,207.00
DBR 4.75% 07/04/34	1,690,000.00	2,829,195.20
DBR 4.75% 07/04/40	1,310,000.00	2,527,016.20
DBR 5.5% 01/04/31	1,640,000.00	2,610,125.60
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,150,010.00
DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,646,534.50
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	980,038.20
DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,854,276.20
FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	2,129,089.00
FRTR 0.5% 05/25/25	3,350,000.00	3,498,606.00
FRTR 0.5% 05/25/26	3,130,000.00	3,289,410.90
FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	2,994,932.40
FRTR 0.5% 05/25/40	720,000.00	727,603.20
FRTR 0.5% 05/25/72	390,000.00	324,932.40
FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	3,186,203.20
FRTR 0.75% 05/25/52	1,330,000.00	1,333,152.10
FRTR 0.75% 11/25/28	2,510,000.00	2,706,457.70
FRTR 0% 02/25/22	2,970,000.00	2,988,829.80
FRTR 0% 02/25/23	610,000.00	617,856.80
FRTR 0% 02/25/26	1,690,000.00	1,729,596.70
FRTR 0% 03/25/23	1,880,000.00	1,904,910.00
FRTR 0% 03/25/24	3,640,000.00	3,707,158.00
FRTR 0% 03/25/25	2,310,000.00	2,360,820.00
FRTR 0% 05/25/22	1,350,000.00	1,360,908.00
FRTR 0% 11/25/29	3,300,000.00	3,344,220.00
FRTR 0% 11/25/30	1,830,000.00	1,841,748.60
FRTR 1.25% 05/25/34	2,400,000.00	2,745,360.00

FRTR 1.25% 05/25/36	2,410,000.00	2,769,331.00
FRTR 1.5% 05/25/31	2,950,000.00	3,417,988.00
FRTR 1.5% 05/25/50	1,960,000.00	2,379,224.40
FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,740,322.00
FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	1,133,084.00
FRTR 1.75% 06/25/39	2,010,000.00	2,508,299.10
FRTR 1.75% 11/25/24	1,980,000.00	2,153,467.80
FRTR 1% 05/25/27	2,480,000.00	2,696,404.80
FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,401,571.20
FRTR 2.25% 05/25/24	2,040,000.00	2,230,434.00
FRTR 2.25% 10/25/22	1,700,000.00	1,782,586.00
FRTR 2.5% 05/25/30	2,450,000.00	3,050,323.50
FRTR 2.75% 10/25/27	2,730,000.00	3,303,709.50
FRTR 2% 05/25/48	2,140,000.00	2,865,738.20
FRTR 3.25% 05/25/45	1,710,000.00	2,765,241.00
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,770,551.20
FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	3,910,087.50
FRTR 4.25% 10/25/23	2,870,000.00	3,248,553.00
FRTR 4.5% 04/25/41	2,340,000.00	4,186,049.40
FRTR 4.75% 04/25/35	1,810,000.00	2,978,137.80
FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	2,118,193.40
FRTR 4% 04/25/60	1,080,000.00	2,239,358.40
FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	2,616,048.00
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,688,825.00
FRTR 5.75% 10/25/32	2,350,000.00	3,929,129.50
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,899,021.50
FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,319,934.00
IRISH 0.2% 05/15/27	460,000.00	475,768.80
IRISH 0.2% 10/18/30	470,000.00	480,875.80
IRISH 0.4% 05/15/35	180,000.00	184,447.80
IRISH 0.8% 03/15/22	630,000.00	639,078.30
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	477,294.40
IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	607,524.50
IRISH 1.3% 05/15/33	690,000.00	790,464.00
IRISH 1.35% 03/18/31	340,000.00	387,477.60
IRISH 1.5% 05/15/50	300,000.00	364,632.00
IRISH 1.7% 05/15/37	490,000.00	598,138.10
IRISH 1% 05/15/26	730,000.00	784,866.80
IRISH 2.4% 05/15/30	770,000.00	948,093.30
IRISH 2% 02/18/45	580,000.00	771,666.80
IRISH 3.4% 03/18/24	460,000.00	516,216.60
IRISH 3.9% 03/20/23	580,000.00	634,293.80
IRISH 5.4% 03/13/25	700,000.00	869,281.00

NETHER 0.25% 07/15/25	920,000.00	954,343.60
NETHER 0.25% 07/15/29	630,000.00	660,328.20
NETHER 0.5% 01/15/40	620,000.00	666,369.80
NETHER 0.5% 07/15/26	1,260,000.00	1,330,887.60
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	970,767.00
NETHER 0.75% 07/15/28	1,040,000.00	1,129,065.60
NETHER 0% 01/15/24	550,000.00	560,741.50
NETHER 0% 01/15/27	480,000.00	493,617.60
NETHER 0% 01/15/52	390,000.00	356,577.00
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	869,711.50
NETHER 1.75% 07/15/23	1,000,000.00	1,058,700.00
NETHER 2.25% 07/15/22	750,000.00	780,562.50
NETHER 2.5% 01/15/33	860,000.00	1,132,731.80
NETHER 2.75% 01/15/47	1,110,000.00	1,823,863.20
NETHER 2% 07/15/24	1,460,000.00	1,592,772.40
NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	325,410.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,060,000.00	1,853,802.20
NETHER 4% 01/15/37	1,020,000.00	1,671,474.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,010,000.00	1,430,978.10
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	809,795.00
OBL 0% 04/05/24	1,760,000.00	1,798,808.00
OBL 0% 04/08/22	1,460,000.00	1,470,935.40
OBL 0% 04/11/25	1,700,000.00	1,746,954.00
OBL 0% 04/14/23	1,110,000.00	1,126,772.10
OBL 0% 10/07/22	1,530,000.00	1,547,120.70
OBL 0% 10/10/25	1,170,000.00	1,205,240.40
OBL 0% 10/18/24	2,150,000.00	2,204,137.00
RAGB 0.5% 02/20/29	700,000.00	743,253.00
RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	688,538.50
RAGB 0.75% 02/20/28	620,000.00	668,843.60
RAGB 0.75% 03/20/51	260,000.00	279,146.40
RAGB 0.75% 10/20/26	600,000.00	641,910.00
RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	198,728.00
RAGB 0% 02/20/30	660,000.00	670,177.20
RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	659,743.50
RAGB 0% 07/15/24	590,000.00	601,776.40
RAGB 0% 09/20/22	430,000.00	434,459.10
RAGB 0% 10/20/40	220,000.00	207,273.00
RAGB 1.2% 10/20/25	640,000.00	692,608.00
RAGB 1.5% 02/20/47	450,000.00	569,353.50
RAGB 1.5% 11/02/86	230,000.00	321,970.10
RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	606,592.00

RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	797,602.50
RAGB 2.1% 09/20/17	340,000.00	605,380.20
RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	694,851.20
RAGB 3.15% 06/20/44	470,000.00	766,739.20
RAGB 3.4% 11/22/22	1,210,000.00	1,296,091.50
RAGB 3.65% 04/20/22	500,000.00	524,850.00
RAGB 3.8% 01/26/62	230,000.00	499,932.60
RAGB 4.15% 03/15/37	920,000.00	1,506,509.20
RAGB 4.85% 03/15/26	760,000.00	970,185.60
RAGB 6.25% 07/15/27	690,000.00	988,776.90
RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	268,817.40
RFGB 0.25% 09/15/40	200,000.00	198,650.00
RFGB 0.5% 04/15/26	470,000.00	494,816.00
RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	402,971.00
RFGB 0.5% 09/15/28	470,000.00	499,102.40
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	308,319.30
RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	293,989.50
RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	319,863.00
RFGB 0% 04/15/22	250,000.00	251,882.50
RFGB 0% 09/15/23	100,000.00	101,711.00
RFGB 0% 09/15/24	300,000.00	306,705.00
RFGB 0% 09/15/30	40,000.00	40,561.60
RFGB 1.125% 04/15/34	350,000.00	398,741.00
RFGB 1.375% 04/15/47	230,000.00	289,114.60
RFGB 1.5% 04/15/23	590,000.00	617,700.50
RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	393,756.00
RFGB 2.625% 07/04/42	340,000.00	505,947.20
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	467,852.20
RFGB 2% 04/15/24	410,000.00	444,517.90
RFGB 4% 07/04/25	320,000.00	385,049.60
SPGB 0.1% 04/30/31	480,000.00	467,860.80
SPGB 0.25% 07/30/24	1,000,000.00	1,021,920.00
SPGB 0.35% 07/30/23	1,570,000.00	1,601,258.70
SPGB 0.4% 04/30/22	1,040,000.00	1,051,492.00
SPGB 0.45% 10/31/22	800,000.00	812,960.00
SPGB 0.5% 04/30/30	1,980,000.00	2,028,133.80
SPGB 0.6% 10/31/29	1,200,000.00	1,244,328.00
SPGB 0.8% 07/30/27	480,000.00	506,404.80
SPGB 0% 01/31/25	1,240,000.00	1,255,338.80
SPGB 0% 04/30/23	1,360,000.00	1,374,089.60
SPGB 1.2% 10/31/40	750,000.00	786,660.00
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,309,836.00
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,582,012.20

SPGB 1.4% 04/30/28	1,020,000.00	1,121,082.00	
SPGB 1.4% 07/30/28	1,320,000.00	1,453,702.80	
SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	831,075.00	
SPGB 1.45% 10/31/27	1,840,000.00	2,021,994.40	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,970,000.00	2,166,566.60	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,350,675.00	
SPGB 1.85% 07/30/35	1,290,000.00	1,503,856.20	
SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,491,098.40	
SPGB 1.95% 07/30/30	1,680,000.00	1,945,876.80	
SPGB 1% 10/31/50	850,000.00	806,624.50	
SPGB 2.15% 10/31/25	1,760,000.00	1,960,728.00	
SPGB 2.35% 07/30/33	1,290,000.00	1,575,541.50	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,060,000.00	1,449,825.60	
SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,739,977.20	
SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,544,510.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	980,000.00	1,598,977.80	
SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,703,055.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	1,310,000.00	2,002,505.30	
SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,494,121.20	
SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,721,187.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	2,214,888.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,328,813.50	
SPGB 4.9% 07/30/40	1,310,000.00	2,258,230.40	
SPGB 5.15% 10/31/28	1,100,000.00	1,527,999.00	
SPGB 5.15% 10/31/44	950,000.00	1,773,935.00	
SPGB 5.4% 01/31/23	1,790,000.00	1,995,205.60	
SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	2,315,751.50	
SPGB 5.85% 01/31/22	1,780,000.00	1,886,782.20	
SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,811,411.20	
SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,447,638.00	
ユーロ 小計	379,700,000.00	453,876,512.00 (58,055,344,649)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,750,000.00	1,737,102.50
	UKT 0.125% 01/31/23	2,050,000.00	2,053,259.50
	UKT 0.125% 01/31/24	980,000.00	979,823.60
	UKT 0.125% 01/31/28	1,320,000.00	1,288,808.40
	UKT 0.375% 10/22/30	1,870,000.00	1,809,860.80
	UKT 0.5% 07/22/22	1,800,000.00	1,813,284.00
	UKT 0.5% 10/22/61	670,000.00	521,159.50
	UKT 0.625% 06/07/25	1,460,000.00	1,487,287.40
	UKT 0.625% 07/31/35	870,000.00	820,488.30
	UKT 0.625% 10/22/50	1,200,000.00	1,010,316.00

