

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年11月29日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCターゲット・イヤー ファンド2025 DCターゲット・イヤー ファンド2035 DCターゲット・イヤー ファンド2045 DCターゲット・イヤー ファンド2055
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	DCターゲット・イヤー ファンド2025 10兆円を上限とします。 DCターゲット・イヤー ファンド2035 10兆円を上限とします。 DCターゲット・イヤー ファンド2045 10兆円を上限とします。 DCターゲット・イヤー ファンド2055 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DCターゲット・イヤー ファンド2025

DCターゲット・イヤー ファンド2035

DCターゲット・イヤー ファンド2045

DCターゲット・イヤー ファンド2055

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

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

( 7 ) 【申込期間】

2022年11月30日から2023年 5月26日までとします。

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

( 8 ) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

( 9 ) 【払込期日】

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

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

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 12 ) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

お申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &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
債券	年4回	日本	オブ・ファンズ		その他	
一般					( )	
公債	年6回	北米				ロング・
社債	(隔月)	欧州				ショート
その他債券	年12回					型/絶対収
クレジット属性	(毎月)	アジア				益追求型
( )	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。

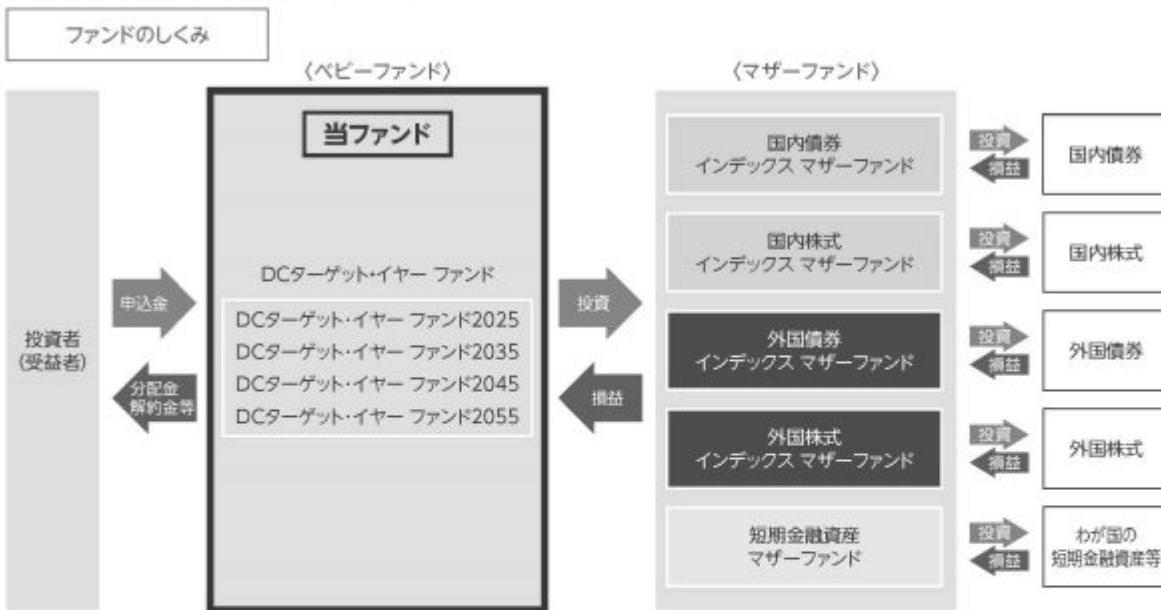
#### [ 特殊型 ]

- (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ペーパーファンドとし、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JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)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すべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

※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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

### ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

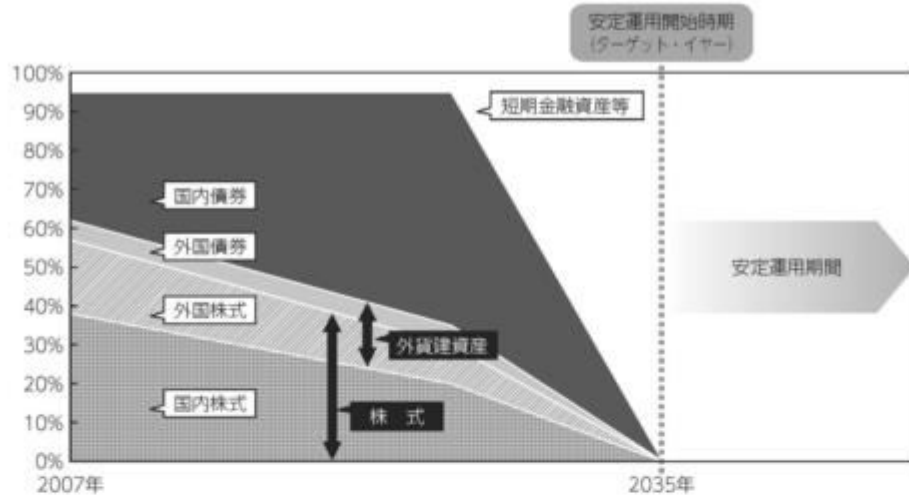
## 3. 安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)に近づくにしたい、原則として1年に2回、各マザーファンドの基本組入比率を変更します。

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

各ファンドの安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)

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

基本組入比率イメージ  
(例:DCターゲット・イヤー ファンド2035)



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

基本組入比率の推移

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

■ 2022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	18.00%	6.00%	1.50%	3.00%	71.50%
DCターゲット・イヤー ファンド2035	55.50%	23.00%	5.00%	11.50%	5.00%
DCターゲット・イヤー ファンド2045	40.50%	33.00%	5.00%	16.50%	5.00%
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25.50%	43.00%	5.00%	21.50%	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

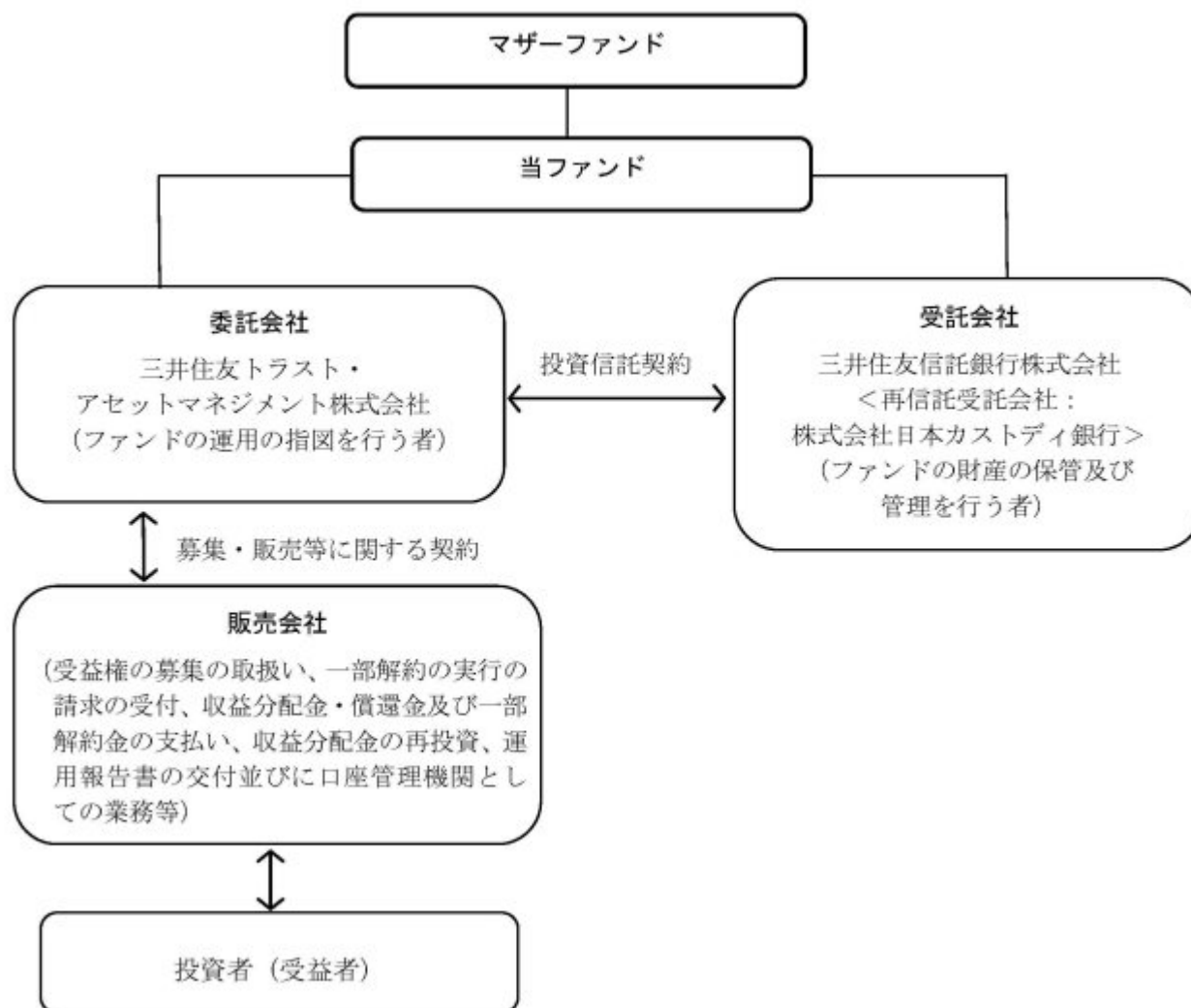
ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 短期金融資産 マザーファンド」の名称を「短期金融資産 マザーファンド」にそれぞれ変更

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（2022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す。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

2025 / 2035 / 2045

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

付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)

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

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

2055

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

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

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

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

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

### (参考)マザーファンド概要

#### 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

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

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

###### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

##### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1.基本方針

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

### 2.運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、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、金利先渡し取引および為替先渡し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。

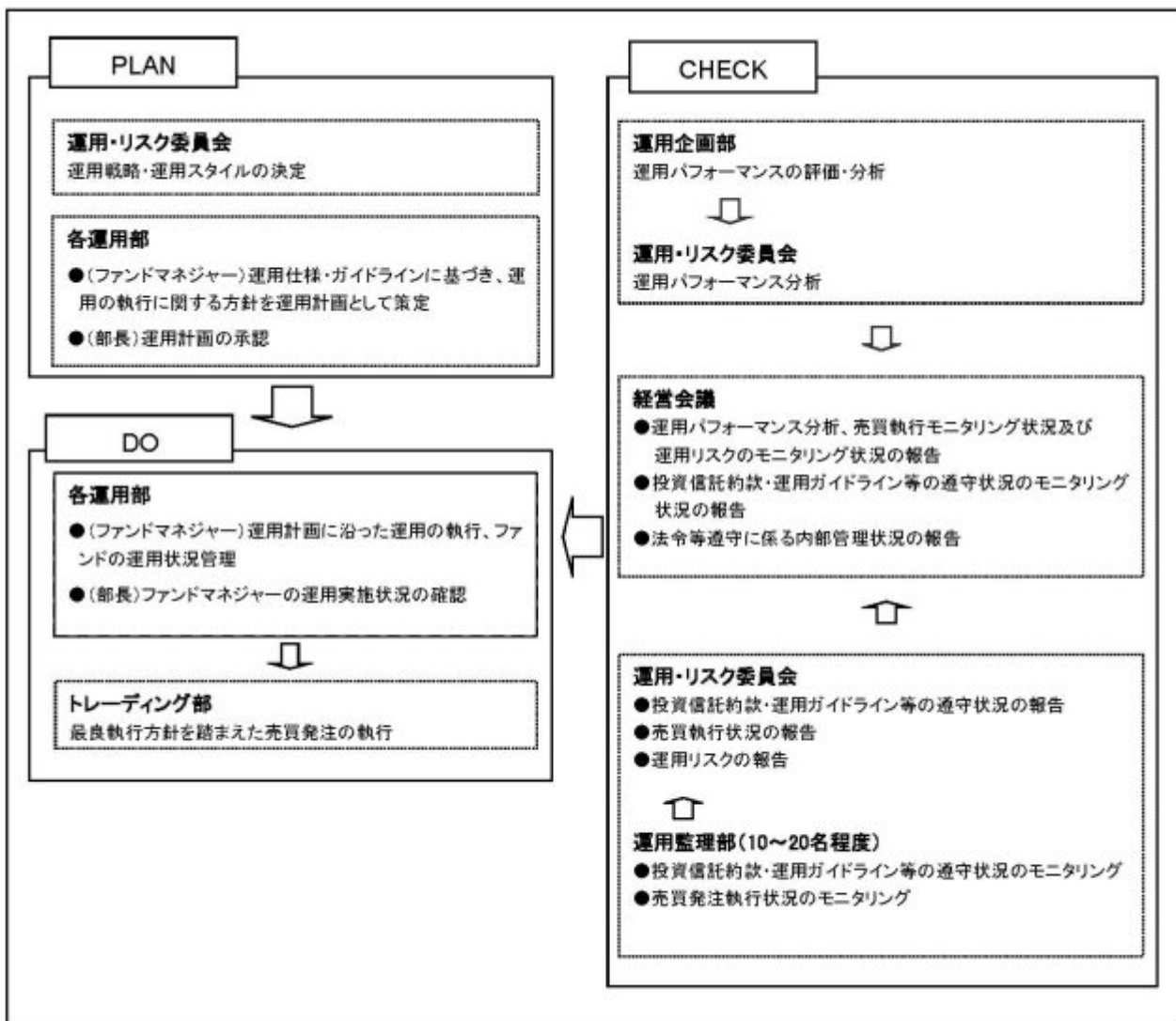
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となる

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、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

### 株価変動リスク

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

### 為替変動リスク

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

### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

### 信用リスク

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

### 流動性リスク

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

### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

## <その他の留意点>

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

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

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

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

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

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

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。

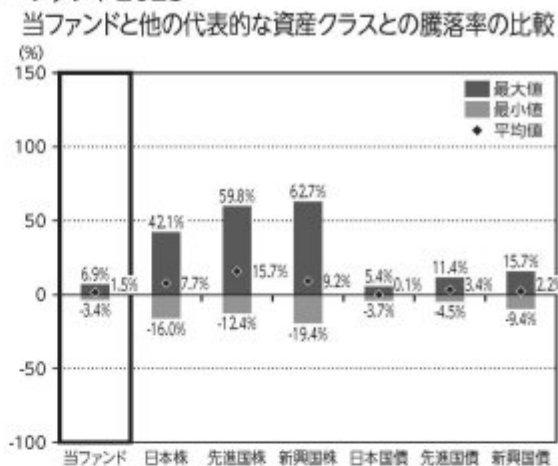
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

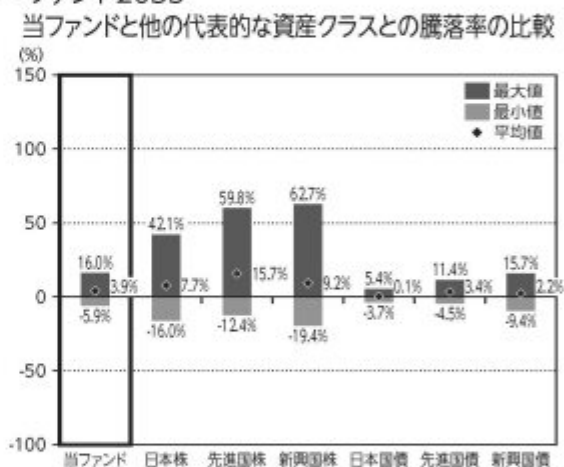
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 〔参考情報〕

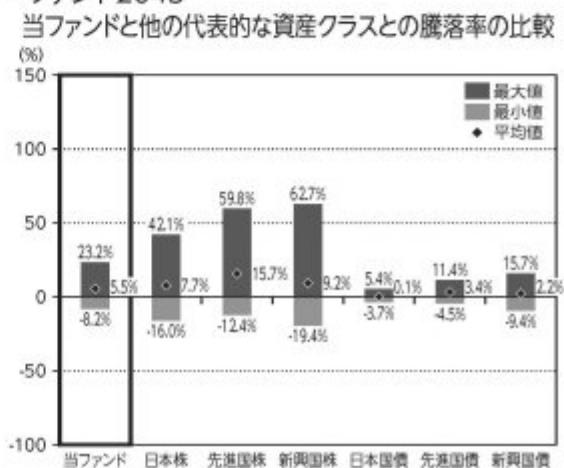
## DCターゲット・イヤー ファンド2025



## 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



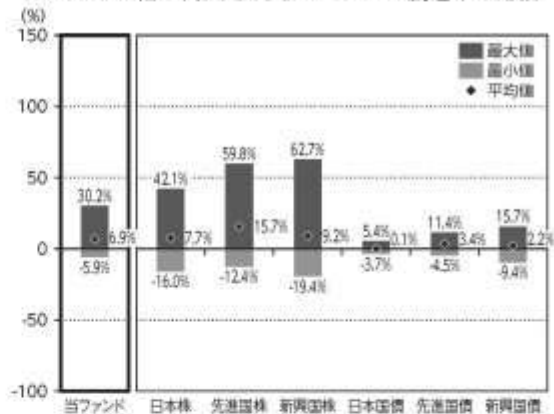
## 【参考情報】

## 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2017年10月～2022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～2022年9月の3年8ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2017年10月～2022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JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・セクターで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当利益を考慮して算出した株価指数です。同指数の算出及び再指数に係る権利は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という)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すべての権利、ノウハウ及び同指数に係る権利は特許に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤差、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品(本「JPX」)は、同指数の指数値の算出又は公表の誤差、遅延又は中断に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当利益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当利益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募国債と付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の購入ベースに基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動(サービス)に関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤差、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Emerging Markets Bond Index Global ex-Japan (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性、正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金(解約)手数料】

<解約手数料>



ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

( 3 ) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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、2022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、2022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	5,093,608,641	97.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		156,303,908	2.98
合計(純資産総額)		5,249,912,549	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	3,583,925,071	1.0115	3,625,142,088	1.0116	3,625,498,601	69.06
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	692,522,238	1.3728	950,704,319	1.3610	942,522,765	17.95
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	162,544,332	1.9220	312,413,942	1.8355	298,350,121	5.68
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	35,826,168	4.3952	157,463,527	4.1254	147,797,273	2.82
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	25,412,630	3.1528	80,121,341	3.1260	79,439,881	1.51

(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	97.02
合計	97.02

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第6期計算期間末 (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
第15期計算期間末 (2022年 8月29日)	5,239,349,972	5,239,349,972	13,058	13,058
2021年 9月末日	5,215,965,552		13,166	
10月末日	5,234,298,896		13,185	
11月末日	5,239,645,689		13,142	
12月末日	5,270,688,465		13,190	
2022年 1月末日	5,218,175,447		13,065	
2月末日	5,177,336,946		13,030	
3月末日	5,248,949,854		13,112	
4月末日	5,254,971,599		13,057	
5月末日	5,265,939,181		13,052	
6月末日	5,241,999,279		12,996	
7月末日	5,289,044,282		13,062	
8月末日	5,283,233,954		13,065	
9月末日	5,249,912,549		12,971	

## 【分配の推移】

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

第6期計算期間	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
第15期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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
第15期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0.6

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第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
第15期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	351,520,007	305,408,490	4,012,327,313

(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	5,497,386,481	96.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		172,437,809	3.04
合計(純資産総額)		5,669,824,290	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	2,352,296,284	1.3726	3,228,960,683	1.3610	3,201,475,242	56.47
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	689,032,770	1.9218	1,324,237,611	1.8355	1,264,719,649	22.31
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	151,221,153	4.3946	664,560,065	4.1254	623,847,744	11.00
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	92,962,226	3.1527	293,082,286	3.1260	290,599,918	5.13
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	115,405,228	1.0115	116,743,927	1.0116	116,743,928	2.06

(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	96.96
合計	96.96

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第6期計算期間末	(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
第15期計算期間末	(2022年 8月29日)	5,735,939,018	5,735,939,018	14,909	14,909
	2021年 9月末日	5,421,193,105		15,061	
	10月末日	5,490,093,878		15,137	
	11月末日	5,463,463,104		15,000	
	12月末日	5,568,178,079		15,182	
	2022年 1月末日	5,449,454,172		14,791	
	2月末日	5,408,990,176		14,704	
	3月末日	5,597,888,839		15,031	
	4月末日	5,590,028,996		14,839	
	5月末日	5,627,850,351		14,838	
	6月末日	5,604,270,361		14,661	
	7月末日	5,728,392,055		14,912	
	8月末日	5,791,949,463		14,936	
	9月末日	5,669,824,290		14,564	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第6期計算期間	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
第15期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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
第15期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第6期計算期間	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
第15期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	395,490,801	125,411,706	3,847,191,370

(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	2,837,049,282	96.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		89,629,428	3.06
合計(純資産総額)		2,926,678,710	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	892,924,329	1.3725	1,225,598,572	1.3610	1,215,270,011	41.52
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	514,365,927	1.9216	988,437,579	1.8355	944,118,659	32.26
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	112,896,349	4.3940	496,069,191	4.1254	465,742,598	15.91
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	48,355,188	3.1525	152,441,989	3.1260	151,158,317	5.16
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	60,062,967	1.0115	60,759,696	1.0116	60,759,697	2.08

(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	96.94
合計	96.94

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第6期計算期間末	(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
第15期計算期間末	(2022年 8月29日)	2,970,332,492	2,970,332,492	15,836	15,836
	2021年 9月末日	2,752,223,502		15,884	
	10月末日	2,788,430,414		16,000	
	11月末日	2,767,824,629		15,787	
	12月末日	2,843,349,952		16,072	
	2022年 1月末日	2,773,222,735		15,540	
	2月末日	2,753,102,761		15,448	
	3月末日	2,883,567,262		15,948	
	4月末日	2,877,676,903		15,676	
	5月末日	2,905,584,076		15,688	
	6月末日	2,891,313,319		15,472	
	7月末日	2,970,591,119		15,809	
	8月末日	3,002,078,887		15,866	
	9月末日	2,926,678,710		15,370	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第6期計算期間	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

第15期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0
----------	-------------------------	---

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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
第15期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第6期計算期間	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
第15期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	250,322,311	93,878,012	1,875,633,288

(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	105,144,702	96.91

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,349,730	3.09
合計(純資産総額)		108,494,432	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	25,044,603	1.9212	48,117,356	1.8355	45,969,368	42.37
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	21,001,215	1.3726	28,827,344	1.3610	28,582,653	26.34
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	5,497,192	4.3927	24,148,047	4.1254	22,678,115	20.90
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	1,806,214	3.1522	5,693,548	3.1260	5,646,224	5.20
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	2,242,331	1.0115	2,268,341	1.0116	2,268,342	2.09

(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	96.91
合計	96.91

(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
第5期計算期間末	(2022年 8月29日)	108,764,217	108,764,217	12,534	12,534
	2021年 9月末日	84,883,770		12,483	
	10月末日	86,790,698		12,601	
	11月末日	87,029,970		12,382	
	12月末日	90,959,896		12,678	
	2022年 1月末日	88,412,443		12,166	
	2月末日	89,508,679		12,094	
	3月末日	96,535,572		12,607	
	4月末日	106,970,900		12,341	
	5月末日	111,565,161		12,361	
	6月末日	103,980,294		12,168	
	7月末日	108,406,834		12,490	
	8月末日	110,462,786		12,558	
	9月末日	108,494,432		12,086	

## 【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
第5期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29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
第5期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	2.0

(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
第5期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	29,069,429	8,642,594	86,772,951

(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	524,623,346,850	84.12
地方債証券	日本	32,937,311,293	5.28
特殊債証券	日本	36,905,161,716	5.92
社債証券	日本	27,024,134,860	4.33
	フランス	894,911,000	0.14
	スペイン	398,132,000	0.06
	小計	28,317,177,860	4.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		864,544,827	0.14
合計(純資産総額)		623,647,542,546	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,650,000,000	100.36	7,677,612,900	100.29	7,672,491,000	0.100	2024/9/20	1.23
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	7,600,000,000	100.06	7,604,560,000	99.93	7,595,136,000	0.005	2026/12/20	1.22
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	6,890,000,000	100.28	6,909,292,000	100.24	6,906,742,700	0.100	2023/12/20	1.11

日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	6,890,000,000	100.33	6,913,241,000	99.97	6,888,070,800	0.100	2028/3/20	1.10
日本	国債証券	第148回利付国債（5年）	6,770,000,000	100.12	6,778,124,000	100.05	6,773,723,500	0.005	2026/6/20	1.09
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	6,740,000,000	98.86	6,663,191,600	98.69	6,651,908,200	0.100	2031/12/20	1.07
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	5,970,000,000	99.71	5,953,275,400	100.04	5,972,746,200	0.200	2032/3/20	0.96
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	100.51	5,930,503,000	100.37	5,922,184,000	0.100	2026/9/20	0.95
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	5,830,000,000	100.45	5,856,235,000	100.39	5,852,911,900	0.100	2025/6/20	0.94
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	100.28	5,766,617,500	0.100	2027/3/20	0.92
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	5,620,000,000	100.47	5,646,643,000	100.41	5,643,323,000	0.100	2025/9/20	0.90
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	5,590,000,000	100.30	5,607,105,400	100.26	5,604,701,700	0.100	2024/3/20	0.90
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	5,415,000,000	100.12	5,421,629,500	99.72	5,399,946,300	0.100	2028/12/20	0.87
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,340,000,000	101.21	5,404,614,000	101.07	5,397,511,800	0.300	2025/12/20	0.87
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	5,360,000,000	99.82	5,350,504,000	99.57	5,337,112,800	0.200	2032/6/20	0.86
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,210,000,000	99.01	5,158,819,000	98.42	5,127,942,500	0.100	2031/9/20	0.82
日本	国債証券	第153回利付国債（5年）	5,090,000,000	99.92	5,086,155,100	99.71	5,075,646,200	0.005	2027/6/20	0.81
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	5,000,000,000	100.41	5,020,800,000	100.05	5,002,550,000	0.100	2027/12/20	0.80
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,070,000,000	99.11	5,024,877,000	98.46	4,992,378,300	0.100	2031/6/20	0.80
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	4,940,000,000	100.27	4,953,387,400	99.88	4,934,368,400	0.100	2028/6/20	0.79
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	4,830,000,000	101.47	4,901,145,900	101.30	4,893,031,500	0.400	2025/9/20	0.78
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	4,890,000,000	99.46	4,863,936,300	98.75	4,828,923,900	0.100	2030/9/20	0.77
日本	国債証券	第149回利付国債（5年）	4,820,000,000	100.10	4,824,820,000	100.00	4,820,000,000	0.005	2026/9/20	0.77
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	100.49	4,783,514,400	100.43	4,780,563,200	0.100	2026/3/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,790,000,000	100.06	4,793,209,300	99.61	4,771,606,400	0.100	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	4,750,000,000	100.43	4,770,465,500	100.36	4,767,527,500	0.100	2025/3/20	0.76
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	4,670,000,000	101.37	4,733,979,000	101.20	4,726,413,600	0.400	2025/6/20	0.76
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	4,660,000,000	100.33	4,675,797,400	100.26	4,672,349,000	0.100	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	4,600,000,000	101.05	4,648,300,000	100.85	4,639,100,000	0.600	2023/12/20	0.74
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	101.27	4,618,231,200	101.10	4,610,524,800	0.400	2025/3/20	0.74

(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	84.12
地方債証券	5.28
特殊債券	5.92
社債券	4.54
合計	99.86

(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	472,582,867,680	98.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,198,826,595	1.71
合計(純資産総額)		480,781,694,275	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	8,353,800,000	1.74

(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	9,182,300	2,125.92	19,520,835,216	1,876.00	17,225,994,800	3.58
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,261,800	11,966.04	15,098,749,272	9,286.00	11,717,074,800	2.44
日本	株式	キーエンス	電気機器	182,500	51,489.69	9,396,868,425	47,900.00	8,741,750,000	1.82
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,215,400	3,983.08	8,824,115,432	3,906.00	8,653,352,400	1.80
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,628,200	738.13	8,583,123,266	651.50	7,575,772,300	1.58
日本	株式	任天堂	その他製品	1,137,000	5,833.87	6,633,119,286	5,854.00	6,655,998,000	1.38
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,441,000	4,540.20	6,542,428,200	4,243.00	6,114,163,000	1.27
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,583,100	3,746.95	5,931,796,545	3,767.00	5,963,537,700	1.24
日本	株式	日立製作所	電気機器	968,700	6,771.23	6,559,290,501	6,114.00	5,922,631,800	1.23
日本	株式	第一三共	医薬品	1,461,100	3,466.09	5,064,304,099	4,042.00	5,905,766,200	1.23
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,185,200	5,358.18	6,350,514,936	4,900.00	5,807,480,000	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,378,800	4,685.17	6,459,912,396	4,161.00	5,737,186,800	1.19
日本	株式	HOYA	精密機器	383,900	13,946.71	5,354,141,969	13,880.00	5,328,532,000	1.11
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,289,100	3,983.13	5,134,652,883	4,024.00	5,187,338,400	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,300,700	4,487.57	5,836,982,299	3,968.00	5,161,177,600	1.07
日本	株式	ダイキン工業	機械	220,000	20,685.24	4,550,752,800	22,295.00	4,904,900,000	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,472,600	3,188.42	4,695,267,292	3,137.00	4,619,546,200	0.96
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	127,800	59,098.28	7,552,760,184	35,700.00	4,562,460,000	0.95
日本	株式	信越化学工業	化学	312,700	18,201.23	5,691,524,621	14,330.00	4,480,991,000	0.93
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,993,800	1,492.57	4,468,456,066	1,446.50	4,330,531,700	0.90
日本	株式	三井物産	卸売業	1,394,200	3,183.13	4,437,919,846	3,089.00	4,306,683,800	0.90
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,658,400	2,459.25	4,078,420,200	2,565.00	4,253,796,000	0.88
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,189,300	3,722.07	4,426,657,851	3,501.00	4,163,739,300	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	204,700	19,686.77	4,029,881,819	19,705.00	4,033,613,500	0.84
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	665,200	5,410.46	3,599,037,992	5,806.00	3,862,151,200	0.80
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,381,900	1,531.63	3,648,189,497	1,562.50	3,721,718,750	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	549,500	8,231.94	4,523,451,030	6,632.00	3,644,284,000	0.76
日本	株式	日本電産	電気機器	447,500	8,644.00	3,868,190,000	8,130.00	3,638,175,000	0.76
日本	株式	ファナック	電気機器	176,800	21,341.82	3,773,233,776	20,260.00	3,581,968,000	0.75
日本	株式	S M C	機械	59,000	66,232.16	3,907,697,440	58,220.00	3,434,980,000	0.71

(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。

#### □ 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29

建設業	2.23	
食料品	3.52	
繊維製品	0.47	
パルプ・紙	0.19	
化学	6.05	
医薬品	5.62	
石油・石炭製品	0.50	
ゴム製品	0.68	
ガラス・土石製品	0.72	
鉄鋼	0.79	
非鉄金属	0.73	
金属製品	0.57	
機械	5.12	
電気機器	16.28	
輸送用機器	7.47	
精密機器	2.79	
その他製品	2.51	
電気・ガス業	1.23	
陸運業	3.30	
海運業	0.50	
空運業	0.48	
倉庫・運輸関連業	0.16	
情報・通信業	9.11	
卸売業	5.56	
小売業	4.62	
銀行業	5.25	
証券、商品先物取引業	0.73	
保険業	2.23	
その他金融業	1.12	
不動産業	2.00	
サービス業	5.37	
	小計	98.29
合計		98.29

(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	455円		8,435,699,650	8,353,800,000	1.74

(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	164,863,387,073	51.59
	フランス	26,501,003,754	8.29
	イタリア	23,052,731,332	7.21
	ドイツ	19,683,294,030	6.16
	スペイン	15,516,179,389	4.86
	イギリス	13,006,360,433	4.07
	中国	9,162,239,902	2.87
	カナダ	6,488,698,055	2.03
	ベルギー	5,845,418,093	1.83
	オランダ	4,841,911,633	1.52
	オーストラリア	4,770,830,228	1.49
	オーストリア	3,699,374,508	1.16
	メキシコ	2,567,078,401	0.80
	アイルランド	1,983,060,436	0.62
	フィンランド	1,641,007,139	0.51
	マレーシア	1,610,583,573	0.50
	シンガポール	1,367,575,158	0.43
	ポーランド	1,318,447,884	0.41
	イスラエル	1,168,126,473	0.37
	デンマーク	1,116,435,313	0.35
スウェーデン	789,226,059	0.25	
ノルウェー	632,305,784	0.20	
	小計	311,625,274,650	97.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,958,449,411	2.49
合計(純資産総額)		319,583,724,061	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	2,603,562,806	0.81
	買建	ドイツ	2,089,645,422	0.65

(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		5,134,055,230	1.61

(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 1.375% 11/15/31	21,030,000	12,736.67	2,678,522,531	11,802.01	2,481,963,755	1.375	2031/11/15	0.78
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	19,380,000	12,698.25	2,460,922,417	11,739.79	2,275,171,693	1.250	2031/8/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	13,195.24	1,913,310,615	12,361.45	1,792,411,224	1.250	2028/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	14,344.10	1,913,504,189	13,381.34	1,785,071,965	2.625	2029/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	13,943.61	1,812,670,498	13,660.78	1,775,902,334	0.250	2024/3/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	12,693.50	1,910,371,984	11,762.41	1,770,243,997	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	17,350,000	11,597.31	2,012,134,606	10,019.04	1,738,303,765	2.000	2051/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	12,000,000	14,116.14	1,693,937,606	13,920.14	1,670,417,288	0.250	2023/9/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,183.84	1,658,091,198	13,458.27	1,573,272,859	2.375	2027/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	11,530,000	13,851.99	1,597,134,976	13,349.10	1,539,151,949	2.250	2027/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	14,069.76	1,547,673,841	13,851.98	1,523,717,972	0.250	2023/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	13,332.13	1,577,191,718	12,726.31	1,505,522,490	0.750	2026/8/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	12,758.99	1,523,424,189	12,351.27	1,474,742,215	0.500	2027/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	13,851.98	1,504,325,198	13,466.19	1,462,429,183	0.750	2024/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	10,900,000	13,258.51	1,445,178,024	13,037.99	1,421,141,012	0.250	2025/5/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	13,446.40	1,479,104,051	12,880.73	1,416,881,004	0.750	2026/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	14,363.90	1,457,936,610	13,905.71	1,411,430,547	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	13,976.71	1,397,671,047	13,734.60	1,373,460,625	0.125	2024/1/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	12,000,000	12,311.74	1,477,409,544	11,442.25	1,373,070,319	0.625	2030/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	14,023.94	1,433,247,019	13,330.43	1,362,370,903	2.000	2026/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	13,209.38	1,472,846,670	12,194.58	1,359,696,330	1.625	2031/5/15	0.43

アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	12,245.49	1,463,336,727	11,377.76	1,359,643,159	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	13,877.15	1,387,715,360	13,574.52	1,357,452,329	0.250	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	12,468.36	1,390,222,958	11,570.09	1,290,065,347	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	13,108.13	1,338,340,407	12,293.57	1,255,174,214	1.125	2028/8/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/41	12,330,000	11,479.08	1,415,371,636	9,995.28	1,232,418,523	1.750	2041/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	13,851.41	1,248,012,575	13,528.70	1,218,936,278	0.375	2024/7/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	13,842.93	1,245,863,784	13,532.38	1,217,914,326	0.250	2024/6/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	12,875.64	1,287,564,547	12,177.61	1,217,761,594	0.625	2027/12/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	14,074.08	1,238,519,383	13,673.23	1,203,244,391	1.500	2024/11/30	0.38

(注1)国ノ地域は、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	97.51
合計	97.51

(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	65	アメリカドル	7,136,783.64	1,033,477,639	7,005,273.6	1,014,433,670	0.32
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	49	アメリカドル	5,659,449.76	819,544,920	5,510,203.37	797,932,550	0.25
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	43	アメリカドル	5,732,151.65	830,072,879	5,463,687.5	791,196,586	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	2,694,067.5	383,419,687	2,674,625	380,652,630	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	4,258,663.5	606,092,989	4,170,600	593,559,792	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	57	ユーロ	8,170,229.7	1,162,787,091	7,837,500	1,115,433,000	0.35

(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	19,490,000.00	2,785,702,696	2,818,649,647	0.88
	カナダドル	買建	1,950,000.00	211,151,265	206,028,225	0.06
	ユーロ	買建	11,760,000.00	1,678,758,872	1,673,098,728	0.52
	イギリスポンド	買建	1,650,000.00	271,501,660	266,554,860	0.08
	オフショア人民元	買建	8,350,000.00	170,609,177	169,723,770	0.05

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

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	360,405,568,493	68.07
	イギリス	21,478,655,320	4.06
	カナダ	19,548,508,275	3.69
	スイス	17,037,297,746	3.22
	フランス	14,877,099,092	2.81
	オーストラリア	10,892,408,576	2.06
	ドイツ	10,750,237,138	2.03
	アイルランド	8,986,242,405	1.70
	オランダ	8,568,496,108	1.62
	スウェーデン	4,478,418,649	0.85
	デンマーク	3,820,300,890	0.72
	スペイン	3,442,000,415	0.65
	香港	3,107,128,130	0.59
	イタリア	2,409,794,522	0.46
	シンガポール	1,815,442,348	0.34
	フィンランド	1,773,824,271	0.34
	ジャージー	1,614,367,527	0.30
	イスラエル	1,227,882,808	0.23
	ノルウェー	1,137,714,859	0.21
	ベルギー	1,130,167,136	0.21
	ケイマン	1,026,131,544	0.19
	バミューダ	724,533,317	0.14
	キュラソー	586,127,195	0.11
	ニュージーランド	367,396,237	0.07
ルクセンブルク	321,733,929	0.06	

	ポルトガル	266,518,332	0.05
	オーストリア	264,009,681	0.05
	パナマ	111,901,458	0.02
	リベリア	105,959,197	0.02
	マン島	88,047,015	0.02
	小計	502,363,912,613	94.89
投資信託受益証券	オーストラリア	157,210,629	0.03
	香港	76,842,958	0.01
	アメリカ	16,079,847	0.00
	小計	250,133,434	0.05
投資証券	アメリカ	10,259,276,042	1.94
	オーストラリア	597,653,735	0.11
	シンガポール	245,753,238	0.05
	イギリス	189,585,132	0.04
	香港	170,655,581	0.03
	フランス	170,346,736	0.03
	カナダ	50,736,115	0.01
	ベルギー	43,632,232	0.01
	小計	11,727,638,811	2.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,099,833,082	2.85
合計(純資産総額)		529,441,517,940	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,086,152,195	2.09
	買建	カナダ	780,467,556	0.15
	買建	ドイツ	2,504,564,632	0.47
	買建	イギリス	278,037,110	0.05
	買建	オーストラリア	493,224,792	0.09

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

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

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		272,779,595	0.05
	売建		3,418,025,681	0.65



(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	1,323,830	21,718.77	28,751,971,325	20,632.52	27,313,960,601	5.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	581,193	39,589.15	23,008,941,821	34,392.37	19,988,607,603	3.78
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	749,309	16,771.10	12,566,737,132	16,624.18	12,456,653,686	2.35
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	216,377	36,793.79	7,961,330,054	38,839.49	8,403,972,349	1.59
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	492,726	16,280.30	8,021,729,911	14,107.39	6,951,077,944	1.31
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	460,933	16,355.57	7,538,824,664	14,204.41	6,547,282,651	1.24
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	76,869	73,492.27	5,649,277,714	73,683.67	5,663,990,206	1.07
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	215,641	26,151.33	5,639,299,026	23,825.58	5,137,773,902	0.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	343,717	14,114.98	4,851,559,705	12,841.75	4,413,928,060	0.83
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	105,127	46,133.67	4,849,895,208	39,037.87	4,103,935,190	0.78
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	187,450	28,206.93	5,287,389,707	19,753.53	3,702,799,592	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	240,076	18,977.60	4,556,067,885	15,373.02	3,690,695,454	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	196,677	21,509.38	4,230,401,447	18,637.04	3,665,478,493	0.69
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	230,976	17,316.26	3,999,641,038	15,832.68	3,656,970,204	0.69
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	205,210	27,153.53	5,572,177,396	17,695.78	3,631,351,424	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	134,653	30,821.62	4,150,224,376	26,074.48	3,511,008,113	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	84,000	44,659.40	3,751,389,936	40,304.96	3,385,617,253	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	153,061	25,747.21	3,940,894,934	20,964.14	3,208,792,799	0.61
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	66,242	46,730.34	3,095,511,196	47,788.74	3,165,622,252	0.60

アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	144,953	21,671.16	3,141,300,077	20,667.28	2,995,784,702	0.57
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	70,879	51,790.01	3,670,824,489	41,527.16	2,943,403,836	0.56
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	460,155	7,778.39	3,579,268,839	6,394.80	2,942,603,611	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	337,769	9,353.61	3,159,361,216	8,191.90	2,766,970,445	0.52
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	113,421	24,871.80	2,820,985,530	24,126.79	2,736,485,114	0.52
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	57,316	48,924.21	2,804,140,565	47,582.74	2,727,252,612	0.52
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	591,261	5,356.80	3,167,271,725	4,439.87	2,625,124,696	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	207,468	13,452.79	2,791,025,303	12,546.33	2,602,963,735	0.49
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	36,343	68,399.25	2,485,834,051	69,361.09	2,520,790,232	0.48
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	32,118	82,891.38	2,662,305,555	74,810.29	2,402,757,026	0.45
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	124,048	18,609.60	2,308,484,549	19,151.12	2,375,658,444	0.45

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.29
		素材	4.00
		資本財	5.80
		商業・専門サービス	1.20
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	2.36
		耐久消費財・アパレル	1.52
		消費者サービス	1.79
		メディア・娯楽	5.32
		小売	4.90
		食品・生活必需品小売り	1.56
		食品・飲料・タバコ	4.32
		家庭用品・パーソナル用品	1.76

	ヘルスケア機器・サービス	4.84
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.01
	銀行	5.66
	各種金融	4.50
	保険	3.11
	不動産	0.38
	ソフトウェア・サービス	10.61
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.55
	電気通信サービス	1.43
	公益事業	3.17
	半導体・半導体製造装置	3.96
	小計	94.89
投資信託受益証券		0.05
投資証券		2.22
合計		97.15

(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	419	アメリカドル	84,470,468	12,232,168,471	76,556,537.5	11,086,152,195	2.09
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	33	カナダドル	7,810,314.5	826,331,274	7,376,820	780,467,556	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	66	スイスフラン	7,070,022	1,050,463,868	6,683,160	992,983,912	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	325	ユーロ	11,435,672.5	1,627,524,910	10,621,000	1,511,580,720	0.29
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	5,586,849	526,113,570	5,237,600	493,224,792	0.09
	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	25	イギリスポンド	1,819,133.75	294,190,310	1,719,250	278,037,110	0.05

(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	1,175,000.00	170,081,250	170,088,065	0.03
	カナダドル	買建	500,000.00	52,658,000	52,884,500	0.01
	ユーロ	買建	350,000.00	49,806,400	49,807,030	0.01
	アメリカドル	売建	18,100,000.00	2,611,649,000	2,620,326,140	0.49
	カナダドル	売建	1,400,000.00	148,022,000	148,076,600	0.03
	ユーロ	売建	2,650,000.00	370,629,000	377,119,910	0.07
	イギリスポンド	売建	1,180,000.00	184,137,820	190,786,176	0.04
	スイスフラン	売建	550,000.00	81,169,550	81,716,855	0.02

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

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

## 短期金融資産 マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,168,820,509	100.00
合計(純資産総額)		9,168,820,509	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

#### ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

### 投資不動産物件


該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

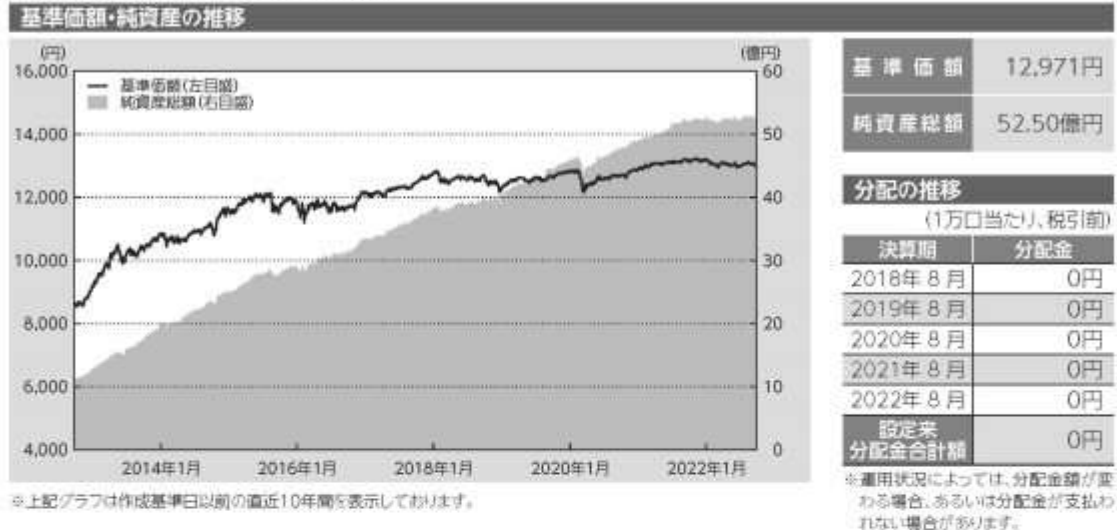
## 参考情報

## 交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2007年9月26日  
作成基準日：2022年9月30日

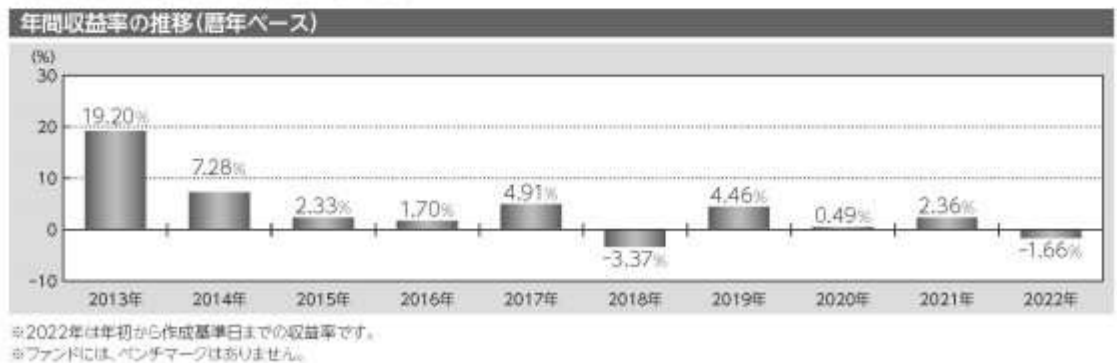
## DCターゲット・イヤー ファンド2025



**主要な資産の状況**


マザーファンド	投資比率	上位購入銘柄	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	69.1%	-	-	-	-	-	-	-
国内債券 インデックス マザーファンド	18.0%	第141回利付国債(5年) 第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100% 0.005%	2024/09/20 2026/12/20	0.2% 0.2%
国内株式 インデックス マザーファンド	5.7%	トヨタ自動車 ソニーグループ	日本	株式	輸送用機器 電気機器	-	-	0.2% 0.1%
外国株式 インデックス マザーファンド	2.8%	APPLE INC MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア ソフトウェア・サービス	-	-	0.1% 0.1%
外国債券 インデックス マザーファンド	1.5%	T 1.375% 11/15/31 T 1.25% 08/15/31	アメリカ	国債	-	1.375% 1.250%	2031/11/15 2031/08/15	0.0% 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。



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：2022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 14,564円

純資産総額 56.70億円

## 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
2022年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

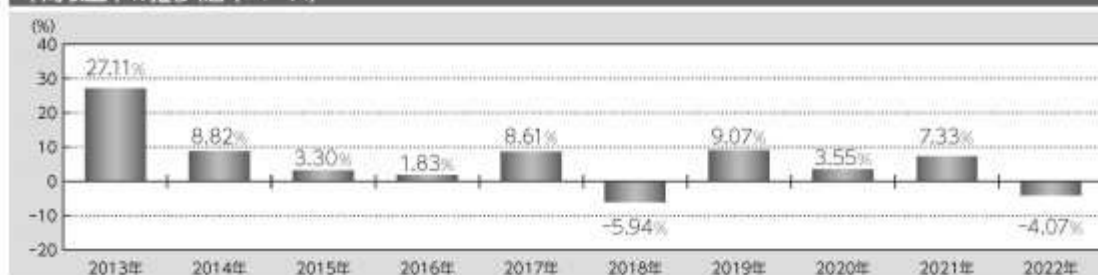
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 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	償還期間	実質投資比率
国内債券 インデックス マザーファンド	56.5%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.7%
		第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	0.7%
国内株式 インデックス マザーファンド	22.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.8%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
外国株式 インデックス マザーファンド	11.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/ハードウェア	-	-	0.6%
		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	5.1%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.0%
		T 1.25% 08/15/31	アメリカ	国債	-	1.250%	2031/08/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	2.1%	-	-	-	-	-	-	-

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2022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：2022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



基準価額 15,370円

純資産総額 29.27億円

## 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
2022年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

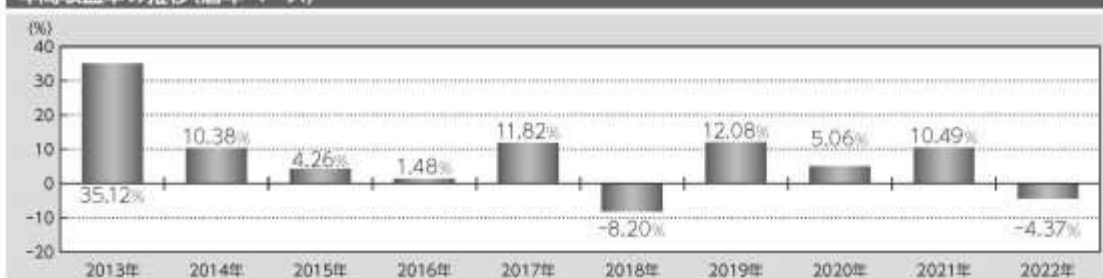
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種別	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	41.5%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.5%
		第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	0.5%
国内株式 インデックス マザーファンド	32.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.2%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
外国株式 インデックス マザーファンド	15.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア機器	-	-	0.8%
		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	5.2%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.0%
		T 1.25% 08/15/31	アメリカ	国債	-	1.250%	2031/08/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	2.1%	-	-	-	-	-	-	-

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)




※2022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。

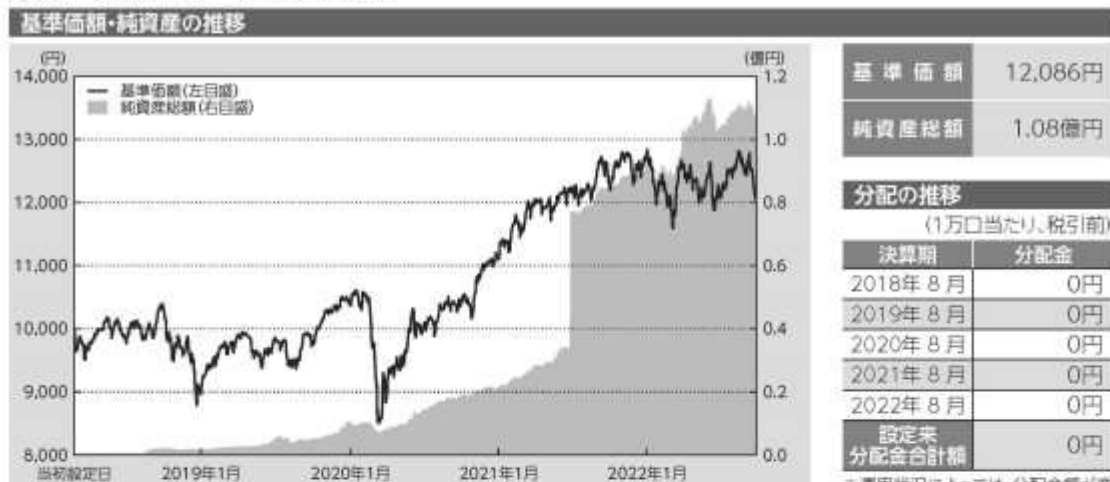
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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：2022年9月30日

## DCターゲット・イヤー ファンド2055



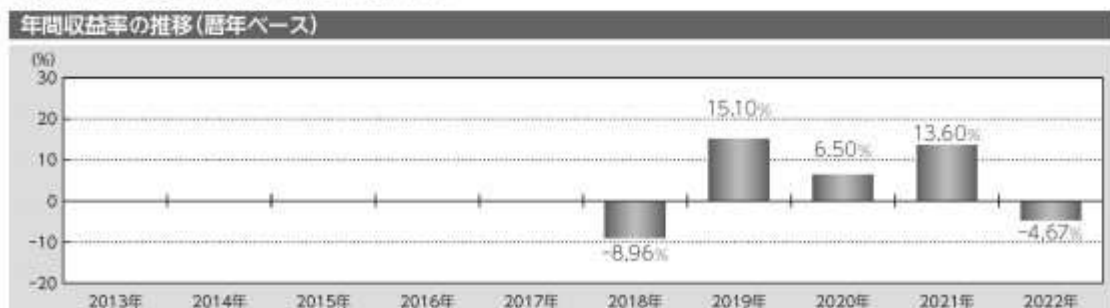
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式 インデックス マザーファンド	42.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.5%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.0%
国内債券 インデックス マザーファンド	26.3%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.3%
		第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	0.3%
外国株式 インデックス マザーファンド	20.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア/ハードウェア/半導体	-	-	1.1%
		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	5.2%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.0%
		T 1.25% 08/15/31	アメリカ	国債	-	1.250%	2031/08/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	2.1%	-	-	-	-	-	-	-

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



※2018年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2022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依り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15期計算期間(2021年8月31日から2022年8月29日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2021年 8月30日現在)	第15期 (2022年 8月29日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	168,444,556	178,148,550
親投資信託受益証券	5,056,309,139	5,082,214,943
未収入金	4,980,000	3,530,000
流動資産合計	5,229,733,695	5,263,893,493
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,137,323	11,908,076
未払受託者報酬	1,116,662	1,148,705
未払委託者報酬	10,887,457	11,199,792
未払利息	291	298
その他未払費用	273,763	286,650
流動負債合計	17,415,496	24,543,521
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,966,215,796	4,012,327,313
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,246,102,403	1,227,022,659
(分配準備積立金)	777,424,309	720,178,435
元本等合計	5,212,318,199	5,239,349,972
純資産合計	5,212,318,199	5,239,349,972
負債純資産合計	5,229,733,695	5,263,893,493

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	2020年 8月29日 至 2021年 8月30日	自	2021年 8月31日 至 2022年 8月29日
営業収益				
受取利息		566		1,065
有価証券売買等損益		199,934,415		8,074,196
営業収益合計		199,934,981		8,073,131
営業費用				
支払利息		58,780		57,016
受託者報酬		2,191,090		2,294,168
委託者報酬		21,363,087		22,367,969
その他費用		273,763		286,650
営業費用合計		23,886,720		25,005,803
営業利益又は営業損失（ ）		176,048,261		33,078,934
経常利益又は経常損失（ ）		176,048,261		33,078,934
当期純利益又は当期純損失（ ）		176,048,261		33,078,934
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（ ）		7,193,971		1,323,604
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,003,042,358		1,246,102,403
剰余金増加額又は欠損金減少額		142,375,447		108,593,515
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		142,375,447		108,593,515
剰余金減少額又は欠損金増加額		68,169,692		95,917,929
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		68,169,692		95,917,929
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,246,102,403		1,227,022,659

## （ 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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第15期計算期間は2021年 8月31日から2022年 8月29日までとなっております。

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

	第14期 (2021年 8月30日現在)	第15期 (2022年 8月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,966,215,796口	4,012,327,313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) 1.3142円 (13,142円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3058円 (13,058円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第14期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日			第15期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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	168,853,766円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	887,424,472円	収益調整金額	C	964,023,642円
分配準備積立金額	D	608,570,543円	分配準備積立金額	D	720,178,435円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,664,848,781円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,684,202,077円
当ファンドの期末残存口数	F	3,966,215,796口	当ファンドの期末残存口数	F	4,012,327,313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	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第15期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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（流動性リスク管理等を含む）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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第15期 (2022年 8月29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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第14期	第15期
	自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日	自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,743,879,044円	3,966,215,796円
期中追加設定元本額	475,701,731円	351,520,007円
期中一部解約元本額	253,364,979円	305,408,490円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 (2021年 8月30日現在)	第15期 (2022年 8月29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	138,231,316	2,690,846
合計	138,231,316	2,690,846

## （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	161,071,852	309,676,742	
	外国株式インデックス マザーファンド	35,498,423	156,083,016	
	国内債券インデックス マザーファンド	686,481,171	942,538,647	
	外国債券インデックス マザーファンド	25,192,171	79,440,992	
	短期金融資産 マザーファンド	3,552,906,540	3,594,475,546	
合計		4,461,150,157	5,082,214,943	

(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15期計算期間(2021年8月31日から2022年8月29日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2021年 8月30日現在)	第15期 (2022年 8月29日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	183,335,668	186,566,089
親投資信託受益証券	5,178,398,909	5,563,236,124
流動資産合計	5,361,734,577	5,749,802,213
資産合計	5,361,734,577	5,749,802,213
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	110	379,838
未払受託者報酬	1,099,370	1,226,049
未払委託者報酬	10,718,756	11,953,925
未払利息	317	312
その他未払費用	259,916	303,071
流動負債合計	12,078,469	13,863,195
負債合計	12,078,469	13,863,195
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,577,112,275	3,847,191,370
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,772,543,833	1,888,747,648
(分配準備積立金)	1,206,937,583	1,166,657,772
元本等合計	5,349,656,108	5,735,939,018
純資産合計	5,349,656,108	5,735,939,018
負債純資産合計	5,361,734,577	5,749,802,213

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	2020年 8月29日	自	2021年 8月31日
	至	2021年 8月30日	至	2022年 8月29日
営業収益				
受取利息		532		1,169
有価証券売買等損益		472,473,450		11,047,215
営業収益合計		472,473,982		11,048,384
営業費用				
支払利息		55,203		61,421
受託者報酬		2,080,334		2,425,517
委託者報酬		20,283,121		23,648,729
その他費用		259,916		303,071
営業費用合計		22,678,574		26,438,738
営業利益又は営業損失（ ）		449,795,408		15,390,354
経常利益又は経常損失（ ）		449,795,408		15,390,354
当期純利益又は当期純損失（ ）		449,795,408		15,390,354
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（ ）		7,535,610		568,002
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,109,512,199		1,772,543,833
剰余金増加額又は欠損金減少額		257,504,165		193,174,325
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		257,504,165		193,174,325
剰余金減少額又は欠損金増加額		36,732,329		62,148,158
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		36,732,329		62,148,158
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,772,543,833		1,888,747,648

## (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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第15期計算期間は2021年 8月31日から2022年 8月29日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第14期 (2021年 8月30日現在)	第15期 (2022年 8月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,577,112,275口	3,847,191,370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) 1.4955円 (14,955円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4909円 (14,909円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日			第15期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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	442,261,033円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	1,222,457,858円	収益調整金額	C	1,446,156,746円
分配準備積立金額	D	764,676,550円	分配準備積立金額	D	1,166,657,772円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,429,395,441円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,612,814,518円
当ファンドの期末残存口数	F	3,577,112,275口	当ファンドの期末残存口数	F	3,847,191,370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	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第15期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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（流動性リスク管理等を含む）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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第15期 (2022年 8月29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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第14期	第15期
	自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日	自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,110,899,178円	3,577,112,275円
期中追加設定元本額	568,152,385円	395,490,801円
期中一部解約元本額	101,939,288円	125,411,706円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 (2021年 8月30日現在)	第15期 (2022年 8月29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	403,908,611	13,747,484
合計	403,908,611	13,747,484

## （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	680,805,366	1,308,916,396	
	外国株式インデックス マザーファンド	149,394,516	656,872,747	
	国内債券インデックス マザーファンド	2,325,049,048	3,192,292,342	
	外国債券インデックス マザーファンド	91,875,201	289,719,258	
	短期金融資産 マザーファンド	114,100,407	115,435,381	
合計		3,361,224,538	5,563,236,124	

(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15期計算期間(2021年8月31日から2022年8月29日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2021年 8月30日現在)	第15期 (2022年 8月29日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	92,588,882	99,466,598
親投資信託受益証券	2,613,100,016	2,880,788,409
未収入金	-	1,650,000
流動資産合計	2,705,688,898	2,981,905,007
資産合計	2,705,688,898	2,981,905,007
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	101,787	4,631,856
未払受託者報酬	557,329	631,213
未払委託者報酬	5,433,872	6,154,247
未払利息	160	166
その他未払費用	130,416	155,033
流動負債合計	6,223,564	11,572,515
負債合計	6,223,564	11,572,515
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,719,188,989	1,875,633,288
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	980,276,345	1,094,699,204
(分配準備積立金)	613,377,043	606,679,398
元本等合計	2,699,465,334	2,970,332,492
純資産合計	2,699,465,334	2,970,332,492
負債純資産合計	2,705,688,898	2,981,905,007

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	2020年 8月29日	自	2021年 8月31日
	至	2021年 8月30日	至	2022年 8月29日
営業収益				
受取利息		264		589
有価証券売買等損益		320,070,552		38,858,393
営業収益合計		320,070,816		38,858,982
営業費用				
支払利息		27,433		31,173
受託者報酬		1,044,283		1,241,278
委託者報酬		10,181,568		12,102,260
その他費用		130,416		155,033
営業費用合計		11,383,700		13,529,744
営業利益又は営業損失（ ）		308,687,116		25,329,238
経常利益又は経常損失（ ）		308,687,116		25,329,238
当期純利益又は当期純損失（ ）		308,687,116		25,329,238
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（ ）		13,442,710		752,485
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		563,413,395		980,276,345
剰余金増加額又は欠損金減少額		167,798,044		143,425,857
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		167,798,044		143,425,857
剰余金減少額又は欠損金増加額		46,179,500		53,579,751
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		46,179,500		53,579,751
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		980,276,345		1,094,699,204



## ( 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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第15期計算期間は2021年 8月31日から2022年 8月29日までとなっております。

( 貸借対照表に関する注記 )

	第14期 (2021年 8月30日現在)	第15期 (2022年 8月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,719,188,989口	1,875,633,288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) 1.5702円 (15,702円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5836円 (15,836円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第14期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日			第15期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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	295,246,799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	24,581,567円
収益調整金額	C	675,845,958円	収益調整金額	C	824,440,565円
分配準備積立金額	D	318,130,244円	分配準備積立金額	D	582,097,831円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,289,223,001円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,431,119,963円
当ファンドの期末残存口数	F	1,719,188,989口	当ファンドの期末残存口数	F	1,875,633,288口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,499円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,630円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第15期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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（流動性リスク管理等を含む）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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第15期 (2022年 8月29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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第14期	第15期
	自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日	自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,507,175,909円	1,719,188,989円
期中追加設定元本額	333,011,049円	250,322,311円
期中一部解約元本額	120,997,969円	93,878,012円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 (2021年 8月30日現在)	第15期 (2022年 8月29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	276,234,569	38,466,309
合計	276,234,569	38,466,309

## （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	506,555,925	973,904,421	
	外国株式インデックス マザーファンド	111,166,105	488,786,247	
	国内債券インデックス マザーファンド	879,818,547	1,207,990,865	
	外国債券インデックス マザーファンド	47,644,201	150,241,223	
	短期金融資産 マザーファンド	59,173,326	59,865,653	
合計		1,604,358,104	2,880,788,409	

(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5期計算期間(2021年8月31日から2022年8月29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】

	第4期 (2021年 8月30日現在)	第5期 (2022年 8月29日現在)
(単位：円)		
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,637,366	3,531,797
親投資信託受益証券	78,976,686	105,480,508
流動資産合計	81,614,052	109,012,305
資産合計	81,614,052	109,012,305
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	10,051	22,819
未払委託者報酬	97,957	222,470
未払利息	4	5
その他未払費用	1,195	2,794
流動負債合計	109,207	248,088
負債合計	109,207	248,088
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	66,346,116	86,772,951
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	15,158,729	21,991,266
(分配準備積立金)	4,795,666	6,219,690
元本等合計	81,504,845	108,764,217
純資産合計	81,504,845	108,764,217
負債純資産合計	81,614,052	109,012,305

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2020年 8月29日	自	2021年 8月31日
	至	2021年 8月30日	至	2022年 8月29日
営業収益				
受取利息		1		16
有価証券売買等損益		4,591,081		2,199,702
営業収益合計		4,591,082		2,199,718
営業費用				
支払利息		290		875
受託者報酬		14,638		41,989
委託者報酬		142,499		409,326
その他費用		1,711		5,128
営業費用合計		159,138		457,318
営業利益又は営業損失（ ）		4,431,944		1,742,400
経常利益又は経常損失（ ）		4,431,944		1,742,400
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,431,944		1,742,400
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（ ）		215,862		140,139
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		661,076		15,158,729
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,452,096		6,951,018
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,452,096		6,951,018
剰余金減少額又は欠損金増加額		170,525		2,001,020
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		2,001,020
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		15,158,729		21,991,266

## (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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は2021年 8月31日から2022年 8月29日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 (2021年 8月30日現在)	第5期 (2022年 8月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,346,116口	86,772,951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) 1.2285円 (12,285円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2534円 (12,534円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日			第5期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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	456,470円	費用控除後の配当等収益額	A	1,274,011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	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	608,528円
収益調整金額	C	10,363,063円	収益調整金額	C	15,771,576円
分配準備積立金額	D	579,584円	分配準備積立金額	D	4,337,151円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,158,729円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,991,266円
当ファンドの期末残存口数	F	66,346,116口	当ファンドの期末残存口数	F	86,772,951口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,284円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,534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5期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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（流動性リスク管理等を含む）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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第5期 (2022年 8月29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4期	第5期
	自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日	自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	17,289,618円	66,346,116円
期中追加設定元本額	51,620,729円	29,069,429円
期中一部解約元本額	2,564,231円	8,642,594円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期 (2021年 8月30日現在)	第5期 (2022年 8月29日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	4,101,942	2,198,079
合計	4,101,942	2,198,079

## （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	24,202,861	46,532,420
	外国株式インデックス マザーファンド	5,311,840	23,355,629
	国内債券インデックス マザーファンド	20,312,114	27,888,532
	外国債券インデックス マザーファンド	1,747,051	5,509,150
	短期金融資産 マザーファンド	2,169,396	2,194,777
合計		53,743,262	105,480,508

(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

	2022年 8月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,823,159,525
国債証券	524,693,821,400
地方債証券	33,312,708,349
特殊債券	37,732,989,893
社債券	29,560,383,520
未収入金	499,510,000
未収利息	1,437,429,910
前払金	1,200,000
前払費用	28,233,956
流動資産合計	629,089,436,553
資産合計	629,089,436,553
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,200,990
未払金	2,891,245,200
未払解約金	141,466,409
未払利息	3,050
流動負債合計	3,033,915,649
負債合計	3,033,915,649
純資産の部	
元本等	

	2022年 8月29日現在
項目	金額（円）
元本	455,969,657,054
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	170,085,863,850
元本等合計	626,055,520,904
純資産合計	626,055,520,904
負債純資産合計	629,089,436,553

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 8月29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、最初の利払日まで個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 8月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	455,969,657,054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 100,165,000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 1.3730円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,730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

	2022年 8月29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（流動性リスク管理等を含む）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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	468,883,493,377円
期中追加設定元本額	42,307,617,453円
期中一部解約元本額	55,221,453,776円
期末元本額	455,969,657,054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）	4,131,571,272円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,934,587円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,830,510,857円
世界経済インデックスファンド	3,993,130,449円
D C マイセレクション 2 5	25,875,161,952円
D C マイセレクション 5 0	29,658,401,062円
D C マイセレクション 7 5	8,685,041,351円
D C 日本債券インデックス・オープン	439,924,073円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,471,403,120円
D C 日本債券インデックス・オープン P	66,873,377,000円
D C マイセレクション S 2 5	13,158,772,949円
D C マイセレクション S 5 0	14,676,913,531円
D C マイセレクション S 7 5	3,349,452,415円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	686,481,171円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,325,049,048円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	879,818,547円
D C 世界経済インデックスファンド	3,465,772,379円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,791,837円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	31,497,651円

区分	2022年 8月29日現在
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	9,937,325円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	972,063円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	83,799,954円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	123,867,935円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	34,194,591円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	27,614,470円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,780,258,408円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	749,828,496円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,129,469,850円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	76,678,284円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	54,711,961円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	971,350,867円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,111,169,719円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,414,486,224円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	137,606,889円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,571,025,390円
日本債券ファンド・シリーズ1	16,481,614,128円
分散投資コア戦略ファンドA	20,452,828,218円
分散投資コア戦略ファンドS	25,702,211,927円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	168,870,277円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,419,861,537円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	72,696,859円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	36,691,535円
SMT インデックスバランス・オープン	61,720,142円
SMT 世界経済インデックス・オープン	39,537,438円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	78,179,441円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	123,183,752円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,470,978円
グローバル経済コア	235,153,640円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	31,853,077円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	20,312,114円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	33,482,313円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	17,839,373円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	4,477,976円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,762,691円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	8,738,856円
10資産分散投資ファンド	89,612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）	82,722,395,970円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	89,400,662円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,694,845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）	309,384,776円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		5,263,596,250
地方債証券		241,646,231
特殊債券		226,937,060
社債券		269,450,860
合計		6,001,630,401

(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）

## 債券関連

（2022年 8月29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	448,860,000	-	447,660,000	1,200,000
	合計	448,860,000	-	447,660,000	1,200,000

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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428回利付国債(2年)	230,000,000	230,322,000	
	第429回利付国債(2年)	950,000,000	951,396,500	
	第430回利付国債(2年)	990,000,000	991,504,800	

第432回利付国債（2年）	1,550,000,000	1,552,495,500	
第433回利付国債（2年）	1,910,000,000	1,913,132,400	
第434回利付国債（2年）	1,915,000,000	1,918,159,750	
第435回利付国債（2年）	3,120,000,000	3,125,428,800	
第436回利付国債（2年）	720,000,000	721,260,000	
第438回利付国債（2年）	290,000,000	290,504,600	
第439回利付国債（2年）	470,000,000	470,813,100	
第137回利付国債（5年）	6,610,000,000	6,626,392,800	
第138回利付国債（5年）	6,890,000,000	6,908,878,600	
第139回利付国債（5年）	5,590,000,000	5,607,384,900	
第140回利付国債（5年）	4,660,000,000	4,675,983,800	
第141回利付国債（5年）	7,650,000,000	7,679,146,500	
第142回利付国債（5年）	4,370,000,000	4,388,659,900	
第143回利付国債（5年）	4,800,000,000	4,822,080,000	
第144回利付国債（5年）	5,830,000,000	5,859,499,800	
第145回利付国債（5年）	5,670,000,000	5,700,391,200	
第146回利付国債（5年）	4,120,000,000	4,143,195,600	
第147回利付国債（5年）	4,170,000,000	4,180,383,300	
第148回利付国債（5年）	6,770,000,000	6,785,435,600	
第149回利付国債（5年）	4,820,000,000	4,828,772,400	
第150回利付国債（5年）	7,700,000,000	7,708,239,000	
第151回利付国債（5年）	4,000,000,000	4,000,880,000	
第152回利付国債（5年）	210,000,000	210,907,200	
第153回利付国債（5年）	410,000,000	409,606,400	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	516,072,000	
第2回利付国債（40年）	1,130,000,000	1,404,194,500	
第3回利付国債（40年）	550,000,000	686,636,500	
第4回利付国債（40年）	950,000,000	1,186,084,500	
第5回利付国債（40年）	1,070,000,000	1,284,770,400	
第6回利付国債（40年）	1,260,000,000	1,478,660,400	
第7回利付国債（40年）	1,240,000,000	1,396,277,200	
第8回利付国債（40年）	1,230,000,000	1,289,089,200	
第9回利付国債（40年）	2,050,000,000	1,589,242,000	
第10回利付国債（40年）	2,100,000,000	1,908,816,000	
第11回利付国債（40年）	1,635,000,000	1,436,216,700	
第12回利付国債（40年）	1,290,000,000	1,017,887,400	
第13回利付国債（40年）	2,120,000,000	1,666,786,400	
第14回利付国債（40年）	2,130,000,000	1,792,565,400	
第15回利付国債（40年）	610,000,000	559,998,300	
第330回利付国債（10年）	3,910,000,000	3,948,709,000	
第331回利付国債（10年）	900,000,000	907,002,000	
第332回利付国債（10年）	4,800,000,000	4,844,592,000	



第333回利付国債(10年)	3,320,000,000	3,356,154,800	
第334回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,313,122,200	
第335回利付国債(10年)	2,310,000,000	2,337,835,500	
第336回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,226,359,200	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,824,892,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,615,996,800	
第339回利付国債(10年)	4,670,000,000	4,732,998,300	
第340回利付国債(10年)	4,830,000,000	4,900,276,500	
第341回利付国債(10年)	5,340,000,000	5,405,468,400	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,787,941,200	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,685,779,700	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,933,512,000	
第345回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,799,542,600	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,776,162,500	
第347回利付国債(10年)	3,850,000,000	3,864,784,000	
第348回利付国債(10年)	4,540,000,000	4,553,710,800	
第349回利付国債(10年)	5,000,000,000	5,011,900,000	
第350回利付国債(10年)	6,390,000,000	6,400,543,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,940,000,000	4,944,248,400	
第352回利付国債(10年)	4,510,000,000	4,511,353,000	
第353回利付国債(10年)	5,415,000,000	5,411,588,550	
第354回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,782,192,300	
第355回利付国債(10年)	3,820,000,000	3,808,387,200	
第356回利付国債(10年)	3,380,000,000	3,363,471,800	
第357回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,751,025,500	
第358回利付国債(10年)	3,560,000,000	3,532,160,800	
第359回利付国債(10年)	3,360,000,000	3,330,331,200	
第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	4,841,589,000	
第361回利付国債(10年)	4,180,000,000	4,135,692,000	
第362回利付国債(10年)	3,790,000,000	3,747,097,200	
第363回利付国債(10年)	5,070,000,000	5,008,754,400	
第364回利付国債(10年)	3,710,000,000	3,667,186,600	
第365回利付国債(10年)	6,740,000,000	6,663,164,000	
第366回利付国債(10年)	5,970,000,000	5,981,163,900	
第367回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,434,470,400	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	130,265,300	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	186,067,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	139,159,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	133,922,800	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	58,470,500	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	419,363,000	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	215,836,200	

第8回利付国債(30年)	350,000,000	403,711,000
第9回利付国債(30年)	240,000,000	267,194,400
第10回利付国債(30年)	160,000,000	173,270,400
第11回利付国債(30年)	260,000,000	298,095,200
第12回利付国債(30年)	190,000,000	226,360,300
第13回利付国債(30年)	400,000,000	472,812,000
第14回利付国債(30年)	800,000,000	983,744,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	422,633,600
第16回利付国債(30年)	200,000,000	249,026,000
第17回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,421,434,500
第18回利付国債(30年)	345,000,000	422,845,800
第19回利付国債(30年)	530,000,000	650,686,300
第20回利付国債(30年)	480,000,000	602,097,600
第21回利付国債(30年)	500,000,000	615,745,000
第22回利付国債(30年)	540,000,000	680,540,400
第23回利付国債(30年)	430,000,000	542,810,500
第24回利付国債(30年)	780,000,000	985,537,800
第25回利付国債(30年)	600,000,000	742,710,000
第26回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,741,197,400
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,437,228,800
第28回利付国債(30年)	2,090,000,000	2,660,570,000
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,104,099,800
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,206,464,300
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,354,518,000
第32回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,697,511,200
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,183,526,800
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,215,299,250
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,765,543,000
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,564,328,300
第37回利付国債(30年)	2,255,000,000	2,674,475,100
第38回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,645,794,300
第39回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,754,717,600
第40回利付国債(30年)	1,380,000,000	1,609,839,000
第41回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,319,188,000
第42回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,329,916,800
第43回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,489,566,000
第44回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,454,302,400
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,590,163,200
第46回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,776,119,800
第47回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,830,310,700
第48回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,848,544,200
第49回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,727,488,000
第50回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,630,809,900

第5 1 回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,446,454,800	
第5 2 回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,424,866,100	
第5 3 回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,193,412,000	
第5 4 回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,623,370,400	
第5 5 回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,355,803,200	
第5 6 回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,390,045,600	
第5 7 回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,321,029,000	
第5 8 回利付国債(30年)	2,350,000,000	2,196,216,000	
第5 9 回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,282,451,400	
第6 0 回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,551,401,400	
第6 1 回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,319,299,800	
第6 2 回利付国債(30年)	480,000,000	410,270,400	
第6 3 回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,350,455,000	
第6 4 回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,477,877,700	
第6 5 回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,159,504,350	
第6 6 回利付国債(30年)	1,010,000,000	834,047,900	
第6 7 回利付国債(30年)	1,865,000,000	1,616,526,050	
第6 8 回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,288,820,200	
第6 9 回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,190,871,400	
第7 0 回利付国債(30年)	1,780,000,000	1,575,638,200	
第7 1 回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,263,419,300	
第7 2 回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,014,093,000	
第7 3 回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,649,377,400	
第7 4 回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,656,845,400	
第7 5 回利付国債(30年)	550,000,000	562,688,500	
第6 4 回利付国債(20年)	320,000,000	326,896,000	
第6 5 回利付国債(20年)	220,000,000	225,786,000	
第6 6 回利付国債(20年)	330,000,000	338,246,700	
第6 7 回利付国債(20年)	130,000,000	134,044,300	
第6 8 回利付国債(20年)	190,000,000	196,798,200	
第6 9 回利付国債(20年)	390,000,000	403,345,800	
第7 0 回利付国債(20年)	400,000,000	418,008,000	
第7 1 回利付国債(20年)	200,000,000	208,282,000	
第7 2 回利付国債(20年)	630,000,000	658,299,600	
第7 3 回利付国債(20年)	360,000,000	377,348,400	
第7 4 回利付国債(20年)	200,000,000	210,100,000	
第7 5 回利付国債(20年)	130,000,000	137,250,100	
第7 6 回利付国債(20年)	270,000,000	283,678,200	
第7 7 回利付国債(20年)	290,000,000	305,430,900	
第7 8 回利付国債(20年)	170,000,000	179,463,900	
第7 9 回利付国債(20年)	270,000,000	285,789,600	
第8 0 回利付国債(20年)	220,000,000	233,483,800	

第81回利付国債(20年)	390,000,000	414,796,200
第82回利付国債(20年)	600,000,000	639,990,000
第83回利付国債(20年)	290,000,000	310,856,800
第84回利付国債(20年)	470,000,000	502,246,700
第85回利付国債(20年)	290,000,000	312,303,900
第86回利付国債(20年)	510,000,000	552,855,300
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,977,260,100
第88回利付国債(20年)	420,000,000	457,716,000
第89回利付国債(20年)	350,000,000	380,096,500
第90回利付国債(20年)	630,000,000	687,210,300
第91回利付国債(20年)	450,000,000	492,691,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	960,414,400
第93回利付国債(20年)	410,000,000	447,334,600
第94回利付国債(20年)	610,000,000	668,328,200
第95回利付国債(20年)	610,000,000	676,764,500
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,748,761,500
第97回利付国債(20年)	900,000,000	998,118,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	485,746,800
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,429,578,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	536,553,600
第101回利付国債(20年)	715,000,000	807,156,350
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,428,915,600
第103回利付国債(20年)	400,000,000	451,312,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	178,675,200
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,322,886,200
第106回利付国債(20年)	380,000,000	428,305,600
第107回利付国債(20年)	760,000,000	854,992,400
第108回利付国債(20年)	870,000,000	967,840,200
第109回利付国債(20年)	520,000,000	580,184,800
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,241,614,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,105,072,500
第112回利付国債(20年)	790,000,000	894,682,900
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,293,467,600
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,651,656,500
第115回利付国債(20年)	700,000,000	801,682,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,712,367,600
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,233,144,000
第118回利付国債(20年)	660,000,000	751,014,000
第119回利付国債(20年)	530,000,000	594,940,900
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,738,256,900
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,700,175,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,057,998,200
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,157,662,100

