

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券報告書

**【提出先】** 関東財務局長殿

**【提出日】** 2021年11月30日提出

**【計算期間】** DCターゲット・イヤー ファンド2025 第14期  
DCターゲット・イヤー ファンド2035 第14期  
DCターゲット・イヤー ファンド2045 第14期  
DCターゲット・イヤー ファンド2055 第4期  
(自 2020年8月29日至 2021年8月30日)

**【ファンド名】** DCターゲット・イヤー ファンド2025  
DCターゲット・イヤー ファンド2035  
DCターゲット・イヤー ファンド2045  
DCターゲット・イヤー ファンド2055

**【発行者名】** 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

**【代表者の役職氏名】** 代表取締役社長 菱田 賀夫

**【本店の所在の場所】** 東京都港区芝公園一丁目1番1号

**【事務連絡者氏名】** 投資業務推進部長 民野 誠

**【連絡場所】** 東京都港区芝公園一丁目1番1号

**【電話番号】** 03-6453-3610

**【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

## &lt;信託金限度額&gt;

各ファンドにつき上限 4,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

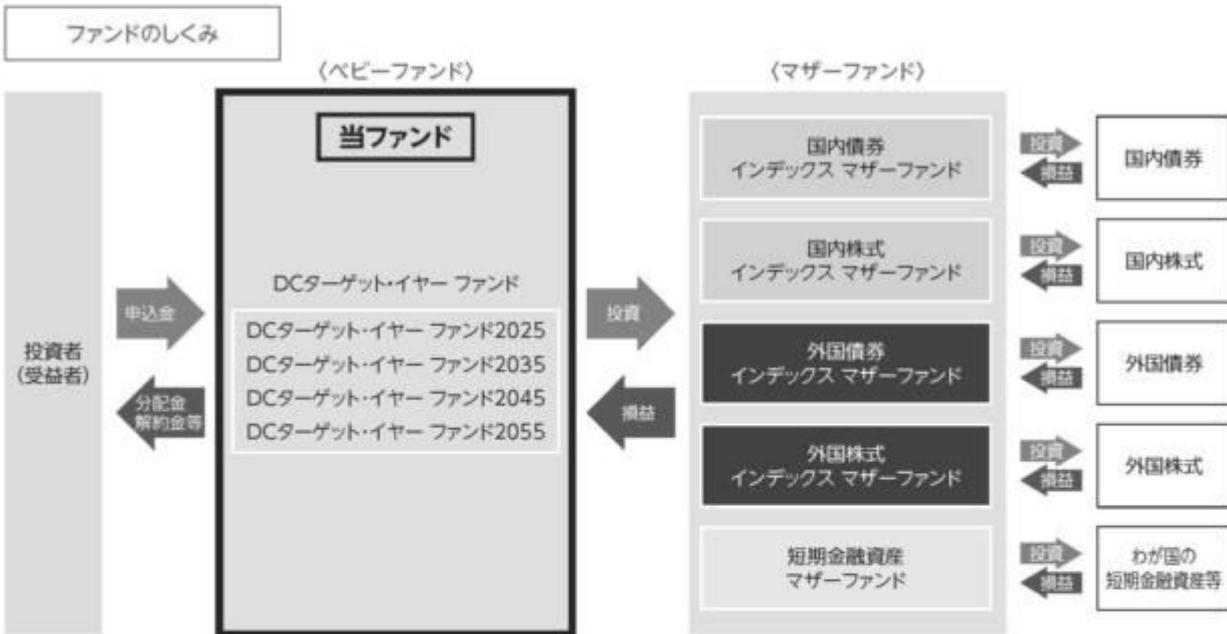
#### [ 特殊型 ]

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

#### < ファンドの特色 >

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



## ? ファミリーファンド方式とは

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

# 2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

\* わが国の短期金融資産等への投資は、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果を目指します。「無担保コール翌日物金利」とは、金融機関の間で担保なしにお金を借りて翌営業日に返す翌日物の金利です。各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

※1「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公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。

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

※3「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

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。

### ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

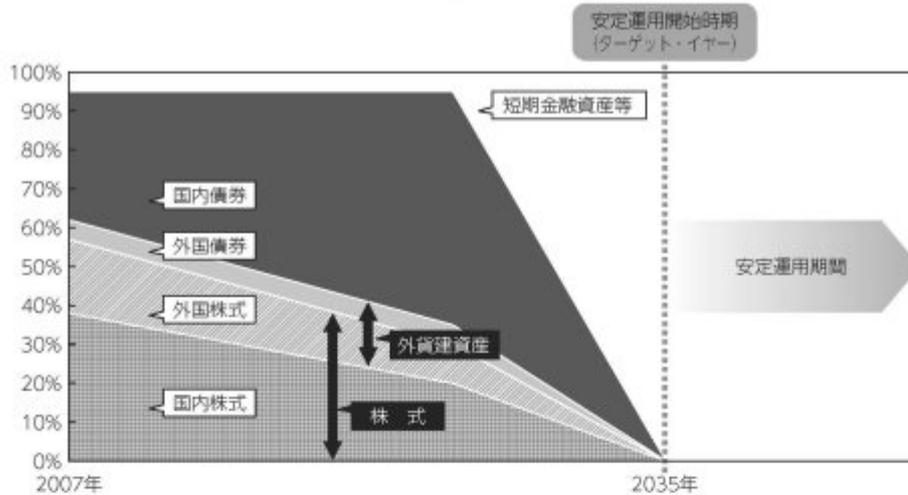
### 3. 安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)に近づくにしたいが、原則として1年に2回、各マザーファンドの基本組入比率を変更します。

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

#### 各ファンドの安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)

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

基本組入比率イメージ  
(例:DCターゲット・イヤー ファンド2035)



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

基本組入比率の推移

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

■ 2021年9月末現在	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	短期金融資産等
DCターゲット・イヤー ファンド2025	24.00%	8.00%	2.00%	4.00%	62.00%
DCターゲット・イヤー ファンド2035	54.00%	24.00%	5.00%	12.00%	5.00%
DCターゲット・イヤー ファンド2045	39.00%	34.00%	5.00%	17.00%	5.00%
DCターゲット・イヤー ファンド2055	24.00%	44.00%	5.00%	22.00%	5.00%

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

## 分配方針

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## 主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、以下の通りとします。

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

- 外貨建資産への実質投資割合は、以下の通りとします。

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

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

## (2)【ファンドの沿革】

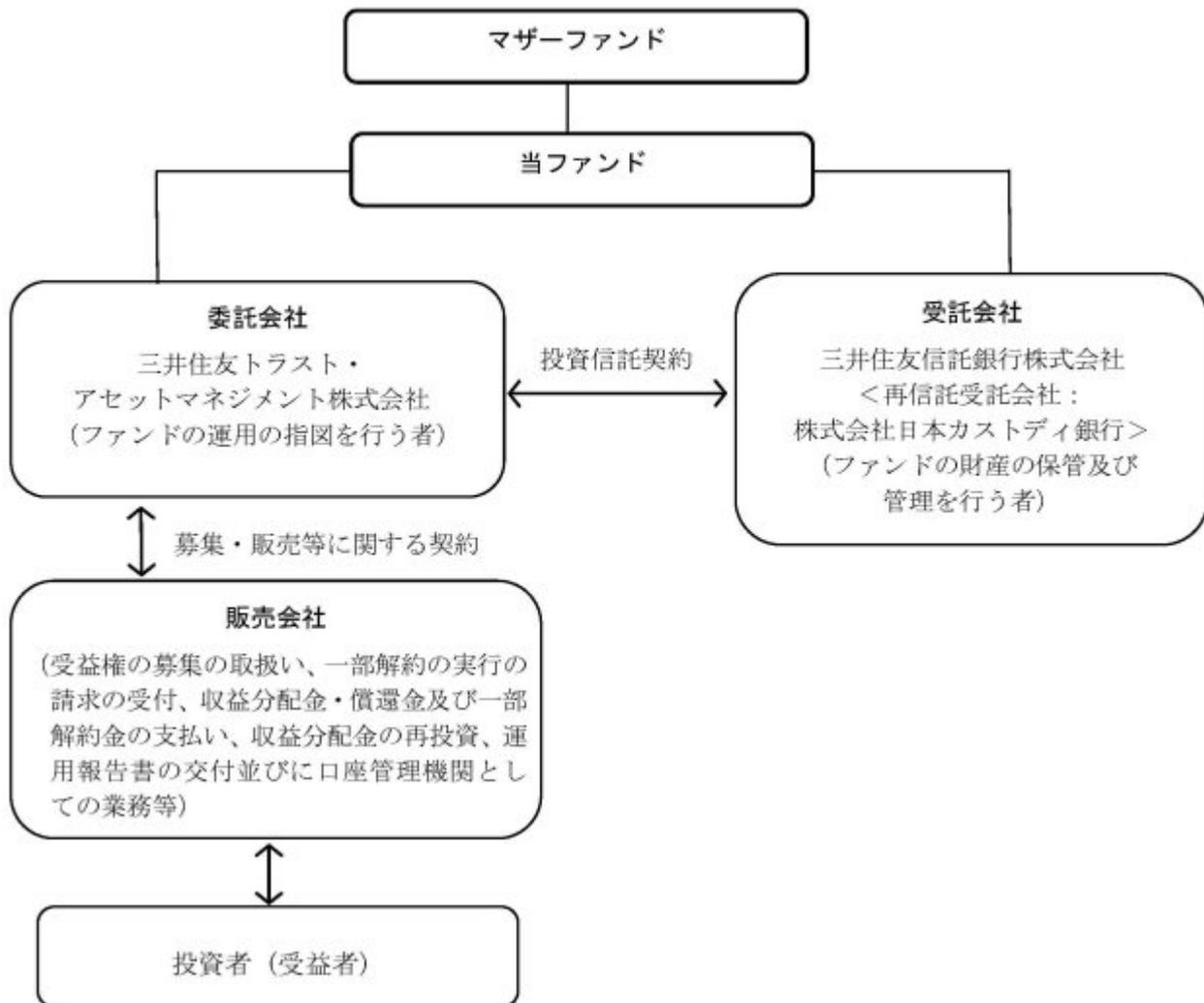
2007年9月26日

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

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

### (3)【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



#### 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】

## (イ) 基本方針

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

## (ロ) 運用方法

## 投資対象

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

## 投資態度

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

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

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

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

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

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

4) ターゲット・イヤー以降は、「短期金融資産 マザーファンド」受益証券に原則として100%投資を行い、より安定的な運用を行うことを基本とします。

5) 各マザーファンド受益証券の各年の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

6) 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損の可能性が高いと判断される場合には、一時的に為替ヘッジを行う場合が

あります。

- 7) 投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 8) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 9) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- 10) ただし、資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

2025 / 2035 / 2045

1. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 短期金融資産 マザーファンド
6. 株券または新株引受権証券
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人の発行する債券
10. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権

付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)

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

2055

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

なお、第6号の証券または証書、第17号ならびに第22号の証券または証書のうち第6号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第7号から第11号までの証券および第17号ならびに第22号の証券または証書のうち第7号から第11号までの証券の性質を有するもの、および第19号に記載する証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第18号の証券および第19号の証券(「投資法人債券」および「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

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

### (参考)マザーファンド概要

#### 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

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

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

###### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

##### 3. 運用制限

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「短期金融資産 マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の短期金融資産等を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

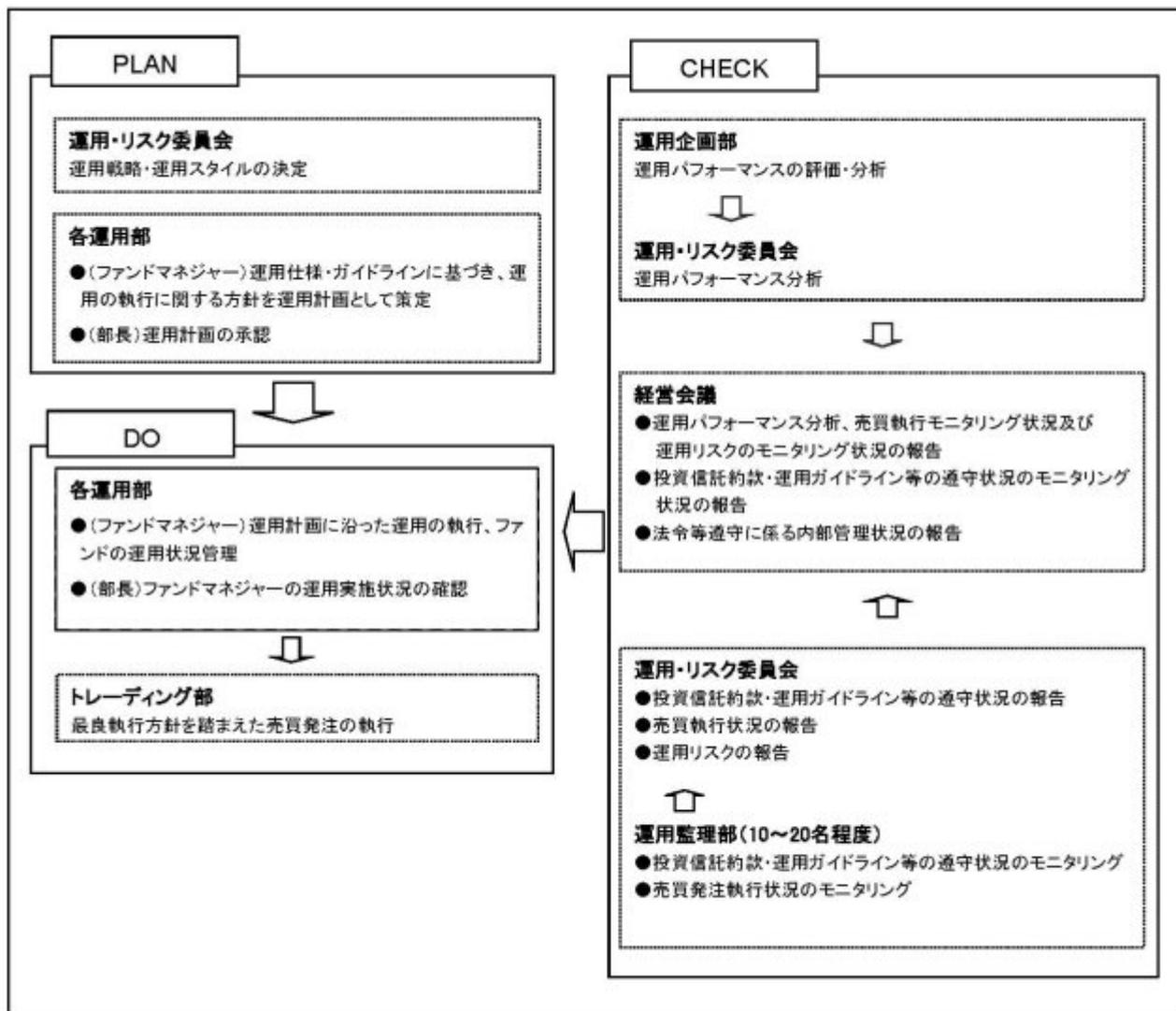
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となる

よう調整を行うこととします。

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

（イ）株式への投資割合（投資信託約款の「運用の基本方針」）

株式への実質投資割合は、以下の通りとします。

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

（ロ）外貨建資産の投資割合（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合は、以下の通りとします。

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

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

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

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

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

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

（チ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

（リ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しに

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

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

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

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

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

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

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

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

（カ）公社債の空売りの指図範囲

2025/2035/2045

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

2055

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

（投資信託約款第27条）

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

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

（ケ）資金の借入れ

2025/2035/2045

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

産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。(投資信託約款第38条)

2055

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

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

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

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

<関連法令に基づく投資制限>

イ.同一の法人の発行する株式への投資制限

(投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則)

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

### 3【投資リスク】

## (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

### 株価変動リスク

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

### 為替変動リスク

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

### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

### 信用リスク

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

### 流動性リスク

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

### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

## <その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

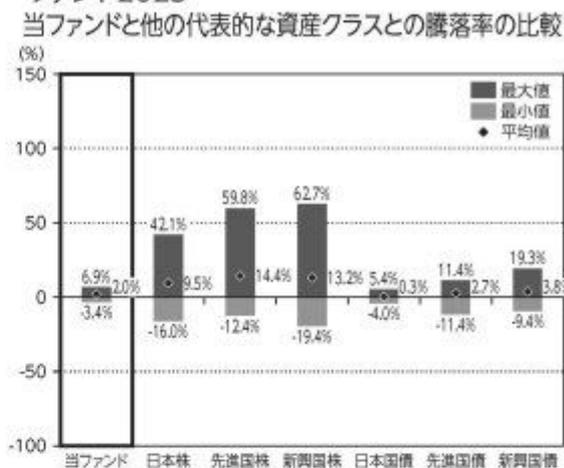
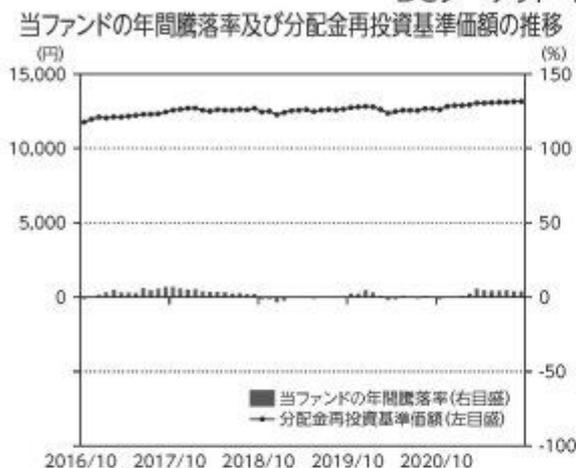
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

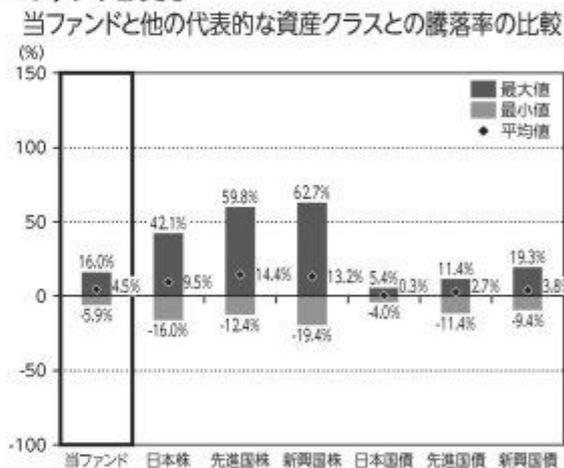
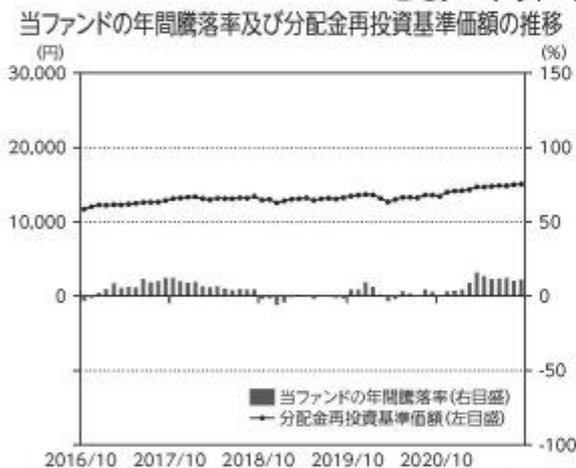
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 〔参考情報〕

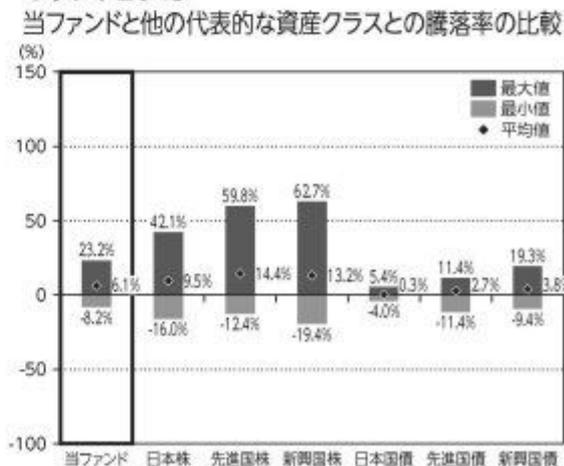
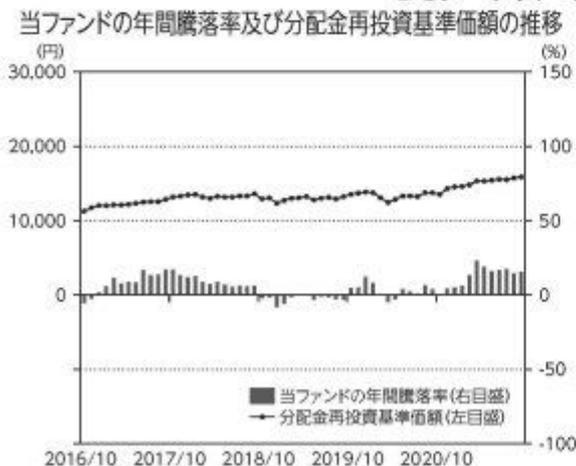
### DCターゲット・イヤー ファンド2025



### DCターゲット・イヤー ファンド2035



### DCターゲット・イヤー ファンド2045



## 【参考情報】

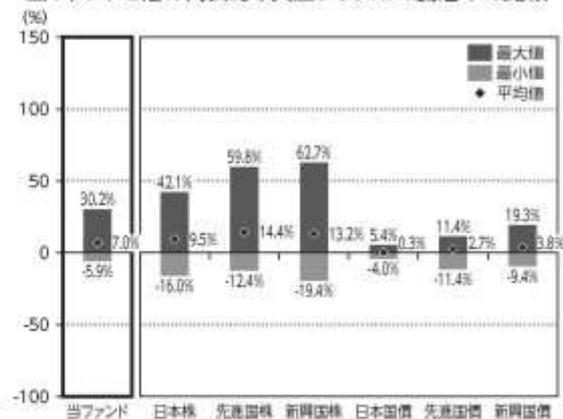
## DCターゲット・イヤー ファンド2055



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

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

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*DCターゲット・イヤー ファンド2055、DCターゲット・イヤー ファンド2035及びDCターゲット・イヤー ファンド2045については2016年10月～2021年9月の5年間、DCターゲット・イヤー ファンド2055については2019年2月～2021年9月の2年8ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては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・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式を銘柄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、東証の知的財産でなく、指数の算出、掲載等の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が抱えています。なお、東証は、ファンドの設立又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国債 MSCIロクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国債 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 NOWMURA-BPI国債	NOWMURA-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債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該の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、延滞または遅延につき自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 JPMオルガンズ・グローバル・インデックス・エマージング・マーケット・ロイヤリティ・ベース・インデックス	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。本指数は誤謬を受けで使用しています。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】

## &lt; 解約手数料 &gt;

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

## ( 3 ) 【信託報酬等】

## 信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

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

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

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

2025/2035/2045

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

2055

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

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

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

### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

### 個別元本について

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

### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

### 確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

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

上記は、2021年 9月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更

される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2021年9月30日現在の状況について記載してあります。

### 【DCターゲット・イヤー ファンド2025】

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	5,062,275,749	97.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		153,689,803	2.95
合計(純資産総額)		5,215,965,552	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### (2)【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	3,033,552,049	1.0119	3,069,653,102	1.0120	3,069,954,673	58.86
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	882,306,711	1.4147	1,248,261,502	1.4101	1,244,140,693	23.85
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	222,737,634	1.8845	419,761,894	1.9766	440,263,207	8.44
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	52,239,057	3.9836	208,104,255	3.9103	204,270,384	3.92
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	33,805,216	3.0787	104,077,249	3.0660	103,646,792	1.99

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.05
合計	97.05

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第5期計算期間末 (2012年 8月28日)	1,081,707,176	1,081,707,176	8,565	8,565
第6期計算期間末 (2013年 8月28日)	1,646,706,115	1,646,706,115	10,125	10,125
第7期計算期間末 (2014年 8月28日)	2,276,603,227	2,276,603,227	11,010	11,010
第8期計算期間末 (2015年 8月28日)	2,797,335,955	2,797,335,955	11,800	11,800
第9期計算期間末 (2016年 8月29日)	3,085,230,787	3,085,230,787	11,648	11,648
第10期計算期間末 (2017年 8月28日)	3,576,745,772	3,576,745,772	12,292	12,292
第11期計算期間末 (2018年 8月28日)	3,910,205,200	3,910,205,200	12,594	12,594
第12期計算期間末 (2019年 8月28日)	4,383,506,424	4,383,506,424	12,540	12,540
第13期計算期間末 (2020年 8月28日)	4,746,921,402	4,746,921,402	12,679	12,679
第14期計算期間末 (2021年 8月30日)	5,212,318,199	5,212,318,199	13,142	13,142
2020年 9月末日	4,782,745,820		12,685	
10月末日	4,780,388,198		12,616	
11月末日	4,873,399,882		12,827	
12月末日	4,898,349,924		12,886	
2021年 1月末日	4,916,610,754		12,888	
2月末日	4,921,162,362		12,933	
3月末日	4,998,721,084		13,062	
4月末日	5,019,202,889		13,059	
5月末日	5,064,216,779		13,084	
6月末日	5,159,032,862		13,111	
7月末日	5,178,128,490		13,108	
8月末日	5,215,310,149		13,150	
9月末日	5,215,965,552		13,166	

## 【分配の推移】

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

第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	0
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	0
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	0
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	0
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	0
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	0
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	0
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	0
第13期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第14期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	3.3
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	18.2
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	8.7
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	7.2
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	1.3
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	5.5
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	2.5
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	0.4
第13期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	1.1
第14期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	3.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	416,917,074	27,887,265	1,262,989,413
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	401,280,871	37,829,036	1,626,441,248
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	510,257,180	68,896,868	2,067,801,560
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	385,997,089	83,215,635	2,370,583,014
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	351,565,066	73,529,672	2,648,618,408
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	345,039,082	83,920,170	2,909,737,320
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	350,641,543	155,550,641	3,104,828,222
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	511,821,385	120,990,227	3,495,659,380
第13期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	419,462,284	171,242,620	3,743,879,044
第14期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	475,701,731	253,364,979	3,966,215,796

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

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2035】

### (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	5,251,117,957	96.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		170,075,148	3.14
合計(純資産総額)		5,421,193,105	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ.評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	2,044,095,233	1.4145	2,891,508,180	1.4101	2,882,378,688	53.17
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	687,824,936	1.8845	1,296,249,832	1.9766	1,359,554,768	25.08
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	162,563,416	3.9835	647,579,196	3.9103	635,671,725	11.73
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	86,886,794	3.0786	267,491,446	3.0660	266,394,910	4.91
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	105,847,694	1.0119	107,107,354	1.0120	107,117,866	1.98

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.86
合計	96.86

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第5期計算期間末	(2012年 8月28日)	688,663,598	688,663,598	7,757	7,757
第6期計算期間末	(2013年 8月28日)	1,149,255,645	1,149,255,645	9,744	9,744
第7期計算期間末	(2014年 8月28日)	1,633,177,356	1,633,177,356	10,868	10,868
第8期計算期間末	(2015年 8月28日)	2,071,477,526	2,071,477,526	11,932	11,932
第9期計算期間末	(2016年 8月29日)	2,267,735,876	2,267,735,876	11,461	11,461
第10期計算期間末	(2017年 8月28日)	2,771,734,999	2,771,734,999	12,573	12,573
第11期計算期間末	(2018年 8月28日)	3,240,277,607	3,240,277,607	13,175	13,175
第12期計算期間末	(2019年 8月28日)	3,642,033,135	3,642,033,135	12,949	12,949
第13期計算期間末	(2020年 8月28日)	4,220,411,377	4,220,411,377	13,567	13,567
第14期計算期間末	(2021年 8月30日)	5,349,656,108	5,349,656,108	14,955	14,955
	2020年 9月末日	4,257,200,289		13,580	
	10月末日	4,241,147,872		13,409	
	11月末日	4,453,609,665		13,981	
	12月末日	4,547,023,297		14,145	
	2021年 1月末日	4,576,506,220		14,168	
	2月末日	4,619,722,646		14,303	
	3月末日	4,814,026,637		14,681	
	4月末日	4,838,577,519		14,675	
	5月末日	4,942,234,011		14,759	
	6月末日	5,228,941,891		14,849	
	7月末日	5,264,294,633		14,836	
	8月末日	5,359,838,146		14,984	
	9月末日	5,421,193,105		15,061	

#### 【分配の推移】

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

第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	0
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	0
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	0
第13期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第14期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	3.8
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	25.6
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	11.5
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	9.8
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	3.9
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	9.7
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	4.8
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	1.7
第13期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	4.8
第14期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	10.2

(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5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	344,852,373	19,768,611	887,818,902
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	319,739,327	28,167,961	1,179,390,268
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	365,544,435	42,147,384	1,502,787,319
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	295,447,605	62,141,449	1,736,093,475
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	280,298,222	37,748,019	1,978,643,678
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	284,666,336	58,716,974	2,204,593,040
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	333,480,026	78,692,832	2,459,380,234
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	417,662,600	64,376,146	2,812,666,688
第13期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	398,934,497	100,702,007	3,110,899,178
第14期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	568,152,385	101,939,288	3,577,112,275

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

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2045】

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,666,324,763	96.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		85,898,739	3.12
合計(純資産総額)		2,752,223,502	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	745,264,397	1.4146	1,054,294,565	1.4101	1,050,897,326	38.18
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	491,876,116	1.8847	927,039,658	1.9766	972,242,330	35.33
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	116,261,022	3.9832	463,100,159	3.9103	454,615,474	16.52
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	43,860,880	3.0786	135,030,314	3.0660	134,477,458	4.89
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	53,450,766	1.0119	54,086,874	1.0120	54,092,175	1.97

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.88
合計	96.88

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第5期計算期間末 (2012年 8月28日)	201,929,105	201,929,105	6,871	6,871
第6期計算期間末 (2013年 8月28日)	398,978,812	398,978,812	9,144	9,144
第7期計算期間末 (2014年 8月28日)	601,017,817	601,017,817	10,456	10,456
第8期計算期間末 (2015年 8月28日)	818,329,438	818,329,438	11,753	11,753
第9期計算期間末 (2016年 8月29日)	897,737,674	897,737,674	10,969	10,969
第10期計算期間末 (2017年 8月28日)	1,184,545,763	1,184,545,763	12,460	12,460
第11期計算期間末 (2018年 8月28日)	1,515,638,255	1,515,638,255	13,298	13,298
第12期計算期間末 (2019年 8月28日)	1,721,901,931	1,721,901,931	12,782	12,782
第13期計算期間末 (2020年 8月28日)	2,070,589,304	2,070,589,304	13,738	13,738
第14期計算期間末 (2021年 8月30日)	2,699,465,334	2,699,465,334	15,702	15,702
2020年 9月末日	2,089,236,290		13,741	
10月末日	2,070,692,907		13,513	
11月末日	2,212,088,714		14,315	
12月末日	2,276,149,414		14,546	
2021年 1月末日	2,293,280,272		14,593	
2月末日	2,322,232,556		14,822	
3月末日	2,447,061,107		15,334	
4月末日	2,463,409,711		15,316	
5月末日	2,518,909,434		15,435	
6月末日	2,638,727,822		15,567	
7月末日	2,658,609,746		15,520	
8月末日	2,706,818,738		15,745	
9月末日	2,752,223,502		15,884	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	0
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	0
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	0
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	0
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	0
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	0
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	0
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	0
第13期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0

第14期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
----------	-------------------------	---

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	4.3
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	33.1
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	14.3
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	12.4
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	6.7
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	13.6
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	6.7
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	3.9
第13期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	7.5
第14期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	14.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第5期計算期間	2011年 8月30日～2012年 8月28日	132,499,607	9,393,588	293,899,487
第6期計算期間	2012年 8月29日～2013年 8月28日	178,897,557	36,486,986	436,310,058
第7期計算期間	2013年 8月29日～2014年 8月28日	178,178,605	39,676,309	574,812,354
第8期計算期間	2014年 8月29日～2015年 8月28日	174,356,779	52,914,082	696,255,051
第9期計算期間	2015年 8月29日～2016年 8月29日	161,155,035	39,011,124	818,398,962
第10期計算期間	2016年 8月30日～2017年 8月28日	187,698,313	55,419,992	950,677,283
第11期計算期間	2017年 8月29日～2018年 8月28日	239,625,450	50,566,222	1,139,736,511
第12期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	277,919,743	70,487,031	1,347,169,223
第13期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	260,422,137	100,415,451	1,507,175,909
第14期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	333,011,049	120,997,969	1,719,188,989

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

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2055】

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	82,327,415	96.99

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,556,355	3.01
合計(純資産総額)		84,883,770	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	19,529,683	1.8865	36,843,800	1.9766	38,602,371	45.48
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	14,087,733	1.4150	19,935,470	1.4101	19,865,112	23.40
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	4,620,529	3.9827	18,402,543	3.9103	18,067,654	21.29
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,347,435	3.0787	4,148,372	3.0660	4,131,235	4.87
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	1,641,347	1.0119	1,661,039	1.0120	1,661,043	1.96

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.99
合計	96.99

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額(円)	1万口当たりの純資産額(円)
--	----------	----------------

		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2018年 8月28日)	1,457,998	1,457,998	10,043	10,043
第2期計算期間末	(2019年 8月28日)	4,150,978	4,150,978	9,426	9,426
第3期計算期間末	(2020年 8月28日)	17,950,694	17,950,694	10,382	10,382
第4期計算期間末	(2021年 8月30日)	81,504,845	81,504,845	12,285	12,285
	2020年 9月末日	18,766,910		10,376	
	10月末日	19,160,666		10,163	
	11月末日	21,224,846		10,937	
	12月末日	21,453,871		11,160	
	2021年 1月末日	22,776,478		11,215	
	2月末日	23,905,434		11,453	
	3月末日	28,074,753		11,940	
	4月末日	29,442,484		11,917	
	5月末日	32,322,556		12,035	
	6月末日	76,735,144		12,165	
	7月末日	77,830,691		12,100	
	8月末日	81,824,271		12,328	
	9月末日	84,883,770		12,483	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2018年 2月27日～2018年 8月28日	0
第2期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	0
第3期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第4期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（%）
第1期計算期間	2018年 2月27日～2018年 8月28日	0.4
第2期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	6.1
第3期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	10.1
第4期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	18.3

(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1期計算期間	2018年 2月27日～2018年 8月28日	1,451,770		1,451,770
第2期計算期間	2018年 8月29日～2019年 8月28日	6,156,092	3,204,277	4,403,585
第3期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	17,683,699	4,797,666	17,289,618
第4期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	51,620,729	2,564,231	66,346,116

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	559,165,884,100	84.08
地方債証券	日本	36,499,280,427	5.49
特殊債券	日本	39,876,899,990	6.00
社債券	日本	27,470,591,160	4.13
	フランス	1,100,384,000	0.17
	オーストラリア	400,428,000	0.06
	小計	28,971,403,160	4.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		497,106,837	0.07
合計(純資産総額)		665,010,574,514	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)	8,160,000,000	100.95	8,237,520,000	100.81	8,226,667,200	0.100	2025/9/20	1.24
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	7,830,000,000	101.05	7,912,234,600	101.03	7,911,275,400	0.100	2028/3/20	1.19
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,750,000,000	100.74	7,807,350,000	100.64	7,799,600,000	0.100	2024/9/20	1.17
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,890,000,000	100.57	6,929,828,200	100.42	6,919,351,400	0.005	2026/6/20	1.04
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	6,880,000,000	100.60	6,921,280,000	100.48	6,913,643,200	0.100	2023/12/20	1.04
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	6,760,000,000	100.54	6,796,706,800	100.43	6,789,338,400	0.100	2023/9/20	1.02

日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	6,640,000,000	100.98	6,705,404,000	100.92	6,701,287,200	0.100	2026/9/20	1.01
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	6,350,000,000	101.01	6,414,706,500	100.98	6,412,738,000	0.100	2027/3/20	0.96
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	6,310,000,000	100.91	6,367,421,000	100.78	6,359,407,300	0.100	2025/6/20	0.96
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	6,300,000,000	100.70	6,344,352,000	100.59	6,337,737,000	0.100	2024/6/20	0.95
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	6,170,000,000	102.24	6,308,208,000	102.03	6,295,436,100	0.400	2025/9/20	0.95
日本	国債証券	第427回利付国債（2年）	5,990,000,000	100.26	6,006,097,900	100.23	6,004,256,200	0.005	2023/8/1	0.90
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	5,940,000,000	101.22	6,012,937,800	101.04	6,002,310,600	0.600	2023/3/20	0.90
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,810,000,000	100.67	5,849,405,100	100.33	5,829,579,700	0.100	2031/6/20	0.88
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	5,690,000,000	100.66	5,727,554,000	100.54	5,720,953,600	0.100	2024/3/20	0.86
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	5,700,000,000	100.35	5,720,406,000	100.26	5,714,934,000	0.100	2022/12/20	0.86
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	5,660,000,000	100.46	5,686,036,000	100.71	5,700,525,600	0.100	2030/9/20	0.86
日本	国債証券	第147回利付国債（5年）	5,450,000,000	100.54	5,479,970,900	100.44	5,474,416,000	0.005	2026/3/20	0.82
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,340,000,000	101.84	5,438,463,400	101.71	5,431,634,400	0.300	2025/12/20	0.82
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	5,380,000,000	100.80	5,423,201,400	100.67	5,416,476,400	0.100	2024/12/20	0.81
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	5,260,000,000	100.90	5,307,718,000	100.91	5,308,234,200	0.100	2029/9/20	0.80
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	5,220,000,000	100.96	5,270,112,000	100.87	5,265,622,800	0.100	2026/3/20	0.79
日本	国債証券	第327回利付国債（10年）	5,190,000,000	101.34	5,260,064,100	101.11	5,247,609,000	0.800	2022/12/20	0.79
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	5,150,000,000	100.95	5,199,383,100	100.96	5,199,749,000	0.100	2029/6/20	0.78
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	5,090,000,000	101.05	5,143,906,100	101.04	5,143,394,100	0.100	2027/9/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	5,090,000,000	100.95	5,138,452,200	100.97	5,139,474,800	0.100	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	5,010,000,000	101.05	5,062,991,900	101.01	5,060,751,300	0.100	2028/9/20	0.76
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	4,860,000,000	102.23	4,968,378,000	101.96	4,955,401,800	0.600	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,920,000,000	100.34	4,936,773,600	100.59	4,949,372,400	0.100	2030/12/20	0.74
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	4,800,000,000	101.87	4,889,760,000	101.59	4,876,320,000	0.600	2023/12/20	0.73

(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	84.08
地方債証券	5.49
特殊債券	6.00
社債券	4.36

合計	99.93
----	-------

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	486,963,215,070	98.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,740,158,535	1.37
合計(純資産総額)		493,703,373,605	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	6,781,870,000	1.37

(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	8,862,000	1,826.95	16,190,430,900	2,000.00	17,724,000,000	3.59
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,096,000	10,790.97	11,826,903,120	12,455.00	13,650,680,000	2.76
日本	株式	キーエンス	電気機器	171,700	54,031.40	9,277,191,380	67,000.00	11,503,900,000	2.33

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,362,300	8,223.42	11,202,765,066	6,480.00	8,827,704,000	1.79
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,197,600	5,560.39	6,659,123,064	6,832.00	8,182,003,200	1.66
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,804,000	619.33	7,310,571,320	657.90	7,765,851,600	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,008,100	2,929.82	5,883,371,542	3,085.00	6,194,988,500	1.25
日本	株式	信越化学工業	化学	316,900	18,834.99	5,968,808,331	18,900.00	5,989,410,000	1.21
日本	株式	HOYA	精密機器	341,400	14,392.68	4,913,660,952	17,475.00	5,965,965,000	1.21
日本	株式	日立製作所	電気機器	841,200	5,752.88	4,839,322,656	6,640.00	5,585,568,000	1.13
日本	株式	ダイキン工業	機械	222,900	21,648.34	4,825,414,986	24,460.00	5,452,134,000	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	100,100	67,456.49	6,752,394,649	54,310.00	5,436,431,000	1.10
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,455,600	3,718.44	5,412,561,264	3,699.00	5,384,264,400	1.09
日本	株式	日本電産	電気機器	421,200	12,536.45	5,280,352,740	12,420.00	5,231,304,000	1.06
日本	株式	村田製作所	電気機器	514,100	8,293.50	4,263,688,350	9,960.00	5,120,436,000	1.04
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	102,500	48,605.05	4,982,017,625	49,670.00	5,091,175,000	1.03
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,376,800	3,708.10	5,105,312,080	3,691.00	5,081,768,800	1.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,377,500	3,358.19	4,625,906,725	3,455.00	4,759,262,500	0.96
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,194,100	3,947.04	4,713,160,464	3,944.00	4,709,530,400	0.95
日本	株式	第一三共	医薬品	1,374,900	2,524.88	3,471,457,512	2,979.50	4,096,514,550	0.83
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,205,200	3,249.74	3,916,586,648	3,277.00	3,949,440,400	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	153,500	26,283.61	4,034,534,135	24,565.00	3,770,727,500	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,344,800	1,670.42	3,916,800,816	1,584.50	3,715,335,600	0.75
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,049,100	2,988.42	3,135,151,422	3,536.00	3,709,617,600	0.75
日本	株式	S M C	機械	51,200	65,569.29	3,357,147,648	70,080.00	3,588,096,000	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	674,100	4,746.14	3,199,372,974	5,085.00	3,427,798,500	0.69
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	568,300	5,180.54	2,944,100,882	6,021.00	3,421,734,300	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	1,338,200	2,417.39	3,234,951,298	2,464.00	3,297,324,800	0.67
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	177,800	16,297.81	2,897,750,618	18,130.00	3,223,514,000	0.65
日本	株式	富士通	電気機器	157,400	17,851.70	2,809,857,580	20,310.00	3,196,794,000	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	3.39
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.22
		化学	6.96