UKT 0.75% 07/22/23	940,000.00	955,933.00	
UKT 0.875% 01/31/46	190,000.00	174,235.70	
UKT 0.875% 10/22/29	550,000.00	561,616.00	
UKT 1.25% 07/22/27	1,190,000.00	1,254,045.80	
UKT 1.25% 10/22/41	1,140,000.00	1,148,082.60	
UKT 1.5% 07/22/26	1,060,000.00	1,129,292.20	
UKT 1.5% 07/22/47	1,310,000.00	1,381,932.10	
UKT 1.625% 10/22/28	1,400,000.00	1,517,208.00	
UKT 1.625% 10/22/54	850,000.00	937,737.00	
UKT 1.625% 10/22/71	470,000.00	565,358.30	
UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	670,212.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,060,000.00	1,224,734.60	
UKT 1.75% 09/07/22	1,640,000.00	1,684,608.00	
UKT 1.75% 09/07/37	1,540,000.00	1,688,918.00	
UKT 1% 04/22/24	1,450,000.00	1,491,673.00	
UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,224,588.80	
UKT 2.5% 07/22/65	940,000.00	1,369,307.40	
UKT 2.75% 09/07/24	820,000.00	896,120.60	
UKT 2% 09/07/25	420,000.00	453,898.20	
UKT 3.25% 01/22/44	1,430,000.00	2,006,232.80	
UKT 3.5% 01/22/45	1,400,000.00	2,054,500.00	
UKT 3.5% 07/22/68	910,000.00	1,680,842.80	
UKT 3.75% 07/22/52	910,000.00	1,502,719.40	
UKT 4.25% 03/07/36	1,200,000.00	1,739,496.00	
UKT 4.25% 06/07/32	1,290,000.00	1,766,242.20	
UKT 4.25% 09/07/39	820,000.00	1,249,220.80	
UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	942,795.00	
UKT 4.25% 12/07/40	1,050,000.00	1,623,457.50	
UKT 4.25% 12/07/46	1,060,000.00	1,761,550.40	
UKT 4.25% 12/07/49	980,000.00	1,690,990.00	
UKT 4.25% 12/07/55	1,040,000.00	1,929,876.00	
UKT 4.5% 09/07/34	1,080,000.00	1,568,494.80	
UKT 4.5% 12/07/42	1,170,000.00	1,910,095.20	
UKT 4.75% 12/07/30	850,000.00	1,175,422.50	
UKT 4.75% 12/07/38	880,000.00	1,401,206.40	
UKT 4% 01/22/60	840,000.00	1,570,976.40	
UKT 4% 03/07/22	910,000.00	948,019.80	
UKT 5% 03/07/25	600,000.00	716,394.00	
UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	636,961.50	
イギリスbond 小計	52,320,000.00	63,726,384.80 (9,430,230,422)	
スウェーデン ンクローナ			
SGB 0.125% 05/12/31	1,690,000.00	1,655,794.40	
SGB 0.75% 05/12/28	3,860,000.00	4,042,655.20	

	SGB 0.75% 11/12/29	3,770,000.00	3,945,568.90	
	SGB 1.5% 11/13/23	5,670,000.00	5,948,680.50	
	SGB 1% 11/12/26	4,940,000.00	5,234,621.60	
	SGB 2.5% 05/12/25	4,380,000.00	4,878,969.60	
	SGB 3.5% 03/30/39	2,950,000.00	4,380,130.50	
	SGB 3.5% 06/01/22	7,220,000.00	7,571,830.60	
スウェーデンクローナ 小計		34,480,000.00	37,658,251.30	(480,519,286)
ノルウェークローネ	NGB 1.375% 08/19/30	2,800,000.00	2,820,524.00	
	NGB 1.5% 02/19/26	3,110,000.00	3,208,960.20	
	NGB 1.75% 02/17/27	2,900,000.00	3,028,934.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	3,120,000.00	3,249,480.00	
	NGB 1.75% 09/06/29	2,470,000.00	2,575,296.10	
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,664,063.80	
	NGB 2% 05/24/23	4,940,000.00	5,112,060.20	
	NGB 3% 03/14/24	3,640,000.00	3,909,287.20	
ノルウェークローネ 小計		25,490,000.00	26,568,605.50	(331,841,882)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,800,000.00	3,852,630.00	
	DGB 0.25% 11/15/52	1,580,000.00	1,531,430.80	
	DGB 0.5% 11/15/27	5,260,000.00	5,558,873.20	
	DGB 0.5% 11/15/29	6,410,000.00	6,813,381.30	
	DGB 1.5% 11/15/23	4,170,000.00	4,406,647.50	
	DGB 1.75% 11/15/25	4,230,000.00	4,678,591.50	
	DGB 4.5% 11/15/39	8,240,000.00	14,878,803.20	
デンマーククローネ 小計		33,690,000.00	41,720,357.50	(717,590,149)
ポーランドズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	720,000.00	727,927.20	
	POLGB 0% 07/25/22	1,000,000.00	999,670.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	780,000.00	773,939.40	
	POLGB 2.25% 04/25/22	3,900,000.00	4,001,634.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	2,860,000.00	3,050,819.20	
	POLGB 2.5% 01/25/23	1,550,000.00	1,621,207.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,880,000.00	2,009,362.80	
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,420,000.00	3,744,318.60	
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,910,000.00	2,102,126.90	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,070,000.00	2,318,710.50	
	POLGB 2.75% 10/25/29	3,640,000.00	4,104,937.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	1,710,000.00	1,912,908.60	
	POLGB 4% 10/25/23	2,080,000.00	2,291,744.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,230,192.00	
POLGB 5.75% 09/23/22	1,500,000.00	1,636,065.00		

