

【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21日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCバランスファンド30 DCバランスファンド50 DCバランスファンド70
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	DCバランスファンド30 10兆円を上限とします。 DCバランスファンド50 10兆円を上限とします。 DCバランスファンド70 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DCバランスファンド30

DCバランスファンド50

DCバランスファンド70

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（ 7 ）【申込期間】

2022年11月22日から2023年 5月19日までとします。

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

（ 8 ）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

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

国内外の株式・公社債へ分散投資します。

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



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

<投資対象とするマザーファンド>

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

ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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

日本株式マザーファンド

原則として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、配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行います。日次でベンチマークとの収益率乖離をチェックした上で、ポートフォリオとベンチマークの諸属性の乖離状況を把握し、個別銘柄構成比をベンチマークの市場構成比に極力合致させます。また、キャッシュポジションは株式先物を用いてヘッジし、ベンチマークとの連動性を高めます。

日本債券マザーファンド

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

外国株式マザーファンド

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

外国債券マザーファンド

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

● 複合指数について

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

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、取得時において以下の通りとします。

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

- 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下の通りとします。

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

◆各マザーファンドが対象とする指数は次の通りです。

日本株式マザーファンド「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」

TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社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。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数の指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、同指数の指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。

日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」

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

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

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

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

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

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

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

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性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。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2006年9月29日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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

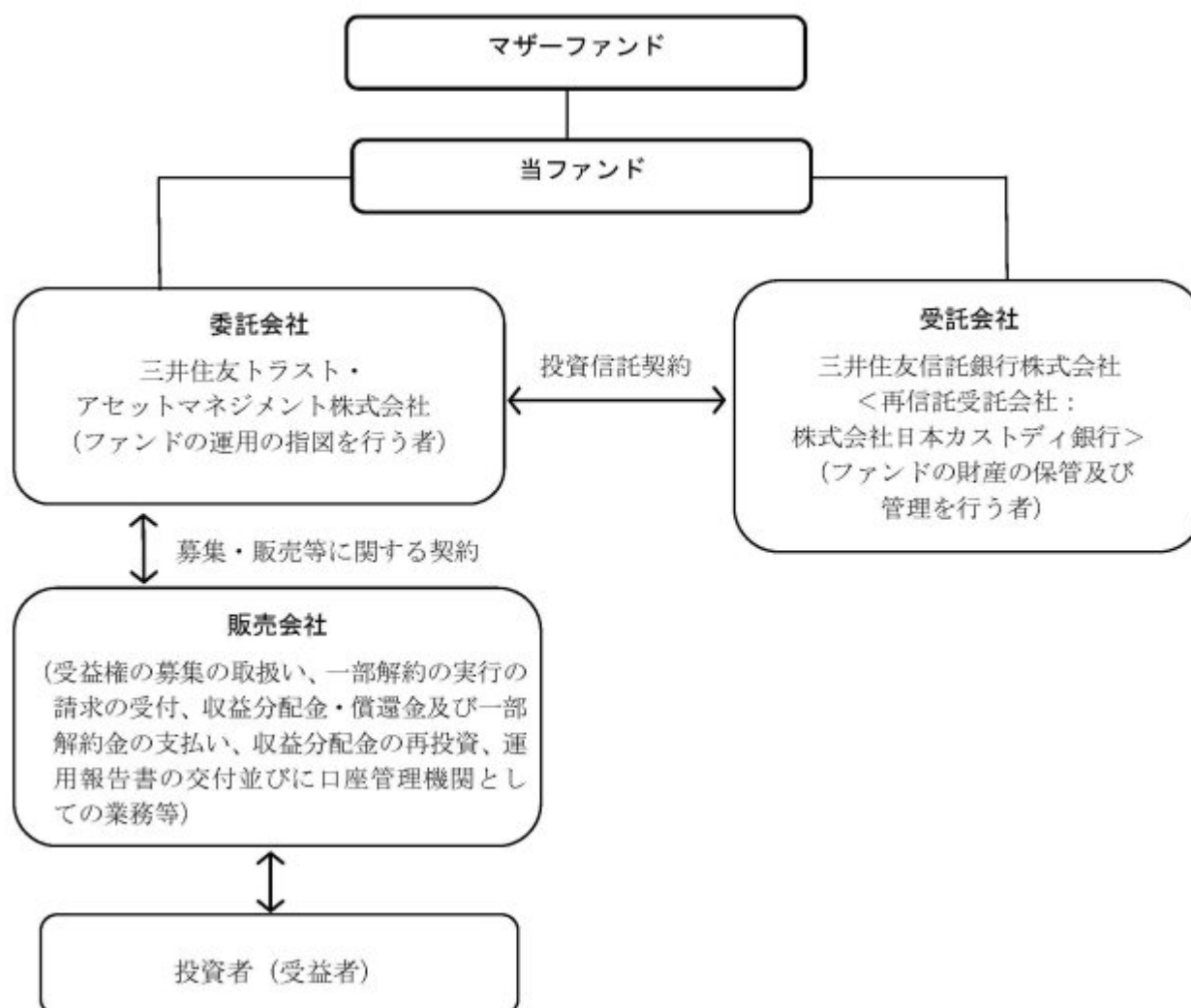
ファンドの名称を中央三井DCバランスファンド30からDCバランスファンド30、中央三井DCバランスファンド50からDCバランスファンド50、中央三井DCバランスファンド70からDCバランスファンド70に変更

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

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

（３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（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】

運用方針

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

投資態度

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

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

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

めるものをいいます。以下同じ。)

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

B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

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

益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

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

（2）投資態度

株式への投資は、原則として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、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「日本債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「外国債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

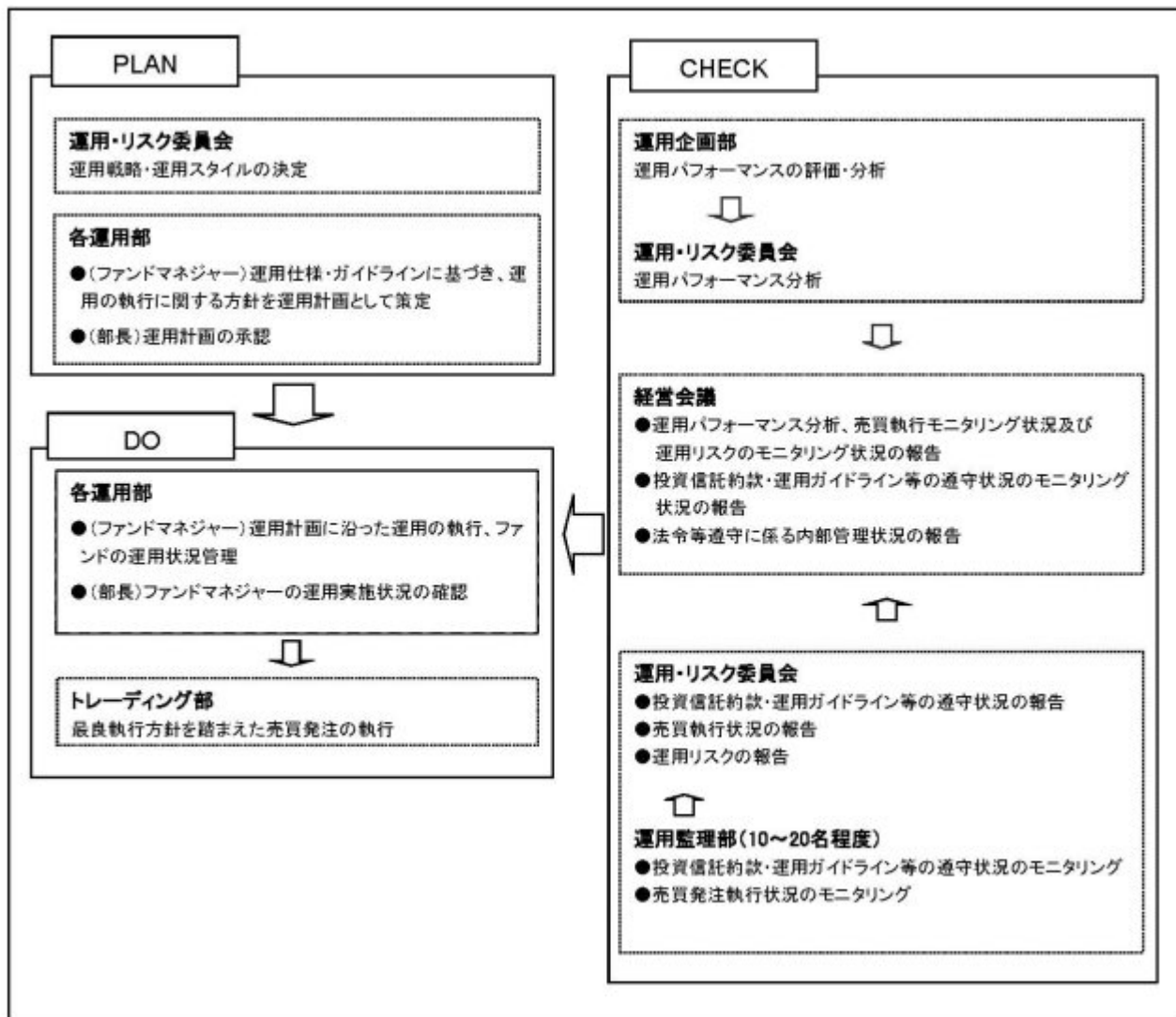
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

A．株式への投資割合

委託会社は、株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

DCバランスファンド30.....信託財産の純資産総額の40%以下

DCバランスファンド50.....信託財産の純資産総額の60%以下

DCバランスファンド70.....信託財産の純資産総額の80%以下

B．外貨建資産の投資割合

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

DCバランスファンド30.....信託財産の純資産総額の30%以下

DCバランスファンド50.....信託財産の純資産総額の40%以下

DCバランスファンド70.....信託財産の純資産総額の45%以下

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資制限

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資制限

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の指図範囲

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

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

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

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

Ｊ．先物取引等の運用指図

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

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

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

Ｋ．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

Ｌ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

Ｍ．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

a．及びb．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

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

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

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

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

T. 資金の借入れ

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

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

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

二. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U. 受託会社による資金の立替え

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

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

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

V. 受託会社の自己又は利害関係人等との取引

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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性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