医薬品	5.08
石油・石炭製品	0.41
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	5.30
電気機器	18.34
輸送用機器	7.60
精密機器	2.93
その他製品	2.17
電気・ガス業	1.12
陸運業	3.25
海運業	0.47
空運業	0.48
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	8.32
卸売業	4.70
小売業	4.44
銀行業	4.94
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	2.00
その他金融業	1.13
不動産業	1.98
サービス業	5.95
小計	98.63
合計	98.63

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	334	円	6,892,842,900	6,781,870,000	1.37

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

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	134,932,172,129	45.28
	フランス	29,622,702,495	9.94
	イタリア	27,461,878,651	9.22
	ドイツ	21,707,171,356	7.28
	イギリス	17,578,771,598	5.90
	スペイン	17,294,069,722	5.80
	ベルギー	6,896,932,231	2.31
	カナダ	5,678,752,870	1.91
	オランダ	5,426,604,668	1.82
	オーストラリア	5,317,259,436	1.78
	オーストリア	4,316,071,697	1.45
	アイルランド	2,387,323,410	0.80
	メキシコ	2,022,045,883	0.68
	フィンランド	1,776,218,290	0.60
	ポーランド	1,653,700,172	0.55
	デンマーク	1,474,819,643	0.49
	マレーシア	1,391,435,058	0.47
	イスラエル	1,334,084,483	0.45
	シンガポール	1,315,315,589	0.44
	スウェーデン	845,879,468	0.28
ノルウェー	711,599,017	0.24	
	小計	291,144,807,866	97.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,856,488,758	2.30
合計(純資産総額)		298,001,296,624	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、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	2,132,607,620	0.72
	買建	ドイツ	2,524,575,795	0.85

(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		4,661,369,340	1.56
	売建		78,629,011	0.03

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	15,950,000	10,320.24	1,646,079,585	10,405.93	1,659,746,940	0.625	2030/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	10,742.57	1,616,756,972	10,832.63	1,630,311,105	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,362.21	1,461,072,763	10,440.03	1,472,045,288	0.625	2030/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/51	13,600,000	10,455.81	1,421,990,925	10,686.61	1,453,379,129	1.875	2051/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	11,193.74	1,455,187,337	11,153.09	1,449,901,744	0.250	2024/3/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/40	13,000,000	9,745.78	1,266,951,887	10,052.68	1,306,849,626	1.375	2040/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	11,069.58	1,273,002,563	10,997.88	1,264,757,206	0.500	2026/2/28	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	11,400.77	1,271,186,881	11,313.53	1,261,459,505	1.625	2031/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	11,189.81	1,230,879,550	11,108.93	1,221,982,787	0.750	2026/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,847.78	1,210,843,243	11,740.23	1,199,851,831	2.000	2026/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,900.68	1,207,919,111	11,780.89	1,195,760,495	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,531.84	1,174,300,932	10,614.91	1,183,562,743	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,493.00	1,149,300,358	11,422.83	1,142,283,500	2.000	2022/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/50	11,300,000	9,865.98	1,114,855,951	10,070.17	1,137,929,992	1.625	2050/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	11,217.79	1,138,606,100	11,200.52	1,136,853,304	0.250	2023/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	11,132.67	1,113,267,680	11,135.60	1,113,560,284	0.250	2024/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	11,162.70	1,116,270,841	11,131.66	1,113,166,818	0.125	2024/1/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	11,035.92	1,103,592,409	10,974.71	1,097,471,784	0.250	2025/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	10,810.77	1,081,077,250	10,791.53	1,079,153,625	0.625	2027/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	11,395.94	1,082,615,062	11,343.48	1,077,631,124	1.500	2022/9/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,997.73	1,073,797,425	11,883.63	1,063,584,945	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	11,334.92	1,076,817,574	11,157.89	1,060,000,445	1.250	2028/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,639.96	1,061,757,060	12,566.51	1,055,587,470	3.125	2028/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,729.45	1,019,298,289	10,705.41	1,017,013,982	0.375	2027/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,986.80	1,024,871,992	11,891.93	1,016,760,627	2.250	2027/8/15	0.34
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000	22,409.94	1,012,929,298	22,462.01	1,015,283,036	4.500	2041/4/25	0.34

フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000	15,904.21	1,014,688,848	15,868.50	1,012,410,454	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,627.00	1,020,850,739	11,529.94	1,012,329,251	1.625	2026/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	11,189.20	1,008,147,101	11,157.46	1,005,287,341	0.375	2024/7/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	11,157.97	1,004,217,869	11,126.42	1,001,377,974	0.250	2024/6/15	0.34

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.70
合計	97.70

(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	58	アメリカ ドル	7,148,967.14	800,112,402	7,114,062.5	796,205,875	0.27
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	40	アメリカ ドル	5,312,721.52	594,599,793	5,258,750	588,559,300	0.20
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	42	アメリカ ドル	6,814,961.35	762,730,474	6,681,937.5	747,842,445	0.25
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	25	ユーロ	2,806,472.5	364,448,519	2,805,250	364,289,765	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	35	ユーロ	4,741,963.5	615,791,380	4,725,000	613,588,500	0.21
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	70	ユーロ	12,017,377	1,560,576,577	11,910,500	1,546,697,530	0.52

(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	19,350,000.00	2,133,110,027	2,165,352,075	0.73
	カナダドル	買建	3,120,000.00	271,850,894	273,918,840	0.09
	ユーロ	買建	14,770,000.00	1,917,063,337	1,918,261,135	0.64

イギリスポンド	買建	2,020,000.00	306,663,920	303,837,290	0.10
カナダドル	売建	895,497.87	78,623,727	78,629,011	0.03

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

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	344,194,019,791	66.57
	イギリス	21,327,736,235	4.13
	カナダ	17,576,264,659	3.40
	スイス	16,292,266,216	3.15
	フランス	16,062,694,582	3.11
	ドイツ	14,103,169,586	2.73
	オランダ	10,450,957,137	2.02
	アイルランド	9,472,295,686	1.83
	オーストラリア	9,369,443,000	1.81
	スウェーデン	5,356,228,340	1.04
	デンマーク	4,072,671,429	0.79
	スペイン	3,773,442,191	0.73
	香港	3,405,309,610	0.66
	イタリア	2,904,932,127	0.56
	フィンランド	1,957,982,261	0.38
	ジャージー	1,570,114,883	0.30
	シンガポール	1,372,918,552	0.27
	ベルギー	1,296,081,034	0.25
	パミュダ	1,158,246,620	0.22
	ケイマン	998,806,745	0.19
	ノルウェー	987,078,646	0.19
	イスラエル	985,885,555	0.19
	ニュージーランド	501,136,115	0.10
	ルクセンブルク	496,510,489	0.10
	キュラソー	396,196,384	0.08
	オーストリア	342,205,134	0.07
	ポルトガル	250,534,753	0.05
パナマ	201,419,111	0.04	
リベリア	195,517,401	0.04	
マン島	161,635,455	0.03	

	パプアニューギニア	64,542,137	0.01
	小計	491,298,241,864	95.02
投資信託受益証券	オーストラリア	216,518,588	0.04
	香港	81,880,151	0.02
	小計	298,398,739	0.06
投資証券	アメリカ	9,550,254,272	1.85
	オーストラリア	688,623,359	0.13
	イギリス	300,430,262	0.06
	フランス	249,172,113	0.05
	シンガポール	230,863,835	0.04
	香港	159,979,297	0.03
	カナダ	75,892,858	0.01
	小計	11,255,215,996	2.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,176,715,369	2.74
合計(純資産総額)		517,028,571,968	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	10,539,740,033	2.04
	買建	カナダ	802,228,647	0.16
	買建	ドイツ	2,014,757,668	0.39
	買建	イギリス	425,716,900	0.08
	買建	オーストラリア	534,077,388	0.10

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,237,360,995	0.24
	売建		317,341,726	0.06

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

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

#### 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,380,967	13,946.35	19,259,450,778	15,985.53	22,075,494,379	4.27
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	592,083	27,944.18	16,545,277,242	31,785.27	18,819,523,938	3.64
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	37,556	362,280.56	13,605,808,832	369,461.35	13,875,490,476	2.68
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	198,185	36,791.46	7,291,515,818	38,009.15	7,532,843,631	1.46
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	24,877	263,778.65	6,562,021,525	300,736.87	7,481,431,224	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	24,088	269,901.79	6,501,394,443	301,111.80	7,253,181,193	1.40
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	67,711	70,734.55	4,789,507,738	87,444.21	5,920,935,255	1.15
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	206,048	18,219.45	3,754,082,634	22,962.62	4,731,403,244	0.92
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	250,254	18,381.74	4,600,104,163	18,573.12	4,647,998,574	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	217,670	18,942.45	4,123,205,268	18,357.11	3,995,793,962	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	139,816	25,439.41	3,556,837,387	25,370.02	3,547,135,499	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	77,990	46,102.08	3,595,501,719	44,813.88	3,495,035,063	0.68
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	109,624	32,394.12	3,551,173,537	31,034.29	3,402,103,752	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	87,860	35,692.40	3,135,934,897	37,709.20	3,313,130,804	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	201,599	15,092.41	3,042,615,167	15,894.87	3,204,391,591	0.62
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	237,137	13,321.06	3,158,917,533	13,481.70	3,197,011,031	0.62
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	637,169	4,744.28	3,022,913,750	4,820.39	3,071,405,879	0.59
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	34,516	71,721.67	2,475,545,438	84,110.32	2,903,151,874	0.56
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	150,108	19,994.50	3,001,335,607	19,326.34	2,901,039,085	0.56
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	73,080	40,356.11	2,949,224,781	39,529.02	2,888,781,132	0.56
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	92,194	29,101.43	2,682,978,012	28,987.27	2,672,453,292	0.52
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	39,486	56,472.59	2,229,876,830	64,656.18	2,553,014,081	0.49

アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	36,617	56,274.49	2,060,603,191	67,046.79	2,455,052,500	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	80,235	26,579.88	2,132,636,736	30,274.36	2,429,063,275	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	378,603	6,417.49	2,429,682,026	6,259.68	2,369,935,747	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	57,934	37,834.12	2,191,882,371	40,525.43	2,347,800,493	0.45
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	349,538	6,532.77	2,283,451,500	6,701.76	2,342,523,142	0.45
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	462,196	4,334.66	2,003,463,253	4,871.87	2,251,762,339	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	347,932	5,920.56	2,059,955,065	6,209.32	2,160,421,683	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	32,450	52,546.44	1,705,131,978	64,868.83	2,104,993,598	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	3.28
		素材	3.95
		資本財	6.14
		商業・専門サービス	1.23
		運輸	1.85
		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	1.86
		メディア・娯楽	7.33
		小売	5.57
		食品・生活必需品小売り	1.39
		食品・飲料・タバコ	3.68
		家庭用品・パーソナル用品	1.67
		ヘルスケア機器・サービス	5.06
		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	4.59		

	保険	2.97
	不動産	0.45
	ソフトウェア・サービス	12.09
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.80
	電気通信サービス	1.58
	公益事業	2.73
	半導体・半導体製造装置	4.52
	小計	95.02
投資信託受益証券		0.06
投資証券		2.18
合計		97.26

(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	433	アメリカドル	96,260,418.5	10,773,466,039	94,172,087.5	10,539,740,033	2.04
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	38	カナダドル	9,313,261	817,797,448	9,135,960	802,228,647	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	51	スイスフラン	6,114,287	732,980,725	5,935,380	711,533,354	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	247	ユーロ	10,240,981.5	1,329,893,857	10,035,610	1,303,224,314	0.25
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	37	オーストラリアドル	6,840,109	550,355,170	6,637,800	534,077,388	0.10
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	40	イギリスポンド	2,801,435	421,419,867	2,830,000	425,716,900	0.08

(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	9,213,000.00	1,029,217,830	1,031,101,956	0.20
	カナダドル	買建	271,000.00	23,863,718	23,796,239	0.00

ユーロ	買建	790,000.00	103,012,840	102,590,190	0.02
イギリスポンド	買建	260,000.00	39,296,140	39,111,540	0.01
スイスフラン	買建	340,000.00	40,755,800	40,761,070	0.01
カナダドル	売建	3,614,000.00	317,500,742	317,341,726	0.06

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

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

## 短期金融資産 マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,099,121,766	100.00
合計(純資産総額)		10,099,121,766	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

##### ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

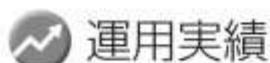
該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### 参考情報

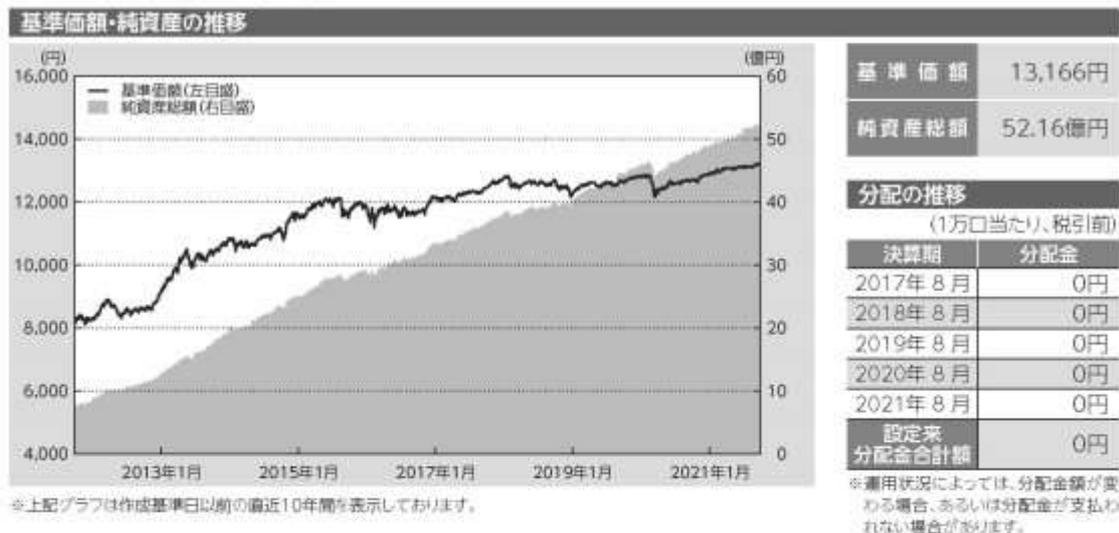
#### 交付目論見書に記載するファンドの運用実績



当初設定日：2007年9月26日

作成基準日：2021年9月30日

## DCターゲット・イヤー ファンド2025

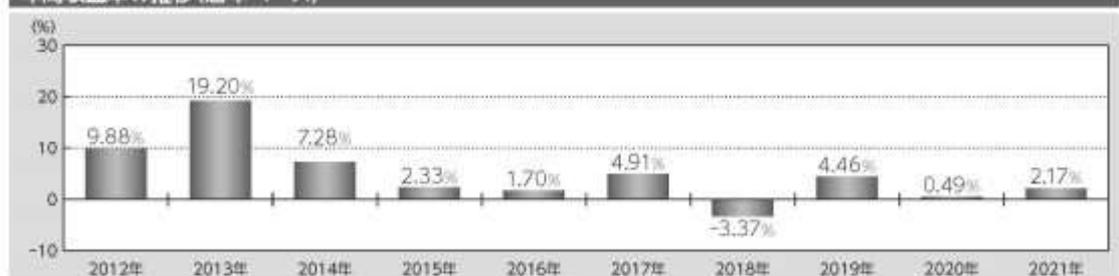


## 主要な資産の状況

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	償還期間	実質投資比率
短期金融資産 マザーファンド	58.9%	-	-	-	-	-	-	-
国内債券 インデックス マザーファンド	23.9%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.3%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/03/20	0.3%
国内株式 インデックス マザーファンド	8.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.3%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.2%
外国株式 インデックス マザーファンド	3.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.2%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.1%
外国債券 インデックス マザーファンド	2.0%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.0%
		T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	1.125%	2031/02/15	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



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：2007年9月26日

作成基準日：2021年9月30日

## DCターゲット・イヤー ファンド2035

## 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 15,061円

純資産総額 54.21億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年8月	0円
2018年8月	0円
2019年8月	0円
2020年8月	0円
2021年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

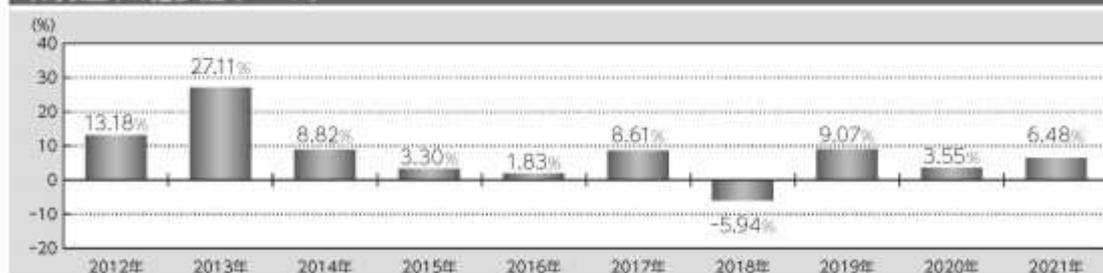
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内債券 インデックス マザーファンド	53.2%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.7%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/03/20	0.6%
国内株式 インデックス マザーファンド	25.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.9%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
外国株式 インデックス マザーファンド	11.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	マイクロコンピュータ/周辺機器	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
外国債券 インデックス マザーファンド	4.9%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.0%
		T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	1.125%	2031/02/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	2.0%	-	-	-	-	-	-	-

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※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。

当初設定日：2007年9月26日

作成基準日：2021年9月30日

## DCターゲット・イヤー ファンド2045

## 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 15,884円

純資産総額 27.52億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年8月	0円
2018年8月	0円
2019年8月	0円
2020年8月	0円
2021年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

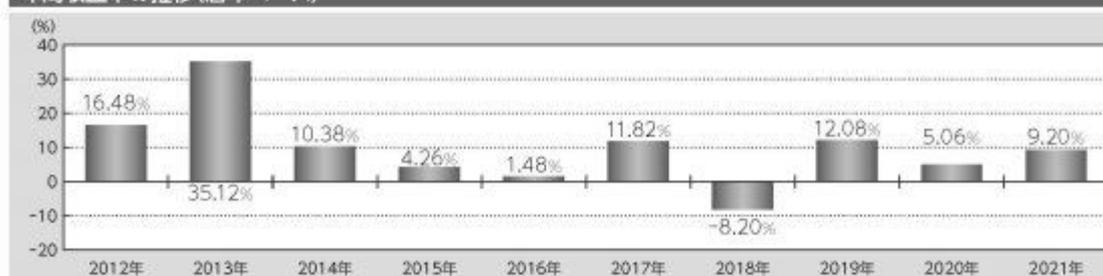
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内債券 インデックス マザーファンド	38.2%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.5%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/03/20	0.5%
国内株式 インデックス マザーファンド	35.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.3%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.0%
外国株式 インデックス マザーファンド	16.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ウェアラブル機器	-	-	0.7%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.6%
外国債券 インデックス マザーファンド	4.9%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.0%
		T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	1.125%	2031/02/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	2.0%	-	-	-	-	-	-	-

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※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。


**運用実績**

当初設定日：2018年2月27日  
作成基準日：2021年9月30日

**DCターゲット・イヤー ファンド2055**
**基準価額・純資産の推移**


基準価額	12,483円
------	---------

純資産総額	0.85億円
-------	--------

**分配の推移**

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2018年8月	0円
2019年8月	0円
2020年8月	0円
2021年8月	0円
-	-

設定来 分配金合計額	0円
---------------	----

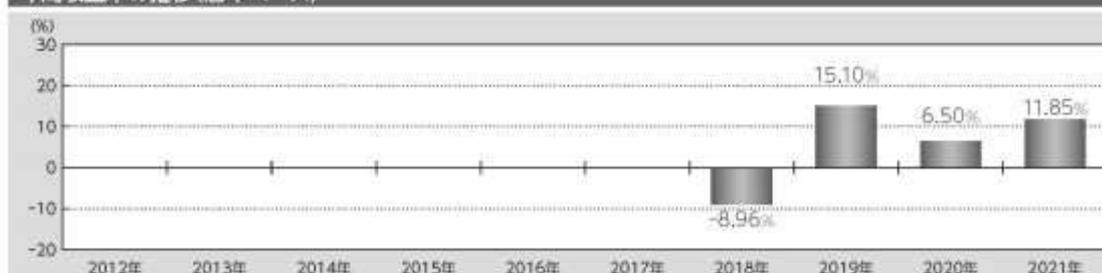
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式 インデックス マザーファンド	45.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.6%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	23.4%	第145回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2025/09/20	0.3%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.1%	2028/03/20	0.3%
外国株式 インデックス マザーファンド	21.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア/ハードウェア/半導体	-	-	0.9%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
外国債券 インデックス マザーファンド	4.9%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.0%
		T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	1.125%	2031/02/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	2.0%	-	-	-	-	-	-	-
		-	-	-	-	-	-	-

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移（暦年ベース）**


※2018年は当初設定日から年末までの収益率です。また、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 >**

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

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

### <一部解約手続>

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

### <一部解約の受付>

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

### <一部解約単位>

1口単位とします。

### <解約価額>

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

### <一部解約代金の支払い>

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

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

### <受付不可日>

ありません。

### <一部解約受付の中止等>

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

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

します。

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

##### ・株式

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

##### ・公社債

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

す。

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

外貨建資産等の円換算

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

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

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

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

#### （4）【計算期間】

原則として、毎年8月29日から翌年8月28日（第1計算期間は、2025、2035、2045は2007年9月26日から2008年8月28日、2055は2018年2月27日から2018年8月28日）までとします。なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### （5）【その他】

2025、2035、2045

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### <投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

##### (1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

##### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超

えるときは、当該約款変更を行いません。

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託

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

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

2055

#### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

##### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

##### (2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

#### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

##### (1) 投資信託約款の変更等

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

- ・ 受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

#### (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

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

## 4 【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益

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

#### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

#### (3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

#### (4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2025】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2020年8月29日から2021年8月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2020年 8月28日現在)	第14期 (2021年 8月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	149,899,887	168,444,556
親投資信託受益証券	4,609,034,724	5,056,309,139
未収入金	-	4,980,000
流動資産合計	4,758,934,611	5,229,733,695
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,018,103	5,137,323
未払受託者報酬	999,559	1,116,662
未払委託者報酬	9,745,673	10,887,457
未払利息	291	291
その他未払費用	249,583	273,763
流動負債合計	12,013,209	17,415,496
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,743,879,044	3,966,215,796
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,003,042,358	1,246,102,403
(分配準備積立金)	650,245,412	777,424,309
元本等合計	4,746,921,402	5,212,318,199
純資産合計	4,746,921,402	5,212,318,199
負債純資産合計	4,758,934,611	5,229,733,695

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	2019年 8月29日	自	2020年 8月29日
	至	2020年 8月28日	至	2021年 8月30日
営業収益				
受取利息		469		566
有価証券売買等損益		70,615,533		199,934,415
営業収益合計		70,616,002		199,934,981
営業費用				
支払利息		62,666		58,780
受託者報酬		1,997,652		2,191,090
委託者報酬		19,477,033		21,363,087
その他費用		249,824		273,763
営業費用合計		21,787,175		23,886,720
営業利益又は営業損失（ ）		48,828,827		176,048,261
経常利益又は経常損失（ ）		48,828,827		176,048,261
当期純利益又は当期純損失（ ）		48,828,827		176,048,261
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（ ）		568,009		7,193,971
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		887,847,044		1,003,042,358
剰余金増加額又は欠損金減少額		110,544,079		142,375,447
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		110,544,079		142,375,447
剰余金減少額又は欠損金増加額		43,609,583		68,169,692
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		43,609,583		68,169,692
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,003,042,358		1,246,102,403

## (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8月29日から翌年8月28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14期計算期間は2020年 8月29日から2021年 8月30日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第13期 (2020年 8月28日現在)	第14期 (2021年 8月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,743,879,044口	3,966,215,796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) 1.2679円 (12,679円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3142円 (13,142円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	第14期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日																																																												
<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>- 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>34,845,667円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>761,892,058円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>615,399,745円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,412,137,470円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,743,879,044口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>3,771円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	34,845,667円	収益調整金額	C	761,892,058円	分配準備積立金額	D	615,399,745円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,412,137,470円	当ファンドの期末残存口数	F	3,743,879,044口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,771円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円	<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>- 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>168,853,766円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>887,424,472円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>608,570,543円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,664,848,781円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,966,215,796口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>4,197円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	168,853,766円	収益調整金額	C	887,424,472円	分配準備積立金額	D	608,570,543円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,664,848,781円	当ファンドの期末残存口数	F	3,966,215,796口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,197円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	- 円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	34,845,667円																																																											
収益調整金額	C	761,892,058円																																																											
分配準備積立金額	D	615,399,745円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,412,137,470円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,743,879,044口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,771円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	- 円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	168,853,766円																																																											
収益調整金額	C	887,424,472円																																																											
分配準備積立金額	D	608,570,543円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,664,848,781円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,966,215,796口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,197円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円																																																											

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第14期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (2021年 8月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第13期	第14期
	自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,495,659,380円	3,743,879,044円
期中追加設定元本額	419,462,284円	475,701,731円
期中一部解約元本額	171,242,620円	253,364,979円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第13期 (2020年 8月28日現在)	第14期 (2021年 8月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	47,607,391	138,231,316
合計	47,607,391	138,231,316

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	222,968,562	420,050,473	
	外国株式インデックス マザーファンド	52,297,886	208,370,467	
	国内債券インデックス マザーファンド	883,338,967	1,250,101,306	
	外国債券インデックス マザーファンド	33,847,224	104,212,217	
	短期金融資産 マザーファンド	3,037,129,127	3,073,574,676	
合計		4,229,581,766	5,056,309,139	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2035】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2020年8月29日から2021年8月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2020年 8月28日現在)	第14期 (2021年 8月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	135,988,987	183,335,668
親投資信託受益証券	4,094,365,459	5,178,398,909
未収入金	80,000	-
流動資産合計	4,230,434,446	5,361,734,577
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	536,941	110
未払受託者報酬	862,391	1,099,370
未払委託者報酬	8,408,240	10,718,756
未払利息	264	317
その他未払費用	215,233	259,916
流動負債合計	10,023,069	12,078,469
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,110,899,178	3,577,112,275
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,109,512,199	1,772,543,833
(分配準備積立金)	788,965,493	1,206,937,583
元本等合計	4,220,411,377	5,349,656,108
純資産合計	4,220,411,377	5,349,656,108
負債純資産合計	4,230,434,446	5,361,734,577

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	2019年 8月29日	自	2020年 8月29日
	至	2020年 8月28日	至	2021年 8月30日
営業収益				
受取利息		450		532
有価証券売買等損益		198,452,256		472,473,450
営業収益合計		198,452,706		472,473,982
営業費用				
支払利息		55,777		55,203
受託者報酬		1,722,821		2,080,334
委託者報酬		16,797,369		20,283,121
その他費用		215,292		259,916
営業費用合計		18,791,259		22,678,574
営業利益又は営業損失（ ）		179,661,447		449,795,408
経常利益又は経常損失（ ）		179,661,447		449,795,408
当期純利益又は当期純損失（ ）		179,661,447		449,795,408
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（ ）		1,106,484		7,535,610
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		829,366,447		1,109,512,199
剰余金増加額又は欠損金減少額		131,543,929		257,504,165
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		131,543,929		257,504,165
剰余金減少額又は欠損金増加額		29,953,140		36,732,329
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		29,953,140		36,732,329
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,109,512,199		1,772,543,833

## (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8月29日から翌年8月28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14期計算期間は2020年 8月29日から2021年 8月30日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第13期 (2020年 8月28日現在)	第14期 (2021年 8月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,110,899,178口	3,577,112,275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) 1.3567円 (13,567円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4955円 (14,955円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	第14期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日																																																												
<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>- 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>125,735,707円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>939,188,401円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>663,229,786円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,728,153,894円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,110,899,178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>5,555円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	125,735,707円	収益調整金額	C	939,188,401円	分配準備積立金額	D	663,229,786円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,728,153,894円	当ファンドの期末残存口数	F	3,110,899,178口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,555円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円	<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>- 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>442,261,033円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,222,457,858円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>764,676,550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>2,429,395,441円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,577,112,275口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>6,791円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	442,261,033円	収益調整金額	C	1,222,457,858円	分配準備積立金額	D	764,676,550円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,429,395,441円	当ファンドの期末残存口数	F	3,577,112,275口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,791円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	- 円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	125,735,707円																																																											
収益調整金額	C	939,188,401円																																																											
分配準備積立金額	D	663,229,786円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,728,153,894円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,110,899,178口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,555円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	- 円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	442,261,033円																																																											
収益調整金額	C	1,222,457,858円																																																											
分配準備積立金額	D	764,676,550円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,429,395,441円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,577,112,275口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,791円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円																																																											

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第14期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (2021年 8月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第13期	第14期
	自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,812,666,688円	3,110,899,178円
期中追加設定元本額	398,934,497円	568,152,385円
期中一部解約元本額	100,702,007円	101,939,288円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第13期 (2020年 8月28日現在)	第14期 (2021年 8月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	161,177,275	403,908,611
合計	161,177,275	403,908,611

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	683,752,645	1,288,121,607	
	外国株式インデックス マザーファンド	161,519,458	643,541,976	
	国内債券インデックス マザーファンド	2,031,132,615	2,874,458,876	
	外国債券インデックス マザーファンド	86,338,817	265,828,583	
	短期金融資産 マザーファンド	105,185,640	106,447,867	
	合計	3,067,929,175	5,178,398,909	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2045】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2020年8月29日から2021年8月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2020年 8月28日現在)	第14期 (2021年 8月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	66,443,904	92,588,882
親投資信託受益証券	2,008,849,464	2,613,100,016
未収入金	530,000	-
流動資産合計	2,075,823,368	2,705,688,898
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	671,061	101,787
未払受託者報酬	414,798	557,329
未払委託者報酬	4,044,155	5,433,872
未払利息	129	160
その他未払費用	103,921	130,416
流動負債合計	5,234,064	6,223,564
負債合計	5,234,064	6,223,564
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,507,175,909	1,719,188,989
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	563,413,395	980,276,345
(分配準備積立金)	343,292,214	613,377,043
元本等合計	2,070,589,304	2,699,465,334
純資産合計	2,070,589,304	2,699,465,334
負債純資産合計	2,075,823,368	2,705,688,898

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	自	2020年 8月29日 至 2021年 8月30日
営業収益				
受取利息		217		264
有価証券売買等損益		142,190,443		320,070,552
営業収益合計		142,190,660		320,070,816
営業費用				
支払利息		26,867		27,433
受託者報酬		832,396		1,044,283
委託者報酬		8,115,638		10,181,568
その他費用		103,963		130,416
営業費用合計		9,078,864		11,383,700
営業利益又は営業損失（ ）		133,111,796		308,687,116
経常利益又は経常損失（ ）		133,111,796		308,687,116
当期純利益又は当期純損失（ ）		133,111,796		308,687,116
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		2,750,871		13,442,710
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		374,732,708		563,413,395
剰余金増加額又は欠損金減少額		86,757,968		167,798,044
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		86,757,968		167,798,044
剰余金減少額又は欠損金増加額		28,438,206		46,179,500
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		28,438,206		46,179,500
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		563,413,395		980,276,345

## (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8月29日から翌年8月28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14期計算期間は2020年 8月29日から2021年 8月30日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第13期 (2020年 8月28日現在)	第14期 (2021年 8月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,507,175,909口	1,719,188,989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) 1.3738円 (13,738円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5702円 (15,702円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日			第14期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	74,612,636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	295,246,799円
収益調整金額	C	528,107,847円	収益調整金額	C	675,845,958円
分配準備積立金額	D	268,679,578円	分配準備積立金額	D	318,130,244円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	871,400,061円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,289,223,001円
当ファンドの期末残存口数	F	1,507,175,909口	当ファンドの期末残存口数	F	1,719,188,989口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,781円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,499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14期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (2021年 8月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第13期	第14期
	自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,347,169,223円	1,507,175,909円
期中追加設定元本額	260,422,137円	333,011,049円
期中一部解約元本額	100,415,451円	120,997,969円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第13期 (2020年 8月28日現在)	第14期 (2021年 8月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	120,507,218	276,234,569
合計	120,507,218	276,234,569

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	488,190,269	919,701,647	
	外国株式インデックス マザーファンド	115,320,737	459,472,412	
	国内債券インデックス マザーファンド	739,326,680	1,046,295,117	
	外国債券インデックス マザーファンド	43,515,108	133,978,666	
	短期金融資産 マザーファンド	53,015,983	53,652,174	
合計		1,439,368,777	2,613,100,016	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2055】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2020年8月29日から2021年8月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2020年 8月28日現在)	第4期 (2021年 8月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	562,107	2,637,366
親投資信託受益証券	17,416,189	78,976,686
流動資産合計	17,978,296	81,614,052
資産合計	17,978,296	81,614,052
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	2,553	10,051
未払委託者報酬	24,781	97,957
未払利息	1	4
その他未払費用	267	1,195
流動負債合計	27,602	109,207
負債合計	27,602	109,207
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,289,618	66,346,116
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	661,076	15,158,729
(分配準備積立金)	649,366	4,795,666
元本等合計	17,950,694	81,504,845
純資産合計	17,950,694	81,504,845
負債純資産合計	17,978,296	81,614,052

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	2019年 8月29日	自	2020年 8月29日
	至	2020年 8月28日	至	2021年 8月30日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		797,984		4,591,081
営業収益合計		797,984		4,591,082
営業費用				
支払利息		42		290
受託者報酬		4,166		14,638
委託者報酬		40,509		142,499
その他費用		402		1,711
営業費用合計		45,119		159,138
営業利益又は営業損失（ ）		752,865		4,431,944
経常利益又は経常損失（ ）		752,865		4,431,944
当期純利益又は当期純損失（ ）		752,865		4,431,944
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（ ）		24,833		215,862
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		252,607		661,076
剰余金増加額又は欠損金減少額		185,651		10,452,096
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		50,192		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		135,459		10,452,096
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		170,525
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		170,525
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		661,076		15,158,729

## (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8月29日から翌年8月28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4期計算期間は2020年 8月29日から2021年 8月30日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第3期 (2020年 8月28日現在)	第4期 (2021年 8月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,289,618口	66,346,116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) 1.0382円 (10,382円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2285円 (12,285円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日			第4期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30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	148,752円	費用控除後の配当等収益額	A	456,470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	475,124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	3,759,612円
収益調整金額	C	347,217円	収益調整金額	C	10,363,063円
分配準備積立金額	D	25,490円	分配準備積立金額	D	579,584円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	996,583円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,158,729円
当ファンドの期末残存口数	F	17,289,618口	当ファンドの期末残存口数	F	66,346,116口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	576円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,284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4期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第4期 (2021年 8月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第3期	第4期
	自 2019年 8月29日 至 2020年 8月28日	自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,403,585円	17,289,618円
期中追加設定元本額	17,683,699円	51,620,729円
期中一部解約元本額	4,797,666円	2,564,231円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第3期 (2020年 8月28日現在)	第4期 (2021年 8月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	724,948	4,101,942
合計	724,948	4,101,942

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	19,072,130	35,929,985	
	外国株式インデックス マザーファンド	4,504,088	17,945,637	
	国内債券インデックス マザーファンド	13,734,474	19,437,027	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,313,629	4,044,532	
	短期金融資産 マザーファンド	1,600,302	1,619,505	
合計		40,224,623	78,976,686	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 8月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,009,108,969
国債証券	555,820,158,800
地方債証券	36,356,155,256
特殊債証券	40,369,357,533
社債証券	30,043,443,180
未収入金	109,340
未収利息	1,446,705,772
前払費用	60,351,574
流動資産合計	667,105,390,424
資産合計	667,105,390,424
負債の部	
流動負債	
未払金	3,496,581,200
未払解約金	62,435,014
未払利息	5,203

	2021年 8月30日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	3,559,021,417
負債合計	3,559,021,417
純資産の部	
元本等	
元本	468,883,493,377
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	194,662,875,630
元本等合計	663,546,369,007
純資産合計	663,546,369,007
負債純資産合計	667,105,390,424

## 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30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>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 8月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	468,883,493,377口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 101,419,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4152円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,152円)</p>

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

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 8月30日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月30日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

	2021年 8月30日現在

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 8月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	393,683,774,509円
期中追加設定元本額	94,794,859,397円
期中一部解約元本額	19,595,140,529円
期末元本額	468,883,493,377円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,784,714,042円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,629,697円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,832,206,860円
世界経済インデックスファンド	2,786,545,798円
D Cマイセレクション25	24,598,457,539円
D Cマイセレクション50	27,884,756,319円
D Cマイセレクション75	8,130,591,391円
D C日本債券インデックス・オープン	437,310,799円
D C日本債券インデックス・オープンS	93,053,856,385円
D C日本債券インデックス・オープンP	68,937,366,274円
D CマイセレクションS25	11,673,646,896円
D CマイセレクションS50	12,950,937,403円
D CマイセレクションS75	2,725,816,637円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	883,338,967円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	2,031,132,615円

区分	2021年 8月30日現在
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	739,326,680円
D C世界経済インデックスファンド	3,045,617,185円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	11,159,089円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,651,160円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	39,159,984円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	9,005,829円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,015,770円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	117,647,996円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	191,294,482円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	38,523,386円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	33,236,247円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,340,071,990円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	803,424,933円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,398,283,520円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	230,935,832円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	84,732,368円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,086,371,369円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,225,897,079円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,528,854,801円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	145,433,924円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,980,597,781円
日本債券ファンド・シリーズ1	13,843,812,552円
分散投資コア戦略ファンドA	31,812,321,476円
分散投資コア戦略ファンドS	39,976,595,052円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	135,672,518円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,262,181,903円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	58,072,328円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	34,099,054円
SMT インデックスバランス・オープン	58,033,956円
SMT 世界経済インデックス・オープン	26,246,925円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	48,261,985円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	77,763,323円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,206,325円
グローバル経済コア	195,794,487円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	23,032,770円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	13,734,474円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	6,888,759円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	3,421,402円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,019,344円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	561,871円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	78,465,994,690円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	52,913,575円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	7,068円

区分	2021年 8月30日現在
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	81,273円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 8月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,790,338,300
地方債証券	65,501,145
特殊債券	59,135,918
社債券	68,652,020
合計	1,983,627,383

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第4 1 6 回利付国債（2年）	4,530,000,000	4,540,872,000	
	第4 1 7 回利付国債（2年）	3,240,000,000	3,248,618,400	
	第4 1 8 回利付国債（2年）	1,040,000,000	1,042,984,800	
	第4 1 9 回利付国債（2年）	570,000,000	571,749,900	
	第4 2 0 回利付国債（2年）	1,250,000,000	1,254,100,000	
	第4 2 1 回利付国債（2年）	590,000,000	592,059,100	
	第4 2 2 回利付国債（2年）	130,000,000	130,477,100	
	第4 2 3 回利付国債（2年）	410,000,000	410,975,800	
	第4 2 4 回利付国債（2年）	570,000,000	571,379,400	
	第4 2 5 回利付国債（2年）	2,870,000,000	2,877,289,800	

第426回利付国債(2年)	620,000,000	621,649,200	
第427回利付国債(2年)	3,940,000,000	3,950,598,600	
第133回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,390,599,600	
第134回利付国債(5年)	5,700,000,000	5,717,499,000	
第135回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,095,177,600	
第136回利付国債(5年)	4,400,000,000	4,418,656,000	
第137回利付国債(5年)	6,760,000,000	6,792,718,400	
第138回利付国債(5年)	6,880,000,000	6,917,358,400	
第139回利付国債(5年)	5,690,000,000	5,724,196,900	
第140回利付国債(5年)	6,300,000,000	6,341,643,000	
第141回利付国債(5年)	7,750,000,000	7,804,637,500	
第142回利付国債(5年)	5,380,000,000	5,421,049,400	
第143回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,839,360,000	
第144回利付国債(5年)	6,310,000,000	6,365,401,800	
第145回利付国債(5年)	8,240,000,000	8,317,208,800	
第146回利付国債(5年)	2,590,000,000	2,615,770,500	
第147回利付国債(5年)	5,450,000,000	5,482,373,000	
第148回利付国債(5年)	4,340,000,000	4,366,170,200	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	581,544,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,593,232,200	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	778,734,000	
第4回利付国債(40年)	1,200,000,000	1,703,292,000	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,466,210,300	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,701,302,400	
第7回利付国債(40年)	1,040,000,000	1,351,532,000	
第8回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,496,454,900	
第9回利付国債(40年)	1,720,000,000	1,569,878,400	
第10回利付国債(40年)	2,370,000,000	2,526,491,100	
第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,850,161,900	
第12回利付国債(40年)	1,710,000,000	1,596,438,900	
第13回利付国債(40年)	2,040,000,000	1,895,976,000	
第14回利付国債(40年)	640,000,000	635,078,400	
第325回利付国債(10年)	4,590,000,000	4,635,073,800	
第326回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,153,820,800	
第327回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,228,726,600	
第328回利付国債(10年)	4,750,000,000	4,804,245,000	
第329回利付国債(10年)	3,810,000,000	3,874,008,000	
第330回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,936,404,000	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	913,536,000	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,880,976,000	
第333回利付国債(10年)	3,030,000,000	3,086,600,400	
第334回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,960,456,200	