第124回利付国債(20年)	610,000,000	698,858,700	
第125回利付国債(20年)	1,770,000,000	2,064,209,400	
第126回利付国債(20年)	730,000,000	839,083,900	
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,163,860,800	
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,110,281,400	
第129回利付国債(20年)	740,000,000	840,632,600	
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,465,940,850	
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,131,930,000	
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,317,771,600	
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,408,522,200	
第134回利付国債(20年)	830,000,000	952,698,900	
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,172,634,400	
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,637,224,000	
第137回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,209,417,600	
第138回利付国債(20年)	620,000,000	695,503,600	
第139回利付国債(20年)	830,000,000	939,037,100	
第140回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,764,245,000	
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,830,352,000	
第142回利付国債(20年)	980,000,000	1,130,920,000	
第143回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,178,662,400	
第144回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,293,152,000	
第145回利付国債(20年)	2,675,000,000	3,066,941,000	
第146回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,099,573,000	
第147回利付国債(20年)	2,250,000,000	2,560,072,500	
第148回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,311,785,000	
第149回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,045,087,000	
第150回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,824,264,300	
第151回利付国債(20年)	2,445,000,000	2,671,284,750	
第152回利付国債(20年)	2,840,000,000	3,100,456,400	
第153回利付国債(20年)	2,630,000,000	2,902,415,400	
第154回利付国債(20年)	2,655,000,000	2,895,197,850	
第155回利付国債(20年)	2,800,000,000	2,980,236,000	
第156回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,443,866,400	
第157回利付国債(20年)	2,950,000,000	2,821,114,500	
第158回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,592,956,700	
第159回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,491,482,400	
第160回利付国債(20年)	1,890,000,000	1,920,429,000	
第161回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,990,000,000	
第162回利付国債(20年)	630,000,000	628,261,200	
第163回利付国債(20年)	1,980,000,000	1,968,951,600	
第164回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,290,207,600	
第165回利付国債(20年)	2,150,000,000	2,096,250,000	

	第166回利付国債(20年)	1,820,000,000	1,823,931,200	
	第167回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,142,153,000	
	第168回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,577,929,600	
	第169回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,853,585,500	
	第170回利付国債(20年)	2,240,000,000	2,078,115,200	
	第171回利付国債(20年)	1,670,000,000	1,544,232,300	
	第172回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,259,881,100	
	第173回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,196,639,000	
	第174回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,310,715,200	
	第175回利付国債(20年)	2,030,000,000	1,918,959,000	
	第176回利付国債(20年)	2,850,000,000	2,685,811,500	
	第177回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,160,498,600	
	第178回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,839,930,400	
	第179回利付国債(20年)	2,935,000,000	2,748,656,850	
	第180回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,381,803,000	
	第181回利付国債(20年)	800,000,000	803,376,000	
	国債証券合計	510,230,000,000	524,693,821,400	
地方債証券	第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	100,000,000	100,085,000	
	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,489,000	
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	87,077,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,027,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	123,911,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	121,453,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	117,384,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	115,102,000	
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	222,088,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,542,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,493,000	
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	87,366,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	225,940,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	225,682,000	
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,800,000	
	第726回東京都公募公債	200,000,000	201,874,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	100,832,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,089,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,503,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,286,000	
	第781回東京都公募公債	300,000,000	299,307,000	
	第800回東京都公募公債	200,000,000	196,632,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,593,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,111,000	

平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,612,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	199,492,000	
第29回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	100,769,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	254,530,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,224,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	225,580,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	113,998,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,648,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	110,208,000	
第78回神奈川県公募公債（5年）	200,000,000	199,944,000	
第201回神奈川県公募公債	200,250,000	201,711,825	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	201,964,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,302,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,511,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,435,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,286,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	196,560,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	225,698,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	226,276,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	112,724,000	
第377回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,835,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,083,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	152,606,640	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,464,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,452,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	156,201,240	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,462,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,468,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	99,765,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	156,838,400	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	178,361,820	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	195,948,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	113,160,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	112,848,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	100,830,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,466,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	95,861,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	98,911,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	137,895,130	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	111,136,000	

第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	101,393,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	106,680,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,516,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,479,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	455,056,000	
平成25年度第7回兵庫県公募公債	100,000,000	100,801,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,072,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	97,443,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	296,337,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	109,079,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	91,876,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	112,664,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,015,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,148,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,334,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,429,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,326,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	306,354,400	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	113,497,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,085,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	202,234,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,141,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,041,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,858,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	295,077,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,987,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	90,594,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	196,680,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,529,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	173,356,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	112,759,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	225,912,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	100,817,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,996,995	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,283,000	



令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	385,444,800	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	111,013,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	112,280,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	96,003,000	
第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	227,148,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	193,510,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	225,580,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	192,244,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,008,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,423,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,057,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,675,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,310,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	98,295,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	98,146,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	146,995,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,053,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,293,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	105,259,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	114,072,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	105,971,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	120,843,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,965,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,420,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,407,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	90,594,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	98,069,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	295,983,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	98,263,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	95,593,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	224,560,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	113,138,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	112,664,000	
平成25年度第8回千葉県公募公債	300,000,000	302,436,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	100,907,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,993,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,416,000	

平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,057,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,465,600	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	294,795,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,502,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	295,863,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	200,000,000	198,852,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	223,798,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,230,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,769,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,799,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,100,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,961,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,042,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,270,080	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,163,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,121,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,075,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,126,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,994,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,854,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,284,762	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,476,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,178,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,110,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,082,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,884,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,912,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,871,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,388,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,657,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,572,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,200,907	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,281,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,880,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,163,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,152,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,285,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	99,451,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	226,700,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	86,387,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	289,077,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	99,530,000	

平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,073,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	196,702,000	
第1回名古屋市長市公募公債（30年）	100,000,000	123,788,000	
第5回名古屋市長市公募公債（30年）	100,000,000	125,775,000	
第9回名古屋市長市公募公債（20年）	100,000,000	111,417,000	
第11回名古屋市長市公募公債（30年）	100,000,000	113,887,000	
第499回名古屋市長市公募公債（10年）	100,000,000	100,550,000	
第512回名古屋市長市公募公債（10年）	300,000,000	295,875,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,776,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	131,330,400	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	224,900,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	113,938,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	113,138,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	86,235,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	86,574,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	106,005,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	337,905,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,366,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,526,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,046,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,438,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	219,916,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	295,887,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	98,350,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	106,219,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,933,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	111,891,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,343,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	98,150,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,975,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,448,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,091,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	112,803,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	111,448,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	202,222,000	
平成30年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	100,007,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	151,464,000	

	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,999,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,360,150	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,460,700	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	541,871,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	199,872,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	196,530,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	296,205,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	99,193,000	
	平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,134,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	201,450,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	99,385,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	110,887,000	
	地方債証券合計	32,411,680,000	33,312,708,349	
特殊債券	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,128,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,013,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,439,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	77,771,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,924,000	
	第21回道路債券	100,000,000	123,845,000	
	第27回道路債券	400,000,000	414,844,000	
	第28回道路債券	200,000,000	250,712,000	
	第33回道路債券	200,000,000	253,630,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,960,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,501,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,559,000	
	第42回道路債券	100,000,000	105,546,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,858,000	
	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	127,337,000	
	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	225,698,000	
	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	227,496,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,940,000	
	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	122,222,000	

第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,755,000	
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,970,000	
第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,010,000	
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	114,605,000	
第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,971,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,223,000	
第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,883,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,981,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,594,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,424,000	
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	113,288,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	588,102,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,784,000	
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	149,309,800	
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	100,837,000	
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	268,083,222	
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	201,888,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,527,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	533,000,000	538,788,380	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,132,000	
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	223,182,000	
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	103,164,840	
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	101,205,000	
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	101,178,000	
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	221,420,000	
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	101,180,000	
	100,000,000	101,095,000	

第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	302,361,000	
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	107,892,000	
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	217,088,000	
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	202,086,000	
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	100,454,000	
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	85,271,000	
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	106,771,020	
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	205,434,600	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,300,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,516,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,179,000	
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	120,294,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,782,000	
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	294,627,000	
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	214,477,220	
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	98,488,000	
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	98,137,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	362,268,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	105,769,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	375,609,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,397,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	250,784,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	41,390,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	123,403,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	226,004,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	221,662,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	600,000,000	600,144,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	169,276,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,531,000	

第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	226,542,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	112,453,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	562,490,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	105,875,700	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	706,944,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,019,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,119,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,210,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,071,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,081,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,764,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,834,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,229,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,017,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,184,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,955,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,128,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,642,560	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,147,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,259,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,207,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,297,000	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,425,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,312,000	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,227,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,325,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,976,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,419,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,030,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,816,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,520,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,636,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,732,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,782,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,239,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,786,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	105,322,000	
第19回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,794,000	

第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	112,955,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	114,931,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,021,420	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,259,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,628,300	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	187,377,740	
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	220,050,600	
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,898,000	
第88回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,942,000	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,949,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	206,612,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	145,722,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	80,234,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	171,770,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,943,000	
第16回政府保証民間都市開発債券	180,000,000	181,467,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,553,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	9,939,000	9,959,374	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,337,000	10,426,311	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,439,000	10,547,983	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	128,475,000	127,453,623	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,699,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	89,544,000	88,775,712	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,878,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,370,000	10,469,240	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,298,000	11,480,010	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	159,501,000	157,811,884	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,114,000	11,287,044	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	182,121,000	179,853,593	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	64,936,000	64,253,522	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,579,000	11,823,085	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	219,006,000	215,902,684	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	9,913,000	9,932,330	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	151,398,000	149,376,836	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,714,000	11,981,313	



第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,043,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,529,000	16,263,987	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,629,000	16,406,230	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,492,000	18,497,615	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,237,000	20,255,406	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,141,000	22,383,667	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,658,000	22,891,206	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,990,000	47,429,807	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,160,000	10,262,616	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,438,000	21,468,279	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,369,000	10,453,922	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,952,000	9,974,192	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,735,000	21,769,883	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,369,000	21,413,318	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,209,000	20,142,941	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,268,000	11,485,359	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,668,000	42,420,790	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,484,000	22,429,725	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,903,000	11,074,177	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,496,000	29,731,871	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,228,000	28,384,917	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,400,000	28,588,886	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,100,000	62,557,489	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,814,000	76,397,490	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,027,000	39,317,636	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,802,000	40,444,488	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,041,000	40,739,283	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,219,000	35,592,550	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,467,000	34,560,701	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,974,000	40,709,512	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	171,546,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,018,000	105,343,786	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,056,000	142,534,536	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,564,000	40,771,097	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,896,000	42,166,229	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,792,000	42,968,026	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,350,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,111,000	135,765,190	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,499,000	46,570,046	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,332,000	96,904,024	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,199,000	54,227,336	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,971,000	57,882,536	

第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	319,824,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,425,000	57,605,975	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,951,000	179,237,299	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,952,000	120,671,973	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,224,000	58,431,426	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,899,000	63,192,070	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,172,000	67,438,469	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,856,000	73,220,099	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,534,000	72,722,184	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,859,000	73,350,850	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,394,000	74,187,928	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,763,000	74,423,575	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,601,000	76,174,332	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,053,000	76,693,933	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,040,000	76,464,511	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,942,000	76,364,165	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,707,000	77,144,401	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,366,000	155,858,433	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,843,000	77,228,818	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,022,000	158,077,409	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,964,000	78,322,812	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,302,000	156,714,230	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,096,000	79,416,785	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,226,000	159,554,086	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,304,000	160,578,708	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,457,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,890,000	81,416,675	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,590,000	81,291,380	
	81,782,000	80,805,522	

第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,784,000	165,995,688	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,555,000	83,054,994	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,834,000	82,470,020	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,890,000	166,837,076	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,340,000	84,176,319	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	260,622,000	252,725,153	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,762,000	169,416,030	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,009,000	87,480,715	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,603,000	87,813,628	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,272,000	181,935,431	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,146,000	91,808,423	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,338,000	183,593,241	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,928,000	184,797,119	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,458,000	92,143,045	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,952,000	186,033,010	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,310,000	187,127,255	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,118,000	93,918,562	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,624,000	94,722,439	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,524,000	283,776,948	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,910,000	95,096,813	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,399,000	97,781,054	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,179,000	98,673,187	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,925,000	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,982,000	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	93,413,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	86,433,000	
第64回日本学生支援債券	300,000,000	299,922,000	

	第65回日本学生支援債券	200,000,000	199,942,000	
	第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	105,581,000	
	第24回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	600,540,000	
	い第823号商工債	200,000,000	200,268,000	
	い第829号商工債	200,000,000	200,144,000	
	い第832号商工債	200,000,000	199,812,000	
	い第833号商工債	100,000,000	99,881,000	
	い第843号商工債	200,000,000	199,940,000	
	い第847号商工債	100,000,000	99,834,000	
	い第850号商工債	200,000,000	199,572,000	
	第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,022,000	
	第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,660,000	
	第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,750,000	
	第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,660,000	
	第385回信金中金債（5年）	100,000,000	99,483,000	
	第254号商工債（3年）	300,000,000	299,862,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,257,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	113,407,000	
	第53回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,054,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,405,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	197,784,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	493,280,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,401,000	
	第60回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,895,000	
	第63回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,876,000	
	第66回西日本高速道路株式会社社債	800,000,000	800,136,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,699,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,899,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	194,474,000	
	特殊債券合計	36,836,035,000	37,732,989,893	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,799,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	298,551,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,633,000	
	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,103,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,892,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,909,000	

第13回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	100,000,000	99,607,000	
第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー 円貨社債	400,000,000	398,424,000	
第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,759,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,742,000	
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	199,758,000	
第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,098,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	299,217,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,009,000	
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	100,095,000	
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	199,722,000	
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	100,140,000	
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	199,774,000	
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	100,973,000	
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	198,438,000	
第8回サントリーホールディングス株式会社 無担保社債	300,000,000	299,514,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,983,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,742,000	
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	99,077,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
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	199,492,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	100,045,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	100,098,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,667,000	
第13回J S R 株式会社無担保社債	100,000,000	99,633,000	
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	99,781,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディ ングス無担保社債	200,000,000	198,868,000	
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	200,060,000	
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	99,442,000	
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	92,685,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,533,000	

第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,708,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,072,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	199,158,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	291,069,000	
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	100,110,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,471,000	
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,477,000	
第19回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	93,667,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,734,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,620,000	
第4回E N E O Sホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,735,000	
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	101,168,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,939,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,094,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,686,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	99,645,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,038,000	
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	300,303,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,855,000	
第14回株式会社L I X I L 無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,815,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	106,093,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,789,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,632,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,072,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	98,901,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,200,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,394,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,924,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,827,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,204,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,754,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,766,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,019,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,833,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,999,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,700,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	196,684,000	

第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,906,000	
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	99,934,000	
第8回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	94,785,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,620,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	91,710,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,107,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,718,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	113,037,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,144,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,570,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,577,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,822,000	
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	98,383,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	99,855,000	
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	114,517,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	109,368,000	
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	100,870,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,795,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	300,000,000	302,304,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,535,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,557,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,590,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	197,892,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,909,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,925,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,852,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,921,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,828,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,031,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,983,000	
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	99,362,000	
第17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	99,096,000	

第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,318,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,999,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,778,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,181,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,035,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,440,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,630,000	
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	200,018,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,980,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	198,960,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,630,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,357,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,563,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	800,000,000	800,032,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,344,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	199,278,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,572,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,726,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	93,494,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	97,913,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,229,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,296,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,543,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,685,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,818,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	98,824,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,444,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,413,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,734,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,146,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,124,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,604,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	94,052,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,286,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,737,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	223,986,000	



第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,129,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,774,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	91,988,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,118,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	87,650,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	92,055,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	83,567,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,096,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	87,299,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,771,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	498,775,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	91,831,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	122,150,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,842,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,882,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	91,548,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	78,865,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	73,107,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	85,467,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	92,810,000	
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	169,670,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,536,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,876,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,591,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	396,756,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	183,726,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	94,878,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	93,931,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,671,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,175,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,407,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	90,622,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,503,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,074,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,091,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,741,000	

第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,625,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,159,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,147,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,465,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,986,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,324,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,859,000	
第442回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,970,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,411,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,339,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,130,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	127,577,520	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,011,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,305,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,810,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,871,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,437,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,147,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,636,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,140,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,433,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,700,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,166,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,226,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,565,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,176,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,797,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	95,518,000	
第377回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,970,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	96,265,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,313,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,315,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,384,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,476,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,535,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,447,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	298,545,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,707,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,900,000	

第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,954,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	280,080,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	98,119,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	87,134,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	195,358,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	194,560,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	92,055,000	
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	199,760,000	
社債券合計	29,926,000,000	29,560,383,520	
合計		625,299,903,162	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 8月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,968,362,808
株式	504,544,593,870
派生商品評価勘定	18,831,400
未収入金	398,650
未収配当金	636,990,689
前払金	9,282,800
差入委託証拠金	62,800,800
流動資産合計	507,241,261,017
資産合計	507,241,261,017
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	28,147,750
未払解約金	89,708,778
未払利息	3,293
流動負債合計	117,859,821
負債合計	117,859,821
純資産の部	
元本等	

	2022年 8月29日現在
項目	金額（円）
元本	263,768,603,358
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	243,354,797,838
元本等合計	507,123,401,196
純資産合計	507,123,401,196
負債純資産合計	507,241,261,017

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 8月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 8月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	263,768,603,358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 1.9226円 (1万口当たり純資産額) (19,226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

	2022年 8月29日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	253,126,744,568円
期中追加設定元本額	33,799,390,866円
期中一部解約元本額	23,157,532,076円
期末元本額	263,768,603,358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）	394,339,020円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,025,214,487円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,568,865円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,680,332,872円
世界経済インデックスファンド	4,102,699,556円
日本株式インデックス・オープン	3,268,391,160円
DCマイセレクション25	6,232,427,921円
DCマイセレクション50	19,062,711,002円
DCマイセレクション75	19,050,637,723円
DC日本株式インデックス・オープン	6,191,232,095円
DCマイセレクションS25	3,184,547,513円
DCマイセレクションS50	9,374,379,052円
DCマイセレクションS75	7,200,602,171円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,456,620,031円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	161,071,852円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	680,805,366円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	506,555,925円
DC世界経済インデックスファンド	3,703,031,059円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,631,480,254円

区分	2022年 8月29日現在
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	4,129,572円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	19,221,125円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	21,109,086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）	171,157,244円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	27,817,384円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	109,223,677円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	25,432,978円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	70,429,312円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	858,057,336円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	428,697,945円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,770,110,736円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	45,623,436円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	17,757,243円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	468,175,602円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	266,883,921円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	342,354,978円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	34,791,727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）	585,372,988円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,898,240,555円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,965,998,216円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドA	1,440,100,504円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	497,548,571円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	434,571,418円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,880,527,274円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	221,967,257円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,959,453円
SMT インデックスバランス・オープン	58,229,110円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	31,582,895,984円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	550,582,732円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,847,257円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	189,515,266円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	33,778,301円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,187,174円
グローバル経済コア	223,170,690円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	28,835,318円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	154,260,657円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	24,202,861円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,309,165,117円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	224,714,875円

区分	2022年 8月29日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	18,069,483円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	15,014,672円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	5,748,222円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,307,058円
10資産分散投資ファンド	32,436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）	44,571,522,793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）	894,108,933円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	316,197,368円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	53,623,641円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	226,775,993円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	45,728,188,890円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,940,173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）	197,097,200円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	5,744,022,294	
合計	5,744,022,294	

(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

（2022年 8月29日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,537,132,800	-	2,527,850,000	9,282,800
合計		2,537,132,800	-	2,527,850,000	9,282,800

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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	8,900	3,700.00	32,930,000	
日本水産	255,800	570.00	145,806,000	
マルハニチロ	36,500	2,492.00	90,958,000	
雪国まいたけ	20,100	1,033.00	20,763,300	
カネコ種苗	7,800	1,591.00	12,409,800	
サカタのタネ	29,900	4,965.00	148,453,500	
ホクト	21,000	1,929.00	40,509,000	
ホクリヨウ	3,700	614.00	2,271,800	
住石ホールディングス	48,200	242.00	11,664,400	
日鉄鉱業	5,300	6,050.00	32,065,000	
三井松島ホールディングス	11,500	3,680.00	42,320,000	
I N P E X	873,500	1,594.00	1,392,359,000	
石油資源開発	32,400	3,920.00	127,008,000	
K & O エナジーグループ	10,700	1,604.00	17,162,800	
ショーボンドホールディングス	32,200	6,020.00	193,844,000	
ミライト・ワン	88,700	1,588.00	140,855,600	
タマホーム	16,700	2,397.00	40,029,900	
サンヨーホームズ	3,200	701.00	2,243,200	
日本アクア	10,900	637.00	6,943,300	
ファーストコーポレーション	6,700	742.00	4,971,400	
ベステラ	5,600	1,125.00	6,300,000	
Robot Home	40,200	193.00	7,758,600	
キャンディル	4,100	580.00	2,378,000	
ダイセキ環境ソリューション	5,300	916.00	4,854,800	
第一カッター興業	6,000	1,291.00	7,746,000	
安藤・間	125,400	875.00	109,725,000	
東急建設	74,000	663.00	49,062,000	
コムシスホールディングス	88,800	2,596.00	230,524,800	
ビーアールホールディングス	34,600	351.00	12,144,600	
高松コンストラクショングループ	17,500	1,924.00	33,670,000	
東建コーポレーション	7,600	8,970.00	68,172,000	
ソネック	2,800	1,029.00	2,881,200	
ヤマウラ	12,000	956.00	11,472,000	
オリエンタル白石	92,600	256.00	23,705,600	
大成建設	177,100	4,110.00	727,881,000	
大林組	590,800	961.00	567,758,800	
清水建設	546,400	769.00	420,181,600	

飛島建設	17,000	1,087.00	18,479,000
長谷工コーポレーション	170,500	1,586.00	270,413,000
松井建設	21,200	602.00	12,762,400
銭高組	2,300	3,370.00	7,751,000
鹿島建設	432,900	1,478.00	639,826,200
不動テトラ	13,500	1,573.00	21,235,500
大末建設	6,700	1,507.00	10,096,900
鉄建建設	12,800	1,786.00	22,860,800
西松建設	38,500	4,030.00	155,155,000
三井住友建設	143,500	463.00	66,440,500
大豊建設	9,300	4,115.00	38,269,500
佐田建設	13,700	438.00	6,000,600
ナカノフドー建設	15,200	300.00	4,560,000
奥村組	31,700	2,970.00	94,149,000
東鉄工業	25,000	2,313.00	57,825,000
イチケン	4,600	1,815.00	8,349,000
富士ピー・エス	8,200	459.00	3,763,800
浅沼組	14,200	2,842.00	40,356,400
戸田建設	243,900	683.00	166,583,700
熊谷組	31,500	2,675.00	84,262,500
北野建設	3,900	2,080.00	8,112,000
植木組	5,200	1,310.00	6,812,000
矢作建設工業	25,300	767.00	19,405,100
ピーエス三菱	20,900	653.00	13,647,700
日本ハウスホールディングス	32,800	423.00	13,874,400
大東建託	65,100	13,590.00	884,709,000
新日本建設	27,100	728.00	19,728,800
東亜道路工業	3,300	5,930.00	19,569,000
日本道路	5,500	6,200.00	34,100,000
東亜建設工業	14,200	2,441.00	34,662,200
日本国土開発	49,500	605.00	29,947,500
若築建設	9,800	2,507.00	24,568,600
東洋建設	71,300	863.00	61,531,900
五洋建設	234,200	733.00	171,668,600
世紀東急工業	29,000	759.00	22,011,000
福田組	6,200	4,960.00	30,752,000
住友林業	126,700	2,368.00	300,025,600
日本基礎技術	15,500	532.00	8,246,000
巴コーポレーション	23,100	442.00	10,210,200
大和ハウス工業	503,600	3,144.00	1,583,318,400
ライト工業	35,000	1,866.00	65,310,000
積水ハウス	603,800	2,357.00	1,423,156,600

日特建設	13,100	906.00	11,868,600	
北陸電気工事	11,300	762.00	8,610,600	
ユアテック	36,400	748.00	27,227,200	
日本リーテック	12,100	846.00	10,236,600	
四電工	6,100	1,879.00	11,461,900	
中電工	25,600	2,138.00	54,732,800	
関電工	103,500	844.00	87,354,000	
きんでん	129,200	1,490.00	192,508,000	
東京エネシス	18,800	1,064.00	20,003,200	
トーエネック	6,400	3,665.00	23,456,000	
住友電設	15,700	2,638.00	41,416,600	
日本電設工業	27,100	1,748.00	47,370,800	
エクシオグループ	88,300	2,145.00	189,403,500	
新日本空調	13,800	1,864.00	25,723,200	
九電工	40,200	2,827.00	113,645,400	
三機工業	41,300	1,637.00	67,608,100	
日揮ホールディングス	179,700	1,887.00	339,093,900	
中外炉工業	5,900	1,658.00	9,782,200	
ヤマト	15,300	773.00	11,826,900	
太平電業	11,500	3,605.00	41,457,500	
高砂熱学工業	48,700	1,649.00	80,306,300	
三晃金属工業	2,500	2,659.00	6,647,500	
朝日工業社	7,700	1,933.00	14,884,100	
明星工業	32,000	745.00	23,840,000	
大気社	26,500	3,200.00	84,800,000	
ダイダン	11,900	2,229.00	26,525,100	
日比谷総合設備	17,300	1,859.00	32,160,700	
フィル・カンパニー	2,900	1,243.00	3,604,700	
テスホールディングス	17,800	1,204.00	21,431,200	
インフロニア・ホールディングス	221,500	996.00	220,614,000	
東洋エンジニアリング	26,700	709.00	18,930,300	
レイズネクスト	27,300	1,226.00	33,469,800	
ニッポン	49,700	1,578.00	78,426,600	
日清製粉グループ本社	191,700	1,591.00	304,994,700	
日東富士製粉	3,000	4,740.00	14,220,000	
昭和産業	16,100	2,592.00	41,731,200	
鳥越製粉	14,800	663.00	9,812,400	
中部飼料	21,000	1,076.00	22,596,000	
フィード・ワン	24,200	705.00	17,061,000	
東洋精糖	3,400	902.00	3,066,800	
日本甜菜製糖	10,600	1,632.00	17,299,200	
D M三井製糖ホールディングス	16,400	1,872.00	30,700,800	

塩水港精糖	24,300	204.00	4,957,200
日新製糖	9,600	1,752.00	16,819,200
森永製菓	41,000	4,020.00	164,820,000
中村屋	4,100	3,120.00	12,792,000
江崎グリコ	47,400	3,645.00	172,773,000
名糖産業	7,300	1,666.00	12,161,800
井村屋グループ	9,900	2,242.00	22,195,800
不二家	11,400	2,358.00	26,881,200
山崎製パン	111,000	1,634.00	181,374,000
第一屋製パン	3,500	476.00	1,666,000
モロゾフ	6,000	3,720.00	22,320,000
亀田製菓	10,500	4,535.00	47,617,500
寿スピリッツ	17,600	7,810.00	137,456,000
カルビー	92,800	2,750.00	255,200,000
森永乳業	34,500	4,330.00	149,385,000
六甲バター	12,200	1,452.00	17,714,400
ヤクルト本社	129,300	8,120.00	1,049,916,000
明治ホールディングス	112,200	6,610.00	741,642,000
雪印メグミルク	44,600	1,729.00	77,113,400
プリマハム	25,500	2,185.00	55,717,500
日本ハム	71,300	3,995.00	284,843,500
林兼産業	6,200	472.00	2,926,400
丸大食品	18,400	1,568.00	28,851,200
S Foods	18,300	2,998.00	54,863,400
柿安本店	7,100	2,294.00	16,287,400
伊藤ハム米久ホールディングス	128,900	675.00	87,007,500
サッポロホールディングス	54,600	3,035.00	165,711,000
アサヒグループホールディングス	383,200	4,680.00	1,793,376,000
キリンホールディングス	748,500	2,250.00	1,684,125,000
宝ホールディングス	113,200	1,063.00	120,331,600
オエノンホールディングス	49,600	289.00	14,334,400
養命酒製造	5,500	1,832.00	10,076,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,900	1,440.00	187,056,000
サントリー食品インターナショナル	116,800	5,120.00	598,016,000
ダイドーグループホールディングス	10,400	4,720.00	49,088,000
伊藤園	61,800	6,150.00	380,070,000
キーコーヒー	18,600	2,158.00	40,138,800
ユニカフェ	6,100	923.00	5,630,300
ジャパンフーズ	2,900	1,115.00	3,233,500
日清オイリオグループ	23,400	3,295.00	77,103,000
不二製油グループ本社	44,100	2,373.00	104,649,300
かどや製油	1,800	3,585.00	6,453,000

J - オイルミルズ	19,000	1,615.00	30,685,000
キッコーマン	122,100	8,580.00	1,047,618,000
味の素	405,900	3,762.00	1,526,995,800
ブルドックソース	7,300	1,854.00	13,534,200
キューピー	89,100	2,279.00	203,058,900
ハウス食品グループ本社	63,500	2,952.00	187,452,000
カゴメ	77,300	3,090.00	238,857,000
焼津水産化学工業	8,200	871.00	7,142,200
アリアケジャパン	18,600	4,785.00	89,001,000
ピエトロ	2,700	1,784.00	4,816,800
エバラ食品工業	4,500	3,170.00	14,265,000
やまみ	1,800	1,449.00	2,608,200
ニチレイ	76,000	2,469.00	187,644,000
東洋水産	90,800	5,650.00	513,020,000
イトアンドホールディングス	7,700	2,221.00	17,101,700
大冷	2,300	1,904.00	4,379,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,500	506.00	5,313,000
日清食品ホールディングス	65,700	10,040.00	659,628,000
永谷園ホールディングス	9,000	2,016.00	18,144,000
一正蒲鉾	7,900	793.00	6,264,700
フジッコ	18,900	1,930.00	36,477,000
ロック・フィールド	20,200	1,559.00	31,491,800
日本たばこ産業	1,091,900	2,364.00	2,581,251,600
ケンコーマヨネーズ	10,400	1,508.00	15,683,200
わらべや日洋ホールディングス	12,200	2,272.00	27,718,400
なとり	11,400	2,061.00	23,495,400
イフジ産業	3,500	920.00	3,220,000
ピククルスコーポレーション	9,700	1,177.00	11,416,900
ファーマフーズ	25,600	1,455.00	37,248,000
ユーグレナ	106,800	1,000.00	106,800,000
紀文食品	15,800	997.00	15,752,600
ミヨシ油脂	6,500	1,000.00	6,500,000
理研ビタミン	14,300	1,733.00	24,781,900
片倉工業	15,800	2,027.00	32,026,600
ゲンゼ	11,700	3,890.00	45,513,000
東洋紡	79,100	1,041.00	82,343,100
ユニチカ	57,000	257.00	14,649,000
富士紡ホールディングス	8,300	3,565.00	29,589,500
倉敷紡績	14,100	2,109.00	29,736,900
シキボウ	10,400	902.00	9,380,800
日本毛織	49,600	1,021.00	50,641,600
トーア紡コーポレーション	7,300	363.00	2,649,900

帝国繊維	19,400	1,621.00	31,447,400
帝人	175,000	1,475.00	258,125,000
東レ	1,234,000	791.40	976,587,600
住江織物	3,400	1,738.00	5,909,200
日本フェルト	12,600	416.00	5,241,600
イチカワ	2,800	1,392.00	3,897,600
日東製網	2,100	1,359.00	2,853,900
アツギ	14,700	418.00	6,144,600
ダイニック	6,400	626.00	4,006,400
セーレン	36,900	2,110.00	77,859,000
ソトー	7,500	779.00	5,842,500
東海染工	2,500	1,128.00	2,820,000
小松マテーレ	30,100	923.00	27,782,300
ワコールホールディングス	40,700	2,207.00	89,824,900
ホギメディカル	24,800	3,495.00	86,676,000
T S Iホールディングス	60,900	379.00	23,081,100
マツオカコーポレーション	6,000	949.00	5,694,000
ワールド	26,200	1,338.00	35,055,600
三陽商会	8,700	916.00	7,969,200
ナイガイ	7,600	263.00	1,998,800
オンワードホールディングス	110,300	263.00	29,008,900
ルックホールディングス	5,500	1,946.00	10,703,000
ゴールドウイン	32,900	8,330.00	274,057,000
デサント	34,000	3,435.00	116,790,000
キング	9,800	449.00	4,400,200
ヤマトインターナショナル	15,600	284.00	4,430,400
特種東海製紙	10,300	3,220.00	33,166,000
王子ホールディングス	766,800	559.00	428,641,200
日本製紙	80,600	911.00	73,426,600
三菱製紙	25,400	299.00	7,594,600
北越コーポレーション	118,500	757.00	89,704,500
中越パルプ工業	7,600	1,003.00	7,622,800
巴川製紙所	5,900	816.00	4,814,400
大王製紙	85,200	1,321.00	112,549,200
阿波製紙	4,500	302.00	1,359,000
レンゴー	153,700	817.00	125,572,900
トーモク	9,700	1,512.00	14,666,400
ザ・パック	12,500	2,300.00	28,750,000
北の達人コーポレーション	71,100	224.00	15,926,400
クラレ	268,200	1,066.00	285,901,200
旭化成	1,229,300	1,020.00	1,253,886,000
共和レザー	10,800	557.00	6,015,600

昭和電工	163,100	2,176.00	354,905,600
住友化学	1,355,600	552.00	748,291,200
住友精化	7,900	3,110.00	24,569,000
日産化学	89,400	7,080.00	632,952,000
ラサ工業	7,000	2,390.00	16,730,000
クレハ	14,400	9,680.00	139,392,000
多木化学	6,600	5,070.00	33,462,000
テイカ	11,300	1,250.00	14,125,000
石原産業	35,600	1,078.00	38,376,800
片倉コープアグリ	4,500	1,275.00	5,737,500
日本曹達	21,800	4,560.00	99,408,000
東ソー	245,700	1,800.00	442,260,000
トクヤマ	59,000	1,837.00	108,383,000
セントラル硝子	29,800	3,355.00	99,979,000
東亜合成	86,800	1,102.00	95,653,600
大阪ソーダ	15,200	3,750.00	57,000,000
関東電化工業	36,200	984.00	35,620,800
デンカ	66,900	3,325.00	222,442,500
信越化学工業	315,000	16,435.00	5,177,025,000
日本カーバイド工業	7,100	1,248.00	8,860,800
堺化学工業	12,900	1,955.00	25,219,500
第一稀元素化学工業	16,900	1,356.00	22,916,400
エア・ウォーター	159,200	1,740.00	277,008,000
日本酸素ホールディングス	163,700	2,484.00	406,630,800
日本化学工業	5,600	2,123.00	11,888,800
東邦アセチレン	4,000	1,173.00	4,692,000
日本パーカラライジング	83,500	960.00	80,160,000
高压ガス工業	28,000	674.00	18,872,000
チタン工業	2,300	1,643.00	3,778,900
四国化成工業	23,000	1,252.00	28,796,000
戸田工業	4,200	2,598.00	10,911,600
ステラ ケミファ	10,000	2,809.00	28,090,000
保土谷化学工業	5,300	3,265.00	17,304,500
日本触媒	28,300	5,580.00	157,914,000
大日精化工業	14,100	1,790.00	25,239,000
カネカ	42,800	3,660.00	156,648,000
三菱瓦斯化学	156,400	2,052.00	320,932,800
三井化学	154,700	3,140.00	485,758,000
J S R	185,200	3,125.00	578,750,000
東京応化工業	29,500	6,910.00	203,845,000
大阪有機化学工業	12,700	2,567.00	32,600,900
三菱ケミカルグループ	1,233,500	731.80	902,675,300

K Hネオケム	28,100	2,540.00	71,374,000
ダイセル	267,200	881.00	235,403,200
住友ベークライト	28,100	4,375.00	122,937,500
積水化学工業	379,600	1,889.00	717,064,400
日本ゼオン	149,300	1,337.00	199,614,100
アイカ工業	46,800	3,085.00	144,378,000
U B E	93,700	2,051.00	192,178,700
積水樹脂	27,300	1,712.00	46,737,600
タキロンシーアイ	43,000	539.00	23,177,000
旭有機材	11,200	2,301.00	25,771,200
ニチバン	10,500	1,610.00	16,905,000
リケンテクノス	40,400	523.00	21,129,200
大倉工業	7,800	1,853.00	14,453,400
積水化成成品工業	23,700	408.00	9,669,600
群栄化学工業	4,000	2,492.00	9,968,000
タイガースポリマー	9,500	424.00	4,028,000
ミライアル	6,400	1,916.00	12,262,400
ダイキアクシス	6,900	681.00	4,698,900
ダイキョーニシカワ	41,900	580.00	24,302,000
竹本容器	6,300	751.00	4,731,300
森六ホールディングス	9,600	1,784.00	17,126,400
恵和	5,500	4,120.00	22,660,000
日本化薬	139,600	1,226.00	171,149,600
カーリットホールディングス	16,700	677.00	11,305,900
日本精化	12,800	1,950.00	24,960,000
扶桑化学工業	15,700	3,445.00	54,086,500
トリケミカル研究所	20,500	2,397.00	49,138,500
A D E K A	78,400	2,344.00	183,769,600
日油	57,400	5,320.00	305,368,000
新日本理化	28,200	247.00	6,965,400
ハリマ化成グループ	13,100	904.00	11,842,400
花王	418,900	6,076.00	2,545,236,400
第一工業製薬	6,700	2,219.00	14,867,300
石原ケミカル	9,200	1,330.00	12,236,000
日華化学	7,500	844.00	6,330,000
ニイタカ	3,700	2,380.00	8,806,000
三洋化成工業	11,900	4,715.00	56,108,500
有機合成薬品工業	13,800	326.00	4,498,800
大日本塗料	22,500	747.00	16,807,500
日本ペイントホールディングス	746,600	1,048.00	782,436,800
関西ペイント	171,700	2,101.00	360,741,700
神東塗料	15,600	145.00	2,262,000



中国塗料	43,000	877.00	37,711,000
日本特殊塗料	11,900	950.00	11,305,000
藤倉化成	24,700	477.00	11,781,900
太陽ホールディングス	29,300	2,751.00	80,604,300
D I C	65,900	2,507.00	165,211,300
サカティンクス	37,500	963.00	36,112,500
東洋インキＳＣホールディングス	33,000	1,906.00	62,898,000
T & K T O K A	16,100	988.00	15,906,800
富士フィルムホールディングス	356,600	7,114.00	2,536,852,400
資生堂	352,800	5,316.00	1,875,484,800
ライオン	202,700	1,624.00	329,184,800
高砂香料工業	11,400	2,859.00	32,592,600
マンダム	39,500	1,512.00	59,724,000
ミルボン	25,000	5,850.00	146,250,000
ファンケル	82,100	2,796.00	229,551,600
コーセー	34,400	13,430.00	461,992,000
コタ	14,100	1,581.00	22,292,100
シーボン	2,600	1,679.00	4,365,400
ポーラ・オルビスホールディングス	86,600	1,557.00	134,836,200
ノエビアホールディングス	15,100	5,830.00	88,033,000
アジュバンホールディングス	4,600	966.00	4,443,600
新日本製薬	9,600	1,644.00	15,782,400
エステー	13,000	1,541.00	20,033,000
アグロ カネショウ	6,800	1,356.00	9,220,800
コニシ	30,800	1,627.00	50,111,600
長谷川香料	35,000	2,999.00	104,965,000
星光P M C	9,500	590.00	5,605,000
小林製薬	51,700	8,020.00	414,634,000
荒川化学工業	14,300	1,036.00	14,814,800
メック	13,900	2,455.00	34,124,500
日本高純度化学	4,800	2,394.00	11,491,200
タカラバイオ	53,100	1,946.00	103,332,600
J C U	20,800	3,335.00	69,368,000
新田ゼラチン	11,600	798.00	9,256,800
O A T アグリオ	7,700	1,993.00	15,346,100
デクセリアルズ	52,800	3,835.00	202,488,000
アース製薬	15,300	5,470.00	83,691,000
北興化学工業	17,000	1,074.00	18,258,000
大成ラミック	5,300	2,813.00	14,908,900
クミアイ化学工業	67,100	1,059.00	71,058,900
日本農薬	36,100	837.00	30,215,700
アキレス	13,000	1,366.00	17,758,000