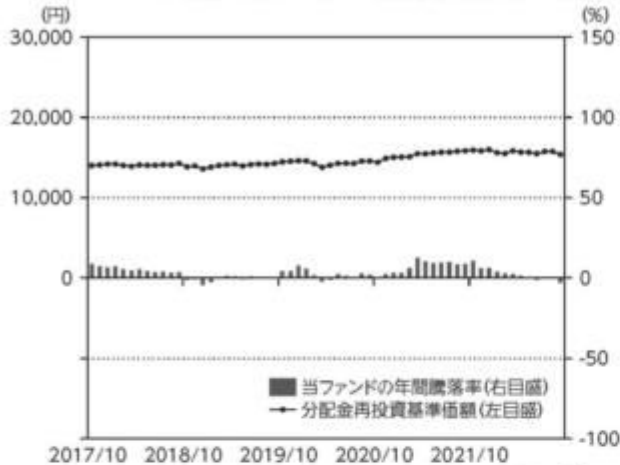
委託会社におけるリスク管理体制

- ・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。

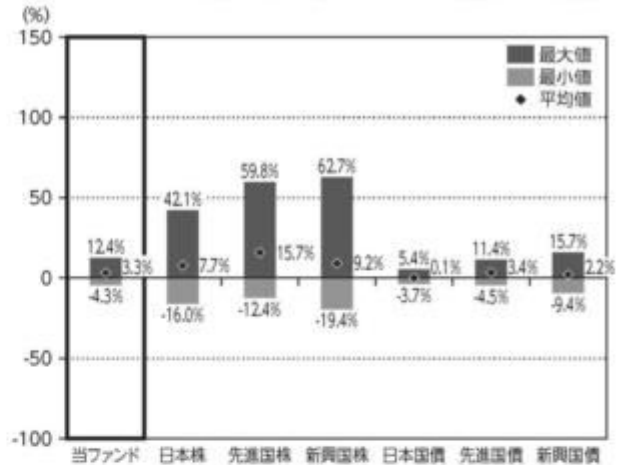
〔参考情報〕

DCバランスファンド30

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

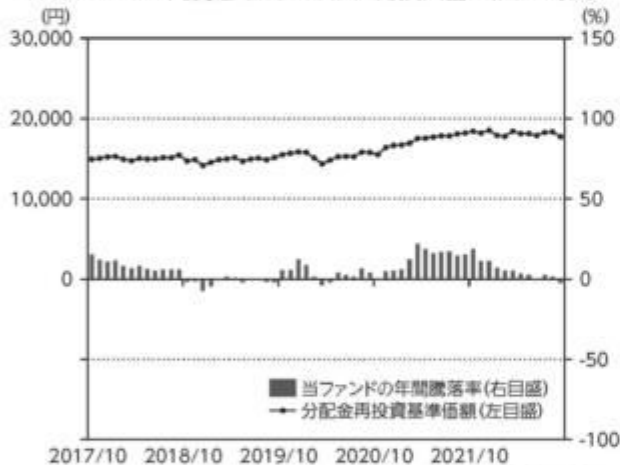


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

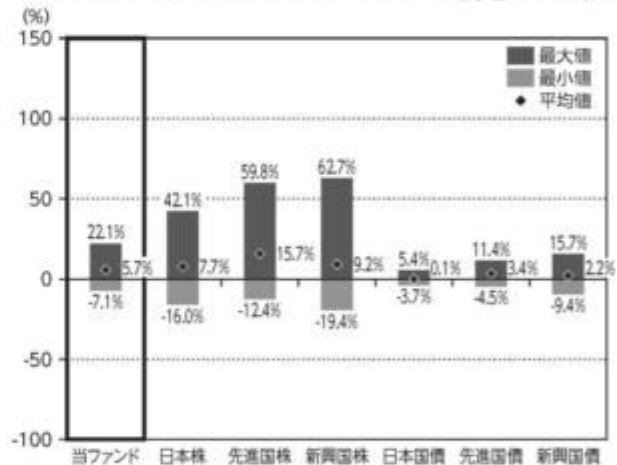


DCバランスファンド50

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

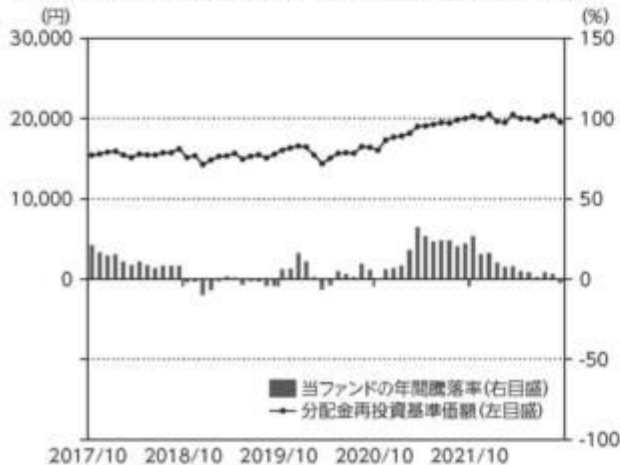


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

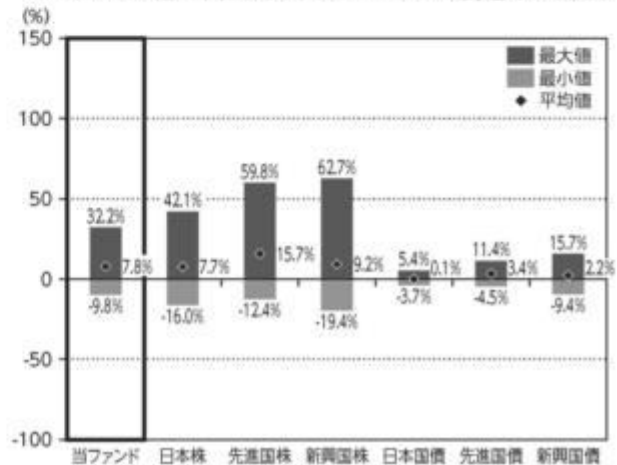


DCバランスファンド70

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



【参考情報】

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

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

*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、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、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バンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社(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章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指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。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、説明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 J.P. Morganグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

	信託財産留保率
D C バランス 3 0	0.13%
D C バランス 5 0	0.15%
D C バランス 7 0	0.17%

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

DCバランスファンド30：年率 0.231%（税抜 0.21%）（ ）

DCバランスファンド50：年率 0.242%（税抜 0.22%）

DCバランスファンド70：年率 0.253%（税抜 0.23%）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2022年 9月30日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2022年9月30日現在の状況について記載してあります。

【DCバランスファンド30】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	26,582,701,388	99.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		103,521,994	0.39
合計(純資産総額)		26,686,223,382	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	12,080,359,025	1.3539	16,356,205,050	1.3297	16,063,253,395	60.19

日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,441,126,048	2.1614	5,276,492,429	2.1287	5,196,425,018	19.47
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	623,222,690	4.2802	2,667,532,833	4.4020	2,743,426,281	10.28
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	955,370,799	2.6210	2,504,052,134	2.7001	2,579,596,694	9.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.61
合計	99.61

(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7期計算期間末	(2013年 2月21日)	2,268,392,887	2,268,392,887	10,435	10,435
第8期計算期間末	(2014年 2月21日)	4,826,567,334	4,826,567,334	11,618	11,618
第9期計算期間末	(2015年 2月23日)	9,609,384,153	9,609,384,153	12,811	12,811
第10期計算期間末	(2016年 2月22日)	12,153,839,606	12,153,839,606	12,527	12,527
第11期計算期間末	(2017年 2月21日)	14,214,751,693	14,214,751,693	13,306	13,306
第12期計算期間末	(2018年 2月21日)	16,338,867,196	16,338,867,196	13,983	13,983
第13期計算期間末	(2019年 2月21日)	18,205,085,029	18,205,085,029	14,025	14,025
第14期計算期間末	(2020年 2月21日)	20,310,903,852	20,310,903,852	14,687	14,687
第15期計算期間末	(2021年 2月22日)	22,717,128,952	22,717,128,952	15,283	15,283
第16期計算期間末	(2022年 2月21日)	24,689,281,244	24,689,281,244	15,527	15,527
	2021年 9月末日	24,907,789,651		15,843	
	10月末日	25,104,191,632		15,937	
	11月末日	25,011,589,525		15,818	
	12月末日	25,190,879,465		15,980	

2022年 1月末日	24,856,402,100		15,607
2月末日	24,647,432,672		15,507
3月末日	25,475,353,238		15,831
4月末日	25,268,070,279		15,658
5月末日	25,231,715,785		15,651
6月末日	26,512,682,877		15,495
7月末日	27,118,873,490		15,740
8月末日	27,245,507,022		15,747
9月末日	26,686,223,382		15,376

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	0
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	0
第16期計算期間	2021年 2月23日～2022年 2月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	10.6
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	11.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	10.3
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2.2
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	6.2
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	5.1
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.3
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	4.7
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	4.1
第16期計算期間	2021年 2月23日～2022年 2月21日	1.6
第17期中間計算期間	2022年 2月22日～2022年 8月21日	2.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	548,368,354	136,959,287	2,173,741,672
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	2,244,075,796	263,589,279	4,154,228,189
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	3,774,064,767	427,446,160	7,500,846,796
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2,707,951,316	506,368,389	9,702,429,723
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	1,522,635,571	541,752,943	10,683,312,351
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	1,622,030,510	620,753,783	11,684,589,078
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	1,853,591,536	558,077,052	12,980,103,562
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	1,679,276,139	830,050,924	13,829,328,777
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	2,046,783,461	1,012,273,788	14,863,838,450
第16期計算期間	2021年 2月23日～2022年 2月21日	2,000,986,753	963,792,042	15,901,033,161
第17期中間計算期間	2022年 2月22日～2022年 8月21日	1,817,486,070	533,600,608	17,184,918,623

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

【DCバランスファンド50】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	27,618,913,033	99.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		107,452,303	0.39
合計(純資産総額)		27,726,365,336	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	8,423,347,366	1.3540	11,405,212,334	1.3297	11,200,524,992	40.40
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,838,120,129	2.1617	8,296,864,283	2.1287	8,170,206,318	29.47
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,268,420,612	4.2777	5,425,922,852	4.4020	5,583,587,534	20.14
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	986,850,187	2.6207	2,586,238,286	2.7001	2,664,594,189	9.61

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.61
合計	99.61

(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7期計算期間末 (2013年 2月21日)	3,400,936,257	3,400,936,257	9,831	9,831
第8期計算期間末 (2014年 2月21日)	4,833,869,383	4,833,869,383	11,529	11,529
第9期計算期間末 (2015年 2月23日)	10,264,606,984	10,264,606,984	13,252	13,252
第10期計算期間末 (2016年 2月22日)	12,016,092,940	12,016,092,940	12,499	12,499
第11期計算期間末 (2017年 2月21日)	14,533,410,562	14,533,410,562	13,835	13,835
第12期計算期間末 (2018年 2月21日)	16,857,871,211	16,857,871,211	14,889	14,889
第13期計算期間末 (2019年 2月21日)	18,131,125,571	18,131,125,571	14,866	14,866
第14期計算期間末 (2020年 2月21日)	20,696,734,917	20,696,734,917	15,946	15,946
第15期計算期間末 (2021年 2月22日)	23,693,213,025	23,693,213,025	17,177	17,177
第16期計算期間末 (2022年 2月21日)	25,849,385,990	25,849,385,990	17,813	17,813
2021年 9月末日	26,124,905,787		18,183	
10月末日	26,572,747,834		18,400	
11月末日	26,275,117,072		18,182	
12月末日	26,697,649,472		18,514	
2022年 1月末日	26,065,680,094		17,886	
2月末日	25,776,434,240		17,770	
3月末日	27,047,745,355		18,415	
4月末日	26,641,073,074		18,097	

5月末日	26,553,473,723		18,103	
6月末日	27,516,143,969		17,875	
7月末日	28,359,372,730		18,271	
8月末日	28,551,880,677		18,323	
9月末日	27,726,365,336		17,740	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	0
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	0
第16期計算期間	2021年 2月23日～2022年 2月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	15.6
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	17.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	14.9
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	5.7
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	10.7
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	7.6
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.2
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	7.3
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	7.7
第16期計算期間	2021年 2月23日～2022年 2月21日	3.7
第17期中間計算期間	2022年 2月22日～2022年 8月21日	4.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	737,283,783	225,124,733	3,459,238,132
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	1,127,761,819	394,119,618	4,192,880,333
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	3,890,146,207	337,276,922	7,745,749,618
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	2,389,338,964	521,486,140	9,613,602,442
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	1,427,316,438	535,903,642	10,505,015,238
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	1,604,824,267	787,711,888	11,322,127,617
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	1,487,203,756	613,284,585	12,196,046,788
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	1,542,536,422	759,460,983	12,979,122,227
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	1,929,479,800	1,115,407,432	13,793,194,595
第16期計算期間	2021年 2月23日～2022年 2月21日	1,696,091,500	977,545,037	14,511,741,058
第17期中間計算期間	2022年 2月22日～2022年 8月21日	1,526,596,913	550,834,008	15,487,503,963

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

【DCバランスファンド70】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	12,524,781,122	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		47,709,010	0.38
合計(純資産総額)		12,572,490,132	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,329,528,317	2.1615	5,035,275,458	2.1287	4,958,866,928	39.44
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	850,877,221	4.2797	3,641,499,243	4.4020	3,745,561,526	29.79
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	2,404,541,140	1.3525	3,252,141,892	1.3297	3,197,318,353	25.43
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	230,744,904	2.6215	604,897,766	2.7001	623,034,315	4.96