第335回利付国債(10年)	2,370,000,000	2,415,788,400	
第336回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,071,945,000	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,839,928,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,646,184,000	
第339回利付国債(10年)	4,750,000,000	4,846,187,500	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,456,512,000	
第341回利付国債(10年)	3,440,000,000	3,504,018,400	
第342回利付国債(10年)	5,220,000,000	5,273,713,800	
第343回利付国債(10年)	4,820,000,000	4,872,393,400	
第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	6,714,235,200	
第345回利付国債(10年)	3,740,000,000	3,783,907,600	
第346回利付国債(10年)	6,350,000,000	6,428,041,500	
第347回利付国債(10年)	3,880,000,000	3,929,858,000	
第348回利付国債(10年)	5,090,000,000	5,158,256,900	
第349回利付国債(10年)	4,130,000,000	4,187,696,100	
第350回利付国債(10年)	7,830,000,000	7,941,107,700	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,610,000,000	4,677,951,400	
第352回利付国債(10年)	5,010,000,000	5,084,799,300	
第353回利付国債(10年)	4,430,000,000	4,496,804,400	
第354回利付国債(10年)	5,090,000,000	5,167,418,900	
第355回利付国債(10年)	5,150,000,000	5,226,889,500	
第356回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,322,153,400	
第357回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,839,732,000	
第358回利付国債(10年)	3,790,000,000	3,842,112,500	
第359回利付国債(10年)	4,030,000,000	4,083,437,800	
第360回利付国債(10年)	5,740,000,000	5,807,732,000	
第361回利付国債(10年)	4,920,000,000	4,972,693,200	
第362回利付国債(10年)	4,850,000,000	4,896,317,500	
第363回利付国債(10年)	2,390,000,000	2,409,884,800	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	135,517,800	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	193,606,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	144,754,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	139,739,600	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	60,660,000	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	434,528,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	223,174,800	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	417,448,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	275,644,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	178,574,400	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	308,885,200	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	235,261,800	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	491,776,000	

第14回利付国債(30年)	800,000,000	1,026,160,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	442,030,600
第16回利付国債(30年)	200,000,000	260,846,000
第17回利付国債(30年)	950,000,000	1,231,219,000
第18回利付国債(30年)	345,000,000	443,804,550
第19回利付国債(30年)	530,000,000	683,625,800
第20回利付国債(30年)	480,000,000	634,387,200
第21回利付国債(30年)	500,000,000	648,720,000
第22回利付国債(30年)	420,000,000	558,558,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	573,422,200
第24回利付国債(30年)	380,000,000	508,101,800
第25回利付国債(30年)	350,000,000	458,801,000
第26回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,514,809,200
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,594,803,200
第28回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,907,553,800
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,251,777,900
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,366,118,300
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,456,708,000
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,102,724,000
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,362,760,400
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,404,833,300
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	3,002,719,000
第36回利付国債(30年)	2,310,000,000	3,026,215,500
第37回利付国債(30年)	2,160,000,000	2,797,329,600
第38回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,918,545,000
第39回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,953,165,000
第40回利付国債(30年)	1,620,000,000	2,077,536,600
第41回利付国債(30年)	990,000,000	1,250,973,900
第42回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,897,455,000
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,760,240,400
第44回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,546,606,200
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,764,489,600
第46回利付国債(30年)	1,850,000,000	2,268,451,500
第47回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,847,913,200
第48回利付国債(30年)	1,860,000,000	2,241,095,400
第49回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,735,891,200
第50回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,909,500,400
第51回利付国債(30年)	1,760,000,000	1,671,260,800
第52回利付国債(30年)	1,910,000,000	1,899,418,600
第53回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,077,755,000
第54回利付国債(30年)	2,110,000,000	2,243,246,500
第55回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,636,234,600
第56回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,781,791,200

第57回利付国債（30年）	1,610,000,000	1,706,406,800	
第58回利付国債（30年）	2,600,000,000	2,753,764,000	
第59回利付国債（30年）	1,050,000,000	1,084,251,000	
第60回利付国債（30年）	2,540,000,000	2,746,121,000	
第61回利付国債（30年）	1,630,000,000	1,678,068,700	
第62回利付国債（30年）	120,000,000	117,301,200	
第63回利付国債（30年）	1,160,000,000	1,102,092,800	
第64回利付国債（30年）	2,510,000,000	2,378,024,200	
第65回利付国債（30年）	1,010,000,000	955,338,800	
第66回利付国債（30年）	1,030,000,000	972,670,200	
第67回利付国債（30年）	1,500,000,000	1,490,835,000	
第68回利付国債（30年）	1,640,000,000	1,627,913,200	
第69回利付国債（30年）	930,000,000	946,098,300	
第70回利付国債（30年）	1,770,000,000	1,798,620,900	
第71回利付国債（30年）	930,000,000	942,778,200	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	306,432,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	204,780,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	356,993,000	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	244,231,200	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	325,376,000	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	206,974,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	333,382,400	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	230,293,800	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	344,678,400	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	136,735,300	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	201,303,100	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	412,202,700	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	428,464,000	
第71回利付国債（20年）	200,000,000	213,108,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	672,978,600	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	385,380,000	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	214,764,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	140,315,500	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	289,499,400	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	311,976,200	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	183,152,900	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	291,921,300	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	238,702,200	
第81回利付国債（20年）	390,000,000	423,774,000	
第82回利付国債（20年）	600,000,000	654,402,000	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	317,921,200	
第84回利付国債（20年）	470,000,000	513,216,500	

第85回利付国債(20年)	290,000,000	319,530,700
第86回利付国債(20年)	510,000,000	566,599,800
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	2,024,712,000
第88回利付国債(20年)	420,000,000	469,098,000
第89回利付国債(20年)	350,000,000	389,221,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	704,151,000
第91回利付国債(20年)	450,000,000	505,251,000
第92回利付国債(20年)	880,000,000	984,016,000
第93回利付国債(20年)	410,000,000	458,441,500
第94回利付国債(20年)	610,000,000	685,475,300
第95回利付国債(20年)	610,000,000	696,052,700
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,795,730,100
第97回利付国債(20年)	400,000,000	456,460,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	499,422,000
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,471,438,500
第100回利付国債(20年)	480,000,000	553,156,800
第101回利付国債(20年)	715,000,000	833,411,150
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,476,757,800
第103回利付国債(20年)	400,000,000	466,072,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	184,235,200
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,364,917,800
第106回利付国債(20年)	380,000,000	442,251,600
第107回利付国債(20年)	260,000,000	302,086,200
第108回利付国債(20年)	660,000,000	757,119,000
第109回利付国債(20年)	520,000,000	598,894,400
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,283,623,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,144,095,600
第112回利付国債(20年)	790,000,000	925,579,800
第113回利付国債(20年)	1,520,000,000	1,787,900,000
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,752,312,500
第115回利付国債(20年)	700,000,000	832,720,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,779,417,600
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,280,491,200
第118回利付国債(20年)	660,000,000	779,625,000
第119回利付国債(20年)	530,000,000	616,692,100
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,799,031,600
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,762,845,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,096,181,000
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,238,483,500
第124回利付国債(20年)	610,000,000	724,515,300
第125回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,202,400,200
第126回利付国債(20年)	730,000,000	869,437,300
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,205,089,200

第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,148,974,700	
第129回利付国債(20年)	890,000,000	1,045,500,800	
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,513,755,700	
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,167,990,000	
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,358,290,400	
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,452,888,300	
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,338,236,400	
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,208,993,400	
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,686,756,000	
第137回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,282,548,500	
第138回利付国債(20年)	620,000,000	716,205,400	
第139回利付国債(20年)	730,000,000	851,114,300	
第140回利付国債(20年)	2,520,000,000	2,972,214,000	
第141回利付国債(20年)	1,540,000,000	1,820,495,600	
第142回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,217,217,000	
第143回利付国債(20年)	1,800,000,000	2,111,922,000	
第144回利付国債(20年)	1,420,000,000	1,649,827,000	
第145回利付国債(20年)	2,995,000,000	3,558,119,900	
第146回利付国債(20年)	2,890,000,000	3,440,747,300	
第147回利付国債(20年)	2,490,000,000	2,940,391,200	
第148回利付国債(20年)	2,230,000,000	2,610,482,600	
第149回利付国債(20年)	2,930,000,000	3,437,651,800	
第150回利付国債(20年)	3,260,000,000	3,789,032,800	
第151回利付国債(20年)	2,175,000,000	2,474,497,500	
第152回利付国債(20年)	3,290,000,000	3,746,290,100	
第153回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,919,493,500	
第154回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,967,588,000	
第155回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,187,012,400	
第156回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,673,502,000	
第157回利付国債(20年)	3,080,000,000	3,075,564,800	
第158回利付国債(20年)	2,930,000,000	3,051,770,800	
第159回利付国債(20年)	2,930,000,000	3,092,527,100	
第160回利付国債(20年)	2,460,000,000	2,631,609,600	
第161回利付国債(20年)	2,190,000,000	2,308,260,000	
第162回利付国債(20年)	620,000,000	652,990,200	
第163回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,746,633,500	
第164回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,719,112,600	
第165回利付国債(20年)	2,180,000,000	2,255,144,600	
第166回利付国債(20年)	900,000,000	959,958,000	
第167回利付国債(20年)	2,690,000,000	2,776,214,500	
第168回利付国債(20年)	2,430,000,000	2,462,294,700	
第169回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,680,045,900	

	第170回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,341,946,000
	第171回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,277,796,600
	第172回利付国債(20年)	2,760,000,000	2,779,182,000
	第173回利付国債(20年)	3,110,000,000	3,126,389,700
	第174回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,488,804,000
	第175回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,592,229,600
	第176回利付国債(20年)	2,810,000,000	2,866,143,800
	第177回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,160,000,000
	国債証券合計	519,400,000,000	555,820,158,800
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,751,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,126,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	133,287,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	131,930,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	128,072,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,418,000
	第16回東京都公募公債(20年)	300,000,000	342,924,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,891,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,214,000
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	100,603,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,294,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	233,882,000
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	200,094,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	100,999,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	100,971,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	101,562,000
	第726回東京都公募公債	200,000,000	203,346,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	101,487,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,593,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	101,025,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,897,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	302,646,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	200,412,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,183,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,966,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,372,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,178,000
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	202,042,000
	第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	101,454,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	272,708,000
	第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,992,000
	第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	234,308,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,785,000

第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,035,000	
第78回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	200,000,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	202,946,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,878,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,842,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,942,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,897,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	200,330,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	234,302,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	233,904,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	117,026,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,943,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,647,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,558,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,645,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	153,378,250	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,093,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,074,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,616,200	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,960,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	500,000,000	505,030,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,071,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	117,123,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	116,780,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	101,634,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,101,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	100,531,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	104,626,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	141,095,720	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,089,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	114,124,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	102,011,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	400,000,000	436,156,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,842,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,942,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	471,848,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	101,603,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,604,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	103,443,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	302,385,000	

第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	121,605,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	104,491,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	117,033,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	115,887,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,049,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,846,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,955,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,071,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,115,000	
平成29年度第14回静岡県公募公債(5年)	100,000,000	100,054,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	313,723,100	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	117,381,000	
平成24年度第18回愛知県公募公債(10年)	150,000,000	151,788,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,999,000	
平成25年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,945,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,759,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,592,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,677,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,338,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,324,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	312,750,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,029,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	103,372,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,588,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,753,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	200,866,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	116,149,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	233,402,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,003,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,492,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,752,132	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,858,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	113,869,000	

第5回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	115,151,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	231,172,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	108,178,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	234,942,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	202,446,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	234,308,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	201,076,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,193,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,670,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,029,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,355,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,282,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,957,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,547,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	100,424,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,063,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,600,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	107,052,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	118,379,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	107,733,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	132,362,000	
平成25年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	101,680,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	113,328,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,004,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	103,372,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,546,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	302,631,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	100,531,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	100,272,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	231,172,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	116,858,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	117,033,000	
平成24年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	100,996,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	101,659,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	101,613,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,492,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,047,000	

平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,354,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	121,069,200	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	300,633,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,767,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	303,006,000	
平成30年度第3回茨城県公募公債	100,000,000	100,049,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	232,252,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,076,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,985,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,876,000	
第119回共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,728,000	
第121回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,934,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,238,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,454,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,465,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,634,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,627,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,043,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	114,047,360	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,844,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,758,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,673,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,236,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,952,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,112,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,101,116	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,100,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,456,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,371,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,674,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,488,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	401,196,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,183,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,891,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,261,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,862,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,652,328	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,136,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,985,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	201,840,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,182,000	

第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	235,416,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	302,634,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	105,068,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,845,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	201,348,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	130,393,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	135,270,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	114,745,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	126,486,000	
第481回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	100,966,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,112,000	
第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	302,496,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	100,910,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	101,207,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,784,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	134,742,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	231,590,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	118,243,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	117,339,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	99,495,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	108,254,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	349,689,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,862,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	101,269,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,091,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	203,468,000	
第30回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	229,692,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	302,490,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,626,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	108,054,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,038,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,403,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	116,117,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,768,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	100,405,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,462,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,064,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,346,000	

	平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	116,711,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	116,019,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	203,374,000	
	平成30年度第5回福岡市公募公債(5年)	200,000,000	200,098,000	
	平成30年度第9回福岡市公募公債(10年)	100,000,000	101,742,000	
	平成30年度第10回福岡市公募公債(5年)	200,000,000	200,068,000	
	平成30年度第11回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,038,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	152,478,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,497,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,836,850	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,201,500	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	552,788,500	
	令和2年度第3回広島市公募公債(5年)	200,000,000	200,168,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	200,422,000	
	平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,843,000	
	平成24年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	101,056,000	
	平成24年度第2回岡山県公募公債(10年)	150,000,000	151,599,000	
	平成24年度第1回岡山市公募公債(10年)	200,000,000	202,386,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債(10年)	200,000,000	202,236,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	114,080,000	
	地方債証券合計	34,529,430,000	36,356,155,256	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	103,668,720	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	414,309,100	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	311,979,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,396,000	
	第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,955,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	95,637,000	
	第14回道路債券	100,000,000	102,483,000	
	第17回道路債券	100,000,000	101,998,000	
	第21回道路債券	100,000,000	129,476,000	
	第27回道路債券	400,000,000	424,500,000	
	第28回道路債券	200,000,000	262,716,000	
	第33回道路債券	200,000,000	266,820,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,111,000	

第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	151,982,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,912,000	
第42回道路債券	100,000,000	107,836,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,686,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	144,133,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	233,362,000	
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,718,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,254,000	
第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,038,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	909,855,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,597,000	
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	131,972,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,548,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,476,000	
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,729,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,035,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,967,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,505,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,755,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,622,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,982,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,881,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,206,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,729,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,110,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	624,072,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	302,000,000	304,784,440	

第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	634,813,800	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,288,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	150,452,360	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,506,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	269,776,368	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,204,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,122,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	422,000,000	429,583,340	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,650,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,576,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	103,805,400	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,807,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,738,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	230,368,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,691,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,533,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,255,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,249,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,114,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,830,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,647,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,569,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,971,110	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	317,260,840	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	206,164,400	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,753,000	
	200,000,000	201,470,000	

第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,893,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	121,480,800	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,888,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,299,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	217,047,360	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,882,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,763,000	
第2回公営企業債券(30年)	300,000,000	378,480,000	
第3回公営企業債券(20年)	210,000,000	213,339,000	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	100,000,000	108,110,000	
第5回公営企業債券(30年)	300,000,000	395,004,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,575,000	
第7回公営企業債券(30年)	200,000,000	264,602,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	42,281,200	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	130,391,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	234,304,000	
第10回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	229,754,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	200,000,000	196,060,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	234,602,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,656,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,986,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,362,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,202,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,218,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,110,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,912,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,059,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,663,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,544,550	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,232,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,625,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,850,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,878,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,598,000	

第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,614,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,990,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,530,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,626,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,090,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,151,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,396,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,565,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,834,810	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,530,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,889,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,880,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,349,700	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,872,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,179,320	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,416,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,589,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,850,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,208,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,310,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,732,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,993,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	107,599,000	
第22回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,952,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	116,922,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	119,565,000	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	202,468,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,113,400	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,892,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	211,081,500	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,488,970	
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,902,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	212,976,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	170,450,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	93,343,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	200,018,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	107,230,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	102,429,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,398,800	
第59回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,987,000	

第6 2回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	100,786,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,253,000	11,465,906	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,650,000	11,905,834	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,922,000	12,226,726	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	160,887,000	160,920,786	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	114,772,000	114,875,294	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,681,000	11,950,831	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,651,000	13,021,168	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	208,062,000	207,727,020	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,101,000	10,119,787	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	21,088,000	21,311,321	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,530,000	12,889,109	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	227,454,000	226,878,541	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	81,134,000	81,159,962	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,140,000	11,336,843	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,031,000	13,453,465	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	264,819,000	264,940,816	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,199,000	11,398,454	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	182,664,000	182,864,930	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,148,000	13,590,035	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,971,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,282,000	18,301,983	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,551,000	18,660,574	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,374,000	20,699,375	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,287,000	22,661,927	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,541,000	25,199,934	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,067,000	25,717,514	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,304,000	54,720,846	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,439,000	11,631,861	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,289,000	24,606,691	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,563,000	11,790,791	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,281,000	11,516,885	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,156,000	25,523,954	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,571,000	10,685,061	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,990,000	25,404,690	

第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,802,000	24,061,354	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,499,000	12,937,464	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,754,000	51,136,607	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,191,000	27,537,479	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,215,000	12,578,518	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,687,000	38,743,673	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,672,000	36,554,342	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,786,000	36,711,752	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,238,000	80,313,683	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,770,000	87,720,593	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,846,000	44,822,485	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,182,000	45,539,737	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,363,000	45,780,920	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,730,000	39,664,417	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,374,000	39,016,961	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,984,000	45,415,175	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	178,141,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,162,000	119,166,862	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,744,000	160,510,273	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,759,000	45,621,820	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,071,000	47,029,334	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,919,000	47,787,444	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,244,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,734,000	151,650,800	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,761,000	51,581,257	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,116,000	107,265,509	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,380,000	60,347,406	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,922,000	63,849,631	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,591,000	63,813,819	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,758,000	198,430,286	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	128,198,000	133,216,951	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,140,000	64,444,151	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,311,000	69,873,529	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,385,000	73,952,999	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,778,000	79,555,538	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,552,000	79,163,920	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,841,000	79,813,109	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,252,000	80,577,885	

第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,021,000	81,242,120	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,487,000	82,715,823	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,189,000	83,525,393	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,086,000	83,201,548	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,314,000	83,429,354	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,822,000	83,993,931	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,444,000	169,461,700	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,959,000	84,075,628	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,846,000	171,542,470	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,251,000	85,397,656	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,518,000	170,558,752	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,173,000	86,347,535	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,556,000	173,539,187	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,596,000	174,577,402	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	130,710,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,420,000	88,931,491	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,162,000	88,852,071	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,210,000	88,195,473	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,928,000	180,221,649	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,497,000	90,064,410	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,313,000	90,008,748	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,436,000	181,607,029	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,186,000	91,134,935	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	275,526,000	274,029,893	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,658,000	183,625,761	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,653,000	94,477,146	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,475,000	95,011,618	

第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,222,000	195,345,509	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,355,000	98,269,163	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,278,000	197,086,274	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,892,000	197,367,066	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,108,000	99,093,004	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,654,000	199,444,520	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,094,000	200,710,821	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,436,000	100,658,068	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,542,000	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,602,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,943,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,559,000	
第60回日本学生支援債券	200,000,000	199,982,000	
第62回日本学生支援債券	100,000,000	99,986,000	
第64回日本学生支援債券	300,000,000	299,883,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	107,705,000	
い第823号商工債	200,000,000	200,604,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,506,000	
い第832号商工債	200,000,000	200,060,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,999,000	
い第843号商工債	200,000,000	200,518,000	
い第847号商工債	100,000,000	100,154,000	
第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,118,000	
第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,119,000	
第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,252,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,147,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,120,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,866,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	100,091,000	
第236号商工債（3年）	300,000,000	299,970,000	
第254号商工債（3年）	300,000,000	300,075,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,994,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	117,848,000	
第48回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,540,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,286,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,750,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	503,730,000	

	第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,032,000	
	第60回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,778,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,367,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,223,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	201,038,000	
	第141回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,974,000	
	特殊債券合計	38,751,913,000	40,369,357,533	
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	100,319,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	299,706,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	100,240,000	
	第2回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,584,000	
	第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,326,000	
	第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,235,000	
	第17回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,986,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,169,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	400,284,000	
	第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,909,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,860,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,644,000	
	第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,564,000	
	第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	100,032,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	300,483,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,671,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,403,000	
	第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,748,000	
	第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,467,000	
	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	199,804,000	
	第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,801,000	
	第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,800,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,214,000	

第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,874,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,969,000	
第10回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	100,492,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,775,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,866,000	
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	101,207,000	
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	200,000,000	200,676,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,098,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,569,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,821,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	101,033,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,185,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,644,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,782,000	
第40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	100,161,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,141,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,938,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	399,812,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,744,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,359,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	203,544,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,196,000	
第42回D I C株式会社無担保社債	100,000,000	100,069,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	99,243,000	
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,946,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,502,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,949,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,695,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,478,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,355,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,209,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,112,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,852,000	

第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,125,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	100,014,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	108,371,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,334,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	100,183,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,284,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,819,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,437,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,198,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,983,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,296,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,046,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,873,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,673,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,625,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,553,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,177,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,150,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	201,678,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	199,138,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,946,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,140,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,198,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,709,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,363,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,899,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,865,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	118,222,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	201,004,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,697,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,281,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	100,120,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	117,492,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	111,836,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,020,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	101,295,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,414,000	
	300,000,000	303,939,000	

第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)			
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,322,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,342,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,035,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,676,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,664,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	99,830,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,209,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,768,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,339,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,253,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,332,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,838,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,949,000	
第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,992,000	
第16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	99,976,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,301,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,042,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,097,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,306,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,081,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,894,000	
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	200,482,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,167,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	202,200,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,638,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,677,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,526,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,252,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,478,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	201,144,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,123,000	

第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,385,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,082,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,087,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,143,000	
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	101,818,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,156,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,785,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,743,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,431,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,658,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,407,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,216,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,313,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,853,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,281,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,889,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	232,662,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,828,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,302,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,658,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,197,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,609,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,351,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,893,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,052,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,074,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,224,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	500,940,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,101,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	131,319,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,137,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,609,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,611,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,079,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	92,051,000	

第53回阪急阪神ホールディングス株式会社 無担保社債	200,000,000	195,516,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,936,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,108,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,578,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,959,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	400,260,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,792,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,214,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,462,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,313,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,247,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,508,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,696,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,405,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,891,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,231,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,691,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,442,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,647,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,172,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,549,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	202,206,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,079,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,529,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,357,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	202,054,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	129,204,180	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,734,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,293,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,920,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,984,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,141,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,885,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,730,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,238,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,047,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,964,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,109,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,559,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,016,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,493,000	

第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,906,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,879,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,563,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,477,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	107,329,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,098,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,939,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,543,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,881,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	207,242,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	400,000,000	405,672,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,442,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	305,577,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,595,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,683,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,686,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	301,413,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	201,694,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	201,346,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	101,082,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,460,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,587,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	203,006,000	
社債券合計	29,626,000,000	30,043,443,180	
合計		662,589,114,769	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 8月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,129,123,025
株式	471,975,714,930
派生商品評価勘定	57,706,700
未収入金	30,643,202
未収配当金	591,021,614
差入委託証拠金	195,322,000
流動資産合計	476,979,531,471
資産合計	476,979,531,471
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,865,250
前受金	54,913,500
未払金	11,681,637
未払解約金	39,375,280
未払利息	7,140
流動負債合計	108,842,807
負債合計	108,842,807
純資産の部	
元本等	
元本	253,126,744,568
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	223,743,944,096
元本等合計	476,870,688,664
純資産合計	476,870,688,664
負債純資産合計	476,979,531,471

## 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30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2021年 8月30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30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	253,126,744,568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 1.8839円 (1万口当たり純資産額) (18,839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 8月30日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>

	2021年 8月30日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 8月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	217,774,818,206円
期中追加設定元本額	85,233,891,371円
期中一部解約元本額	49,881,965,009円
期末元本額	253,126,744,568円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	420,455,572円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,898,621,112円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,243,264円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,781,096,530円
世界経済インデックスファンド	3,027,030,056円
日本株式インデックス・オープン	3,465,877,428円
DCマイセレクション25	6,135,670,494円
DCマイセレクション50	18,175,045,249円
DCマイセレクション75	17,963,416,731円
DC日本株式インデックス・オープン	5,904,227,504円
DCマイセレクションS25	2,997,278,412円
DCマイセレクションS50	8,609,640,631円
DCマイセレクションS75	6,158,188,965円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,780,402,423円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	222,968,562円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	683,752,645円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	488,190,269円
DC世界経済インデックスファンド	3,319,403,342円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,558,001,493円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	6,195,294円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	26,076,117円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	20,457,639円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	190,852,112円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,358,345円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	45,665,967円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	170,578,558円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	30,528,034円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	90,337,559円

区分	2021年 8月30日現在
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,112,900,803円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	473,103,610円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,015,511,473円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	145,932,062円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	29,298,087円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	547,051,957円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	308,709,283円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	394,848,672円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	41,442,132円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	646,230,734円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,641,067,065円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,952,370,953円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,492,806,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,088,522,067円
分散投資コア戦略ファンドA	1,412,057,804円
分散投資コア戦略ファンドS	6,014,239,060円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	422,075,921円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	395,658,804円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,064,349,975円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	210,051,770円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,491,519円
SMT インデックスバランス・オープン	59,929,947円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	26,408,539,689円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	592,505,570円
SMT 世界経済インデックス・オープン	37,161,766円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	129,022,977円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	23,645,935円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,477,336円
グローバル経済コア	236,682,910円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	23,347,156円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	64,047,097円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	19,072,130円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,211,188,493円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	150,802,682円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	4,317,173円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	3,297,620円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,519,732円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,397,939円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,981,073,534円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,155,384,771円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	205,044,462円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	31,738,413円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	541,022,593円

区分	2021年 8月30日現在
SMTAM日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	46,635,177,391円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	8,021円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	58,821円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 8月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	6,537,666,201	
合計	6,537,666,201	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2021年 8月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,808,836,500	-	4,863,750,000	54,913,500
合計		4,808,836,500	-	4,863,750,000	54,913,500

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	7,800	3,050.00	23,790,000	
日本水産	222,600	609.00	135,563,400	
マルハニチロ	37,500	2,551.00	95,662,500	
雪国まいたけ	19,700	1,601.00	31,539,700	

カネコ種苗	7,300	1,502.00	10,964,600
サカタのタネ	28,600	3,635.00	103,961,000
ホクト	20,100	1,987.00	39,938,700
ホクリヨウ	3,700	754.00	2,789,800
住石ホールディングス	42,000	134.00	5,628,000
日鉄鉱業	5,500	6,530.00	35,915,000
三井松島ホールディングス	10,000	1,312.00	13,120,000
I N P E X	961,900	764.00	734,891,600
石油資源開発	31,300	1,890.00	59,157,000
K & O エナジーグループ	11,600	1,354.00	15,706,400
ヒノキヤグループ	5,200	2,334.00	12,136,800
ショーボンドホールディングス	34,200	4,920.00	168,264,000
ミライト・ホールディングス	83,100	2,130.00	177,003,000
タマホーム	14,500	2,430.00	35,235,000
サンヨーホームズ	2,800	719.00	2,013,200
日本アクア	9,500	581.00	5,519,500
ファーストコーポレーション	7,300	764.00	5,577,200
ベステラ	4,600	1,458.00	6,706,800
Robot Home	40,000	208.00	8,320,000
キャンディル	4,100	621.00	2,546,100
スペースバリューホールディングス	29,200	839.00	24,498,800
ダイセキ環境ソリューション	4,600	1,209.00	5,561,400
第一カッター興業	5,900	1,309.00	7,723,100
安藤・間	153,700	815.00	125,265,500
東急建設	70,200	748.00	52,509,600
コムシスホールディングス	85,000	2,921.00	248,285,000
ビーアールホールディングス	32,100	513.00	16,467,300
高松コンストラクショングループ	14,900	2,059.00	30,679,100
東建コーポレーション	7,400	10,390.00	76,886,000
ソネック	2,500	1,098.00	2,745,000
ヤマウラ	10,400	954.00	9,921,600
オリエンタル白石	80,600	275.00	22,165,000
大成建設	172,300	3,475.00	598,742,500
大林組	553,700	918.00	508,296,600
清水建設	518,700	799.00	414,441,300
飛島建設	15,900	1,090.00	17,331,000
長谷工コーポレーション	181,400	1,514.00	274,639,600
松井建設	21,800	776.00	16,916,800
銭高組	2,400	4,180.00	10,032,000
鹿島建設	405,700	1,420.00	576,094,000
不動テトラ	13,600	1,734.00	23,582,400
大末建設	7,000	986.00	6,902,000

鉄建建設	11,200	1,818.00	20,361,600
西松建設	39,600	3,440.00	136,224,000
三井住友建設	133,800	478.00	63,956,400
大豊建設	12,100	4,085.00	49,428,500
前田建設工業	138,700	822.00	114,011,400
佐田建設	12,800	479.00	6,131,200
ナカノフドー建設	13,200	366.00	4,831,200
奥村組	30,400	3,045.00	92,568,000
東鉄工業	23,700	2,490.00	59,013,000
イチケン	4,000	1,931.00	7,724,000
富士ピー・エス	7,100	571.00	4,054,100
浅沼組	6,600	4,475.00	29,535,000
戸田建設	229,900	810.00	186,219,000
熊谷組	25,700	2,698.00	69,338,600
北野建設	3,400	2,179.00	7,408,600
植木組	4,900	1,484.00	7,271,600
矢作建設工業	24,500	735.00	18,007,500
ピーエス三菱	18,200	650.00	11,830,000
日本ハウスホールディングス	37,800	427.00	16,140,600
大東建託	60,400	12,660.00	764,664,000
新日本建設	23,500	855.00	20,092,500
N I P P O	45,800	3,180.00	145,644,000
東亜道路工業	3,400	4,540.00	15,436,000
前田道路	34,200	1,871.00	63,988,200
日本道路	5,400	8,090.00	43,686,000
東亜建設工業	14,800	2,313.00	34,232,400
日本国土開発	53,900	576.00	31,046,400
若築建設	9,900	1,931.00	19,116,900
東洋建設	62,100	558.00	34,651,800
五洋建設	235,200	699.00	164,404,800
世紀東急工業	26,600	846.00	22,503,600
福田組	5,900	4,980.00	29,382,000
住友林業	141,700	2,061.00	292,043,700
日本基礎技術	16,900	593.00	10,021,700
巴コーポレーション	24,600	433.00	10,651,800
大和ハウス工業	511,300	3,369.00	1,722,569,700
ライト工業	31,700	1,914.00	60,673,800
積水ハウス	600,500	2,166.00	1,300,683,000
日特建設	13,700	722.00	9,891,400
北陸電気工事	9,600	1,304.00	12,518,400
ユアテック	31,700	705.00	22,348,500
日本リーテック	11,600	1,728.00	20,044,800

四電工	3,000	3,400.00	10,200,000
中電工	25,500	2,263.00	57,706,500
関電工	90,000	939.00	84,510,000
きんでん	112,500	1,854.00	208,575,000
東京エネシス	18,400	1,054.00	19,393,600
トーエネック	5,600	3,820.00	21,392,000
住友電設	15,600	2,187.00	34,117,200
日本電設工業	30,400	1,865.00	56,696,000
協和エクシオ	84,000	2,732.00	229,488,000
新日本空調	14,600	2,397.00	34,996,200
九電工	38,800	3,970.00	154,036,000
三機工業	39,200	1,507.00	59,074,400
日揮ホールディングス	184,700	918.00	169,554,600
中外炉工業	6,000	1,824.00	10,944,000
ヤマト	17,700	770.00	13,629,000
太平電業	12,300	2,717.00	33,419,100
高砂熱学工業	50,100	2,117.00	106,061,700
三晃金属工業	2,200	2,300.00	5,060,000
朝日工業社	4,100	3,410.00	13,981,000
明星工業	35,800	753.00	26,957,400
大気社	26,900	3,535.00	95,091,500
ダイダン	12,300	2,720.00	33,456,000
日比谷総合設備	17,800	1,909.00	33,980,200
フィル・カンパニー	3,200	2,904.00	9,292,800
テスホールディングス	10,100	2,011.00	20,311,100
東洋エンジニアリング	23,300	900.00	20,970,000
レイズネクスト	29,700	1,116.00	33,145,200
ニッポン	51,900	1,622.00	84,181,800
日清製粉グループ本社	200,200	1,804.00	361,160,800
日東富士製粉	1,300	6,650.00	8,645,000
昭和産業	15,400	2,802.00	43,150,800
鳥越製粉	15,700	787.00	12,355,900
中部飼料	21,600	1,139.00	24,602,400
フィード・ワン	23,800	760.00	18,088,000
東洋精糖	3,000	1,172.00	3,516,000
日本甜菜製糖	9,200	1,645.00	15,134,000
D M三井製糖ホールディングス	14,000	1,960.00	27,440,000
塩水港精糖	21,100	221.00	4,663,100
日新製糖	8,400	1,700.00	14,280,000
森永製菓	41,600	3,880.00	161,408,000
中村屋	4,300	3,815.00	16,404,500
江崎グリコ	48,800	4,175.00	203,740,000

名糖産業	7,800	1,740.00	13,572,000
井村屋グループ	10,000	2,375.00	23,750,000
不二家	9,900	2,363.00	23,393,700
山崎製パン	132,800	1,797.00	238,641,600
第一屋製パン	3,400	869.00	2,954,600
モロゾフ	2,800	5,510.00	15,428,000
亀田製菓	10,100	4,700.00	47,470,000
寿スピリッツ	17,100	7,380.00	126,198,000
カルビー	80,800	2,728.00	220,422,400
森永乳業	32,800	6,990.00	229,272,000
六甲バター	12,900	1,603.00	20,678,700
ヤクルト本社	121,900	6,340.00	772,846,000
明治ホールディングス	117,200	6,800.00	796,960,000
雪印メグミルク	42,700	2,316.00	98,893,200
プリマハム	24,900	2,972.00	74,002,800
日本ハム	67,700	4,290.00	290,433,000
林兼産業	5,900	583.00	3,439,700
丸大食品	17,400	1,792.00	31,180,800
S Foods	15,900	3,215.00	51,118,500
柿安本店	6,100	2,566.00	15,652,600
伊藤ハム米久ホールディングス	114,100	740.00	84,434,000
サッポロホールディングス	60,500	2,358.00	142,659,000
アサヒグループホールディングス	416,900	5,095.00	2,124,105,500
キリンホールディングス	651,300	1,994.00	1,298,692,200
宝ホールディングス	131,400	1,384.00	181,857,600
オエノンホールディングス	50,300	383.00	19,264,900
養命酒製造	5,400	1,839.00	9,930,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	124,400	1,526.00	189,834,400
サントリー食品インターナショナル	118,600	4,325.00	512,945,000
ダイトーグループホールディングス	10,000	5,310.00	53,100,000
伊藤園	53,800	7,070.00	380,366,000
キーコーヒー	17,400	2,213.00	38,506,200
ユニカフェ	5,300	1,015.00	5,379,500
ジャパンフーズ	2,500	1,239.00	3,097,500
日清オイリオグループ	22,200	3,075.00	68,265,000
不二製油グループ本社	43,200	2,483.00	107,265,600
かどや製油	1,900	4,045.00	7,685,500
J - オイルミルズ	16,500	1,820.00	30,030,000
キッコーマン	127,500	8,130.00	1,036,575,000
味の素	421,400	3,202.00	1,349,322,800
ブルドックソース	8,000	2,102.00	16,816,000
キューピー	98,700	2,700.00	266,490,000

ハウス食品グループ本社	66,300	3,535.00	234,370,500
カゴメ	67,200	2,930.00	196,896,000
焼津水産化学工業	8,600	970.00	8,342,000
アリアケジャパン	16,200	6,280.00	101,736,000
ピエトロ	2,300	1,750.00	4,025,000
エバラ食品工業	3,900	2,628.00	10,249,200
やまみ	1,900	2,068.00	3,929,200
ニチレイ	84,400	2,817.00	237,754,800
東洋水産	91,200	4,520.00	412,224,000
イトアンドホールディングス	6,100	2,102.00	12,822,200
大冷	2,000	2,015.00	4,030,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,900	753.00	7,454,700
日清食品ホールディングス	69,500	8,610.00	598,395,000
永谷園ホールディングス	8,700	2,142.00	18,635,400
一正蒲鉾	6,900	928.00	6,403,200
フジッコ	19,200	1,912.00	36,710,400
ロック・フィールド	19,100	1,589.00	30,349,900
日本たばこ産業	950,200	2,135.50	2,029,152,100
ケンコーマヨネーズ	10,800	1,553.00	16,772,400
わらべや日洋ホールディングス	11,600	2,398.00	27,816,800
なとり	9,900	1,970.00	19,503,000
イフジ産業	2,700	956.00	2,581,200
ピクルスコーポレーション	8,400	1,875.00	15,750,000
ファーマフーズ	16,700	3,070.00	51,269,000
北の達人コーポレーション	61,900	512.00	31,692,800
ユーグレナ	90,200	888.00	80,097,600
紀文食品	10,300	1,276.00	13,142,800
ミヨシ油脂	6,800	1,285.00	8,738,000
理研ビタミン	16,700	1,852.00	30,928,400
片倉工業	19,600	1,488.00	29,164,800
ゲンゼ	12,800	4,535.00	58,048,000
東洋紡	68,700	1,355.00	93,088,500
ユニチカ	52,100	347.00	18,078,700
富士紡ホールディングス	8,500	4,185.00	35,572,500
倉敷紡績	15,000	1,967.00	29,505,000
シキボウ	9,700	924.00	8,962,800
日本毛織	52,600	1,013.00	53,283,800
トーア紡コーポレーション	6,400	432.00	2,764,800
帝国繊維	19,800	2,015.00	39,897,000
帝人	163,100	1,587.00	258,839,700
東レ	1,252,700	739.70	926,622,190
サカイオーベックス	4,700	3,805.00	17,883,500

住江織物	3,800	1,840.00	6,992,000
日本フェルト	10,900	445.00	4,850,500
イチカワ	2,600	1,360.00	3,536,000
日東製網	1,900	1,530.00	2,907,000
アツギ	13,600	632.00	8,595,200
ダイニック	6,500	740.00	4,810,000
セーレン	42,800	1,946.00	83,288,800
ソトー	7,100	802.00	5,694,200
東海染工	2,400	1,149.00	2,757,600
小松マテーレ	28,600	1,018.00	29,114,800
ワコールホールディングス	43,200	2,330.00	100,656,000
ホギメディカル	23,400	3,515.00	82,251,000
T S Iホールディングス	53,100	313.00	16,620,300
マツオカコーポレーション	5,700	1,420.00	8,094,000
ワールド	22,800	1,382.00	31,509,600
三陽商会	9,000	865.00	7,785,000
ナイガイ	7,000	339.00	2,373,000
オンワードホールディングス	104,600	293.00	30,647,800
ルックホールディングス	5,700	1,315.00	7,495,500
ゴールドウイン	28,600	6,550.00	187,330,000
デサント	29,600	3,215.00	95,164,000
キング	9,700	510.00	4,947,000
ヤマトインターナショナル	15,800	326.00	5,150,800
特種東海製紙	10,600	4,540.00	48,124,000
王子ホールディングス	778,500	578.00	449,973,000
日本製紙	76,500	1,238.00	94,707,000
三菱製紙	24,500	361.00	8,844,500
北越コーポレーション	123,700	607.00	75,085,900
中越パルプ工業	6,600	1,190.00	7,854,000
巴川製紙所	5,700	919.00	5,238,300
大王製紙	83,400	2,035.00	169,719,000
阿波製紙	4,500	385.00	1,732,500
レンゴー	178,300	905.00	161,361,500
トーモク	10,600	1,902.00	20,161,200
ザ・パック	13,100	2,932.00	38,409,200
クラレ	252,900	1,030.00	260,487,000
旭化成	1,146,200	1,135.50	1,301,510,100
共和レザー	9,400	687.00	6,457,800
昭和電工	123,100	2,483.00	305,657,300
住友化学	1,361,200	555.00	755,466,000
住友精化	8,400	3,565.00	29,946,000
日産化学	94,700	6,040.00	571,988,000