有沢製作所	27,600	1,308.00	36,100,800
日東電工	122,600	8,560.00	1,049,456,000
レック	24,000	763.00	18,312,000
三光合成	23,200	456.00	10,579,200
きもと	31,100	252.00	7,837,200
藤森工業	15,800	3,510.00	55,458,000
前澤化成工業	11,900	1,319.00	15,696,100
未来工業	7,300	1,511.00	11,030,300
ウェーブロックホールディングス	7,700	638.00	4,912,600
J S P	11,900	1,450.00	17,255,000
エフピコ	37,300	3,295.00	122,903,500
天馬	15,900	2,251.00	35,790,900
信越ポリマー	36,400	1,338.00	48,703,200
東リ	46,300	205.00	9,491,500
ニフコ	67,700	3,120.00	211,224,000
バルカー	16,500	2,707.00	44,665,500
ユニ・チャーム	352,000	4,855.00	1,708,960,000
ショーエイコーポレーション	5,400	582.00	3,142,800
協和キリン	204,100	3,065.00	625,566,500
武田薬品工業	1,594,700	3,821.00	6,093,348,700
アステラス製薬	1,734,700	1,973.00	3,422,563,100
住友ファーマ	125,300	1,043.00	130,687,900
塩野義製薬	235,500	6,753.00	1,590,331,500
わかもと製薬	19,800	240.00	4,752,000
日本新薬	44,300	7,460.00	330,478,000
中外製薬	528,800	3,642.00	1,925,889,600
科研製薬	28,900	3,845.00	111,120,500
エーザイ	224,200	5,643.00	1,265,160,600
ロート製薬	96,700	4,115.00	397,920,500
小野薬品工業	391,100	3,313.00	1,295,714,300
久光製薬	42,900	3,395.00	145,645,500
持田製薬	22,800	3,370.00	76,836,000
参天製薬	353,400	1,002.00	354,106,800
扶桑薬品工業	6,500	2,121.00	13,786,500
日本ケミファ	2,100	1,901.00	3,992,100
ツムラ	58,000	3,145.00	182,410,000
日医工	57,200	352.00	20,134,400
キッセイ薬品工業	29,400	2,407.00	70,765,800
生化学工業	35,800	871.00	31,181,800
栄研化学	30,200	1,856.00	56,051,200
鳥居薬品	9,100	2,960.00	26,936,000
J C R ファーマ	57,200	2,130.00	121,836,000

東和薬品	29,200	2,219.00	64,794,800
富士製薬工業	10,900	1,014.00	11,052,600
ゼリア新薬工業	30,100	2,098.00	63,149,800
第一三共	1,471,800	4,108.00	6,046,154,400
キョーリン製薬ホールディングス	36,600	1,758.00	64,342,800
大幸薬品	30,600	617.00	18,880,200
ダイト	12,700	2,606.00	33,096,200
大塚ホールディングス	386,500	4,550.00	1,758,575,000
大正製薬ホールディングス	37,500	5,180.00	194,250,000
ペプチドリーム	81,900	1,637.00	134,070,300
あすか製薬ホールディングス	19,300	1,193.00	23,024,900
サワイグループホールディングス	38,900	4,150.00	161,435,000
日本コークス工業	171,400	101.00	17,311,400
ニチレキ	22,000	1,371.00	30,162,000
ユシロ化学工業	9,600	885.00	8,496,000
ビーピー・カストロール	7,200	1,102.00	7,934,400
富士石油	44,300	371.00	16,435,300
MORESCO	6,700	1,188.00	7,959,600
出光興産	206,400	3,690.00	761,616,000
ENEOSホールディングス	3,052,200	525.90	1,605,151,980
コスモエネルギーホールディングス	80,100	4,145.00	332,014,500
横浜ゴム	96,100	2,271.00	218,243,100
TOYO TIRE	97,100	1,670.00	162,157,000
ブリヂストン	539,500	5,380.00	2,902,510,000
住友ゴム工業	165,700	1,175.00	194,697,500
藤倉コンポジット	16,200	1,058.00	17,139,600
オカモト	9,400	3,930.00	36,942,000
フコク	8,900	1,014.00	9,024,600
ニッタ	19,100	2,926.00	55,886,600
住友理工	39,300	577.00	22,676,100
三ツ星ベルト	24,600	3,200.00	78,720,000
バンドー化学	32,700	987.00	32,274,900
日東紡績	25,200	2,525.00	63,630,000
AGC	171,900	4,745.00	815,665,500
日本板硝子	91,700	516.00	47,317,200
石塚硝子	3,300	1,636.00	5,398,800
日本山村硝子	7,200	651.00	4,687,200
日本電気硝子	69,000	2,617.00	180,573,000
オハラ	8,100	1,326.00	10,740,600
住友大阪セメント	30,300	3,380.00	102,414,000
太平洋セメント	115,300	2,028.00	233,828,400
日本ヒューム	16,800	692.00	11,625,600

日本コンクリート工業	36,900	269.00	9,926,100
三谷セキサン	8,300	3,545.00	29,423,500
アジアパイルホールディングス	29,100	507.00	14,753,700
東海カーボン	141,800	1,024.00	145,203,200
日本カーボン	9,700	4,095.00	39,721,500
東洋炭素	10,600	3,280.00	34,768,000
ノリタケカンパニーリミテド	10,300	4,160.00	42,848,000
TOTO	122,700	4,760.00	584,052,000
日本碍子	199,900	1,940.00	387,806,000
日本特殊陶業	141,500	2,855.00	403,982,500
MARUWA	7,000	17,190.00	120,330,000
品川リフラクトリーズ	4,800	3,760.00	18,048,000
黒崎播磨	3,500	4,755.00	16,642,500
ヨータイ	13,000	1,395.00	18,135,000
東京窯業	20,500	275.00	5,637,500
ニッカトー	8,700	467.00	4,062,900
フジインコーポレーテッド	16,300	6,690.00	109,047,000
クニミネ工業	6,500	848.00	5,512,000
エーアンドエーマテリアル	3,600	864.00	3,110,400
ニチアス	42,800	2,367.00	101,307,600
ニチハ	25,900	2,695.00	69,800,500
日本製鉄	838,100	2,182.00	1,828,734,200
神戸製鋼所	349,600	631.00	220,597,600
中山製鋼所	27,900	548.00	15,289,200
合同製鐵	9,800	1,787.00	17,512,600
JFEホールディングス	464,500	1,498.00	695,821,000
東京製鐵	58,700	1,422.00	83,471,400
共英製鋼	19,800	1,509.00	29,878,200
大和工業	32,800	4,925.00	161,540,000
東京鐵鋼	8,300	1,347.00	11,180,100
大阪製鐵	10,700	1,284.00	13,738,800
淀川製鋼所	22,000	2,431.00	53,482,000
丸一鋼管	58,200	2,960.00	172,272,000
モリ工業	4,900	2,748.00	13,465,200
大同特殊鋼	27,400	3,890.00	106,586,000
日本高周波鋼業	7,600	324.00	2,462,400
日本冶金工業	13,700	2,908.00	39,839,600
山陽特殊製鋼	17,200	2,080.00	35,776,000
愛知製鋼	11,300	2,101.00	23,741,300
日立金属	216,200	2,116.00	457,479,200
日本金属	5,100	1,079.00	5,502,900
大平洋金属	12,400	2,470.00	30,628,000

新日本電工	111,300	374.00	41,626,200
栗本鐵工所	8,300	1,652.00	13,711,600
虹技	2,600	954.00	2,480,400
三菱製鋼	12,900	1,030.00	13,287,000
日亜鋼業	23,100	252.00	5,821,200
日本精線	3,200	4,625.00	14,800,000
エンビプロ・ホールディングス	13,400	996.00	13,346,400
シンニッタン	24,600	222.00	5,461,200
新家工業	4,200	1,762.00	7,400,400
大紀アルミニウム工業所	24,800	1,340.00	33,232,000
日本軽金属ホールディングス	50,800	1,610.00	81,788,000
三井金属鉱業	54,200	3,260.00	176,692,000
東邦亜鉛	10,300	2,401.00	24,730,300
三菱マテリアル	116,000	2,096.00	243,136,000
住友金属鉱山	219,900	4,387.00	964,701,300
D O W Aホールディングス	46,900	5,210.00	244,349,000
古河機械金属	30,700	1,256.00	38,559,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,200	3,150.00	73,080,000
東邦チタニウム	36,000	2,218.00	79,848,000
U A C J	27,400	2,445.00	66,993,000
C Kサンエツ	3,800	4,100.00	15,580,000
古河電気工業	57,900	2,425.00	140,407,500
住友電気工業	700,200	1,604.00	1,123,120,800
フジクラ	223,800	989.00	221,338,200
昭和電線ホールディングス	17,500	1,829.00	32,007,500
東京特殊電線	2,600	2,240.00	5,824,000
タツタ電線	35,600	465.00	16,554,000
カナレ電気	3,100	1,519.00	4,708,900
平河ヒューテック	11,200	1,139.00	12,756,800
リョービ	18,600	1,299.00	24,161,400
アーレスティ	21,600	424.00	9,158,400
アサヒホールディングス	80,400	2,068.00	166,267,200
稲葉製作所	10,200	1,319.00	13,453,800
宮地エンジニアリンググループ	5,700	3,210.00	18,297,000
トーカロ	51,800	1,272.00	65,889,600
アルファC o	7,100	960.00	6,816,000
S U M C O	330,900	1,915.00	633,673,500
川田テクノロジーズ	3,700	3,690.00	13,653,000
R S T e c h n o l o g i e s	5,700	6,940.00	39,558,000
ジェイテックコーポレーション	2,600	1,779.00	4,625,400
信和	12,400	812.00	10,068,800
東洋製罐グループホールディングス	102,200	1,624.00	165,972,800

ホッカホールディングス	9,300	1,326.00	12,331,800
コロナ	9,700	835.00	8,099,500
横河ブリッジホールディングス	28,700	1,913.00	54,903,100
駒井ハルテック	3,100	1,680.00	5,208,000
高田機工	1,700	2,423.00	4,119,100
三和ホールディングス	189,200	1,380.00	261,096,000
文化シャッター	59,100	1,066.00	63,000,600
三協立山	23,900	614.00	14,674,600
アルインコ	13,300	898.00	11,943,400
東洋シャッター	4,400	544.00	2,393,600
LIXIL	315,800	2,470.00	780,026,000
日本フィルコン	12,600	485.00	6,111,000
ノーリツ	25,600	1,532.00	39,219,200
長府製作所	18,100	1,965.00	35,566,500
リンナイ	34,700	10,500.00	364,350,000
ダイニチ工業	9,600	641.00	6,153,600
日東精工	25,200	540.00	13,608,000
三洋工業	2,400	1,669.00	4,005,600
岡部	27,900	653.00	18,218,700
ジーテクト	22,100	1,404.00	31,028,400
東プレ	30,600	1,220.00	37,332,000
高周波熱錬	30,900	677.00	20,919,300
東京製綱	12,300	1,004.00	12,349,200
サンコール	17,200	708.00	12,177,600
モリテック スチール	15,600	292.00	4,555,200
パイオラックス	26,400	2,001.00	52,826,400
エイチワン	17,900	608.00	10,883,200
日本発條	169,100	938.00	158,615,800
中央発條	9,700	712.00	6,906,400
アドバネクス	2,600	1,228.00	3,192,800
立川ブラインド工業	7,800	1,048.00	8,174,400
三益半導体工業	15,700	2,151.00	33,770,700
日本ドライケミカル	4,600	1,633.00	7,511,800
日本製鋼所	51,600	3,095.00	159,702,000
三浦工業	79,000	2,962.00	233,998,000
タクマ	57,700	1,409.00	81,299,300
ツガミ	41,200	1,240.00	51,088,000
オークマ	19,200	5,100.00	97,920,000
芝浦機械	22,700	3,035.00	68,894,500
アマダ	316,900	1,071.00	339,399,900
アイダエンジニアリング	44,000	867.00	38,148,000
滝澤鉄工所	5,900	1,172.00	6,914,800

F U J I	80,200	2,007.00	160,961,400	
牧野フライス製作所	20,400	4,305.00	87,822,000	
オーエスジー	81,400	1,919.00	156,206,600	
ダイジェット工業	2,400	902.00	2,164,800	
旭ダイヤモンド工業	49,400	795.00	39,273,000	
D M G 森精機	103,300	1,770.00	182,841,000	
ソディック	47,500	804.00	38,190,000	
ディスコ	29,600	33,850.00	1,001,960,000	
日東工器	9,700	1,627.00	15,781,900	
日進工具	15,900	1,120.00	17,808,000	
パンチ工業	17,300	438.00	7,577,400	
富士ダイス	10,300	629.00	6,478,700	
豊和工業	10,600	839.00	8,893,400	
ニデックオーケーケー	7,600	1,328.00	10,092,800	
東洋機械金属	13,300	574.00	7,634,200	
津田駒工業	3,400	495.00	1,683,000	
エンシュウ	4,700	765.00	3,595,500	
島精機製作所	29,400	2,231.00	65,591,400	
オプトラン	25,200	2,203.00	55,515,600	
N C ホールディングス	5,700	1,868.00	10,647,600	
イワキポンプ	12,900	1,214.00	15,660,600	
フリー	17,900	1,013.00	18,132,700	
ヤマシンフィルタ	31,800	331.00	10,525,800	
日阪製作所	20,800	832.00	17,305,600	
やまびこ	27,900	1,136.00	31,694,400	
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,680.00	23,552,000	
平田機工	8,800	4,555.00	40,084,000	
ペガサスミシン製造	20,500	848.00	17,384,000	
マルマエ	8,300	2,119.00	17,587,700	
タツモ	9,400	1,391.00	13,075,400	
ナプテスコ	106,800	3,275.00	349,770,000	
三井海洋開発	21,400	1,420.00	30,388,000	
レオン自動機	21,600	1,229.00	26,546,400	
S M C	59,400	64,620.00	3,838,428,000	
ホソカワミクロン	13,100	2,614.00	34,243,400	
ユニオンツール	7,500	3,500.00	26,250,000	
オイレス工業	26,000	1,518.00	39,468,000	
日精エー・エス・ビー機械	7,800	4,155.00	32,409,000	
サトーホールディングス	26,500	1,910.00	50,615,000	
技研製作所	17,800	3,270.00	58,206,000	
日本エアーテック	8,700	1,075.00	9,352,500	
カワタ	6,000	913.00	5,478,000	

日精樹脂工業	12,900	967.00	12,474,300
オカダアイヨン	6,400	1,446.00	9,254,400
ワイエイシイホールディングス	8,100	1,439.00	11,655,900
小松製作所	919,600	2,924.00	2,688,910,400
住友重機械工業	108,500	2,924.00	317,254,000
日立建機	81,400	2,901.00	236,141,400
日工	25,600	632.00	16,179,200
巴工業	7,300	2,459.00	17,950,700
井関農機	16,100	1,281.00	20,624,100
TOWA	17,400	1,868.00	32,503,200
丸山製作所	3,300	1,596.00	5,266,800
北川鉄工所	8,100	1,347.00	10,910,700
ローツェ	10,000	8,460.00	84,600,000
タカキタ	6,400	573.00	3,667,200
クボタ	907,400	2,147.00	1,948,187,800
荏原実業	8,600	2,245.00	19,307,000
三菱化工機	6,100	2,301.00	14,036,100
月島機械	31,900	906.00	28,901,400
帝国電機製作所	12,900	1,979.00	25,529,100
新東工業	38,200	717.00	27,389,400
澁谷工業	16,100	2,498.00	40,217,800
アイチ コーポレーション	29,200	834.00	24,352,800
小森コーポレーション	46,900	770.00	36,113,000
鶴見製作所	14,400	2,113.00	30,427,200
住友精密工業	3,100	2,507.00	7,771,700
日本ギア工業	7,600	333.00	2,530,800
酒井重工業	3,400	2,998.00	10,193,200
荏原製作所	69,600	5,220.00	363,312,000
石井鐵工所	2,500	2,866.00	7,165,000
西島製作所	16,700	1,347.00	22,494,900
北越工業	17,200	959.00	16,494,800
ダイキン工業	221,600	24,160.00	5,353,856,000
オルガノ	5,900	9,250.00	54,575,000
トーヨーカネツ	7,100	2,599.00	18,452,900
栗田工業	102,500	5,400.00	553,500,000
椿本チエイン	26,600	3,185.00	84,721,000
大同工業	8,600	739.00	6,355,400
木村化工機	15,900	760.00	12,084,000
アネスト岩田	31,700	955.00	30,273,500
ダイフク	95,700	8,110.00	776,127,000
サムコ	5,600	3,065.00	17,164,000
加藤製作所	10,000	773.00	7,730,000



油研工業	3,300	1,818.00	5,999,400
タダノ	98,200	984.00	96,628,800
フジテック	62,300	2,749.00	171,262,700
C K D	51,400	1,820.00	93,548,000
キトー	16,000	2,696.00	43,136,000
平和	56,600	2,088.00	118,180,800
理想科学工業	17,100	2,419.00	41,364,900
S A N K Y O	41,800	4,090.00	170,962,000
日本金銭機械	20,700	658.00	13,620,600
マースグループホールディングス	13,000	1,586.00	20,618,000
フクシマガリレイ	12,500	3,545.00	44,312,500
オーイズミ	7,400	400.00	2,960,000
ダイコク電機	9,400	1,291.00	12,135,400
竹内製作所	30,900	2,622.00	81,019,800
アマノ	53,200	2,538.00	135,021,600
J U K I	26,500	715.00	18,947,500
ジャノメ	17,400	714.00	12,423,600
マックス	24,000	1,970.00	47,280,000
グローリー	48,200	2,193.00	105,702,600
新晃工業	18,900	1,593.00	30,107,700
大和冷機工業	26,200	1,121.00	29,370,200
セガサミーホールディングス	182,400	2,042.00	372,460,800
日本ピストンリング	7,500	1,272.00	9,540,000
リケン	7,400	2,450.00	18,130,000
T P R	22,200	1,289.00	28,615,800
ツバキ・ナカシマ	42,000	1,139.00	47,838,000
ホシザキ	109,500	4,050.00	443,475,000
大豊工業	16,700	701.00	11,706,700
日本精工	347,400	758.00	263,329,200
N T N	368,900	267.00	98,496,300
ジェイテクト	173,100	986.00	170,676,600
不二越	12,600	3,835.00	48,321,000
日本トムソン	46,500	577.00	26,830,500
T H K	98,200	2,781.00	273,094,200
ユーシン精機	15,900	714.00	11,352,600
前澤給装工業	13,200	904.00	11,932,800
イーグル工業	22,000	1,151.00	25,322,000
前澤工業	12,300	649.00	7,982,700
日本ピラー工業	17,400	2,599.00	45,222,600
キッツ	62,800	806.00	50,616,800
マキタ	229,300	3,190.00	731,467,000
三井E & S ホールディングス	75,700	427.00	32,323,900

日立造船	161,100	868.00	139,834,800
三菱重工業	297,600	5,115.00	1,522,224,000
I H I	126,700	3,565.00	451,685,500
スター精密	32,900	1,796.00	59,088,400
日清紡ホールディングス	138,500	1,068.00	147,918,000
イビデン	97,700	4,250.00	415,225,000
コニカミノルタ	412,900	477.00	196,953,300
ブラザー工業	231,500	2,613.00	604,909,500
ミネベアミツミ	323,100	2,393.00	773,178,300
日立製作所	975,800	6,881.00	6,714,479,800
東芝	354,700	5,137.00	1,822,093,900
三菱電機	1,893,600	1,392.50	2,636,838,000
富士電機	112,900	5,910.00	667,239,000
東洋電機製造	6,700	908.00	6,083,600
安川電機	201,600	4,570.00	921,312,000
シンフォニアテクノロジー	20,600	1,519.00	31,291,400
明電舎	28,700	1,973.00	56,625,100
オリジン	4,600	1,407.00	6,472,200
山洋電気	7,500	5,330.00	39,975,000
デンヨー	14,400	1,642.00	23,644,800
P H C ホールディングス	31,700	1,587.00	50,307,900
東芝テック	21,800	4,135.00	90,143,000
芝浦メカトロニクス	3,700	11,620.00	42,994,000
マブチモーター	42,400	3,920.00	166,208,000
日本電産	450,800	8,939.00	4,029,701,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,400	486.00	4,082,400
トレックス・セミコンダクター	8,900	2,923.00	26,014,700
東光高岳	11,600	1,935.00	22,446,000
ダブル・スコープ	55,600	2,266.00	125,989,600
ダイヘン	18,800	4,105.00	77,174,000
ヤーマン	33,500	1,635.00	54,772,500
J V C ケンウッド	168,300	205.00	34,501,500
ミマキエンジニアリング	19,100	689.00	13,159,900
I - P E X	9,900	1,374.00	13,602,600
日新電機	47,500	1,487.00	70,632,500
大崎電気工業	34,100	535.00	18,243,500
オムロン	168,900	7,225.00	1,220,302,500
日東工業	25,500	2,569.00	65,509,500
I D E C	25,100	2,826.00	70,932,600
正興電機製作所	7,700	1,075.00	8,277,500
不二電機工業	4,300	1,102.00	4,738,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	61,200	2,525.00	154,530,000

サクサホールディングス	4,700	1,301.00	6,114,700	
メルコホールディングス	5,800	3,340.00	19,372,000	
テクノメディカ	4,900	1,632.00	7,996,800	
日本電気	240,600	4,775.00	1,148,865,000	
富士通	182,600	16,260.00	2,969,076,000	
沖電気工業	76,900	749.00	57,598,100	
岩崎通信機	8,300	782.00	6,490,600	
電気興業	9,800	2,486.00	24,362,800	
サンケン電気	17,400	4,950.00	86,130,000	
ナカヨ	3,300	1,094.00	3,610,200	
アイホン	9,200	2,067.00	19,016,400	
ルネサスエレクトロニクス	1,107,600	1,304.00	1,444,310,400	
セイコーエプソン	226,600	2,188.00	495,800,800	
ワコム	156,200	842.00	131,520,400	
アルバック	40,400	5,380.00	217,352,000	
アクセル	8,400	990.00	8,316,000	
E I Z O	13,800	3,845.00	53,061,000	
日本信号	43,000	928.00	39,904,000	
京三製作所	39,600	429.00	16,988,400	
能美防災	23,400	1,630.00	38,142,000	
ホーチキ	13,200	1,343.00	17,727,600	
星和電機	8,900	450.00	4,005,000	
エレコム	46,800	1,683.00	78,764,400	
パナソニック ホールディングス	2,163,900	1,110.00	2,401,929,000	
シャープ	192,700	1,001.00	192,892,700	
アンリツ	128,300	1,624.00	208,359,200	
富士通ゼネラル	55,100	2,937.00	161,828,700	
ソニーグループ	1,271,000	11,295.00	14,355,945,000	
T D K	294,000	4,845.00	1,424,430,000	
帝国通信工業	9,400	1,441.00	13,545,400	
タムラ製作所	73,000	715.00	52,195,000	
アルプスアルパイン	166,200	1,246.00	207,085,200	
池上通信機	6,000	604.00	3,624,000	
日本電波工業	20,800	1,459.00	30,347,200	
鈴木	10,700	821.00	8,784,700	
メイコー	22,100	3,185.00	70,388,500	
日本トリム	4,100	2,405.00	9,860,500	
ローランド ディー . ジー .	9,700	3,300.00	32,010,000	
フォスター電機	18,900	803.00	15,176,700	
S M K	4,500	2,540.00	11,430,000	
ヨコオ	13,800	2,164.00	29,863,200	
ホシデン	45,200	1,557.00	70,376,400	

ヒロセ電機	28,100	19,430.00	545,983,000
日本航空電子工業	40,700	2,292.00	93,284,400
TOA	21,800	801.00	17,461,800
マクセル	37,400	1,461.00	54,641,400
古野電気	24,700	1,137.00	28,083,900
ユニデンホールディングス	4,400	4,090.00	17,996,000
スミダコーポレーション	16,200	976.00	15,811,200
アイコム	6,500	2,621.00	17,036,500
リオン	7,300	2,139.00	15,614,700
本多通信工業	16,600	703.00	11,669,800
横河電機	186,100	2,429.00	452,036,900
新電元工業	7,200	3,670.00	26,424,000
アズビル	117,700	3,890.00	457,853,000
東亜ディーケーケー	10,800	845.00	9,126,000
日本光電工業	78,000	3,050.00	237,900,000
チノー	6,400	1,646.00	10,534,400
共和電業	17,700	343.00	6,071,100
日本電子材料	9,500	1,583.00	15,038,500
堀場製作所	37,500	6,230.00	233,625,000
アドバンテスト	150,800	8,010.00	1,207,908,000
小野測器	8,400	417.00	3,502,800
エスペック	15,300	1,835.00	28,075,500
キーエンス	183,800	52,100.00	9,575,980,000
日置電機	8,900	6,630.00	59,007,000
シスメックス	145,300	8,368.00	1,215,870,400
日本マイクロニクス	28,200	1,413.00	39,846,600
メガチップス	18,200	2,726.00	49,613,200
OBARA GROUP	8,100	3,285.00	26,608,500
澤藤電機	2,900	1,279.00	3,709,100
原田工業	10,400	812.00	8,444,800
コーセル	23,200	876.00	20,323,200
イリソ電子工業	17,200	4,070.00	70,004,000
オブテックスグループ	31,200	2,023.00	63,117,600
千代田インテグレ	7,100	2,167.00	15,385,700
レーザーテック	83,200	19,070.00	1,586,624,000
スタンレー電気	131,000	2,529.00	331,299,000
岩崎電気	6,600	2,576.00	17,001,600
ウシオ電機	96,300	1,697.00	163,421,100
岡谷電機産業	16,900	243.00	4,106,700
ヘリオス テクノ ホールディング	18,900	376.00	7,106,400
エノモト	6,000	1,556.00	9,336,000
日本セラミック	17,400	2,589.00	45,048,600

遠藤照明	10,100	779.00	7,867,900
古河電池	15,000	1,158.00	17,370,000
双信電機	11,100	452.00	5,017,200
山一電機	13,500	2,019.00	27,256,500
図研	13,400	3,405.00	45,627,000
日本電子	39,100	5,560.00	217,396,000
カシオ計算機	125,500	1,310.00	164,405,000
ファナック	178,100	22,445.00	3,997,454,500
日本シイエムケイ	37,100	473.00	17,548,300
エンプラス	5,200	4,200.00	21,840,000
大真空	25,700	966.00	24,826,200
ローム	84,400	10,240.00	864,256,000
浜松ホトニクス	135,300	5,850.00	791,505,000
三井ハイテック	17,500	8,530.00	149,275,000
新光電気工業	59,800	3,790.00	226,642,000
京セラ	285,500	7,576.00	2,162,948,000
太陽誘電	90,400	4,300.00	388,720,000
村田製作所	553,500	7,468.00	4,133,538,000
双葉電子工業	35,700	664.00	23,704,800
北陸電気工業	8,100	1,091.00	8,837,100
ニチコン	54,500	1,438.00	78,371,000
日本ケミコン	19,500	1,838.00	35,841,000
K O A	28,300	2,303.00	65,174,900
市光工業	25,900	380.00	9,842,000
小糸製作所	101,400	4,570.00	463,398,000
ミツバ	31,600	431.00	13,619,600
S C R E E Nホールディングス	32,000	9,410.00	301,120,000
キャノン電子	19,000	1,668.00	31,692,000
キャノン	924,200	3,386.00	3,129,341,200
リコー	482,700	1,083.00	522,764,100
象印マホービン	50,700	1,603.00	81,272,100
M U T O Hホールディングス	2,900	1,951.00	5,657,900
東京エレクトロン	128,700	43,530.00	5,602,311,000
トヨタ紡織	70,900	2,004.00	142,083,600
芦森工業	3,800	1,025.00	3,895,000
ユニプレス	33,300	946.00	31,501,800
豊田自動織機	143,700	7,690.00	1,105,053,000
モリタホールディングス	32,500	1,269.00	41,242,500
三櫻工業	28,100	762.00	21,412,200
デンソー	397,100	7,555.00	3,000,090,500
東海理化電機製作所	53,400	1,501.00	80,153,400
川崎重工業	137,500	2,600.00	357,500,000

名村造船所	52,300	633.00	33,105,900
日本車輛製造	6,500	2,155.00	14,007,500
三菱ロジスネクスト	26,900	853.00	22,945,700
近畿車輛	3,000	1,024.00	3,072,000
日産自動車	2,392,800	531.70	1,272,251,760
いすゞ自動車	587,700	1,731.00	1,017,308,700
トヨタ自動車	9,249,400	2,090.00	19,331,246,000
日野自動車	253,400	629.00	159,388,600
三菱自動車工業	751,000	538.00	404,038,000
エフテック	13,000	516.00	6,708,000
レシップホールディングス	8,000	531.00	4,248,000
G M B	3,700	724.00	2,678,800
ファルテック	3,500	591.00	2,068,500
武蔵精密工業	45,200	1,652.00	74,670,400
日産車体	29,700	771.00	22,898,700
新明和工業	52,900	1,077.00	56,973,300
極東開発工業	32,300	1,363.00	44,024,900
トピー工業	15,200	1,391.00	21,143,200
ティラド	5,500	2,786.00	15,323,000
曙ブレーキ工業	111,400	168.00	18,715,200
タチエス	33,300	1,198.00	39,893,400
N O K	76,300	1,221.00	93,162,300
フタバ産業	45,100	362.00	16,326,200
K Y B	17,800	3,265.00	58,117,000
大同メタル工業	38,900	531.00	20,655,900
プレス工業	90,900	435.00	39,541,500
ミクニ	23,600	327.00	7,717,200
太平洋工業	38,600	1,086.00	41,919,600
河西工業	24,900	239.00	5,951,100
アイシン	148,500	4,110.00	610,335,000
マツダ	597,000	1,226.00	731,922,000
今仙電機製作所	13,300	572.00	7,607,600
本田技研工業	1,483,400	3,669.00	5,442,594,600
スズキ	402,200	4,771.00	1,918,896,200
S U B A R U	533,000	2,448.00	1,304,784,000
安永	8,200	693.00	5,682,600
ヤマハ発動機	264,700	2,860.00	757,042,000
T B K	20,400	322.00	6,568,800
エクセディ	30,600	1,823.00	55,783,800
豊田合成	57,300	2,386.00	136,717,800
愛三工業	31,800	733.00	23,309,400
盟和産業	2,900	992.00	2,876,800

日本プラスト	14,700	455.00	6,688,500
ヨロズ	15,800	888.00	14,030,400
エフ・シー・シー	33,200	1,465.00	48,638,000
シマノ	68,900	23,760.00	1,637,064,000
テイ・エス テック	85,700	1,560.00	133,692,000
ジャムコ	11,800	1,267.00	14,950,600
テルモ	574,100	4,448.00	2,553,596,800
クリエートメディック	6,100	938.00	5,721,800
日機装	42,100	1,008.00	42,436,800
日本エム・ディ・エム	11,700	1,380.00	16,146,000
島津製作所	242,500	4,050.00	982,125,000
JMS	15,600	560.00	8,736,000
長野計器	13,500	1,107.00	14,944,500
ブイ・テクノロジー	8,900	2,938.00	26,148,200
東京計器	12,900	1,285.00	16,576,500
愛知時計電機	7,300	1,441.00	10,519,300
インターアクション	10,200	1,825.00	18,615,000
オーバル	18,200	493.00	8,972,600
東京精密	31,700	4,650.00	147,405,000
マニー	74,100	1,749.00	129,600,900
ニコン	286,000	1,592.00	455,312,000
トプコン	95,400	1,854.00	176,871,600
オリンパス	972,000	2,959.00	2,876,148,000
理研計器	13,400	4,250.00	56,950,000
タムロン	12,600	3,005.00	37,863,000
HOYA	391,700	14,240.00	5,577,808,000
シード	9,500	559.00	5,310,500
ノーリツ鋼機	16,000	2,452.00	39,232,000
A & Dホロンホールディングス	22,800	920.00	20,976,000
朝日インテック	222,500	2,423.00	539,117,500
シチズン時計	198,100	597.00	118,265,700
リズム	6,400	1,433.00	9,171,200
大研医器	16,100	472.00	7,599,200
メニコン	62,600	3,310.00	207,206,000
シンシア	1,800	451.00	811,800
松風	6,800	2,161.00	14,694,800
セイコーホールディングス	28,700	2,806.00	80,532,200
ニプロ	140,400	1,109.00	155,703,600
中本パックス	5,700	1,594.00	9,085,800
スノーピーク	28,800	2,221.00	63,964,800
パラマウントベッドホールディングス	38,900	2,616.00	101,762,400
トランザクション	13,000	1,115.00	14,495,000

粧美堂	5,100	410.00	2,091,000
ニホンフラッシュ	15,800	951.00	15,025,800
前田工織	18,300	3,330.00	60,939,000
永大産業	22,100	253.00	5,591,300
アートネイチャー	17,300	725.00	12,542,500
バンダイナムコホールディングス	167,800	10,285.00	1,725,823,000
アイフィスジャパン	5,200	601.00	3,125,200
共立印刷	27,800	148.00	4,114,400
SHOEI	17,800	5,440.00	96,832,000
フランスベッドホールディングス	26,100	956.00	24,951,600
パイロットコーポレーション	26,300	4,915.00	129,264,500
萩原工業	11,300	1,113.00	12,576,900
フジシールインターナショナル	41,700	1,506.00	62,800,200
タカラトミー	83,800	1,335.00	111,873,000
広済堂ホールディングス	12,600	1,182.00	14,893,200
エステールホールディングス	4,300	622.00	2,674,600
タカノ	6,900	732.00	5,050,800
プロネクサス	15,700	1,008.00	15,825,600
ホクシン	14,300	156.00	2,230,800
ウッドワン	6,200	1,073.00	6,652,600
大建工業	10,200	1,957.00	19,961,400
凸版印刷	264,300	2,148.00	567,716,400
大日本印刷	219,800	2,887.00	634,562,600
共同印刷	5,300	2,414.00	12,794,200
NISSHA	32,000	1,790.00	57,280,000
光村印刷	1,600	1,223.00	1,956,800
TAKARA & COMPANY	11,600	2,017.00	23,397,200
アシックス	155,500	2,490.00	387,195,000
ツツミ	5,100	1,983.00	10,113,300
ローランド	12,400	4,065.00	50,406,000
小松ウオール工業	6,200	1,901.00	11,786,200
ヤマハ	118,000	5,410.00	638,380,000
河合楽器製作所	5,100	2,750.00	14,025,000
クリナップ	18,900	614.00	11,604,600
ピジョン	107,300	2,091.00	224,364,300
兼松サステック	1,300	1,646.00	2,139,800
キングジム	14,900	904.00	13,469,600
リンテック	38,600	2,294.00	88,548,400
イトーキ	34,500	449.00	15,490,500
任天堂	114,500	57,240.00	6,553,980,000
三菱鉛筆	24,300	1,388.00	33,728,400
タカラスタANDARD	32,600	1,330.00	43,358,000



コクヨ	81,100	1,783.00	144,601,300
ナカバヤシ	16,300	514.00	8,378,200
グローブライド	15,100	2,776.00	41,917,600
オカムラ	57,000	1,329.00	75,753,000
美津濃	16,700	2,691.00	44,939,700
東京電力ホールディングス	1,518,400	527.00	800,196,800
中部電力	573,000	1,411.00	808,503,000
関西電力	709,600	1,327.00	941,639,200
中国電力	292,700	843.00	246,746,100
北陸電力	172,200	517.00	89,027,400
東北電力	443,500	703.00	311,780,500
四国電力	168,600	816.00	137,577,600
九州電力	388,300	838.00	325,395,400
北海道電力	176,300	516.00	90,970,800
沖縄電力	43,000	1,134.00	48,762,000
電源開発	149,900	2,136.00	320,186,400
エフオン	12,300	687.00	8,450,100
イーレックス	26,100	2,772.00	72,349,200
レノバ	39,800	2,889.00	114,982,200
東京瓦斯	361,100	2,597.00	937,776,700
大阪瓦斯	341,200	2,370.00	808,644,000
東邦瓦斯	79,600	3,170.00	252,332,000
北海道瓦斯	10,100	1,643.00	16,594,300
広島ガス	35,500	329.00	11,679,500
西部ガスホールディングス	19,300	1,756.00	33,890,800
静岡ガス	38,400	1,062.00	40,780,800
メタウォーター	21,100	2,042.00	43,086,200
SBSホールディングス	15,000	2,864.00	42,960,000
東武鉄道	185,000	3,190.00	590,150,000
相鉄ホールディングス	60,300	2,365.00	142,609,500
東急	472,300	1,617.00	763,709,100
京浜急行電鉄	225,800	1,388.00	313,410,400
小田急電鉄	255,300	1,854.00	473,326,200
京王電鉄	89,100	5,150.00	458,865,000
京成電鉄	119,500	3,690.00	440,955,000
富士急行	20,700	4,045.00	83,731,500
新京成電鉄	4,700	3,015.00	14,170,500
東日本旅客鉄道	309,500	6,940.00	2,147,930,000
西日本旅客鉄道	215,200	5,212.00	1,121,622,400
東海旅客鉄道	142,700	15,875.00	2,265,362,500
西武ホールディングス	244,500	1,372.00	335,454,000
鴻池運輸	28,700	1,315.00	37,740,500

西日本鉄道	48,700	2,798.00	136,262,600
ハマキョウレックス	13,200	3,170.00	41,844,000
サカイ引越センター	9,300	4,800.00	44,640,000
近鉄グループホールディングス	180,200	4,585.00	826,217,000
阪急阪神ホールディングス	224,200	4,040.00	905,768,000
南海電気鉄道	80,400	2,688.00	216,115,200
京阪ホールディングス	74,900	3,430.00	256,907,000
神戸電鉄	4,600	3,345.00	15,387,000
名古屋鉄道	185,900	2,089.00	388,345,100
山陽電気鉄道	13,700	2,276.00	31,181,200
アルプス物流	13,400	1,118.00	14,981,200
ヤマトホールディングス	263,200	2,187.00	575,618,400
山九	46,700	4,235.00	197,774,500
丸運	9,100	231.00	2,102,100
丸全昭和運輸	13,000	3,205.00	41,665,000
センコーグループホールディングス	89,000	952.00	84,728,000
トナミホールディングス	3,700	3,700.00	13,690,000
ニッコンホールディングス	58,000	2,336.00	135,488,000
日本石油輸送	2,100	2,428.00	5,098,800
福山通運	24,600	3,130.00	76,998,000
セイノーホールディングス	104,700	1,111.00	116,321,700
エスライン	5,200	820.00	4,264,000
神奈川中央交通	4,800	3,740.00	17,952,000
日立物流	37,100	8,780.00	325,738,000
丸和運輸機関	32,500	1,652.00	53,690,000
C & F ロジホールディングス	16,200	1,217.00	19,715,400
九州旅客鉄道	128,800	2,851.00	367,208,800
S Gホールディングス	322,700	2,283.00	736,724,100
NIPPON EXPRESSホールディングス	62,800	7,590.00	476,652,000
日本郵船	160,900	10,690.00	1,720,021,000
商船三井	297,000	3,700.00	1,098,900,000
川崎汽船	59,400	8,940.00	531,036,000
NSユナイテッド海運	9,600	5,060.00	48,576,000
飯野海運	78,300	842.00	65,928,600
共栄タンカー	5,900	922.00	5,439,800
乾汽船	12,600	2,087.00	26,296,200
日本航空	413,000	2,512.00	1,037,456,000
ANAホールディングス	457,600	2,625.50	1,201,428,800
パスコ	3,600	1,315.00	4,734,000
ランコム	5,400	7,490.00	40,446,000
日新	14,000	1,825.00	25,550,000
三菱倉庫	46,500	3,595.00	167,167,500

三井倉庫ホールディングス	18,800	3,410.00	64,108,000
住友倉庫	56,400	2,185.00	123,234,000
澁澤倉庫	9,600	2,099.00	20,150,400
東陽倉庫	27,200	280.00	7,616,000
日本トランスシティ	33,800	510.00	17,238,000
ケイヒン	3,300	1,443.00	4,761,900
中央倉庫	9,900	960.00	9,504,000
川西倉庫	3,500	1,063.00	3,720,500
安田倉庫	12,900	935.00	12,061,500
ファイズホールディングス	4,100	999.00	4,095,900
東洋埠頭	5,400	1,230.00	6,642,000
上組	91,300	2,693.00	245,870,900
サンリツ	4,900	695.00	3,405,500
キムラユニティー	10,000	814.00	8,140,000
キューソー流通システム	11,200	1,270.00	14,224,000
東海運	10,900	282.00	3,073,800
エーアイティー	12,100	1,666.00	20,158,600
内外トランスライン	6,100	2,142.00	13,066,200
日本コンセプト	5,200	1,731.00	9,001,200
NEC ネットエスアイ	66,000	1,670.00	110,220,000
クロスキャット	10,900	1,304.00	14,213,600
システナ	284,600	417.00	118,678,200
デジタルアーツ	10,700	6,610.00	70,727,000
日鉄ソリューションズ	34,700	3,730.00	129,431,000
キューブシステム	10,300	1,032.00	10,629,600
WOW WORLD	3,000	851.00	2,553,000
コア	8,600	1,496.00	12,865,600
手間いらず	2,900	4,820.00	13,978,000
ラクーンホールディングス	17,100	1,343.00	22,965,300
ソリトンシステムズ	8,900	1,215.00	10,813,500
ソフトクリエイイトホールディングス	8,700	3,845.00	33,451,500
T I S	174,100	3,905.00	679,860,500
J N S ホールディングス	9,800	401.00	3,929,800
グリー	90,900	835.00	75,901,500
G M O ペパボ	2,500	1,940.00	4,850,000
コーエーテクモホールディングス	63,600	4,595.00	292,242,000
三菱総合研究所	8,300	4,110.00	34,113,000
電算	2,300	2,027.00	4,662,100
A G S	8,200	711.00	5,830,200
ファインデックス	13,700	662.00	9,069,400
ブレインパッド	17,100	1,104.00	18,878,400
K L a b	31,600	400.00	12,640,000