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.62
合計	99.62

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第7期計算期間末 (2013年 2月21日)	1,396,043,467	1,396,043,467	9,146	9,146
第8期計算期間末 (2014年 2月21日)	2,259,670,200	2,259,670,200	11,186	11,186
第9期計算期間末 (2015年 2月23日)	4,376,661,860	4,376,661,860	13,325	13,325
第10期計算期間末 (2016年 2月22日)	4,382,407,791	4,382,407,791	12,156	12,156
第11期計算期間末 (2017年 2月21日)	5,465,018,584	5,465,018,584	14,000	14,000
第12期計算期間末 (2018年 2月21日)	6,554,623,946	6,554,623,946	15,405	15,405
第13期計算期間末 (2019年 2月21日)	7,105,425,421	7,105,425,421	15,276	15,276
第14期計算期間末 (2020年 2月21日)	8,349,294,464	8,349,294,464	16,706	16,706
第15期計算期間末 (2021年 2月22日)	10,072,849,421	10,072,849,421	18,545	18,545
第16期計算期間末 (2022年 2月21日)	11,455,179,464	11,455,179,464	19,577	19,577
2021年 9月末日	11,388,855,099		19,999	
10月末日	11,642,295,092		20,330	
11月末日	11,532,577,376		20,012	
12月末日	11,827,542,744		20,528	
2022年 1月末日	11,481,177,906		19,632	
2月末日	11,418,271,295		19,514	
3月末日	12,152,854,064		20,489	
4月末日	11,913,917,408		20,009	
5月末日	11,903,909,246		20,036	
6月末日	12,479,614,439		19,703	
7月末日	12,919,052,143		20,263	
8月末日	13,061,556,253		20,377	

9月末日	12,572,490,132		19,563	
------	----------------	--	--------	--

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	0
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	0
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	0
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	0
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	0
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	0
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	0
第16期計算期間	2021年 2月23日～2022年 2月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	19.5
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	22.3
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	19.1
第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	8.8
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	15.2
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	10.0
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	0.8
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	9.4
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	11.0
第16期計算期間	2021年 2月23日～2022年 2月21日	5.6
第17期中間計算期間	2022年 2月22日～2022年 8月21日	6.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第7期計算期間	2012年 2月22日～2013年 2月21日	336,941,132	131,115,473	1,526,430,011
第8期計算期間	2013年 2月22日～2014年 2月21日	749,827,425	256,234,473	2,020,022,963
第9期計算期間	2014年 2月22日～2015年 2月23日	1,564,258,884	299,743,427	3,284,538,420

第10期計算期間	2015年 2月24日～2016年 2月22日	721,489,462	400,760,508	3,605,267,374
第11期計算期間	2016年 2月23日～2017年 2月21日	578,597,748	280,214,854	3,903,650,268
第12期計算期間	2017年 2月22日～2018年 2月21日	820,305,427	469,118,909	4,254,836,786
第13期計算期間	2018年 2月22日～2019年 2月21日	752,735,309	356,104,678	4,651,467,417
第14期計算期間	2019年 2月22日～2020年 2月21日	795,085,220	448,783,440	4,997,769,197
第15期計算期間	2020年 2月22日～2021年 2月22日	1,035,869,348	602,091,038	5,431,547,507
第16期計算期間	2021年 2月23日～2022年 2月21日	999,992,239	580,045,869	5,851,493,877
第17期中間計算期間	2022年 2月22日～2022年 8月21日	833,252,386	315,537,870	6,369,208,393

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

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	283,212,696,510	98.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,738,809,666	1.99
合計(純資産総額)		288,951,506,176	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,856,840,000	2.03

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	5,502,400	2,272.15	12,502,289,034	1,876.00	10,322,502,400	3.57

日本	株式	ソニーグループ	電気機器	756,100	12,696.34	9,599,708,975	9,286.00	7,021,144,600	2.43
日本	株式	キーエンス	電気機器	109,400	59,037.70	6,458,725,290	47,900.00	5,240,260,000	1.81
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,327,600	3,361.89	4,463,248,422	3,906.00	5,185,605,600	1.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,968,100	687.52	4,790,710,320	651.50	4,539,717,150	1.57
日本	株式	任天堂	その他製品	681,000	5,442.32	3,706,220,736	5,854.00	3,986,574,000	1.38
日本	株式	KDDI	情報・通信業	863,500	3,652.45	3,153,890,948	4,243.00	3,663,830,500	1.27
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	948,700	3,379.43	3,206,074,094	3,767.00	3,573,752,900	1.24
日本	株式	日立製作所	電気機器	580,500	6,302.93	3,658,855,375	6,114.00	3,549,177,000	1.23
日本	株式	第一三共	医薬品	875,500	2,627.65	2,300,510,596	4,042.00	3,538,771,000	1.22
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	710,200	5,348.32	3,798,382,604	4,900.00	3,479,980,000	1.20
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	826,300	5,898.13	4,873,625,894	4,161.00	3,438,234,300	1.19
日本	株式	HOYA	精密機器	230,000	14,617.08	3,361,928,400	13,880.00	3,192,400,000	1.10
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	772,500	4,163.90	3,216,619,448	4,024.00	3,108,540,000	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	779,500	3,877.14	3,022,230,800	3,968.00	3,093,056,000	1.07
日本	株式	ダイキン工業	機械	131,800	24,707.39	3,256,434,423	22,295.00	2,938,481,000	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	882,500	3,382.23	2,984,821,255	3,137.00	2,768,402,500	0.96
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	76,600	57,753.98	4,423,955,055	35,700.00	2,734,620,000	0.95
日本	株式	信越化学工業	化学	187,400	18,663.28	3,497,499,333	14,330.00	2,685,442,000	0.93
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,794,000	1,450.40	2,602,017,825	1,446.50	2,595,021,000	0.90
日本	株式	三井物産	卸売業	835,500	2,855.59	2,385,845,445	3,089.00	2,580,859,500	0.89
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	993,900	2,272.58	2,258,724,600	2,565.00	2,549,353,500	0.88
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	712,700	3,685.67	2,626,780,000	3,501.00	2,495,162,700	0.86
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	122,700	18,898.97	2,318,904,238	19,705.00	2,417,803,500	0.84
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	398,600	5,268.65	2,100,083,933	5,806.00	2,314,271,600	0.80
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,427,300	1,584.12	2,261,021,880	1,562.50	2,230,156,250	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	329,300	8,551.70	2,816,076,540	6,632.00	2,183,917,600	0.76
日本	株式	日本電産	電気機器	268,200	10,947.12	2,936,018,728	8,130.00	2,180,466,000	0.75
日本	株式	ファナック	電気機器	105,900	22,951.20	2,430,532,360	20,260.00	2,145,534,000	0.74
日本	株式	S M C	機械	35,300	65,264.99	2,303,854,280	58,220.00	2,055,166,000	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。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	2.22
		食料品	3.51
		繊維製品	0.46

パルプ・紙	0.18
化学	6.03
医薬品	5.61
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	5.11
電気機器	16.24
輸送用機器	7.45
精密機器	2.79
その他製品	2.51
電気・ガス業	1.23
陸運業	3.29
海運業	0.50
空運業	0.48
倉庫・運輸関連業	0.16
情報・通信業	9.08
卸売業	5.54
小売業	4.60
銀行業	5.24
証券、商品先物取引業	0.72
保険業	2.22
その他金融業	1.12
不動産業	1.99
サービス業	5.36
小計	98.01
合計	98.01

(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	319円		5,918,552,350	5,856,840,000	2.03

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

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

日本債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	322,792,921,790	84.15
地方債証券	日本	20,062,104,043	5.23
特殊債証券	日本	22,711,141,973	5.92
社債券	日本	16,694,738,000	4.35
	フランス	398,133,000	0.10
	スペイン	199,066,000	0.05
	小計	17,291,937,000	4.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		728,719,533	0.19
合計(純資産総額)		383,586,824,339	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367回利付国債(10年)	3,960,000,000	99.84	3,953,684,750	99.57	3,943,090,800	0.200	2032/6/20	1.03
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	3,560,000,000	100.33	3,571,854,800	100.24	3,568,650,800	0.100	2023/12/20	0.93
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	3,450,000,000	100.73	3,475,461,000	99.97	3,449,034,000	0.100	2028/3/20	0.90
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	3,410,000,000	101.48	3,460,536,200	101.10	3,447,782,800	0.400	2025/3/20	0.90
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	3,425,000,000	100.69	3,448,838,000	100.28	3,434,898,250	0.100	2027/3/20	0.90
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	3,330,000,000	100.20	3,336,660,000	100.00	3,330,000,000	0.005	2026/9/20	0.87
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,240,000,000	101.70	3,295,144,800	101.30	3,282,282,000	0.400	2025/9/20	0.86
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	3,240,000,000	100.67	3,261,708,000	100.37	3,252,182,400	0.100	2026/9/20	0.85
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	3,295,000,000	99.90	3,291,705,000	98.46	3,244,553,550	0.100	2031/6/20	0.85
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	3,205,000,000	100.70	3,227,435,000	100.18	3,210,993,350	0.100	2027/6/20	0.84

日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	3,190,000,000	100.64	3,210,543,600	100.43	3,203,780,800	0.100	2026/3/20	0.84
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	3,180,000,000	100.63	3,200,151,600	100.33	3,190,684,800	0.100	2026/12/20	0.83
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	3,220,000,000	99.01	3,188,204,800	98.69	3,177,914,600	0.100	2031/12/20	0.83
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	3,110,000,000	100.54	3,127,019,900	99.61	3,098,057,600	0.100	2029/3/20	0.81
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	3,010,000,000	101.61	3,058,461,000	101.12	3,043,772,200	0.600	2024/6/20	0.79
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	3,020,000,000	100.73	3,042,046,000	100.12	3,023,714,600	0.100	2027/9/20	0.79
日本	国債証券	第150回利付国債（5年）	2,960,000,000	99.97	2,959,112,000	99.93	2,958,105,600	0.005	2026/12/20	0.77
日本	国債証券	第141回利付国債（5年）	2,918,000,000	100.44	2,930,839,200	100.29	2,926,578,920	0.100	2024/9/20	0.76
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	2,905,000,000	100.60	2,922,430,000	100.41	2,917,055,750	0.100	2025/9/20	0.76
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	2,895,000,000	100.66	2,914,107,000	100.40	2,906,811,600	0.100	2026/6/20	0.76
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	2,930,000,000	100.22	2,936,446,000	98.63	2,889,946,900	0.100	2030/12/20	0.75
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	2,845,000,000	101.54	2,889,035,800	101.20	2,879,367,600	0.400	2025/6/20	0.75
日本	国債証券	第153回利付国債（5年）	2,885,000,000	99.96	2,884,012,800	99.71	2,876,864,300	0.005	2027/6/20	0.75
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	2,870,000,000	100.69	2,889,803,000	99.72	2,862,021,400	0.100	2028/12/20	0.75
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	2,865,000,000	100.30	2,873,595,000	98.75	2,829,216,150	0.100	2030/9/20	0.74
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	2,790,000,000	100.56	2,805,624,000	100.39	2,800,964,700	0.100	2025/6/20	0.73
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	2,810,000,000	100.56	2,825,759,300	99.50	2,796,006,200	0.100	2029/6/20	0.73
日本	国債証券	第362回利付国債（10年）	2,835,000,000	99.50	2,820,920,050	98.55	2,793,977,550	0.100	2031/3/20	0.73
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	2,735,000,000	100.73	2,755,184,300	100.05	2,736,394,850	0.100	2027/12/20	0.71
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	2,730,000,000	100.73	2,749,929,000	99.79	2,724,321,600	0.100	2028/9/20	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。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	84.15
地方債証券	5.23
特殊債券	5.92
社債券	4.51
合計	99.81