ラサ工業	5,700	1,859.00	10,596,300
クレハ	14,800	7,470.00	110,556,000
多木化学	6,700	6,360.00	42,612,000
テイカ	12,700	1,328.00	16,865,600
石原産業	31,000	1,137.00	35,247,000
片倉コープアグリ	4,500	1,208.00	5,436,000
日本曹達	24,200	3,525.00	85,305,000
東ソー	267,300	1,990.00	531,927,000
トクヤマ	51,400	2,193.00	112,720,200
セントラル硝子	33,000	2,202.00	72,666,000
東亜合成	98,500	1,256.00	123,716,000
大阪ソーダ	17,600	2,680.00	47,168,000
関東電化工業	41,000	1,051.00	43,091,000
デンカ	63,100	3,850.00	242,935,000
信越化学工業	319,800	17,900.00	5,724,420,000
日本カーバイド工業	6,400	1,323.00	8,467,200
堺化学工業	12,100	2,088.00	25,264,800
第一稀元素化学工業	17,400	1,625.00	28,275,000
エア・ウォーター	176,300	1,775.00	312,932,500
日本酸素ホールディングス	142,400	2,590.00	368,816,000
日本化学工業	4,900	3,305.00	16,194,500
東邦アセチレン	2,600	1,606.00	4,175,600
日本パーカライズン	87,200	1,151.00	100,367,200
高压ガス工業	27,400	765.00	20,961,000
チタン工業	2,200	1,832.00	4,030,400
四国化成工業	22,500	1,379.00	31,027,500
戸田工業	3,700	3,170.00	11,729,000
ステラ ケミファ	9,400	2,821.00	26,517,400
保土谷化学工業	5,100	5,000.00	25,500,000
日本触媒	31,300	5,820.00	182,166,000
大日精化工業	14,300	2,526.00	36,121,800
カネカ	44,700	4,560.00	203,832,000
三菱瓦斯化学	173,200	2,039.00	353,154,800
三井化学	149,300	3,715.00	554,649,500
J S R	173,500	3,705.00	642,817,500
東京応化工業	29,700	6,680.00	198,396,000
大阪有機化学工業	14,700	3,800.00	55,860,000
三菱ケミカルホールディングス	1,156,000	954.70	1,103,633,200
K Hネオケム	28,500	3,025.00	86,212,500
ダイセル	232,500	883.00	205,297,500
住友ベークライト	27,200	4,690.00	127,568,000
積水化学工業	361,800	1,861.00	673,309,800

日本ゼオン	155,900	1,454.00	226,678,600
アイカ工業	48,200	3,670.00	176,894,000
宇部興産	87,300	2,240.00	195,552,000
積水樹脂	26,100	2,158.00	56,323,800
タキロンシーアイ	37,400	640.00	23,936,000
旭有機材	9,800	1,480.00	14,504,000
ニチバン	9,100	1,815.00	16,516,500
リケンテクノス	42,200	574.00	24,222,800
大倉工業	8,800	2,225.00	19,580,000
積水化成成品工業	23,200	598.00	13,873,600
群栄化学工業	3,900	2,696.00	10,514,400
タイガースポリマー	9,100	445.00	4,049,500
ミライアル	5,500	1,300.00	7,150,000
ダイキアクシス	6,600	869.00	5,735,400
ダイキョーニシカワ	36,500	679.00	24,783,500
竹本容器	6,200	929.00	5,759,800
森六ホールディングス	9,300	2,140.00	19,902,000
恵和	4,300	4,795.00	20,618,500
日本化薬	107,000	1,221.00	130,647,000
カーリットホールディングス	17,100	853.00	14,586,300
日本精化	12,500	2,121.00	26,512,500
扶桑化学工業	13,600	4,545.00	61,812,000
トリケミカル研究所	16,000	3,465.00	55,440,000
A D E K A	79,600	2,317.00	184,433,200
日油	65,100	6,130.00	399,063,000
新日本理化	28,600	284.00	8,122,400
ハリマ化成グループ	12,900	898.00	11,584,200
花王	390,600	6,638.00	2,592,802,800
第一工業製薬	5,900	3,250.00	19,175,000
石原ケミカル	4,400	2,654.00	11,677,600
日華化学	5,800	1,079.00	6,258,200
ニイタカ	3,600	2,228.00	8,020,800
三洋化成工業	10,300	5,850.00	60,255,000
有機合成薬品工業	13,200	326.00	4,303,200
大日本塗料	19,500	857.00	16,711,500
日本ペイントホールディングス	649,700	1,352.00	878,394,400
関西ペイント	194,300	2,845.00	552,783,500
神東塗料	13,600	191.00	2,597,600
中国塗料	41,600	902.00	37,523,200
日本特殊塗料	12,900	1,065.00	13,738,500
藤倉化成	23,300	530.00	12,349,000
太陽ホールディングス	12,700	5,970.00	75,819,000

D I C	73,000	3,095.00	225,935,000
サカティンクス	34,300	1,144.00	39,239,200
東洋インキS Cホールディングス	36,600	2,035.00	74,481,000
T & K T O K A	12,100	822.00	9,946,200
富士フィルムホールディングス	310,300	8,812.00	2,734,363,600
資生堂	328,900	7,235.00	2,379,591,500
ライオン	213,200	1,880.00	400,816,000
高砂香料工業	11,000	2,877.00	31,647,000
マンダム	37,000	1,675.00	61,975,000
ミルボン	21,800	6,880.00	149,984,000
ファンケル	64,300	3,695.00	237,588,500
コーセー	33,200	13,460.00	446,872,000
コタ	11,200	1,593.00	17,841,600
シーボン	2,300	1,878.00	4,319,400
ポーラ・オルビスホールディングス	75,400	2,420.00	182,468,000
ノエビアホールディングス	15,000	5,850.00	87,750,000
アジュバンコスメジャパン	3,900	1,051.00	4,098,900
新日本製薬	4,800	1,884.00	9,043,200
エステー	11,300	1,791.00	20,238,300
アグロ カネショウ	5,900	1,432.00	8,448,800
コニシ	29,000	1,700.00	49,300,000
長谷川香料	30,400	2,800.00	85,120,000
星光P M C	10,100	875.00	8,837,500
小林製薬	49,500	8,700.00	430,650,000
荒川化学工業	14,700	1,270.00	18,669,000
メック	13,200	3,200.00	42,240,000
日本高純度化学	4,800	2,961.00	14,212,800
タカラバイオ	46,200	3,180.00	146,916,000
J C U	19,900	4,170.00	82,983,000
新田ゼラチン	11,100	638.00	7,081,800
O A T アグリオ	3,600	1,811.00	6,519,600
デクセリアルズ	49,400	2,031.00	100,331,400
アース製薬	14,500	6,510.00	94,395,000
北興化学工業	16,400	1,048.00	17,187,200
大成ラミック	5,400	2,809.00	15,168,600
クミアイ化学工業	65,700	907.00	59,589,900
日本農薬	31,500	546.00	17,199,000
アキレス	12,200	1,336.00	16,299,200
有沢製作所	24,600	927.00	22,804,200
日東電工	106,700	8,230.00	878,141,000
レック	20,900	1,115.00	23,303,500
三光合成	18,500	443.00	8,195,500

きもと	27,000	241.00	6,507,000
藤森工業	15,800	4,600.00	72,680,000
前澤化成工業	11,200	1,271.00	14,235,200
未来工業	6,300	1,663.00	10,476,900
ウェブロックホールディングス	6,100	677.00	4,129,700
J S P	10,300	1,619.00	16,675,700
エフピコ	32,500	4,145.00	134,712,500
天馬	13,200	2,784.00	36,748,800
信越ポリマー	27,200	975.00	26,520,000
東リ	44,000	235.00	10,340,000
ニフコ	64,800	3,490.00	226,152,000
バルカー	14,300	2,142.00	30,630,600
ユニ・チャーム	340,300	4,872.00	1,657,941,600
ショーエイコーポレーション	3,900	824.00	3,213,600
協和キリン	207,200	3,550.00	735,560,000
武田薬品工業	1,468,900	3,665.00	5,383,518,500
アステラス製薬	1,530,800	1,846.50	2,826,622,200
大日本住友製薬	130,900	1,957.00	256,171,300
塩野義製薬	222,000	6,919.00	1,536,018,000
わかもと製薬	21,000	352.00	7,392,000
日本新薬	50,100	8,770.00	439,377,000
中外製薬	552,200	4,242.00	2,342,432,400
科研製薬	30,200	5,010.00	151,302,000
エーザイ	195,100	8,955.00	1,747,120,500
ロート製薬	84,200	3,460.00	291,332,000
小野薬品工業	405,500	2,604.50	1,056,124,750
久光製薬	51,400	4,415.00	226,931,000
持田製薬	24,500	3,590.00	87,955,000
参天製薬	307,300	1,624.00	499,055,200
扶桑薬品工業	5,700	2,502.00	14,261,400
日本ケミファ	2,100	2,232.00	4,687,200
ツムラ	58,900	3,790.00	223,231,000
日医工	50,000	878.00	43,900,000
キッセイ薬品工業	31,200	2,423.00	75,597,600
生化学工業	31,100	1,124.00	34,956,400
栄研化学	31,000	2,152.00	66,712,000
日水製薬	6,500	1,003.00	6,519,500
鳥居薬品	9,500	2,901.00	27,559,500
J C R ファーマ	49,800	2,883.00	143,573,400
東和薬品	25,400	2,942.00	74,726,800
富士製薬工業	10,900	1,162.00	12,665,800
ゼリア新薬工業	32,000	2,166.00	69,312,000

第一三共	1,387,500	2,544.00	3,529,800,000
キョーリン製薬ホールディングス	39,000	1,854.00	72,306,000
大幸薬品	26,600	924.00	24,578,400
ダイト	11,300	3,585.00	40,510,500
大塚ホールディングス	366,900	4,649.00	1,705,718,100
大正製薬ホールディングス	43,500	6,300.00	274,050,000
ペプチドリーム	92,600	3,910.00	362,066,000
あすか製薬ホールディングス	20,100	1,045.00	21,004,500
サワイグループホールディングス	38,700	5,020.00	194,274,000
日本コークス工業	149,200	124.00	18,500,800
ニチレキ	20,800	1,291.00	26,852,800
ユシロ化学工業	9,900	1,192.00	11,800,800
ビーピー・カストロール	6,300	1,344.00	8,467,200
富士石油	42,900	257.00	11,025,300
MORESCO	6,400	1,136.00	7,270,400
出光興産	195,900	2,655.00	520,114,500
Eneosホールディングス	2,656,100	427.30	1,134,951,530
コスモエネルギーホールディングス	55,800	2,209.00	123,262,200
横浜ゴム	102,200	1,883.00	192,442,600
TOYO TIRE	92,900	1,956.00	181,712,400
ブリヂストン	508,600	5,037.00	2,561,818,200
住友ゴム工業	158,600	1,310.00	207,766,000
藤倉コンポジット	15,400	725.00	11,165,000
オカモト	10,500	4,175.00	43,837,500
フコク	7,700	1,015.00	7,815,500
ニッタ	18,300	2,756.00	50,434,800
住友理工	34,200	699.00	23,905,800
三ツ星ベルト	21,400	2,034.00	43,527,600
バンドー化学	31,100	909.00	28,269,900
日東紡績	26,300	3,325.00	87,447,500
AGC	162,100	5,280.00	855,888,000
日本板硝子	89,600	561.00	50,265,600
石塚硝子	3,000	2,048.00	6,144,000
日本山村硝子	7,400	933.00	6,904,200
日本電気硝子	71,000	2,352.00	166,992,000
オハラ	7,000	1,370.00	9,590,000
住友大阪セメント	31,800	3,005.00	95,559,000
太平洋セメント	100,300	2,542.00	254,962,600
日本ヒューム	16,200	739.00	11,971,800
日本コンクリート工業	38,300	302.00	11,566,600
三谷セキサン	8,200	6,220.00	51,004,000
アジアパイルホールディングス	27,300	488.00	13,322,400

東海カーボン	148,000	1,464.00	216,672,000
日本カーボン	9,100	4,165.00	37,901,500
東洋炭素	11,500	2,756.00	31,694,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,800	4,160.00	40,768,000
TOTO	126,100	5,990.00	755,339,000
日本碍子	194,300	1,807.00	351,100,100
日本特殊陶業	134,400	1,702.00	228,748,800
MARUWA	6,100	10,620.00	64,782,000
品川リフラクトリーズ	4,200	3,885.00	16,317,000
黒崎播磨	3,000	4,915.00	14,745,000
ヨータイ	12,700	1,265.00	16,065,500
イソライト工業	7,900	661.00	5,221,900
東京窯業	22,700	324.00	7,354,800
ニッカトー	8,100	712.00	5,767,200
フジミインコーポレーテッド	14,200	5,990.00	85,058,000
クニミネ工業	5,600	1,096.00	6,137,600
エーアンドエーマテリアル	3,400	1,000.00	3,400,000
ニチアス	44,600	2,906.00	129,607,600
ニチハ	24,600	3,170.00	77,982,000
日本製鉄	833,500	2,168.50	1,807,444,750
神戸製鋼所	319,700	691.00	220,912,700
中山製鋼所	24,400	469.00	11,443,600
合同製鐵	9,500	1,485.00	14,107,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	505,300	1,728.00	873,158,400
東京製鐵	68,100	1,175.00	80,017,500
共英製鋼	19,700	1,448.00	28,525,600
大和工業	37,100	4,150.00	153,965,000
東京鐵鋼	6,700	1,579.00	10,579,300
大阪製鐵	9,300	1,182.00	10,992,600
淀川製鋼所	23,000	2,480.00	57,040,000
丸一鋼管	56,700	2,707.00	153,486,900
モリ工業	5,200	2,336.00	12,147,200
大同特殊鋼	28,600	4,940.00	141,284,000
日本高周波鋼業	6,600	390.00	2,574,000
日本冶金工業	13,600	2,632.00	35,795,200
山陽特殊製鋼	21,000	1,800.00	37,800,000
愛知製鋼	9,800	2,810.00	27,538,000
日立金属	164,600	2,129.00	350,433,400
日本金属	4,400	1,016.00	4,470,400
大平洋金属	11,900	1,645.00	19,575,500
新日本電工	112,900	329.00	37,144,100
栗本鐵工所	7,900	1,654.00	13,066,600

虹技	2,500	1,142.00	2,855,000
三菱製鋼	13,000	1,240.00	16,120,000
日亜鋼業	25,800	291.00	7,507,800
日本精線	2,500	4,940.00	12,350,000
エンビプロ・ホールディングス	7,500	1,596.00	11,970,000
シンニッタン	21,400	243.00	5,200,200
新家工業	4,400	1,498.00	6,591,200
大紀アルミニウム工業所	26,400	1,458.00	38,491,200
日本軽金属ホールディングス	47,600	1,931.00	91,915,600
三井金属鉱業	47,100	3,310.00	155,901,000
東邦亜鉛	9,700	2,024.00	19,632,800
三菱マテリアル	115,400	2,222.00	256,418,800
住友金属鉱山	223,200	4,154.00	927,172,800
D O W Aホールディングス	44,200	4,810.00	212,602,000
古河機械金属	28,900	1,245.00	35,980,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,300	789.00	14,438,700
東邦チタニウム	31,400	1,109.00	34,822,600
U A C J	26,500	2,689.00	71,258,500
C Kサンエツ	3,700	3,280.00	12,136,000
古河電気工業	54,300	2,354.00	127,822,200
住友電気工業	609,400	1,468.50	894,903,900
フジクラ	211,000	625.00	131,875,000
昭和電線ホールディングス	17,000	2,276.00	38,692,000
東京特殊電線	2,300	2,700.00	6,210,000
タツタ電線	31,000	526.00	16,306,000
カナレ電気	2,700	1,722.00	4,649,400
平河ヒューテック	9,800	1,182.00	11,583,600
リョービ	21,600	1,286.00	27,777,600
アーレスティ	21,700	436.00	9,461,200
アサヒホールディングス	65,600	2,253.00	147,796,800
稲葉製作所	9,800	1,464.00	14,347,200
宮地エンジニアリンググループ	5,700	2,640.00	15,048,000
トーカロ	45,000	1,342.00	60,390,000
アルファC o	6,200	1,250.00	7,750,000
S U M C O	222,700	2,326.00	518,000,200
川田テクノロジーズ	3,600	3,650.00	13,140,000
R S T e c h n o l o g i e s	5,700	5,850.00	33,345,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,618.00	4,974,200
信和	9,300	714.00	6,640,200
東洋製罐グループホールディングス	111,200	1,535.00	170,692,000
ホッカンホールディングス	8,900	1,439.00	12,807,100
コロナ	9,700	915.00	8,875,500

横河ブリッジホールディングス	30,000	2,218.00	66,540,000
駒井ハルテック	3,500	1,644.00	5,754,000
高田機工	1,600	2,803.00	4,484,800
三和ホールディングス	164,600	1,424.00	234,390,400
文化シャッター	51,400	1,166.00	59,932,400
三協立山	22,500	755.00	16,987,500
アルインコ	11,500	1,031.00	11,856,500
東洋シャッター	3,900	669.00	2,609,100
L I X I L	240,500	3,145.00	756,372,500
日本フィルコン	12,200	513.00	6,258,600
ノーリツ	33,400	1,897.00	63,359,800
長府製作所	17,800	2,039.00	36,294,200
リンナイ	34,000	11,490.00	390,660,000
ダイニチ工業	8,400	753.00	6,325,200
日東精工	21,900	612.00	13,402,800
三洋工業	2,100	1,873.00	3,933,300
岡部	35,400	665.00	23,541,000
ジーテクト	21,700	1,503.00	32,615,100
東プレ	32,600	1,348.00	43,944,800
高周波熱錬	33,600	625.00	21,000,000
東京製綱	12,500	1,026.00	12,825,000
サンコール	14,900	447.00	6,660,300
モリテック スチール	13,600	439.00	5,970,400
パイオラックス	25,800	1,536.00	39,628,800
エイチワン	17,100	718.00	12,277,800
日本発條	173,900	795.00	138,250,500
中央発條	8,400	1,112.00	9,340,800
アドバネクス	2,500	1,203.00	3,007,500
立川ブラインド工業	7,700	1,284.00	9,886,800
三益半導体工業	13,600	2,322.00	31,579,200
日本ドライケミカル	4,400	1,999.00	8,795,600
日本製鋼所	53,100	2,566.00	136,254,600
三浦工業	75,600	4,980.00	376,488,000
タクマ	59,300	1,670.00	99,031,000
ツガミ	36,400	1,529.00	55,655,600
オークマ	20,400	5,230.00	106,692,000
芝浦機械	18,200	2,621.00	47,702,200
アマダ	256,200	1,118.00	286,431,600
アイダエンジニアリング	46,000	1,059.00	48,714,000
滝澤鉄工所	5,100	1,109.00	5,655,900
F U J I	69,700	2,798.00	195,020,600
牧野フライス製作所	20,500	4,050.00	83,025,000

オーエスジー	80,900	1,973.00	159,615,700
ダイジェット工業	2,200	1,179.00	2,593,800
旭ダイヤモンド工業	46,400	517.00	23,988,800
D M G 森精機	103,700	1,955.00	202,733,500
ソディック	38,800	893.00	34,648,400
ディスコ	23,700	31,850.00	754,845,000
日東工器	8,400	1,985.00	16,674,000
日進工具	13,800	1,398.00	19,292,400
パンチ工業	14,700	554.00	8,143,800
富士ダイス	8,900	679.00	6,043,100
豊和工業	10,000	827.00	8,270,000
O K K	6,700	390.00	2,613,000
東洋機械金属	12,700	501.00	6,362,700
津田駒工業	3,400	843.00	2,866,200
エンシュウ	4,500	783.00	3,523,500
島精機製作所	25,700	2,037.00	52,350,900
オプトラン	21,900	2,230.00	48,837,000
N C ホールディングス	5,300	1,043.00	5,527,900
イワキポンプ	11,200	927.00	10,382,400
フリー	17,100	1,596.00	27,291,600
ヤマシンフィルタ	35,300	622.00	21,956,600
日阪製作所	21,600	843.00	18,208,800
やまびこ	33,900	1,255.00	42,544,500
野村マイクロ・サイエンス	3,800	4,815.00	18,297,000
平田機工	8,300	6,730.00	55,859,000
ペガサスミシン製造	17,900	429.00	7,679,100
マルマエ	7,200	1,952.00	14,054,400
タツモ	8,200	1,598.00	13,103,600
ナプテスコ	99,600	4,360.00	434,256,000
三井海洋開発	18,600	1,646.00	30,615,600
レオン自動機	17,200	1,471.00	25,301,200
S M C	51,700	69,980.00	3,617,966,000
ホソカワミクロン	6,200	6,600.00	40,920,000
ユニオンツール	6,500	3,905.00	25,382,500
オイレス工業	24,500	1,637.00	40,106,500
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,190.00	24,721,000
サトーホールディングス	23,000	2,705.00	62,215,000
技研製作所	15,400	4,725.00	72,765,000
日本エアーテック	8,100	1,191.00	9,647,100
カワタ	4,800	899.00	4,315,200
日精樹脂工業	13,700	1,159.00	15,878,300
オカダアイオン	5,600	1,314.00	7,358,400

ワイエイシイホールディングス	7,000	953.00	6,671,000	
小松製作所	800,100	2,663.00	2,130,666,300	
住友重機械工業	101,200	2,897.00	293,176,400	
日立建機	82,600	3,105.00	256,473,000	
日工	26,800	685.00	18,358,000	
巴工業	7,000	2,395.00	16,765,000	
井関農機	16,600	1,542.00	25,597,200	
TOWA	16,500	2,635.00	43,477,500	
丸山製作所	3,800	1,633.00	6,205,400	
北川鉄工所	8,100	1,601.00	12,968,100	
ローツェ	7,700	8,440.00	64,988,000	
タカキタ	6,300	610.00	3,843,000	
クボタ	861,400	2,246.00	1,934,704,400	
荏原実業	8,200	2,471.00	20,262,200	
三菱化工機	5,800	2,379.00	13,798,200	
月島機械	32,800	1,167.00	38,277,600	
帝国電機製作所	12,400	1,308.00	16,219,200	
新東工業	42,300	781.00	33,036,300	
澁谷工業	15,500	3,110.00	48,205,000	
アイチ コーポレーション	30,400	748.00	22,739,200	
小森コーポレーション	45,100	839.00	37,838,900	
鶴見製作所	13,700	1,735.00	23,769,500	
住友精密工業	2,700	2,417.00	6,525,900	
日本ギア工業	7,300	300.00	2,190,000	
酒井重工業	3,200	2,450.00	7,840,000	
荏原製作所	73,300	5,370.00	393,621,000	
石井鐵工所	2,600	3,020.00	7,852,000	
西島製作所	17,900	962.00	17,219,800	
北越工業	18,300	1,090.00	19,947,000	
ダイキン工業	224,900	26,995.00	6,071,175,500	
オルガノ	5,800	6,270.00	36,366,000	
トーヨーカネツ	6,800	2,498.00	16,986,400	
栗田工業	95,600	5,140.00	491,384,000	
椿本チエイン	25,300	3,390.00	85,767,000	
大同工業	8,700	1,014.00	8,821,800	
木村化工機	15,100	739.00	11,158,900	
アネスト岩田	29,800	1,015.00	30,247,000	
ダイフク	97,200	9,580.00	931,176,000	
サムコ	4,400	3,030.00	13,332,000	
加藤製作所	10,000	912.00	9,120,000	
油研工業	3,100	1,739.00	5,390,900	
タダノ	85,400	1,204.00	102,821,600	

フジテック	60,800	2,733.00	166,166,400
C K D	41,000	2,254.00	92,414,000
キトー	14,900	1,678.00	25,002,200
平和	49,300	2,017.00	99,438,100
理想科学工業	13,000	2,383.00	30,979,000
S A N K Y O	42,000	2,823.00	118,566,000
日本金銭機械	19,700	566.00	11,150,200
マースグループホールディングス	11,300	1,694.00	19,142,200
フクシマガリレイ	12,100	4,830.00	58,443,000
オーイズミ	7,600	383.00	2,910,800
ダイコク電機	8,200	915.00	7,503,000
竹内製作所	29,600	2,661.00	78,765,600
アマノ	46,300	2,780.00	128,714,000
J U K I	24,600	766.00	18,843,600
蛇の目ミシン工業	16,200	693.00	11,226,600
マックス	23,700	1,923.00	45,575,100
グローリー	45,400	2,314.00	105,055,600
新晃工業	16,400	2,197.00	36,030,800
大和冷機工業	25,600	1,235.00	31,616,000
セガサミーホールディングス	160,600	1,471.00	236,242,600
日本ピストンリング	6,500	1,401.00	9,106,500
リケン	8,200	2,599.00	21,311,800
T P R	23,800	1,493.00	35,533,400
ツバキ・ナカシマ	38,700	1,486.00	57,508,200
ホシザキ	51,600	10,270.00	529,932,000
大豊工業	14,500	851.00	12,339,500
日本精工	362,700	765.00	277,465,500
N T N	408,600	250.00	102,150,000
ジェイテクト	169,400	993.00	168,214,200
不二越	15,000	4,285.00	64,275,000
日本トムソン	48,500	565.00	27,402,500
T H K	102,800	2,530.00	260,084,000
ユーシン精機	11,800	840.00	9,912,000
前澤給装工業	12,400	1,034.00	12,821,600
イーグル工業	21,900	1,254.00	27,462,600
前澤工業	10,700	700.00	7,490,000
日本ピラー工業	17,900	2,569.00	45,985,100
キッツ	59,600	813.00	48,454,800
マキタ	230,300	6,310.00	1,453,193,000
日立造船	140,300	805.00	112,941,500
三菱重工業	277,500	2,926.00	811,965,000
I H I	118,800	2,479.00	294,505,200

スター精密	27,200	1,554.00	42,268,800
日清紡ホールディングス	108,000	917.00	99,036,000
イビデン	85,100	5,870.00	499,537,000
コニカミノルタ	360,100	553.00	199,135,300
ブラザー工業	216,100	2,237.00	483,415,700
ミネベアミツミ	304,700	2,828.00	861,691,600
日立製作所	848,900	6,170.00	5,237,713,000
東芝	349,400	4,770.00	1,666,638,000
三菱電機	1,765,500	1,501.00	2,650,015,500
富士電機	106,400	4,780.00	508,592,000
東洋電機製造	6,900	1,112.00	7,672,800
安川電機	190,000	5,420.00	1,029,800,000
シンフォニアテクノロジー	22,900	1,198.00	27,434,200
明電舎	29,900	2,438.00	72,896,200
オリジン	4,800	1,271.00	6,100,800
山洋電気	8,700	7,080.00	61,596,000
デンヨー	15,000	2,089.00	31,335,000
東芝テック	19,000	4,740.00	90,060,000
芝浦メカトロニクス	3,300	6,680.00	22,044,000
マブチモーター	41,600	3,835.00	159,536,000
日本電産	425,000	12,495.00	5,310,375,000
トレックス・セミコンダクター	9,900	2,587.00	25,611,300
東光高岳	9,700	1,492.00	14,472,400
ダイヘン	19,300	4,745.00	91,578,500
ヤーマン	29,800	1,090.00	32,482,000
JVCケンウッド	157,900	208.00	32,843,200
ミマキエンジニアリング	17,200	900.00	15,480,000
I - P E X	8,700	2,009.00	17,478,300
日新電機	41,400	1,236.00	51,170,400
大崎電気工業	35,100	559.00	19,620,900
オムロン	147,000	10,260.00	1,508,220,000
日東工業	25,900	1,749.00	45,299,100
I D E C	23,700	2,259.00	53,538,300
正興電機製作所	6,300	1,476.00	9,298,800
不二電機工業	3,800	1,283.00	4,875,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	63,900	2,585.00	165,181,500
サクサホールディングス	4,100	1,354.00	5,551,400
メルコホールディングス	6,300	5,150.00	32,445,000
テクノメディカ	4,700	1,616.00	7,595,200
日本電気	224,400	5,720.00	1,283,568,000
富士通	158,900	19,980.00	3,174,822,000
沖電気工業	71,700	986.00	70,696,200

岩崎通信機	7,700	918.00	7,068,600
電気興業	8,500	2,307.00	19,609,500
サンケン電気	20,600	5,320.00	109,592,000
ナカヨ	3,400	1,421.00	4,831,400
アイホン	10,000	2,165.00	21,650,000
ルネサスエレクトロニクス	954,200	1,178.00	1,124,047,600
セイコーエプソン	219,100	1,995.00	437,104,500
ワコム	129,300	699.00	90,380,700
アルバック	32,500	5,890.00	191,425,000
アクセル	8,800	750.00	6,600,000
E I Z O	15,000	4,275.00	64,125,000
日本信号	41,200	919.00	37,862,800
京三製作所	37,900	475.00	18,002,500
能美防災	23,900	2,144.00	51,241,600
ホーチキ	13,800	1,195.00	16,491,000
星和電機	10,300	521.00	5,366,300
エレコム	41,100	1,768.00	72,664,800
パナソニック	1,882,900	1,295.00	2,438,355,500
シャープ	234,800	1,449.00	340,225,200
アンリツ	106,100	1,909.00	202,544,900
富士通ゼネラル	53,900	2,715.00	146,338,500
ソニーグループ	1,106,000	11,235.00	12,425,910,000
T D K	85,300	11,460.00	977,538,000
帝国通信工業	8,700	1,429.00	12,432,300
タムラ製作所	63,500	742.00	47,117,000
アルプスアルパイン	145,200	1,148.00	166,689,600
池上通信機	5,600	786.00	4,401,600
鈴木	9,200	843.00	7,755,600
メイコー	13,600	2,720.00	36,992,000
日本トリム	4,100	3,800.00	15,580,000
ローランド ディー . ジー .	10,800	2,849.00	30,769,200
フォスター電機	17,800	874.00	15,557,200
S M K	4,500	2,135.00	9,607,500
ヨコオ	14,700	2,657.00	39,057,900
ホシデン	47,300	909.00	42,995,700
ヒロセ電機	27,200	18,560.00	504,832,000
日本航空電子工業	40,500	1,641.00	66,460,500
T O A	20,800	828.00	17,222,400
マクセルホールディングス	35,900	1,311.00	47,064,900
古野電気	23,700	1,086.00	25,738,200
ユニデンホールディングス	4,200	2,732.00	11,474,400
スミダコーポレーション	17,300	1,294.00	22,386,200

アイコム	7,300	2,435.00	17,775,500
リオン	7,900	2,613.00	20,642,700
本多通信工業	16,100	465.00	7,486,500
横河電機	176,700	1,716.00	303,217,200
新電元工業	6,800	4,050.00	27,540,000
アズビル	119,400	4,670.00	557,598,000
東亜ディーケーケー	10,100	860.00	8,686,000
日本光電工業	73,300	3,685.00	270,110,500
チノー	5,600	1,449.00	8,114,400
共和電業	16,900	379.00	6,405,100
日本電子材料	7,300	1,798.00	13,125,400
堀場製作所	32,600	7,790.00	253,954,000
アドバンテスト	131,300	9,340.00	1,226,342,000
小野測器	9,500	553.00	5,253,500
エスベック	16,100	2,153.00	34,663,300
キーエンス	173,300	65,390.00	11,332,087,000
日置電機	8,600	8,030.00	69,058,000
シスメックス	137,900	12,255.00	1,689,964,500
日本マイクロニクス	31,500	1,429.00	45,013,500
メガチップス	18,000	3,295.00	59,310,000
O B A R A G R O U P	8,300	3,850.00	31,955,000
澤藤電機	2,400	2,045.00	4,908,000
原田工業	8,400	933.00	7,837,200
コーセル	22,600	1,029.00	23,255,400
イリソ電子工業	15,000	4,635.00	69,525,000
オブテックスグループ	29,700	1,455.00	43,213,500
千代田インテグレ	8,000	1,920.00	15,360,000
アイ・オー・データ機器	7,700	904.00	6,960,800
レーザーテック	77,600	22,870.00	1,774,712,000
スタンレー電気	123,900	2,741.00	339,609,900
岩崎電気	7,000	2,060.00	14,420,000
ウシオ電機	91,100	1,986.00	180,924,600
岡谷電機産業	15,900	353.00	5,612,700
ヘリオス テクノ ホールディング	19,600	329.00	6,448,400
エノモト	5,600	1,589.00	8,898,400
日本セラミック	16,800	2,952.00	49,593,600
遠藤照明	10,300	950.00	9,785,000
古河電池	13,300	1,595.00	21,213,500
双信電機	10,200	860.00	8,772,000
山一電機	12,200	1,639.00	19,995,800
図研	11,800	3,710.00	43,778,000
日本電子	32,300	7,810.00	252,263,000

カシオ計算機	142,000	1,703.00	241,826,000
ファナック	155,000	23,555.00	3,651,025,000
日本シイエムケイ	41,000	423.00	17,343,000
エンプラス	8,300	3,155.00	26,186,500
大真空	6,300	3,800.00	23,940,000
ローム	73,500	10,590.00	778,365,000
浜松ホトニクス	126,800	6,370.00	807,716,000
三井ハイテック	17,500	6,310.00	110,425,000
新光電気工業	59,600	3,630.00	216,348,000
京セラ	269,300	6,748.00	1,817,236,400
太陽誘電	78,700	6,160.00	484,792,000
村田製作所	518,800	9,047.00	4,693,583,600
双葉電子工業	31,600	812.00	25,659,200
北陸電気工業	7,700	1,024.00	7,884,800
ニチコン	56,700	1,089.00	61,746,300
日本ケミコン	17,800	2,165.00	38,537,000
K O A	25,100	1,557.00	39,080,700
市光工業	22,800	678.00	15,458,400
小糸製作所	105,900	6,720.00	711,648,000
ミツバ	32,500	667.00	21,677,500
S C R E E Nホールディングス	30,600	9,380.00	287,028,000
キャノン電子	16,900	1,590.00	26,871,000
キャノン	877,300	2,568.00	2,252,906,400
リコー	449,200	1,109.00	498,162,800
象印マホービン	48,500	1,714.00	83,129,000
M U T O Hホールディングス	3,000	1,585.00	4,755,000
東京エレクトロン	103,400	46,570.00	4,815,338,000
トヨタ紡織	51,500	2,056.00	105,884,000
芦森工業	3,400	1,031.00	3,505,400
ユニプレス	29,000	912.00	26,448,000
豊田自動織機	142,900	9,430.00	1,347,547,000
モリタホールディングス	28,300	1,558.00	44,091,400
三櫻工業	24,500	1,106.00	27,097,000
デンソー	388,700	7,592.00	2,951,010,400
東海理化電機製作所	46,500	1,605.00	74,632,500
三井E & Sホールディングス	68,300	470.00	32,101,000
川崎重工業	138,100	2,389.00	329,920,900
名村造船所	53,000	226.00	11,978,000
日本車輛製造	6,400	2,100.00	13,440,000
三菱ロジスネクスト	23,400	955.00	22,347,000
近畿車輛	3,000	1,133.00	3,399,000
日産自動車	2,082,300	579.40	1,206,484,620

いすゞ自動車	468,800	1,393.00	653,038,400
トヨタ自動車	1,788,700	9,534.00	17,053,465,800
日野自動車	220,500	955.00	210,577,500
三菱自動車工業	653,500	281.00	183,633,500
エフテック	12,400	632.00	7,836,800
レシップホールディングス	7,000	587.00	4,109,000
G M B	3,300	902.00	2,976,600
ファルテック	3,200	719.00	2,300,800
武蔵精密工業	39,400	1,908.00	75,175,200
日産車体	25,900	754.00	19,528,600
新明和工業	49,900	917.00	45,758,300
極東開発工業	30,500	1,655.00	50,477,500
トピー工業	14,600	1,184.00	17,286,400
ティラド	5,500	3,045.00	16,747,500
曙ブレーキ工業	96,900	189.00	18,314,100
タチエス	27,100	1,355.00	36,720,500
N O K	85,500	1,344.00	114,912,000
フタバ産業	44,400	481.00	21,356,400
K Y B	19,800	3,095.00	61,281,000
大同メタル工業	36,600	594.00	21,740,400
プレス工業	87,700	348.00	30,519,600
ミクニ	22,700	322.00	7,309,400
太平洋工業	37,000	1,275.00	47,175,000
河西工業	24,000	391.00	9,384,000
アイシン	129,200	4,170.00	538,764,000
マツダ	554,100	952.00	527,503,200
今仙電機製作所	15,600	702.00	10,951,200
本田技研工業	1,390,100	3,312.00	4,604,011,200
スズキ	350,000	4,725.00	1,653,750,000
S U B A R U	506,000	2,038.50	1,031,481,000
安永	8,600	1,141.00	9,812,600
ヤマハ発動機	230,400	2,774.00	639,129,600
T B K	21,200	409.00	8,670,800
エクセディ	24,000	1,663.00	39,912,000
豊田合成	57,100	2,343.00	133,785,300
愛三工業	27,700	845.00	23,406,500
盟和産業	2,800	1,010.00	2,828,000
日本プラスト	15,000	632.00	9,480,000
ヨロズ	15,200	1,182.00	17,966,400
エフ・シー・シー	28,900	1,530.00	44,217,000
シマノ	71,200	31,790.00	2,263,448,000
テイ・エス テック	82,100	1,482.00	121,672,200

ジャムコ	10,400	1,001.00	10,410,400
テルモ	541,300	4,476.00	2,422,858,800
クリエートメディック	5,300	980.00	5,194,000
日機装	53,000	886.00	46,958,000
日本エム・ディ・エム	10,200	2,243.00	22,878,600
島津製作所	227,200	4,920.00	1,117,824,000
JMS	15,000	773.00	11,595,000
長野計器	12,800	1,116.00	14,284,800
ブイ・テクノロジー	8,300	4,545.00	37,723,500
東京計器	11,300	1,011.00	11,424,300
愛知時計電機	2,300	4,675.00	10,752,500
インターアクション	8,800	2,700.00	23,760,000
オーバル	15,900	280.00	4,452,000
東京精密	29,800	4,760.00	141,848,000
マニー	70,300	2,178.00	153,113,400
ニコン	269,600	1,168.00	314,892,800
トプコン	89,000	1,722.00	153,258,000
オリンパス	925,900	2,240.00	2,074,016,000
理研計器	15,600	2,819.00	43,976,400
タムロン	13,700	2,569.00	35,195,300
H O Y A	344,500	17,520.00	6,035,640,000
シード	6,900	691.00	4,767,900
ノーリツ鋼機	15,900	2,385.00	37,921,500
エー・アンド・デイ	14,900	1,070.00	15,943,000
朝日インテック	193,100	3,245.00	626,609,500
シチズン時計	224,100	480.00	107,568,000
リズム	5,600	1,356.00	7,593,600
大研医器	14,000	600.00	8,400,000
メニコン	27,100	8,870.00	240,377,000
シンシア	2,000	640.00	1,280,000
松風	8,100	1,945.00	15,754,500
セイコーホールディングス	25,000	2,173.00	54,325,000
ニプロ	131,600	1,280.00	168,448,000
中本パックス	4,500	1,677.00	7,546,500
スノーピーク	11,500	5,200.00	59,800,000
パラマウントベッドホールディングス	33,900	2,096.00	71,054,400
トランザクション	9,700	1,094.00	10,611,800
粧美堂	5,100	419.00	2,136,900
ニホンフラッシュ	15,100	1,279.00	19,312,900
前田工織	19,500	3,305.00	64,447,500
永大産業	23,100	300.00	6,930,000
アートネイチャー	17,000	702.00	11,934,000

バンダイナムコホールディングス	146,000	7,567.00	1,104,782,000
アイフィスジャパン	4,500	680.00	3,060,000
共立印刷	29,600	175.00	5,180,000
S H O E I	16,600	4,855.00	80,593,000
フランスベッドホールディングス	22,700	935.00	21,224,500
パイロットコーポレーション	29,800	4,250.00	126,650,000
萩原工業	11,400	1,509.00	17,202,600
トッパン・フォームズ	31,500	1,016.00	32,004,000
フジシールインターナショナル	36,300	2,483.00	90,132,900
タカラトミー	79,200	1,067.00	84,506,400
廣済堂	12,300	980.00	12,054,000
エステールホールディングス	4,700	653.00	3,069,100
タカノ	6,000	729.00	4,374,000
プロネクサス	14,200	1,031.00	14,640,200
ホクシン	10,900	164.00	1,787,600
ウッドワン	5,900	1,109.00	6,543,100
大建工業	11,900	2,354.00	28,012,600
凸版印刷	268,400	1,890.00	507,276,000
大日本印刷	208,700	2,611.00	544,915,700
共同印刷	5,400	2,644.00	14,277,600
N I S S H A	36,200	1,698.00	61,467,600
光村印刷	1,500	1,645.00	2,467,500
T A K A R A & C O M P A N Y	8,700	1,754.00	15,259,800
アシックス	156,100	2,315.00	361,371,500
ツツミ	4,400	2,378.00	10,463,200
ローランド	12,300	4,990.00	61,377,000
小松ウオール工業	5,400	1,954.00	10,551,600
ヤマハ	105,000	6,350.00	666,750,000
河合楽器製作所	4,900	3,775.00	18,497,500
クリナップ	16,400	557.00	9,134,800
ビジョン	106,700	3,225.00	344,107,500
兼松サステック	1,100	1,805.00	1,985,500
キングジム	14,200	879.00	12,481,800
リンテック	37,800	2,491.00	94,159,800
イトーキ	32,500	363.00	11,797,500
任天堂	101,000	52,490.00	5,301,490,000
三菱鉛筆	29,100	1,472.00	42,835,200
タカラスタンダード	36,500	1,662.00	60,663,000
コクヨ	84,700	1,944.00	164,656,800
ナカバヤシ	17,400	586.00	10,196,400
グローブライド	8,600	7,370.00	63,382,000
オカムラ	60,700	1,721.00	104,464,700