ポーランドズロチ 小計		29,920,000.00	32,525,562.40 (927,954,295)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,730,000.00	1,728,218.10
	ACGB 0.25% 11/21/25	1,000,000.00	987,740.00
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,540,000.00	1,523,398.80
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	1,100,282.40
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,189,512.10
	ACGB 1.75% 06/21/51	990,000.00	840,480.30
	ACGB 1% 11/21/31	1,810,000.00	1,710,739.60
	ACGB 1% 12/21/30	2,220,000.00	2,126,915.40
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,260,000.00	2,450,201.60
	ACGB 2.25% 11/21/22	430,000.00	446,086.30
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,480,000.00	2,724,453.60
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,590,000.00	2,804,426.10
	ACGB 2.75% 05/21/41	810,000.00	879,514.20
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	702,519.30
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,400,000.00	1,566,236.00
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,750,000.00	1,959,352.50
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,640,000.00	1,836,783.60
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,750,000.00	1,957,340.00
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,330,000.00	2,700,866.10
	ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	761,878.00
	ACGB 3.75% 04/21/37	810,000.00	1,010,782.80
	ACGB 3% 03/21/47	880,000.00	986,964.00
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,600,000.00	3,084,484.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,220,000.00	1,606,849.80
ACGB 4.75% 04/21/27	2,230,000.00	2,758,420.80	
ACGB 5.5% 04/21/23	1,810,000.00	2,019,652.30	
ACGB 5.75% 07/15/22	3,270,000.00	3,528,264.60	
オーストラリアドル 小計		43,160,000.00	46,992,362.30 (3,909,294,619)
シンガポ ールドル	SIGB 1.75% 02/01/23	410,000.00	421,094.60
	SIGB 1.75% 04/01/22	160,000.00	162,590.40
	SIGB 2.125% 06/01/26	520,000.00	556,836.80
	SIGB 2.25% 08/01/36	340,000.00	372,728.40
	SIGB 2.375% 06/01/25	500,000.00	537,965.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	257,439.00
	SIGB 2.625% 05/01/28	190,000.00	211,158.40
	SIGB 2.75% 03/01/46	630,000.00	763,786.80
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	357,036.00
	SIGB 2.75% 07/01/23	540,000.00	569,845.80
	SIGB 2.875% 07/01/29	640,000.00	728,422.40
	SIGB 2.875% 09/01/30	550,000.00	630,976.50

	SIGB 2% 02/01/24	90,000.00	94,101.30	
	SIGB 3.125% 09/01/22	430,000.00	448,339.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	340,000.00	413,895.60	
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	611,455.70	
	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	554,507.70	
	シンガポールドル 小計	6,910,000.00	7,692,179.90	(613,451,347)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,220,000.00	1,249,206.80	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,341,470.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	100,000.00	105,142.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	300,000.00	320,769.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	150,000.00	147,304.50	
	MGS 3.795% 09/30/22	800,000.00	825,448.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	550,000.00	574,887.50	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	878,154.60	
	MGS 3.882% 03/10/22	930,000.00	950,348.40	
	MGS 3.882% 03/14/25	690,000.00	733,966.80	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,530,000.00	1,634,850.90	
	MGS 3.892% 03/15/27	780,000.00	837,649.80	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,160,000.00	1,247,498.80	
	MGS 3.9% 11/30/26	360,000.00	388,357.20	
	MGS 3.906% 07/15/26	1,010,000.00	1,085,871.20	
	MGS 3.955% 09/15/25	520,000.00	558,532.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	750,000.00	800,355.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,090,000.00	1,163,771.20	
	MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	934,209.50	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,270,000.00	1,343,190.10	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,160,000.00	1,271,325.20	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,410,582.60	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,275,304.00	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,090,000.00	1,189,527.90	
MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,294,235.20		
MGS 4.893% 06/08/38	1,080,000.00	1,206,586.80		
MGS 4.921% 07/06/48	900,000.00	1,004,193.00		
MGS 4.935% 09/30/43	530,000.00	590,844.00		
	マレーシアリンギット 小計	24,560,000.00	26,363,582.00	(688,616,761)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 04/30/25	460,000.00	463,688.18	
	ILGOV 0.75% 07/31/22	3,180,000.00	3,212,013.37	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	740,000.00	718,671.26	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	320,000.00	332,175.32	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,040,000.00	1,109,013.98	

	ILGOV 1% 03/31/30	960,000.00	957,853.15	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,400,000.00	1,549,256.24	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	2,000,000.00	2,219,902.80	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,330,000.00	1,764,379.84	
	ILGOV 4.25% 03/31/23	200,000.00	217,141.64	
	ILGOV 5.5% 01/31/22	940,000.00	988,959.80	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,270,000.00	2,091,607.32	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	3,300,000.00	4,364,937.06	
	イスラエルシェケル 小計	17,140,000.00	19,989,599.96 (644,264,806)	
	合計		139,919,380,535 (139,919,380,535)	

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 182銘柄	100.0%	43.0%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 318銘柄	100.0%	41.5%
イギリスポンド	国債証券 49銘柄	100.0%	6.7%
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%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.8%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

【DCバランスファンド30】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期中間計算期間(2021年2月23日から2021年8月22日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	125,750,521	128,522,482
親投資信託受益証券	22,592,800,568	24,130,482,735
未収入金	31,812,612	7,428,416
流動資産合計	22,750,363,701	24,266,433,633
資産合計	22,750,363,701	24,266,433,633
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,121,376	7,864,165
未払受託者報酬	4,858,297	5,165,511
未払委託者報酬	20,647,746	21,953,375
未払利息	102	690
その他未払費用	607,228	645,629
流動負債合計	33,234,749	35,629,370
負債合計	33,234,749	35,629,370
純資産の部		
元本等		
元本	14,863,838,450	15,517,473,543
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	7,853,290,502	8,713,330,720
(分配準備積立金)	3,643,228,795	3,533,483,474
元本等合計	22,717,128,952	24,230,804,263
純資産合計	22,717,128,952	24,230,804,263
負債純資産合計	22,750,363,701	24,266,433,633