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	224,448,972,787	67.55
	イギリス	13,428,432,228	4.04
	カナダ	12,204,956,951	3.67
	スイス	10,585,681,976	3.19
	フランス	9,252,099,159	2.78
	オーストラリア	6,811,819,634	2.05
	ドイツ	6,666,280,092	2.01
	アイルランド	5,604,659,363	1.69
	オランダ	5,294,848,360	1.59
	スウェーデン	2,796,563,322	0.84
	デンマーク	2,355,815,296	0.71
	スペイン	2,158,774,062	0.65
	香港	1,966,296,373	0.59
	イタリア	1,488,863,311	0.45
	フィンランド	1,136,013,208	0.34
	シンガポール	1,094,036,419	0.33
	ジャージー	984,513,328	0.30
	イスラエル	767,126,720	0.23
	ベルギー	726,807,022	0.22
	ノルウェー	721,169,631	0.22
	ケイマン	642,517,635	0.19
	バミューダ	457,876,580	0.14
	キュラソー	362,945,069	0.11
ニュージーランド	226,456,922	0.07	
ルクセンブルク	206,682,909	0.06	
ポルトガル	157,097,300	0.05	

	オーストリア	149,538,066	0.05
	パナマ	76,323,159	0.02
	リベリア	67,119,499	0.02
	マン島	47,800,499	0.01
	小計	312,888,086,880	94.16
投資信託受益証券	オーストラリア	90,030,417	0.03
	香港	45,180,360	0.01
	アメリカ	10,450,430	0.00
	小計	145,661,207	0.04
投資証券	アメリカ	6,471,715,704	1.95
	オーストラリア	362,780,775	0.11
	シンガポール	158,259,645	0.05
	イギリス	120,959,452	0.04
	香港	107,898,367	0.03
	フランス	98,393,266	0.03
	カナダ	38,957,228	0.01
	ベルギー	24,444,727	0.01
	小計	7,383,409,164	2.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,859,272,464	3.57
合計(純資産総額)		332,276,429,715	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	8,757,795,648	2.64
	買建	カナダ	614,913,832	0.19
	買建	ドイツ	1,977,662,484	0.60
	買建	イギリス	211,308,203	0.06
	買建	オーストラリア	385,331,868	0.12

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,667,120,585	0.50

(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	824,743	24,878.83	20,518,646,073	20,632.52	17,016,533,700	5.12
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	362,124	44,057.53	15,954,289,072	34,392.37	12,454,304,405	3.75
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	466,920	22,587.39	10,546,508,532	16,624.18	7,762,165,861	2.34
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	134,797	44,025.97	5,934,569,892	38,839.49	5,235,446,747	1.58
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	307,020	20,529.34	6,302,918,332	14,107.39	4,331,250,939	1.30
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	287,940	20,559.72	5,919,966,666	14,204.41	4,090,018,650	1.23
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	47,911	70,124.72	3,359,745,553	73,683.67	3,530,258,424	1.06
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	134,458	24,822.39	3,337,569,761	23,825.58	3,203,541,086	0.96
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	215,256	11,883.16	2,557,923,499	12,841.75	2,764,263,910	0.83
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	65,737	45,494.05	2,990,642,539	39,037.87	2,566,233,104	0.77
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	117,268	34,076.67	3,996,102,986	19,753.53	2,316,457,202	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	150,220	21,896.87	3,289,348,240	15,373.02	2,309,336,507	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	122,711	23,267.80	2,855,216,212	18,637.04	2,286,970,674	0.69
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	144,118	17,671.46	2,546,775,920	15,832.68	2,281,774,868	0.69

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	127,987	34,673.26	4,437,726,665	17,695.78	2,264,830,051	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	84,171	32,944.30	2,772,954,986	26,074.48	2,194,715,780	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	52,579	51,758.94	2,721,433,324	40,304.96	2,119,194,876	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	95,575	19,844.76	1,896,663,166	20,964.14	2,003,648,034	0.60
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	41,362	35,459.98	1,466,695,807	47,788.74	1,976,638,199	0.59
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	90,539	20,375.88	1,844,812,663	20,667.28	1,871,195,154	0.56
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	44,462	55,064.62	2,448,283,350	41,527.16	1,846,380,752	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	287,342	7,644.00	2,196,442,958	6,394.80	1,837,497,380	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	210,913	8,839.62	1,864,392,381	8,191.90	1,727,778,563	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	36,040	51,121.42	1,842,416,143	47,582.74	1,714,882,130	0.52
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	70,838	24,944.17	1,766,995,121	24,126.79	1,709,093,840	0.51
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	371,469	6,920.74	2,570,843,935	4,439.87	1,649,275,778	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	129,630	11,436.62	1,482,529,358	12,546.33	1,626,381,847	0.49
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	22,698	75,115.52	1,704,972,180	69,361.09	1,574,358,107	0.47
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	20,060	85,795.45	1,721,056,746	74,810.29	1,500,694,500	0.45
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	77,661	20,121.55	1,562,659,738	19,151.12	1,487,295,324	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	5.26
		素材	3.95
		資本財	5.76
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.84

	自動車・自動車部品	2.33
	耐久消費財・アパレル	1.50
	消費者サービス	1.79
	メディア・娯楽	5.28
	小売	4.87
	食品・生活必需品小売り	1.54
	食品・飲料・タバコ	4.27
	家庭用品・パーソナル用品	1.75
	ヘルスケア機器・サービス	4.79
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.96
	銀行	5.66
	各種金融	4.46
	保険	3.06
	不動産	0.36
	ソフトウェア・サービス	10.56
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.50
	電気通信サービス	1.42
	公益事業	3.14
	半導体・半導体製造装置	3.92
	小計	94.16
投資信託受益証券		0.04
投資証券		2.22
合計		96.43

(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	331	アメリカドル	66,732,489.5	9,663,531,804	60,477,837.5	8,757,795,648	2.64
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	26	カナダドル	6,162,403	651,982,237	5,812,040	614,913,832	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	52	スイスフラン	5,585,884	829,950,644	5,265,520	782,350,961	0.24
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	257	ユーロ	9,048,906.5	1,287,840,373	8,398,760	1,195,311,523	0.36
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	25	オーストラリアドル	4,304,825	405,385,370	4,091,875	385,331,868	0.12

イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	19	イギリス ポンド	1,390,106.25	224,807,982	1,306,630	211,308,203	0.06
------	--------------------	----------	----	----	-------------	--------------	-------------	-----------	-------------	------

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	9,187,500.00	1,314,300,754	1,329,243,186	0.40
	カナダドル	買建	350,000.00	37,006,550	37,019,150	0.01
	ユーロ	買建	1,456,500.00	209,726,857	207,225,797	0.06
	イギリスポンド	買建	300,000.00	49,915,500	48,464,520	0.01
	スイスフラン	買建	175,200.00	25,857,943	26,030,532	0.01
	デンマーククローネ	買建	1,000,000.00	19,138,800	19,137,400	0.01

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

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

外国債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	80,410,261,643	51.67
	フランス	12,916,217,998	8.30
	イタリア	11,232,285,608	7.22
	ドイツ	9,593,700,328	6.17
	スペイン	7,563,048,267	4.86
	イギリス	6,357,808,200	4.09
	中国	4,464,432,608	2.87
	カナダ	3,174,516,748	2.04
	ベルギー	2,848,829,632	1.83
	オランダ	2,366,865,015	1.52
	オーストラリア	2,324,705,631	1.49
	オーストリア	1,804,079,902	1.16
	メキシコ	1,250,849,875	0.80
	アイルランド	973,792,890	0.63
	フィンランド	798,718,698	0.51
	マレーシア	785,313,718	0.50
	シンガポール	671,012,391	0.43

	ポーランド	638,608,971	0.41
	イスラエル	568,446,192	0.37
	デンマーク	543,238,142	0.35
	スウェーデン	383,044,433	0.25
	ノルウェー	309,469,440	0.20
	小計	151,979,246,330	97.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,634,959,301	2.34
合計(純資産総額)		155,614,205,631	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,110,156,475	0.71
	買建	ドイツ	891,525,925	0.57

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		2,278,536,445	1.46

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/25	10,770,000	14,424.26	1,553,493,743	14,006.97	1,508,551,053	2.875	2025/4/30	0.97
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	10,610,000	14,088.99	1,494,842,352	13,532.38	1,435,785,666	0.250	2024/6/15	0.92
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,110,000	13,414.55	1,624,502,776	11,802.01	1,429,224,016	1.375	2031/11/15	0.92
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	10,200,000	14,621.72	1,491,415,841	13,620.62	1,389,303,749	2.875	2028/8/15	0.89
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	13,455.16	1,076,413,276	13,125.10	1,050,008,262	0.375	2025/4/30	0.67
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	13,037.42	1,190,316,930	11,377.76	1,038,790,128	0.625	2030/8/15	0.67

アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/24	7,300,000	14,420.46	1,052,694,268	14,057.03	1,026,163,542	2.250	2024/3/31	0.66
アメリカ	国債証券	T 0.125% 08/31/23	7,080,000	14,047.73	994,579,432	13,953.23	987,889,070	0.125	2023/8/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	6,900,000	15,072.55	1,040,006,001	13,381.34	923,313,085	2.625	2029/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/25	7,000,000	13,762.60	963,382,470	12,886.39	902,047,508	0.250	2025/9/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/23	6,000,000	14,896.19	893,771,849	14,255.30	855,318,000	2.875	2023/11/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	13,080.41	967,950,768	11,442.25	846,726,697	0.625	2030/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	14,668.23	887,428,207	13,760.34	832,500,814	2.000	2025/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	6,000,000	14,227.29	853,637,573	13,446.96	806,817,966	2.750	2029/5/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.125% 01/15/25	5,830,000	13,960.69	813,908,674	13,503.53	787,255,945	1.125	2025/1/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	13,647.21	893,892,334	11,739.79	768,956,377	1.250	2031/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	14,433.48	829,925,343	13,325.91	766,240,058	1.625	2026/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	5,460,000	14,810.78	808,668,707	13,996.79	764,224,819	2.375	2024/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	14,778.53	812,819,666	13,659.09	751,249,958	2.250	2025/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	13,939.09	836,345,634	12,468.93	748,135,978	1.250	2028/5/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.375% 08/15/24	5,500,000	14,094.65	775,205,827	13,480.34	741,418,717	0.375	2024/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	5,090,000	14,746.57	750,600,882	14,107.94	718,094,376	2.250	2024/1/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	14,419.90	778,675,047	13,261.42	716,117,127	1.625	2026/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	13,288.58	818,576,538	11,570.09	712,717,717	0.875	2030/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	5,500,000	14,041.28	772,270,710	12,892.61	709,093,842	1.250	2026/12/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	5,230,000	14,180.63	741,647,071	13,466.19	704,282,194	0.750	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	14,805.69	778,779,358	13,285.75	698,830,548	2.250	2027/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	14,328.27	759,398,350	13,126.23	695,690,430	1.500	2026/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	6,940,000	13,658.90	947,927,899	10,019.04	695,321,506	2.000	2051/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	5,000,000	14,772.88	738,644,133	13,905.71	695,285,984	2.250	2024/11/15	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.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.66
合計	97.66

(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	28	アメリカ ドル	3,080,008.09	446,015,971	3,017,656.32	436,986,811	0.28
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	21	アメリカ ドル	2,433,308.87	352,367,457	2,361,515.73	341,971,093	0.22
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	18	アメリカ ドル	2,398,206.65	347,284,305	2,287,125	331,198,571	0.21

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	11	ユーロ	1,185,638.1	168,740,014	1,176,835	167,487,157	0.11
ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	15	ユーロ	1,828,431.5	260,222,371	1,787,400	254,382,768	0.16
ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	24	ユーロ	3,446,660.4	490,528,708	3,300,000	469,656,000	0.30