美津濃	17,500	2,598.00	45,465,000
東京電力ホールディングス	1,497,500	293.00	438,767,500
中部電力	540,200	1,332.50	719,816,500
関西電力	669,000	1,121.50	750,283,500
中国電力	254,700	1,031.00	262,595,700
北陸電力	161,400	595.00	96,033,000
東北電力	413,500	854.00	353,129,000
四国電力	146,700	775.00	113,692,500
九州電力	389,900	853.00	332,584,700
北海道電力	165,200	531.00	87,721,200
沖縄電力	34,300	1,441.00	49,426,300
電源開発	140,500	1,660.00	233,230,000
エフオン	10,700	824.00	8,816,800
イーレックス	25,900	2,215.00	57,368,500
レノバ	30,000	4,115.00	123,450,000
東京瓦斯	339,500	2,147.50	729,076,250
大阪瓦斯	319,800	2,083.00	666,143,400
東邦瓦斯	86,800	5,280.00	458,304,000
北海道瓦斯	9,500	1,581.00	15,019,500
広島ガス	36,400	378.00	13,759,200
西部ガスホールディングス	19,900	2,475.00	49,252,500
静岡ガス	45,900	1,292.00	59,302,800
メタウォーター	19,900	1,887.00	37,551,300
SBSホールディングス	13,100	3,995.00	52,334,500
東武鉄道	184,000	2,964.00	545,376,000
相鉄ホールディングス	60,500	2,280.00	137,940,000
東急	445,300	1,539.00	685,316,700
京浜急行電鉄	226,700	1,361.00	308,538,700
小田急電鉄	282,800	2,650.00	749,420,000
京王電鉄	98,700	6,150.00	607,005,000
京成電鉄	132,300	3,460.00	457,758,000
富士急行	24,100	4,615.00	111,221,500
新京成電鉄	4,500	2,154.00	9,693,000
東日本旅客鉄道	310,800	7,521.00	2,337,526,800
西日本旅客鉄道	157,300	6,084.00	957,013,200
東海旅客鉄道	146,800	16,415.00	2,409,722,000
西武ホールディングス	212,800	1,362.00	289,833,600
鴻池運輸	28,100	1,340.00	37,654,000
西日本鉄道	48,900	2,809.00	137,360,100
ハマキョウレックス	13,500	3,295.00	44,482,500
サカイ引越センター	8,100	4,870.00	39,447,000
近鉄グループホールディングス	167,200	3,890.00	650,408,000

阪急阪神ホールディングス	223,000	3,335.00	743,705,000
南海電気鉄道	79,300	2,442.00	193,650,600
京阪ホールディングス	74,500	3,215.00	239,517,500
神戸電鉄	4,000	3,590.00	14,360,000
名古屋鉄道	137,500	1,960.00	269,500,000
山陽電気鉄道	11,900	1,993.00	23,716,700
アルプス物流	11,700	944.00	11,044,800
日本通運	57,900	7,490.00	433,671,000
ヤマトホールディングス	234,300	2,777.00	650,651,100
山九	42,900	5,100.00	218,790,000
丸運	9,500	268.00	2,546,000
丸全昭和運輸	13,600	3,470.00	47,192,000
センコーグループホールディングス	92,200	970.00	89,434,000
トナミホールディングス	4,000	4,800.00	19,200,000
ニッコンホールディングス	56,100	2,336.00	131,049,600
日本石油輸送	1,800	2,645.00	4,761,000
福山通運	21,400	4,710.00	100,794,000
セイノーホールディングス	125,200	1,377.00	172,400,400
エスライン	4,600	909.00	4,181,400
神奈川中央交通	4,100	3,435.00	14,083,500
日立物流	34,500	4,615.00	159,217,500
丸和運輸機関	35,300	1,432.00	50,549,600
C & F ロジホールディングス	16,900	1,750.00	29,575,000
九州旅客鉄道	129,300	2,510.00	324,543,000
S Gホールディングス	315,900	2,986.00	943,277,400
日本郵船	140,100	8,570.00	1,200,657,000
商船三井	99,500	8,240.00	819,880,000
川崎汽船	51,500	5,380.00	277,070,000
N S ユナイテッド海運	8,600	3,595.00	30,917,000
飯野海運	82,400	523.00	43,095,200
共栄タンカー	5,400	1,051.00	5,675,400
乾汽船	11,400	2,196.00	25,034,400
日本航空	407,400	2,378.00	968,797,200
A N Aホールディングス	451,300	2,660.50	1,200,683,650
パスコ	3,200	1,487.00	4,758,400
トランコム	5,100	8,260.00	42,126,000
日新	13,300	1,524.00	20,269,200
三菱倉庫	57,900	3,120.00	180,648,000
三井倉庫ホールディングス	17,700	2,707.00	47,913,900
住友倉庫	59,100	1,768.00	104,488,800
澁澤倉庫	9,200	2,217.00	20,396,400
東陽倉庫	28,000	324.00	9,072,000

日本トランスシティ	36,800	587.00	21,601,600
ケイヒン	3,200	1,399.00	4,476,800
中央倉庫	10,200	995.00	10,149,000
川西倉庫	3,100	1,132.00	3,509,200
安田倉庫	13,700	948.00	12,987,600
ファイブホールディングス	3,000	736.00	2,208,000
東洋埠頭	5,100	1,487.00	7,583,700
宇徳	11,900	538.00	6,402,200
上組	92,000	2,384.00	219,328,000
サンリツ	4,300	772.00	3,319,600
キムラユニティー	4,500	1,351.00	6,079,500
キューソー流通システム	4,200	1,755.00	7,371,000
近鉄エクスプレス	31,600	2,592.00	81,907,200
東海運	9,500	347.00	3,296,500
エーアイティー	10,500	1,061.00	11,140,500
内外トランスライン	6,500	2,127.00	13,825,500
日本コンセプト	5,300	2,153.00	11,410,900
NEC ネットエスアイ	57,400	2,085.00	119,679,000
クロスキャット	4,900	1,066.00	5,223,400
システナ	61,900	2,211.00	136,860,900
デジタルアーツ	10,100	8,550.00	86,355,000
日鉄ソリューションズ	25,100	3,725.00	93,497,500
キューブシステム	9,100	1,095.00	9,964,500
WOW WORLD	2,900	1,675.00	4,857,500
コア	7,500	1,518.00	11,385,000
ラクーンホールディングス	12,400	2,248.00	27,875,200
ソリトンシステムズ	8,800	1,483.00	13,050,400
ソフトクリエイティブホールディングス	6,900	3,130.00	21,597,000
T I S	173,300	3,095.00	536,363,500
J N S ホールディングス	8,600	509.00	4,377,400
グリー	106,600	638.00	68,010,800
G M O ペパボ	1,900	3,680.00	6,992,000
コーエーテクモホールディングス	46,100	4,885.00	225,198,500
三菱総合研究所	7,500	4,185.00	31,387,500
電算	2,100	2,286.00	4,800,600
A G S	9,200	892.00	8,206,400
ファインデックス	14,900	1,043.00	15,540,700
ブレインパッド	4,500	5,210.00	23,445,000
K L a b	31,800	650.00	20,670,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	23,200	1,088.00	25,241,600
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	3,730.00	10,817,000
ネクソン	390,200	2,077.00	810,445,400

アイスタイル	53,400	420.00	22,428,000
エムアップホールディングス	4,600	3,045.00	14,007,000
エイチーム	12,100	1,505.00	18,210,500
エニグモ	16,500	1,461.00	24,106,500
テクノスジャパン	14,000	623.00	8,722,000
コロプラ	57,200	833.00	47,647,600
ブロードリーフ	86,300	525.00	45,307,500
クロス・マーケティンググループ	7,200	923.00	6,645,600
デジタルハーツホールディングス	8,100	1,911.00	15,479,100
システム情報	13,300	959.00	12,754,700
メディアドゥ	6,800	5,150.00	35,020,000
じげん	43,500	417.00	18,139,500
ブイキューブ	17,700	1,848.00	32,709,600
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	629.00	2,264,400
サイバーリンクス	6,000	1,561.00	9,366,000
フィックスターズ	18,800	758.00	14,250,400
CARTA HOLDINGS	7,100	2,118.00	15,037,800
オブティム	12,200	2,166.00	26,425,200
セレス	6,400	2,739.00	17,529,600
SHIFT	8,700	24,790.00	215,673,000
ティーガイア	18,600	1,957.00	36,400,200
セック	2,700	2,408.00	6,501,600
日本アジアグループ	16,700	970.00	16,199,000
テクマトリックス	27,000	1,937.00	52,299,000
プロシップ	5,300	1,600.00	8,480,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	47,100	2,187.00	103,007,700
GMOペイメントゲートウェイ	33,600	14,170.00	476,112,000
ザッパラス	7,400	598.00	4,425,200
システムリサーチ	5,200	2,026.00	10,535,200
インターネットイニシアティブ	46,200	3,755.00	173,481,000
さくらインターネット	19,100	622.00	11,880,200
ヴィンクス	5,200	954.00	4,960,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	4,630.00	18,057,000
SRAホールディングス	9,300	2,763.00	25,695,900
システムインテグレータ	5,500	607.00	3,338,500
朝日ネット	14,500	745.00	10,802,500
eBASE	21,000	782.00	16,422,000
アバント	18,700	1,531.00	28,629,700
アドソル日進	6,300	2,246.00	14,149,800
ODKソリューションズ	4,100	706.00	2,894,600
フリービット	10,700	830.00	8,881,000
コムチュア	16,000	2,963.00	47,408,000

サイバーコム	2,900	1,327.00	3,848,300
アステリア	12,900	708.00	9,133,200
アイル	9,800	1,807.00	17,708,600
マークライنز	8,800	2,874.00	25,291,200
メディカル・データ・ビジョン	22,100	1,667.00	36,840,700
g u m i	24,300	870.00	21,141,000
ショーケース	4,300	674.00	2,898,200
モバイルファクトリー	4,200	1,051.00	4,414,200
テラスカイ	5,800	2,192.00	12,713,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,988.00	15,506,400
P C Iホールディングス	8,100	1,115.00	9,031,500
パイプドHD	3,700	2,261.00	8,365,700
アイビーシー	3,200	852.00	2,726,400
ネオジャパン	3,500	1,510.00	5,285,000
P R T I M E S	3,800	3,165.00	12,027,000
ラクス	52,200	3,695.00	192,879,000
ランドコンピュータ	3,000	1,252.00	3,756,000
ダブルスタンダード	2,300	7,640.00	17,572,000
オープンドア	10,400	2,287.00	23,784,800
マイネット	6,200	661.00	4,098,200
アカツキ	7,000	3,280.00	22,960,000
ベネフィットジャパン	1,500	2,363.00	3,544,500
U b i c o mホールディングス	4,600	2,909.00	13,381,400
カナミックネットワーク	19,000	621.00	11,799,000
ノムラシステムコーポレーション	9,600	305.00	2,928,000
チェンジ	32,000	2,343.00	74,976,000
シンクロ・フード	11,400	385.00	4,389,000
オークネット	9,400	2,052.00	19,288,800
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	1,013.00	3,849,400
セグエグループ	4,800	814.00	3,907,200
エイトレッド	3,400	2,390.00	8,126,000
マクロミル	35,700	750.00	26,775,000
ビーグリー	4,200	1,509.00	6,337,800
オロ	5,500	3,645.00	20,047,500
ユーザーローカル	5,400	1,859.00	10,038,600
テモナ	4,100	799.00	3,275,900
ニーズウェル	4,200	728.00	3,057,600
マネーフォワード	26,200	8,560.00	224,272,000
サインポスト	4,200	684.00	2,872,800
電算システムホールディングス	7,200	2,638.00	18,993,600
ソルクシーズ	7,600	1,020.00	7,752,000
フェイス	5,800	670.00	3,886,000

プロトコーポレーション	20,800	1,479.00	30,763,200
ハイマックス	5,200	1,103.00	5,735,600
野村総合研究所	301,000	4,055.00	1,220,555,000
サイバネットシステム	12,800	692.00	8,857,600
C Eホールディングス	9,800	551.00	5,399,800
日本システム技術	3,300	1,940.00	6,402,000
インテージホールディングス	21,800	1,527.00	33,288,600
東邦システムサイエンス	4,900	958.00	4,694,200
ソースネクスト	83,100	232.00	19,279,200
インフォコム	15,900	2,418.00	38,446,200
HEROZ	5,100	2,045.00	10,429,500
ラクスル	18,900	5,580.00	105,462,000
I P S	4,200	2,171.00	9,118,200
F I G	20,100	275.00	5,527,500
システムサポート	5,400	1,349.00	7,284,600
イーソル	10,800	897.00	9,687,600
アルテリア・ネットワークス	19,300	1,795.00	34,643,500
E d u L a b	1,700	3,045.00	5,176,500
東海ソフト	3,000	1,262.00	3,786,000
ウイングアーク1 s t	9,500	2,403.00	22,828,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	1,877.00	7,695,700
サーバーワークス	1,800	3,760.00	6,768,000
東名	1,900	1,120.00	2,128,000
ヴィッツ	1,800	1,528.00	2,750,400
トピラシステムズ	3,600	1,250.00	4,500,000
S a n s a n	15,400	11,200.00	172,480,000
L i n k - U	3,300	1,613.00	5,322,900
ギフトィ	15,100	3,480.00	52,548,000
ベース	3,000	5,030.00	15,090,000
フォーカスシステムズ	11,900	1,016.00	12,090,400
クレスコ	11,500	1,974.00	22,701,000
フジ・メディア・ホールディングス	179,900	1,163.00	209,223,700
オービック	54,600	21,000.00	1,146,600,000
ジャストシステム	24,700	6,440.00	159,068,000
T D Cソフト	15,400	1,380.00	21,252,000
Zホールディングス	2,380,800	694.60	1,653,703,680
トレンドマイクロ	92,600	5,940.00	550,044,000
I Dホールディングス	10,300	929.00	9,568,700
日本オラクル	35,200	8,930.00	314,336,000
アルファシステムズ	4,700	3,990.00	18,753,000
フューチャー	18,400	2,433.00	44,767,200
C A C H o l d i n g s	10,300	1,656.00	17,056,800

S Bテクノロジー	6,300	3,000.00	18,900,000
トーセ	5,200	788.00	4,097,600
オービックビジネスコンサルタント	16,600	5,290.00	87,814,000
伊藤忠テクノソリューションズ	79,000	3,370.00	266,230,000
アイティフォー	23,000	875.00	20,125,000
東計電算	2,100	4,865.00	10,216,500
エクスネット	3,100	1,024.00	3,174,400
大塚商会	93,800	5,680.00	532,784,000
サイボウズ	23,200	2,482.00	57,582,400
電通国際情報サービス	25,100	4,205.00	105,545,500
A C C E S S	21,900	961.00	21,045,900
デジタルガレージ	28,700	4,930.00	141,491,000
E Mシステムズ	28,900	805.00	23,264,500
ウェザーニューズ	5,200	5,890.00	30,628,000
C I J	11,600	854.00	9,906,400
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,305.00	5,949,000
日本エンタープライズ	19,500	209.00	4,075,500
WOWOW	8,400	2,430.00	20,412,000
スカラ	15,900	725.00	11,527,500
インテリジェント ウェイブ	10,700	633.00	6,773,100
I M A G I C A G R O U P	15,500	517.00	8,013,500
ネットワンシステムズ	70,800	3,475.00	246,030,000
システムソフト	37,300	199.00	7,422,700
アルゴグラフィックス	13,500	3,340.00	45,090,000
マーベラス	27,700	685.00	18,974,500
エイベックス	30,000	1,493.00	44,790,000
日本ユニシス	60,200	2,956.00	177,951,200
兼松エレクトロニクス	9,500	3,805.00	36,147,500
都築電気	7,900	1,752.00	13,840,800
T B S ホールディングス	115,100	1,622.00	186,692,200
日本テレビホールディングス	144,800	1,186.00	171,732,800
朝日放送グループホールディングス	17,600	715.00	12,584,000
テレビ朝日ホールディングス	53,700	1,713.00	91,988,100
スカパーJ S A Tホールディングス	114,600	411.00	47,100,600
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,089.00	26,112,500
日本BS放送	6,200	1,107.00	6,863,400
ビジョン	29,800	1,186.00	35,342,800
スマートバリュー	5,100	731.00	3,728,100
U S E N - N E X T H O L D I N G S	16,500	2,944.00	48,576,000
ワイヤレスゲート	8,000	417.00	3,336,000
コネクシオ	10,000	1,543.00	15,430,000
クロップス	3,600	966.00	3,477,600

日本電信電話	2,026,500	2,958.00	5,994,387,000
KDDI	1,389,400	3,404.00	4,729,517,600
ソフトバンク	1,574,600	1,467.50	2,310,725,500
光通信	20,400	19,070.00	389,028,000
エムティーアイ	17,200	686.00	11,799,200
GMOインターネット	61,400	2,808.00	172,411,200
ファイバーゲート	5,900	1,740.00	10,266,000
アイドママーケティングコミュニケーション	5,500	381.00	2,095,500
KADOKAWA	44,900	5,040.00	226,296,000
学研ホールディングス	24,600	1,231.00	30,282,600
ゼンリン	31,600	1,040.00	32,864,000
昭文社ホールディングス	7,700	503.00	3,873,100
インプレスホールディングス	14,300	246.00	3,517,800
アイネット	9,100	1,448.00	13,176,800
松竹	11,500	12,210.00	140,415,000
東宝	102,300	4,805.00	491,551,500
東映	5,700	19,730.00	112,461,000
エヌ・ティ・ティ・データ	461,400	1,954.00	901,575,600
ピー・シー・エー	2,600	5,560.00	14,456,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,743.00	10,632,300
DTS	36,000	2,584.00	93,024,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	73,900	6,520.00	481,828,000
シーイーシー	18,700	1,578.00	29,508,600
カブコン	148,600	3,080.00	457,688,000
アイ・エス・ビー	8,300	1,212.00	10,059,600
ジャステック	10,300	1,263.00	13,008,900
SCSK	40,000	6,930.00	277,200,000
日本システムウエア	5,800	2,378.00	13,792,400
アイネス	17,200	1,569.00	26,986,800
TKC	29,400	3,725.00	109,515,000
富士ソフト	18,500	5,770.00	106,745,000
NSD	55,800	2,039.00	113,776,200
コナミホールディングス	63,000	6,950.00	437,850,000
福井コンピュータホールディングス	8,000	4,560.00	36,480,000
JBCホールディングス	11,900	1,562.00	18,587,800
ミロク情報サービス	17,300	1,628.00	28,164,400
ソフトバンクグループ	1,374,800	6,152.00	8,457,769,600
ハウスイ	1,400	929.00	1,300,600
高千穂交易	6,700	1,182.00	7,919,400
オルバヘルスケアホールディングス	2,900	1,572.00	4,558,800
伊藤忠食品	4,200	5,280.00	22,176,000
エレマテック	14,000	1,123.00	15,722,000

JALUX	4,900	1,706.00	8,359,400
あらた	13,800	4,455.00	61,479,000
トーメンデバイス	2,200	4,965.00	10,923,000
東京エレクトロン デバイス	5,700	5,440.00	31,008,000
フィールズ	15,200	493.00	7,493,600
双日	960,400	326.00	313,090,400
アルフレッサ ホールディングス	180,400	1,753.00	316,241,200
横浜冷凍	48,800	902.00	44,017,600
ラサ商事	9,200	917.00	8,436,400
アルコニクス	18,500	1,593.00	29,470,500
神戸物産	135,000	4,130.00	557,550,000
ハイパー	4,400	533.00	2,345,200
あい ホールディングス	24,800	2,221.00	55,080,800
ディーブイエックス	5,400	1,005.00	5,427,000
ダイワボウホールディングス	79,200	2,072.00	164,102,400
マクニカ・富士エレホールディングス	41,500	2,601.00	107,941,500
ラクト・ジャパン	6,000	2,733.00	16,398,000
グリムス	5,200	2,865.00	14,898,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,300	814.00	24,664,200
八洲電機	13,500	1,000.00	13,500,000
メディアスホールディングス	9,900	904.00	8,949,600
レスターホールディングス	18,100	1,922.00	34,788,200
ジューテックホールディングス	4,000	1,106.00	4,424,000
大光	6,700	688.00	4,609,600
OCHIホールディングス	5,100	1,275.00	6,502,500
TOKAIホールディングス	84,300	921.00	77,640,300
黒谷	4,800	854.00	4,099,200
Cominix	3,100	710.00	2,201,000
三洋貿易	17,500	1,133.00	19,827,500
ビューティガレージ	2,800	4,645.00	13,006,000
ウイン・パートナーズ	12,600	1,000.00	12,600,000
ミタチ産業	4,800	769.00	3,691,200
シップヘルスケアホールディングス	61,300	2,739.00	167,900,700
明治電機工業	6,000	1,358.00	8,148,000
デリカフーズホールディングス	6,800	657.00	4,467,600
スターティアホールディングス	3,400	1,805.00	6,137,000
コメダホールディングス	37,900	2,018.00	76,482,200
ピーバンドットコム	2,400	713.00	1,711,200
アセンテック	4,500	1,277.00	5,746,500
富士興産	5,300	978.00	5,183,400
協栄産業	2,000	1,450.00	2,900,000
小野建	15,600	1,561.00	24,351,600

南陽	3,600	1,993.00	7,174,800
佐島電機	10,900	856.00	9,330,400
エコートレーディング	3,700	632.00	2,338,400
伯東	10,600	1,789.00	18,963,400
コンドーテック	13,500	1,015.00	13,702,500
中山福	10,100	414.00	4,181,400
ナガイレーベン	23,100	2,552.00	58,951,200
三菱食品	19,100	2,940.00	56,154,000
松田産業	12,700	2,934.00	37,261,800
第一興商	33,000	3,805.00	125,565,000
メディパルホールディングス	174,300	2,112.00	368,121,600
S P K	7,500	1,373.00	10,297,500
萩原電気ホールディングス	6,400	2,244.00	14,361,600
アズワン	12,500	16,260.00	203,250,000
スズデン	6,100	1,511.00	9,217,100
尾家産業	5,100	1,110.00	5,661,000
シモジマ	10,700	1,092.00	11,684,400
ドウシシャ	16,400	1,754.00	28,765,600
小津産業	3,800	1,918.00	7,288,400
高速	9,200	1,631.00	15,005,200
たけびし	6,100	1,554.00	9,479,400
リックス	3,900	1,553.00	6,056,700
丸文	15,400	702.00	10,810,800
ハピネット	14,500	1,471.00	21,329,500
橋本総業ホールディングス	3,500	2,219.00	7,766,500
日本ライフライン	56,200	1,334.00	74,970,800
タカショー	11,300	994.00	11,232,200
マルカ	6,200	2,619.00	16,237,800
I D O M	58,600	920.00	53,912,000
進和	10,300	2,270.00	23,381,000
エスケイジャパン	4,300	453.00	1,947,900
ダイトロン	7,400	2,160.00	15,984,000
シークス	24,900	1,279.00	31,847,100
田中商事	5,400	658.00	3,553,200
オーハシテクニカ	8,900	1,488.00	13,243,200
白銅	6,200	2,604.00	16,144,800
ダイコー通産	2,100	1,249.00	2,622,900
伊藤忠商事	1,216,300	3,296.00	4,008,924,800
丸紅	1,714,800	876.60	1,503,193,680
高島	2,800	1,770.00	4,956,000
長瀬産業	95,500	1,808.00	172,664,000
蝶理	11,100	1,845.00	20,479,500

豊田通商	174,700	4,800.00	838,560,000
三共生興	26,400	518.00	13,675,200
兼松	69,500	1,422.00	98,829,000
ツカモトコーポレーション	2,900	1,438.00	4,170,200
三井物産	1,387,200	2,435.00	3,377,832,000
日本紙パルプ商事	9,100	3,745.00	34,079,500
カメイ	22,700	1,189.00	26,990,300
東都水産	2,000	5,830.00	11,660,000
OUGホールディングス	2,800	2,990.00	8,372,000
スターゼン	12,900	2,227.00	28,728,300
山善	68,000	1,100.00	74,800,000
椿本興業	3,200	3,780.00	12,096,000
住友商事	1,097,400	1,552.50	1,703,713,500
内田洋行	7,400	5,450.00	40,330,000
三菱商事	1,058,700	3,315.00	3,509,590,500
第一実業	7,900	4,735.00	37,406,500
キャノンマーケティングジャパン	43,100	2,480.00	106,888,000
西華産業	9,200	1,741.00	16,017,200
佐藤商事	14,400	1,176.00	16,934,400
菱洋エレクトロ	13,200	2,263.00	29,871,600
東京産業	15,800	708.00	11,186,400
ユアサ商事	17,800	3,000.00	53,400,000
神鋼商事	3,900	3,160.00	12,324,000
トルク	9,400	227.00	2,133,800
阪和興業	34,800	3,280.00	114,144,000
正栄食品工業	11,300	4,215.00	47,629,500
カナデン	14,100	1,050.00	14,805,000
菱電商事	12,500	1,800.00	22,500,000
フルサト工業	8,800	2,040.00	17,952,000
岩谷産業	41,700	6,100.00	254,370,000
ナイス	6,900	1,931.00	13,323,900
ニチモウ	2,700	2,015.00	5,440,500
極東貿易	5,000	2,393.00	11,965,000
アステナホールディングス	24,100	596.00	14,363,600
三愛石油	42,800	1,385.00	59,278,000
稲畑産業	41,800	1,661.00	69,429,800
G S I クレオス	8,500	1,040.00	8,840,000
明和産業	16,100	471.00	7,583,100
クワザワホールディングス	6,200	621.00	3,850,200
ヤマエ久野	12,700	1,200.00	15,240,000
ワキタ	34,300	1,016.00	34,848,800
東邦ホールディングス	55,800	1,919.00	107,080,200

サンゲツ	46,800	1,614.00	75,535,200
ミツウロコグループホールディングス	25,700	1,294.00	33,255,800
シナネンホールディングス	6,400	3,520.00	22,528,000
伊藤忠エネクス	38,500	986.00	37,961,000
サンリオ	48,800	2,183.00	106,530,400
サンワテクノス	11,500	1,431.00	16,456,500
リョーサン	19,200	2,226.00	42,739,200
新光商事	23,500	773.00	18,165,500
トーホー	7,900	1,621.00	12,805,900
三信電気	9,300	1,623.00	15,093,900
東陽テクニカ	17,200	1,175.00	20,210,000
モスフードサービス	24,600	3,300.00	81,180,000
加賀電子	15,700	2,935.00	46,079,500
ソーダニッカ	16,600	579.00	9,611,400
立花エレテック	12,900	1,491.00	19,233,900
フォーバル	6,100	1,004.00	6,124,400
PALTAC	27,900	4,800.00	133,920,000
三谷産業	23,000	377.00	8,671,000
西本Wismettacホールディングス	3,900	3,760.00	14,664,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	1,847.00	2,955,200
コア商事ホールディングス	13,100	648.00	8,488,800
国際紙パルプ商事	37,200	357.00	13,280,400
ヤマタネ	7,500	1,564.00	11,730,000
丸紅建材リース	1,700	1,862.00	3,165,400
日鉄物産	12,400	5,020.00	62,248,000
泉州電業	4,900	4,345.00	21,290,500
トラスコ中山	36,200	2,919.00	105,667,800
オートバックスセブン	63,000	1,552.00	97,776,000
モリト	12,700	684.00	8,686,800
加藤産業	25,100	3,420.00	85,842,000
北恵	4,400	1,042.00	4,584,800
イノテック	9,800	1,405.00	13,769,000
イエローハット	32,900	1,947.00	64,056,300
JKホールディングス	15,800	808.00	12,766,400
日伝	14,400	2,390.00	34,416,000
北沢産業	11,900	241.00	2,867,900
杉本商事	8,800	2,613.00	22,994,400
因幡電機産業	46,400	2,727.00	126,532,800
東テク	5,800	2,636.00	15,288,800
ミスミグループ本社	218,200	4,305.00	939,351,000
アルテック	11,800	320.00	3,776,000
タキヒヨー	5,800	1,783.00	10,341,400

蔵王産業	3,400	1,640.00	5,576,000
スズケン	73,700	3,260.00	240,262,000
ジェコス	12,000	897.00	10,764,000
グローセル	18,900	411.00	7,767,900
ローソン	44,000	5,390.00	237,160,000
サンエー	13,200	4,055.00	53,526,000
カワチ薬品	12,300	2,348.00	28,880,400
エービーシー・マート	27,200	5,920.00	161,024,000
ハードオフコーポレーション	8,100	788.00	6,382,800
アスクル	28,300	1,722.00	48,732,600
ゲオホールディングス	23,600	1,189.00	28,060,400
アダストリア	24,300	1,788.00	43,448,400
くら寿司	18,200	4,275.00	77,805,000
キャンドウ	8,500	1,943.00	16,515,500
アイケイ	5,600	622.00	3,483,200
パルグループホールディングス	15,500	1,664.00	25,792,000
エディオン	74,100	1,058.00	78,397,800
サーラコーポレーション	35,900	616.00	22,114,400
ワッツ	8,800	896.00	7,884,800
ハローズ	7,100	3,000.00	21,300,000
フジオフードグループ本社	14,700	1,350.00	19,845,000
あみやき亭	3,900	2,897.00	11,298,300
大黒天物産	5,600	6,910.00	38,696,000
ハニーズホールディングス	14,100	1,145.00	16,144,500
ファーマライズホールディングス	4,700	777.00	3,651,900
アルペン	13,400	3,460.00	46,364,000
ハブ	6,100	693.00	4,227,300
クオールホールディングス	23,700	1,555.00	36,853,500
ジinzホールディングス	11,900	7,140.00	84,966,000
ビックカメラ	103,500	1,066.00	110,331,000
D C Mホールディングス	107,600	1,060.00	114,056,000
Monotaro	220,000	2,375.00	522,500,000
東京一番フーズ	5,100	588.00	2,998,800
きちりホールディングス	4,600	609.00	2,801,400
アーランドサービスホールディングス	12,900	2,227.00	28,728,300
J.フロント リテイリング	208,000	965.00	200,720,000
ドトール・日レスホールディングス	27,700	1,648.00	45,649,600
マツモトキヨシホールディングス	72,000	5,110.00	367,920,000
ブロンコビリー	10,100	2,447.00	24,714,700
Z O Z O	102,600	4,160.00	426,816,000
トレジャー・ファクトリー	5,500	902.00	4,961,000
物語コーポレーション	9,300	6,150.00	57,195,000

ココカラファイン	15,500	8,670.00	134,385,000
三越伊勢丹ホールディングス	304,800	751.00	228,904,800
H a m e e	4,700	1,652.00	7,764,400
マーケットエンタープライズ	1,600	824.00	1,318,400
ウエルシアホールディングス	92,000	3,985.00	366,620,000
クリエイトSDホールディングス	25,700	3,885.00	99,844,500
丸善CHIホールディングス	20,300	385.00	7,815,500
ミサワ	4,100	670.00	2,747,000
ティーライフ	2,600	1,485.00	3,861,000
チムニー	5,300	1,480.00	7,844,000
シュッピン	12,200	1,176.00	14,347,200
オイシックス・ラ・大地	23,000	3,640.00	83,720,000
ネクステージ	35,200	2,126.00	74,835,200
ジョイフル本田	51,200	1,404.00	71,884,800
烏貴族ホールディングス	6,600	1,782.00	11,761,200
ホットランド	13,300	1,315.00	17,489,500
すかいらーくホールディングス	224,700	1,600.00	359,520,000
SFPホールディングス	8,500	1,374.00	11,679,000
綿半ホールディングス	13,400	1,248.00	16,723,200
ヨシックスホールディングス	3,600	2,066.00	7,437,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,900	1,075.00	54,717,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,300	1,456.00	13,540,800
B E E N O S	8,900	3,065.00	27,278,500
あさひ	13,200	1,343.00	17,727,600
日本調剤	10,800	1,757.00	18,975,600
コスモス薬品	17,600	19,510.00	343,376,000
トーエル	8,900	858.00	7,636,200
オンリー	3,700	763.00	2,823,100
セブン&アイ・ホールディングス	680,300	4,745.00	3,228,023,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	93,500	856.00	80,036,000
ツルハホールディングス	38,000	14,220.00	540,360,000
サンマルクホールディングス	14,000	1,522.00	21,308,000
フェリシモ	4,100	1,490.00	6,109,000
トリドールホールディングス	43,300	2,279.00	98,680,700
T O K Y O B A S E	16,400	609.00	9,987,600
ウイルプラスホールディングス	3,100	976.00	3,025,600
J Mホールディングス	11,900	2,275.00	27,072,500
サツドラホールディングス	2,800	2,168.00	6,070,400
アレンザホールディングス	13,500	1,378.00	18,603,000
串カツ田中ホールディングス	4,800	1,937.00	9,297,600
パロックジャパンリミテッド	12,500	811.00	10,137,500

クスリのアオキホールディングス	17,300	7,770.00	134,421,000
力の源ホールディングス	7,900	612.00	4,834,800
FOOD & LIFE COMPANIES	101,900	4,720.00	480,968,000
メディカルシステムネットワーク	15,600	794.00	12,386,400
はるやまホールディングス	8,800	582.00	5,121,600
ノジマ	31,100	2,703.00	84,063,300
カッパ・クリエイト	24,400	1,406.00	34,306,400
ライトオン	13,000	723.00	9,399,000
良品計画	200,300	2,394.00	479,518,200
三城ホールディングス	22,900	264.00	6,045,600
アドヴァングループ	18,100	918.00	16,615,800
アルビス	5,700	2,405.00	13,708,500
コナカ	20,500	352.00	7,216,000
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,640.00	3,936,000
G - 7ホールディングス	8,600	3,635.00	31,261,000
イオン北海道	23,100	1,182.00	27,304,200
コジマ	30,500	653.00	19,916,500
ヒマラヤ	6,400	1,253.00	8,019,200
コーナン商事	24,800	3,635.00	90,148,000
エコス	6,600	1,931.00	12,744,600
ワタミ	22,900	970.00	22,213,000
マルシェ	4,600	478.00	2,198,800
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	347,700	2,118.00	736,428,600
西松屋チェーン	38,400	1,332.00	51,148,800
ゼンショーホールディングス	93,500	2,748.00	256,938,000
幸楽苑ホールディングス	11,000	1,505.00	16,555,000
ハークスレイ	4,000	1,041.00	4,164,000
サイゼリヤ	25,900	2,475.00	64,102,500
V Tホールディングス	66,200	536.00	35,483,200
魚力	5,600	2,113.00	11,832,800
フジ・コーポレーション	9,500	1,168.00	11,096,000
ユナイテッドアローズ	20,100	1,757.00	35,315,700
ハイデイ日高	25,300	1,640.00	41,492,000
京都きもの友禅	12,600	249.00	3,137,400
コロナイド	57,800	1,789.00	103,404,200
ピーシーデポコーポレーション	21,000	472.00	9,912,000
壱番屋	12,300	4,800.00	59,040,000
P L A N T	5,000	727.00	3,635,000
スギホールディングス	34,800	8,550.00	297,540,000
薬王堂ホールディングス	7,700	2,509.00	19,319,300
スクロール	25,300	877.00	22,188,100

ヨンドシーホールディングス	16,200	1,745.00	28,269,000
木曽路	22,900	2,355.00	53,929,500
S R Sホールディングス	23,300	824.00	19,199,200
リテールパートナーズ	21,400	1,220.00	26,108,000
ケーヨー	32,300	809.00	26,130,700
上新電機	20,100	2,525.00	50,752,500
日本瓦斯	84,800	1,531.00	129,828,800
ロイヤルホールディングス	29,800	1,971.00	58,735,800
いなげや	19,500	1,470.00	28,665,000
チヨダ	17,400	804.00	13,989,600
ライフコーポレーション	16,300	4,255.00	69,356,500
リンガーハット	21,400	2,246.00	48,064,400
MrMaxHD	24,500	639.00	15,655,500
AOKIホールディングス	34,200	629.00	21,511,800
オークワ	27,400	1,142.00	31,290,800
コメリ	27,000	2,532.00	68,364,000
青山商事	39,200	653.00	25,597,600
しまむら	20,300	9,840.00	199,752,000
はせがわ	10,600	268.00	2,840,800
高島屋	126,800	1,119.00	141,889,200
松屋	38,200	932.00	35,602,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	82,600	852.00	70,375,200
近鉄百貨店	6,800	2,417.00	16,435,600
丸井グループ	147,200	1,978.00	291,161,600
アクシアル リテイリング	14,500	4,055.00	58,797,500
イオン	669,200	2,922.00	1,955,402,400
イズミ	35,400	3,575.00	126,555,000
平和堂	32,200	2,182.00	70,260,400
フジ	21,100	1,943.00	40,997,300
ヤオコー	19,800	7,160.00	141,768,000
ゼビオホールディングス	21,400	1,109.00	23,732,600
ケースホールディングス	148,300	1,212.00	179,739,600
Olympicグループ	9,500	767.00	7,286,500
日産東京販売ホールディングス	27,200	243.00	6,609,600
シルバーライフ	3,700	1,910.00	7,067,000
Genky DrugStores	7,700	5,090.00	39,193,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,700	920.00	3,404,000
ブックオフグループホールディングス	10,100	964.00	9,736,400
ギフト	2,900	2,248.00	6,519,200
アインホールディングス	25,300	7,370.00	186,461,000
元気寿司	5,000	2,617.00	13,085,000
ヤマダホールディングス	583,700	482.00	281,343,400

アークランドサカモト	27,500	1,553.00	42,707,500
ニトリホールディングス	69,000	20,370.00	1,405,530,000
グルメ杵屋	12,800	996.00	12,748,800
愛眼	13,900	225.00	3,127,500
ケーユーホールディングス	9,500	1,018.00	9,671,000
吉野家ホールディングス	57,300	2,037.00	116,720,100
松屋フーズホールディングス	8,500	3,600.00	30,600,000
サガミホールディングス	25,700	1,032.00	26,522,400
関西スーパーマーケット	13,400	1,320.00	17,688,000
王将フードサービス	11,600	5,980.00	69,368,000
プレナス	19,700	2,034.00	40,069,800
ミニストップ	13,000	1,407.00	18,291,000
アークス	33,400	2,254.00	75,283,600
パローホールディングス	35,700	2,460.00	87,822,000
ベルク	8,600	5,860.00	50,396,000
大庄	9,700	989.00	9,593,300
ファーストリテイリング	23,300	71,030.00	1,654,999,000
サンドラッグ	65,500	3,680.00	241,040,000
サックスパー ホールディングス	15,400	552.00	8,500,800
ヤマザワ	4,300	1,725.00	7,417,500
やまや	3,600	2,440.00	8,784,000
ベルーナ	37,800	827.00	31,260,600
島根銀行	6,000	584.00	3,504,000
じもとホールディングス	11,800	712.00	8,401,600
めぶきフィナンシャルグループ	904,800	247.00	223,485,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,800	1,631.00	35,555,800
九州フィナンシャルグループ	355,600	430.00	152,908,000
ゆうちょ銀行	493,300	958.00	472,581,400
富山第一銀行	41,500	293.00	12,159,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,060,900	429.00	455,126,100
西日本フィナンシャルホールディングス	113,700	703.00	79,931,100
三十三フィナンシャルグループ	15,100	1,472.00	22,227,200
第四北越フィナンシャルグループ	28,300	2,705.00	76,551,500
ひろぎんホールディングス	256,800	643.00	165,122,400
新生銀行	142,000	1,370.00	194,540,000
あおぞら銀行	103,700	2,606.00	270,242,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,912,300	590.30	7,031,830,690
りそなホールディングス	2,009,600	427.30	858,702,080
三井住友トラスト・ホールディングス	329,200	3,618.00	1,191,045,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,205,100	3,793.00	4,570,944,300
千葉銀行	581,200	696.00	404,515,200
群馬銀行	358,400	358.00	128,307,200

武蔵野銀行	25,900	1,791.00	46,386,900
千葉興業銀行	44,300	287.00	12,714,100
筑波銀行	72,400	174.00	12,597,600
七十七銀行	54,600	1,258.00	68,686,800
青森銀行	13,500	2,150.00	29,025,000
秋田銀行	10,400	1,462.00	15,204,800
山形銀行	19,600	879.00	17,228,400
岩手銀行	11,400	1,710.00	19,494,000
東邦銀行	155,700	216.00	33,631,200
東北銀行	8,300	1,015.00	8,424,500
みちのく銀行	11,200	892.00	9,990,400
ふくおかフィナンシャルグループ	157,200	2,051.00	322,417,200
静岡銀行	424,100	872.00	369,815,200
十六銀行	21,800	2,322.00	50,619,600
スルガ銀行	152,700	365.00	55,735,500
八十二銀行	392,200	384.00	150,604,800
山梨中央銀行	20,200	841.00	16,988,200
大垣共立銀行	34,400	1,949.00	67,045,600
福井銀行	14,900	1,590.00	23,691,000
北國銀行	16,200	2,119.00	34,327,800
清水銀行	7,200	1,638.00	11,793,600
富山銀行	3,400	1,967.00	6,687,800
滋賀銀行	34,900	1,890.00	65,961,000
南都銀行	25,300	2,019.00	51,080,700
百五銀行	156,700	325.00	50,927,500
京都銀行	62,400	4,875.00	304,200,000
紀陽銀行	61,700	1,594.00	98,349,800
ほくほくフィナンシャルグループ	115,900	851.00	98,630,900
山陰合同銀行	109,700	585.00	64,174,500
中国銀行	149,900	888.00	133,111,200
鳥取銀行	5,500	1,126.00	6,193,000
伊予銀行	230,700	594.00	137,035,800
百十四銀行	18,500	1,589.00	29,396,500
四国銀行	24,700	730.00	18,031,000
阿波銀行	26,700	2,199.00	58,713,300
大分銀行	10,000	1,788.00	17,880,000
宮崎銀行	10,900	2,050.00	22,345,000
佐賀銀行	9,900	1,450.00	14,355,000
沖縄銀行	15,900	2,716.00	43,184,400
琉球銀行	37,800	816.00	30,844,800
セブン銀行	581,800	250.00	145,450,000
みずほフィナンシャルグループ	2,366,300	1,545.50	3,657,116,650