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期中間計算期間 自 2020年 2月22日 至 2020年 8月21日	第16期中間計算期間 自 2021年 2月23日 至 2021年 8月22日
営業収益		
受取利息	335	109
有価証券売買等損益	220,305,042	526,627,771
営業収益合計	220,304,707	526,627,880
営業費用		
支払利息	26,809	25,460
受託者報酬	4,401,370	5,165,511
委託者報酬	18,705,755	21,953,375
その他費用	550,307	645,629
営業費用合計	23,684,241	27,789,975
営業利益又は営業損失（ ）	243,988,948	498,837,905
経常利益又は経常損失（ ）	243,988,948	498,837,905
中間純利益又は中間純損失（ ）	243,988,948	498,837,905
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	32,950,824	13,170,477
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,481,575,075	7,853,290,502
剰余金増加額又は欠損金減少額	512,733,023	622,419,594
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	512,733,023	622,419,594
剰余金減少額又は欠損金増加額	250,465,983	248,046,804
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	250,465,983	248,046,804
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,532,803,991	8,713,330,720

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期中間計算期間は2021年 2月23日から2021年 8月22日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,863,838,450口	15,517,473,543口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5283円 (15,283円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5615円 (15,615円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日	第16期中間計算期間 自 2021年 2月23日 至 2021年 8月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	13,829,328,777円	14,863,838,450円
期中追加設定元本額	2,046,783,461円	1,123,953,368円
期中一部解約元本額	1,012,273,788円	470,318,275円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

【DCバランスファンド50】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期中間計算期間(2021年2月23日から2021年8月22日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	130,221,320	128,778,340
親投資信託受益証券	23,567,577,711	25,113,624,657
未収入金	32,944,564	12,290,015
流動資産合計	23,730,743,595	25,254,693,012
資産合計	23,730,743,595	25,254,693,012
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,708,179	8,950,849
未払受託者報酬	4,946,208	5,401,808
未払委託者報酬	22,257,867	24,308,104
未払利息	105	691
その他未払費用	618,211	675,166
流動負債合計	37,530,570	39,336,618
負債合計	37,530,570	39,336,618
純資産の部		
元本等		
元本	13,793,194,595	14,205,320,324
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	9,900,018,430	11,010,036,070
(分配準備積立金)	5,788,761,649	5,607,201,915
元本等合計	23,693,213,025	25,215,356,394
純資産合計	23,693,213,025	25,215,356,394
負債純資産合計	23,730,743,595	25,254,693,012

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期中間計算期間 自 2020年 2月22日 至 2020年 8月21日	第16期中間計算期間 自 2021年 2月23日 至 2021年 8月22日
営業収益		
受取利息	372	102
有価証券売買等損益	291,824,825	828,513,484
営業収益合計	291,824,453	828,513,586
営業費用		
支払利息	28,738	25,845
受託者報酬	4,325,707	5,401,808
委託者報酬	19,465,618	24,308,104
その他費用	540,894	675,166
営業費用合計	24,360,957	30,410,923
営業利益又は営業損失（ ）	316,185,410	798,102,663
経常利益又は経常損失（ ）	316,185,410	798,102,663
中間純利益又は中間純損失（ ）	316,185,410	798,102,663
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	70,310,743	20,272,046
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,717,612,690	9,900,018,430
剰余金増加額又は欠損金減少額	558,846,143	654,163,465
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	558,846,143	654,163,465
剰余金減少額又は欠損金増加額	372,615,405	321,976,442
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	372,615,405	321,976,442
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,657,968,761	11,010,036,070

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期中間計算期間は2021年 2月23日から2021年 8月22日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	13,793,194,595口	14,205,320,324口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7177円 (17,177円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7751円 (17,751円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日	第16期中間計算期間 自 2021年 2月23日 至 2021年 8月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	12,979,122,227円	13,793,194,595円
期中追加設定元本額	1,929,479,800円	861,587,153円
期中一部解約元本額	1,115,407,432円	449,461,424円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

【DCバランスファンド70】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期中間計算期間(2021年2月23日から2021年8月22日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	76,047,001	60,208,671
親投資信託受益証券	10,022,653,303	10,883,797,936
未収入金	447,319	1,423,650
流動資産合計	10,099,147,623	10,945,430,257
資産合計	10,099,147,623	10,945,430,257
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,261,819	2,742,416
未払受託者報酬	2,048,759	2,324,110
未払委託者報酬	9,731,530	11,039,478
未払利息	61	322
その他未払費用	256,033	290,448
流動負債合計	26,298,202	16,396,774
負債合計	26,298,202	16,396,774
純資産の部		
元本等		
元本	5,431,547,507	5,651,687,782
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	4,641,301,914	5,277,345,701
(分配準備積立金)	2,742,201,556	2,610,152,151
元本等合計	10,072,849,421	10,929,033,483
純資産合計	10,072,849,421	10,929,033,483
負債純資産合計	10,099,147,623	10,945,430,257

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期中間計算期間 自 2020年 2月22日 至 2020年 8月21日	第16期中間計算期間 自 2021年 2月23日 至 2021年 8月22日
営業収益		
受取利息	142	47
有価証券売買等損益	164,372,340	447,036,548
営業収益合計	164,372,198	447,036,595
営業費用		
支払利息	10,105	12,009
受託者報酬	1,714,163	2,324,110
委託者報酬	8,142,228	11,039,478
その他費用	214,263	290,448
営業費用合計	10,080,759	13,666,045
営業利益又は営業損失（ ）	174,452,957	433,370,550
経常利益又は経常損失（ ）	174,452,957	433,370,550
中間純利益又は中間純損失（ ）	174,452,957	433,370,550
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	51,467,080	16,032,424
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,351,525,267	4,641,301,914
剰余金増加額又は欠損金減少額	308,929,168	453,259,295
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	308,929,168	453,259,295
剰余金減少額又は欠損金増加額	218,571,051	234,553,634
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	218,571,051	234,553,634
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,318,897,507	5,277,345,701