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

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


種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	8,650,000.00	1,234,662,370	1,250,965,595	0.80
	カナダドル	買建	850,000.00	92,182,155	89,807,175	0.06
	ユーロ	買建	5,410,000.00	772,843,007	769,682,323	0.49
	イギリスポンド	買建	590,000.00	96,837,401	95,313,556	0.06
	オフショア人民元	買建	3,580,000.00	73,151,298	72,767,796	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。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2022年9月30日

DCバランスファンド30

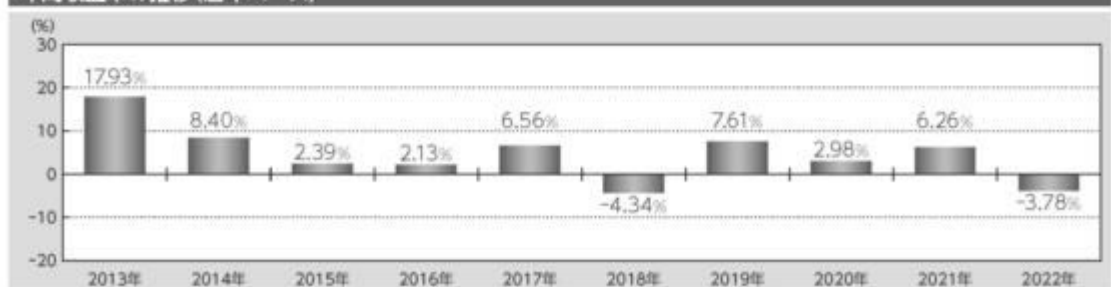
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	60.2%	第367回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/06/20	0.6%
		第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2023/12/20	0.6%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.5%
日本株式 マザーファンド	19.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
外国株式 マザーファンド	10.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.2%
外国債券 マザーファンド	9.7%	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	0.1%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンド内には、ベンチマークはありません。

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

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


運用実績

当初設定日：2006年9月29日

作成基準日：2022年9月30日

DCバランスファンド50

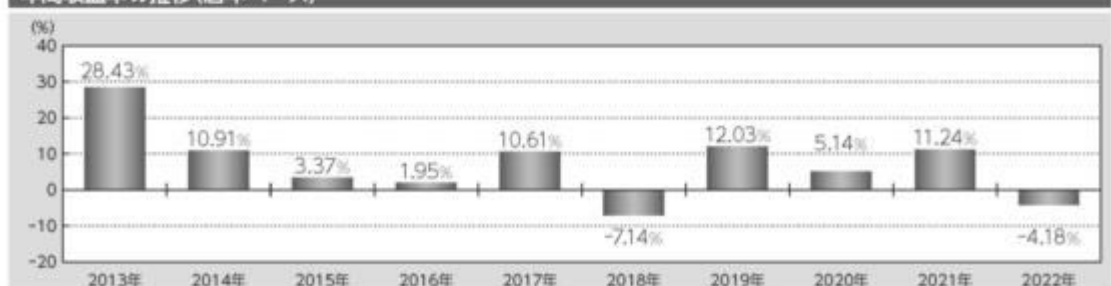
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	40.4%	第367回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/06/20	0.4%
		第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2023/12/20	0.4%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.4%
日本株式 マザーファンド	29.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
外国株式 マザーファンド	20.1%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ソフトウェア	-	-	1.0%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.5%
外国債券 マザーファンド	9.6%	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	0.1%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※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：2006年9月29日

作成基準日：2022年9月30日

DCバランスファンド70

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年2月	0円
2019年2月	0円
2020年2月	0円
2021年2月	0円
2022年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

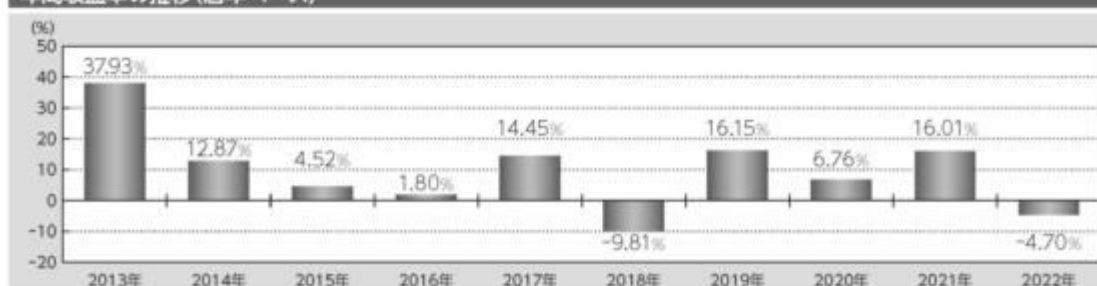
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式 マザーファンド	39.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.4%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.0%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
外国株式 マザーファンド	29.8%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/ハードウェア	-	-	1.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	1.1%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	0.7%
日本債券 マザーファンド	25.4%	第367回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/06/20	0.3%
		第138回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2023/12/20	0.2%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.2%
外国債券 マザーファンド	5.0%	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	0.0%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.0%
		T 0.25% 06/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/06/15	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※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 >

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

< 一部解約の制限 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3 【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

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

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

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

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

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2006年9月29日設定）

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

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

【DCバランスファンド30】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(2021年2月23日から2022年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期 (2022年 2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	125,750,521	107,067,401
親投資信託受益証券	22,592,800,568	24,590,802,639
未収入金	31,812,612	34,023,669
流動資産合計	22,750,363,701	24,731,893,709
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,121,376	12,989,427
未払受託者報酬	4,858,297	5,511,264
未払委託者報酬	20,647,746	23,422,802
未払利息	102	126
その他未払費用	607,228	688,846
流動負債合計	33,234,749	42,612,465
純資産の部		
元本等		
元本	14,863,838,450	15,901,033,161
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	7,853,290,502	8,788,248,083
(分配準備積立金)	3,643,228,795	3,737,419,952
元本等合計	22,717,128,952	24,689,281,244
純資産合計	22,717,128,952	24,689,281,244
負債純資産合計	22,750,363,701	24,731,893,709

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	2020年 2月22日	自	2021年 2月23日
	至	2021年 2月22日	至	2022年 2月21日
営業収益				
受取利息		795		587
有価証券売買等損益		960,224,011		408,470,787
営業収益合計		960,224,806		408,471,374
営業費用				
支払利息		55,864		51,573
受託者報酬		9,259,667		10,676,775
委託者報酬		39,353,501		45,376,177
その他費用		1,157,535		1,334,475
営業費用合計		49,826,567		57,439,000
営業利益又は営業損失（ ）		910,398,239		351,032,374
経常利益又は経常損失（ ）		910,398,239		351,032,374
当期純利益又は当期純損失（ ）		910,398,239		351,032,374
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（ ）		23,782,260		38,880,223
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,481,575,075		7,853,290,502
剰余金増加額又は欠損金減少額		907,140,214		1,132,511,128
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		907,140,214		1,132,511,128
剰余金減少額又は欠損金増加額		469,605,286		509,705,698
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		469,605,286		509,705,698
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,853,290,502		8,788,248,083

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は2021年 2月23日から2022年 2月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期 (2022年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,863,838,450口	15,901,033,161口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5283円 (15,283円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5527円 (15,527円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日			第16期 自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21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	262,799,454円	費用控除後の配当等収益額	A	249,080,960円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	671,381,045円	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	63,071,191円
収益調整金額	C	4,999,720,156円	収益調整金額	C	5,824,953,479円
分配準備積立金額	D	2,709,048,296円	分配準備積立金額	D	3,425,267,801円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,642,948,951円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,562,373,431円
当ファンドの期末残存口数	F	14,863,838,450口	当ファンドの期末残存口数	F	15,901,033,161口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,814円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,013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16期 自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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16期 (2022年 2月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第15期	第16期
	自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日	自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	13,829,328,777円	14,863,838,450円
期中追加設定元本額	2,046,783,461円	2,000,986,753円
期中一部解約元本額	1,012,273,788円	963,792,042円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第15期	第16期
	(2021年 2月22日現在)	(2022年 2月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,008,792,625	352,052,137
合計	1,008,792,625	352,052,137

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,264,651,448	4,895,270,569	
	日本債券マザーファンド	10,926,789,340	14,829,838,492	
	外国株式マザーファンド	598,190,204	2,552,597,238	
	外国債券マザーファンド	885,327,952	2,313,096,340	
合計		14,674,958,944	24,590,802,639	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【DCバランスファンド50】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(2021年2月23日から2022年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期 (2022年 2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	130,221,320	104,022,579
親投資信託受益証券	23,567,577,711	25,745,695,813
未収入金	32,944,564	36,534,439
流動資産合計	23,730,743,595	25,886,252,831
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,708,179	4,213,769
未払受託者報酬	4,946,208	5,804,985
未払委託者報酬	22,257,867	26,122,405
未払利息	105	122
その他未払費用	618,211	725,560
流動負債合計	37,530,570	36,866,841
純資産の部		
元本等		
元本	13,793,194,595	14,511,741,058
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	9,900,018,430	11,337,644,932
(分配準備積立金)	5,788,761,649	6,210,096,248
元本等合計	23,693,213,025	25,849,385,990
純資産合計	23,693,213,025	25,849,385,990
負債純資産合計	23,730,743,595	25,886,252,831

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	2020年 2月22日	自	2021年 2月23日
	至	2021年 2月22日	至	2022年 2月21日
営業収益				
受取利息		865		590
有価証券売買等損益		1,770,756,091		939,862,380
営業収益合計		1,770,756,956		939,862,970
営業費用				
支払利息		58,570		51,583
受託者報酬		9,271,915		11,206,793
委託者報酬		41,723,485		50,430,509
その他費用		1,159,105		1,400,726
営業費用合計		52,213,075		63,089,611
営業利益又は営業損失（ ）		1,718,543,881		876,773,359
経常利益又は経常損失（ ）		1,718,543,881		876,773,359
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,718,543,881		876,773,359
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（ ）		49,206,265		73,305,104
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		7,717,612,690		9,900,018,430
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,070,164,323		1,337,132,196
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,070,164,323		1,337,132,196
剰余金減少額又は欠損金増加額		655,508,729		702,973,949
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		655,508,729		702,973,949
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,900,018,430		11,337,644,932

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は2021年 2月23日から2022年 2月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期 (2022年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	13,793,194,595口	14,511,741,058口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7177円 (17,177円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7813円 (17,813円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日			第16期 自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21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	316,242,881円	費用控除後の配当等収益額	A	336,506,485円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,451,507,265円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	466,961,770円
収益調整金額	C	6,465,247,784円	収益調整金額	C	7,490,817,517円
分配準備積立金額	D	4,021,011,503円	分配準備積立金額	D	5,406,627,993円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,254,009,433円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,700,913,765円
当ファンドの期末残存口数	F	13,793,194,595口	当ファンドの期末残存口数	F	14,511,741,058口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	8,884円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	9,441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
収益分配金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金額	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16期 自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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16期 (2022年 2月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第15期	第16期
	自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日	自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	12,979,122,227円	13,793,194,595円
期中追加設定元本額	1,929,479,800円	1,696,091,500円
期中一部解約元本額	1,115,407,432円	977,545,037円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期 (2022年 2月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,835,273,251	836,564,304
合計	1,835,273,251	836,564,304

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,555,577,270	7,685,735,826	
	日本債券マザーファンド	7,680,769,971	10,424,341,004	
	外国株式マザーファンド	1,230,859,401	5,252,323,235	
	外国債券マザーファンド	912,196,482	2,383,295,748	
合計		13,379,403,124	25,745,695,813	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【DCバランスファンド70】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(2021年2月23日から2022年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期 (2022年 2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	76,047,001	53,755,933
親投資信託受益証券	10,022,653,303	11,409,032,905
未収入金	447,319	16,846,615
流動資産合計	10,099,147,623	11,479,635,453
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,261,819	9,455,978
未払受託者報酬	2,048,759	2,553,207
未払委託者報酬	9,731,530	12,127,656
未払利息	61	63
その他未払費用	256,033	319,085
流動負債合計	26,298,202	24,455,989
純資産の部		
元本等		
元本	5,431,547,507	5,851,493,877
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,641,301,914	5,603,685,587
(分配準備積立金)	2,742,201,556	2,975,107,003
元本等合計	10,072,849,421	11,455,179,464
純資産合計	10,072,849,421	11,455,179,464
負債純資産合計	10,099,147,623	11,479,635,453