高知銀行	6,300	781.00	4,920,300
山口フィナンシャルグループ	217,400	648.00	140,875,200
長野銀行	5,700	1,158.00	6,600,600
名古屋銀行	14,000	2,677.00	37,478,000
北洋銀行	262,500	263.00	69,037,500
愛知銀行	5,800	3,495.00	20,271,000
中京銀行	6,300	1,356.00	8,542,800
大光銀行	6,000	1,367.00	8,202,000
愛媛銀行	24,300	788.00	19,148,400
トマト銀行	6,700	1,084.00	7,262,800
京葉銀行	74,300	447.00	33,212,100
栃木銀行	84,100	174.00	14,633,400
北日本銀行	5,400	1,578.00	8,521,200
東和銀行	30,600	508.00	15,544,800
福島銀行	20,000	243.00	4,860,000
大東銀行	8,400	619.00	5,199,600
トモニホールディングス	134,600	326.00	43,879,600
フィデアホールディングス	169,100	127.00	21,475,700
池田泉州ホールディングス	200,300	167.00	33,450,100
F P G	59,000	687.00	40,533,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,600	1,424.00	19,366,400
マーキュリアホールディングス	6,200	732.00	4,538,400
S B Iホールディングス	214,700	2,624.00	563,372,800
ジャフコ グループ	22,200	6,450.00	143,190,000
大和証券グループ本社	1,304,600	622.40	811,983,040
野村ホールディングス	2,659,300	536.90	1,427,778,170
岡三証券グループ	149,000	408.00	60,792,000
丸三証券	52,200	633.00	33,042,600
東洋証券	59,300	150.00	8,895,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	186,400	399.00	74,373,600
光世証券	4,700	563.00	2,646,100
水戸証券	47,400	305.00	14,457,000
いちよし証券	35,300	634.00	22,380,200
松井証券	85,600	800.00	68,480,000
マネックスグループ	156,600	576.00	90,201,600
極東証券	23,700	810.00	19,197,000
岩井コスモホールディングス	18,000	1,370.00	24,660,000
藍澤證券	31,500	1,039.00	32,728,500
マネーパートナーズグループ	19,900	207.00	4,119,300
スパークス・グループ	81,500	277.00	22,575,500
かんぽ生命保険	215,900	2,003.00	432,447,700
S O M P Oホールディングス	307,000	4,833.00	1,483,731,000

アニコム ホールディングス	49,000	900.00	44,100,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	422,900	3,563.00	1,506,792,700
第一生命ホールディングス	857,100	2,198.00	1,883,905,800
東京海上ホールディングス	573,500	5,374.00	3,081,989,000
T & D ホールディングス	520,500	1,379.00	717,769,500
アドバンスクリエイト	8,300	978.00	8,117,400
全国保証	45,400	5,300.00	240,620,000
あんしん保証	7,300	310.00	2,263,000
イントラスト	5,500	693.00	3,811,500
日本モーゲージサービス	9,300	1,094.00	10,174,200
C a s a	5,300	936.00	4,960,800
アルヒ	26,000	1,340.00	34,840,000
プレミアグループ	8,200	3,370.00	27,634,000
クレディセゾン	102,000	1,267.00	129,234,000
芙蓉総合リース	18,300	7,620.00	139,446,000
みずほリース	27,000	3,525.00	95,175,000
東京センチュリー	40,500	6,200.00	251,100,000
日本証券金融	74,200	862.00	63,960,400
アイフル	293,400	350.00	102,690,000
リコーリース	13,800	3,660.00	50,508,000
イオンフィナンシャルサービス	106,900	1,302.00	139,183,800
アコム	344,500	430.00	148,135,000
ジャックス	19,400	2,732.00	53,000,800
オリエントコーポレーション	473,900	152.00	72,032,800
オリックス	1,057,400	2,063.00	2,181,416,200
三菱H C キャピタル	603,000	588.00	354,564,000
九州リースサービス	9,300	599.00	5,570,700
日本取引所グループ	470,600	2,643.00	1,243,795,800
イー・ギャランティ	20,600	2,428.00	50,016,800
アサックス	9,600	698.00	6,700,800
N E C キャピタルソリューション	7,300	2,113.00	15,424,900
いちご	199,500	351.00	70,024,500
日本駐車場開発	202,600	170.00	34,442,000
スター・マイカ・ホールディングス	10,900	1,439.00	15,685,100
S R E ホールディングス	2,800	7,490.00	20,972,000
A D ワークスグループ	34,200	159.00	5,437,800
ヒューリック	370,900	1,297.00	481,057,300
三栄建築設計	7,900	1,872.00	14,788,800
野村不動産ホールディングス	100,600	2,880.00	289,728,000
三重交通グループホールディングス	39,200	501.00	19,639,200
サムティ	25,600	2,324.00	59,494,400
ディア・ライフ	26,300	490.00	12,887,000

日本商業開発	12,200	1,708.00	20,837,600
プレサンスコーポレーション	29,800	1,688.00	50,302,400
ハウスコム	4,600	1,249.00	5,745,400
日本管理センター	9,800	1,249.00	12,240,200
サンセイランディック	7,400	808.00	5,979,200
フージャースホールディングス	28,400	663.00	18,829,200
オープンハウス	55,600	5,300.00	294,680,000
東急不動産ホールディングス	476,600	643.00	306,453,800
飯田グループホールディングス	146,000	2,719.00	396,974,000
イーランド	4,300	1,421.00	6,110,300
ムゲンエステート	14,600	470.00	6,862,000
ハウストゥ	8,600	1,047.00	9,004,200
シーアールイー	5,700	1,662.00	9,473,400
グッドコムアセット	8,800	1,426.00	12,548,800
ジェイ・エス・ビー	4,100	3,445.00	14,124,500
テンポイノベーション	7,000	905.00	6,335,000
フェイスネットワーク	2,800	1,363.00	3,816,400
パーク24	94,400	2,147.00	202,676,800
パラカ	5,600	1,817.00	10,175,200
三井不動産	794,400	2,527.50	2,007,846,000
三菱地所	1,145,100	1,742.00	1,994,764,200
平和不動産	30,300	4,300.00	130,290,000
東京建物	173,100	1,703.00	294,789,300
ダイビル	45,500	1,483.00	67,476,500
京阪神ビルディング	31,300	1,543.00	48,295,900
住友不動産	392,000	3,581.00	1,403,752,000
テーオーシー	37,100	666.00	24,708,600
東京楽天地	3,300	4,140.00	13,662,000
スターツコーポレーション	21,400	2,915.00	62,381,000
フジ住宅	23,000	684.00	15,732,000
空港施設	20,700	592.00	12,254,400
明和地所	11,300	603.00	6,813,900
ゴールドクレスト	16,800	1,701.00	28,576,800
エスリード	8,000	1,605.00	12,840,000
日神グループホールディングス	29,500	501.00	14,779,500
日本エスコン	32,400	789.00	25,563,600
タカラレーベン	73,000	322.00	23,506,000
A V A N T I A	11,000	879.00	9,669,000
イオンモール	88,400	1,667.00	147,362,800
毎日コムネット	8,400	749.00	6,291,600
ファースト住建	8,000	1,271.00	10,168,000
カチタス	43,600	3,605.00	157,178,000

トーセイ	25,600	1,178.00	30,156,800
穴吹興産	4,800	2,014.00	9,667,200
サンフロンティア不動産	23,100	1,159.00	26,772,900
エフ・ジェー・ネクスト	18,900	1,035.00	19,561,500
インテリックス	3,900	743.00	2,897,700
ランドビジネス	7,300	269.00	1,963,700
サンネクスタグループ	7,400	994.00	7,355,600
グランディハウス	15,900	495.00	7,870,500
日本空港ビルデング	60,900	5,010.00	305,109,000
明豊ファシリティワークス	8,000	932.00	7,456,000
日本工営	10,000	3,100.00	31,000,000
L I F U L L	52,400	338.00	17,711,200
ミクシィ	43,000	2,485.00	106,855,000
ジェイエシーリクルートメント	14,100	1,758.00	24,787,800
日本M&Aセンター	276,800	3,205.00	887,144,000
メンバーズ	5,100	3,250.00	16,575,000
中広	3,100	383.00	1,187,300
UTグループ	24,400	2,899.00	70,735,600
アイティメディア	5,800	2,281.00	13,229,800
タケエイ	19,000	1,624.00	30,856,000
E・Jホールディングス	9,100	1,235.00	11,238,500
夢真ビーネックスグループ	45,200	1,200.00	54,240,000
コシダカホールディングス	45,700	575.00	26,277,500
アルトナー	4,500	812.00	3,654,000
パソナグループ	18,400	2,689.00	49,477,600
C D S	4,400	1,650.00	7,260,000
リンクアンドモチベーション	37,200	1,053.00	39,171,600
G C A	24,800	1,377.00	34,149,600
エス・エム・エス	57,400	3,790.00	217,546,000
サニーサイドアップグループ	6,200	722.00	4,476,400
パーソルホールディングス	168,800	2,574.00	434,491,200
リニカル	9,800	823.00	8,065,400
クックパッド	54,300	226.00	12,271,800
アイ・ケイ・ケイ	8,700	691.00	6,011,700
学情	7,100	1,173.00	8,328,300
スタジオアリス	8,600	2,263.00	19,461,800
シミックホールディングス	9,500	1,482.00	14,079,000
エプコ	4,000	815.00	3,260,000
N J S	3,900	1,876.00	7,316,400
総合警備保障	67,200	5,070.00	340,704,000
カカクコム	124,700	3,395.00	423,356,500
アイロムグループ	6,100	2,082.00	12,700,200

セントケア・ホールディング	12,700	918.00	11,658,600
サイネックス	3,300	670.00	2,211,000
ルネサンス	10,800	1,197.00	12,927,600
ディップ	26,500	3,475.00	92,087,500
デジタルホールディングス	11,900	1,656.00	19,706,400
新日本科学	20,900	860.00	17,974,000
キャリアデザインセンター	4,500	1,158.00	5,211,000
ベネフィット・ワン	61,500	4,435.00	272,752,500
エムスリー	297,700	7,217.00	2,148,500,900
ツカダ・グローバルホールディング	10,700	334.00	3,573,800
アウトソーシング	96,800	1,790.00	173,272,000
ウェルネット	17,600	506.00	8,905,600
ワールドホールディングス	6,900	2,612.00	18,022,800
ディー・エヌ・エー	71,500	1,959.00	140,068,500
博報堂D Yホールディングス	235,000	1,749.00	411,015,000
ぐるなび	30,000	468.00	14,040,000
タカミヤ	21,100	481.00	10,149,100
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	1,076.00	12,266,400
ファンコミュニケーションズ	42,900	410.00	17,589,000
ライク	4,600	1,773.00	8,155,800
ビジネス・ブレークスルー	7,800	404.00	3,151,200
エスプール	48,000	927.00	44,496,000
WDBホールディングス	7,800	3,440.00	26,832,000
手間いらず	2,200	5,540.00	12,188,000
ティア	10,400	512.00	5,324,800
C D G	1,700	1,557.00	2,646,900
アドウェイズ	27,900	672.00	18,748,800
バリューコマース	13,300	4,445.00	59,118,500
インフォマート	185,200	979.00	181,310,800
J Pホールディングス	49,300	279.00	13,754,700
エコナックホールディングス	33,900	88.00	2,983,200
レッグス	3,700	2,238.00	8,280,600
プレステージ・インターナショナル	63,600	737.00	46,873,200
アミューズ	9,300	2,373.00	22,068,900
ドリームインキュベータ	5,500	891.00	4,900,500
クイック	10,700	1,362.00	14,573,400
T A C	10,500	233.00	2,446,500
電通グループ	174,000	4,120.00	716,880,000
イオンファンタジー	6,700	1,880.00	12,596,000
シーティーエス	19,400	749.00	14,530,600
ネクシィーズグループ	6,200	870.00	5,394,000
H . U . グループホールディングス	47,300	3,180.00	150,414,000

アルプス技研	15,100	1,939.00	29,278,900
ダイオーズ	3,600	1,056.00	3,801,600
日本空調サービス	18,100	722.00	13,068,200
オリエンタルランド	179,400	16,720.00	2,999,568,000
ダスキン	39,300	2,631.00	103,398,300
明光ネットワークジャパン	20,300	575.00	11,672,500
ファルコホールディングス	8,200	1,762.00	14,448,400
ラウンドワン	57,800	1,304.00	75,371,200
リゾートトラスト	77,500	1,888.00	146,320,000
ビー・エム・エル	21,800	4,375.00	95,375,000
りらいあコミュニケーションズ	25,900	1,190.00	30,821,000
リソー教育	86,400	394.00	34,041,600
早稲田アカデミー	7,500	948.00	7,110,000
ユー・エス・エス	189,000	1,823.00	344,547,000
東京個別指導学院	15,400	590.00	9,086,000
サイバーエージェント	416,000	1,989.00	827,424,000
楽天グループ	865,400	1,114.00	964,055,600
クリーク・アンド・リバー社	9,000	1,773.00	15,957,000
モーニングスター	25,200	487.00	12,272,400
テー・オー・ダブリュー	30,500	321.00	9,790,500
山田コンサルティンググループ	10,100	1,118.00	11,291,800
セントラルスポーツ	6,400	2,438.00	15,603,200
フルキャストホールディングス	14,500	2,108.00	30,566,000
エン・ジャパン	30,100	3,615.00	108,811,500
リソルホールディングス	1,900	3,970.00	7,543,000
テクノプロ・ホールディングス	101,100	2,958.00	299,053,800
アトラグループ	3,700	320.00	1,184,000
インターワークス	5,600	395.00	2,212,000
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	12,730.00	87,837,000
K e e P e r 技研	10,900	3,525.00	38,422,500
ファーストロジック	3,600	774.00	2,786,400
三機サービス	3,500	1,089.00	3,811,500
G u n o s y	11,000	674.00	7,414,000
デザインワン・ジャパン	5,500	219.00	1,204,500
イー・ガーディアン	6,900	3,305.00	22,804,500
リブセンス	10,800	208.00	2,246,400
ジャパンマテリアル	52,100	1,232.00	64,187,200
ベクトル	21,300	1,018.00	21,683,400
ウチヤマホールディングス	9,200	326.00	2,999,200
チャーム・ケア・コーポレーション	12,800	1,523.00	19,494,400
キャリアリンク	5,700	1,968.00	11,217,600
I B J	14,100	968.00	13,648,800

アサンテ	6,300	1,752.00	11,037,600
バリューHR	6,900	1,611.00	11,115,900
M&Aキャピタルパートナーズ	14,000	5,200.00	72,800,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,700	1,627.00	10,900,900
E R Iホールディングス	5,000	1,020.00	5,100,000
アビスト	2,700	2,971.00	8,021,700
シグマクシス	9,400	2,475.00	23,265,000
ウィルグループ	12,600	1,299.00	16,367,400
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	26,500	205.00	5,432,500
メドピア	13,100	3,945.00	51,679,500
レアジョブ	3,400	1,323.00	4,498,200
リクルートホールディングス	1,208,600	6,376.00	7,706,033,600
エラン	23,500	1,254.00	29,469,000
土木管理総合試験所	8,600	365.00	3,139,000
ネットマーケティング	9,000	431.00	3,879,000
日本郵政	1,276,900	940.00	1,200,286,000
ベルシステム24ホールディングス	28,500	1,588.00	45,258,000
鎌倉新書	17,300	1,048.00	18,130,400
S MN	4,100	652.00	2,673,200
グローバルキッズCOMPANY	3,500	749.00	2,621,500
エアトリ	10,800	2,903.00	31,352,400
アトラエ	11,800	2,680.00	31,624,000
ストライク	6,400	3,960.00	25,344,000
ソラスト	41,600	1,500.00	62,400,000
セラク	5,500	2,069.00	11,379,500
インソース	16,500	2,073.00	34,204,500
バイカレント・コンサルティング	11,100	54,400.00	603,840,000
Orchestra Holdings	3,300	3,505.00	11,566,500
アイモバイル	5,000	1,453.00	7,265,000
キャリアインデックス	7,200	1,046.00	7,531,200
MS - Japan	7,100	1,008.00	7,156,800
船場	3,700	786.00	2,908,200
グレイステクノロジー	17,500	1,157.00	20,247,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,800	2,855.00	139,324,000
フルテック	2,600	1,345.00	3,497,000
GameWith	5,600	526.00	2,945,600
ソウルドアウト	4,200	1,763.00	7,404,600
MS&Consulting	3,200	605.00	1,936,000
ウェルビー	6,500	1,515.00	9,847,500
エル・ティー・エス	2,200	3,450.00	7,590,000
ミダック	7,400	4,365.00	32,301,000
日総工産	13,600	748.00	10,172,800

キュービーネットホールディングス	7,900	1,766.00	13,951,400
R P Aホールディングス	20,800	598.00	12,438,400
スプリックス	5,100	938.00	4,783,800
マネジメントソリューションズ	8,400	2,838.00	23,839,200
プロレド・パートナーズ	3,800	2,356.00	8,952,800
テノ・ホールディングス	2,400	938.00	2,251,200
フロンティア・マネジメント	4,700	1,042.00	4,897,400
ピアラ	3,100	867.00	2,687,700
コプロ・ホールディングス	2,500	1,125.00	2,812,500
ギークス	3,100	1,622.00	5,028,200
カーブスホールディングス	46,700	837.00	39,087,900
フォーラムエンジニアリング	12,100	872.00	10,551,200
ダイレクトマーケティングミックス	9,100	4,190.00	38,129,000
ポピンズホールディングス	4,000	2,920.00	11,680,000
L I T A L I C O	6,900	5,130.00	35,397,000
アドバンテッジリスクマネジメント	8,800	1,121.00	9,864,800
リログループ	92,300	2,486.00	229,457,800
東祥	10,700	1,670.00	17,869,000
エイチ・アイ・エス	37,200	2,581.00	96,013,200
ラックランド	4,900	2,799.00	13,715,100
共立メンテナンス	28,000	3,670.00	102,760,000
イチネンホールディングス	17,800	1,221.00	21,733,800
建設技術研究所	10,200	2,465.00	25,143,000
スペース	12,400	912.00	11,308,800
長大	6,900	1,862.00	12,847,800
燦ホールディングス	7,500	1,425.00	10,687,500
スバル興業	1,100	7,970.00	8,767,000
東京テアトル	6,600	1,251.00	8,256,600
タナベ経営	3,400	1,501.00	5,103,400
ナガワ	5,400	10,640.00	57,456,000
東京都競馬	12,700	4,260.00	54,102,000
カナモト	29,900	2,508.00	74,989,200
西尾レントオール	15,700	2,897.00	45,482,900
トランス・コスモス	16,100	3,440.00	55,384,000
乃村工藝社	72,600	905.00	65,703,000
藤田観光	7,400	2,224.00	16,457,600
K N T - C Tホールディングス	9,000	1,372.00	12,348,000
日本管財	18,200	2,625.00	47,775,000
トーカイ	16,400	2,385.00	39,114,000
セコム	166,300	8,347.00	1,388,106,100
セントラル警備保障	8,200	2,602.00	21,336,400
丹青社	32,200	858.00	27,627,600

メイテック	20,400	6,390.00	130,356,000	
応用地質	19,200	1,320.00	25,344,000	
船井総研ホールディングス	34,700	2,708.00	93,967,600	
進学会ホールディングス	7,300	423.00	3,087,900	
オオバ	12,200	811.00	9,894,200	
いであ	4,700	1,861.00	8,746,700	
学究社	5,100	1,382.00	7,048,200	
ベネッセホールディングス	62,000	2,384.00	147,808,000	
イオンディライト	20,900	3,480.00	72,732,000	
ナック	8,300	926.00	7,685,800	
ダイセキ	33,960	4,460.00	151,461,600	
ステップ	6,300	1,777.00	11,195,100	
合 計	184,983,060		471,975,714,930	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 8月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	437,793,431
コール・ローン	5,611,940,512
国債証券	289,902,524,323
派生商品評価勘定	14,728,832
未収利息	1,545,629,789
前払費用	38,107,316
差入委託証拠金	491,488,446
流動資産合計	298,042,212,649
資産合計	298,042,212,649
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,967,432
前受金	369,782

	2021年 8月30日現在
項目	金額（円）
未払解約金	33,325,867
未払利息	9,704
流動負債合計	54,672,785
負債合計	54,672,785
純資産の部	
元本等	
元本	96,783,804,165
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	201,203,735,699
元本等合計	297,987,539,864
純資産合計	297,987,539,864
負債純資産合計	298,042,212,649

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

	2021年 8月30日現在
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2021年 8月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	96,783,804,165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 3.0789円 (1万口当たり純資産額) (30,789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 8月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月30日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<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 8月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	97,121,104,574円
期中追加設定元本額	17,753,270,544円

区分	2021年 8月30日現在
期中一部解約元本額	18,090,570,953円
期末元本額	96,783,804,165円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,408,849,351円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	603,282,534円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,087,855,490円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,694,556円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	7,442,214,223円
世界経済インデックスファンド	10,596,941,935円
DCマイセレクション25	1,920,837,617円
DCマイセレクション50	1,619,649,817円
DCマイセレクション75	1,104,816,151円
DC外国債券インデックス・オープン	2,220,132,290円
DCマイセレクションS25	904,740,353円
DCマイセレクションS50	699,855,884円
DCマイセレクションS75	371,948,092円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	33,847,224円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	86,338,817円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	43,515,108円
DC世界経済インデックスファンド	11,623,141,575円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	635,114,350円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	225,076円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,235,701円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,233,869円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	32,018,598円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	61,785,845円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	106,632,165円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	88,244,203円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	87,030,560円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,523,081,342円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	471,954,017円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,873,963,697円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	220,294,709円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	61,754,529円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	494,646,709円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	184,968,047円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	227,879,181円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	777,788,384円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	2,055,913,187円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	742,940,466円
外国債券ファンド・シリーズ1	628,143,326円

区分	2021年 8月30日現在
コア投資戦略ファンド(安定型)	911,972,296円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,396,565,810円
分散投資コア戦略ファンドA	256,969,288円
分散投資コア戦略ファンドS	551,227,295円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	479,848,653円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,746,376,828円
コア投資戦略ファンド(切替型)	957,038,082円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	233,456,949円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	102,492,162円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,299,974,131円
SMT インデックスバランス・オープン	195,413,567円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	18,123,586,009円
SMT 世界経済インデックス・オープン	194,820,634円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	221,393,803円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	360,611,003円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,684,202円
グローバル経済コア	771,117,489円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	12,748,450円
DCターゲット・イヤーフンド2055	1,313,629円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	271,449,363円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	33,978,653円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	4,423,606円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	4,183,384円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	2,153,152円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	2,177,543円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	503,031,815円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	10,601,311,536円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	337,207,265円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	344,328,335円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	221,806,158円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	185,883,196円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	43,657円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	20,374円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 8月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		4,634,616,962
合計		4,634,616,962

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2021年 8月30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	5,825,025,597	-	5,825,395,379	369,782
合計		5,825,025,597	-	5,825,395,379	369,782

(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。

- 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。
- 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。
- 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30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	5,798,569,449	-	5,791,961,067	6,608,382
	アメリカドル	2,698,469,523	-	2,691,416,882	7,052,641
	カナダドル	248,551,014	-	246,936,296	1,614,718
	ユーロ	2,448,618,645	-	2,453,498,964	4,880,319
	イギリスポンド	402,930,267	-	400,108,925	2,821,342
合計		5,798,569,449	-	5,791,961,067	6,608,382

(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% 01/15/24	10,000,000.00	9,960,156.30	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,690,129.68	
		T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,996,875.00	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,495,019.55	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,044,257.85	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,980,625.04	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,238,955.07	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,400,249.98	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,976,640.69	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,165,859.37	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,968,359.40	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,009,843.76	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	986,406.25	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,855,078.10	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,376,660.17	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,536,859.38	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,879,062.48	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	7,004,921.91	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,940,937.52	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,196,445.36	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,722,812.48	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,960,390.64	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,943,593.76	
		T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,384,550.81	
		T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,812,492.18	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,206,462.50	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,875,572.66	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,419,199.21	
		T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,931,097.67	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,536,400.76	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,284,082.05	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,390,593.75	
		T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	15,106,394.61	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,444,628.90			

T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,769,140.60	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,357,890.62	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	11,004,726.59	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,999,765.64	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	8,035,937.52	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,778,043.02	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,853,644.60	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	8,053,125.04	
T 1.125% 05/15/40	6,260,000.00	5,590,473.46	
T 1.125% 08/15/40	9,300,000.00	8,277,726.60	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,220,007.81	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	8,105,000.00	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	7,369,394.57	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,641,977.52	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	4,115,781.24	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,109,472.65	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,701,945.36	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,558,154.30	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,095,468.76	
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,071,582.05	
T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	12,065,625.00	
T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,317,582.00	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,204,375.00	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,622,146.12	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,958,742.16	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,085,546.88	
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,136,914.10	
T 1.5% 08/15/26	2,400,000.00	2,482,218.74	
T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,640,273.48	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,778,242.23	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,421,785.13	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,585,244.14	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,360,711.33	
T 1.625% 05/15/31	9,470,000.00	9,765,197.70	
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,025,468.75	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,537,109.37	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,987,304.68	
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,077,636.70	
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,574,707.02	
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,597,703.12	
T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,228,028.10	
T 1.625% 11/15/50	11,300,000.00	10,565,500.00	

T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,137,373.48
T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,670,382.80
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,723,561.51
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,790,177.74
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,492,718.74
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,242,740.22
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,135,234.39
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	7,979,617.22
T 1.875% 02/15/51	9,900,000.00	9,818,015.62
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,149,589.81
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,463,691.43
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,072,031.24
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,261,562.50
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,711,485.55
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,604,965.81
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,331,093.75
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,741,960.95
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,536,218.74
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,829,359.38
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,040,750.00
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	5,258,593.75
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,792,120.31
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,461,728.15
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,189,218.76
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,611,810.52
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	8,012,695.35
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,353,554.67
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,202,271.46
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	7,811,690.62
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,913,359.37
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,655,359.37
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,729,660.20
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,688,406.27
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,239,587.87
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,706,367.21
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,887,593.79
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,159,277.35
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,056,324.98
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,794,289.05
T 2.375% 05/15/27	5,840,000.00	6,320,431.27
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,735,906.25
T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	3,048,847.67
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,290,039.05

T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	6,738,117.21	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,654,208.21	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,337,109.40	
T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,588,679.68	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,484,062.52	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,200,688.47	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,357,335.97	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,665,468.75	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,754,305.64	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,081,138.68	
T 2.625% 02/15/29	7,490,000.00	8,294,589.88	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,452,335.93	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,783,837.87	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,118,298.82	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,690,859.37	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,300,377.32	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,180,351.57	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,265,638.65	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,755,320.30	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,055,054.69	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,947,734.37	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,048,906.25	
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,508,203.12	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	5,828,625.00	
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,576,054.69	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,476,796.87	
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,447,418.76	
T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,272,081.25	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,594,472.67	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,334,687.52	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,124,393.75	
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,913,859.37	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,754,495.31	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,143,506.25	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,937,110.14	
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	4,395,300.00	
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,132,789.08	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,011,064.46	
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,641,992.20	
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,255,546.87	
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,190,527.32	
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,136,132.80	

T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,888,617.94
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,103,515.65
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,504,266.03
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,457,527.72
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,750,722.67
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,053,261.73
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,261,144.93
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,221,679.70
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,832,002.31
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,047,382.82
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,289,367.18
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	2,457,656.26
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,480,602.37
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	5,120,015.62
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,582,562.50
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,145,527.35
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,862,441.42
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	6,996,414.08
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	987,645.31
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,189,562.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,647,187.50
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,668,125.00
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	4,048,593.75
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,956,480.47
T 3% 02/15/47	800,000.00	982,500.00
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,487,058.61
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,675,078.16
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,951,467.19
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,260,976.58
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,022,853.93
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,732,878.93
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,598,015.64
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,481,054.70
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	3,397,187.50
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,261,757.81
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,323,781.25
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,407,265.63
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,719,968.75
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,808,914.06
T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,795,795.31
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,525,659.37
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	785,855.47
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,454,375.00

	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	2,028,600.00
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,127,929.68
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,635,390.62
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,677,609.37
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,673,937.50
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,559,718.75
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,096,312.50
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,903,068.36
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,490,917.97
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,845,486.32
	アメリカドル 小計	1,142,350,000.00	1,196,793,793.47 (131,336,150,895)
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,056,817.60
	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,221,563.60
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,381,808.00
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,594,748.00
	CAN 0.25% 08/01/22	910,000.00	909,872.60
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,355,104.00
	CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,769,079.60
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,454,555.20
	CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,272,549.40
	CAN 1.25% 03/01/25	1,960,000.00	1,999,219.60
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,672,715.60
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,091,100.40
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,402,282.40
	CAN 1.5% 06/01/31	2,220,000.00	2,270,904.60
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	615,990.00
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,697,178.40
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,738,840.30
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,518,300.00
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,398,578.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,903,482.00
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,372,833.00
	CAN 2.5% 06/01/24	300,000.00	315,858.00
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,301,101.20
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	712,118.40
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,396,630.30
	CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,443,437.60
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	4,988,455.20
	CAN 3.5% 12/01/45	1,150,000.00	1,564,333.50
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,478,463.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,577,475.90

	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,414,224.00
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,226,916.80
	カナダドル 小計	63,540,000.00	67,116,536.20 (5,837,125,153)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,625,598.00
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	34,035,894.40
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,440,000.00	37,378,287.20
	MBONO 6.75% 03/09/23	29,950,000.00	30,520,248.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	40,438,773.90
	MBONO 7.75% 05/29/31	27,580,000.00	29,080,076.20
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	24,608,970.80
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	11,105,832.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	33,970,000.00	37,203,264.60
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,220,000.00	28,610,215.20
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	36,273,125.70
	MBONO 8% 11/07/47	24,630,000.00	25,615,692.60
	MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	36,527,371.10
		メキシコペソ 小計	362,940,000.00
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,412,004.20
	BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	999,727.40
	BGB 0.4% 06/22/40	1,050,000.00	1,044,057.00
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,682,434.80
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	575,891.20
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,832,518.80
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,822,191.80
	BGB 0.8% 06/22/28	2,090,000.00	2,268,841.30
	BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,589,698.80
	BGB 0% 10/22/27	430,000.00	443,054.80
	BGB 0% 10/22/31	1,020,000.00	1,028,996.40
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,726,350.00
	BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	853,336.80
	BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,696,627.20
	BGB 1.7% 06/22/50	1,140,000.00	1,439,911.20
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,324,984.50
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,457,862.80
	BGB 1% 06/22/31	1,980,000.00	2,205,640.80
	BGB 2.15% 06/22/66	770,000.00	1,145,505.90
	BGB 2.25% 06/22/23	1,010,000.00	1,064,903.60
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,128,565.90
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,342,465.40
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,059,104.00	
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,417,043.10	

BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	3,215,614.60
BGB 4.25% 09/28/22	1,820,000.00	1,917,897.80
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,413,793.80
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,555,048.80
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,904,093.00
BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,482,104.90
BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,223,951.30
BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	4,998,163.50
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,045,996.40
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,684,015.20
BTPS 0.3% 08/15/23	1,850,000.00	1,876,251.50
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	591,611.60
BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,805,866.40
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,316,388.80
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,131,978.00
BTPS 0.6% 08/01/31	1,850,000.00	1,844,727.50
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	685,349.70
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,346,187.50
BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,913,810.00
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,221,594.40
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,043,440.00
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	996,162.60
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,637,405.00
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,316,680.10
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,496,453.40
BTPS 0.95% 12/01/31	1,700,000.00	1,745,645.00
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,008,470.00
BTPS 0% 04/15/24	2,000,000.00	2,016,500.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,076,867.00
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,086,819.20
BTPS 1.45% 03/01/36	1,450,000.00	1,532,505.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,441,312.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,030,834.80
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,532,312.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,564,456.90
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,052,466.30
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,305,010.10
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,794,381.00
BTPS 1.7% 09/01/51	1,120,000.00	1,137,662.40
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,386,944.00
BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,951,795.40
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,118,340.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,909,574.00

BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,052,880.60	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,533,152.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	749,863.30	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,558,000.40	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,145,219.20	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,126,208.80	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	2,157,465.70	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,085,356.60	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,278,895.50	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,216,355.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	2,745,505.10	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,020,000.00	1,255,212.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,231,730.90	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,602,147.00	
BTPS 2% 02/01/28	2,690,000.00	3,002,873.90	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,279,834.70	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,844,665.20	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,646,891.00	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,887,420.80	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,986,507.60	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,976,175.60	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,412,171.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,807,428.20	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	4,051,992.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,085,665.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,512,536.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,880,254.60	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	4,017,007.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,756,752.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	5,021,794.50	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,997,654.50	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	4,816,740.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,961,251.60	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,400,000.00	1,484,742.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,692,293.50	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	3,525,016.80	
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,335,562.80	
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,450,634.10	
BTPS 5% 09/01/40	2,880,000.00	4,677,091.20	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	5,001,660.00	
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	4,449,807.60	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,927,240.00	

BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	963,752.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,098,659.60
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,146,584.40
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,318,081.20
DBR 0.5% 02/15/25	1,350,000.00	1,410,939.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,171,690.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,574,364.60
DBR 0.5% 08/15/27	4,040,000.00	4,333,304.00
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,738,325.50
DBR 0% 02/15/31	800,000.00	836,312.00
DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,914,385.40
DBR 0% 05/15/36	1,670,000.00	1,715,206.90
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,512,211.50
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,663,940.00
DBR 0% 08/15/30	6,450,000.00	6,751,473.00
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	705,650.70
DBR 0% 08/15/31	750,000.00	782,497.50
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,361,081.40
DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,251,540.80
DBR 0% 11/15/28	900,000.00	940,068.00
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,779,908.60
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,059,633.60
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,137,840.40
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,433,537.20
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,864,400.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,754,461.50
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,107,220.00
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,913,772.80
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,679,930.00
DBR 2.5% 08/15/46	3,570,000.00	5,862,368.40
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,017,528.80
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,842,312.30
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,897,289.90
DBR 4.25% 07/04/39	2,310,000.00	4,197,708.90
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,522,672.00
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	5,019,940.90
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,531,291.60
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,495,464.40
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,333,452.80
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,768,182.60
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,986,537.50
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,405,153.40
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,874,875.20

FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,830,146.40	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,352,542.20	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,688,708.50	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,182,271.50	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	830,867.40	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,230,000.00	1,224,071.40	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,788,230.90	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,830,134.00	
FRTR 0.75% 05/25/53	770,000.00	768,852.70	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,100,000.00	5,516,160.00	
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,072,222.00	
FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,559,080.00	
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,346,918.80	
FRTR 0% 02/25/27	950,000.00	975,450.50	
FRTR 0% 03/25/23	7,190,000.00	7,271,318.90	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,055,374.50	
FRTR 0% 03/25/25	5,490,000.00	5,616,379.80	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,372,721.80	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,131,868.40	
FRTR 0% 11/25/31	2,910,000.00	2,930,952.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	4,110,000.00	4,703,566.20	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,930,000.00	6,815,408.30	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,837,701.00	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	4,370,394.20	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,611,340.00	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,182,602.60	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,781,494.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,489,388.80	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,053,527.00	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,645,904.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,434,109.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	2,940,000.00	3,040,842.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,926,384.40	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,176,477.30	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,779,691.60	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,050,000.00	4,917,179.50	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,575,486.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,561,557.60	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	8,042,074.40	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,130,000.00	5,106,908.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	4,782,888.00	
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	4,209,347.10	

FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,475,609.70
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,521,677.90
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,169,810.20
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,431,183.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,153,340.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	965,860.80
IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,062,218.40
IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	782,762.00
IRISH 0.55% 04/22/41	390,000.00	396,622.20
IRISH 0.9% 05/15/28	720,000.00	782,661.60
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	533,842.50
IRISH 0% 10/18/31	880,000.00	883,722.40
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,328,868.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	768,905.40
IRISH 1.35% 03/18/31	620,000.00	709,100.20
IRISH 1.5% 05/15/50	780,000.00	942,653.40
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	1,000,547.60
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,525,207.80
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,489,582.60
IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,526,418.00
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,071,083.70
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,082,457.40
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,835,314.40
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,397,341.10
NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,804,939.20
NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,582,862.40
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,455,024.00
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,281,289.80
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,765,378.80
NETHER 0% 01/15/24	1,420,000.00	1,446,028.60
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,901,511.20
NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	703,080.00
NETHER 0% 01/15/52	980,000.00	942,446.40
NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,984,550.40
NETHER 0% 07/15/31	860,000.00	885,628.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,032,732.00
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,664,602.20
NETHER 2.75% 01/15/47	2,230,000.00	3,764,931.30
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,149,697.50
NETHER 3.75% 01/15/23	1,560,000.00	1,657,765.20
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,987,472.50
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,576,050.20
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,411,498.90

NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	222,944.00	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,398,498.10	
OBL 0% 04/10/26	4,070,000.00	4,212,816.30	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,855,450.00	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,247,816.60	
OBL 0% 10/07/22	3,110,000.00	3,135,502.00	
OBL 0% 10/10/25	4,340,000.00	4,478,966.80	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,535,322.70	
OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,576,098.30	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,886,377.50	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	944,726.10	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,751,220.00	
RAGB 0.75% 03/20/51	680,000.00	743,206.00	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,227,076.80	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	333,220.80	
RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,484,916.00	
RAGB 0% 02/20/31	740,000.00	753,719.60	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	953,157.00	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,521,960.00	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,470,096.00	
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	322,425.60	
RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	399,550.20	
RAGB 1.2% 10/20/25	700,000.00	755,447.00	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,192,269.30	
RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	466,880.70	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,065,279.60	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,401,966.30	
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	1,444,699.80	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,414,627.20	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,363,789.60	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,480,312.80	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,032,463.10	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,972,114.60	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,644,456.10	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,662,808.80	
RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	545,481.00	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	434,175.60	
RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	412,724.00	
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	406,140.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	653,442.80	
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	925,810.50	
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	693,920.50	

RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	813,283.60
RFGB 0.75% 04/15/31	620,000.00	680,877.80
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	733,746.00
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	548,262.00
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	429,101.40
RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	645,649.20
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	644,369.60
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	630,306.60
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	674,082.50
RFGB 1.625% 09/15/22	850,000.00	870,969.50
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	892,870.60
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	515,398.80
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	783,479.80
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	982,960.70
SPGB 0.1% 04/30/31	2,180,000.00	2,154,603.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,342,326.50
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,655,804.70
SPGB 0.45% 10/31/22	2,460,000.00	2,491,955.40
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	3,003,472.00
SPGB 0.5% 10/31/31	930,000.00	949,288.20
SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	3,088,148.50
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,122,160.00
SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	975,062.40
SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,389,973.50
SPGB 0% 01/31/26	1,410,000.00	1,433,871.30
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,947,563.00
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,404,514.00
SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,277,929.80
SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	2,378,582.20
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,355,183.00
SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,986,692.50
SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,746,818.60
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,649,899.00
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,997,843.60
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,353,545.60
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	613,885.80
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,921,598.50
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,286,039.50
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,223,027.50
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,118,341.30
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,421,542.60
SPGB 1% 10/31/50	2,330,000.00	2,215,993.10
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,118,004.10

	SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,993,953.20
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,533,445.50
	SPGB 2.75% 10/31/24	2,500,000.00	2,762,600.00
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,050,000.00	2,885,149.50
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	2,845,258.80
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,815,192.80
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,869,078.40
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,984,339.80
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,416,974.40
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,495,999.20
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,715,336.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,883,995.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,914,923.30
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,810,000.00	3,382,310.80
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,280,873.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	4,542,766.80
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,563,915.60
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,527,351.00
	ユーロ 小計	770,860,000.00	909,350,593.40 (117,779,088,857)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,508,995.20
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,510,721.60
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,965,099.50
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,217,489.40
	UKT 0.25% 01/31/25	650,000.00	650,084.50
	UKT 0.25% 07/31/31	2,110,000.00	2,025,220.20
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,371,793.60
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,164,500.20
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,726,282.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,950,000.00	2,854,066.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,860,000.00	1,684,639.20
	UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,388,721.20
	UKT 0.875% 01/31/46	960,000.00	927,628.80
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,747,940.00
	UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	511,775.00
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,144,822.20
	UKT 1.25% 07/31/51	180,000.00	191,122.20
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,929,864.00
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,118,240.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,635,511.10
UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,756,290.60	
UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,198,110.80	

	UKT 1.625% 10/22/71	1,120,000.00	1,496,185.60	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,532,674.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,752,974.90	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,173,227.20	
	UKT 1.75% 09/07/37	2,930,000.00	3,293,144.20	
	UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,635,472.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,607,600.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	3,045,216.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,120,000.00	1,206,665.60	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,906,308.80	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,580,000.00	3,741,129.00	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,550,000.00	3,876,306.00	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,883,893.40	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,777,728.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,090,000.00	3,063,208.50	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,876,223.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,511,081.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,698,306.80	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,900,000.00	3,000,404.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,754,134.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,723,390.70	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	3,751,125.40	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,584,978.80	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,922,705.80	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	2,009,179.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,664,948.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	3,081,232.00	
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,102,364.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,745,037.50	
	イギリスbond 小計	98,380,000.00	122,645,760.90 (18,519,509,895)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,970,000.00	5,957,283.90	
	SGB 0.75% 05/12/28	7,380,000.00	7,763,833.80	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,841,993.50	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,000,875.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,544,112.80	
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,566,750.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	10,247,949.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,580,000.00	8,433,054.00	
	スウェーデンクローナ 小計	60,920,000.00	67,355,852.00 (856,766,437)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,994,750.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,040,000.00	5,099,623.20	