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期中間計算期間は2021年 2月23日から2021年 8月22日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,431,547,507口	5,651,687,782口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8545円 (18,545円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9338円 (19,338円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第16期中間計算期間 (2021年 8月22日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日	第16期中間計算期間 自 2021年 2月23日 至 2021年 8月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,997,769,197円	5,431,547,507円
期中追加設定元本額	1,035,869,348円	494,968,600円
期中一部解約元本額	602,091,038円	274,828,325円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,773,620,335
株式	280,089,167,660
派生商品評価勘定	77,800
未収配当金	342,051,773
前払金	46,194,700
差入委託証拠金	67,280,000
流動資産合計	282,318,392,268
資産合計	282,318,392,268
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,287,900
未払解約金	184,092,838
未払利息	3,180
流動負債合計	230,383,918
負債合計	230,383,918
純資産の部	
元本等	
元本	133,918,606,259
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	148,169,402,091
元本等合計	282,088,008,350
純資産合計	282,088,008,350
負債純資産合計	282,318,392,268

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月22日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2021年 8月22日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2021年 8月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	133,918,606,259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 2.1064円 (1万口当たり純資産額) (21,064円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月22日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

	2021年 8月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（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	2021年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月23日
期首元本額	134,423,726,662円
期中追加設定元本額	4,643,097,159円
期中一部解約元本額	5,148,217,562円
期末元本額	133,918,606,259円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	608,494,485円
D C 日本株式インデックスファンド	309,920,270円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,287,088,112円
D C 日本株式インデックスファンド A	676,354,559円
D C バランスファンド 3 0	2,248,034,109円
D C バランスファンド 5 0	3,482,503,048円
D C バランスファンド 7 0	2,018,557,498円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	560,693,703円
日本株式インデックス e	1,486,085,706円
インデックスコレクション（国内株式）	19,739,877,650円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	11,876,609,485円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,572,421,294円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	2,210,545,743円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,494,467,224円
日本株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	2,771,270,332円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,083,516,221円

区分	2021年 8月22日現在
バランスVA30（適格機関投資家専用）	55,303,682円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	650,702,926円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	75,444,232円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	140,751,036円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	196,593,133円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	816,296,097円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	475,786,343円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	8,196,158,742円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	778,529,187円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	85,076,718円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,335,231,741円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	30,995,830円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	162,073,339円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,127,723,778円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	62,380,938円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	64,266,900円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	26,176,245円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	670,712,023円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	289,532,693円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	4,969,863,365円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	91,435,779円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	39,202,435円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	8,277,935円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	139,155,877円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	4,495,846円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,097,029,700	-	2,050,835,000	46,194,700
	合計	2,097,029,700	-	2,050,835,000	46,194,700

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

項目	2021年 8月22日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	329,116,701
国債証券	320,876,081,500
地方債証券	21,169,336,833
特殊債券	23,614,516,088
社債券	17,187,505,000
未収入金	498,240,200
未収利息	862,589,621
前払費用	13,132,530
流動資産合計	384,550,518,473
資産合計	384,550,518,473
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,330
未払解約金	273,265,923
未払利息	590
流動負債合計	273,276,843
負債合計	273,276,843
純資産の部	
元本等	
元本	277,757,039,306
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	106,520,202,324
元本等合計	384,277,241,630
純資産合計	384,277,241,630
負債純資産合計	384,550,518,473

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月22日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2021年 8月22日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。 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	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)

2021年 8月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	277,757,039,306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 101,524,000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 1.3835円 (1万口当たり純資産額) (13,835円)

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月22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。

	2021年 8月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（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	2021年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月23日
期首元本額	274,296,462,926円
期中追加設定元本額	10,769,857,047円
期中一部解約元本額	7,309,280,667円
期末元本額	277,757,039,306円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	861,137,291円
D C 日本債券インデックスファンド	2,069,999,709円
D C 日本債券インデックスファンド L	42,394,599,254円
D C バランスファンド 3 0	10,432,639,762円
D C バランスファンド 5 0	7,262,249,766円
D C バランスファンド 7 0	1,959,547,833円
日本債券インデックス e	1,205,831,888円
インデックスコレクション（国内債券）	36,936,561,205円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	55,883,104,778円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	5,333,601,423円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	2,132,514,577円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	48,355,158,163円
日本債券パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	3,879,586,512円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	195,794,006円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	980,881,568円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	136,037,699円

区分	2021年 8月22日現在
V Aバランスファンド（株50 / 100）（適格機関投資家専用）	83,164,333円
V Aバランスファンド（株60 / 100）（適格機関投資家専用）	460,888,486円
バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	3,338,452,555円
バランスV A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	1,063,930,471円
バランスV A 5 0 L（適格機関投資家専用）	12,014,910,267円
バランスV A 7 5（適格機関投資家専用）	158,413,079円
V Aバランスファンド（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	331,011,105円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	3,113,637,988円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	192,786,576円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	364,255,989円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	3,135,014,291円
V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	387,894,219円
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	899,253,808円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	81,448,550円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	3,457,271,624円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	1,526,229,754円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	25,821,033,666円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	471,235,778円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	143,338,066円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	38,763,351円
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	649,070,137円
私募日本債券インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	5,789,779円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2021年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	152,400,000	-	152,390,000	10,000
	合計	152,400,000	-	152,390,000	10,000

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,689,317,600
コール・ローン	1,570,511,978
株式	275,533,985,455
投資信託受益証券	163,306,468
投資証券	6,420,007,245
派生商品評価勘定	363,070,411
未収入金	1,275,190
未収配当金	379,392,171
差入委託証拠金	2,510,267,938
流動資産合計	298,631,134,456
資産合計	298,631,134,456
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,391,378
前受金	342,743,524
未払金	190,597,884
未払解約金	445,358,503
未払利息	2,816
流動負債合計	1,005,094,105
負債合計	1,005,094,105
純資産の部	
元本等	
元本	71,640,862,556
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	225,985,177,795
元本等合計	297,626,040,351
純資産合計	297,626,040,351
負債純資産合計	298,631,134,456