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期		第16期	
	自	2020年 2月22日	自	2021年 2月23日
	至	2021年 2月22日	至	2022年 2月21日
営業収益				
受取利息		372		267
有価証券売買等損益		1,039,930,398		587,697,605
営業収益合計		1,039,930,770		587,697,872
営業費用				
支払利息		23,380		24,375
受託者報酬		3,762,922		4,877,317
委託者報酬		17,873,758		23,167,134
その他費用		470,296		609,533
営業費用合計		22,130,356		28,678,359
営業利益又は営業損失()		1,017,800,414		559,019,513
経常利益又は経常損失()		1,017,800,414		559,019,513
当期純利益又は当期純損失()		1,017,800,414		559,019,513
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()		28,956,331		59,759,047
期首剰余金又は期首欠損金()		3,351,525,267		4,641,301,914
剰余金増加額又は欠損金減少額		639,422,322		961,269,854
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		639,422,322		961,269,854
剰余金減少額又は欠損金増加額		396,402,420		498,146,647
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		396,402,420		498,146,647
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		4,641,301,914		5,603,685,587

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は2021年 2月23日から2022年 2月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期 (2022年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,431,547,507口	5,851,493,877口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8545円 (18,545円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9577円 (19,577円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日			第16期 自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21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	143,577,709円	費用控除後の配当等収益額	A	165,209,540円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	903,179,036円	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	334,050,926円
収益調整金額	C	3,078,538,862円	収益調整金額	C	3,798,541,598円
分配準備積立金額	D	1,695,444,811円	分配準備積立金額	D	2,475,846,537円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,820,740,418円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,773,648,601円
当ファンドの期末残存口数	F	5,431,547,507口	当ファンドの期末残存口数	F	5,851,493,877口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	10,716円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	11,575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16期 自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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16期 (2022年 2月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第15期	第16期
	自 2020年 2月22日 至 2021年 2月22日	自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,997,769,197円	5,431,547,507円
期中追加設定元本額	1,035,869,348円	999,992,239円
期中一部解約元本額	602,091,038円	580,045,869円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第15期 (2021年 2月22日現在)	第16期 (2022年 2月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,085,524,179	542,795,769
合計	1,085,524,179	542,795,769

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,107,391,900	4,555,338,331	
	日本債券マザーファンド	2,113,091,767	2,867,888,146	
	外国株式マザーファンド	804,289,050	3,432,062,234	
	外国債券マザーファンド	211,943,275	553,744,194	
合計		5,236,715,992	11,409,032,905	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,932,695,343
株式	287,749,467,590
派生商品評価勘定	20,727,400
未収入金	5,880,000
未収配当金	451,955,241
差入委託証拠金	84,244,200
流動資産合計	290,244,969,774
資産合計	290,244,969,774
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,964,100
前受金	8,776,500
未払金	3,251,400
未払解約金	167,414,112
未払利息	2,282
流動負債合計	191,408,394
負債合計	191,408,394
純資産の部	
元本等	
元本	134,184,060,378

	2022年 2月21日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	155,869,501,002
元本等合計	290,053,561,380
純資産合計	290,053,561,380
負債純資産合計	290,244,969,774

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 2月21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 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	134,184,060,378口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.1616円 (1万口当たり純資産額) (21,616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 2月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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 2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

	2022年 2月21日現在

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月23日
期首元本額	134,423,726,662円
期中追加設定元本額	9,526,219,035円
期中一部解約元本額	9,765,885,319円
期末元本額	134,184,060,378円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	608,604,567円
D C 日本株式インデックスファンド	304,783,251円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,596,353,813円
D C 日本株式インデックスファンド A	667,227,093円
D C バランスファンド 3 0	2,264,651,448円
D C バランスファンド 5 0	3,555,577,270円
D C バランスファンド 7 0	2,107,391,900円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	570,270,818円
日本株式インデックス e	1,470,128,510円
インデックスコレクション（国内株式）	20,674,968,392円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	12,073,487,360円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,748,749,375円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	2,445,074,554円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,485,547,237円
日本株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	2,741,972,522円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,018,535,021円

区分	2022年 2月21日現在
バランスVA30（適格機関投資家専用）	49,588,428円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	568,665,354円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	71,112,786円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	137,040,978円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	140,828,025円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	747,116,078円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	437,087,014円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	7,609,061,389円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	724,213,833円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	78,230,171円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,287,291,138円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	28,933,524円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	154,218,318円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,981,053,450円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	59,191,256円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	59,810,379円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	22,574,260円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	602,738,620円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	268,686,820円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	4,556,809,665円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	86,265,108円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	35,564,611円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	7,827,604円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	133,342,143円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	3,486,295円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,858,715,340
合計	2,858,715,340

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 2月21日現在）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,113,543,500	-	2,122,320,000	8,776,500
合計		2,113,543,500	-	2,122,320,000	8,776,500

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,200	3,205.00	16,666,000	
日本水産	149,700	550.00	82,335,000	
マルハニチロ	23,400	2,579.00	60,348,600	
雪国まいたけ	10,900	1,221.00	13,308,900	
カネコ種苗	4,500	1,546.00	6,957,000	
サカタのタネ	17,800	3,400.00	60,520,000	
ホクト	12,600	1,959.00	24,683,400	
ホクリヨウ	2,000	687.00	1,374,000	
住石ホールディングス	26,200	137.00	3,589,400	
日鉄鉱業	3,400	6,370.00	21,658,000	
三井松島ホールディングス	6,300	1,638.00	10,319,400	
I N P E X	600,400	1,127.00	676,650,800	
石油資源開発	17,600	2,680.00	47,168,000	
K & O エナジーグループ	6,800	1,584.00	10,771,200	
ヒノキヤグループ	3,300	2,384.00	7,867,200	
ショーボンドホールディングス	21,400	5,230.00	111,922,000	
ミライト・ホールディングス	48,200	1,935.00	93,267,000	
タマホーム	9,100	2,289.00	20,829,900	
サンヨーホームズ	1,700	752.00	1,278,400	
日本アクア	5,900	588.00	3,469,200	
ファーストコーポレーション	4,600	732.00	3,367,200	
ベステラ	3,000	1,277.00	3,831,000	
R o b o t H o m e	24,900	206.00	5,129,400	
キャンディル	2,600	493.00	1,281,800	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	1,145.00	3,320,500	

第一カッター興業	3,700	1,309.00	4,843,300
安藤・間	74,300	934.00	69,396,200
東急建設	43,800	729.00	31,930,200
コムシスホールディングス	48,200	2,800.00	134,960,000
ビーアールホールディングス	20,400	345.00	7,038,000
高松コンストラクショングループ	9,300	1,999.00	18,590,700
東建コーポレーション	4,600	9,220.00	42,412,000
ソネック	1,500	1,030.00	1,545,000
ヤマウラ	7,200	994.00	7,156,800
オリエンタル白石	50,300	242.00	12,172,600
大成建設	99,900	3,805.00	380,119,500
大林組	345,600	969.00	334,886,400
清水建設	323,800	780.00	252,564,000
飛鳥建設	9,300	1,128.00	10,490,400
長谷工コーポレーション	102,900	1,512.00	155,584,800
松井建設	13,600	741.00	10,077,600
銭高組	1,500	4,085.00	6,127,500
鹿島建設	253,200	1,565.00	396,258,000
不動テトラ	7,300	1,550.00	11,315,000
大末建設	3,600	1,323.00	4,762,800
鉄建建設	7,500	1,924.00	14,430,000
西松建設	20,900	3,875.00	80,987,500
三井住友建設	77,900	448.00	34,899,200
大豊建設	5,000	3,675.00	18,375,000
佐田建設	7,400	474.00	3,507,600
ナカノフドー建設	8,300	343.00	2,846,900
奥村組	20,400	3,225.00	65,790,000
東鉄工業	16,100	2,526.00	40,668,600
イチケン	2,500	1,844.00	4,610,000
富士ピー・エス	4,500	494.00	2,223,000
浅沼組	3,900	5,320.00	20,748,000
戸田建設	143,500	769.00	110,351,500
熊谷組	17,600	2,877.00	50,635,200
北野建設	2,100	2,149.00	4,512,900
植木組	3,100	1,504.00	4,662,400
矢作建設工業	15,300	783.00	11,979,900
ピーエス三菱	11,400	611.00	6,965,400
日本ハウスホールディングス	23,600	454.00	10,714,400
大東建託	35,400	12,760.00	451,704,000
新日本建設	14,700	743.00	10,922,100
東亜道路工業	1,800	5,020.00	9,036,000
日本道路	3,300	9,890.00	32,637,000

東亜建設工業	8,500	2,673.00	22,720,500
日本国土開発	33,600	532.00	17,875,200
若築建設	5,800	1,898.00	11,008,400
東洋建設	38,700	592.00	22,910,400
五洋建設	137,000	621.00	85,077,000
世紀東急工業	16,600	818.00	13,578,800
福田組	3,700	4,220.00	15,614,000
住友林業	88,400	2,270.00	200,668,000
日本基礎技術	9,500	666.00	6,327,000
巴コーポレーション	15,300	503.00	7,695,900
大和ハウス工業	319,200	3,352.00	1,069,958,400
ライト工業	21,800	1,942.00	42,335,600
積水ハウス	374,800	2,373.50	889,587,800
日特建設	7,100	736.00	5,225,600
北陸電気工事	7,200	805.00	5,796,000
ユアテック	19,800	713.00	14,117,400
日本リーテック	7,200	1,438.00	10,353,600
四電工	3,800	1,599.00	6,076,200
中電工	15,900	2,152.00	34,216,800
関電工	56,200	878.00	49,343,600
きんでん	77,200	1,635.00	126,222,000
東京エネシス	11,500	945.00	10,867,500
トーエネック	3,500	3,330.00	11,655,000
住友電設	8,500	2,241.00	19,048,500
日本電設工業	19,000	1,537.00	29,203,000
エクシオグループ	52,000	2,391.00	124,332,000
新日本空調	9,100	2,036.00	18,527,600
九電工	26,700	3,110.00	83,037,000
三機工業	22,500	1,502.00	33,795,000
日揮ホールディングス	106,500	1,093.00	116,404,500
中外炉工業	3,500	1,581.00	5,533,500
ヤマト	10,100	708.00	7,150,800
太平電業	7,700	2,688.00	20,697,600
高砂熱学工業	31,200	1,985.00	61,932,000
三晃金属工業	1,400	2,527.00	3,537,800
朝日工業社	2,300	3,045.00	7,003,500
明星工業	22,400	724.00	16,217,600
大気社	16,800	3,065.00	51,492,000
ダイダン	7,700	2,307.00	17,763,900
日比谷総合設備	11,100	1,888.00	20,956,800
フィル・カンパニー	2,000	1,131.00	2,262,000
テスホールディングス	6,300	1,253.00	7,893,900