	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,855,603.60	
	NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	6,270,403.20	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,770,000.00	4,899,887.10	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,640,000.00	7,950,107.60	
	NGB 2% 04/26/28	4,510,000.00	4,753,359.60	
	NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,914,987.20	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,756,630.40	
	ノルウェークローネ 小計	54,780,000.00	56,495,351.90 (712,406,387)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	7,170,000.00	7,242,990.60	
	DGB 0.25% 11/15/52	3,870,000.00	3,820,193.10	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	11,018,524.80	
	DGB 0.5% 11/15/29	14,260,000.00	15,186,614.80	
	DGB 0% 11/15/24	1,830,000.00	1,863,141.30	
	DGB 0% 11/15/31	3,110,000.00	3,147,755.40	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,765,846.20	
	DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	7,986,160.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	14,980,000.00	27,039,499.20	
	デンマーククローネ 小計	70,340,000.00	85,070,725.40 (1,481,932,036)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,900,000.00	1,803,366.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,567,832.00	
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,222,226.40	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	4,012,303.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,130,351.40	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,047,578.60	
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,800,000.00	1,893,654.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,454,021.20	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	4,039,572.60	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,380,000.00	5,868,288.80	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	6,802,627.40	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	5,357,202.80	
	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	4,054,408.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	786,816.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,410,000.00	3,617,975.90	
	ポーランドズロチ 小計	56,550,000.00	59,658,224.10 (1,688,500,750)	
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,928,915.90	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,317,582.80	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	2,027,984.40	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,749,233.80	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,293,898.30	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,642,748.80	

	ACGB 1.75% 11/21/32	1,610,000.00	1,694,879.20	
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	3,193,255.00	
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,277,188.80	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,798,284.80	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,246,931.60	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,251,432.50	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,479,346.20	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,871,843.10	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,431,535.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,162,275.50	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,877,476.60	
	ACGB 2.75% 11/21/29	2,420,000.00	2,756,210.60	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,843,764.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,577,520.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,206,350.60	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,106,615.60	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,013,799.20	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,820,000.00	3,299,202.60	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,583,408.70	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,842,023.20	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,724,550.00	
	オーストラリアドル 小計	63,450,000.00	69,198,257.70	(5,553,160,180)
シンガポ ールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	390,000.00	386,439.30	
	SIGB 1.625% 07/01/31	300,000.00	305,247.00	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	815,840.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	420,000.00	422,091.60	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	785,051.20	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	953,848.60	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	522,021.50	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	470,342.60	
	SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	580,821.70	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,190,000.00	1,384,350.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,037,142.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,115,945.80	
	SIGB 2.875% 07/01/29	590,000.00	661,484.40	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	856,208.40	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	425,346.30	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,350,000.00	1,388,070.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	990,173.40	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	998,615.20	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,708,470.90	

	シンガポールドル 小計	14,560,000.00	15,807,510.70 (1,289,260,572)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,523,370.00
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	721,651.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,388,203.40
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,556,281.50
	MGS 3.733% 06/15/28	2,630,000.00	2,742,406.20
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,120,825.20
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	529,969.00
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,532,295.00
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	962,475.60
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,382,618.00
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,077,596.30
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,573,785.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,187,889.90
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,076,734.60
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,526,644.80
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	633,612.00
	MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,506,259.00
	MGS 4.059% 09/30/24	960,000.00	1,007,452.80
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	745,438.40
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,344,524.80
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,220,890.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,144,654.40
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,126,445.80
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	3,114,482.80
MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,071,597.10	
MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,567,438.40	
MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,495,232.00	
MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,541,508.20	
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,821,506.40	
MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,124,698.20	
	マレーシアリンギット 小計	50,550,000.00	53,368,485.80 (1,402,171,574)
イスラエル シェゲル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	700,960.82
	ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	866,547.78
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,444,390.68
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,490,000.00	6,537,136.87
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,120,490.05
	ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,806,228.89
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,146,903.72
	ILGOV 1% 03/31/30	3,180,000.00	3,189,335.20
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,360,000.00	2,609,949.96

	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,464,065.08	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	4,083,346.66	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,410,000.00	3,886,258.75	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	4,940,000.00	6,423,211.28	
	イスラエルシェケル 小計	35,590,000.00	40,278,825.74 (1,370,116,480)	
	合計		289,902,524,323 (289,902,524,323)	

## 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 214銘柄	100.0%	45.3%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 340銘柄	100.0%	40.6%
イギリスポンド	国債証券 51銘柄	100.0%	6.4%
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 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 30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。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 8月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,807,750,550
コール・ローン	999,823,260
株式	509,905,176,766
投資信託受益証券	307,051,646
投資証券	11,661,953,975
派生商品評価勘定	455,807,304
未収入金	1,748,870
未収配当金	753,949,708
差入委託証拠金	3,930,507,205
流動資産合計	534,823,769,284
資産合計	534,823,769,284
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	878,352
前受金	455,642,899
未払解約金	555,083,223
未払利息	1,729
流動負債合計	1,011,606,203
負債合計	1,011,606,203
純資産の部	
元本等	
元本	133,977,978,789
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	399,834,184,292
元本等合計	533,812,163,081
純資産合計	533,812,163,081
負債純資産合計	534,823,769,284

## 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30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30日現在
	<p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)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 8月30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	133,977,978,789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) 3.9843円 (39,843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 8月30日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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 8月30日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引

2021年 8月30日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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>

（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 8月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	147,798,871,638円
期中追加設定元本額	19,012,870,612円
期中一部解約元本額	32,833,763,461円
期末元本額	133,977,978,789円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,980,908,500円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,569,870円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	28,351,456,279円
世界経済インデックスファンド	8,845,372,852円

区分	2021年 8月30日現在
外国株式インデックス・オープン	830,239,601円
DCマイセレクション25	850,546,933円
DCマイセレクション50	3,993,460,346円
DCマイセレクション75	4,480,068,436円
DC外国株式インデックス・オープン	11,320,513,480円
DCマイセレクションS25	413,154,267円
DCマイセレクションS50	1,875,531,809円
DCマイセレクションS75	1,513,220,502円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	52,297,886円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	161,519,458円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	115,320,737円
DC世界経済インデックスファンド	9,894,746,779円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,851,889,261円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	5,294,989円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	5,085,097円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	30,671,853円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	23,304,498円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	85,079,750円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	14,588,632円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	43,186,401円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	367,701,596円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	208,299,177円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,509,628,330円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	351,466,302円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	42,014,703円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	205,075,640円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	70,076,549円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,184,199,192円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,324,853,900円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,127,922,453円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,175,668,297円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,441,608,434円
分散投資コア戦略ファンドA	1,517,087,653円
分散投資コア戦略ファンドS	8,477,877,522円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,233,934,458円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,118,423,510円
コア投資戦略ファンド（切替型）	997,038,521円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	632,234,837円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,869,090円
SMT インデックスバランス・オープン	172,126,466円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	658,012,852円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	24,111,612,409円
SMT 世界経済インデックス・オープン	163,689,529円

区分	2021年 8月30日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	570,766,441円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	108,822,906円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,477,368円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	117,835,478円
グローバル経済コア	671,585,427円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,940,209円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	4,504,088円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	664,326,699円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	81,301,456円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	12,152,080円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	9,282,528円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	4,255,160円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	3,953,891円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	560,545,102円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	879,035,095円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,460,231,567円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	910,630,180円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	144,953,925円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	4,684,544円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	34,174円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	21,644円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	277,587,747円
SMTAMバランスファンド2002(適格機関投資家専用)	260,107,582円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	279,785,392円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	270,292,284円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	268,409,933円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	265,829,351円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	266,176,902円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 8月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	31,435,895,693
投資信託受益証券	18,504,612
投資証券	848,141,099
合計	32,302,541,404

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2021年 8月30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	11,885,972,252	-	12,341,615,151	455,642,899
合計		11,885,972,252	-	12,341,615,151	455,642,899

## (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30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	863,412,600	-	862,698,653	713,947
	アメリカドル	754,620,000	-	753,899,669	720,331
	ユーロ	108,792,600	-	108,798,984	6,384
合計		863,412,600	-	862,698,653	713,947

## (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	57,980	23.07	1,337,598.60	

CHENIERE ENERGY INC	19,034	89.70	1,707,349.80
CHEVRON CORP	162,537	98.64	16,032,649.68
CONOCOPHILLIPS	113,805	56.74	6,457,295.70
DEVON ENERGY CORPORATION	57,000	30.36	1,730,520.00
EOG RESOURCES INC	48,739	69.63	3,393,696.57
EXXON MOBIL	357,409	55.77	19,932,699.93
HALLIBURTON CO	77,539	20.55	1,593,426.45
HESS CORP	22,781	69.85	1,591,252.85
KINDER MORGAN INC	169,739	16.59	2,815,970.01
MARATHON PETROLEUM CORP	54,237	60.02	3,255,304.74
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	25.66	2,029,859.96
ONEOK INC	37,709	53.84	2,030,252.56
PHILLIPS 66	38,113	72.61	2,767,384.93
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,954	151.67	2,723,083.18
SCHLUMBERGER	116,716	29.08	3,394,101.28
VALERO ENERGY CORP	34,683	67.11	2,327,576.13
WILLIAMS COS	104,984	24.61	2,583,656.24
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,561	268.50	4,983,628.50
ALBEMARLE CORP	10,180	236.65	2,409,097.00
AMCOR PLC	132,975	12.78	1,699,420.50
AVERY DENNISON CORP	7,457	226.14	1,686,325.98
BALL CORP	27,925	94.37	2,635,282.25
CELANESE CORP-SERIES A	9,842	160.25	1,577,180.50
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	45.23	862,581.33
CORTEVA INC	64,900	44.18	2,867,282.00
CROWN HOLDINGS INC	11,212	109.28	1,225,247.36
DOW INC	63,659	65.38	4,162,025.42
DUPONT DE NEMOURS INC	46,139	75.15	3,467,345.85
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	115.27	1,276,615.25
ECOLAB INC	22,189	224.99	4,992,303.11
FMC CORP	10,507	93.07	977,886.49
FREEMPORT-MCMORAN INC	125,342	36.57	4,583,756.94
INT'L PAPER CO	30,800	60.13	1,852,004.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,184	151.83	3,216,366.72
LINDE PLC	44,125	314.54	13,879,077.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	102.88	2,332,598.24
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	384.35	2,045,126.35
MOSAIC CO/THE	31,911	32.65	1,041,894.15
NEWMONT CORPORATION	68,576	58.19	3,990,437.44
NUCOR CORP	25,565	119.85	3,063,965.25
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	151.39	1,163,734.93
PPG INDUSTRIES INC	20,538	161.84	3,323,869.92

RPM INTERNATIONAL INC	10,456	83.49	872,971.44
SEALED AIR CORP	14,689	61.07	897,057.23
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,917	302.87	6,638,001.79
STEEL DYNAMICS INC	18,273	70.91	1,295,738.43
VULCAN MATERIALS CO	11,347	187.95	2,132,668.65
WESTROCK CO	21,356	51.95	1,109,444.20
3 M COMPANY	48,764	195.05	9,511,418.20
ALLEGION PLC	7,601	141.49	1,075,465.49
AMETEK INC	19,666	136.84	2,691,095.44
BOEING CO	46,662	221.75	10,347,298.50
CARRIER GLOBAL CORP	70,603	58.32	4,117,566.96
CATERPILLAR	45,919	212.83	9,772,940.77
CUMMINS INC	12,914	240.30	3,103,234.20
DEERE&CO	25,063	379.49	9,511,157.87
DOVER CORP	12,202	174.59	2,130,347.18
EATON CORP	33,384	170.03	5,676,281.52
EMERSON ELECTRIC CO	51,393	104.77	5,384,444.61
FASTENAL CO	48,796	55.67	2,716,473.32
FORTIVE CORP	25,722	74.07	1,905,228.54
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	101.74	1,303,289.40
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	437.11	2,277,780.21
GENERAL DYNAMICS CORP	20,350	199.72	4,064,302.00
GENERAL ELECTRIC CO	92,290	106.09	9,791,046.10
GRAINGER (WW) INC	3,846	432.13	1,661,971.98
HEICO CORP	3,640	127.90	465,556.00
HEICO CORP-CLASS A	6,449	116.77	753,049.73
HONEYWELL INTL INC	58,647	231.14	13,555,667.58
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	32.79	1,035,967.26
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	206.99	729,018.78
IDEX CORP	5,916	225.30	1,332,874.80
ILLINOIS TOOL WORKS	26,587	230.64	6,132,025.68
INGERSOLL-RAND INC	31,562	52.85	1,668,051.70
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	55.83	988,191.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	60,279	74.73	4,504,649.67
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,086	232.20	4,199,569.20
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	333.82	1,022,156.84
LOCKHEED MARTIN CORP	21,206	361.99	7,676,359.94
MASCO CORP	23,467	61.99	1,454,719.33
NORDSON CORP	4,880	233.54	1,139,675.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,571	364.84	4,951,243.64
OTIS WORLDWIDE CORP	35,040	92.01	3,224,030.40
OWENS CORNING	8,642	98.60	852,101.20

PACCAR INC	30,155	82.25	2,480,248.75
PARKER HANNIFIN CORP	11,234	304.53	3,421,090.02
PENTAIR PLC	14,533	76.69	1,114,535.77
PLUG POWER INC	41,884	26.60	1,114,114.40
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	128,033	85.40	10,934,018.20
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,938	321.66	3,196,657.08
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,784	478.55	4,203,583.20
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	60.60	837,976.80
SMITH (A.O.) CORP	12,146	72.38	879,127.48
SNAP-ON INC	4,900	227.24	1,113,476.00
STANLEY BLACK&DECKER	13,718	194.05	2,661,977.90
SUNRUN INC	13,917	44.38	617,636.46
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	458.89	1,789,212.11
TEXTRON	18,893	72.89	1,377,110.77
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,642	198.78	4,103,216.76
TRANSDIGM GROUP INC	4,425	608.75	2,693,718.75
UNITED RENTALS INC	6,103	355.22	2,167,907.66
WABTEC CORP	15,024	90.11	1,353,812.64
XYLEM INC	15,209	134.94	2,052,302.46
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	81.68	928,211.52
CINTAS CORP	8,043	391.69	3,150,362.67
CLARIVATE PLC	27,357	25.01	684,198.57
COPART INC	18,067	144.44	2,609,597.48
COSTAR GROUP INC	34,030	83.19	2,830,955.70
EQUIFAX INC	10,409	266.86	2,777,745.74
IHS MARKIT LTD	32,602	119.33	3,890,396.66
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	136.01	1,450,002.61
LEIDOS HOLDINGS	11,220	98.21	1,101,916.20
REPUBLIC SERVICES INC	18,483	123.56	2,283,759.48
ROBERT HALF INTL INC	9,566	104.09	995,724.94
ROLLINS INC	17,468	38.61	674,439.48
TRANSUNION	15,741	119.63	1,883,095.83
VERISK ANALYTICS INC	13,390	199.52	2,671,572.80
WASTE CONNECTIONS INC	22,454	128.08	2,875,908.32
WASTE MANAGEMENT INC	36,263	154.15	5,589,941.45
AMERCO	1,000	673.74	673,740.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	90.74	1,024,636.08
CSX CORP	192,089	33.45	6,425,377.05
DELTA AIR LINES INC	14,609	41.52	606,565.68
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	124.57	1,777,863.04
FEDEX CORP	21,597	267.90	5,785,836.30
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	179.56	1,266,257.12

KANSAS CITY SOUTHERN	7,965	294.46	2,345,373.90
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	51.86	554,902.00
LYFT INC-A	21,288	48.39	1,030,126.32
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,133	260.81	5,511,697.73
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	289.78	2,319,109.34
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	50.88	688,559.04
UBER TECHNOLOGIES INC	103,109	40.69	4,195,505.21
UNION PACIFIC CORP	56,461	221.43	12,502,159.23
UNITED PARCEL SERVICE B	60,637	193.30	11,721,132.10
APTIV PLC	23,540	156.41	3,681,891.40
AUTOLIV INC	6,776	89.74	608,078.24
BORGWARNER INC	19,781	43.49	860,275.69
FORD MOTOR COMPANY	334,463	13.31	4,451,702.53
GENERAL MOTORS CO	108,886	49.80	5,422,522.80
LEAR CORP	5,287	164.50	869,711.50
TESLA INC	64,902	711.92	46,205,031.84
DR HORTON INC	29,632	96.96	2,873,118.72
GARMIN LTD	12,854	175.86	2,260,504.44
HASBRO INC	10,572	98.45	1,040,813.40
LENNAR CORP-CL A	22,762	107.96	2,457,385.52
LULULEMON ATHLETICA INC	10,358	405.97	4,205,037.26
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	203.65	1,030,876.30
NEWELL BRANDS INC	31,461	25.54	803,513.94
NIKE B	107,303	167.58	17,981,836.74
NVR INC	297	5,139.27	1,526,363.19
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	104.34	2,267,934.24
PULTE GROUP INC	21,609	54.88	1,185,901.92
VF CORP	28,638	76.63	2,194,529.94
WHIRLPOOL CORP	5,220	225.94	1,179,406.80
AIRBNB INC-CLASS A	4,665	154.18	719,249.70
ARAMARK	20,955	34.95	732,377.25
BOOKING HOLDINGS INC	3,445	2,305.47	7,942,344.15
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	104.24	1,830,454.40
CARNIVAL CORPORATION	70,520	24.35	1,717,162.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,399	1,918.95	4,603,561.05
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	153.08	1,639,792.96
DOMINO'S PIZZA INC	3,251	511.87	1,664,089.37
DRAFTKINGS INC - CL A	15,674	60.01	940,596.74
EXPEDIA GROUP INC	11,638	146.74	1,707,760.12
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,788	127.56	3,034,397.28
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	43.91	1,289,636.70
MARRIOTT INTL A	23,009	136.02	3,129,684.18

MCDONALD'S CORP	62,893	237.48	14,935,829.64
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	12.88	227,486.56
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	43.32	1,432,332.48
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	83.26	1,604,170.42
STARBUCKS CORP	99,234	115.12	11,423,818.08
VAIL RESORTS INC	3,574	304.44	1,088,068.56
WYNN RESORTS LTD	9,302	101.05	939,967.10
YUM BRANDS INC	25,844	131.70	3,403,654.80
ACTIVISION BLIZZARD INC	65,003	82.43	5,358,197.29
ALPHABET INC-CL A	25,430	2,880.08	73,240,434.40
ALPHABET INC-CL C	24,928	2,891.01	72,067,097.28
ALTICE USA INC- A	22,505	28.21	634,866.05
CABLE ONE INC	445	2,067.12	919,868.40
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	11,410	807.18	9,209,923.80
COMCAST CORP-CL A	385,983	59.40	22,927,390.20
DISCOVERY INC - A	12,804	28.28	362,097.12
DISCOVERY INC-C	28,190	27.15	765,358.50
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	43.15	868,695.80
ELECTRONIC ARTS INC	24,944	142.94	3,565,495.36
FACEBOOK INC-A	203,410	372.63	75,796,668.30
FOX CORP - CLASS A	27,658	37.20	1,028,877.60
FOX CORP- CLASS B	15,092	34.53	521,126.76
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	132.77	892,347.17
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	36.84	1,246,444.56
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	184.98	477,063.42
LIBERTY BROADBAND-C	13,516	189.52	2,561,552.32
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	49.84	766,489.36
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	49.29	669,555.36
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	49.49	315,944.16
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	86.90	1,208,605.20
MATCH GROUP INC	21,851	141.00	3,080,991.00
NETFLIX INC	37,386	558.92	20,895,783.12
NEWS CORP-CLASS A	33,479	22.74	761,312.46
OMNICOM GROUP	18,031	73.19	1,319,688.89
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	57.22	2,618,787.74
ROKU INC	9,122	357.03	3,256,827.66
SEA LTD-ADR	638	321.03	204,817.14
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.25	622,175.00
SNAP INC - A	78,901	73.12	5,769,241.12
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,738	160.03	1,558,372.14
THE WALT DISNEY CO	153,336	180.14	27,621,947.04
TWITTER INC	66,866	63.43	4,241,310.38

VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	40.89	1,986,681.54
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	98.63	542,169.11
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	99.24	1,332,495.48
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	203.82	1,085,137.68
AMAZON.COM	36,205	3,349.63	121,273,354.15
AUTOZONE INC	1,986	1,548.49	3,075,301.14
BATH & BODY WORKS INC	19,806	68.54	1,357,503.24
BEST BUY COMPANY INC	19,870	117.50	2,334,725.00
BURLINGTON STORES INC	5,808	309.53	1,797,750.24
CARMAX INC	13,891	126.59	1,758,461.69
CARVANA CO	5,700	337.52	1,923,864.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	88.11	606,020.58
DOLLAR GENERAL CORP	20,962	225.25	4,721,690.50
DOLLAR TREE INC	20,151	90.89	1,831,524.39
EBAY	56,933	76.41	4,350,250.53
ETSY INC	11,000	210.40	2,314,400.00
GENUINE PARTS CO	12,119	123.66	1,498,635.54
HOME DEPOT	90,952	323.38	29,412,057.76
LKQ CORP	26,705	52.05	1,389,995.25
LOWES COMPANIES	61,610	205.90	12,685,499.00
MERCADOLIBRE INC	3,770	1,865.00	7,031,050.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,067	591.91	3,591,117.97
POOL CORP	3,304	480.91	1,588,926.64
ROSS STORES INC	29,776	118.89	3,540,068.64
TARGET (DAYTON HUDSON)	42,191	249.18	10,513,153.38
TJX COMPANIES INC	103,121	73.64	7,593,830.44
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,932	192.40	1,910,916.80
ULTA BEAUTY INC	4,520	387.23	1,750,279.60
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	291.12	1,746,720.00
COSTCO WHOLESALE CORP	37,370	450.34	16,829,205.80
KROGER CO	61,306	45.49	2,788,809.94
SYSCO CORP	43,568	80.25	3,496,332.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,310	48.48	3,069,268.80
WALMART INC	131,340	146.52	19,243,936.80
ALTRIA GROUP INC	156,266	49.53	7,739,854.98
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,339	60.57	2,927,893.23
BOSTON BEER COMPANY INC-A	744	585.11	435,321.84
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	70.17	1,839,857.40
BUNGE LIMITED	11,604	77.12	894,900.48
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	41.40	656,976.60
COCA-COLA CO	345,573	55.65	19,231,137.45
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	58.11	894,545.34

CONAGRA BRANDS INC	41,157	33.05	1,360,238.85
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,180	212.42	3,012,115.60
GENERAL MILLS INC	53,282	57.73	3,075,969.86
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,532	175.63	2,200,995.16
HORMEL FOODS CORP	27,157	44.92	1,219,892.44
JM SMUCKER CO	9,145	123.57	1,130,047.65
KELLOGG CO	21,630	63.28	1,368,746.40
KEURIG DR PEPPER INC	59,596	35.13	2,093,607.48
KRAFT HEINZ CO/THE	57,338	36.38	2,085,956.44
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	65.56	847,297.44
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	85.22	1,797,119.36
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	47.51	864,824.53
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	118,747	61.89	7,349,251.83
MONSTER BEVERAGE CORP	34,258	97.33	3,334,331.14
PEPSICO INC	116,436	154.94	18,040,593.84
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	131,310	102.10	13,406,751.00
TYSON FOODS INC	25,074	78.51	1,968,559.74
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	82.71	1,741,459.05
CLOROX COMPANY	10,830	164.86	1,785,433.80
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,648	77.44	5,238,661.12
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,298	340.82	6,577,144.36
KIMBERLY-CLARK CORP	28,913	136.35	3,942,287.55
PROCTER & GAMBLE CO	208,024	142.31	29,603,895.44
ABBOTT LABORATORIES	149,509	124.59	18,627,326.31
ABIOMED INC	3,781	358.53	1,355,601.93
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,263	701.85	4,395,686.55
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	119.89	1,546,101.44
ANTHEM INC	20,600	372.67	7,677,002.00
BAXTER INTERNATIONAL	44,024	73.97	3,256,455.28
BECTON DICKINSON & CO	24,401	248.50	6,063,648.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	118,882	44.80	5,325,913.60
CARDINAL HEALTH	24,692	51.74	1,277,564.08
CENTENE CORP	48,540	63.98	3,105,589.20
CERNER CORP	25,323	76.84	1,945,819.32
CIGNA CORP	30,245	210.68	6,372,016.60
CVS HEALTH CORP	110,398	83.71	9,241,416.58
DANAHER CORP	54,077	319.10	17,255,970.70
DAVITA INC	5,784	130.81	756,605.04
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	62.09	1,103,587.66
DEXCOM INC	8,037	520.71	4,184,946.27
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,513	116.39	6,228,378.07
HCA HEALTHCARE INC	23,291	251.85	5,865,838.35

HENRY SCHEIN INC	11,747	75.23	883,726.81
HOLOGIC INC	21,687	79.19	1,717,393.53
HUMANA INC	11,040	405.76	4,479,590.40
IDEXX LABORATORIES INC	7,161	668.27	4,785,481.47
INSULET CORP	5,923	295.09	1,747,818.07
INTUITIVE SURGICAL INC	9,913	1,036.52	10,275,022.76
LABORATORY CRP OF AMER	8,285	300.52	2,489,808.20
MASIMO CORP	4,835	277.28	1,340,648.80
MCKESSON CORP	13,893	201.12	2,794,160.16
MEDTRONIC PLC	113,657	133.81	15,208,443.17
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	268.74	1,327,575.60
NOVOCURE LTD	7,933	134.74	1,068,892.42
OAK STREET HEALTH INC	7,613	46.72	355,679.36
QUEST DIAGNOSTICS	11,335	149.14	1,690,501.90
RESMED INC	12,370	286.91	3,549,076.70
STERIS PLC	7,163	213.61	1,530,088.43
STRYKER CORP	28,475	273.42	7,785,634.50
TELADOC HEALTH INC	11,375	142.83	1,624,691.25
TELEFLEX INC	3,934	388.22	1,527,257.48
THE COOPER COS INC	4,134	446.58	1,846,161.72
UNITEDHEALTH GROUP INC	80,170	418.76	33,571,989.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	156.79	1,136,413.92
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,775	330.42	3,890,695.50
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,317	446.96	2,823,446.32
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,300	150.07	2,596,211.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	164.21	928,607.55
ABBVIE INC	149,024	119.58	17,820,289.92
AGILENT TECHNOLOGIES	26,029	173.81	4,524,100.49
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	203.93	1,966,496.99
AMGEN	48,679	222.78	10,844,707.62
AVANTOR INC	42,980	39.28	1,688,254.40
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	792.41	1,468,335.73
BIO-TECHNE CORP	3,245	495.01	1,606,307.45
BIOGEN INC	12,750	343.19	4,375,672.50
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	83.51	1,234,528.33
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	188,895	66.60	12,580,407.00
CATALENT INC	15,232	129.85	1,977,875.20
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	436.75	1,836,097.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	33.31	1,201,191.91
EXACT SCIENCES CORP	14,756	103.89	1,533,000.84
GILEAD SCIENCES INC	105,658	71.28	7,531,302.24
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	108.23	1,940,130.98

ILLUMINA INC	12,501	464.58	5,807,714.58
INCYTE CORP	15,212	75.68	1,151,244.16
IQVIA HOLDINGS INC	16,036	259.55	4,162,143.80
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	133.15	661,888.65
JOHNSON & JOHNSON	222,152	172.93	38,416,745.36
LILLY (ELI) & CO	68,743	259.75	17,855,994.25
MERCK & CO	213,503	76.30	16,290,278.90
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,051	1,565.61	3,211,066.11
MODERNA INC	27,089	382.22	10,353,957.58
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	95.22	806,894.28
NOVAVAX INC	5,754	226.67	1,304,259.18
PERKINELMER INC	9,372	182.91	1,714,232.52
PFIZER	470,870	46.60	21,942,542.00
PPD INC	11,027	46.26	510,109.02
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,829	663.29	5,856,187.41
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	39.19	608,777.46
SEAGEN INC	11,471	166.81	1,913,477.51
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.35	751,749.35
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,232	548.51	18,228,084.32
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,458	199.92	4,489,803.36
VIATRIS INC	103,541	14.37	1,487,884.17
WATERS CORP	5,228	407.35	2,129,625.80
ZOETIS INC	39,976	203.82	8,147,908.32
BANK OF AMERICA CORP	656,214	42.49	27,882,532.86
CITIGROUP	175,488	72.99	12,808,869.12
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	44.74	1,612,474.34
FIFTH THIRD BANCORP	61,361	39.46	2,421,305.06
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,827	202.92	3,008,694.84
HUNTINGTON BANCSHARES INC	127,582	15.65	1,996,658.30
JPMORGAN CHASE & CO	257,893	163.05	42,049,453.65
KEY CORP	83,212	20.89	1,738,298.68
M & T BANK CORP	10,537	142.18	1,498,150.66
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,597	194.51	6,923,972.47
REGIONS FINL CORP	81,824	20.92	1,711,758.08
SVB FINANCIAL GROUP	4,393	574.48	2,523,690.64
TRUIST FINANCIAL CORP	115,723	57.97	6,708,462.31
US BANCORP	122,617	58.30	7,148,571.10
WELLS FARGO & CO	348,776	49.81	17,372,532.56
ALLY FINANCIAL INC	31,445	53.54	1,683,565.30
AMERICAN EXPRESS	57,665	168.65	9,725,202.25
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,185	276.42	2,815,337.70
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	58.65	888,723.45

BANK NEW YORK CO	71,298	56.41	4,021,920.18
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	115,834	286.60	33,198,024.40
BLACKROCK INC	12,861	954.94	12,281,483.34
BLACKSTONE INC	58,748	124.22	7,297,676.56
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,568	175.80	6,780,254.40
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	48.37	609,220.15
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	125.40	1,112,925.00
CME GROUP INC	30,156	199.86	6,026,978.16
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,121	133.48	3,486,631.08
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	31.49	1,033,344.35
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	376.58	1,185,473.84
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	32.94	858,745.80
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	96.47	416,364.52
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,134	419.69	12,227,248.46
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,143	118.41	5,582,202.63
INVESCO LTD	35,765	25.69	918,802.85
KKR & CO INC	43,643	64.20	2,801,880.60
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	484.77	1,554,657.39
MOODY'S CORP	14,125	377.85	5,337,131.25
MORGAN STANLEY	118,951	105.45	12,543,382.95
MSCI INC	6,908	629.59	4,349,207.72
NASDAQ INC	9,657	193.48	1,868,436.36
NORTHERN TRUST CORP	17,625	121.03	2,133,153.75
PRICE T ROWE GROUP INC	19,057	222.65	4,243,041.05
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,324	142.99	1,476,228.76
S&P GLOBAL INC	20,253	438.30	8,876,889.90
SCHWAB (CHARLES) CORP	121,361	75.84	9,204,018.24
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	63.15	603,082.50
STATE STREET CORP	29,894	94.28	2,818,406.32
SYNCHRONY FINANCIAL	49,509	51.95	2,571,992.55
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	89.00	806,429.00
VOYA FINANCIAL INC	10,050	65.58	659,079.00
AFLAC	54,481	57.09	3,110,320.29
ALLEGHANY CORP	1,276	685.02	874,085.52
ALLSTATE CORP	26,425	137.51	3,633,701.75
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	136.78	864,312.82
AMERICAN INT'L GROUP	75,227	55.01	4,138,237.27
AON PLC	19,359	285.13	5,519,831.67
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	41.75	1,420,794.25
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	143.76	2,351,769.84
ASSURANT INC	4,726	169.36	800,395.36
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	65.58	669,375.06

BROWN & BROWN INC	19,873	58.15	1,155,614.95
CHUBB LTD	38,652	186.32	7,201,640.64
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	124.40	1,591,200.40
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	174.88	378,790.08
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	267.91	880,888.08
FNF GROUP	24,961	49.05	1,224,337.05
GLOBE LIFE INC	8,106	96.95	785,876.70
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,371	68.18	2,070,694.78
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	70.66	1,156,280.24
LOEWS CORP	18,851	56.53	1,065,647.03
MARKEL CORP	1,156	1,272.80	1,471,356.80
MARSH & MCLENNAN COS	42,677	156.35	6,672,548.95
METLIFE INC	64,294	62.77	4,035,734.38
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	68.12	1,571,664.64
PROGRESSIVE CORP	50,582	97.49	4,931,239.18
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,127	107.36	3,556,514.72
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	118.72	789,725.44
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	158.87	772,743.68
TRAVELERS COS INC/THE	21,022	162.09	3,407,455.98
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,021	219.30	2,416,905.30
WR BERKLEY CORP	11,715	76.14	891,980.10
CBRE GROUP INC-A	27,882	95.62	2,666,076.84
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.26	420,462.00
WEYERHAEUSER CO	63,665	35.95	2,288,756.75
ACCENTURE PLC-CL A	53,519	335.66	17,964,187.54
ADOBE INC	40,430	658.52	26,623,963.60
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	112.20	1,534,110.60
ANSYS INC	7,474	365.02	2,728,159.48
AUTODESK INC	18,457	315.64	5,825,767.48
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,984	208.96	7,519,216.64
AVALARA INC	7,698	179.94	1,385,178.12
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	65.06	910,579.76
BLACK KNIGHT INC	14,413	75.33	1,085,731.29
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	171.58	1,671,532.36
CADENCE DESIGN SYSTEMS	23,282	162.47	3,782,626.54
CERIDIAN HCM HOLDING INC	12,296	110.75	1,361,782.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	126.68	1,328,366.48
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	101.77	1,062,885.88
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,762	123.57	2,194,850.34
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,007	77.24	3,553,580.68
COUPA SOFTWARE INC	6,059	239.13	1,448,888.67
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,957	282.31	4,222,510.67

CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	168.79	523,249.00
DATADOG INC - CLASS A	14,371	134.84	1,937,785.64
DOCUSIGN INC	15,540	300.76	4,673,810.40
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	31.15	898,521.75
DYNATRACE INC	14,790	66.97	990,486.30
EPAM SYSTEMS INC	4,753	629.10	2,990,112.30
FAIR ISAAC CORP	2,615	459.50	1,201,592.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	52,242	128.59	6,717,798.78
FISERV INC	51,693	117.94	6,096,672.42
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,523	261.84	1,707,982.32
FORTINET INC	11,565	316.06	3,655,233.90
GARTNER INC	7,500	307.80	2,308,500.00
GLOBAL PAYMENTS INC	25,292	164.14	4,151,428.88
GODADDY INC - CLASS A	13,798	74.12	1,022,707.76
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	118.00	745,524.00
HUBSPOT INC	3,646	702.55	2,561,497.30
INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,281	139.41	10,494,924.21
INTUIT INC	23,082	565.94	13,063,027.08
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	175.93	1,106,775.63
MASTERCARD INC-CLASS A	74,900	355.73	26,644,177.00
MICROSOFT CORP	606,107	299.72	181,662,390.04
MONGODB INC	4,623	395.61	1,828,905.03
NORTONLIFELOCK INC	50,376	26.78	1,349,069.28
OKTA INC	10,230	262.38	2,684,147.40
ORACLE CORP	161,383	89.35	14,419,571.05
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	43,290	25.71	1,112,985.90
PALO ALTO NETWORKS INC	8,311	461.28	3,833,698.08
PAYCHEX INC	27,703	114.37	3,168,392.11
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	484.70	2,052,704.50
PAYPAL HOLDINGS INC	93,989	278.33	26,159,958.37
PTC INC	9,984	131.98	1,317,688.32
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	257.48	1,646,069.64
SALESFORCE.COM INC	82,450	266.53	21,975,398.50
SERVICENOW INC	16,513	632.40	10,442,821.20
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,960	297.71	583,511.60
SPLUNK INC	13,355	155.07	2,070,959.85
SQUARE INC - A	33,292	268.01	8,922,588.92
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	76.24	1,474,100.40
SYNOPSYS INC	12,728	331.81	4,223,277.68
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35,780	80.58	2,883,152.40
TWILIO INC - A	13,692	361.25	4,946,235.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	476.17	1,589,931.63

UNITY SOFTWARE INC	4,329	123.51	534,674.79
VERISIGN INC	8,760	214.66	1,880,421.60
VISA INC-CLASS A SHARES	143,326	232.69	33,350,526.94
VMWARE INC-CLASS A	6,812	148.18	1,009,402.16
WESTERN UNION CO	38,757	21.65	839,089.05
WIX.COM LTD	5,010	223.51	1,119,785.10
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	269.28	4,175,186.40
ZENDESK INC	10,500	124.69	1,309,245.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,545	340.81	5,979,511.45
ZSCALER INC	6,234	273.73	1,706,432.82
AMPHENOL CORPORATION	51,451	76.75	3,948,864.25
APPLE INC	1,420,191	148.60	211,040,382.60
ARISTA NETWORKS INC	4,720	372.86	1,759,899.20
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	122.68	748,348.00
CDW CORP/DE	11,982	199.25	2,387,413.50
CISCO SYSTEMS	356,369	59.02	21,032,898.38
COGNEX CORP	14,352	89.17	1,279,767.84
CORNING	64,989	40.75	2,648,301.75
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	96.95	2,087,333.50
F5 NETWORKS INC	5,350	205.57	1,099,799.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	15.42	1,683,077.58
HP INC	106,353	28.92	3,075,728.76
IPG PHOTONICS CORP	3,207	172.43	552,983.01
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	29.49	923,154.96
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,004	177.51	2,840,870.04
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,091	242.81	3,421,435.71
NETAPP INC	18,303	87.06	1,593,459.18
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,940	86.31	1,548,401.40
TE CONNECTIVITY LTD	27,668	152.70	4,224,903.60
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	95.71	2,026,754.96
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	63.24	1,630,959.60
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,612	587.96	2,711,671.52
AT&T INC	601,777	27.13	16,326,210.01
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	28.41	440,809.56
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	28.54	961,227.20
LUMEN TECHNOLOGIES INC	86,131	11.97	1,030,988.07
T-MOBILE US INC	52,257	138.38	7,231,323.66
VERIZON COMMUNICATIONS	349,306	54.77	19,131,489.62
AES CORP	54,375	24.19	1,315,331.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	60.84	1,264,133.52
AMEREN CORPORATION	20,898	88.02	1,839,441.96
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,494	89.29	3,704,999.26

AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,464	180.31	2,788,313.84
ATMOS ENERGY CORP	11,419	97.38	1,111,982.22
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	25.62	1,233,910.44
CMS ENERGY CORP	23,697	64.16	1,520,399.52
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	75.64	2,174,271.80
DOMINION ENERGY INC	69,073	78.19	5,400,817.87
DTE ENERGY COMPANY	16,240	120.65	1,959,356.00
DUKE ENERGY CORP	66,012	104.67	6,909,476.04
EDISON INTL	32,117	57.53	1,847,691.01
ENERGY CORP	16,926	111.69	1,890,464.94
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	48.71	1,014,824.14
EVERGY INC	18,475	68.31	1,262,027.25
EVERSOURCE ENERGY	29,303	90.18	2,642,544.54
EXELON CORP	81,616	49.09	4,006,529.44
FIRSTENERGY CORP	45,787	38.57	1,766,004.59
NEXTERA ENERGY INC	165,232	83.41	13,782,001.12
NISOURCE INC	35,781	24.82	888,084.42
NRG ENERGY INC	23,078	45.07	1,040,125.46
PG&E CORP	135,327	9.12	1,234,182.24
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	77.31	832,783.32
PPL CORPORATION	63,429	29.22	1,853,395.38
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,258	64.17	2,775,865.86
SEMPRA ENERGY	27,056	131.86	3,567,604.16
SOUTHERN CO	88,673	65.99	5,851,531.27
UGI CORP	18,019	46.47	837,342.93
VISTRA CORP	37,797	18.68	706,047.96
WEC ENERGY GROUP INC	26,821	94.41	2,532,170.61
XCEL ENERGY INC	46,423	68.70	3,189,260.10
ADVANCED MICRO DEVICES	102,014	111.40	11,364,359.60
ANALOG DEVICES	45,192	166.48	7,523,564.16
APPLIED MATERIALS	77,306	136.55	10,556,134.30
BROADCOM INC	34,444	495.94	17,082,157.36
ENPHASE ENERGY INC	10,113	174.99	1,769,673.87
INTEL CORP	342,906	53.89	18,479,204.34
KLA CORP	12,889	342.93	4,420,024.77
LAM RESEARCH CORP	12,019	609.59	7,326,662.21
MARVELL TECHNOLOGY INC	66,930	61.34	4,105,486.20
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,404	159.38	3,570,749.52
MICRON TECHNOLOGY	94,036	74.00	6,958,664.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	494.96	1,747,703.76
NVIDIA CORP	209,265	226.36	47,369,225.40
NXP SEMICONDUCTORS NV	23,203	226.51	5,255,711.53