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 8月22日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

	2021年 8月22日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 8月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		71,640,862,556口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.1544円 (41,544円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2021年 8月22日現在
期首	2021年 2月23日
期首元本額	77,760,045,092円
期中追加設定元本額	4,988,143,916円
期中一部解約元本額	11,107,326,452円
期末元本額	71,640,862,556円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,545,360,370円
D C外国株式インデックスファンド	4,614,653,130円
D C外国株式インデックスファンドL	24,168,565,016円
D Cバランスファンド3 0	635,670,743円
D Cバランスファンド5 0	1,293,418,392円
D Cバランスファンド7 0	812,875,422円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	300,296,210円
外国株式インデックスe	4,811,510,290円
インデックスコレクション（外国株式）	12,722,957,188円
インデックスコレクション（バランス株式3 0）	3,366,670,055円
インデックスコレクション（バランス株式5 0）	934,393,068円
インデックスコレクション（バランス株式7 0）	882,201,764円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,554,698,844円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,575,404,923円
私募外国株式パッシブファンド2（適格機関投資家専用）	121,334円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	505,392,698円
バランスVA3 0（適格機関投資家専用）	30,825,029円
バランスVA5 0（適格機関投資家専用）	343,315,146円
VAバランスファンド（株2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	39,101,635円
VAバランスファンド（株5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	72,952,040円
VAバランスファンド（株6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	510,033,061円
バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	301,349,492円
バランスVA3 7 . 5（適格機関投資家専用）	221,403,128円
バランスVA5 0 L（適格機関投資家専用）	4,268,833,719円
バランスVA7 5（適格機関投資家専用）	492,698,251円
VAバランスファンド（株4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	132,334,845円
VAポートフォリオ4 0（適格機関投資家専用）	691,936,993円
VAポートフォリオ2 0（適格機関投資家専用）	16,063,752円
バランスVA4 0（適格機関投資家専用）	85,867,853円
VAバランスファンド2（株4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	96,977,969円
VAバランス5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	299,762,760円
VAファンド2 5（適格機関投資家専用）	13,563,551円
バランスVA2 5 L（適格機関投資家専用）	72,794,633円
VAバランス2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	216,342,569円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	10,516,683円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	15,303,768,606	-	15,646,512,130	342,743,524
合計		15,303,768,606	-	15,646,512,130	342,743,524

（注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2021年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,327,789,275	-	1,321,724,784	6,064,491
	アメリカドル	939,978,806	-	936,521,284	3,457,522
	ユーロ	341,886,499	-	340,240,820	1,645,679
	イギリスポンド	45,923,970	-	44,962,680	961,290
合計		1,327,789,275	-	1,321,724,784	6,064,491

（注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	250,778,536
コール・ローン	1,747,792,611
国債証券	145,144,105,453
派生商品評価勘定	6,536,165
未収入金	11,196
未収利息	728,274,730
前払費用	15,793,748
差入委託証拠金	343,864,652
流動資産合計	148,237,157,091
資産合計	148,237,157,091
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,497,395
前受金	5,565,285
未払金	2,913,367
未払解約金	201,625,713
未払利息	3,134
流動負債合計	224,604,894
負債合計	224,604,894
純資産の部	
元本等	
元本	55,667,703,657
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	92,344,848,540
元本等合計	148,012,552,197
純資産合計	148,012,552,197
負債純資産合計	148,237,157,091

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2021年 8月22日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 8月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	55,667,703,657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 2.6589円 (1万口当たり純資産額) (26,589円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p>

	2021年 8月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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	2021年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月23日
期首元本額	55,567,630,111円
期中追加設定元本額	3,043,958,398円
期中一部解約元本額	2,943,884,852円
期末元本額	55,667,703,657円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,065,166,117円
DC外国債券インデックスファンド	1,923,865,163円
DC外国債券インデックスファンドL	13,848,141,717円
DCバランスファンド30	872,855,709円
DCバランスファンド50	886,599,842円
DCバランスファンド70	204,544,866円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	454,671,217円
外国債券インデックスe	1,083,021,898円
インデックスコレクション(外国債券)	8,109,480,368円
インデックスコレクション(バランス株式30)	4,550,189,431円

区分	2021年 8月22日現在
インデックスコレクション(バランス株式50)	685,379,955円
インデックスコレクション(バランス株式70)	205,193,257円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	4,249,548,580円
外国債券パッシブファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,545,676,177円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	493,124,925円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	103,140,607円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	514,778,654円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	291,660,438円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	181,425,784円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	396,094,052円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,512,157,951円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	601,650,908円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	6,342,669,483円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	368,927,066円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	239,975,240円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	1,613,194,227円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	99,847,326円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	190,499,981円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	100,494,944円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	51,767,402円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	84,326,517円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	246,437,336円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	71,209,804円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	1,457,195,854円
私募外国債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	22,790,861円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2021年 8月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,767,673,033	-	1,773,238,318	5,565,285
合計		1,767,673,033	-	1,773,238,318	5,565,285

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2021年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建	1,569,124,143	-	1,555,597,628	13,526,515
	アメリカドル	735,932,665	-	732,803,552	3,129,113
	カナダドル	73,185,864	-	71,143,948	2,041,916
	ユーロ	637,573,734	-	631,749,648	5,824,086
	イギリスポンド	122,431,880	-	119,900,480	2,531,400
	合計	1,569,124,143	-	1,555,597,628	13,526,515

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DCバランスファンド30】

【純資産額計算書】

(2021年 9月30日現在)