インフロニア・ホールディングス	147,400	1,060.00	156,244,000
東洋エンジニアリング	14,500	566.00	8,207,000
レイズネクスト	16,700	1,120.00	18,704,000
ニッポン	32,400	1,696.00	54,950,400
日清製粉グループ本社	125,000	1,654.00	206,750,000
日東富士製粉	1,600	4,250.00	6,800,000
昭和産業	10,500	2,700.00	28,350,000
鳥越製粉	9,800	669.00	6,556,200
中部飼料	12,500	1,042.00	13,025,000
フィード・ワン	14,900	682.00	10,161,800
東洋精糖	1,900	1,100.00	2,090,000
日本甜菜製糖	5,800	1,701.00	9,865,800
D M三井製糖ホールディングス	10,100	1,999.00	20,189,900
塩水港精糖	13,200	217.00	2,864,400
日新製糖	5,200	1,795.00	9,334,000
森永製菓	26,000	3,610.00	93,860,000
中村屋	2,700	3,375.00	9,112,500
江崎グリコ	30,500	3,875.00	118,187,500
名糖産業	4,900	1,676.00	8,212,400
井村屋グループ	6,300	2,256.00	14,212,800
不二家	6,200	2,517.00	15,605,400
山崎製パン	82,900	1,542.00	127,831,800
第一屋製パン	2,100	549.00	1,152,900
モロゾフ	3,600	2,731.00	9,831,600
亀田製菓	6,300	4,115.00	25,924,500
寿スピリッツ	10,600	6,220.00	65,932,000
カルビー	50,400	2,564.00	129,225,600
森永乳業	20,500	5,610.00	115,005,000
六甲バター	8,100	1,565.00	12,676,500
ヤクルト本社	81,900	6,160.00	504,504,000
明治ホールディングス	73,100	6,870.00	502,197,000
雪印メグミルク	26,600	1,992.00	52,987,200
プリマハム	13,800	2,428.00	33,506,400
日本ハム	42,300	4,400.00	186,120,000
林兼産業	3,400	502.00	1,706,800
丸大食品	10,900	1,513.00	16,491,700
S Foods	9,900	3,220.00	31,878,000
柿安本店	3,800	2,567.00	9,754,600
伊藤ハム米久ホールディングス	71,200	689.00	49,056,800
サッポロホールディングス	37,700	2,408.00	90,781,600
アサヒグループホールディングス	260,200	5,115.00	1,330,923,000
キリンホールディングス	406,600	2,012.00	818,079,200

宝ホールディングス	75,200	1,176.00	88,435,200
オエノンホールディングス	31,400	346.00	10,864,400
養命酒製造	3,400	1,775.00	6,035,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	77,600	1,517.00	117,719,200
サントリー食品インターナショナル	74,000	4,685.00	346,690,000
ダイドグループホールディングス	5,700	5,200.00	29,640,000
伊藤園	33,600	6,710.00	225,456,000
キーコーヒー	10,900	2,071.00	22,573,900
ユニカフェ	3,300	971.00	3,204,300
ジャパンフーズ	1,600	1,233.00	1,972,800
日清オイリオグループ	13,800	2,995.00	41,331,000
不二製油グループ本社	24,000	2,236.00	53,664,000
かどや製油	1,200	3,630.00	4,356,000
J - オイルミルズ	10,300	1,742.00	17,942,600
キッコーマン	79,600	8,990.00	715,604,000
味の素	244,300	3,324.00	812,053,200
ブルドックソース	4,700	2,005.00	9,423,500
キューピー	58,100	2,441.00	141,822,100
ハウス食品グループ本社	41,400	3,015.00	124,821,000
カゴメ	42,000	3,035.00	127,470,000
焼津水産化学工業	5,400	917.00	4,951,800
アリアケジャパン	10,100	5,740.00	57,974,000
ピエトロ	1,400	1,805.00	2,527,000
エバラ食品工業	2,400	2,799.00	6,717,600
やまみ	1,200	1,838.00	2,205,600
ニチレイ	50,400	2,579.00	129,981,600
東洋水産	53,100	4,925.00	261,517,500
イトアンドホールディングス	4,200	2,299.00	9,655,800
大冷	1,200	1,888.00	2,265,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,700	511.00	2,912,700
日清食品ホールディングス	43,400	9,200.00	399,280,000
永谷園ホールディングス	4,900	2,015.00	9,873,500
一正蒲鉾	4,300	797.00	3,427,100
フジッコ	10,300	1,956.00	20,146,800
ロック・フィールド	11,900	1,590.00	18,921,000
日本たばこ産業	593,100	2,323.00	1,377,771,300
ケンコーマヨネーズ	6,200	1,406.00	8,717,200
わらべや日洋ホールディングス	7,200	1,833.00	13,197,600
なとり	6,200	2,070.00	12,834,000
イフジ産業	1,900	952.00	1,808,800
ピクルスコーポレーション	5,300	1,512.00	8,013,600
ファーマフーズ	10,400	1,565.00	16,276,000

ユーグレナ	56,300	754.00	42,450,200
紀文食品	6,400	1,192.00	7,628,800
ミヨシ油脂	4,200	1,135.00	4,767,000
理研ビタミン	11,500	1,780.00	20,470,000
片倉工業	12,200	2,289.00	27,925,800
グンゼ	7,300	3,840.00	28,032,000
東洋紡	42,900	1,251.00	53,667,900
ユニチカ	30,600	309.00	9,455,400
富士紡ホールディングス	4,900	3,620.00	17,738,000
倉敷紡績	9,400	1,911.00	17,963,400
シキボウ	5,700	912.00	5,198,400
日本毛織	32,900	893.00	29,379,700
トーア紡コーポレーション	4,000	407.00	1,628,000
帝国繊維	12,300	1,908.00	23,468,400
帝人	101,800	1,418.00	144,352,400
東レ	781,900	660.00	516,054,000
住江織物	2,400	1,951.00	4,682,400
日本フェルト	6,700	450.00	3,015,000
イチカワ	1,600	1,412.00	2,259,200
日東製網	1,200	1,457.00	1,748,400
アツギ	8,500	609.00	5,176,500
ダイニック	4,100	754.00	3,091,400
セーレン	22,200	2,223.00	49,350,600
ソトー	4,100	837.00	3,431,700
東海染工	1,300	1,165.00	1,514,500
小松マテーレ	17,800	1,292.00	22,997,600
ワコールホールディングス	27,000	2,013.00	54,351,000
ホギメディカル	14,600	3,300.00	48,180,000
T S Iホールディングス	36,400	320.00	11,648,000
マツオカコーポレーション	3,500	1,163.00	4,070,500
ワールド	14,200	1,234.00	17,522,800
三陽商会	5,200	875.00	4,550,000
ナイガイ	4,000	281.00	1,124,000
オンワードホールディングス	65,200	292.00	19,038,400
ルックホールディングス	3,500	1,585.00	5,547,500
ゴールドウイン	19,500	5,990.00	116,805,000
デサント	21,100	2,880.00	60,768,000
キング	5,300	529.00	2,803,700
ヤマトインターナショナル	9,900	292.00	2,890,800
特種東海製紙	6,600	4,105.00	27,093,000
王子ホールディングス	451,200	606.00	273,427,200
日本製紙	51,700	1,148.00	59,351,600

三菱製紙	15,300	315.00	4,819,500
北越コーポレーション	70,800	752.00	53,241,600
中越パルプ工業	4,100	990.00	4,059,000
巴川製紙所	3,200	884.00	2,828,800
大王製紙	52,000	1,777.00	92,404,000
阿波製紙	2,800	330.00	924,000
レンゴー	102,000	861.00	87,822,000
トモク	6,600	1,729.00	11,411,400
ザ・パック	8,200	2,700.00	22,140,000
北の達人コーポレーション	38,600	221.00	8,530,600
クラレ	157,900	1,084.00	171,163,600
旭化成	715,500	1,090.00	779,895,000
共和レザー	6,700	674.00	4,515,800
昭和電工	93,600	2,239.00	209,570,400
住友化学	793,000	549.00	435,357,000
住友精化	4,800	3,300.00	15,840,000
日産化学	58,700	6,490.00	380,963,000
ラサ工業	3,800	1,593.00	6,053,400
クレハ	8,500	8,920.00	75,820,000
多木化学	4,200	4,705.00	19,761,000
テイカ	7,900	1,318.00	10,412,200
石原産業	18,000	1,034.00	18,612,000
片倉コープアグリ	2,400	1,177.00	2,824,800
日本曹達	13,800	3,355.00	46,299,000
東ソー	155,700	1,830.00	284,931,000
トクヤマ	34,500	1,832.00	63,204,000
セントラル硝子	17,600	2,062.00	36,291,200
東亜合成	61,500	1,074.00	66,051,000
大阪ソーダ	10,100	3,120.00	31,512,000
関東電化工業	23,600	1,181.00	27,871,600
デンカ	39,400	3,525.00	138,885,000
信越化学工業	185,300	17,510.00	3,244,603,000
日本カーバイド工業	3,800	1,444.00	5,487,200
堺化学工業	7,600	1,996.00	15,169,600
第一稀元素化学工業	10,000	988.00	9,880,000
エア・ウォーター	102,200	1,677.00	171,389,400
日本酸素ホールディングス	103,700	2,272.00	235,606,400
日本化学工業	3,400	2,460.00	8,364,000
東邦アセチレン	1,800	1,214.00	2,185,200
日本パーカライズニング	54,400	997.00	54,236,800
高圧ガス工業	17,100	689.00	11,781,900
チタン工業	1,200	1,660.00	1,992,000

四国化成工業	14,100	1,437.00	20,261,700
戸田工業	2,300	2,546.00	5,855,800
ステラ ケミファ	5,400	2,389.00	12,900,600
保土谷化学工業	3,500	4,260.00	14,910,000
日本触媒	18,100	5,680.00	102,808,000
大日精化工業	8,900	2,201.00	19,588,900
カネカ	27,900	3,755.00	104,764,500
三菱瓦斯化学	100,400	1,982.00	198,992,800
三井化学	98,000	2,978.00	291,844,000
J S R	100,600	3,410.00	343,046,000
東京応化工業	17,500	7,210.00	126,175,000
大阪有機化学工業	9,200	2,985.00	27,462,000
三菱ケミカルホールディングス	721,600	826.80	596,618,880
K Hネオケム	17,800	2,792.00	49,697,600
ダイセル	155,500	869.00	135,129,500
住友ベークライト	17,000	4,880.00	82,960,000
積水化学工業	225,900	1,950.00	440,505,000
日本ゼオン	97,300	1,331.00	129,506,300
アイカ工業	30,100	3,190.00	96,019,000
宇部興産	50,900	2,177.00	110,809,300
積水樹脂	16,300	1,922.00	31,328,600
タキロンシーアイ	23,400	558.00	13,057,200
旭有機材	6,100	2,044.00	12,468,400
ニチバン	6,400	1,789.00	11,449,600
リケンテクノス	26,300	464.00	12,203,200
大倉工業	5,500	1,866.00	10,263,000
積水化成成品工業	14,500	452.00	6,554,000
群栄化学工業	2,500	3,505.00	8,762,500
タイガースポリマー	5,700	450.00	2,565,000
ミライアル	3,500	1,538.00	5,383,000
ダイキアクシス	4,200	722.00	3,032,400
ダイキョーニシカワ	22,800	574.00	13,087,200
竹本容器	3,900	815.00	3,178,500
森六ホールディングス	5,800	1,856.00	10,764,800
恵和	2,900	4,435.00	12,861,500
日本化薬	85,000	1,127.00	95,795,000
カーリットホールディングス	10,700	690.00	7,383,000
日本精化	8,700	2,004.00	17,434,800
扶桑化学工業	9,700	4,480.00	43,456,000
トリケミカル研究所	11,100	2,776.00	30,813,600
A D E K A	49,700	2,599.00	129,170,300
日油	36,900	5,030.00	185,607,000