	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	45.50	1,637,818.00
	QORVO INC	9,678	190.73	1,845,884.94
	QUALCOMM	95,794	144.85	13,875,760.90
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,359	183.45	2,634,158.55
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	291.25	1,339,750.00
	TERADYNE INC	14,398	122.60	1,765,194.80
	TEXAS INSTRUMENTS	77,615	190.52	14,787,209.80
	XILINX INC	20,982	156.27	3,278,857.14
	アメリカドル 小計	26,454,163		3,372,188,438.89 (370,063,959,283)
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	22.46	603,724.80
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	102,786	42.42	4,360,182.12
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	10.53	1,017,892.98
	ENBRIDGE	173,165	49.74	8,613,227.10
	IMPERIAL OIL	24,763	33.76	835,998.88
	INTER PIPELINE LTD	35,455	19.99	708,745.45
	KEYERA CORP	18,607	30.78	572,723.46
	PARKLAND CORP	14,075	38.32	539,354.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	39.23	1,791,477.18
	SUNCOR ENERGY	132,181	24.20	3,198,780.20
	TC ENERGY CORP	77,108	59.78	4,609,516.24
	AGNICO EAGLE MINES	20,293	73.92	1,500,058.56
	B2GOLD CORP	90,243	4.92	443,995.56
	BARRICK GOLD CORP	153,589	25.56	3,925,734.84
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	72.36	950,738.04
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,000	26.64	1,465,200.00
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	183.79	2,823,565.77
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	10.00	518,470.00
	KINROSS GOLD CORP	108,451	7.63	827,481.13
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	49.73	1,165,074.44
	LUNDIN MINING CORP	62,243	10.35	644,215.05
	NUTRIEN LTD	48,966	77.31	3,785,561.46
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	32.56	599,462.16
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	28.82	1,168,968.02
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	97.82	762,996.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	56.67	2,240,051.76
	YAMANA GOLD INC	81,672	5.62	458,996.64
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	20.66	407,497.84
	CAE INC	25,999	36.06	937,523.94
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	105.75	814,803.75
	WSP GLOBAL INC	8,602	163.54	1,406,771.08
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	44.05	594,895.25

RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	78.98	809,150.10
THOMSON REUTERS CORP	15,013	145.51	2,184,541.63
AIR CANADA	13,805	25.03	345,539.15
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,870	139.21	8,473,712.70
CP RAILWAY LIMITED	57,581	90.61	5,217,414.41
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	100.85	2,347,989.70
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	48.76	832,772.04
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	81.50	1,880,449.50
QUEBECOR INC -CL B	15,200	31.52	479,104.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	36.97	1,309,551.34
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	192.81	1,042,909.29
DOLLARAMA INC	26,700	57.81	1,543,527.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	74,153	51.21	3,797,375.13
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	40.69	620,644.57
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	88.12	1,137,893.56
METRO INC	18,840	63.21	1,190,876.40
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	134.74	927,415.42
SAPUTO INC	24,489	35.42	867,400.38
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	36.53	1,015,534.00
CANOPY GROWTH CORP	20,989	21.65	454,411.85
BANK MONTREAL	53,539	126.94	6,796,240.66
BANK NOVA SCOTIA	100,660	79.39	7,991,397.40
CANADIAN IMPERIAL BANK	38,790	146.47	5,681,571.30
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	99.32	2,710,343.48
ROYAL BANK OF CANADA	119,310	132.28	15,782,326.80
TORONTO-DOMINION BANK	151,853	83.30	12,649,354.90
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	106,335	71.87	7,642,296.45
IGM FINANCIAL INC	7,685	46.29	355,738.65
ONEX CORP	6,603	88.93	587,204.79
TMX GROUP LTD	4,685	138.04	646,717.40
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	563.63	1,202,222.79
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	39.36	936,295.68
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	72.16	728,743.84
INTACT FINANCIAL CORP	13,043	173.30	2,260,351.90
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	25.10	4,092,705.60
POWER CORP OF CANADA	43,577	43.02	1,874,682.54
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,702	65.69	3,330,614.38
FIRSTSERVICE CORP	3,690	233.08	860,065.20
BLACKBERRY LIMITED	39,400	14.23	560,662.00
CGI INC - CL A	18,428	110.33	2,033,161.24
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	2,130.77	3,539,208.97
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	131.84	1,093,744.64

	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	161.29	693,708.29
	OPEN TEXT CORP	24,643	68.73	1,693,713.39
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,429	1,934.14	18,237,006.06
	BCE INC	6,203	64.95	402,884.85
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	64.01	1,957,681.84
	TELUS CORP	32,908	29.07	956,635.56
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.68	1,019,778.24
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	25.44	620,608.80
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	42.56	223,056.96
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	55.41	625,855.95
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	35.64	367,947.36
	EMERA INC	18,723	59.51	1,114,205.73
	FORTIS INC	36,823	57.70	2,124,687.10
	HYDRO ONE LTD	32,299	31.36	1,012,896.64
	NORTHLAND POWER INC	17,854	41.98	749,510.92
	カナダドル 小計	3,469,882		205,927,724.17 (17,909,534,171)
ユーロ	ENI	218,529	10.42	2,278,820.41
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	8.62	424,347.44
	NESTE OIL OYJ	37,233	50.62	1,884,734.46
	OMV AG	12,549	47.47	595,701.03
	REPSOL SA	127,332	9.90	1,261,096.12
	TENARIS SA	40,648	8.62	350,548.35
	TOTALENERGIES SE	208,459	37.75	7,869,327.25
	VOPAK	6,360	36.30	230,868.00
	AIR LIQUIDE	40,492	150.72	6,102,954.24
	AKZO NOBEL	15,301	103.60	1,585,183.60
	ARCELORMITTAL	61,651	29.41	1,813,155.91
	ARKEMA	5,949	107.10	637,137.90
	BASF SE	78,752	66.50	5,237,008.00
	COVESTRO AG	17,254	55.50	957,597.00
	CRH PLC	64,773	45.24	2,930,330.52
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	29.00	572,866.00
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	42.66	245,806.92
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	74.18	967,381.38
	KONINKLIJKE DSM NV	14,947	180.75	2,701,670.25
	LANXESS	7,293	60.00	437,580.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	49.05	956,671.20
	SOLVAY SA	6,906	113.40	783,140.40
	STORA ENSO OYJ R	42,169	16.71	704,854.83
	SYMRISE AG	11,456	120.65	1,382,166.40
	UMICORE	17,605	56.64	997,147.20

UPM KYMMENE OYJ	45,603	34.71	1,582,880.13
VOESTALPINE AG	7,152	38.62	276,210.24
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,729	23.03	477,388.87
AIRBUS SE	50,151	115.02	5,768,368.02
ALSTOM	24,388	36.87	899,185.56
BOUYGUES ORD	21,446	35.35	758,116.10
BRENTAG SE	12,514	86.44	1,081,710.16
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	14.21	1,151,784.59
DASSAULT AVIATION SA	213	966.00	205,758.00
EIFFAGE	7,964	87.62	697,805.68
FERROVIAL SA	41,438	24.46	1,013,573.48
GEA GROUP AG	13,382	39.60	529,927.20
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	97.32	1,206,573.36
KION GROUP AG	5,887	90.20	531,007.40
KNORR-BREMSE AG	6,822	101.70	693,797.40
KONE OYJ-B	29,051	72.02	2,092,253.02
LEGRAND SA	21,768	97.16	2,114,978.88
MTU AERO ENGINES AG	4,753	197.30	937,766.90
PRYSMIAN SPA	21,155	31.91	675,056.05
RATIONAL AG	483	943.40	455,662.20
SAFRAN SA	28,410	107.12	3,043,279.20
SAINT-GOBAIN	43,973	62.65	2,754,908.45
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,808	152.20	6,819,777.60
SIEMENS	63,910	140.68	8,990,858.80
SIEMENS ENERGY AG	36,181	24.28	878,474.68
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	25.49	571,868.15
THALES SA	9,665	86.08	831,963.20
VINCI S.A.	45,934	90.89	4,174,941.26
WARTSILA OYJ	41,917	12.16	509,710.72
BUREAU VERITAS SA	25,073	28.03	702,796.19
RANDSTAD NV	11,218	62.50	701,125.00
TELEPERFORMANCE	4,734	373.30	1,767,202.20
WOLTERS KLUWER	22,949	97.56	2,238,904.44
ADP	2,382	100.35	239,033.70
AENA SME SA	6,542	136.30	891,674.60
ATLANTIA SPA	46,597	15.94	742,989.16
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	8.74	203,606.72
DEUTSCHE POST AG-REG	81,964	59.24	4,855,547.36
GETLINK	29,362	13.81	405,636.03
INPOST SA	12,480	15.90	198,432.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,684	78.28	2,245,383.52
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	68.40	341,384.40

CONTINENTAL AG	9,928	114.90	1,140,727.20
DAIMLER AG	73,367	71.21	5,224,464.07
FAURECIA	10,948	42.07	460,582.36
FERRARI NV	10,170	183.10	1,862,127.00
MICHELIN	13,839	139.75	1,934,000.25
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	85.94	1,009,365.30
RENAULT SA	17,362	31.17	541,260.35
STELLANTIS NV	170,174	17.16	2,920,866.53
VALEO SA	21,538	24.14	519,927.32
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,167	200.75	3,044,775.25
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	282.00	701,052.00
ADIDAS AG	16,242	304.25	4,941,628.50
ESSILORLUXOTTICA	23,442	162.04	3,798,541.68
HERMES INTERNATIONAL	2,731	1,241.00	3,389,171.00
KERING	6,205	668.60	4,148,663.00
LVMH	23,334	623.10	14,539,415.40
MONCLER SPA	14,361	54.34	780,376.74
PUMA SE	9,220	105.10	969,022.00
SEB SA	2,282	133.60	304,875.20
ACCOR	14,436	29.10	420,087.60
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	165.40	2,401,277.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	42.88	347,671.04
SODEXO	8,135	69.44	564,894.40
BOLLORE	83,646	5.10	426,594.60
PUBLICIS GROUPE	17,077	55.76	952,213.52
SCOUT24 AG	7,492	71.58	536,277.36
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	53.74	379,995.54
VIVENDI SE	61,243	32.48	1,989,172.64
DELIVERY HERO SE	13,414	120.00	1,609,680.00
HELLOFRESH SE	13,805	93.86	1,295,737.30
INDITEX	95,060	28.96	2,752,937.60
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	74.78	1,164,474.16
PROSUS	78,855	71.77	5,659,423.35
ZALANDO SE	17,664	94.12	1,662,535.68
CARREFOUR	52,544	16.90	887,993.60
COLRUYT SA	5,424	48.07	260,731.68
JERONIMO MARTINS	24,901	17.75	442,117.25
KESKO OYJ-B SHS	25,583	35.45	906,917.35
KONINKLIJKE AHOLD NV	87,400	28.72	2,510,128.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,788	51.72	3,299,115.36
DANONE (GROUPE)	54,643	62.16	3,396,608.88
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	11.67	572,728.59

HEINEKEN HOLDING NV	10,701	78.40	838,958.40
HEINEKEN NV	22,407	92.62	2,075,336.34
JDE PEET'S BV	7,000	29.03	203,210.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	123.60	1,612,980.00
PERNOD-RICARD	18,224	177.70	3,238,404.80
REMY COINTREAU	2,382	165.30	393,744.60
BEIERSDORF AG	9,190	103.30	949,327.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	76.85	674,743.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	82.92	1,197,281.88
LOREAL	21,038	393.60	8,280,556.80
AMPLIFON SPA	11,650	43.68	508,872.00
BIOMERIEUX	4,175	105.80	441,715.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	186.90	641,067.00
DIASORIN SPA	2,070	189.45	392,161.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,472	66.16	1,155,947.52
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	45.02	1,516,847.22
KONINKLIJKE PHILIPS	77,215	38.06	2,939,188.97
ORPEA	4,336	106.75	462,868.00
SARTORIUS AG-VORZUG	2,224	556.00	1,236,544.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	20,758	59.40	1,233,025.20
ARGENX SE	4,178	288.00	1,203,264.00
BAYER	83,832	47.31	3,966,091.92
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	118.86	1,214,749.20
GRIFOLS SA	27,685	20.55	568,926.75
IPSEN	3,532	82.94	292,944.08
MERCK KGAA	10,555	199.70	2,107,833.50
ORION OYJ-CLASS B	9,854	34.15	336,514.10
QIAGEN N.V.	17,038	47.48	808,964.24
RECORDATI SPA	9,859	56.14	553,484.26
SANOFI	94,644	88.18	8,345,707.92
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	517.80	1,252,558.20
UCB (GROUPE)	9,389	97.44	914,864.16
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	11.74	468,672.54
BANCO BILBAO VIZCAYA	576,942	5.58	3,219,336.36
BANCO SANTANDER SA	1,470,387	3.16	4,655,245.24
BNP PARIBAS	93,068	53.46	4,975,415.28
CAIXABANK	380,168	2.65	1,007,825.36
COMMERZBANK AG	94,388	5.27	497,519.14
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	12.11	1,084,384.71
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	33.50	800,817.50
FINECOBANK SPA	53,120	15.99	849,388.80
ING GROEP NV-CVA	320,768	11.66	3,740,796.41

INTESA SANPAOLO	1,346,514	2.37	3,202,010.29
KBC GROEP NV	21,052	71.78	1,511,112.56
MEDIOBANCA	53,990	9.96	538,064.34
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	20.44	255,295.60
SOCIETE GENERALE	67,846	26.68	1,810,131.28
UNICREDIT SPA	189,030	10.67	2,018,084.28
AMUNDI SA	6,226	79.40	494,344.40
DEUTSCHE BANK NAMEN	177,263	10.52	1,865,161.28
DEUTSCHE BOERSE	16,510	148.80	2,456,688.00
EURAZEO SA	3,357	87.50	293,737.50
EXOR NV	10,345	70.82	732,632.90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	96.94	825,444.10
SOFINA	1,238	376.20	465,735.60
WENDEL	2,023	123.30	249,435.90
AEGON	166,267	4.22	702,644.34
AGEAS	16,065	43.12	692,722.80
ALLIANZ SE-REG	34,366	199.00	6,838,834.00
ASSICURAZIONI GENERALI	97,567	17.15	1,673,274.05
AXA SA	166,887	24.06	4,016,135.65
CNP ASSURANCES	16,287	14.69	239,256.03
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	156.15	676,597.95
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,376	251.95	2,866,183.20
NN GROUP NV	22,611	44.44	1,004,832.84
POSTE ITALIANE SPA	46,035	11.63	535,387.05
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	43.97	1,894,007.75
SCOR SE	13,354	25.92	346,135.68
AROUNDTOWN SA	94,068	6.52	613,511.49
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,092	52.48	1,474,268.16
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	136.65	720,828.75
VONOVIA SE	45,080	58.30	2,628,164.00
ADYEN NV	1,666	2,725.50	4,540,683.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,094	51.26	2,003,958.44
ATOS SE	9,750	42.86	417,885.00
BECHTLE AG	7,659	61.66	472,253.94
CAPGEMINI SA	13,914	191.00	2,657,574.00
DASSAULT SYSTEMES SA	57,125	48.74	2,784,272.50
EDENRED	18,664	48.04	896,618.56
NEMETSCHEK SE	5,455	82.26	448,728.30
NEXI SPA	41,348	17.57	726,484.36
SAP SE	87,453	125.76	10,998,089.28
TEAMVIEWER AG	14,174	28.67	406,368.58
WORLDLINE SA	20,332	74.55	1,515,750.60

	NOKIA OYJ	450,608	5.16	2,326,939.71	
	CELLNEX TELECOM SA	41,435	60.78	2,518,419.30	
	DEUTSCHE TELEKOM	285,034	18.47	5,264,577.98	
	ELISA A	13,387	54.96	735,749.52	
	ILIAD SA	1,253	182.00	228,046.00	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.09	306,483.75	
	KPN (KON.)	282,927	2.70	766,166.31	
	ORANGE	171,535	9.67	1,660,287.26	
	PROXIMUS	13,141	16.70	219,520.40	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.38	326,442.16	
	TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.41	193,465.49	
	TELEFONICA	456,377	4.27	1,951,468.05	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.42	239,581.30	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	36.68	348,936.84	
	E.ON SE	185,377	11.06	2,051,011.12	
	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	21.34	458,084.44	
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.42	451,329.82	
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	105.40	308,295.00	
	ENAGAS	25,299	19.26	487,258.74	
	ENDESA	25,972	20.06	520,998.32	
	ENEL	692,930	7.67	5,321,009.47	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.61	1,040,721.33	
	ENGIE	158,224	12.03	1,904,067.61	
	FORTUM OYJ	32,550	25.57	832,303.50	
	IBERDROLA SA	510,769	10.45	5,337,536.05	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	21.76	507,225.60	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.03	675,131.12	
	RWE STAMM	55,390	32.80	1,816,792.00	
	SNAM SPA	147,559	4.98	735,286.49	
	SUEZ	32,549	19.62	638,611.38	
	TERNA SPA	130,230	6.69	871,499.16	
	UNIPER SE	7,335	33.83	248,143.05	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	28.58	1,241,143.66	
	VERBUND AG	6,430	90.10	579,343.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	4,217	330.20	1,392,453.40	
	ASML HOLDING NV	35,340	703.50	24,861,690.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES	112,361	36.09	4,055,108.49	
	STMICROELECTRONICS	55,076	37.26	2,052,407.14	
	ユーロ 小計	16,046,743		417,678,494.47 (54,097,718,603)	
イギリスポンド	BP PLC	1,696,535	3.02	5,132,018.37	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,807	14.53	4,969,190.16	

ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	308,298	14.49	4,468,471.21
ANGLO AMERICAN PLC	108,946	30.84	3,359,894.64
ANTOFAGASTA PLC	35,856	14.62	524,214.72
BHP GROUP PLC	175,556	22.80	4,002,676.80
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	90.54	989,058.96
EVRAZ PLC	43,000	5.95	256,194.00
GLENCORE PLC	823,141	3.32	2,737,355.39
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	29.93	504,260.64
MONDI PLC	36,710	20.30	745,213.00
RIO TINTO PLC REG	96,096	54.04	5,193,027.84
ASHTED GROUP PLC	37,034	56.14	2,079,088.76
BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.71	1,485,193.84
BUNZL PLC	24,880	26.80	666,784.00
DCC PLC	9,127	61.58	562,040.66
FERGUSON PLC	19,417	102.25	1,985,388.25
MELROSE INDUSTRIES PLC	456,624	1.68	769,183.12
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.16	742,360.16
SMITHS GROUP PLC	37,146	14.24	529,144.77
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	161.00	887,754.00
EXPERIAN PLC	79,162	32.01	2,533,975.62
INTERTEK GROUP PLC	13,890	52.30	726,447.00
RELX PLC	166,847	21.77	3,632,259.19
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.78	813,098.24
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	7.33	707,117.77
BURBERRY GROUP PLC	29,776	18.51	551,153.76
PERSIMMON PLC	25,686	28.91	742,582.26
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.81	478,556.44
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,829	48.22	570,394.38
COMPASS GROUP PLC	155,632	15.03	2,339,927.12
ENTAIN PLC	49,630	19.09	947,684.85
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	46.01	738,046.41
WHITBREAD PLC	17,434	32.08	559,282.72
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.26	453,757.04
INFORMA PLC	141,175	5.33	753,309.80
PEARSON	66,305	7.67	508,559.35
WPP PLC	95,821	9.80	939,620.72
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	10.12	418,820.62
KINGFISHER PLC	198,587	3.54	704,189.50
NEXT PLC	11,468	79.62	913,082.16
OCADO GROUP PLC	44,612	20.38	909,192.56
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	2.90	608,211.13
SAINSBURY (J) PLC	148,335	3.10	460,431.84

TESCO PLC	666,000	2.54	1,697,301.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	19.73	660,925.15	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	181,738	26.99	4,905,108.62	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.26	471,629.60	
DIAGEO	195,886	34.87	6,831,524.25	
IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	15.29	1,238,680.87	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,534	55.41	3,354,188.94	
UNILEVER PLC	220,661	40.45	8,925,737.45	
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	14.01	961,015.95	
ASTRAZENECA	133,282	85.65	11,415,603.30	
GLAXOSMITHKLINE	430,042	14.75	6,345,699.75	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	25.24	415,298.96	
BARCLAYS	1,426,525	1.85	2,650,483.45	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,705,000	3.94	6,733,897.50	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,838,937	0.44	2,574,387.32	
NATWEST GROUP PLC	369,149	2.18	807,328.86	
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	4.57	972,577.78	
3I GROUP PLC	88,121	13.31	1,172,890.51	
ABRDN PLC	210,980	2.67	563,738.56	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	15.04	497,508.16	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	80.24	2,213,982.08	
M&G PLC	229,107	2.08	477,917.20	
SCHRODERS PLC	11,794	37.52	442,510.88	
ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	16.03	656,376.69	
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	36.58	594,607.90	
AVIVA PIC	332,730	4.11	1,367,853.03	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.10	352,971.36	
LEGAL & GENERAL GROUP	514,539	2.70	1,389,255.30	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.29	320,796.29	
PRUDENTIAL	225,330	15.27	3,440,789.10	
AVEVA GROUP PLC	10,917	41.82	456,548.94	
SAGE GROUP PLC	95,210	7.42	706,839.04	
HALMA PLC	31,069	29.94	930,205.86	
BT GROUP PLC	769,485	1.69	1,307,739.75	
VODAFONE GROUP PLC	2,206,986	1.22	2,708,854.61	
NATIONAL GRID PLC	306,760	9.37	2,877,102.04	
SEVERN TRENT PLC	22,468	27.68	621,914.24	
SSE PLC	92,294	16.20	1,495,162.80	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.49	614,504.20	
イギリスポンド 小計	24,422,580		150,769,671.06 (22,766,220,330)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.53	339,869.93

EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	1,006.00	577,444.00
GIVAUDAN-REG	795	4,628.00	3,679,260.00
HOLCIM LTD	45,387	52.64	2,389,171.68
SIKA AG-BR	11,766	332.40	3,911,018.40
ABB LTD	149,042	34.20	5,097,236.40
GEBERIT AG-REG	2,964	769.40	2,280,501.60
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	287.00	606,144.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	298.80	1,125,878.40
ADECCO GROUP AG-REG	14,573	51.74	754,007.02
SGS SA	506	2,874.00	1,454,244.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	332.40	1,521,394.80
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,541	103.30	4,497,785.30
SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	263.00	653,029.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	51.55	203,003.90
BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,376.00	665,280.00
CHOCOLAFABRIKEN LINDT-REG	10	109,100.00	1,091,000.00
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,710.00	878,220.00
NESTLE SA - REGISTERED	243,137	116.36	28,291,421.32
ALCON INC	42,603	74.70	3,182,444.10
SONOVA HOLDING AG-REG	4,677	356.90	1,669,221.30
STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,755.00	1,498,770.00
LONZA GROUP AG-REG	6,195	777.80	4,818,471.00
NOVARTIS	187,008	84.28	15,761,034.24
ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	409.00	1,144,791.00
ROCHE HOLDING GENUSS	59,238	366.30	21,698,879.40
VIFOR PHARMA AG	4,486	131.95	591,927.70
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	78.00	222,612.00
CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.70	2,070,280.47
JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	63.48	1,199,581.56
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,941	1,623.50	3,151,213.50
UBS GROUP AG	315,017	15.39	4,849,686.71
BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	150.30	655,608.60
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	484.60	1,380,625.40
SWISS RE LTD	24,674	85.92	2,119,990.08
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,740	402.60	5,129,124.00
SWISS PRIME SITE-REG	5,679	98.60	559,949.40
TEMENOS AG - REG	5,150	143.70	740,055.00
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	95.20	1,398,107.20
SWISSCOM	2,187	539.00	1,178,793.00
スイスフラン 小計	1,479,172		135,037,075.41 (16,270,617,216)
LUNDIN ENERGY AB	17,222	263.60	4,539,719.20

スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	23,903	309.90	7,407,539.70
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	155.10	8,835,581.70
	ALFA LAVAL AB	27,268	350.40	9,554,707.20
	ASSA ABLOY AB-B	86,548	279.90	24,224,785.20
	ATLAS COPCO A	55,390	600.20	33,245,078.00
	ATLAS COPCO B	31,902	502.80	16,040,325.60
	EPIROC AB-A	58,039	193.50	11,230,546.50
	EPIROC AB-B	37,972	167.45	6,358,411.40
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	300.00	4,200,600.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	119.20	12,828,780.80
	SANDVIK AB	96,684	223.30	21,589,537.20
	SKANSKA B	25,507	250.70	6,394,604.90
	SKF AB-B	35,405	219.50	7,771,397.50
	VOLVO AB-A SHS	13,514	203.20	2,746,044.80
	VOLVO B	123,279	198.10	24,421,569.90
	SECURITAS B	29,533	143.60	4,240,938.80
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	221.50	4,711,083.50
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	116.70	4,517,690.40
	EVOLUTION AB	14,096	1,445.40	20,374,358.40
	EMBRACER GROUP AB	18,755	196.05	3,676,917.75
	HENNES & MAURITZ B	65,999	173.14	11,427,066.86
	ICA GRUPPEN AB	9,493	429.70	4,079,142.10
	SWEDISH MATCH AB	127,270	79.38	10,102,692.60
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	277.70	13,738,929.80
	NORDEA BANK ABP	280,957	103.06	28,955,428.42
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	117.50	16,270,225.00
	SVENSKA HANDELSBK A	131,166	98.58	12,930,344.28
	SWEDBANK AB-A	72,526	168.18	12,197,422.68
	EQT AB	20,102	435.40	8,752,410.80
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	314.60	3,182,179.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	300.80	3,359,334.40
INVESTOR AB-B SHS	157,664	204.70	32,273,820.80	
KINNEVIK AB - B	18,792	340.50	6,398,676.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	543.80	3,958,864.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	624.00	5,896,800.00	
SINCH AB	33,150	192.15	6,369,772.50	
ERICSSON (LM) B	253,862	103.00	26,147,786.00	
HEXAGON AB-B SHS	169,708	148.65	25,227,094.20	
TELE2 AB-B SHS	32,829	130.90	4,297,316.10	
TELIA CO AB	230,643	37.57	8,665,257.51	
スウェーデンクローナ 小計	2,763,709		483,140,781.50 (6,145,550,740)	

ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	76,370	189.44	14,467,532.80	
	NORSK HYDRO	126,800	60.60	7,684,080.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	447.60	7,344,220.80	
	ADEVINTA ASA	19,117	188.00	3,593,996.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	430.00	3,987,820.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	483.90	3,426,979.80	
	MOWI ASA	40,968	235.90	9,664,351.20	
	ORKLA	69,804	78.66	5,490,782.64	
	DNB BANK ASA	71,795	189.95	13,637,460.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	209.20	3,885,680.80	
	TELENOR ASA	51,193	155.50	7,960,511.50	
ノルウェークローネ 小計		507,385		81,143,415.79 (1,023,218,473)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	579.00	4,911,657.00	
	NOVOZYMES A/S	17,111	508.00	8,692,388.00	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	3,384.00	2,554,920.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	87,375	254.80	22,263,150.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	17,250.00	5,157,750.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	514	18,055.00	9,280,270.00	
	DSV PANALPINA A S	17,354	1,589.00	27,575,506.00	
	PANDORA A/S	8,163	761.20	6,213,675.60	
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,097.50	9,488,985.00	
	AMBU A/S-B	13,555	185.55	2,515,130.25	
	COLOPLAST-B	9,208	1,095.50	10,087,364.00	
	DEMANT A/S	8,512	356.40	3,033,676.80	
	GN STORE NORD A/S	11,967	475.40	5,689,111.80	
	GENMAB A/S	5,192	2,990.00	15,524,080.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	145,274	645.00	93,701,730.00	
	DANSKE BANK A/S	56,132	109.55	6,149,260.60	
TRYG A/S	29,772	157.45	4,687,601.40		
ORSTED A/S	15,439	993.80	15,343,278.20		
デンマーククローネ 小計		443,751		252,869,534.65 (4,404,987,293)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	27.90	575,549.10	
	OIL SEARCH LTD	186,117	3.71	690,494.07	
	SANTOS	156,437	5.97	933,928.89	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	35.00	448,455.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	20.28	1,508,913.12	
	BHP GROUP LTD	245,638	44.70	10,980,018.60	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	24.55	853,603.50	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	3.95	482,508.30	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	20.00	2,769,660.00	

JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	52.66	1,945,681.68
NEWCREST MINING LIMITED	74,098	24.53	1,817,623.94
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	9.34	949,205.52
ORICA LTD	38,288	13.05	499,658.40
RIO TINTO LTD	32,028	109.70	3,513,471.60
SOUTH32 LTD	341,133	2.90	989,285.70
REECE LTD	16,814	21.05	353,934.70
BRAMBLES LTD	108,007	11.86	1,280,963.02
AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.82	731,495.62
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.15	437,750.00
TRANSURBAN GROUP	233,493	14.08	3,287,581.44
ARISTOCRAT LEISURE LTD	44,067	44.49	1,960,540.83
CROWN RESORTS LTD	30,328	9.32	282,656.96
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	148.50	525,838.50
TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	4.81	875,482.53
REA GROUP LTD	5,276	151.65	800,105.40
SEEK LTD	31,593	31.80	1,004,657.40
WESFARMERS LTD	92,850	62.20	5,775,270.00
COLES GROUP LTD	115,478	17.89	2,065,901.42
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.96	764,910.96
WOOLWORTHS GROUP LTD	109,901	40.96	4,501,544.96
TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	12.45	878,198.10
COCHLEAR LIMITED	4,783	226.85	1,085,023.55
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	68.21	1,108,276.08
SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	42.72	1,712,046.72
CSL LIMITED	38,878	311.06	12,093,390.68
AUST AND NZ BANKING GROUP	239,681	28.32	6,787,765.92
COMMONWEALTH BANK OF AUST	148,199	101.54	15,048,126.46
NATIONAL AUSTRALIA BANK	278,638	27.64	7,701,554.32
WESTPAC BANKING	302,673	25.99	7,866,471.27
ASX LTD	18,195	87.62	1,594,245.90
MACQUARIE GROUP LIMITED	29,813	165.60	4,937,032.80
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	43.65	476,308.80
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	5.38	1,234,209.66
MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.53	952,605.80
QBE INSURANCE GROUP	138,071	12.03	1,660,994.13
SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	12.41	1,481,183.14
AFTERPAY LTD	16,441	130.35	2,143,084.35
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	16.59	736,197.84
WISETECH GLOBAL LTD	13,801	46.35	639,676.35
XERO LTD	11,340	150.40	1,705,536.00
TELSTRA CORP	308,467	3.86	1,190,682.62

	AGL ENERGY LTD	64,235	6.81	437,440.35
	AUSNET SERVICES	187,145	1.96	367,739.92
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.54	751,801.30
	オーストラリアドル 小計	5,742,047		128,196,283.22 (10,287,751,728)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.07	833,347.97
	A2 MILK CO LTD	66,854	6.09	407,140.86
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	32.25	1,758,270.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	15.30	555,650.10
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.87	843,084.66
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.80	439,368.40
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.07	560,458.08
	ニュージーランドドル 小計	623,837		5,397,320.07 (414,891,993)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	56.55	12,977,998.80
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	117,500	169.10	19,869,250.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	32.10	5,521,200.00
	MTR CORP	125,000	44.15	5,518,750.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	48.30	8,404,200.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	24.20	4,791,600.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	6.69	883,080.00
	WYNN MACAU LTD	140,800	8.60	1,210,880.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	14.70	2,531,340.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	19.38	2,827,542.00
	WH GROUP LTD	936,500	6.26	5,862,490.00
	BANK EAST ASIA	109,160	12.58	1,373,232.80
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	23.90	6,727,850.00
	HANG SENG BANK	59,400	140.90	8,369,460.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	101,400	485.80	49,260,120.00
	AIA GROUP LTD	1,020,200	95.25	97,174,050.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	50.75	8,348,172.00
	ESR CAYMAN LTD	157,000	23.80	3,736,600.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	19.24	3,328,520.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	34.90	4,370,457.20
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	37.00	5,045,875.00
	SINO LAND CO	315,400	11.44	3,608,176.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	110.30	11,912,400.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	53.30	2,158,650.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	21.90	2,106,780.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	37.85	5,942,450.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	46.80	3,159,000.00	
CLP HOLDINGS	137,500	77.70	10,683,750.00	

	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	12.64	11,434,864.48	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	48.75	5,460,000.00	
	香港ドル 小計	6,809,912		314,598,738.28 (4,432,696,222)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.25	720,825.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.76	554,224.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.06	548,159.92	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.79	485,850.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.14	739,404.00	
	DBS GROUP	155,200	30.10	4,671,520.00	
	OCBC BANK	291,200	11.55	3,363,360.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	25.68	2,411,352.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	10.11	791,613.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	4.04	902,940.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.86	293,608.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.01	332,975.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	19.05	489,585.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.36	1,775,293.48	
	シンガポールドル 小計	2,896,975		18,080,709.40 (1,474,662,658)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	22.46	1,521,799.76	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	472.60	1,014,199.60	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	27.80	2,733,018.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	26.90	2,928,441.60	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	16.91	1,682,545.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	106.50	1,331,569.50	
	AZRIELI GROUP	4,323	294.00	1,270,962.00	
	NICE LTD	5,891	942.00	5,549,322.00	
	イスラエルシェケル 小計	399,293		18,031,857.46 (613,368,056)	
	合 計	92,059,449		509,905,176,766 (509,905,176,766)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	114,413	1,068,617.42	
		LENLEASE GROUP	64,786	788,445.62	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	983,952.90	
		オーストラリアドル 小計	303,750	2,841,015.94 (227,991,529)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,711,080.00	

		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,900,000.00	
		香港ドル 小計	595,500	5,611,080.00 (79,060,117)	
		投資信託受益証券合計	899,250	307,051,646 (307,051,646)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	764,677.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,247,957.90	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,437	10,688,263.50	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,095,357.98	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,025	2,713,080.50	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,473,449.61	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	1,289,726.88	
		CROWN CASTLE INTL CORP	36,859	7,038,963.23	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,924	3,830,471.64	
		DUKE REALTY CORP	31,540	1,595,608.60	
		EQUINIX INC	7,500	6,186,075.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,164,679.40	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,400	2,450,490.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,767,387.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,993,734.60	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,606,907.50	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	932,212.66	
		INVITATION HOMES INC	46,840	1,897,020.00	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,081,626.62	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,004,722.88	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,816,983.63	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	693,410.48	
		PROLOGIS INC	63,163	8,293,933.53	
		PUBLIC STORAGE	13,171	4,184,294.99	
		REALTY INCOME CORP	31,608	2,261,552.40	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	851,123.33	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,113	3,215,339.79	
		SIMON PROPERTY GROUP	28,176	3,766,849.44	
		SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,802,212.65	
		UDR INC	24,265	1,281,434.65	
		VENTAS INC	31,565	1,745,228.85	
		VEREIT INC	21,159	1,055,834.10	
VICI PROPERTIES INC	43,921	1,340,468.92			
VORNADO REALTY TRUST	15,390	644,841.00			
WELLTOWER INC	35,679	3,055,549.56			
WP CAREY INC	14,258	1,101,858.24			
			1,019,402	89,933,329.46	

アメリカドル 小計			(9,869,283,574)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	544,861.97
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	348,679.90
カナダドル 小計		24,377	893,541.87 (77,711,336)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	399,639.48
	GECINA SA	4,459	588,142.10
	KLEPIERRE	17,225	360,863.75
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	778,688.40
ユーロ 小計		37,101	2,127,333.73 (275,532,264)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	421,211.85
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	474,395.35
	SEGRO PLC	106,999	1,371,727.18
イギリスポンド 小計		252,762	2,267,334.38 (342,367,491)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	983,240.50
	GOODMAN GROUP	139,848	3,164,760.24
	GPT GROUP	167,884	814,237.40
	MIRVAC GROUP	266,683	826,717.30
	SCENTRE GROUP	486,663	1,362,656.40
	STOCKLAND	207,412	949,946.96
	VICINITY CENTERS	365,149	624,404.79
オーストラリアドル 小計		1,727,729	8,725,963.59 (700,258,578)
香港ドル	LINK REIT	170,500	12,190,750.00
香港ドル 小計		170,500	12,190,750.00 (171,767,667)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	872,303.66
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	426,560	878,713.60
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	451,000.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	557,093.40
シンガポールドル 小計		1,203,783	2,759,110.66 (225,033,065)
投資証券合計		4,435,654	11,661,953,975 (11,661,953,975)
合計			11,969,005,621 (11,969,005,621)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

- 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 597銘柄	97.4%			70.9%
	投資証券 36銘柄			2.6%	1.9%
カナダドル	株式 89銘柄	99.6%			3.4%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 231銘柄	99.5%			10.4%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 83銘柄	98.5%			4.4%
	投資証券 3銘柄			1.5%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデンクローナ	株式 41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 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 54銘柄	91.7%			2.0%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.0%		0.0%
	投資証券 7銘柄			6.2%	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 30銘柄	94.6%			0.8%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.7%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	86.8%			0.3%
	投資証券 4銘柄			13.2%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 短期金融資産 マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 8月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	15,151,844,323
流動資産合計	15,151,844,323
資産合計	15,151,844,323
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,702,674,477
未払利息	26,202
流動負債合計	3,702,700,679
負債合計	3,702,700,679
純資産の部	
元本等	
元本	11,313,010,524
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	136,133,120
元本等合計	11,449,143,644
純資産合計	11,449,143,644
負債純資産合計	15,151,844,323

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 8月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,313,010,524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 1.0120円 (1万口当たり純資産額) (10,120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 8月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2021年 8月30日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。
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 8月30日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	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 8月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月29日
期首元本額	9,507,375,564円
期中追加設定元本額	21,513,608,691円
期中一部解約元本額	19,707,973,731円
期末元本額	11,313,010,524円
期末元本額の内訳	
DCターゲット・イヤー ファンド2025	3,037,129,127円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	105,185,640円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	53,015,983円
バランスG(25)VA(適格機関投資家専用)	6,760,615,573円
FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	13,430,146円
ブラジル国債ファンド(毎月分配型)	2,120,953円
ブラジル国債ファンド(年2回決算型)	140,627円
ブラジル高配当株オープン(毎月決算型)	9,880,568円
アメリカ高配当株オープン(毎月決算型)	296,510円
アメリカ高配当株オープン(年2回決算型)	98,901円
米国成長株式ファンド	493,486円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,600,302円
日本株配当戦略投信2020-03(適格機関投資家専用)	270,662,387円
日本株配当戦略投信2020-09(適格機関投資家専用)	1,058,340,321円

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2025】

## 【純資産額計算書】

(2021年 9月30日現在)

資産総額	5,223,501,103円
負債総額	7,535,551円
純資産総額( - )	5,215,965,552円
発行済口数	3,961,600,920口
1口当たり純資産額( / )	1.3166円
(1万口当たり純資産額)	(13,166円)

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2035】

## 【純資産額計算書】

(2021年 9月30日現在)

資産総額	5,424,771,566円
負債総額	3,578,461円
純資産総額( - )	5,421,193,105円
発行済口数	3,599,541,062口
1口当たり純資産額( / )	1.5061円
(1万口当たり純資産額)	(15,061円)

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2045】

## 【純資産額計算書】

(2021年 9月30日現在)

資産総額	2,756,233,307円
負債総額	4,009,805円
純資産総額( - )	2,752,223,502円
発行済口数	1,732,716,346口
1口当たり純資産額( / )	1.5884円
(1万口当たり純資産額)	(15,884円)

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2055】

## 【純資産額計算書】

(2021年 9月30日現在)

資産総額	84,917,825円
負債総額	34,055円
純資産総額（ - ）	84,883,770円
発行済口数	68,000,198口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2483円
（1万口当たり純資産額）	（12,483円）

(参考)

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 9月30日現在)

資産総額	673,513,615,734円
負債総額	8,503,041,220円
純資産総額（ - ）	665,010,574,514円
発行済口数	471,608,130,011口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4101円
（1万口当たり純資産額）	（14,101円）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 9月30日現在)

資産総額	494,486,406,552円
負債総額	783,032,947円
純資産総額（ - ）	493,703,373,605円
発行済口数	249,768,323,924口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9766円
（1万口当たり純資産額）	（19,766円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2021年 9月30日現在）

資産総額	298,249,604,626円
負債総額	248,308,002円
純資産総額（ - ）	298,001,296,624円
発行済口数	97,195,843,485口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0660円
（1万口当たり純資産額）	（30,660円）

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2021年 9月30日現在）

資産総額	527,707,794,317円
負債総額	10,679,222,349円
純資産総額（ - ）	517,028,571,968円
発行済口数	132,221,776,468口
1口当たり純資産額（ / ）	3.9103円
（1万口当たり純資産額）	（39,103円）

## 短期金融資産 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	10,100,976,363円
負債総額	1,854,597円
純資産総額（ - ）	10,099,121,766円
発行済口数	9,979,334,878口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0120円
（1万口当たり純資産額）	（10,120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。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（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年における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2021年11月30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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	305	500
<b>その他利益剰余金</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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30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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年11月27日	有価証券届出書
2020年11月27日	有価証券報告書
2021年 5月28日	有価証券届出書
2021年 5月28日	半期報告書

**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10月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤー ファンド2025の2020年8月29日から2021年8月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤー ファンド2025の2021年8月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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10月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤー ファンド2035の2020年8月29日から2021年8月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤー ファンド2035の2021年8月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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10月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤー ファンド2045の2020年8月29日から2021年8月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤー ファンド2045の2021年8月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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10月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤー ファンド2055の2020年8月29日から2021年8月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤー ファンド2055の2021年8月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。