ポールトゥウィンホールディングス	29,100	1,011.00	29,420,100
ネクソン	454,600	2,753.00	1,251,513,800
アイスタイル	51,900	509.00	26,417,100
エムアップホールディングス	23,200	1,424.00	33,036,800
エイチーム	12,800	750.00	9,600,000
エニグモ	21,900	554.00	12,132,600
テクノスジャパン	15,900	458.00	7,282,200
コロプラ	65,900	682.00	44,943,800
ブロードリーフ	99,200	507.00	50,294,400
クロス・マーケティンググループ	7,800	865.00	6,747,000
デジタルハーツホールディングス	9,200	1,764.00	16,228,800
システム情報	15,200	984.00	14,956,800
メディアドゥ	6,900	2,041.00	14,082,900
じげん	57,000	335.00	19,095,000
ブイキューブ	20,400	1,290.00	26,316,000
エンカレッジ・テクノロジー	4,800	517.00	2,481,600
サイバーリンクス	6,200	1,144.00	7,092,800
フィックスターズ	19,300	1,228.00	23,700,400
CARTA HOLDINGS	8,300	1,757.00	14,583,100
オブティム	14,200	888.00	12,609,600
セレス	6,900	1,146.00	7,907,400
SHIFT	12,400	19,490.00	241,676,000
ティーガイア	17,800	1,654.00	29,441,200
セック	3,000	2,280.00	6,840,000
テクマトリックス	33,800	1,745.00	58,981,000
プロシップ	6,700	1,439.00	9,641,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	51,800	2,273.00	117,741,400
GMOペイメントゲートウェイ	38,600	10,880.00	419,968,000
ザッパラス	7,500	311.00	2,332,500
システムリサーチ	5,900	1,989.00	11,735,100
インターネットイニシアティブ	53,100	4,790.00	254,349,000
さくらインターネット	21,700	583.00	12,651,100
ヴィンクス	5,700	1,522.00	8,675,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,200	5,140.00	26,728,000
SRAホールディングス	9,700	2,943.00	28,547,100
システムインテグレータ	6,800	464.00	3,155,200
朝日ネット	18,500	622.00	11,507,000
eBASE	24,200	549.00	13,285,800
アバント	21,500	1,493.00	32,099,500
アドソル日進	7,200	1,580.00	11,376,000
ODKソリューションズ	4,500	585.00	2,632,500
フリービット	10,600	891.00	9,444,600

コムチュア	22,400	2,417.00	54,140,800
サイバーコム	3,200	1,261.00	4,035,200
アステリア	14,600	805.00	11,753,000
アイル	9,600	1,721.00	16,521,600
マークラインズ	9,300	2,209.00	20,543,700
メディカル・データ・ビジョン	25,400	1,139.00	28,930,600
g u m i	27,900	754.00	21,036,600
ショーケース	4,900	410.00	2,009,000
モバイルファクトリー	4,200	951.00	3,994,200
テラスカイ	7,400	1,884.00	13,941,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,000	1,503.00	13,527,000
P C Iホールディングス	8,000	971.00	7,768,000
アイビーシー	3,400	414.00	1,407,600
ネオジャパン	5,800	1,123.00	6,513,400
P R T I M E S	4,300	2,453.00	10,547,900
ラクス	91,400	1,616.00	147,702,400
ランドコンピュータ	4,800	873.00	4,190,400
ダブルスタンダード	6,100	2,392.00	14,591,200
オープンドア	11,900	1,966.00	23,395,400
マイネット	6,500	504.00	3,276,000
アカツキ	9,000	2,407.00	21,663,000
ベネフィットジャパン	1,600	1,587.00	2,539,200
U b i c o mホールディングス	5,300	2,615.00	13,859,500
カナミックネットワーク	24,700	567.00	14,004,900
ノムラシステムコーポレーション	19,400	141.00	2,735,400
チェンジ	41,500	1,915.00	79,472,500
シンクロ・フード	10,700	442.00	4,729,400
オークネット	8,900	2,119.00	18,859,100
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	705.00	2,749,500
セグエグループ	5,600	714.00	3,998,400
エイトレッド	2,900	1,844.00	5,347,600
マクロミル	38,500	1,066.00	41,041,000
ビーグリー	3,300	1,318.00	4,349,400
オロ	5,200	1,541.00	8,013,200
ユーザーローカル	6,200	1,590.00	9,858,000
テモナ	4,300	321.00	1,380,300
ニーズウェル	6,100	638.00	3,891,800
マネーフォワード	40,600	3,410.00	138,446,000
サインポスト	6,400	879.00	5,625,600
電算システムホールディングス	8,300	2,327.00	19,314,100
ソルクシーズ	15,800	376.00	5,940,800
フェイス	5,600	570.00	3,192,000

プロトコーポレーション	21,300	1,126.00	23,983,800
ハイマックス	5,400	1,397.00	7,543,800
野村総合研究所	346,300	3,725.00	1,289,967,500
サイバネットシステム	14,400	951.00	13,694,400
C Eホールディングス	10,100	508.00	5,130,800
日本システム技術	3,600	2,600.00	9,360,000
インテージホールディングス	23,100	1,555.00	35,920,500
東邦システムサイエンス	5,500	995.00	5,472,500
ソースネクスト	86,800	245.00	21,266,000
インフォコム	21,900	1,991.00	43,602,900
シンプレクス・ホールディングス	31,600	2,052.00	64,843,200
HEROZ	5,900	860.00	5,074,000
ラクスル	23,900	2,082.00	49,759,800
メルカリ	76,000	2,247.00	170,772,000
I P S	5,600	2,807.00	15,719,200
F I G	22,400	389.00	8,713,600
システムサポート	7,400	1,411.00	10,441,400
イーソル	11,200	646.00	7,235,200
アルテリア・ネットワークス	19,100	1,297.00	24,772,700
東海ソフト	3,300	936.00	3,088,800
ウイングアーク1st	15,300	1,729.00	26,453,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,786.00	8,394,200
サーバーワークス	3,500	2,768.00	9,688,000
東名	1,600	1,074.00	1,718,400
ヴィッツ	2,100	1,087.00	2,282,700
トピラシステムズ	4,900	987.00	4,836,300
S a n s a n	63,100	1,269.00	80,073,900
L i n k - U	3,900	744.00	2,901,600
ギフトィ	18,300	1,973.00	36,105,900
ベース	2,900	6,630.00	19,227,000
J M D C	25,000	6,590.00	164,750,000
フォーカスシステムズ	12,600	988.00	12,448,800
クレスコ	14,600	1,813.00	26,469,800
フジ・メディア・ホールディングス	177,300	1,101.00	195,207,300
オービック	62,800	20,660.00	1,297,448,000
ジャストシステム	28,400	3,580.00	101,672,000
T D C ソフト	16,000	1,177.00	18,832,000
Zホールディングス	2,871,500	412.70	1,185,068,050
トレンドマイクロ	97,600	8,490.00	828,624,000
I Dホールディングス	12,800	892.00	11,417,600
日本オラクル	32,300	8,380.00	270,674,000
アルファシステムズ	5,400	4,650.00	25,110,000

フューチャー	42,200	1,660.00	70,052,000
C A C H o l d i n g s	10,500	1,427.00	14,983,500
S B テクノロジー	8,700	2,420.00	21,054,000
トーセ	5,200	801.00	4,165,200
オービックビジネスコンサルタント	19,000	4,850.00	92,150,000
伊藤忠テクノソリューションズ	90,800	3,470.00	315,076,000
アイティフォー	24,400	787.00	19,202,800
東計電算	2,400	6,490.00	15,576,000
エクスネット	3,300	1,001.00	3,303,300
大塚商会	95,800	4,510.00	432,058,000
サイボウズ	23,500	1,358.00	31,913,000
電通国際情報サービス	20,600	4,410.00	90,846,000
A C C E S S	22,800	800.00	18,240,000
デジタルガレージ	33,000	3,870.00	127,710,000
E M システムズ	28,400	999.00	28,371,600
ウェザーニューズ	6,000	7,940.00	47,640,000
C I J	15,700	753.00	11,822,100
ビジネスエンジニアリング	4,600	2,382.00	10,957,200
日本エンタープライズ	20,900	167.00	3,490,300
WOWOW	8,300	1,369.00	11,362,700
スカラ	17,000	748.00	12,716,000
インテリジェント ウェイブ	10,200	858.00	8,751,600
I M A G I C A G R O U P	14,400	878.00	12,643,200
ネットワンシステムズ	73,500	3,090.00	227,115,000
システムソフト	61,000	109.00	6,649,000
アルゴグラフィックス	15,600	3,735.00	58,266,000
マーベラス	31,700	677.00	21,460,900
エイベックス	34,500	1,579.00	54,475,500
B I P R O G Y	62,300	3,045.00	189,703,500
兼松エレクトロニクス	10,900	4,155.00	45,289,500
都築電気	9,100	1,350.00	12,285,000
T B S ホールディングス	97,400	1,612.00	157,008,800
日本テレビホールディングス	166,400	1,186.00	197,350,400
朝日放送グループホールディングス	16,200	650.00	10,530,000
テレビ朝日ホールディングス	48,000	1,435.00	68,880,000
スカパーJ S A T ホールディングス	169,000	570.00	96,330,000
テレビ東京ホールディングス	12,400	1,980.00	24,552,000
日本BS放送	7,000	973.00	6,811,000
ビジョン	22,400	1,269.00	28,425,600
スマートバリュー	5,000	506.00	2,530,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	15,300	2,107.00	32,237,100
ワイヤレスゲート	9,000	281.00	2,529,000

コネクシオ	14,300	1,310.00	18,733,000
クロップス	3,900	947.00	3,693,300
日本電信電話	2,231,600	3,753.00	8,375,194,800
K D D I	1,451,500	4,214.00	6,116,621,000
ソフトバンク	3,015,700	1,504.50	4,537,120,650
光通信	23,000	17,440.00	401,120,000
エムティーアイ	15,900	492.00	7,822,800
GMOインターネット	62,900	2,517.00	158,319,300
ファイバーゲート	9,300	1,012.00	9,411,600
アイドママーケティングコミュニケーション	5,000	290.00	1,450,000
K A D O K A W A	107,300	2,944.00	315,891,200
学研ホールディングス	28,400	964.00	27,377,600
ゼンリン	32,800	936.00	30,700,800
昭文社ホールディングス	8,700	317.00	2,757,900
インプレスホールディングス	17,500	208.00	3,640,000
アイネット	9,400	1,329.00	12,492,600
松竹	11,400	12,180.00	138,852,000
東宝	117,500	5,230.00	614,525,000
東映	5,600	18,250.00	102,200,000
エヌ・ティ・ティ・データ	530,200	1,924.00	1,020,104,800
ピー・シー・エー	11,800	1,061.00	12,519,800
ビジネスブレイン太田昭和	6,800	1,524.00	10,363,200
D T S	37,200	3,460.00	128,712,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	92,700	5,960.00	552,492,000
シーイーシー	21,500	1,307.00	28,100,500
カブコン	187,800	3,685.00	692,043,000
アイ・エス・ビー	8,800	1,265.00	11,132,000
ジャステック	10,600	1,211.00	12,836,600
S C S K	137,900	2,206.00	304,207,400
N S W	7,600	2,288.00	17,388,800
アイネス	17,300	1,571.00	27,178,300
T K C	30,400	3,440.00	104,576,000
富士ソフト	19,100	8,150.00	155,665,000
N S D	62,500	2,419.00	151,187,500
コナミグループ	72,300	7,090.00	512,607,000
福井コンピュータホールディングス	9,200	3,650.00	33,580,000
J B C Cホールディングス	13,600	1,788.00	24,316,800
ミロク情報サービス	17,700	1,511.00	26,744,700
ソフトバンクグループ	1,193,900	5,496.00	6,561,674,400
高千穂交易	7,100	2,234.00	15,861,400
オルバヘルスケアホールディングス	3,300	1,528.00	5,042,400
伊藤忠食品	4,000	5,090.00	20,360,000



エレマテック	16,000	1,357.00	21,712,000
あらた	14,800	4,300.00	63,640,000
トーメンデバイス	3,000	5,510.00	16,530,000
東京エレクトロン デバイス	5,900	5,770.00	34,043,000
フィールズ	17,500	1,329.00	23,257,500
双日	205,000	2,320.00	475,600,000
アルフレッサ ホールディングス	207,300	1,644.00	340,801,200
横浜冷凍	48,600	922.00	44,809,200
ラサ商事	9,100	974.00	8,863,400
アルコニックス	25,400	1,418.00	36,017,200
神戸物産	137,900	3,570.00	492,303,000
ハイパー	3,800	441.00	1,675,800
あい ホールディングス	28,500	2,048.00	58,368,000
ディーブイエックス	6,800	927.00	6,303,600
ダイワボウホールディングス	85,000	1,930.00	164,050,000
マクニカホールディングス	47,700	2,907.00	138,663,900
ラクト・ジャパン	6,900	2,322.00	16,021,800
グリムス	8,900	1,766.00	15,717,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,900	668.00	21,309,200
八洲電機	14,500	1,013.00	14,688,500
メディアスホールディングス	11,400	805.00	9,177,000
レスターホールディングス	19,000	2,054.00	39,026,000
ジューテックホールディングス	3,900	1,100.00	4,290,000
大光	8,500	707.00	6,009,500
OCHIホールディングス	4,500	1,230.00	5,535,000
TOKAIホールディングス	96,800	887.00	85,861,600
黒谷	5,500	627.00	3,448,500
Cominix	3,500	721.00	2,523,500
三洋貿易	18,300	1,013.00	18,537,900
ビューティガレージ	3,200	2,876.00	9,203,200
ウイン・パートナーズ	14,500	991.00	14,369,500
ミタチ産業	5,100	774.00	3,947,400
シップヘルスケアホールディングス	57,700	2,532.00	146,096,400
明治電機工業	6,000	1,065.00	6,390,000
デリカフーズホールディングス	7,800	520.00	4,056,000
スターティアホールディングス	4,600	960.00	4,416,000
コメダホールディングス	43,600	2,308.00	100,628,800
ピーバンドットコム	2,900	509.00	1,476,100
アセンテック	6,900	628.00	4,333,200
富士興産	5,000	1,206.00	6,030,000
協栄産業	2,000	1,421.00	2,842,000
フルサト・マルカホールディングス	17,700	3,230.00	57,171,000

ヤマエグループホールディングス	11,200	1,660.00	18,592,000
小野建	17,900	1,483.00	26,545,700
南陽	3,800	1,891.00	7,185,800
佐島電機	12,500	1,166.00	14,575,000
エコートレーディング	4,300	573.00	2,463,900
伯東	11,700	3,260.00	38,142,000
コンドーテック	15,000	1,018.00	15,270,000
中山福	10,700	311.00	3,327,700
ナガイレーベン	24,100	2,037.00	49,091,700
三菱食品	19,200	3,385.00	64,992,000
松田産業	14,600	2,454.00	35,828,400
第一興商	37,900	3,935.00	149,136,500
メディパルホールディングス	184,900	1,913.00	353,713,700
S P K	7,900	1,399.00	11,052,100
萩原電気ホールディングス	6,800	2,325.00	15,810,000
アズワン	28,700	6,410.00	183,967,000
スズデン	6,300	2,058.00	12,965,400
尾家産業	4,700	875.00	4,112,500
シモジマ	12,300	1,082.00	13,308,600
ドウシシャ	18,900	1,525.00	28,822,500
小津産業	4,400	1,820.00	8,008,000
高速	10,600	1,503.00	15,931,800
たけびし	6,800	1,521.00	10,342,800
リックス	4,100	1,917.00	7,859,700
丸文	16,000	792.00	12,672,000
ハピネット	15,200	1,607.00	24,426,400
橋本総業ホールディングス	3,500	2,002.00	7,007,000
日本ライフライン	59,200	1,024.00	60,620,800
タカショー	15,600	711.00	11,091,600
I D O M	60,700	827.00	50,198,900
進和	11,800	2,255.00	26,609,000
エスケイジャパン	4,900	561.00	2,748,900
ダイトロン	7,000	2,073.00	14,511,000
シークス	25,400	1,064.00	27,025,600
田中商事	6,200	568.00	3,521,600
オーハシテクニカ	9,900	1,410.00	13,959,000
白銅	6,400	2,666.00	17,062,400
ダイコー通産	2,400	1,100.00	2,640,000
伊藤忠商事	1,198,000	3,835.00	4,594,330,000
丸紅	1,731,100	1,432.00	2,478,935,200
高島	2,900	2,556.00	7,412,400
長瀬産業	91,400	1,993.00	182,160,200

蝶理	11,200	2,033.00	22,769,600
豊田通商	178,400	4,885.00	871,484,000
三共生興	25,700	467.00	12,001,900
兼松	69,200	1,516.00	104,907,200
ツカモトコーポレーション	3,300	1,063.00	3,507,900
三井物産	1,448,500	3,259.00	4,720,661,500
日本紙パルプ商事	9,500	4,330.00	41,135,000
カメイ	21,400	1,094.00	23,411,600
東都水産	1,000	4,925.00	4,925,000
OUGホールディングス	2,900	2,937.00	8,517,300
スターゼン	13,500	2,104.00	28,404,000
山善	72,100	932.00	67,197,200
椿本興業	3,300	3,735.00	12,325,500
住友商事	1,182,400	1,950.00	2,305,680,000
内田洋行	7,900	4,895.00	38,670,500
三菱商事	1,310,200	4,528.00	5,932,585,600
第一実業	7,700	3,795.00	29,221,500
キャノンマーケティングジャパン	41,300	3,215.00	132,779,500
西華産業	8,600	1,644.00	14,138,400
佐藤商事	13,800	1,148.00	15,842,400
菱洋エレクトロ	11,800	2,252.00	26,573,600
東京産業	16,300	794.00	12,942,200
ユアサ商事	16,100	3,465.00	55,786,500
神鋼商事	4,500	4,185.00	18,832,500
トルク	10,800	202.00	2,181,600
阪和興業	34,700	3,495.00	121,276,500
正栄食品工業	11,900	4,005.00	47,659,500
カナデン	16,300	1,050.00	17,115,000
菱電商事	15,800	1,638.00	25,880,400
岩谷産業	44,300	5,570.00	246,751,000
ナイス	6,100	1,622.00	9,894,200
ニチモウ	2,400	2,522.00	6,052,800
極東貿易	5,700	2,704.00	15,412,800
アステナホールディングス	30,900	445.00	13,750,500
三愛オブリ	44,800	1,093.00	48,966,400
稲畑産業	40,000	2,435.00	97,400,000
G S I クレオス	9,600	1,548.00	14,860,800
明和産業	18,500	797.00	14,744,500
クワザワホールディングス	7,200	431.00	3,103,200
ワキタ	36,100	1,102.00	39,782,200
東邦ホールディングス	54,300	1,825.00	99,097,500
サンゲツ	48,500	1,669.00	80,946,500

ミツウロコグループホールディングス	23,000	1,001.00	23,023,000
シナネンホールディングス	6,600	3,830.00	25,278,000
伊藤忠エネクス	44,200	1,099.00	48,575,800
サンリオ	56,100	3,560.00	199,716,000
サンワテクノス	10,100	1,414.00	14,281,400
リョーサン	20,500	2,227.00	45,653,500
新光商事	26,400	978.00	25,819,200
トーホー	7,700	1,317.00	10,140,900
三信電気	8,200	1,674.00	13,726,800
東陽テクニカ	19,800	1,322.00	26,175,600
モスフードサービス	26,200	3,195.00	83,709,000
加賀電子	16,300	3,975.00	64,792,500
ソーダニッカ	16,000	611.00	9,776,000
立花エレテック	13,000	1,650.00	21,450,000
フォーバル	7,000	999.00	6,993,000
PALTAC	28,000	4,010.00	112,280,000
三谷産業	31,300	307.00	9,609,100
西本Wismettacホールディングス	4,500	3,865.00	17,392,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,800	1,620.00	2,916,000
コア商事ホールディングス	12,500	707.00	8,837,500
国際紙パルプ商事	37,000	708.00	26,196,000
ヤマタネ	8,600	1,613.00	13,871,800
丸紅建材リース	1,800	1,910.00	3,438,000
日鉄物産	12,200	5,410.00	66,002,000
泉州電業	4,500	5,480.00	24,660,000
トラスコ中山	37,400	1,966.00	73,528,400
オートバックスセブン	62,100	1,428.00	88,678,800
モリト	13,200	721.00	9,517,200
加藤産業	21,600	3,425.00	73,980,000
北恵	4,500	787.00	3,541,500
イノテック	12,100	1,364.00	16,504,400
イエローハット	31,500	1,828.00	57,582,000
JKホールディングス	14,100	1,032.00	14,551,200
日伝	13,600	1,892.00	25,731,200
北沢産業	10,700	209.00	2,236,300
杉本商事	9,400	1,991.00	18,715,400
因幡電機産業	49,800	2,748.00	136,850,400
東テク	6,000	3,600.00	21,600,000
ミスミグループ本社	250,900	3,440.00	863,096,000
アルテック	11,100	331.00	3,674,100
タキヒヨー	5,400	788.00	4,255,200
蔵王産業	3,900	1,792.00	6,988,800

スズケン	71,600	3,315.00	237,354,000
ジェコス	13,800	810.00	11,178,000
グローセル	21,700	414.00	8,983,800
ローソン	44,300	4,680.00	207,324,000
サンエー	13,700	4,225.00	57,882,500
カワチ薬品	15,700	2,128.00	33,409,600
エービーシー・マート	31,300	5,590.00	174,967,000
ハードオフコーポレーション	9,100	1,189.00	10,819,900
アスクル	43,200	1,780.00	76,896,000
ゲオホールディングス	24,300	1,623.00	39,438,900
アダストリア	21,700	1,962.00	42,575,400
くら寿司	21,000	3,275.00	68,775,000
キャンドウ	6,500	2,171.00	14,111,500
アイケイ	7,100	447.00	3,173,700
パルグループホールディングス	17,600	2,348.00	41,324,800
エディオン	92,000	1,208.00	111,136,000
サーラコーポレーション	37,900	832.00	31,532,800
ワッツ	10,100	740.00	7,474,000
ハローズ	9,200	3,135.00	28,842,000
フジオフードグループ本社	14,800	1,312.00	19,417,600
あみやき亭	4,900	2,904.00	14,229,600
大黒天物産	6,400	5,730.00	36,672,000
ハニーズホールディングス	16,100	1,234.00	19,867,400
ファーマライズホールディングス	4,800	683.00	3,278,400
アルペン	14,900	2,141.00	31,900,900
ハブ	7,100	562.00	3,990,200
クオールホールディングス	24,800	1,250.00	31,000,000
ジーンズホールディングス	10,700	4,250.00	45,475,000
ビックカメラ	118,800	1,144.00	135,907,200
DCMホールディングス	119,000	1,037.00	123,403,000
Monotaro	252,800	2,510.00	634,528,000
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	5,300	358.00	1,897,400
アーランドサービスホールディングス	14,800	2,075.00	30,710,000
J.フロント リテイリング	221,900	1,090.00	241,871,000
ドトール・日レスホールディングス	31,800	1,613.00	51,293,400
マツキヨココカラ&カンパニー	117,100	5,440.00	637,024,000
ブロンコビリー	9,600	2,383.00	22,876,800
ZOZO	137,500	3,080.00	423,500,000
トレジャー・ファクトリー	6,100	1,689.00	10,302,900
物語コーポレーション	10,000	7,010.00	70,100,000
三越伊勢丹ホールディングス	300,300	1,051.00	315,615,300

H a m e e	7,500	1,092.00	8,190,000
マーケットエンタープライズ	2,400	891.00	2,138,400
ウエルシアホールディングス	105,800	2,953.00	312,427,400
クリエイトSDホールディングス	29,600	3,125.00	92,500,000
丸善CHIホールディングス	24,300	363.00	8,820,900
ミサワ	4,600	604.00	2,778,400
ティーライフ	3,000	1,303.00	3,909,000
チムニー	6,100	1,212.00	7,393,200
シュッピン	16,700	1,232.00	20,574,400
オイシックス・ラ・大地	28,900	1,917.00	55,401,300
ネクステージ	40,700	3,045.00	123,931,500
ジョイフル本田	57,500	1,706.00	98,095,000
鳥貴族ホールディングス	6,700	2,156.00	14,445,200
ホットランド	13,900	1,312.00	18,236,800
すかいらーくホールディングス	243,900	1,528.00	372,679,200
SFPホールディングス	9,700	1,767.00	17,139,900
綿半ホールディングス	14,000	1,431.00	20,034,000
ヨシックスホールディングス	4,100	2,299.00	9,425,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	58,400	1,071.00	62,546,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,300	2,166.00	17,977,800
B E E N O S	10,200	2,398.00	24,459,600
あさひ	16,800	1,322.00	22,209,600
日本調剤	12,400	1,356.00	16,814,400
コスモス薬品	20,200	14,740.00	297,748,000
トーエル	9,100	844.00	7,680,400
セブン&アイ・ホールディングス	670,100	5,621.00	3,766,632,100
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	134,100	945.00	126,724,500
ツルハホールディングス	43,700	7,730.00	337,801,000
サンマルクホールディングス	16,000	1,621.00	25,936,000
フェリシモ	4,800	1,073.00	5,150,400
トリドールホールディングス	49,900	2,925.00	145,957,500
T O K Y O B A S E	19,400	344.00	6,673,600
ウイルプラスホールディングス	4,100	1,043.00	4,276,300
J Mホールディングス	15,400	1,570.00	24,178,000
サツドラホールディングス	9,500	639.00	6,070,500
アレンザホールディングス	13,700	1,025.00	14,042,500
串カツ田中ホールディングス	4,900	1,872.00	9,172,800
パロックジャパンリミテッド	14,300	812.00	11,611,600
クスリのアオキホールディングス	17,900	6,080.00	108,832,000
力の源ホールディングス	10,600	649.00	6,879,400

FOOD & LIFE COMPANIES	102,500	2,366.00	242,515,000	
メディカルシステムネットワーク	18,200	431.00	7,844,200	
はるやまホールディングス	10,200	434.00	4,426,800	
ノジマ	32,400	2,826.00	91,562,400	
カッパ・クリエイト	28,000	1,419.00	39,732,000	
ライトオン	14,900	723.00	10,772,700	
良品計画	230,200	1,286.00	296,037,200	
パリミキホールディングス	26,100	250.00	6,525,000	
アドヴァングループ	17,400	822.00	14,302,800	
アルビス	6,000	2,301.00	13,806,000	
コナカ	21,600	350.00	7,560,000	
ハウス オブ ローゼ	2,700	1,640.00	4,428,000	
G - 7ホールディングス	22,400	1,474.00	33,017,600	
イオン北海道	26,500	1,146.00	30,369,000	
コジマ	34,900	659.00	22,999,100	
ヒマラヤ	6,600	999.00	6,593,400	
コーナン商事	28,500	3,540.00	100,890,000	
エコス	6,800	1,884.00	12,811,200	
ワタミ	24,200	930.00	22,506,000	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	399,700	2,431.00	971,670,700	
西松屋チェーン	39,700	1,627.00	64,591,900	
ゼンショーホールディングス	97,700	3,585.00	350,254,500	
幸楽苑ホールディングス	11,600	1,140.00	13,224,000	
ハークスレイ	9,000	504.00	4,536,000	
サイゼリヤ	29,800	2,565.00	76,437,000	
V Tホールディングス	75,900	478.00	36,280,200	
魚力	5,700	2,415.00	13,765,500	
フジ・コーポレーション	10,900	1,241.00	13,526,900	
ユナイテッドアローズ	21,100	1,802.00	38,022,200	
ハイデイ日高	29,000	2,104.00	61,016,000	
YU - WA Creation Holdings	13,500	204.00	2,754,000	
コロワイド	82,100	1,894.00	155,497,400	
ピーシーデポコーポレーション	24,400	284.00	6,929,600	
壱番屋	14,200	4,605.00	65,391,000	
PLANT	5,100	658.00	3,355,800	
スギホールディングス	40,000	5,980.00	239,200,000	
薬王堂ホールディングス	10,100	2,314.00	23,371,400	
スクロール	31,200	784.00	24,460,800	
ヨンドシーホールディングス	17,100	1,825.00	31,207,500	
木曽路	27,100	2,186.00	59,240,600	

S R Sホールディングス	29,500	863.00	25,458,500
千趣会	33,700	389.00	13,109,300
リテールパートナーズ	26,700	1,119.00	29,877,300
ケーヨー	37,100	927.00	34,391,700
上新電機	19,600	1,947.00	38,161,200
日本瓦斯	95,700	2,215.00	211,975,500
ロイヤルホールディングス	34,000	2,171.00	73,814,000
いなげや	20,000	1,245.00	24,900,000
チヨダ	17,500	805.00	14,087,500
ライフコーポレーション	15,700	2,639.00	41,432,300
リンガーハット	23,000	2,251.00	51,773,000
MrMaxHD	25,500	627.00	15,988,500
AOKIホールディングス	39,200	683.00	26,773,600
オークワ	28,700	906.00	26,002,200
コメリ	31,000	2,626.00	81,406,000
青山商事	38,500	882.00	33,957,000
しまむら	23,300	12,590.00	293,347,000
はせがわ	11,700	371.00	4,340,700
高島屋	134,500	1,524.00	204,978,000
松屋	33,800	847.00	28,628,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	87,000	941.00	81,867,000
近鉄百貨店	5,900	2,261.00	13,339,900
丸井グループ	144,700	2,445.00	353,791,500
アクシアル リテイリング	13,400	3,435.00	46,029,000
イオン	659,200	2,707.50	1,784,784,000
イズミ	31,700	2,980.00	94,466,000
平和堂	29,900	1,983.00	59,291,700
フジ	43,900	1,967.00	86,351,300
ヤオコー	22,700	6,510.00	147,777,000
ゼビオホールディングス	27,500	969.00	26,647,500
ケーズホールディングス	170,400	1,284.00	218,793,600
Olympicグループ	9,400	597.00	5,611,800
日産東京販売ホールディングス	30,800	294.00	9,055,200
シルバーライフ	4,400	1,312.00	5,772,800
Genky DrugStores	8,900	3,600.00	32,040,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,900	854.00	4,184,600
ブックオフグループホールディングス	12,000	1,011.00	12,132,000
ギフトホールディングス	3,900	3,000.00	11,700,000
アインホールディングス	24,600	7,880.00	193,848,000
元気寿司	5,700	2,542.00	14,489,400
ヤマダホールディングス	707,700	477.00	337,572,900
アーランドサカモト	31,500	1,521.00	47,911,500



ニトリホールディングス	79,300	13,040.00	1,034,072,000	
グルメ杵屋	16,200	1,030.00	16,686,000	
愛眼	14,600	178.00	2,598,800	
ケーユーホールディングス	10,700	1,218.00	13,032,600	
吉野家ホールディングス	69,900	2,465.00	172,303,500	
松屋フーズホールディングス	9,700	3,825.00	37,102,500	
サガミホールディングス	28,900	1,196.00	34,564,400	
関西フードマーケット	16,400	1,215.00	19,926,000	
王将フードサービス	13,300	6,510.00	86,583,000	
プレナス	22,600	1,934.00	43,708,400	
ミニストップ	14,900	1,456.00	21,694,400	
アークス	35,600	2,080.00	74,048,000	
パローホールディングス	41,000	1,798.00	73,718,000	
ベルク	8,900	5,470.00	48,683,000	
大庄	11,000	1,164.00	12,804,000	
ファーストリテイリング	26,700	82,550.00	2,204,085,000	
サンドラッグ	75,300	3,440.00	259,032,000	
サックスパー ホールディングス	19,400	615.00	11,931,000	
ヤマザワ	4,400	1,381.00	6,076,400	
やまや	4,200	2,590.00	10,878,000	
ベルーナ	43,400	742.00	32,202,800	
島根銀行	6,400	476.00	3,046,400	
じもとホールディングス	13,200	555.00	7,326,000	
めぶきフィナンシャルグループ	823,200	265.00	218,148,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23,200	2,254.00	52,292,800	
九州フィナンシャルグループ	350,300	383.00	134,164,900	
ゆうちょ銀行	472,400	1,009.00	476,651,600	
富山第一銀行	44,500	423.00	18,823,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	990,500	444.00	439,782,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	105,000	755.00	79,275,000	
三十三フィナンシャルグループ	16,100	1,470.00	23,667,000	
第四北越フィナンシャルグループ	28,200	2,593.00	73,122,600	
ひろぎんホールディングス	255,800	618.00	158,084,400	
おきなわフィナンシャルグループ	16,900	2,182.00	36,875,800	
十六フィナンシャルグループ	23,300	2,468.00	57,504,400	
北國フィナンシャルホールディングス	16,500	4,935.00	81,427,500	
プロクレアホールディングス	20,300	2,176.00	44,172,800	
新生銀行	130,500	1,953.00	254,866,500	
あおぞら銀行	111,800	2,693.00	301,077,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,713,200	725.10	8,493,241,320	
りそなホールディングス	2,117,400	514.40	1,089,190,560	
三井住友トラスト・ホールディングス	331,000	4,356.00	1,441,836,000	

三井住友フィナンシャルグループ	1,298,600	4,189.00	5,439,835,400	
千葉銀行	565,100	752.00	424,955,200	
群馬銀行	321,900	394.00	126,828,600	
武蔵野銀行	25,600	1,710.00	43,776,000	
千葉興業銀行	43,100	261.00	11,249,100	
筑波銀行	78,000	196.00	15,288,000	
七十七銀行	53,100	1,771.00	94,040,100	
秋田銀行	12,000	1,656.00	19,872,000	
山形銀行	18,400	942.00	17,332,800	
岩手銀行	12,200	1,893.00	23,094,600	
東邦銀行	143,100	206.00	29,478,600	
東北銀行	9,000	972.00	8,748,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	144,500	2,471.00	357,059,500	
静岡銀行	412,400	814.00	335,693,600	
スルガ銀行	175,500	384.00	67,392,000	
八十二銀行	371,200	491.00	182,259,200	
山梨中央銀行	20,100	1,158.00	23,275,800	
大垣共立銀行	34,300	1,733.00	59,441,900	
福井銀行	16,000	1,403.00	22,448,000	
清水銀行	7,100	1,496.00	10,621,600	
富山銀行	3,100	1,774.00	5,499,400	
滋賀銀行	32,600	2,598.00	84,694,800	
南都銀行	27,000	1,976.00	53,352,000	
百五銀行	168,100	321.00	53,960,100	
京都銀行	62,100	5,460.00	339,066,000	
紀陽銀行	59,400	1,476.00	87,674,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	113,600	838.00	95,196,800	
山陰合同銀行	111,200	683.00	75,949,600	
中国銀行	140,800	953.00	134,182,400	
鳥取銀行	6,400	1,124.00	7,193,600	
伊予銀行	224,300	656.00	147,140,800	
百十四銀行	18,400	1,701.00	31,298,400	
四国銀行	26,300	853.00	22,433,900	
阿波銀行	26,600	1,928.00	51,284,800	
大分銀行	10,700	1,905.00	20,383,500	
宮崎銀行	10,800	2,206.00	23,824,800	
佐賀銀行	10,500	1,493.00	15,676,500	
琉球銀行	43,400	777.00	33,721,800	
セブン銀行	594,300	264.00	156,895,200	
みずほフィナンシャルグループ	2,399,300	1,584.50	3,801,690,850	
高知銀行	6,300	677.00	4,265,100	
山口フィナンシャルグループ	199,800	767.00	153,246,600	

長野銀行	6,100	1,282.00	7,820,200
名古屋銀行	12,200	3,115.00	38,003,000
北洋銀行	251,400	230.00	57,822,000
愛知銀行	6,200	5,820.00	36,084,000
中京銀行	6,200	1,863.00	11,550,600
大光銀行	5,900	1,348.00	7,953,200
愛媛銀行	26,100	859.00	22,419,900
トマト銀行	6,100	1,027.00	6,264,700
京葉銀行	83,500	486.00	40,581,000
栃木銀行	89,800	288.00	25,862,400
北日本銀行	5,800	1,661.00	9,633,800
東和銀行	32,800	527.00	17,285,600
福島銀行	21,200	219.00	4,642,800
大東銀行	8,800	638.00	5,614,400
トモニホールディングス	144,400	314.00	45,341,600
フィデアホールディングス	18,300	1,331.00	24,357,300
池田泉州ホールディングス	212,400	220.00	46,728,000
F P G	67,600	1,247.00	84,297,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,700	1,336.00	18,303,200
マーキュリアホールディングス	11,200	613.00	6,865,600
S B Iホールディングス	247,300	2,729.00	674,881,700
ジャフコ グループ	69,400	1,989.00	138,036,600
大和証券グループ本社	1,285,600	606.40	779,587,840
野村ホールディングス	3,055,800	501.20	1,531,566,960
岡三証券グループ	145,000	334.00	48,430,000
丸三証券	60,000	479.00	28,740,000
東洋証券	61,600	259.00	15,954,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	197,700	378.00	74,730,600
光世証券	4,800	448.00	2,150,400
水戸証券	50,000	268.00	13,400,000
いちよし証券	33,500	629.00	21,071,500
松井証券	98,300	796.00	78,246,800
マネックスグループ	169,000	483.00	81,627,000
極東証券	23,100	695.00	16,054,500
岩井コスモホールディングス	19,100	1,258.00	24,027,800
アイザワ証券グループ	27,300	646.00	17,635,800
マネーパートナーズグループ	22,300	248.00	5,530,400
スパークス・グループ	93,300	300.00	27,990,000
かんぽ生命保険	201,400	2,109.00	424,752,600
S O M P Oホールディングス	284,700	5,874.00	1,672,327,800
アニコム ホールディングス	61,500	650.00	39,975,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	411,400	4,135.00	1,701,139,000

第一生命ホールディングス	974,500	2,359.00	2,298,845,500
東京海上ホールディングス	556,800	7,550.00	4,203,840,000
T & Dホールディングス	445,200	1,472.00	655,334,400
アドバンスクリエイト	9,600	1,077.00	10,339,200
全国保証	47,900	4,585.00	219,621,500
あんしん保証	10,000	263.00	2,630,000
イントラスト	9,400	657.00	6,175,800
日本モーゲージサービス	11,700	947.00	11,079,900
C a s a	7,700	853.00	6,568,100
アルヒ	30,100	1,050.00	31,605,000
プレミアグループ	10,300	5,210.00	53,663,000
ネットプロテクションズホールディングス	61,700	510.00	31,467,000
クレディセゾン	117,200	1,763.00	206,623,600
芙蓉総合リース	17,300	8,190.00	141,687,000
みずほリース	24,900	3,380.00	84,162,000
東京センチュリー	31,100	4,930.00	153,323,000
日本証券金融	79,400	833.00	66,140,200
アイフル	337,500	386.00	130,275,000
リコーリース	17,900	3,615.00	64,708,500
イオンフィナンシャルサービス	109,300	1,440.00	157,392,000
アコム	396,700	332.00	131,704,400
ジャックス	20,100	3,845.00	77,284,500
オリエントコーポレーション	546,100	123.00	67,170,300
オリックス	1,189,200	2,260.00	2,687,592,000
三菱HCキャピタル	647,800	668.00	432,730,400
九州リースサービス	9,500	622.00	5,909,000
日本取引所グループ	466,400	2,072.00	966,380,800
イー・ギャランティ	30,000	2,275.00	68,250,000
アサックス	11,300	600.00	6,780,000
NECキャピタルソリューション	8,400	2,131.00	17,900,400
いちご	229,400	302.00	69,278,800
日本駐車場開発	209,100	158.00	33,037,800
スター・マイカ・ホールディングス	9,700	1,562.00	15,151,400
SREホールディングス	5,800	2,877.00	16,686,600
ADワークスグループ	44,600	157.00	7,002,200
ヒューリック	389,000	1,055.00	410,395,000
三栄建築設計	9,200	1,665.00	15,318,000
野村不動産ホールディングス	104,200	3,365.00	350,633,000
三重交通グループホールディングス	44,500	480.00	21,360,000
サムティ	27,300	2,188.00	59,732,400
ディア・ライフ	27,800	657.00	18,264,600
地主	13,600	2,010.00	27,336,000