資産総額	24,955,675,101円
負債総額	47,885,450円
純資産総額（ - ）	24,907,789,651円
発行済口数	15,721,914,627口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5843円
（1万口当たり純資産額）	（15,843円）

【DCバランスファンド50】

【純資産額計算書】

(2021年 9月30日現在)

資産総額	26,143,186,462円
負債総額	18,280,675円
純資産総額（ - ）	26,124,905,787円
発行済口数	14,368,114,012口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8183円
（1万口当たり純資産額）	（18,183円）

【DCバランスファンド70】

【純資産額計算書】

(2021年 9月30日現在)

資産総額	11,402,061,558円
負債総額	13,206,459円
純資産総額（ - ）	11,388,855,099円
発行済口数	5,694,838,632口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9999円
（1万口当たり純資産額）	（19,999円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 9月30日現在)

資産総額	306,097,289,929円
負債総額	309,226,084円
純資産総額（ - ）	305,788,063,845円
発行済口数	133,404,100,100口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2922円
（1万口当たり純資産額）	（22,922円）

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 9月30日現在)

資産総額	389,793,558,134円
負債総額	3,740,860,000円
純資産総額（ - ）	386,052,698,134円
発行済口数	280,216,826,249口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3777円
（1万口当たり純資産額）	（13,777円）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 9月30日現在)

資産総額	299,450,217,976円
負債総額	417,438,874円
純資産総額（ - ）	299,032,779,102円
発行済口数	71,702,596,338口
1口当たり純資産額（ / ）	4.1705円
（1万口当たり純資産額）	（41,705円）

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 9月30日現在)

資産総額	149,361,596,259円
負債総額	269,198,341円
純資産総額（ - ）	149,092,397,918円
発行済口数	56,294,715,319口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6484円
（1万口当たり純資産額）	（26,484円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2021年 9月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2021年11月22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。

2021年9月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	535	14,650,754
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	76	276,621
単位型公社債投資信託	51	304,685
合計	662	15,232,060

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 2020年4月1日 至 2021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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	24,869	21,589
金銭の信託	5,823	10,857
前払費用	348	397
未収委託者報酬	7,284	8,471
未収運用受託報酬	5,842	6,151
未収収益	190	177
その他	4,624	3,428
流動資産合計	48,983	51,072
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 256	1 301
器具備品	1 576	1 692
その他	1 0	1 0
有形固定資産合計	832	993
無形固定資産		
ソフトウェア	3,030	4,104
その他	40	41
無形固定資産合計	3,070	4,145
投資その他の資産		
投資有価証券	8,469	9,950
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	700	311
その他	35	39
投資その他の資産合計	14,842	15,937
固定資産合計	18,745	21,077
資産合計	67,729	72,149

(単位：百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
固定負債		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
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	305	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額	587	791
金		
繰延ヘッジ損益	284	65
評価・換算差額等合計	302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

(2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	-
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

（単位：百万円）

前事業年度

当事業年度

(自 2019年4月1日
至 2020年3月31日)(自 2020年4月1日
至 2021年3月31日)

営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
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				
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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330

当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
-------	-----	-------	--------	--------	--------

	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	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

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、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員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。

(2) 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

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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
建 物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	"	391	"
そ の 他	4	"	4	"
計	367	"	503	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020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

2021年6月23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
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、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（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。

当事業年度（2021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	21,589	21,589	-
(2) 金銭の信託	10,857	10,857	-
(3) 未収委託者報酬	8,471	8,471	-
(4) 未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-
(6) 未払金	(7,572)	(7,572)	-
(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	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(*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

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券の時価について、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

未払金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 2020年3月31日	当事業年度 2021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)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(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	-

当事業年度(2021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	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-

投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0
----------------	---	----	-------	---

（有価証券関係）

1. 子会社株式

前事業年度（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

当事業年度（2021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（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

当事業年度（2021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	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

(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（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

当事業年度（2021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
109	1	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（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	種類	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。

当事業年度（2021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	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
	合計	3,567	-	41	41

(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	13,711	-	315	315
	合計	13,711	-	315	315

(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	種類	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		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

(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。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

(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74百万円 当事業年度77百万円

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44百万円、当事業年度92百万円であります。

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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	"	170	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	"	191	"
税務上の収益認識差額	-	"	71	"
有価証券評価差額	259	"	-	"
繰延ヘッジ損益	-	"	28	"
その他	151	"	123	"
繰延税金資産 合計	862	"	693	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	-	"	349	"
繰延ヘッジ損益	125	"	-	"
その他	35	"	32	"
繰延税金負債 合計	161	"	382	"
繰延税金資産の純額	700	"	311	"

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 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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

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

[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 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(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	-----------	----	-----------

親会社 の子会 社	三井住 友信託 銀行(株)	東京都 千代田 区	342,037	信託業務 及び銀行 業務	-	営業上の 取引 役員の兼 任	運用受託報 酬	9,365	未収運用 受託報酬	5,402
							投信販売 代行手数料 等	9,124	未払 手数料	1,888

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（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）

当事業年度（2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
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

2021年11月22日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載すること

があります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2021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 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
業務執行社員**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2020年4月1日から2021年3月31日までの第35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2021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、継続企業的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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年4月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 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バランスファンド30の2020年2月22日から2021年2月22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バランスファンド30の2021年2月22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、継続企業的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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年4月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 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バランスファンド50の2020年2月22日から2021年2月22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バランスファンド50の2021年2月22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、継続企業的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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年4月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 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バランスファンド70の2020年2月22日から2021年2月22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バランスファンド70の2021年2月22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、継続企業的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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年10月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド30の2021年2月23日から2021年8月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド30の2021年8月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年2月23日から2021年8月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年10月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド50の2021年2月23日から2021年8月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド50の2021年8月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年2月23日から2021年8月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年10月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド70の2021年2月23日から2021年8月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド70の2021年8月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年2月23日から2021年8月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。