プレサンスコーポレーション	23,000	1,512.00	34,776,000
ハウスコム	5,500	942.00	5,181,000
JPMC	10,200	1,001.00	10,210,200
サンセイランディック	7,600	829.00	6,300,400
フージャースホールディングス	25,600	805.00	20,608,000
オープンハウスグループ	64,000	5,310.00	339,840,000
東急不動産ホールディングス	547,000	738.00	403,686,000
飯田グループホールディングス	164,400	2,153.00	353,953,200
イーランド	4,100	1,509.00	6,186,900
ムゲンエステート	16,200	478.00	7,743,600
And Doホールディングス	9,900	865.00	8,563,500
シーアールイー	8,700	1,702.00	14,807,400
ケイアイスター不動産	9,400	4,890.00	45,966,000
グッドコムアセット	9,200	1,320.00	12,144,000
ジェイ・エス・ビー	4,700	3,450.00	16,215,000
ロードスターキャピタル	8,100	1,829.00	14,814,900
テンポイノベーション	7,700	914.00	7,037,800
フェイスネットワーク	3,900	1,408.00	5,491,200
パーク24	130,400	1,922.00	250,628,800
パラカ	6,800	1,990.00	13,532,000
三井不動産	781,600	2,798.50	2,187,307,600
三菱地所	1,140,600	1,866.50	2,128,929,900
平和不動産	32,300	3,970.00	128,231,000
東京建物	159,100	2,137.00	339,996,700
京阪神ビルディング	27,600	1,251.00	34,527,600
住友不動産	360,500	3,397.00	1,224,618,500
テーオーシー	32,400	728.00	23,587,200
東京楽天地	3,300	4,060.00	13,398,000
スターツコーポレーション	27,900	2,663.00	74,297,700
フジ住宅	26,100	656.00	17,121,600
空港施設	23,400	552.00	12,916,800
明和地所	12,400	617.00	7,650,800
ゴールドクレスト	16,900	1,751.00	29,591,900
エスリード	8,900	1,716.00	15,272,400
日神グループホールディングス	36,800	431.00	15,860,800
日本エスコン	37,300	798.00	29,765,400
タカラレーベン	83,800	378.00	31,676,400
AVANTIA	11,700	830.00	9,711,000
イオンモール	101,600	1,676.00	170,281,600
毎日コムネット	9,800	618.00	6,056,400
ファースト住建	9,100	1,134.00	10,319,400
カチタス	50,200	3,260.00	163,652,000

トーセイ	29,100	1,376.00	40,041,600
穴吹興産	5,300	2,082.00	11,034,600
サンフロンティア不動産	29,400	1,194.00	35,103,600
FJネクストホールディングス	21,400	1,035.00	22,149,000
インテリックス	4,500	558.00	2,511,000
ランドビジネス	6,700	243.00	1,628,100
サンネクスタグループ	8,000	972.00	7,776,000
グランディハウス	16,900	546.00	9,227,400
日本空港ビルデング	64,900	5,560.00	360,844,000
明豊ファシリティワークス	9,400	670.00	6,298,000
日本工営	12,400	3,570.00	44,268,000
LIFULL	61,300	173.00	10,604,900
ミクシィ	44,500	2,333.00	103,818,500
ジェイエシーリクルートメント	15,800	1,962.00	30,999,600
日本M&Aセンターホールディングス	318,200	1,719.00	546,985,800
メンバーズ	5,200	2,506.00	13,031,200
中広	4,000	407.00	1,628,000
UTグループ	28,100	2,766.00	77,724,600
アイティメディア	9,400	1,742.00	16,374,800
E・Jホールディングス	11,400	1,292.00	14,728,800
夢真ビーネックスグループ	63,500	1,635.00	103,822,500
コシダカホールディングス	52,300	815.00	42,624,500
アルトナー	5,100	936.00	4,773,600
パソナグループ	21,200	2,043.00	43,311,600
CDS	5,000	1,780.00	8,900,000
リンクアンドモチベーション	49,900	618.00	30,838,200
エス・エム・エス	66,000	3,125.00	206,250,000
サニーサイドアップグループ	7,200	631.00	4,543,200
パーソルホールディングス	194,000	2,732.00	530,008,000
リニカル	11,300	731.00	8,260,300
クックパッド	49,000	220.00	10,780,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	10,000	596.00	5,960,000
学情	8,200	1,132.00	9,282,400
スタジオアリス	8,800	2,267.00	19,949,600
シミックホールディングス	9,800	1,623.00	15,905,400
エプコ	4,600	650.00	2,990,000
NJS	4,000	2,038.00	8,152,000
総合警備保障	70,800	3,585.00	253,818,000
カカクコム	142,400	2,499.00	355,857,600
アイロムグループ	7,100	2,440.00	17,324,000
セントケア・ホールディング	13,000	872.00	11,336,000
サイネックス	3,900	595.00	2,320,500

ルネサンス	13,900	959.00	13,330,100
ディップ	34,200	3,610.00	123,462,000
デジタルホールディングス	13,800	1,306.00	18,022,800
新日本科学	23,800	2,291.00	54,525,800
キャリアデザインセンター	4,200	1,672.00	7,022,400
ベネフィット・ワン	70,400	2,017.00	141,996,800
エムスリー	342,200	4,461.00	1,526,554,200
ツカダ・グローバルホールディング	12,300	332.00	4,083,600
アウトソーシング	103,500	1,202.00	124,407,000
ウェルネット	17,900	492.00	8,806,800
ワールドホールディングス	7,900	2,713.00	21,432,700
ディー・エヌ・エー	74,000	1,903.00	140,822,000
博報堂D Yホールディングス	245,700	1,246.00	306,142,200
ぐるなび	29,100	430.00	12,513,000
タカミヤ	24,300	424.00	10,303,200
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	747.00	8,142,300
ファンコミュニケーションズ	34,800	411.00	14,302,800
ライク	6,600	2,224.00	14,678,400
ビジネス・ブレークスルー	8,000	415.00	3,320,000
エスプール	50,100	1,089.00	54,558,900
WDBホールディングス	9,000	2,509.00	22,581,000
ティア	12,100	439.00	5,311,900
C D G	2,300	1,272.00	2,925,600
アドウェイズ	24,300	751.00	18,249,300
バリューコマース	13,200	2,522.00	33,290,400
インフォマート	180,600	414.00	74,768,400
J Pホールディングス	51,200	252.00	12,902,400
エコナックホールディングス	37,300	88.00	3,282,400
C Lホールディングス	5,200	846.00	4,399,200
プレステージ・インターナショナル	73,200	636.00	46,555,200
アミューズ	10,700	1,933.00	20,683,100
ドリームインキュベータ	6,100	1,998.00	12,187,800
クイック	12,300	1,694.00	20,836,200
T A C	12,200	227.00	2,769,400
電通グループ	181,800	4,465.00	811,737,000
イオンファンタジー	7,600	3,375.00	25,650,000
シーティーエス	22,300	782.00	17,438,600
ネクシィーズグループ	6,600	571.00	3,768,600
H . U . グループホールディングス	50,800	2,907.00	147,675,600
アルプス技研	15,300	1,877.00	28,718,100
ダイオーズ	4,100	1,293.00	5,301,300
日本空調サービス	20,800	758.00	15,766,400

オリエンタルランド	206,200	20,100.00	4,144,620,000
ダスキン	41,900	2,874.00	120,420,600
明光ネットワークジャパン	23,400	614.00	14,367,600
ファルコホールディングス	8,700	1,833.00	15,947,100
ラウンドワン	54,300	1,976.00	107,296,800
リゾートトラスト	82,200	2,220.00	182,484,000
ビー・エム・エル	24,800	3,575.00	88,660,000
りらいあコミュニケーションズ	28,900	1,013.00	29,275,700
リソー教育	89,800	310.00	27,838,000
早稲田アカデミー	11,100	1,085.00	12,043,500
ユー・エス・エス	217,200	2,444.00	530,836,800
東京個別指導学院	17,700	576.00	10,195,200
サイバーエージェント	414,400	1,343.00	556,539,200
楽天グループ	800,500	667.00	533,933,500
クリーク・アンド・リバー社	10,300	2,434.00	25,070,200
モーニングスター	34,600	491.00	16,988,600
テー・オー・ダブリュー	38,200	307.00	11,727,400
山田コンサルティンググループ	10,300	1,248.00	12,854,400
セントラルスポーツ	7,400	2,511.00	18,581,400
フルキャストホールディングス	16,700	2,394.00	39,979,800
エン・ジャパン	34,600	2,310.00	79,926,000
リソルホールディングス	2,200	4,570.00	10,054,000
テクノプロ・ホールディングス	116,200	3,195.00	371,259,000
アトラグループ	4,300	189.00	812,700
インターワークス	6,500	403.00	2,619,500
アイ・アールジャパンホールディングス	9,100	2,239.00	20,374,900
Keeper 技研	12,600	3,940.00	49,644,000
ファーストロジック	3,500	780.00	2,730,000
三機サービス	3,700	965.00	3,570,500
Gunosy	11,100	747.00	8,291,700
デザインワン・ジャパン	7,700	180.00	1,386,000
イー・ガーディアン	6,700	2,983.00	19,986,100
リブセンス	10,000	276.00	2,760,000
ジャパンマテリアル	59,800	1,972.00	117,925,600
ベクトル	27,500	1,158.00	31,845,000
ウチヤマホールディングス	10,700	298.00	3,188,600
チャーム・ケア・コーポレーション	14,700	1,164.00	17,110,800
キャリアリンク	7,300	2,321.00	16,943,300
I B J	11,000	927.00	10,197,000
アサンテ	8,800	1,637.00	14,405,600
バリューHR	15,400	1,441.00	22,191,400
M&Aキャピタルパートナーズ	16,100	3,240.00	52,164,000



ライドオンエクスプレスホールディングス	7,800	1,215.00	9,477,000
E R Iホールディングス	5,800	1,009.00	5,852,200
アビスト	3,100	3,080.00	9,548,000
シグマクス・ホールディングス	23,600	1,237.00	29,193,200
ウィルグループ	14,700	1,355.00	19,918,500
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	22,400	157.00	3,516,800
メドピア	13,800	1,623.00	22,397,400
レアジョブ	4,200	733.00	3,078,600
リクルートホールディングス	1,388,900	4,397.00	6,106,993,300
エラン	23,200	1,102.00	25,566,400
土木管理総合試験所	9,200	319.00	2,934,800
ネットマーケティング	9,900	897.00	8,880,300
日本郵政	2,118,500	954.60	2,022,320,100
ベルシステム24ホールディングス	28,100	1,473.00	41,391,300
鎌倉新書	22,600	656.00	14,825,600
S M N	5,000	560.00	2,800,000
グローバルキッズCOMPANY	3,500	691.00	2,418,500
エアトリ	11,300	2,639.00	29,820,700
アトラエ	13,800	1,646.00	22,714,800
ストライク	8,600	3,850.00	33,110,000
ソラスト	48,100	829.00	39,874,900
セラク	6,400	1,101.00	7,046,400
インソース	21,600	2,759.00	59,594,400
ベイカレント・コンサルティング	13,700	40,700.00	557,590,000
Orchestra Holdings	3,800	2,643.00	10,043,400
アイモバイル	9,900	1,391.00	13,770,900
キャリアインデックス	7,300	445.00	3,248,500
MS - Japan	8,300	782.00	6,490,600
船場	3,800	745.00	2,831,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	61,700	1,815.00	111,985,500
フルテック	3,000	1,234.00	3,702,000
GameWith	6,600	391.00	2,580,600
MS&Consulting	3,400	619.00	2,104,600
ウェルビー	13,200	733.00	9,675,600
エル・ティー・エス	2,300	3,160.00	7,268,000
ミダックホールディングス	8,900	3,050.00	27,145,000
日総工産	15,700	575.00	9,027,500
キュービーネットホールディングス	9,200	1,387.00	12,760,400
R P Aホールディングス	28,500	314.00	8,949,000
スプリックス	7,000	1,087.00	7,609,000
マネジメントソリューションズ	9,600	2,945.00	28,272,000
プロレド・パートナーズ	4,900	517.00	2,533,300

テノ・ホールディングス	2,900	594.00	1,722,600	
フロンティア・マネジメント	6,000	1,388.00	8,328,000	
ピアラ	3,600	735.00	2,646,000	
コプロ・ホールディングス	4,200	929.00	3,901,800	
ギークス	3,700	905.00	3,348,500	
カーブスホールディングス	53,700	801.00	43,013,700	
フォーラムエンジニアリング	12,200	966.00	11,785,200	
Fast Fitness Japan	3,800	1,473.00	5,597,400	
ダイレクトマーケティングミックス	19,900	1,825.00	36,317,500	
ポピンズ	2,800	1,843.00	5,160,400	
LITALICO	15,800	2,855.00	45,109,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	10,500	487.00	5,113,500	
リログループ	106,200	2,190.00	232,578,000	
東祥	14,800	1,153.00	17,064,400	
ビーウィズ	5,400	1,395.00	7,533,000	
TREホールディングス	36,700	1,685.00	61,839,500	
人・夢・技術グループ	7,900	2,645.00	20,895,500	
エイチ・アイ・エス	45,500	2,057.00	93,593,500	
ラックランド	5,500	2,951.00	16,230,500	
共立メンテナンス	34,700	5,250.00	182,175,000	
イチネンホールディングス	20,200	1,255.00	25,351,000	
建設技術研究所	9,100	2,583.00	23,505,300	
スペース	13,000	853.00	11,089,000	
燦ホールディングス	8,600	1,797.00	15,454,200	
スバル興業	1,200	8,870.00	10,644,000	
東京テアトル	7,100	1,214.00	8,619,400	
タナベ経営	8,000	645.00	5,160,000	
ナガワ	5,500	8,010.00	44,055,000	
東京都競馬	14,600	4,205.00	61,393,000	
カナモト	31,900	2,135.00	68,106,500	
西尾レントオール	16,200	2,856.00	46,267,200	
トランス・コスモス	24,700	3,650.00	90,155,000	
乃村工藝社	83,500	931.00	77,738,500	
藤田観光	7,700	2,696.00	20,759,200	
KNT-CTホールディングス	12,100	1,684.00	20,376,400	
日本管財	20,900	2,651.00	55,405,900	
トーカイ	15,500	1,813.00	28,101,500	
セコム	191,100	8,760.00	1,674,036,000	
セントラル警備保障	9,500	2,537.00	24,101,500	
丹青社	37,100	799.00	29,642,900	
メイテック	69,200	2,436.00	168,571,200	
応用地質	17,000	1,783.00	30,311,000	

船井総研ホールディングス	36,500	2,352.00	85,848,000	
進学会ホールディングス	7,400	322.00	2,382,800	
オオバ	12,600	718.00	9,046,800	
いであ	4,500	1,725.00	7,762,500	
学究社	6,400	1,606.00	10,278,400	
ベネッセホールディングス	64,800	2,177.00	141,069,600	
イオンディライト	22,500	2,872.00	64,620,000	
ナック	9,600	944.00	9,062,400	
ダイセキ	35,400	4,150.00	146,910,000	
ステップ	7,300	1,782.00	13,008,600	
合 計	205,488,400		504,544,593,870	

## (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

項目	2022年 8月29日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		485,101,061
コール・ローン		3,664,455,763
国債証券		312,157,133,148
派生商品評価勘定		49,266,559
未収利息		1,724,964,267
前払金		42,544,428
前払費用		87,502,166
差入委託証拠金		628,564,833
流動資産合計		318,839,532,225
資産合計		318,839,532,225
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		49,174,112
未払金		13,138,976
未払解約金		58,656,346

	2022年 8月29日現在
項目	金額（円）
未払利息	6,131
流動負債合計	120,975,565
負債合計	120,975,565
純資産の部	
元本等	
元本	101,070,365,995
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	217,648,190,665
元本等合計	318,718,556,660
純資産合計	318,718,556,660
負債純資産合計	318,839,532,225

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
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>

	2022年 8月29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)

	2022年 8月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	101,070,365,995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 3.1534円 (1万口当たり純資産額) (31,534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

	2022年 8月29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（流動性リスク管理等を含む）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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月29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	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	96,783,804,165円
期中追加設定元本額	18,297,322,268円
期中一部解約元本額	14,010,760,438円
期末元本額	101,070,365,995円

区分	2022年 8月29日現在
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,291,300,129円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	558,678,321円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,195,881,811円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,422,538円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,320,796,928円
世界経済インデックスファンド	14,615,948,557円
D Cマイセレクション25	1,949,656,225円
D Cマイセレクション50	1,688,400,483円
D Cマイセレクション75	1,151,498,112円
D C外国債券インデックス・オープン	2,303,371,544円
D CマイセレクションS25	960,204,963円
D CマイセレクションS50	762,778,120円
D CマイセレクションS75	432,050,826円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	25,192,171円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	91,875,201円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	47,644,201円
D C世界経済インデックスファンド	13,053,032,035円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	599,636,890円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,727,388円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,321,326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）	21,643,631円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	41,756,194円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	68,363,691円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	73,376,503円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	67,730,491円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,208,142,631円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	422,938,457円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,695,784,232円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	68,548,875円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	37,357,331円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	422,511,901円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	162,296,603円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	206,607,175円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	735,049,745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）	2,744,514,685円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	688,811,698円
外国債券ファンド・シリーズ1	700,789,295円
コア投資戦略ファンド（安定型）	511,218,449円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,348,562,464円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円

区分	2022年 8月29日現在
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	568,367,383円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,155,426,751円
コア投資戦略ファンド（切替型）	617,085,545円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	252,004,718円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,077,493円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,359,309,029円
S M T インデックスバランス・オープン	197,880,957円
外国債券S M T Bセクション（S M A専用）	15,548,998,921円
S M T 世界経済インデックス・オープン	268,450,078円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	336,649,074円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	535,909,769円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,445,781円
グローバル経済コア	861,852,157円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	17,263,138円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	1,747,051円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	199,453,093円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,400,351円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	17,693,076円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	19,468,895円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	8,351,944円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,104,542円
M y S M T グローバル債券インデックス（ノーロード）	23,836,662円
10資産分散投資ファンド	7,886円
F O F s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）	260,145,149円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	11,030,504,775円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	331,579,538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）	301,479,729円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	360,230,834円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	997,961,657円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	89,594,351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）	73,315,485円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	9,258,095,615
合計	9,258,095,615

(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

（2022年 8月29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	4,318,669,263	-	4,276,124,835	42,544,428
	合計	4,318,669,263	-	4,276,124,835	42,544,428

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2022年 8月29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	4,373,499,569	-	4,416,136,444	42,636,875
	アメリカドル	2,465,672,107	-	2,511,930,600	46,258,493
	カナダドル	183,491,343	-	185,038,875	1,547,532
	ユーロ	1,485,438,608	-	1,481,878,099	3,560,509
	イギリスポンド	238,897,511	-	237,288,870	1,608,641
	合計	4,373,499,569	-	4,416,136,444	42,636,875

## (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	9,564,062.50	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,493,174.39	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,857,031.25	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,798,207.41	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,716,562.48	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,117,651.35	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,391,640.69	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,482,812.50	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,512,910.19	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,478,929.67	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,746,828.11	
		T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,609,765.64	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,816,210.97	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,262,781.26	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,599,316.42	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,228,437.52	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,668,320.33	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,386,250.00	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,521,840.99	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,794,453.12	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,716,796.90	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,210,187.50	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,932,812.48	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,723,320.32	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,622,343.76	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,075,664.08	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,705,575.00	
		T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,524,457.00	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,079,316.41	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,110,934.35	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,076,953.89	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,530,859.37	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,665,917.95	
		T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	10,005,000.00	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,207,812.48	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,912,898.43	
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,795,043.75			

T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,186,523.45	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,728,125.00	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,457,753.88	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,033,632.84	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,731,406.25	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,635,000.00	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,695,059.37	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,253,367.24	
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,254,156.25	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,293,437.52	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,445,234.36	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,424,363.33	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,449,109.39	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,950,054.68	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,040,800.76	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,157,812.48	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,183,106.25	
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	5,007,343.75	
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,049,809.00	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,630,171.87	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,182,187.52	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,440,039.06	
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,171,875.04	
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,505,097.68	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,466,464.86	
T 1.25% 08/15/31	19,380,000.00	16,684,968.75	
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,929,921.87	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,435,078.16	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,545,674.25	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,813,750.00	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,440,414.11	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,452,294.92	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,918,359.36	
T 1.375% 11/15/31	21,030,000.00	18,220,523.43	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,288,125.00	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,395,835.96	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,563,593.78	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,800,759.37	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,993,457.05	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,182,910.13	
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,443,531.27	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,774,609.37	

T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,639,628.88
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,134,598.04
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,960,957.08
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,134,062.50
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,451,367.20
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,618,546.86
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,800,890.62
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,469,113.29
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,502,656.28
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,330,765.61
T 1.75% 08/15/41	12,330,000.00	9,328,415.62
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,750,625.00
T 1.875% 02/15/32	8,020,000.00	7,251,834.37
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,154,593.75
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,895,859.40
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,770,000.00
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,917,727.72
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,827,617.18
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,884,906.25
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,166,289.08
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,581,562.48
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,007,064.43
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,259,082.02
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,090,872.67
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,448,125.00
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,690,687.48
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,877,148.45
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,639,433.59
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,937,968.76
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,565,779.27
T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,867,312.50
T 2.25% 03/31/24	5,900,000.00	5,796,404.31
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,225,488.30
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,872,714.87
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,357,762.50
T 2.25% 08/15/27	3,030,000.00	2,893,294.91
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,335,305.48
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,479,492.21
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,152,589.82
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,909,730.51
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,247,031.27
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,289,314.43
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,433,818.36

T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,262,890.65
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,638,046.87
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,675,962.52
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,661,125.00
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,515,906.25
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,237,925.83
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,620,764.06
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	6,816,074.24
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,907,128.90
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	3,433,109.37
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,427,438.29
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,897,265.65
T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,437,201.56
T 2.5% 02/15/46	6,450,000.00	5,404,394.56
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,786,591.78
T 2.5% 05/15/46	3,450,000.00	2,889,644.54
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,515,697.27
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,579,345.31
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,900,196.87
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,114,628.94
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,466,982.43
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,684,957.84
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,973,281.25
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,389,064.46
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,549,484.37
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,405,468.75
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	996,015.63
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,161,976.56
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,574,441.42
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,491,884.76
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,773,589.86
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,303,053.11
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,496,762.50
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,696,390.62
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,945,625.00
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,122,173.47
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,763,207.05
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	5,145,287.50
T 2.875% 05/15/52	1,800,000.00	1,684,265.63
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,767,176.58
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,382,152.35
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,845,121.88

T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,066,765.62
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,729,404.28
T 2.875% 10/31/23	7,900,000.00	7,858,185.53
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,250,781.25
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	3,996,131.25
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,384,570.35
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,185,710.97
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,843,750.00
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,093,232.06
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,232,745.12
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,366,474.63
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,619,513.68
T 2% 08/15/51	17,350,000.00	13,245,640.62
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,695,027.31
T 2% 11/15/41	8,200,000.00	6,485,687.50
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,002,914.06
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,890,468.76
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,667,319.56
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	3,889,982.83
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,358,656.29
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,674,394.54
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,949,800.00
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,330,226.58
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	800,980.47
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,445,562.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,042,343.76
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,096,875.00
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,120,234.39
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,558,863.28
T 3% 02/15/47	800,000.00	737,187.50
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,138,847.67
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,722,265.65
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,514,320.32
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,295,507.82
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,961,475.79
T 3% 08/15/48	7,250,000.00	6,781,015.62
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,153,898.44
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,943,359.40
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,572,281.26
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,024,945.31
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,651,093.75
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,157,031.25
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,185,742.19

	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,231,531.25
	T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,415,331.26
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,272,745.31
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	644,531.25
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,992,851.57
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,640,151.56
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	901,933.59
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,351,710.94
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,447,824.22
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,280,890.62
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,844,964.84
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,647,166.01
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,275,503.91
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,697,211.91
	アメリカドル 小計	1,273,310,000.00	1,168,852,521.31 (161,699,057,798)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,049,104.40
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,279,400.00
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,318,003.20
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,274,656.00
	CAN 0.5% 12/01/30	4,940,000.00	4,027,582.00
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,249,248.00
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	661,703.00
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,363,723.20
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,739,275.60
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,176,912.00
	CAN 1.5% 04/01/25	2,710,000.00	2,578,537.90
	CAN 1.5% 05/01/24	1,590,000.00	1,537,243.80
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,275,897.60
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,503,564.70
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,154,040.00
	CAN 1.5% 12/01/31	4,320,000.00	3,788,899.20
	CAN 1.75% 12/01/53	2,260,000.00	1,698,435.20
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	733,552.20
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,401,587.10
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,256,369.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,241,536.00
	CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	723,626.40
	CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	484,224.60
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,307,323.50
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	827,786.40
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,578,786.00

	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	716,915.60
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,234,321.30
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,179,150.30
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,402,529.40
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,808,270.50
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,134,189.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,192,674.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,187,239.20
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,193,126.40
	CAN 5% 06/01/37	880,000.00	1,081,740.00
	カナダドル 小計	68,410,000.00	63,361,172.70 (6,709,314,577)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,324,031.50
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,895,548.80
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,887,000.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	52,610,000.00	47,285,868.00
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,697,576.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,672,285.90
	MBONO 7.75% 05/29/31	42,690,000.00	39,715,787.70
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	25,328,433.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	8,110,228.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,340,000.00	36,572,663.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	25,576,263.30
	MBONO 8% 07/31/53	3,700,000.00	3,373,919.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,503,116.50
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	25,811,908.00
MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,405,169.10	
	メキシコペソ 小計	388,130,000.00	366,159,798.30 (2,523,829,641)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,207,709.80
	BGB 0.2% 10/22/23	630,000.00	625,218.30
	BGB 0.35% 06/22/32	1,330,000.00	1,132,468.40
	BGB 0.4% 06/22/40	1,010,000.00	706,888.90
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,404,195.40
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	308,377.60
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,653,762.80
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,641,159.00
	BGB 0.8% 06/22/28	1,460,000.00	1,402,330.00
	BGB 0.9% 06/22/29	2,430,000.00	2,314,599.30
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	722,943.00
	BGB 0% 10/22/31	1,830,000.00	1,539,707.10
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,394,280.00
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	781,882.50



BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	707,624.00
BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	1,024,103.60
BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,075,906.00
BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	981,330.00
BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,255,444.40
BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,931,103.00
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	786,086.40
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	709,816.80
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,202,659.20
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,443,468.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,112,915.00
BGB 4.25% 03/28/41	2,030,000.00	2,538,819.50
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,268,854.20
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,278,126.00
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,381,786.60
BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	2,974,801.60
BKO 0.2% 06/14/24	500,000.00	494,160.00
BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,829,206.00
BKO 0% 09/15/23	2,470,000.00	2,454,439.00
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,864,057.60
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,450,646.40
BTPS 0.3% 08/15/23	1,270,000.00	1,258,328.70
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	556,272.20
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,751,323.50
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,789,593.60
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	1,976,395.20
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,469,666.40
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	664,981.70
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,085,547.50
BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	3,111,836.70
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	709,073.40
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	2,006,952.00
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,861,135.70
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,176,343.40
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,710,844.40
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	978,410.00
BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,594,971.30
BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,526,997.80
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,919,240.00
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,334,977.40
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,445,550.00
BTPS 0% 11/29/23	1,750,000.00	1,717,800.00
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,766,803.00

BTPS 1.1% 04/01/27	1,000,000.00	929,510.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,847,469.00	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,693,523.00	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,313,913.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,250,228.00	
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,371,872.00	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	823,987.50	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,364,740.20	
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,741,619.10	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,790,229.00	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,228,596.00	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,089,009.60	
BTPS 1.75% 05/30/24	800,000.00	797,864.00	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	998,510.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,669,733.20	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,452,744.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,666,520.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,650,210.20	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,150,432.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	487,997.70	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	719,293.80	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,226,420.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,407,366.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,358,417.60	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,394,007.70	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,945,705.70	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	2,961,151.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,982,273.00	
BTPS 2.65% 12/01/27	960,000.00	946,569.60	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	1,836,974.10	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	895,830.10	
BTPS 2.8% 06/15/29	820,000.00	801,492.60	
BTPS 2.8% 12/01/28	2,720,000.00	2,691,956.80	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,580,000.00	1,429,710.40	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,164,040.40	
BTPS 2% 12/01/25	1,490,000.00	1,473,922.90	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,297,312.00	
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	898,876.80	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,970,000.00	1,811,572.60	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,754,407.20	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,000,304.80	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,043,952.00	

BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,227,679.50
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	1,861,971.60
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,152,943.80
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,866,215.00
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,228,886.40
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,766,508.00
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,883,111.20
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,395,092.00
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,675,741.00
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,465,390.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,055,658.80
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,698,152.00
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,920,958.00
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,347,694.90
BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,590,537.60
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,258,944.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,520,679.40
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,666,630.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	870,168.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,755,133.70
DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,903,793.20
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,490,715.20
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,049,015.20
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,949,480.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,552,414.40
DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,846,700.10
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,259,778.30
DBR 0% 02/15/31	3,280,000.00	2,952,623.20
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,230,206.20
DBR 0% 05/15/35	2,780,000.00	2,306,871.80
DBR 0% 05/15/36	3,130,000.00	2,551,889.00
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,177,087.50
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,223,675.00
DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,474,920.70
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	608,165.70
DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,899,219.90
DBR 0% 08/15/50	5,330,000.00	3,511,830.40
DBR 0% 08/15/52	1,790,000.00	1,142,485.40
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,790,540.00
DBR 0% 11/15/28	1,720,000.00	1,600,167.60
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,392,622.80
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,318,029.60
DBR 1.7% 08/15/32	350,000.00	360,108.00

DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,675,360.50	
DBR 1% 05/15/38	800,000.00	739,312.00	
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,004,540.00	
DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,643,712.80	
DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,981,297.60	
DBR 2.5% 08/15/46	3,610,000.00	4,343,876.90	
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,898,810.20	
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,899,691.30	
DBR 4.0% 01/04/37	3,190,000.00	4,209,651.60	
DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	3,009,161.50	
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,061,708.50	
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,088,735.30	
DBR 4.75% 07/04/40	2,260,000.00	3,385,706.00	
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,798,074.00	
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,901,077.20	
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,470,021.30	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,693,087.50	
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,225,548.80	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,462,614.00	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,485,411.10	
FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,490,704.90	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,950,000.00	5,531,239.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,356,396.80	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	451,638.00	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,342,044.00	
FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	2,058,001.50	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,019,089.70	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,980,000.00	2,563,438.40	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,660,000.00	1,673,485.80	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,566,041.00	
FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,794,031.00	
FRTR 0% 02/25/25	2,050,000.00	1,989,730.00	
FRTR 0% 02/25/26	4,460,000.00	4,266,346.80	
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,278,146.40	
FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,205,344.20	
FRTR 0% 03/25/25	5,490,000.00	5,324,751.00	
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,725,089.60	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,671,774.20	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,228,405.20	
FRTR 0% 11/25/31	5,790,000.00	4,893,244.80	
FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	3,983,354.30	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,535,484.30	

FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	6,043,576.70
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,916,480.10
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,443,366.40
FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	3,083,881.60
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,219,779.20
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,556,488.50
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,240,505.60
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,193,275.00
FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000.00	7,623,221.40
FRTR 2.75% 10/25/27	6,580,000.00	6,997,303.60
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,264,626.80
FRTR 2% 11/25/32	580,000.00	579,205.40
FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	3,887,526.00
FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	6,040,440.00
FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,878,373.00
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	5,958,264.00
FRTR 4.75% 04/25/35	3,540,000.00	4,550,280.60
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,218,842.00
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,761,327.80
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,140,213.50
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,432,152.10
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,855,137.40
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,179,813.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	877,334.10
IRISH 0.2% 10/18/30	960,000.00	844,291.20
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	398,860.80
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	489,945.90
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	362,680.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	741,109.60
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	714,000.00
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,156,416.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	620,560.70
IRISH 1.35% 03/18/31	790,000.00	762,926.70
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	642,528.00
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	764,912.40
IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,623,140.80
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,272,060.90
IRISH 2% 02/18/45	1,280,000.00	1,187,481.60
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,005,860.90
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,282,275.60
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,251,695.60
NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,443,709.20
NETHER 0.5% 01/15/40	1,780,000.00	1,420,867.20

NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,255,666.40
NETHER 0.5% 07/15/32	900,000.00	801,225.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,516,819.20
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,635,859.00
NETHER 0% 01/15/24	1,630,000.00	1,611,026.80
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,141,876.40
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,737,309.60
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,263,551.70
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	719,308.80
NETHER 0% 01/15/52	1,610,000.00	937,342.00
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,198,881.00
NETHER 0% 07/15/31	1,770,000.00	1,540,254.00
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,164,490.60
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,742,992.50
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,029,720.40
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,924,505.00
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,756,479.20
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,096,189.10
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,291,272.10
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,961,229.90
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,659,962.50
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,045,715.00
OBL 0% 10/09/26	3,900,000.00	3,729,804.00
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,396,015.00
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,499,611.20
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,363,728.00
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	459,612.00
RAGB 0.5% 02/20/29	1,810,000.00	1,679,390.40
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,045,746.00
RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	237,679.20
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,156,554.30
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	536,749.20
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,031,972.80
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	155,505.90
RAGB 0.9% 02/20/32	880,000.00	796,329.60
RAGB 0% 02/20/30	1,690,000.00	1,480,693.50
RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,400,215.60
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	900,453.90
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,411,804.80
RAGB 0% 10/20/28	200,000.00	180,346.00
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	444,719.20
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,069,443.60

RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	894,235.70
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	195,048.00
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,001,196.90
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,343,885.20
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	423,241.40
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	705,639.60
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,114,290.00
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	965,746.50
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	574,387.80
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,257,309.60
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,540,688.30
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,450,798.20
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	337,554.80
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	260,999.40
RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	463,752.00
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	355,010.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	603,408.80
RFGB 0.5% 04/15/43	440,000.00	314,380.00
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	829,466.70
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	609,693.50
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	701,525.60
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	734,488.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	683,424.30
RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	565,417.20
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	411,226.20
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	283,818.00
RFGB 0% 09/15/30	520,000.00	452,244.00
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	506,671.20
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	421,473.50
RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	470,037.40
RFGB 2.625% 07/04/42	680,000.00	720,487.20
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	587,400.00
RFGB 2% 04/15/24	660,000.00	672,540.00
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	897,470.70
SPGB 0.1% 04/30/31	2,700,000.00	2,230,200.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,245,619.80
SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	3,001,282.00
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,169,773.90
SPGB 0.6% 10/31/29	2,050,000.00	1,844,897.50
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,864,126.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,323,514.40
SPGB 0.8% 07/30/29	740,000.00	677,277.60
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,100,694.00

SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,205,580.80	
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,572,984.00	
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,442,064.00	
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,741,612.70	
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,068,601.80	
SPGB 0% 05/31/25	990,000.00	948,697.20	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	2,113,878.70	
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,823,995.00	
SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,190,712.50	
SPGB 1.4% 04/30/28	3,070,000.00	2,987,662.60	
SPGB 1.4% 07/30/28	3,030,000.00	2,936,463.90	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,590,792.80	
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	2,981,115.20	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	364,518.00	
SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,976,440.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,065,555.00	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,488,447.50	
SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	677,700.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	3,600,000.00	3,640,572.00	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,687,200.20	
SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	629,861.90	
SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	1,516,357.70	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,871,117.50	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,150,000.00	2,105,129.50	
SPGB 2.55% 10/31/32	1,350,000.00	1,345,680.00	
SPGB 2.7% 10/31/48	2,160,000.00	2,030,292.00	
SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,146,898.50	
SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,161,720.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,819,605.00	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,631,283.20	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,957,367.60	
SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,794,910.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,103,523.60	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	2,818,592.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	1,840,000.00	1,936,195.20	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,600,490.90	
SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	4,127,343.80	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,353,402.20	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,698,552.00	
SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,396,933.60	
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,303,837.50	
ユーロ 小計	779,510,000.00	766,694,613.30	



		(105,313,172,082)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,397,366.40
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,171,531.00
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	1,989,206.80
	UKT 0.25% 01/31/25	1,800,000.00	1,690,398.00
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,663,022.60
	UKT 0.375% 10/22/26	2,970,000.00	2,706,739.20
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,813,030.50
	UKT 0.5% 01/31/29	1,650,000.00	1,448,832.00
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	641,230.20
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,609,934.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,810,000.00	2,113,513.40
	UKT 0.625% 10/22/50	880,000.00	502,013.60
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	758,897.10
	UKT 0.875% 07/31/33	1,260,000.00	1,038,819.60
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,521,075.00
	UKT 1.125% 01/31/39	1,370,000.00	1,039,391.60
	UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	304,636.80
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	893,114.00
	UKT 1.25% 07/31/51	1,710,000.00	1,168,083.90
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,095,408.00
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,534,592.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,772,499.30
	UKT 1.5% 07/31/53	420,000.00	304,386.60
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	1,017,826.80
	UKT 1.625% 10/22/54	1,740,000.00	1,299,292.80
	UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	1,069,492.40
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,022,970.00
	UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,716,573.30
	UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,868,573.70
	UKT 1% 01/31/32	1,720,000.00	1,483,930.00
	UKT 1% 04/22/24	800,000.00	777,056.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,486,575.00
	UKT 2.5% 07/22/65	2,000,000.00	1,920,120.00
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,690,540.80
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,747,657.40
	UKT 3.25% 01/22/44	2,230,000.00	2,315,810.40
	UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,474,161.80
	UKT 3.5% 07/22/68	2,130,000.00	2,592,976.80
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	1,883,648.00
	UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	1,884,638.80
UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,397,780.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,891,463.40	

	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,479,093.10
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,060,817.50
	UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,335,776.00
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,880,236.90
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,502,462.90
	UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,839,553.30
	UKT 4.5% 12/07/42	2,050,000.00	2,516,867.00
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,704,126.60
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,034,994.50
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	1,992,251.80
	UKT 5% 03/07/25	2,300,000.00	2,424,752.00
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,499,475.00
	イギリスポンド 小計	95,890,000.00	91,989,215.60 (14,863,617,456)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,556,694.80
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	6,000,476.00
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	6,966,918.00
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,424,750.00
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,213,526.40
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,495,941.00
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,361,101.00
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,577,019.10
	スウェーデンクローナ 小計	62,510,000.00	61,596,426.30 (795,209,863)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,652,196.80
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,626,713.60
	NGB 1.5% 02/19/26	6,470,000.00	6,066,336.70
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,949,043.40
	NGB 1.75% 03/13/25	6,070,000.00	5,824,043.60
	NGB 1.75% 09/06/29	6,010,000.00	5,433,520.80
	NGB 2.125% 05/18/32	3,220,000.00	2,908,754.80
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,681,903.00
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,716,854.40
	ノルウェークローネ 小計	49,600,000.00	45,859,367.10 (647,534,263)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,880,000.00	3,772,137.60
	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,399,358.00
	DGB 0.5% 11/15/29	8,280,000.00	7,646,911.20
	DGB 0% 11/15/24	2,870,000.00	2,792,395.20
	DGB 0% 11/15/31	8,390,000.00	7,151,048.70
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,595,602.00
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,582,732.00

	DGB 4.5% 11/15/39	13,320,000.00	18,379,069.20	
デンマーククローネ 小計		60,650,000.00	61,319,253.90	(1,132,566,619)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,290,000.00	1,766,941.10	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,053,127.20	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,891,598.40	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,872,630.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	1,610,000.00	1,098,164.90	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,565,296.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,317,439.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,557,197.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,260,000.00	3,540,826.80	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,772,615.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,984,459.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,451,111.40	
	POLGB 3.75% 05/25/27	530,000.00	467,104.90	
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,338,278.40	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	582,552.00	
ポーランドズロチ 小計		53,580,000.00	45,259,342.30	(1,309,913,988)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,219,569.50	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,905,645.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,660,000.00	2,375,646.00	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,219,811.00	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,695,518.10	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,244,665.70	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,400,000.00	2,024,664.00	
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,882,765.50	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,929,536.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,390,978.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,620,000.00	3,374,310.60	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,374,328.20	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,376,730.60	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,079,676.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,870,884.10	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,596,372.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,343,433.90	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,560,588.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,172,786.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,035,540.80	
ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,609,291.80		
ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,438,819.20		
ACGB 3% 11/21/33	1,290,000.00	1,213,554.60		

	ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,198,202.60	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,490,087.60	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,457,924.00	
	オーストラリアドル 小計	56,000,000.00	51,081,329.80 (4,849,150,637)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	700,755.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	499,922.50	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	585,084.50	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	634,116.60	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	249,120.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,059,868.80	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	816,414.80	
	SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	933,269.60	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	394,899.10	
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	604,906.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	720,335.60	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	601,064.10	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	651,196.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,070,000.00	1,069,989.30	
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	673,526.40	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	864,685.70	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	763,761.40	
SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,600,350.90		
	シンガポールドル 小計	13,960,000.00	13,423,266.80 (1,327,963,784)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,510,000.00	1,366,459.40	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,927,507.20	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,497,920.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,597,411.20	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,830,000.00	1,686,582.90	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	939,058.20	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,715,501.70	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,636,516.50	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,389,988.30	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,498,605.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,139,424.20	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,989,837.90	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,144,486.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	606,660.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,171,698.40	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,300,275.20	
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,159,305.20	
MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,301,798.40		

	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,541,866.70
	MGS 4.254% 05/31/35	2,760,000.00	2,763,615.60
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,571,650.00
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,963,846.60
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,846,711.80
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,094,604.00
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,525,095.60
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,413,174.80
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,453,959.20
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,774,231.20
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,095,137.20
	マレーシアリングット 小計	53,680,000.00	54,112,928.40 (1,670,168,478)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	840,000.00	823,721.47
	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,010,000.00	962,974.80
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,047,449.87
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,289,147.69
	ILGOV 1.3% 04/30/32	590,000.00	515,946.02
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,970,000.00	1,608,921.45
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,207,637.33
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,208,002.91
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,494,370.49
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,954,750.32
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,664,574.00
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,154,526.50
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,334,721.71
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,837,663.10
ILGOV 6.25% 10/30/26	2,660,000.00	3,024,892.68	
	イスラエルシェケル 小計	31,020,000.00	31,129,300.34 (1,308,408,074)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,337,566.40
	CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,537,575.00
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,735,502.00
	CGB 2.47% 09/02/24	18,980,000.00	19,111,531.40
	CGB 2.48% 04/15/27	9,000,000.00	9,016,920.00
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,655,819.60
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,467,860.80
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,435,501.60
	CGB 2.75% 06/15/29	10,000,000.00	10,079,200.00
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,334,341.60
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,797,722.00
	CGB 2.85% 06/04/27	21,430,000.00	21,819,168.80

	CGB 2.89% 11/18/31	9,510,000.00	9,630,586.80	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,790,000.00	6,913,238.50	
	CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,203,140.70	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,201,884.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,921,050.80	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,151,331.50	
	CGB 3.28% 12/03/27	19,110,000.00	19,893,701.10	
	CGB 3.39% 03/16/50	10,420,000.00	10,795,224.20	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	7,976,417.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,627,374.80	
	CGB 3.81% 09/14/50	7,460,000.00	8,311,335.20	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,420,954.40	
	CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,758,270.30	
	オフショア人民元 小計	391,470,000.00	400,133,218.50 (8,007,225,888)	
	合計		312,157,133,148 (312,157,133,148)	

## 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 221銘柄	100.0%	51.8%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 353銘柄	100.0%	33.7%
イギリスポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	4.8%
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 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 25銘柄	100.0%	2.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 8月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	10,695,413,549
コール・ローン	1,017,956,769
株式	532,553,614,703
投資信託受益証券	298,607,150
投資証券	13,191,501,545
派生商品評価勘定	497,817,245
未収入金	2,741,429
未収配当金	858,659,369
差入委託証拠金	3,548,408,669
流動資産合計	562,664,720,428
資産合計	562,664,720,428
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	79,360,133
前受金	409,978,950
未払解約金	194,965,538
未払利息	1,703
流動負債合計	684,306,324
負債合計	684,306,324
純資産の部	
元本等	
元本	127,813,585,667
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	434,166,828,437
元本等合計	561,980,414,104
純資産合計	561,980,414,104
負債純資産合計	562,664,720,428

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 8月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	2022年 8月29日現在
	<p>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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</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>



	2022年 8月29日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 8月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	127,813,585,667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 4.3969円 (1万口当たり純資産額) (43,969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

	2022年 8月29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（流動性リスク管理等を含む）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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月29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	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	133,977,978,789円
期中追加設定元本額	17,028,831,619円
期中一部解約元本額	23,193,224,741円
期末元本額	127,813,585,667円

区分	2022年 8月29日現在
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン(資産成長型)	1,874,921,758円
S B I 資産設計オープン(分配型)	6,539,705円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	32,452,522,155円
世界経済インデックスファンド	11,114,926,446円
外国株式インデックス・オープン	886,305,095円
D C マイセレクション 2 5	798,746,038円
D C マイセレクション 5 0	3,650,489,537円
D C マイセレクション 7 5	4,381,672,820円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,971,580,419円
D C マイセレクション S 2 5	405,418,931円
D C マイセレクション S 5 0	1,861,389,519円
D C マイセレクション S 7 5	1,585,679,786円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	35,498,423円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	149,394,516円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	111,166,105円
D C 世界経済インデックスファンド	9,939,522,792円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,395,868,567円
マイセレクション 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	3,617,563円
マイセレクション 7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	4,723,159円
外国株式インデックス・オープン V A 1(適格機関投資家専用)	26,266,318円
バランス 3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	12,318,823円
バランス 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	50,530,039円
バランス 2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	11,368,951円
バランス 5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	31,477,956円
バランス A ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	261,872,034円
バランス B ( 3 7 . 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	169,393,045円
バランス C ( 5 0 ) V A 1(適格機関投資家専用)	1,242,072,986円
世界バランス V A 1(適格機関投資家専用)	104,489,403円
世界バランス V A 2(適格機関投資家専用)	24,375,793円
バランス D ( 3 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	158,446,855円
バランス E ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	52,543,813円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	989,546,670円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,089,982,275円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,135,745,517円
コア投資戦略ファンド(安定型)	560,233,098円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,362,981,916円
分散投資コア戦略ファンド A	1,498,580,570円
分散投資コア戦略ファンド S	8,213,245,075円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,329,977,197円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,116,285,606円
コア投資戦略ファンド(切替型)	598,401,219円

区分	2022年 8月29日現在
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	581,827,888円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,161,428円
SMT インデックスバランス・オープン	157,558,804円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	362,459,872円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	17,148,575,159円
SMT 世界経済インデックス・オープン	203,028,774円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	781,637,957円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	143,092,650円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,067,333円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	220,858,020円
グローバル経済コア	644,569,689円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,815,903円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,311,840円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	472,763,498円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,500,147円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	47,783,273円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	39,946,205円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	15,200,930円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	21,859,038円
10資産分散投資ファンド	18,092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）	263,272,399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）	31,761,258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）	892,368,551円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,295,260,634円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	214,059,209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）	84,904,553円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	66,702,080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）	66,662,894円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	236,402,277円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	226,303,448円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	225,149,556円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	228,989,512円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	225,426,645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2021-11（適格機関投資家専用）	112,167,658円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	14,769,136,160

投資信託受益証券	6,700,158
投資証券	601,326,009
合計	15,377,162,327

(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

(2022年 8月29日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	15,834,895,943	-	16,244,874,893	409,978,950
	合計	15,834,895,943	-	16,244,874,893	409,978,950

(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

(2022年 8月29日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,166,496,665	-	1,174,974,827	8,478,162
	アメリカドル	942,157,000	-	949,613,250	7,456,250
	カナダドル	13,764,270	-	13,763,347	923
	ユーロ	103,818,260	-	104,392,274	574,014
	イギリスポンド	50,055,935	-	50,085,956	30,021
	スイスフラン	56,701,200	-	57,120,000	418,800
	合計	1,166,496,665	-	1,174,974,827	8,478,162

(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	APA CORP	27,671	40.18	1,111,820.78	
	BAKER HUGHES CO	75,948	26.13	1,984,521.24	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	167.76	3,060,445.68	
	CHEVRON CORP	158,183	163.41	25,848,684.03	
	CONOCOPHILLIPS	105,873	112.12	11,870,480.76	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	30.87	1,975,680.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	72.77	3,657,129.12	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	133.93	1,776,849.31	
	EOG RESOURCES INC	47,936	124.57	5,971,387.52	
	EQT CORPORATION	27,026	49.67	1,342,381.42	
	EXXON MOBIL	343,717	97.87	33,639,582.79	
	HALLIBURTON CO	71,583	31.10	2,226,231.30	
	HESS CORP	22,781	124.60	2,838,512.60	
	KINDER MORGAN INC	168,208	18.99	3,194,269.92	
	MARATHON OIL CORP	57,281	26.16	1,498,470.96	
	MARATHON PETROLEUM CORP	45,012	104.34	4,696,552.08	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	74,379	73.55	5,470,575.45	
	ONEOK INC	35,533	64.84	2,303,959.72	
	PHILLIPS 66	38,237	92.18	3,524,686.66	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	257.38	4,690,493.12	
	SCHLUMBERGER	112,526	39.42	4,435,774.92	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	70.21	1,214,492.58	
	VALERO ENERGY CORP	32,597	121.88	3,972,922.36	
	WILLIAMS COS	98,553	35.03	3,452,311.59	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	262.23	4,599,776.43	
	ALBEMARLE CORP	9,440	288.16	2,720,230.40	
	ALCOA CORP	15,500	55.84	865,520.00	
	AMCOR PLC	126,534	12.42	1,571,552.28	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	188.78	1,253,121.64	
	BALL CORP	25,605	57.71	1,477,664.55	
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	113.89	977,403.98		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	118.35	1,955,970.45		
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	18.73	805,390.00		
CORTEVA INC	58,500	62.32	3,645,720.00		

CROWN HOLDINGS INC	9,940	92.12	915,672.80
DOW INC	60,585	54.46	3,299,459.10
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	57.82	2,369,463.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	95.04	1,052,568.00
ECOLAB INC	21,208	165.26	3,504,834.08
FMC CORP	10,507	113.92	1,196,957.44
FREEMPORT-MCMORAN INC	119,600	32.19	3,849,924.00
INT'L PAPER CO	30,800	42.62	1,312,696.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,024	114.22	2,401,361.28
LINDE PLC	41,706	286.25	11,938,342.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	21,835	86.87	1,896,806.45
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,192	351.74	1,826,234.08
MOSAIC CO/THE	27,732	61.77	1,713,005.64
NEWMONT CORPORATION	65,704	43.22	2,839,726.88
NUCOR CORP	22,299	140.51	3,133,232.49
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	138.94	1,068,031.78
PPG INDUSTRIES INC	19,278	126.04	2,429,799.12
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	94.86	991,856.16
SEALED AIR CORP	11,690	54.39	635,819.10
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	235.70	4,647,768.30
STEEL DYNAMICS INC	15,552	86.87	1,351,002.24
VULCAN MATERIALS CO	10,247	169.11	1,732,870.17
WESTLAKE CORP	4,100	106.97	438,577.00
WESTROCK CO	21,356	41.22	880,294.32
3 M COMPANY	46,618	129.14	6,020,248.52
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	45.59	501,717.95
ALLEGION PLC	7,601	97.66	742,313.66
AMETEK INC	18,006	122.66	2,208,615.96
BOEING CO	45,184	164.53	7,434,123.52
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	40.24	2,742,677.92
CATERPILLAR	43,701	191.92	8,387,095.92
CUMMINS INC	11,214	222.50	2,495,115.00
DEERE&CO	23,765	379.38	9,015,965.70
DOVER CORP	12,041	127.99	1,541,127.59
EATON CORP	32,650	141.08	4,606,262.00
EMERSON ELECTRIC CO	48,687	84.66	4,121,841.42
FASTENAL CO	44,846	50.96	2,285,352.16
FORTIVE CORP	28,348	64.74	1,835,249.52
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	62.94	648,911.40
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	234.88	1,223,959.68
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	232.59	4,412,232.30
GENERAL ELECTRIC CO	89,763	75.27	6,756,461.01

GRAINGER (WW) INC	3,667	566.24	2,076,402.08
HEICO CORP	3,640	155.89	567,439.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	126.28	814,379.72
HONEYWELL INTL INC	55,841	193.06	10,780,663.46
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	36.66	1,158,236.04
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	236.20	831,896.40
IDEX CORP	5,916	205.46	1,215,501.36
ILLINOIS TOOL WORKS	24,918	199.47	4,970,393.46
INGERSOLL-RAND INC	31,562	48.29	1,524,128.98
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	51.83	917,391.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	54.61	3,095,786.29
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	30.31	84,140.56
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	234.06	3,670,997.04
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	242.65	612,933.90
LOCKHEED MARTIN CORP	19,979	431.13	8,613,546.27
MASCO CORP	19,462	51.01	992,756.62
NORDSON CORP	4,121	232.83	959,492.43
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,122	485.13	5,880,745.86
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	75.23	2,547,137.34
OWENS CORNING	8,642	85.33	737,421.86
PACCAR INC	28,106	89.97	2,528,696.82
PARKER HANNIFIN CORP	10,579	276.20	2,921,919.80
PENTAIR PLC	14,533	46.18	671,133.94
PLUG POWER INC	41,884	28.94	1,212,122.96
QUANTA SERVICES INC	11,465	144.63	1,658,182.95
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	121,485	93.52	11,361,277.20
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	236.88	2,155,134.24
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	41.18	569,437.04
SMITH (A.O.) CORP	9,016	58.43	526,804.88
SNAP-ON INC	4,000	220.25	881,000.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	90.07	1,134,701.86
TEXTRON	16,934	64.62	1,094,275.08
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	155.57	2,899,513.66
TRANSDIGM GROUP INC	4,347	631.02	2,743,043.94
UNITED RENTALS INC	6,022	306.42	1,845,261.24
WABTEC CORP	15,024	90.44	1,358,770.56
XYLEM INC	15,077	92.97	1,401,708.69
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	96.91	1,101,285.24
CINTAS CORP	7,423	420.02	3,117,808.46
CLARIVATE PLC	27,357	12.07	330,198.99
COPART INC	16,617	122.37	2,033,422.29
COSTAR GROUP INC	32,116	70.32	2,258,397.12



EQUIFAX INC	9,509	197.13	1,874,509.17
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	127.56	1,359,917.16
LEIDOS HOLDINGS	11,220	97.20	1,090,584.00
REPUBLIC SERVICES INC	18,296	144.68	2,647,065.28
ROBERT HALF INTL INC	9,566	77.77	743,947.82
ROLLINS INC	17,468	34.48	602,296.64
TRANSUNION	15,741	77.64	1,222,131.24
VERISK ANALYTICS INC	13,315	189.89	2,528,385.35
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	139.64	2,970,841.00
WASTE MANAGEMENT INC	33,891	171.51	5,812,645.41
AMERCO	734	553.21	406,056.14
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	115.31	1,185,040.87
CSX CORP	179,261	32.63	5,849,286.43
DELTA AIR LINES INC	14,609	32.68	477,422.12
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	104.91	1,497,275.52
FEDEX CORP	20,314	218.16	4,431,702.24
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	3.05	253,183.55
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	182.59	1,287,624.68
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,697	52.99	725,804.03
LYFT INC-A	21,288	14.97	318,681.36
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	252.99	4,828,820.13
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	285.65	2,286,056.95
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	37.53	507,893.49
UBER TECHNOLOGIES INC	120,334	28.58	3,439,145.72
UNION PACIFIC CORP	51,838	231.27	11,988,574.26
UNITED PARCEL SERVICE B	59,627	198.93	11,861,599.11
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	41.05	294,533.75
APTIV PLC	22,415	94.55	2,119,338.25
BORGWARNER INC	19,781	37.97	751,084.57
FORD MOTOR COMPANY	321,972	15.41	4,961,588.52
GENERAL MOTORS CO	109,933	39.23	4,312,671.59
LEAR CORP	5,287	139.22	736,056.14
LUCID GROUP INC	31,234	16.24	507,240.16
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	32.11	429,085.93
TESLA INC	213,777	288.09	61,587,015.93
DR HORTON INC	27,764	72.81	2,021,496.84
GARMIN LTD	12,854	91.45	1,175,498.30
HASBRO INC	10,572	80.44	850,411.68
LENNAR CORP-CL A	20,844	80.33	1,674,398.52
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	311.31	2,896,739.55
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	109.55	456,056.65
NEWELL BRANDS INC	31,461	19.56	615,377.16

NIKE B	103,874	108.28	11,247,476.72
NVR INC	247	4,224.99	1,043,572.53
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	10.61	230,618.96
PULTE GROUP INC	21,609	41.04	886,833.36
VF CORP	25,718	41.16	1,058,552.88
WHIRLPOOL CORP	5,220	159.33	831,702.60
AIRBNB INC-CLASS A	26,610	112.82	3,002,140.20
ARAMARK	20,955	35.42	742,226.10
BOOKING HOLDINGS INC	3,339	1,910.96	6,380,695.44
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	44.31	778,083.60
CARNIVAL CORPORATION	84,361	9.97	841,079.17
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,303	1,627.86	3,748,961.58
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	124.97	1,338,678.64
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	390.28	1,111,517.44
EXPEDIA GROUP INC	11,638	103.41	1,203,485.58
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	131.09	2,867,987.02
LAS VEGAS SANDS CORP	29,096	37.93	1,103,611.28
MARRIOTT INTL A	22,091	156.69	3,461,438.79
MCDONALD'S CORP	60,458	256.95	15,534,683.10
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	33.58	969,588.92
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	42.30	709,244.10
STARBUCKS CORP	93,796	84.06	7,884,491.76
VAIL RESORTS INC	3,014	229.00	690,206.00
WYNN RESORTS LTD	9,302	62.33	579,793.66
YUM BRANDS INC	22,637	112.16	2,538,965.92
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	78.63	4,846,989.09
ALPHABET INC-CL A	487,975	110.34	53,843,161.50
ALPHABET INC-CL C	460,933	111.30	51,301,842.90
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	9.17	351,119.30
CABLE ONE INC	445	1,192.46	530,644.70
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	425.77	4,176,377.93
COMCAST CORP-CL A	367,926	36.80	13,539,676.80
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	17.61	354,524.52
ELECTRONIC ARTS INC	23,158	132.17	3,060,792.86
FOX CORP - CLASS A	27,658	34.24	947,009.92
FOX CORP- CLASS B	10,345	31.72	328,143.40
IAC INC	6,721	64.90	436,192.90
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	28.54	965,622.36
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	104.83	1,181,224.44
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	68.48	1,053,153.92
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	42.18	572,973.12
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	42.36	270,426.24

LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	91.80	1,133,087.40
MATCH GROUP INC	22,730	57.87	1,315,385.10
META PLATFORMS INC-CLASS A	187,450	161.78	30,325,661.00
NETFLIX INC	36,196	223.28	8,081,842.88
NEWS CORP-CLASS A	33,479	17.35	580,860.65
OMNICOM GROUP	16,538	68.45	1,132,026.10
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	24.90	1,209,791.40
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	23.08	1,056,302.36
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	39.56	1,110,014.04
ROKU INC	9,122	68.32	623,215.04
SEA LTD-ADR	28,338	63.82	1,808,531.16
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.17	373,087.56
SNAP INC - A	83,375	10.67	889,611.25
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	127.47	1,640,156.49
THE WALT DISNEY CO	148,022	114.07	16,884,869.54
TWITTER INC	63,066	40.46	2,551,650.36
WARNER BROS DISCOVERY INC	175,398	13.16	2,308,237.68
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	46.10	1,011,203.50
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	173.59	924,193.16
AMAZON.COM	742,757	130.75	97,115,477.75
AUTOZONE INC	1,639	2,163.02	3,545,189.78
BATH & BODY WORKS INC	19,806	36.83	729,454.98
BEST BUY COMPANY INC	18,175	74.15	1,347,676.25
BURLINGTON STORES INC	5,108	144.81	739,689.48
CARMAX INC	13,591	90.00	1,223,190.00
CARVANA CO	5,700	35.54	202,578.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	38.10	262,051.80
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	236.32	4,415,875.52
DOLLAR TREE INC	17,931	138.70	2,487,029.70
DOORDASH INC - A	15,171	61.66	935,443.86
EBAY	46,820	44.53	2,084,894.60
ETSY INC	10,294	104.25	1,073,149.50
GENUINE PARTS CO	11,319	156.42	1,770,517.98
HOME DEPOT	84,800	298.10	25,278,880.00
LKQ CORP	22,779	53.99	1,229,838.21
LOWES COMPANIES	54,553	200.99	10,964,607.47
MERCADOLIBRE INC	3,725	877.80	3,269,805.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	698.79	3,778,357.53
POOL CORP	3,304	352.75	1,165,486.00
ROSS STORES INC	28,076	87.26	2,449,911.76
TARGET (DAYTON HUDSON)	39,126	160.62	6,284,418.12
TJX COMPANIES INC	97,454	62.89	6,128,882.06

TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	191.06	1,704,637.32
ULTA BEAUTY INC	4,315	411.47	1,775,493.05
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	53.48	320,880.00
COSTCO WHOLESALE CORP	36,032	531.82	19,162,538.24
KROGER CO	56,126	48.38	2,715,375.88
SYSCO CORP	40,288	83.63	3,369,285.44
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	36.00	2,151,612.00
WALMART INC	124,048	131.60	16,324,716.80
ALTRIA GROUP INC	148,393	45.88	6,808,270.84
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,772	89.56	4,009,780.32
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	75.75	1,818,454.50
BUNGE LIMITED	11,604	102.32	1,187,321.28
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	50.69	804,399.61
COCA-COLA CO	334,608	63.11	21,117,110.88
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	49.37	760,078.75
CONAGRA BRANDS INC	40,304	34.91	1,407,012.64
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	251.90	3,259,586.00
GENERAL MILLS INC	49,534	76.32	3,780,434.88
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	228.67	2,748,384.73
HORMEL FOODS CORP	23,338	51.08	1,192,105.04
JM SMUCKER CO	9,145	141.59	1,294,840.55
KELLOGG CO	21,630	73.85	1,597,375.50
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	38.62	2,400,426.10
KRAFT HEINZ CO/THE	58,511	38.11	2,229,854.21
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	86.60	1,800,414.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	53.87	790,219.03
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	113,286	62.73	7,106,430.78
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	89.15	2,876,603.05
PEPSICO INC	112,413	175.04	19,676,771.52
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	126,117	96.55	12,176,596.35
TYSON FOODS INC	23,306	78.31	1,825,092.86
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	85.30	1,650,213.80
CLOROX COMPANY	9,570	144.73	1,385,066.10
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	79.21	5,052,647.48
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,016	261.88	4,979,910.08
KIMBERLY-CLARK CORP	26,841	129.52	3,476,446.32
PROCTER & GAMBLE CO	194,633	142.29	27,694,329.57
ABBOTT LABORATORIES	143,383	101.90	14,610,727.70
ABIOMED INC	3,781	258.12	975,951.72
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	252.45	1,500,310.35
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	146.19	1,885,266.24
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	57.17	2,287,543.21

BECTON DICKINSON & CO	23,274	253.73	5,905,312.02
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,818	40.52	4,733,465.36
CARDINAL HEALTH	21,902	67.60	1,480,575.20
CENTENE CORP	46,422	89.94	4,175,194.68
CIGNA CORP	26,188	284.87	7,460,175.56
CVS HEALTH CORP	106,862	100.06	10,692,611.72
DAVITA INC	4,627	88.65	410,183.55
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	33.61	597,384.14
DEXCOM INC	30,588	84.49	2,584,380.12
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,627	91.24	4,527,967.48
ELEVANCE HEALTH INC	19,661	483.48	9,505,700.28
HCA HEALTHCARE INC	19,440	204.98	3,984,811.20
HENRY SCHEIN INC	11,747	73.39	862,112.33
HOLOGIC INC	19,018	67.71	1,287,708.78
HUMANA INC	10,365	486.71	5,044,749.15
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	349.90	2,362,174.90
INSULET CORP	5,311	267.17	1,418,939.87
INTUITIVE SURGICAL INC	29,197	211.09	6,163,194.73
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	229.16	1,740,470.20
MASIMO CORP	4,147	151.79	629,473.13
MCKESSON CORP	12,089	356.79	4,313,234.31
MEDTRONIC PLC	109,343	89.43	9,778,544.49
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	338.51	1,538,527.95
NOVOCURE LTD	7,933	82.77	656,614.41
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	127.10	1,271,635.50
RESMED INC	11,440	221.15	2,529,956.00
STERIS PLC	8,018	200.99	1,611,537.82
STRYKER CORP	27,055	207.00	5,600,385.00
TELADOC HEALTH INC	11,375	32.10	365,137.50
TELEFLEX INC	3,934	224.14	881,766.76
THE COOPER COS INC	4,134	296.57	1,226,020.38
UNITEDHEALTH GROUP INC	76,357	529.25	40,411,942.25
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	101.47	619,169.94
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	206.49	2,324,044.95
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	107.51	1,750,370.31
ABBVIE INC	143,718	136.35	19,595,949.30
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	129.87	3,088,957.95
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	210.94	2,034,094.42
AMGEN	45,347	240.65	10,912,755.55
AVANTOR INC	48,633	25.55	1,242,573.15
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	495.28	917,753.84
BIO-TECHNE CORP	3,245	338.74	1,099,211.30

BIOGEN INC	11,860	198.59	2,355,277.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	91.01	1,345,400.83
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	177,351	71.19	12,625,617.69
CATALENT INC	13,739	99.70	1,369,778.30
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	204.81	861,021.24
DANAHER CORP	55,252	280.33	15,488,793.16
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	15.38	554,618.18
EXACT SCIENCES CORP	14,756	36.91	544,643.96
GILEAD SCIENCES INC	99,836	62.37	6,226,771.32
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	61.00	1,093,486.00
ILLUMINA INC	12,506	205.37	2,568,357.22
INCYTE CORP	15,212	71.48	1,087,353.76
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	219.67	3,322,728.42
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	155.87	774,829.77
JOHNSON & JOHNSON	213,402	164.27	35,055,546.54
LILLY (ELI) & CO	65,773	315.56	20,755,327.88
MERCK & CO	205,447	89.26	18,338,199.22
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,251.91	2,263,453.28
MODERNA INC	27,309	136.70	3,733,140.30
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	104.87	888,668.38
PERKINELMER INC	10,545	137.57	1,450,675.65
PFIZER	456,781	46.82	21,386,486.42
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,497	596.18	5,065,741.46
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	43.05	1,124,810.40
SEAGEN INC	10,981	155.01	1,702,164.81
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.59	771,045.59
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,791	563.71	17,920,904.61
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,811	281.68	5,862,042.48
VIATRIS INC	90,748	9.88	896,590.24
WATERS CORP	4,749	300.81	1,428,546.69
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	303.77	1,751,841.59
ZOETIS INC	38,534	159.89	6,161,201.26
BANK OF AMERICA CORP	591,261	34.03	20,120,611.83
CITIGROUP	161,792	49.78	8,054,005.76
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	37.26	1,472,589.72
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	34.95	1,845,464.85
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	813.77	773,081.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	155.64	2,145,808.68
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.64	1,556,487.68
JPMORGAN CHASE & CO	240,076	114.67	27,529,514.92
KEY CORP	71,472	18.43	1,317,228.96
M & T BANK CORP	14,037	184.02	2,583,088.74

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,513	162.19	5,597,663.47
REGIONS FINL CORP	79,314	21.97	1,742,528.58
SIGNATURE BANK	4,686	181.14	848,822.04
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	410.56	1,865,995.20
TRUIST FINANCIAL CORP	105,758	48.19	5,096,478.02
US BANCORP	112,247	46.49	5,218,363.03
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	48.04	685,674.92
WELLS FARGO & CO	310,526	43.97	13,653,828.22
ALLY FINANCIAL INC	27,761	34.39	954,700.79
AMERICAN EXPRESS	52,626	157.31	8,278,596.06
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	274.84	2,391,657.68
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	56.37	1,795,609.98
BANK NEW YORK CO	61,254	42.00	2,572,668.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,127	289.96	30,482,624.92
BLACKROCK INC	12,394	676.44	8,383,797.36
BLACKSTONE INC	57,841	98.55	5,700,230.55
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	109.82	3,652,173.92
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	33.09	518,487.21
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	120.35	1,068,106.25
CME GROUP INC	29,373	196.35	5,767,388.55
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	66.74	639,102.24
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	102.70	2,403,488.10
EQUITABLE HOLDINGS INC	34,355	30.38	1,043,704.90
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	445.12	1,401,237.76
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	26.49	690,594.30
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	46.34	200,003.44
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,736	336.40	9,330,390.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	103.59	4,630,783.77
INVESCO LTD	26,420	17.26	456,009.20
KKR & CO INC	44,282	51.63	2,286,279.66
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	226.16	1,444,257.76
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	244.95	785,554.65
MOODY'S CORP	13,365	292.91	3,914,742.15
MORGAN STANLEY	108,856	86.81	9,449,789.36
MSCI INC	6,518	456.42	2,974,945.56
NASDAQ INC	9,657	182.07	1,758,249.99
NORTHERN TRUST CORP	15,902	95.40	1,517,050.80
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	119.68	2,143,109.76
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	106.78	1,653,595.08
S&P GLOBAL INC	28,938	364.06	10,535,168.28
SCHWAB (CHARLES) CORP	118,155	71.89	8,494,162.95
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	54.53	520,761.50

STATE STREET CORP	30,359	69.13	2,098,717.67
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	33.65	1,398,695.90
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	70.49	638,709.89
UPSTART HOLDINGS INC	3,148	25.21	79,361.08
AFLAC	50,591	60.87	3,079,474.17
ALLEGHANY CORP	1,080	841.21	908,506.80
ALLSTATE CORP	22,174	125.05	2,772,858.70
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	131.71	832,275.49
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	53.00	3,492,594.00
AON PLC	17,038	285.87	4,870,653.06
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	46.50	1,382,259.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	187.70	3,070,584.30
ASSURANT INC	4,726	161.55	763,485.30
BROWN & BROWN INC	19,873	65.09	1,293,533.57
CHUBB LTD	34,810	193.51	6,736,083.10
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	100.83	1,289,716.53
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	217.70	471,538.20
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	272.92	897,360.96
FNF GROUP	20,461	40.27	823,964.47
GLOBE LIFE INC	8,106	98.76	800,548.56
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	66.20	1,835,130.20
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	47.57	641,433.88
LOEWS CORP	16,741	56.80	950,888.80
MARKEL CORP	1,156	1,219.68	1,409,950.08
MARSH & MCLENNAN COS	41,045	165.96	6,811,828.20
METLIFE INC	57,127	65.68	3,752,101.36
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	76.61	1,587,282.59
PROGRESSIVE CORP	48,534	125.16	6,074,515.44
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,511	98.52	2,907,423.72
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	166.84	3,298,760.48
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,385	207.81	1,950,296.85
WR BERKLEY CORP	17,572	66.54	1,169,240.88
CBRE GROUP INC-A	27,714	80.43	2,229,037.02
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.89	482,643.00
WEYERHAEUSER CO	58,295	35.38	2,062,477.10
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	34.06	457,323.62
ACCENTURE PLC-CL A	51,384	298.13	15,319,111.92
ADOBE INC	38,347	381.02	14,610,973.94
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	24.57	314,889.12
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	92.04	1,258,462.92
ANSYS INC	6,794	254.31	1,727,782.14
APPROVIN CORP-CLASS A	10,000	25.75	257,500.00



AUTODESK INC	17,467	207.77	3,629,118.59
AUTOMATIC DATA PROCESS	34,246	250.48	8,577,938.08
AVALARA INC	6,847	91.82	628,691.54
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	37.29	521,910.84
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	167.66	1,247,893.38
BLACK KNIGHT INC	11,543	67.23	776,035.89
BLOCK INC	41,288	68.87	2,843,504.56
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	173.99	1,695,010.58
CADENCE DESIGN SYSTEMS	22,740	177.83	4,043,854.20
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	61.21	652,988.28
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	121.68	988,528.32
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	102.45	1,069,987.80
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	64.39	1,306,022.37
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,220	64.70	2,796,334.00
COUPA SOFTWARE INC	6,059	58.65	355,360.35
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,760	194.56	3,066,265.60
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	148.25	459,575.00
DATADOG INC - CLASS A	18,646	106.73	1,990,087.58
DOCUSIGN INC	14,969	58.02	868,501.38
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	22.05	508,649.40
DYNATRACE INC	14,790	38.16	564,386.40
EPAM SYSTEMS INC	4,403	422.57	1,860,575.71
FAIR ISAAC CORP	2,125	476.85	1,013,306.25
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	49,912	93.09	4,646,308.08
FISERV INC	49,921	103.83	5,183,297.43
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	221.38	1,328,722.76
FORTINET INC	56,318	49.57	2,791,683.26
GARTNER INC	6,340	294.95	1,869,983.00
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	125.13	2,823,808.71
GODADDY INC - CLASS A	13,798	77.73	1,072,518.54
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	72.25	456,475.50
HUBSPOT INC	3,646	335.33	1,222,613.18
INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,262	130.38	9,551,899.56
INTUIT INC	21,909	448.46	9,825,310.14
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	197.47	1,242,283.77
MASTERCARD INC-CLASS A	70,879	331.96	23,528,992.84
MICROSOFT CORP	577,361	268.09	154,784,710.49
MONGODB INC	5,325	353.57	1,882,760.25
NORTONLIFELOCK INC	43,549	22.70	988,562.30
OKTA INC	11,505	93.48	1,075,487.40
ORACLE CORP	130,499	74.65	9,741,750.35
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	7.94	994,437.36

PALO ALTO NETWORKS INC	8,079	560.69	4,529,814.51
PAYCHEX INC	26,693	128.80	3,438,058.40
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	360.60	1,527,141.00
PAYPAL HOLDINGS INC	90,208	92.70	8,362,281.60
PTC INC	8,304	114.59	951,555.36
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	42.42	271,191.06
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,672	409.83	3,554,045.76
SALESFORCE INC	80,094	165.23	13,233,931.62
SERVICENOW INC	16,309	444.69	7,252,449.21
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	197.71	3,495,512.80
SPLUNK INC	13,355	94.42	1,260,979.10
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	57.16	1,105,188.60
SYNOPSYS INC	12,539	355.00	4,451,345.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	63.41	2,325,308.11
TWILIO INC - A	12,842	72.34	928,990.28
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	378.26	1,263,010.14
UNITY SOFTWARE INC	16,329	44.58	727,946.82
VERISIGN INC	7,790	187.51	1,460,702.90
VISA INC-CLASS A SHARES	134,653	202.89	27,319,747.17
VMWARE INC-CLASS A	16,717	118.71	1,984,475.07
WESTERN UNION CO	29,297	15.23	446,193.31
WIX.COM LTD	5,010	64.09	321,090.90
WORKDAY INC-CLASS A	15,615	166.46	2,599,272.90
ZENDESK INC	8,890	76.53	680,351.70
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	81.41	1,386,249.48
ZSCALER INC	6,234	161.19	1,004,858.46
AMPHENOL CORPORATION	47,707	75.47	3,600,447.29
APPLE INC	1,323,029	163.62	216,474,004.98
ARISTA NETWORKS INC	20,350	123.03	2,503,660.50
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	107.19	653,859.00
CDW CORP/DE	10,882	179.69	1,955,386.58
CISCO SYSTEMS	337,789	45.89	15,501,137.21
COGNEX CORP	14,352	44.85	643,687.20
CORNING	64,989	34.64	2,251,218.96
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	41.43	931,387.83
F5 INC	4,851	160.17	776,984.67
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	13.76	1,358,689.92
HP INC	83,910	31.39	2,633,934.90
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	29.39	744,184.19
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	167.08	2,504,362.12
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,836	248.32	3,435,755.52
NETAPP INC	18,303	74.96	1,371,992.88

SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	74.62	1,237,423.46
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	126.77	3,304,640.36
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	383.70	1,496,046.30
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	66.00	1,397,616.00
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	45.49	1,173,187.10
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	308.16	1,282,561.92
AT&T INC	581,626	17.89	10,405,289.14
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	20.13	312,337.08
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	21.40	588,221.80
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	10.76	793,754.44
T-MOBILE US INC	50,968	143.02	7,289,443.36
VERIZON COMMUNICATIONS	341,350	43.25	14,763,387.50
AES CORP	54,375	25.63	1,393,631.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	62.27	1,293,846.06
AMEREN CORPORATION	20,898	94.79	1,980,921.42
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,156	101.82	4,088,683.92
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	151.09	2,141,549.66
ATMOS ENERGY CORP	10,802	115.99	1,252,923.98
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	31.75	1,529,143.50
CMS ENERGY CORP	23,697	68.76	1,629,405.72
CONSOLIDATED EDISON INC	29,197	98.53	2,876,780.41
CONSTELLATION ENERGY	25,732	80.83	2,079,917.56
DOMINION ENERGY INC	64,535	83.08	5,361,567.80
DTE ENERGY COMPANY	15,851	133.22	2,111,670.22
DUKE ENERGY CORP	62,802	108.73	6,828,461.46
EDISON INTL	30,339	69.27	2,101,582.53
ENERGY CORP	16,181	118.97	1,925,053.57
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	50.28	1,025,661.72
EVERGY INC	18,475	69.48	1,283,643.00
EVERSOURCE ENERGY	28,450	91.60	2,606,020.00
EXELON CORP	77,196	44.71	3,451,433.16
FIRSTENERGY CORP	45,165	40.19	1,815,181.35
NEXTERA ENERGY INC	159,643	88.06	14,058,162.58
NISOURCE INC	32,351	30.18	976,353.18
NRG ENERGY INC	19,068	41.72	795,516.96
PG&E CORP	118,132	12.48	1,474,287.36
PPL CORPORATION	58,459	29.79	1,741,493.61
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	66.69	2,632,120.92
SEMPRA ENERGY	25,885	166.54	4,310,887.90
SOUTHERN CO	86,558	78.20	6,768,835.60
UGI CORP	18,019	40.19	724,183.61
VISTRA CORP	37,797	24.93	942,279.21

	WEC ENERGY GROUP INC	26,033	104.79	2,727,998.07
	XCEL ENERGY INC	43,741	74.93	3,277,513.13
	ADVANCED MICRO DEVICES	132,978	91.18	12,124,934.04
	ANALOG DEVICES	42,691	158.67	6,773,780.97
	APPLIED MATERIALS	72,040	98.80	7,117,552.00
	BROADCOM INC	33,289	520.86	17,338,908.54
	ENPHASE ENERGY INC	11,020	288.59	3,180,261.80
	ENTEGRIS INC	12,483	100.11	1,249,673.13
	INTEL CORP	331,419	33.36	11,056,137.84
	KLA CORP	12,119	359.18	4,352,902.42
	LAM RESEARCH CORP	11,398	453.31	5,166,827.38
	MARVELL TECHNOLOGY INC	67,204	50.17	3,371,624.68
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	65.96	2,921,302.44
	MICRON TECHNOLOGY	91,511	57.63	5,273,778.93
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	476.62	1,682,945.22
	NVIDIA CORP	202,894	162.60	32,990,564.40
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	168.12	3,504,965.76
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	71.58	2,467,219.44
	QORVO INC	8,556	95.70	818,809.20
	QUALCOMM	91,671	138.38	12,685,432.98
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	102.40	1,369,292.80
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,214	287.93	1,213,337.02
	TERADYNE INC	12,318	90.16	1,110,590.88
	TEXAS INSTRUMENTS	75,121	169.49	12,732,258.29
	アメリカドル 小計	27,731,211		2,863,475,167.44 (396,133,154,663)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	18.58	1,019,298.80
	CAMECO CORP	31,793	34.74	1,104,488.82
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,374	74.16	7,147,095.84
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	25.15	2,799,018.95
	ENBRIDGE	165,402	56.80	9,394,833.60
	IMPERIAL OIL	16,573	65.66	1,088,183.18
	KEYERA CORP	18,607	32.15	598,215.05
	PARKLAND CORP	14,075	32.82	461,941.50
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	48.28	2,204,754.48
	SUNCOR ENERGY	116,208	44.73	5,197,983.84
	TC ENERGY CORP	77,328	65.74	5,083,542.72
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	79.49	1,987,965.41
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	56.82	2,065,634.28
	BARRICK GOLD CORP	139,009	20.17	2,803,811.53
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	64.27	844,443.53
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	25.83	1,110,690.00

FRANCO-NEVADA CORP	15,363	165.52	2,542,883.76
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	9.02	467,659.94
KINROSS GOLD CORP	108,451	4.45	482,606.95
LUNDIN MINING CORP	62,243	7.24	450,639.32
NUTRIEN LTD	44,786	130.88	5,861,591.68
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	20.69	380,923.59
TECK RESOURCES LTD-CL B	40,179	47.44	1,906,091.76
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	122.78	748,958.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	41.26	1,412,659.88
CAE INC	25,999	25.04	651,014.96
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	105.49	800,141.65
WSP GLOBAL INC	9,951	155.92	1,551,559.92
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	36.88	498,064.40
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	90.64	928,606.80
THOMSON REUTERS CORP	13,293	144.27	1,917,781.11
AIR CANADA	13,805	18.21	251,389.05
CANADIAN NATL RAILWAY CO	48,612	160.99	7,826,045.88
CP RAILWAY LIMITED	75,991	103.57	7,870,387.87
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	139.95	816,888.15
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	76.89	1,790,152.98
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	94.94	291,465.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	39.46	673,937.34
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	77.10	1,778,928.30
QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.91	439,432.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	34.94	1,237,644.68
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	161.24	727,676.12
DOLLARAMA INC	22,000	80.48	1,770,560.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	56.97	3,843,594.99
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	38.41	585,867.73
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	117.31	1,514,824.03
METRO INC	18,840	70.06	1,319,930.40
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	154.88	809,402.88
SAPUTO INC	20,898	33.24	694,649.52
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	6.74	140,192.00
BANK MONTREAL	53,040	128.53	6,817,231.20
BANK NOVA SCOTIA	99,336	74.80	7,430,332.80
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,829	64.94	4,664,575.26
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	89.76	2,449,460.64
ROYAL BANK OF CANADA	115,288	124.97	14,407,541.36
TORONTO-DOMINION BANK	148,462	86.87	12,896,893.94
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	116,005	64.11	7,437,080.55
IGM FINANCIAL INC	7,685	36.32	279,119.20

	ONEX CORP	6,603	65.75	434,147.25	
	TMX GROUP LTD	4,685	131.67	616,873.95	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	654.41	1,395,856.53	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	32.80	780,246.40	
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	70.79	714,908.21	
	INTACT FINANCIAL CORP	15,012	192.44	2,888,909.28	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	23.26	3,600,136.28	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	34.55	1,505,585.35	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	59.19	2,705,101.38	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	167.02	449,283.80	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	7.94	312,836.00	
	CGI INC - CL A	18,300	104.65	1,915,095.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	2,025.00	3,248,100.00	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	25.35	210,303.60	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	39.93	171,738.93	
	OPEN TEXT CORP	20,463	41.54	850,033.02	
	SHOPIFY INC - CLASS A	92,560	42.23	3,908,808.80	
	BCE INC	6,203	64.65	401,023.95	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	57.40	1,501,985.80	
	TELUS CORP	32,908	30.10	990,530.80	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.47	957,078.46	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	29.73	725,263.35	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	51.21	578,416.95	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	41.23	425,658.52	
	EMERA INC	23,223	61.35	1,424,731.05	
	FORTIS INC	36,823	58.83	2,166,297.09	
	HYDRO ONE LTD	23,269	35.36	822,791.84	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	45.68	815,570.72	
	カナダドル 小計	3,313,371		192,795,602.23 (20,415,126,320)	
ユーロ	ENI	197,669	12.31	2,434,491.40	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	11.14	442,032.99	
	NESTE OIL OYJ	36,735	51.18	1,880,097.30	
	OMV AG	12,549	41.53	521,159.97	
	REPSOL SA	111,112	13.43	1,492,234.16	
	TENARIS SA	40,648	13.90	565,210.44	
	TOTALENERGIES SE	203,322	53.96	10,971,255.12	
	AIR LIQUIDE	43,239	129.64	5,605,503.96	
	AKZO NOBEL	15,301	63.78	975,897.78	
	ARCELORMITTAL	48,641	23.53	1,144,765.93	
	ARKEMA	4,369	83.56	365,073.64	
	BASF SE	73,837	40.94	3,022,886.78	

COVESTRO AG	14,454	29.38	424,658.52
CRH PLC	59,653	37.88	2,259,655.64
EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	18.62	298,689.12
HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	44.20	576,412.20
KONINKLIJKE DSM NV	13,707	134.00	1,836,738.00
OCI NV	12,000	41.32	495,840.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	33.06	644,802.24
SOLVAY SA	5,356	80.38	430,515.28
STORA ENSO OYJ R	42,169	14.89	627,896.41
SYMRISE AG	11,830	107.45	1,271,133.50
UMICORE	17,605	32.62	574,275.10
UPM KYMMENE OYJ	42,324	34.25	1,449,597.00
VOESTALPINE AG	7,152	19.95	142,682.40
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,552	22.42	505,615.84
AIRBUS SE	46,955	101.92	4,785,653.60
ALSTOM	24,388	20.61	502,636.68
BOUYGUES ORD	16,606	29.22	485,227.32
BRENTAG SE	12,514	66.70	834,683.80
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.53	1,015,255.78
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	25.34	846,218.86
DASSAULT AVIATION SA	2,130	140.60	299,478.00
EIFFAGE	5,924	87.70	519,534.80
FERROVIAL SA	43,631	25.87	1,128,733.97
GEA GROUP AG	13,382	35.36	473,187.52
IMCD NV	4,641	146.80	681,298.80
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	57.52	713,132.96
KION GROUP AG	5,887	39.58	233,007.46
KNORR-BREMSE AG	5,022	48.37	242,914.14
KONE OYJ-B	26,311	39.92	1,050,335.12
LEGRAND SA	21,768	73.96	1,609,961.28
MTU AERO ENGINES AG	3,962	182.50	723,065.00
PRYSMIAN SPA	21,155	31.69	670,401.95
RATIONAL AG	483	559.50	270,238.50
RHEINMETALL AG	3,660	166.85	610,671.00
SAFRAN SA	28,774	104.80	3,015,515.20
SAINT-GOBAIN	40,093	40.79	1,635,593.93
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,670	124.70	5,570,349.00
SIEMENS	61,200	102.90	6,297,480.00
SIEMENS ENERGY AG	36,841	15.35	565,509.35
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	17.93	402,259.55
THALES SA	8,524	123.90	1,056,123.60
VINCI S.A.	42,507	91.95	3,908,518.65

WARTSILA OYJ	41,917	8.34	349,755.44
BUREAU VERITAS SA	25,073	25.53	640,113.69
RANDSTAD NV	10,558	46.42	490,102.36
TELEPERFORMANCE	4,734	289.00	1,368,126.00
WOLTERS KLUWER	20,839	103.85	2,164,130.15
ADP	2,382	138.30	329,430.60
AENA SME SA	5,508	124.40	685,195.20
ATLANTIA SPA	35,937	22.83	820,441.71
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	5.84	265,029.83
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	36.87	2,902,185.18
GETLINK	35,220	19.34	681,330.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	73.12	1,908,943.84
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	69.15	345,127.65
CONTINENTAL AG	8,168	56.38	460,511.84
FERRARI NV	10,170	199.85	2,032,474.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	64,434	55.00	3,543,870.00
MICHELIN	55,356	24.26	1,343,213.34
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	67.18	789,029.10
RENAULT SA	17,362	27.40	475,805.61
STELLANTIS NV	175,794	13.74	2,415,409.56
VALEO SA	16,596	18.59	308,602.62
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,874	140.94	2,237,281.56
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	184.80	459,412.80
ADIDAS AG	13,972	151.54	2,117,316.88
ESSILORLUXOTTICA	22,910	151.90	3,480,029.00
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,336.50	3,393,373.50
KERING	6,271	528.90	3,316,731.90
LVMH	22,668	669.00	15,164,892.00
MONCLER SPA	19,057	45.62	869,380.34
PUMA SE	9,220	62.10	572,562.00
SEB SA	2,282	75.65	172,633.30
ACCOR	14,436	24.07	347,474.52
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	125.75	1,640,786.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.68	264,969.44
SODEXO	6,027	77.96	469,864.92
BOLLORE SE	83,646	4.70	393,470.78
PUBLICIS GROUPE	17,077	49.37	843,091.49
SCOUT24 SE	7,492	56.02	419,701.84
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	44.50	314,659.50
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	20.39	1,248,744.77
VIVENDI SE	61,243	9.03	553,514.23
D' IETEREN GROUP	2,217	154.90	343,413.30



DELIVERY HERO SE	13,414	42.41	568,887.74
INDITEX	87,326	22.27	1,944,750.02
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	17.47	272,042.84
PROSUS	66,706	64.93	4,331,220.58
ZALANDO SE	17,664	23.27	411,041.28
CARREFOUR	52,544	16.90	887,993.60
HELLOFRESH SE	13,805	24.58	339,326.90
JERONIMO MARTINS	24,901	22.78	567,244.78
KESKO OYJ-B SHS	20,083	21.35	428,772.05
KONINKLIJKE AHOLD NV	86,170	27.52	2,371,398.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,711	50.28	3,454,789.08
DANONE (GROUPE)	51,543	52.42	2,701,884.06
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	10.22	501,566.94
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	72.50	670,697.50
HEINEKEN NV	20,157	91.56	1,845,574.92
JDE PEET'S BV	7,000	31.04	217,280.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	104.35	1,361,767.50
PERNOD-RICARD	16,694	187.85	3,135,967.90
REMY COINTREAU	1,382	194.70	269,075.40
BEIERSDORF AG	7,430	103.55	769,376.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	63.55	557,969.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	65.18	941,134.02
LOREAL	19,843	352.75	6,999,618.25
AMPLIFON SPA	11,650	26.06	303,599.00
BIOMERIEUX	3,044	104.85	319,163.40
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	127.55	437,496.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	132.50	274,275.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	34.35	583,434.75
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	24.80	835,487.20
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	16.97	1,218,256.39
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	434.40	792,345.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	48.45	1,044,921.15
ARGENX SE	3,976	391.10	1,555,013.60
BAYER	78,757	53.70	4,229,250.90
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	71.04	726,028.80
GRIFOLS SA	27,685	12.42	343,847.70
IPSEN	3,532	96.75	341,721.00
MERCK KGAA	10,555	173.70	1,833,403.50
ORION OYJ-CLASS B	9,854	47.03	463,433.62
QIAGEN N.V.	17,038	47.16	803,512.08
RECORDATI SPA	9,859	42.12	415,261.08
SANOFI	93,369	81.89	7,645,987.41

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,539	378.40	960,757.60
UCB (GROUPE)	9,389	71.70	673,191.30
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	9.51	379,728.55
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.45	2,381,758.29
BANCO SANTANDER SA	1,393,640	2.40	3,355,188.30
BNP PARIBAS	92,730	45.85	4,251,670.50
CAIXABANK	330,447	2.88	951,687.36
COMMERZBANK AG	81,889	6.22	509,349.58
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	9.11	906,514.09
ERSTE GROUP BANK AG	31,905	21.66	691,062.30
FINECOBANK SPA	53,120	10.70	568,384.00
ING GROEP NV-CVA	324,888	8.72	2,834,972.68
INTESA SANPAOLO	1,322,943	1.68	2,229,158.95
KBC GROEP NV	18,608	46.32	861,922.56
MEDIOBANCA	53,990	7.93	428,248.68
SOCIETE GENERALE	63,329	21.59	1,367,589.75
UNICREDIT SPA	168,352	9.10	1,532,003.20
AMUNDI SA	4,626	50.90	235,463.40
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	8.17	1,312,368.82
DEUTSCHE BOERSE	14,999	169.55	2,543,080.45
EURAZEO SA	3,357	61.25	205,616.25
EURONEXT NV	6,480	75.72	490,665.60
EXOR NV	7,825	62.70	490,627.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	76.14	648,332.10
SOFINA	1,238	200.20	247,847.60
WENDEL	2,023	80.40	162,649.20
AEGON	148,741	4.49	668,739.53
AGEAS	11,086	40.40	447,874.40
ALLIANZ SE-REG	32,696	170.58	5,577,283.68
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	14.72	1,261,004.82
AXA SA	154,335	23.43	3,616,069.05
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	146.10	633,051.30
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,889	235.30	2,797,481.70
NN GROUP NV	22,611	40.06	905,796.66
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.86	362,111.31
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	44.99	1,739,088.45
AROUNDTOWN SA	64,068	2.91	186,950.42
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	75.94	400,583.50
VONOVIA SE	59,080	26.56	1,569,164.80
ADYEN NV	1,746	1,602.00	2,797,092.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	54.80	1,950,003.20
BECHTLE AG	7,659	39.82	304,981.38

CAPGEMINI SA	13,877	178.40	2,475,656.80
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	39.55	2,087,198.68
EDENRED	18,664	50.56	943,651.84
NEMETSCHKE SE	5,455	61.52	335,591.60
NEXI SPA	48,458	8.06	390,765.31
SAP SE	85,927	85.29	7,328,713.83
WORLDLINE SA	20,332	40.82	829,952.24
NOKIA OYJ	427,600	4.94	2,114,695.80
CELLNEX TELECOM SA	46,824	39.92	1,869,214.08
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	18.67	4,820,518.38
ELISA A	10,227	53.68	548,985.36
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.49	288,501.75
KPN (KON.)	282,927	3.18	899,707.86
ORANGE	153,815	10.02	1,542,149.19
PROXIMUS	13,141	12.79	168,073.39
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.20	176,904.54
TELEFONICA	431,420	4.14	1,787,804.48
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.55	252,118.11
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	22.67	215,659.71
ACCIONA SA	2,181	206.00	449,286.00
E.ON SE	195,549	8.51	1,664,513.08
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	25.86	555,110.76
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.94	471,880.74
ELIA GROUP SA/NV	3,125	155.20	485,000.00
ENAGAS	21,663	19.30	418,204.21
ENDESA	25,972	17.86	463,989.78
ENEL	650,125	4.83	3,141,729.06
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	5.13	1,158,564.39
ENGIE	141,564	12.75	1,805,224.12
FORTUM OYJ	32,550	10.03	326,639.25
IBERDROLA SA	477,647	10.92	5,218,293.47
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	29.58	296,095.80
RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	19.42	595,766.76
RWE STAMM	49,680	40.99	2,036,383.20
SNAM SPA	147,559	5.00	738,975.47
TERNA SPA	102,810	7.62	783,412.20
UNIPER SE	7,335	5.42	39,792.37
VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	22.61	1,153,720.47
VERBUND AG	6,430	109.60	704,728.00
ASM INTERNATIONAL NV	3,483	289.15	1,007,109.45
ASML HOLDING NV	33,005	521.40	17,208,807.00
INFINEON TECHNOLOGIES	110,035	24.96	2,747,023.77

	STMICROELECTRONICS	55,076	35.56	1,958,777.94
	ユーロ 小計	14,873,040		334,706,062.72 (45,975,224,775)
イギリスポンド	BP PLC	1,596,790	4.57	7,310,104.62
	SHELL PLC-NEW	620,239	23.34	14,476,378.26
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	29.22	2,985,509.10
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	11.74	420,949.44
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	68.42	747,420.08
	GLENCORE PLC	817,868	4.98	4,080,343.45
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	20.51	345,552.48
	MONDI PLC	36,710	14.60	535,966.00
	RIO TINTO PLC REG	89,551	49.80	4,459,639.80
	ASHTED GROUP PLC	37,687	42.98	1,619,787.26
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	8.13	2,114,645.52
	BUNZL PLC	24,880	31.15	775,012.00
	DCC PLC	6,622	50.66	335,470.52
	FERGUSON PLC	17,761	100.85	1,791,196.85
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.39	445,609.24
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.78	499,061.38
	SMITHS GROUP PLC	26,476	15.15	401,111.40
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	106.20	585,586.80
	EXPERIAN PLC	74,115	26.83	1,988,505.45
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	40.21	558,516.90
	RELX PLC	154,242	23.03	3,552,193.26
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.33	748,758.40
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.29	314,695.39
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	37.10	285,224.80
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	17.35	516,613.60
	PERSIMMON PLC	25,686	14.97	384,647.85
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.09	289,193.88
	COMPASS GROUP PLC	142,427	18.76	2,671,930.52
	ENTAIN PLC	49,630	12.46	618,637.95
	INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	47.50	703,522.50
	WHITBREAD PLC	17,434	25.07	437,070.38
	AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.50	471,437.77
	INFORMA PLC	110,598	5.48	606,961.82
	PEARSON	55,305	8.68	480,158.01
	WPP PLC	95,821	7.43	712,524.95
	JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.09	226,783.61
	KINGFISHER PLC	153,717	2.30	353,856.53
	NEXT PLC	11,468	57.32	657,345.76
	OCADO GROUP PLC	54,753	7.31	400,353.93

SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.02	300,675.04	
TESCO PLC	601,050	2.52	1,518,853.35	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	15.15	390,089.70	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	178,799	34.62	6,190,915.37	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	19.80	355,608.00	
DIAGEO	189,615	38.25	7,253,721.82	
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	18.77	1,428,021.60	
HALEON PLC	405,046	2.66	1,078,637.49	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,022	65.80	3,752,047.60	
UNILEVER PLC	209,465	39.35	8,242,447.75	
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.08	691,437.60	
ASTRAZENECA	126,291	113.64	14,351,709.24	
GSK PLC	334,172	13.94	4,661,031.05	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	13.36	219,825.44	
BARCLAYS	1,339,545	1.62	2,171,402.44	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,655,458	5.23	8,658,045.34	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,667,831	0.43	2,475,141.79	
NATWEST GROUP PLC	443,701	2.50	1,113,245.80	
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.89	1,252,581.61	
3I GROUP PLC	74,757	11.93	891,851.01	
ABRDN PLC	153,430	1.47	225,618.81	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.48	280,642.23	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	82.68	2,174,235.96	
M&G PLC	229,107	1.96	449,164.27	
SCHRODERS PLC	11,794	27.22	321,032.68	
ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	11.25	460,712.17	
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	21.92	356,309.60	
AVIVA PLC	225,378	4.20	947,714.49	
LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.55	1,177,239.24	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.00	306,108.00	
PRUDENTIAL	230,270	9.15	2,106,970.50	
AVEVA GROUP PLC	10,917	27.90	304,584.30	
SAGE GROUP PLC	76,660	7.25	556,244.96	
HALMA PLC	31,069	21.21	658,973.49	
BT GROUP PLC	557,358	1.51	844,118.69	
VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.15	2,537,221.69	
NATIONAL GRID PLC	302,035	11.37	3,435,648.12	
SEVERN TRENT PLC	22,468	28.50	640,338.00	
SSE PLC	90,604	18.02	1,633,137.10	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.86	636,178.80	
イギリスポンド 小計	23,111,209		147,957,759.60 (23,907,014,796)	

スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.69	307,770.62
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	694.50	398,643.00
	GIVAUDAN-REG	748	3,161.00	2,364,428.00
	HOLCIM LTD	44,847	43.67	1,958,468.49
	SIKA AG-BR	11,714	222.70	2,608,707.80
	ABB LTD	137,175	27.53	3,776,427.75
	GEBERIT AG-REG	2,964	456.10	1,351,880.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	166.00	339,968.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	170.25	526,413.00
	VAT GROUP AG	1,956	242.40	474,134.40
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	30.43	317,993.50
	SGS SA	506	2,197.00	1,111,682.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	234.10	1,071,475.70
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,318	111.40	4,825,625.20
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	237.00	588,471.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	44.10	173,665.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,026.00	567,280.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	107,500.00	860,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,480.00	859,360.00
	NESTLE SA - REGISTERED	229,173	115.50	26,469,481.50
	ALCON INC	39,333	65.40	2,572,378.20
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,686	265.70	1,245,070.20
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	109.65	936,411.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	66.70	123,395.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	537.40	3,167,973.00
	NOVARTIS	179,027	80.37	14,388,399.99
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	378.20	837,713.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,316	316.75	18,154,843.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	5.12	1,092,316.16
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	47.53	898,174.41
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	967.80	1,773,977.40
	UBS GROUP AG	281,888	15.26	4,303,020.32
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	143.80	456,421.20
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	506.80	1,225,949.20	
SWISS RE LTD	24,445	73.98	1,808,441.10	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,053	434.10	5,232,207.30	
SWISS PRIME SITE-REG	5,679	85.20	483,850.80	
TEMENOS AG - REG	5,150	77.00	396,550.00	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	49.72	730,187.92	
SWISSCOM	2,187	505.00	1,104,435.00	
スイスフラン 小計	1,401,947		111,883,590.36 (15,976,976,703)	

スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	365.95	8,143,119.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	449.20	4,492,000.00	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	158.00	6,934,146.00	
	ALFA LAVAL AB	27,268	291.00	7,934,988.00	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	220.90	17,265,102.20	
	ATLAS COPCO A	227,097	111.50	25,321,315.50	
	ATLAS COPCO B	127,608	99.17	12,654,885.36	
	EPIROC AB-A	53,479	167.80	8,973,776.20	
	EPIROC AB-B	28,804	150.90	4,346,523.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	72.00	2,787,264.00	
	INDUTRADE AB	22,644	207.60	4,700,894.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	213.50	2,989,427.00	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	169.65	3,048,610.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	99.86	12,267,601.28	
	SANDVIK AB	87,644	170.40	14,934,537.60	
	SKANSKA B	25,507	157.00	4,004,599.00	
	SKF AB-B	37,718	165.00	6,223,470.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	177.70	2,401,437.80	
	VOLVO B	121,238	171.30	20,768,069.40	
	SECURITAS B	29,533	94.00	2,776,102.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	66.83	3,330,740.37	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	136.54	2,904,069.26	
	EVOLUTION AB	14,096	871.10	12,279,025.60	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	65.98	3,506,639.06	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	111.18	6,140,360.22	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	106.65	13,573,345.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	246.90	12,215,130.60	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	205.50	3,657,078.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	234.80	3,365,858.00	
	NORDEA BANK ABP	279,221	100.78	28,139,892.38	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	107.10	14,056,339.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	88.44	9,793,491.84	
	SWEDBANK AB-A	72,526	135.75	9,845,404.50	
	EQT AB	23,207	236.90	5,497,738.30	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	240.50	2,842,229.00		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	237.90	2,656,867.20		
INVESTOR AB-A SHS	38,925	186.35	7,253,673.75		
INVESTOR AB-B SHS	142,777	174.22	24,874,608.94		
KINNEVIK AB - B	18,792	154.55	2,904,303.60		
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	416.00	3,028,480.00		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	59.66	3,382,722.00		
SAGAX AB-B	12,402	229.80	2,849,979.60		

	SINCH AB	44,150	18.79	829,843.40
	ERICSSON (LM) B	225,508	77.63	17,506,186.04
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	114.85	17,668,294.30
	TELE2 AB-B SHS	46,762	113.75	5,319,177.50
	TELIA CO AB	230,643	37.99	8,762,127.57
	スウェーデンクローナ 小計	3,170,036		401,151,475.27 (5,178,865,545)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	27,755	367.00	10,186,085.00
	EQUINOR ASA	81,436	406.15	33,075,231.40
	NORSK HYDRO	96,800	71.10	6,882,480.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	416.00	5,199,168.00
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	348.40	3,011,918.00
	ADEVINTA ASA	19,117	70.75	1,352,527.75
	MOWI ASA	31,968	206.60	6,604,588.80
	ORKLA	69,804	83.06	5,797,920.24
	SALMAR ASA	5,423	653.50	3,543,930.50
	DNB BANK ASA	71,795	189.85	13,630,280.75
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	205.60	3,818,814.40
	TELENOR ASA	51,193	109.65	5,613,312.45
	ノルウェークローネ 小計	495,008		98,716,257.29 (1,393,873,552)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	436.00	3,698,588.00
	NOVOZYMES A/S	17,111	439.00	7,511,729.00
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,491.00	1,125,705.00
	VESTAS WIND SYSSEMS A/S	81,654	190.24	15,533,856.96
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	18,140.00	3,972,660.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	18,375.00	7,974,750.00
	DSV A/S	15,307	1,134.50	17,365,791.50
	PANDORA A/S	8,163	445.30	3,634,983.90
	CARLSBERG AS-B	8,481	965.80	8,190,949.80
	COLOPLAST-B	9,208	862.60	7,942,820.80
	DEMANT A/S	8,512	228.00	1,940,736.00
	GN STORE NORD A/S	9,226	215.40	1,987,280.40
	GENMAB A/S	5,250	2,684.00	14,091,000.00
	NOVO NORDISK A/S-B	136,910	819.50	112,197,745.00
	DANSKE BANK A/S	56,132	97.82	5,490,832.24
TRYG A/S	29,772	171.55	5,107,386.60	
ORSTED A/S	15,439	769.80	11,884,942.20	
	デンマーククローネ 小計	411,056		229,651,757.40 (4,241,667,959)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	35.62	734,804.98
	SANTOS	265,406	7.91	2,099,361.46
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	26.15	335,059.95



WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	158,086	35.95	5,683,191.70
BHP GROUP LTD	414,748	42.81	17,755,361.88
BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	17.42	605,693.40
EVOLUTION MINING LTD	122,154	2.50	305,385.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	19.87	2,753,823.04
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	34.66	1,280,617.68
MINERAL RESOURCES LTD	14,409	65.12	938,314.08
NEWCREST MINING LIMITED	73,939	18.24	1,348,647.36
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	7.58	770,340.24
ORICA LTD	38,288	15.60	597,292.80
RIO TINTO LTD	28,818	98.66	2,843,183.88
SOUTH32 LTD	341,133	4.23	1,442,992.59
REECE LTD	16,814	16.17	271,882.38
BRAMBLES LTD	108,007	12.64	1,365,208.48
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.78	452,053.98
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.18	440,300.00
TRANSURBAN GROUP	249,674	13.88	3,465,475.12
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	35.96	1,661,711.60
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	66.11	234,095.51
IDP EDUCATION LTD	17,793	28.89	514,039.77
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.39	799,037.07
REA GROUP LTD	3,586	128.34	460,227.24
SEEK LTD	28,001	21.34	597,541.34
WESFARMERS LTD	91,917	47.95	4,407,420.15
COLES GROUP LTD	108,486	17.65	1,914,777.90
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.24	795,683.24
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	36.76	3,672,360.76
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	13.38	855,784.80
COCHLEAR LIMITED	4,783	214.85	1,027,627.55
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	70.50	1,145,484.00
SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	35.63	1,327,253.13
CSL LIMITED	38,619	295.50	11,411,914.50
AUST AND NZ BANKING GROUP	247,511	22.96	5,682,852.56
COMMONWEALTH BANK OF AUST	139,969	98.31	13,760,352.39
NATIONAL AUSTRALIA BANK	267,570	30.61	8,190,317.70
WESTPAC BANKING	283,793	21.68	6,152,632.24
ASX LTD	14,549	79.90	1,162,465.10
MACQUARIE GROUP LIMITED	29,434	178.50	5,253,969.00
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	236,496	4.60	1,087,881.60
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.70	859,077.10
QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.33	1,375,917.03
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	10.91	1,034,966.24

	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.62	1,092,537.12	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	59.12	815,915.12	
	XERO LTD	11,340	88.02	998,146.80	
	TELSTRA CORP	308,467	4.03	1,243,122.01	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	6.35	961,815.45	
	オーストラリアドル 小計	5,421,068		125,985,916.02 (11,959,843,007)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.68	905,249.28	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	20.20	807,596.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.27	912,331.86	
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.94	383,801.22	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.00	552,720.00	
	ニュージーランドドル 小計	506,126		3,561,698.36 (301,212,830)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	52.20	11,170,591.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	98.75	10,566,250.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	15.40	2,648,800.00	
	MTR CORP	125,000	40.35	5,043,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	22.75	2,730,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	44.25	7,699,500.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	17.04	3,373,920.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	16.06	2,765,532.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	23.20	3,384,880.00	
	WH GROUP LTD	658,301	5.43	3,574,574.43	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	27.25	7,670,875.00	
	HANG SENG BANK	59,400	124.40	7,389,360.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	328.80	31,499,040.00	
	AIA GROUP LTD	982,200	78.20	76,808,040.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	53.95	8,874,559.20	
	ESR GROUP LTD	157,000	20.60	3,234,200.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	13.16	2,276,680.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	26.45	3,312,280.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	25.95	3,538,931.25	
	SINO LAND CO	315,400	11.46	3,614,484.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	94.05	10,157,400.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	56.40	2,284,200.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	18.24	1,754,688.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	37.00	4,403,000.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	48.70	3,287,250.00		
CLP HOLDINGS	137,500	68.10	9,363,750.00		
HONG KONG & CHINA GAS	904,657	7.97	7,210,116.29		
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	47.85	5,359,200.00		

	香港ドル 小計	6,162,153		244,995,851.97 (4,319,276,870)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,800	7.21	813,288.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.84	566,016.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.38	582,826.16
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.79	485,850.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.08	728,688.00
	DBS GROUP	150,000	32.84	4,926,000.00
	OCBC BANK	282,100	12.14	3,424,694.00
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	27.47	2,579,433.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.64	636,240.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.77	842,595.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.25	353,100.00
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.16	340,100.00
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.55	476,735.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.65	1,804,498.95
	シンガポールドル 小計	2,774,575		18,560,064.11 (1,836,147,142)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	34.90	2,074,002.30
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	674.20	1,446,833.20
	BANK HAPOLIM BM	98,310	34.75	3,416,272.50
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	134,557	35.76	4,811,758.32
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	20.96	2,085,520.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	137.60	1,720,412.80
	AZRIELI GROUP	4,323	277.80	1,200,929.40
	NICE LTD	4,991	700.50	3,496,195.50
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	152.30	1,523,000.00
	イスラエルシェケル 小計	425,757		21,774,924.02 (915,230,541)
	合 計	89,796,557		532,553,614,703 (532,553,614,703)

## (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	アメリカドル	AMC ENTERTAINMENT HLDGS 0% 21710819(PREF)	38,290	248,885.00	
		アメリカドル 小計	38,290	248,885.00 (34,430,750)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	109,658	1,228,169.60	
		LENDLEASE GROUP	64,786	666,647.94	
			174,444	1,894,817.54	

		オーストラリアドル 小計		(179,875,029)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,455,300.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,326,400.00	
		香港ドル 小計	535,500	4,781,700.00	
				(84,301,371)	
		投資信託受益証券合計	748,234	298,607,150	
				(298,607,150)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,110	1,913,380.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	905,557.24	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,131	9,698,245.89	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	149,611	981,448.16	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,372,014.24	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	917,721.09	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,043,790.30	
		CROWN CASTLE INC	35,305	6,122,240.05	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,935,201.37	
		DUKE REALTY CORP	30,517	1,853,602.58	
		EQUINIX INC	7,423	4,978,903.02	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,021,947.70	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,592	2,249,879.76	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,430,334.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	2,251,088.84	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	769,728.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,214,459.95	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,035,539.52	
		INVITATION HOMES INC	46,840	1,746,195.20	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,265,902.02	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	1,040,322.84	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	749,038.92	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,598,826.60	
		PROLOGIS INC	60,352	7,746,179.20	
		PUBLIC STORAGE	12,922	4,451,887.44	
		REALTY INCOME CORP	47,102	3,292,900.82	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	786,316.35	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,834,793.24	
		SIMON PROPERTY GROUP	27,091	2,840,491.35	
		SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,450,581.30	
		UDR INC	24,265	1,124,925.40	
		VENTAS INC	31,565	1,524,589.50	
		VICI PROPERTIES INC	75,321	2,533,798.44	
		VORNADO REALTY TRUST	11,390	308,099.50	
		WELLTOWER INC	35,629	2,755,190.57	

	WP CAREY INC	16,024	1,373,737.52	
	アメリカドル 小計	1,092,149	83,118,857.92 (11,498,662,804)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	220,648.05	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	319,868.50	
	カナダドル 小計	20,377	540,516.55 (57,235,297)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	274,150.50	
	GECINA SA	3,139	283,608.65	
	KLEPIERRE	17,225	352,423.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	539,164.35	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	401,883.68	
	ユーロ 小計	48,695	1,851,230.68 (254,285,046)	
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	342,830.23	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	301,248.81	
	SEGRO PLC	93,383	902,640.07	
	イギリスポンド 小計	219,086	1,546,719.11 (249,918,873)	
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	833,637.40	
	GOODMAN GROUP	133,807	2,745,719.64	
	GPT GROUP	167,884	711,828.16	
	MIRVAC GROUP	266,683	560,034.30	
	SCENTRE GROUP	382,183	1,108,330.70	
	STOCKLAND	207,412	761,202.04	
	VICINITY CENTERS	365,149	697,434.59	
	オーストラリアドル 小計	1,617,208	7,418,186.83 (704,208,475)	
香港ドル	LINK REIT	170,500	10,528,375.00	
	香港ドル 小計	170,500	10,528,375.00 (185,615,251)	
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	818,317.44	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	708,092.32	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	504,076.42	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	411,400.00	
	シンガポールドル 小計	1,127,756	2,441,886.18 (241,575,799)	
	投資証券合計	4,295,771	13,191,501,545 (13,191,501,545)	
	合計		13,490,108,695 (13,490,108,695)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 604銘柄	97.2%			72.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 36銘柄			2.8%	2.1%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%			3.7%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 223銘柄	99.4%			8.4%
	投資証券 5銘柄			0.6%	0.0%
イギリスポンド	株式 79銘柄	99.0%			4.4%
	投資証券 3銘柄			1.0%	0.0%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%			2.9%
スウェーデンクローナ	株式 47銘柄	100.0%			0.9%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 50銘柄	93.1%			2.2%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 28銘柄	94.1%			0.8%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	88.4%			0.3%
	投資証券 4銘柄			11.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%			0.2%

(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

	2022年 8月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,189,270,781
流動資産合計	11,189,270,781
資産合計	11,189,270,781
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,040,055
未払利息	18,721
流動負債合計	1,058,776
負債合計	1,058,776
純資産の部	
元本等	
元本	11,058,963,995
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	129,248,010
元本等合計	11,188,212,005
純資産合計	11,188,212,005
負債純資産合計	11,189,270,781

### 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)

	2022年 8月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,058,963,995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 1.0117円 (1万口当たり純資産額) (10,117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

	2022年 8月29日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
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（流動性リスク管理等を含む）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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月29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	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	11,313,010,524円
期中追加設定元本額	14,217,649,278円
期中一部解約元本額	14,471,695,807円
期末元本額	11,058,963,995円
期末元本額の内訳	
DCターゲット・イヤー ファンド2025	3,552,906,540円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	114,100,407円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	59,173,326円
バランスG(25)VA(適格機関投資家専用)	5,278,040,765円
FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	13,410,205円
ブラジル高配当株オープン(毎月決算型)	9,880,568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	2,169,396円
北米株配当戦略投信2018-08(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,400,622,714円
日本株配当戦略投信2020-03(適格機関投資家専用)	263,482,819円
日本株配当戦略投信2020-09(適格機関投資家専用)	364,683,769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】

(2022年 9月30日現在)

資産総額	5,254,382,192円
負債総額	4,469,643円
純資産総額（ - ）	5,249,912,549円
発行済口数	4,047,575,596口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2971円
（1万口当たり純資産額）	（12,971円）

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2035】

## 【純資産額計算書】

(2022年 9月30日現在)

資産総額	5,672,508,197円
負債総額	2,683,907円
純資産総額（ - ）	5,669,824,290円
発行済口数	3,892,907,212口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4564円
（1万口当たり純資産額）	（14,564円）

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2045】

## 【純資産額計算書】

(2022年 9月30日現在)

資産総額	2,927,940,998円
負債総額	1,262,288円
純資産総額（ - ）	2,926,678,710円
発行済口数	1,904,110,422口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5370円
（1万口当たり純資産額）	（15,370円）

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2055】

## 【純資産額計算書】

(2022年 9月30日現在)

資産総額	108,540,550円
負債総額	46,118円
純資産総額（ - ）	108,494,432円
発行済口数	89,766,196口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2086円
（1万口当たり純資産額）	（12,086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

(2022年 9月30日現在)

資産総額	627,305,115,755円
負債総額	3,657,573,209円
純資産総額（ - ）	623,647,542,546円
発行済口数	458,239,606,430口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3610円
（1万口当たり純資産額）	（13,610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

(2022年 9月30日現在)

資産総額	482,639,704,027円
負債総額	1,858,009,752円
純資産総額（ - ）	480,781,694,275円
発行済口数	261,939,828,601口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8355円
（1万口当たり純資産額）	（18,355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

（2022年 9月30日現在）

資産総額	320,050,506,553円
負債総額	466,782,492円
純資産総額（ - ）	319,583,724,061円
発行済口数	102,233,099,421口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1260円
（1万口当たり純資産額）	（31,260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

（2022年 9月30日現在）

資産総額	534,917,070,091円
負債総額	5,475,552,151円
純資産総額（ - ）	529,441,517,940円
発行済口数	128,335,928,077口
1口当たり純資産額（ / ）	4.1254円
（1万口当たり純資産額）	（41,254円）

## 短期金融資産 マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 9月30日現在）

資産総額	9,168,842,780円
負債総額	22,271円
純資産総額（ - ）	9,168,820,509円
発行済口数	9,063,458,759口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0116円
（1万口当たり純資産額）	（10,116円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

#### 受益証券の不発行

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

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2022年 9月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に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2022年11月29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。

2022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	536	13,725,962
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	212,668
単位型公社債投資信託	51	201,567
合計	655	14,140,196

## 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 2021年4月1日 至 2022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 ( 2021年3月31日 )	当事業年度 ( 2022年3月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292
その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

( 単位：百万円 )

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
固定負債		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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				
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		

当期首残高	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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	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	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 注記事項

### （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

市場価格のない株式等以外のもの

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。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

#### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 4．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

##### （2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づ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

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

##### （2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用           ：発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異       ：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

#### 7．収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

##### （1）投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応

じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. 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。

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

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日）を適用する予定であります。

(会計方針の変更)

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

（未適用の会計基準等）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であり、

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る事業年度末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当事業年度より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、「重要な会計方針6．引当金の計上基準（2）退職給付引当金」をご参照ください。

（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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	〃	535	〃
そ の 他	4	〃	-	〃
計	503	〃	681	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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



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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24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

2022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
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022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 8 . 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. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先度が最も低いレベルに時価を分類しております。

### (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950
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)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(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。

当事業年度（2022年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	-	196	-	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

(\*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) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

(\*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

(\*4) 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。

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

#### デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(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（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

当事業年度（2022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	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

（有価証券関係）

## 1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない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）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

## 2．その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	126
小計	1,585	1,711	126
合計	6,474	5,115	1,358

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等		133

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（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）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (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）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 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 関係会社株式				
	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	

当事業年度（2022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	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
	合計	6,915	-	80	80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(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	17,197	-	1,333	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

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 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
	合計		8,057	-	71

## (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従来簡便法により、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したが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

## 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	600	626
勤務費用	-	124
利息費用	-	2
転籍者受入	18	-
退職給付の支払額	69	81
簡便法で計算した退職給付費用	77	8
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
退職給付債務の期末残高	626	820

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

## (3) 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820
退職給付引当金	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	-	124
利息費用	-	2
簡便法で計算した退職給付費用	77	8

簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	-	0.4%

### 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92百万円、当事業年度100百万円であります。

(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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	107	百万円	112	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170	"	177	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	191	"	251	"
税務上の収益認識差額	71	"	74	"
税務上の費用認識差額	-	"	439	"
繰延ヘッジ損益	28	"	224	"
その他	123	"	76	"
繰延税金資産 合計	693	"	1,357	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	349	"	415	"
その他	32	"	34	"
繰延税金負債 合計	382	"	450	"
繰延税金資産の純額	311	"	907	"

#### 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。

(収益認識関係)

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

#### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

#### 3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
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 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(*)	6,372百万円

(\*)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おります。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(\*)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おります。

## 〔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。

## （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 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(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（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）

当事業年度（2022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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

## 5【その他】

## (1)定款の変更

委託会社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

2022年11月29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（2022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） （2022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（2022年3月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

**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2021年4月1日から2022年3月31日までの第36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2022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。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. 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

2022年11月9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 公認会計士 松崎雅則  
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、「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2021年8月31日から2022年8月29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2022年8月29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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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、継続企業的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。継続企業的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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年11月9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 公認会計士 松崎雅則  
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、「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2021年8月31日から2022年8月29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2022年8月29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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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、継続企業的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。継続企業的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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年11月9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 公認会計士 松崎雅則  
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、「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2021年8月31日から2022年8月29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2022年8月29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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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、継続企業的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。継続企業的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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年11月9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

## 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2021年8月31日から2022年8月29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2022年8月29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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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、継続企業的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。継続企業的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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。