新日本理化	17,900	238.00	4,260,200
ハリマ化成グループ	8,000	818.00	6,544,000
花王	243,800	5,327.00	1,298,722,600
第一工業製薬	4,000	2,706.00	10,824,000
石原ケミカル	5,400	1,337.00	7,219,800
日華化学	3,600	760.00	2,736,000
ニイタカ	2,200	2,381.00	5,238,200
三洋化成工業	6,400	5,080.00	32,512,000
有機合成薬品工業	7,500	269.00	2,017,500
大日本塗料	13,200	818.00	10,797,600
日本ペイントホールディングス	405,600	1,060.00	429,936,000
関西ペイント	111,900	2,399.00	268,448,100
神東塗料	8,500	153.00	1,300,500
中国塗料	25,500	907.00	23,128,500
日本特殊塗料	8,100	879.00	7,119,900
藤倉化成	13,400	461.00	6,177,400
太陽ホールディングス	15,900	3,020.00	48,018,000
D I C	45,600	2,657.00	121,159,200
サカタインクス	21,400	935.00	20,009,000
東洋インキＳＣホールディングス	22,800	1,890.00	43,092,000
T & K T O K A	8,700	900.00	7,830,000
富士フィルムホールディングス	193,700	7,531.00	1,458,754,700
資生堂	205,300	6,746.00	1,384,953,800
ライオン	133,100	1,516.00	201,779,600
高砂香料工業	7,600	2,711.00	20,603,600
マンダム	23,100	1,392.00	32,155,200
ミルボン	13,600	6,020.00	81,872,000
ファンケル	44,600	3,255.00	145,173,000
コーセー	20,700	13,360.00	276,552,000
コタ	7,000	1,597.00	11,179,000
シーボン	1,400	1,828.00	2,559,200
ポーラ・オルビスホールディングス	47,000	1,862.00	87,514,000
ノエビアホールディングス	9,400	5,180.00	48,692,000
アジュバンホールディングス	2,500	1,145.00	2,862,500
新日本製薬	3,000	1,348.00	4,044,000
エステー	7,100	1,561.00	11,083,100
アグロ カネショウ	3,700	1,186.00	4,388,200
コニシ	18,100	1,557.00	28,181,700
長谷川香料	19,000	2,345.00	44,555,000
星光P M C	6,200	602.00	3,732,400
小林製薬	30,900	9,830.00	303,747,000
荒川化学工業	9,200	1,127.00	10,368,400

メック	8,200	2,859.00	23,443,800
日本高純度化学	3,000	2,531.00	7,593,000
タカラバイオ	28,800	2,425.00	69,840,000
J C U	12,400	4,595.00	56,978,000
新田ゼラチン	6,900	652.00	4,498,800
O A T アグリオ	2,300	1,887.00	4,340,100
デクセリアルズ	28,600	2,960.00	84,656,000
アース製薬	9,100	5,670.00	51,597,000
北興化学工業	10,300	837.00	8,621,100
大成ラミック	3,400	2,766.00	9,404,400
クミアイ化学工業	41,000	793.00	32,513,000
日本農薬	19,600	533.00	10,446,800
アキレス	7,100	1,269.00	9,009,900
有沢製作所	16,100	993.00	15,987,300
日東電工	66,600	8,260.00	550,116,000
レック	14,400	943.00	13,579,200
三光合成	11,600	353.00	4,094,800
きもと	16,900	211.00	3,565,900
藤森工業	9,900	4,005.00	39,649,500
前澤化成工業	7,000	1,271.00	8,897,000
未来工業	3,900	1,520.00	5,928,000
ウェーブロックホールディングス	4,200	717.00	3,011,400
J S P	6,400	1,589.00	10,169,600
エフピコ	20,300	3,195.00	64,858,500
天馬	8,700	2,586.00	22,498,200
信越ポリマー	19,800	1,087.00	21,522,600
東リ	27,400	227.00	6,219,800
ニフコ	36,800	3,495.00	128,616,000
バルカー	9,000	2,545.00	22,905,000
ユニ・チャーム	212,400	4,355.00	925,002,000
ショーエイコーポレーション	3,000	635.00	1,905,000
協和キリン	129,300	3,050.00	394,365,000
武田薬品工業	866,200	3,494.00	3,026,502,800
アステラス製薬	955,600	1,990.50	1,902,121,800
大日本住友製薬	68,100	1,247.00	84,920,700
塩野義製薬	138,600	7,585.00	1,051,281,000
わかもと製薬	13,100	290.00	3,799,000
日本新薬	28,800	7,570.00	218,016,000
中外製薬	344,700	3,909.00	1,347,432,300
科研製薬	17,300	4,140.00	71,622,000
エーザイ	131,900	5,773.00	761,458,700
ロート製薬	56,600	3,755.00	212,533,000

小野薬品工業	253,100	2,853.00	722,094,300
久光製薬	29,100	3,645.00	106,069,500
持田製薬	13,900	3,885.00	54,001,500
参天製薬	205,500	1,284.00	263,862,000
扶桑薬品工業	3,900	2,315.00	9,028,500
日本ケミファ	1,300	2,070.00	2,691,000
ツムラ	34,100	3,195.00	108,949,500
日医工	34,200	836.00	28,591,200
キッセイ薬品工業	19,500	2,407.00	46,936,500
生化学工業	19,400	897.00	17,401,800
栄研化学	19,400	1,739.00	33,736,600
日水製薬	4,100	989.00	4,054,900
鳥居薬品	5,900	2,959.00	17,458,100
JCRファーマ	31,100	2,144.00	66,678,400
東和薬品	15,900	3,005.00	47,779,500
富士製薬工業	6,800	1,010.00	6,868,000
ゼリア新薬工業	20,000	1,958.00	39,160,000
第一三共	866,100	2,549.50	2,208,121,950
キョーリン製薬ホールディングス	22,100	1,830.00	40,443,000
大幸薬品	16,600	601.00	9,976,600
ダイト	7,100	2,941.00	20,881,100
大塚ホールディングス	229,100	4,030.00	923,273,000
大正製薬ホールディングス	26,200	5,720.00	149,864,000
ペプチドリーム	57,800	2,043.00	118,085,400
あすか製薬ホールディングス	12,500	1,068.00	13,350,000
サワイグループホールディングス	24,100	4,425.00	106,642,500
日本コークス工業	93,100	135.00	12,568,500
ニチレキ	14,100	1,309.00	18,456,900
ユシロ化学工業	5,700	1,048.00	5,973,600
ビーピー・カストロール	3,900	1,285.00	5,011,500
富士石油	29,400	268.00	7,879,200
MORESCO	3,600	1,142.00	4,111,200
出光興産	122,300	3,015.00	368,734,500
ENEOSホールディングス	1,658,000	454.30	753,229,400
コスモエネルギーホールディングス	31,900	2,519.00	80,356,100
横浜ゴム	63,800	1,765.00	112,607,000
TOYO TIRE	58,000	1,602.00	92,916,000
ブリヂストン	317,500	5,134.00	1,630,045,000
住友ゴム工業	99,000	1,174.00	116,226,000
藤倉コンポジット	8,800	685.00	6,028,000
オカモト	6,500	4,005.00	26,032,500
フコク	4,800	974.00	4,675,200

ニッタ	11,400	2,734.00	31,167,600
住友理工	21,400	599.00	12,818,600
三ツ星ベルト	13,400	2,111.00	28,287,400
バンドー化学	17,800	852.00	15,165,600
日東紡績	16,400	3,105.00	50,922,000
A G C	101,200	5,600.00	566,720,000
日本板硝子	52,900	509.00	26,926,100
石塚硝子	1,900	2,048.00	3,891,200
日本山村硝子	4,300	805.00	3,461,500
日本電気硝子	44,300	2,824.00	125,103,200
オハラ	4,400	1,148.00	5,051,200
住友大阪セメント	20,400	3,545.00	72,318,000
太平洋セメント	62,600	2,321.00	145,294,600
日本ヒューム	11,100	700.00	7,770,000
日本コンクリート工業	22,000	299.00	6,578,000
三谷セキサン	5,100	6,260.00	31,926,000
アジアパイルホールディングス	17,100	431.00	7,370,100
東海カーボン	92,400	1,137.00	105,058,800
日本カーボン	5,700	4,160.00	23,712,000
東洋炭素	7,200	3,145.00	22,644,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	4,455.00	27,175,500
T O T O	78,700	5,070.00	399,009,000
日本碍子	119,400	1,857.00	221,725,800
日本特殊陶業	83,900	2,122.00	178,035,800
M A R U W A	3,800	14,290.00	54,302,000
品川リフラクトリーズ	2,600	3,915.00	10,179,000
黒崎播磨	1,900	4,375.00	8,312,500
ヨータイ	7,100	1,262.00	8,960,200
東京窯業	14,200	304.00	4,316,800
ニッカトー	5,100	572.00	2,917,200
フジインコーポレーテッド	8,800	6,490.00	57,112,000
クニミネ工業	3,500	1,015.00	3,552,500
エーアンドエーマテリアル	1,900	912.00	1,732,800
ニチアス	25,500	2,623.00	66,886,500
ニチハ	15,300	2,585.00	39,550,500
日本製鉄	487,800	2,074.00	1,011,697,200
神戸製鋼所	203,500	614.00	124,949,000
中山製鋼所	17,400	467.00	8,125,800
合同製鐵	5,900	1,379.00	8,136,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	294,400	1,707.00	502,540,800
東京製鐵	37,200	1,144.00	42,556,800
共英製鋼	12,300	1,613.00	19,839,900

大和工業	20,900	3,670.00	76,703,000
東京鐵鋼	4,800	1,370.00	6,576,000
大阪製鐵	5,800	1,220.00	7,076,000
淀川製鋼所	14,300	2,730.00	39,039,000
丸一鋼管	38,600	2,969.00	114,603,400
モリ工業	3,200	2,539.00	8,124,800
大同特殊鋼	17,800	4,185.00	74,493,000
日本高周波鋼業	4,100	344.00	1,410,400
日本冶金工業	8,000	2,913.00	23,304,000
山陽特殊製鋼	11,200	2,077.00	23,262,400
愛知製鋼	6,100	2,630.00	16,043,000
日立金属	117,400	2,074.00	243,487,600
日本金属	2,800	1,334.00	3,735,200
大平洋金属	6,700	3,355.00	22,478,500
新日本電工	70,500	344.00	24,252,000
栗本鐵工所	5,000	1,539.00	7,695,000
虹技	1,500	955.00	1,432,500
三菱製鋼	7,000	1,333.00	9,331,000
日亜鋼業	14,300	279.00	3,989,700
日本精線	1,800	4,415.00	7,947,000
エンビプロ・ホールディングス	4,700	1,279.00	6,011,300
シンニッタン	13,300	226.00	3,005,800
新家工業	2,700	1,760.00	4,752,000
大紀アルミニウム工業所	16,500	1,673.00	27,604,500
日本輕金属ホールディングス	27,600	1,824.00	50,342,400
三井金属鋳業	29,400	3,325.00	97,755,000
東邦亜鉛	6,100	2,694.00	16,433,400
三菱マテリアル	72,000	2,089.00	150,408,000
住友金属鋳山	139,300	5,439.00	757,652,700
D O W Aホールディングス	29,700	4,900.00	145,530,000
古河機械金属	18,000	1,300.00	23,400,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,700	860.00	10,922,000
東邦チタニウム	19,600	910.00	17,836,000
U A C J	16,600	2,363.00	39,225,800
C Kサンエツ	2,300	4,025.00	9,257,500
古河電氣工業	33,900	2,402.00	81,427,800
住友電氣工業	407,500	1,580.00	643,850,000
フジクラ	121,600	655.00	79,648,000
昭和電線ホールディングス	9,500	1,857.00	17,641,500
東京特殊電線	1,600	2,851.00	4,561,600
タツタ電線	19,300	451.00	8,704,300
カナレ電氣	1,700	1,510.00	2,567,000

平河ヒューテック	6,100	1,172.00	7,149,200
リョービ	13,500	1,111.00	14,998,500
アーレスティ	11,700	379.00	4,434,300
アサヒホールディングス	43,700	2,153.00	94,086,100
稲葉製作所	6,100	1,303.00	7,948,300
宮地エンジニアリンググループ	3,300	3,580.00	11,814,000
トーカロ	28,100	1,326.00	37,260,600
アルファC o	4,200	1,092.00	4,586,400
SUMCO	167,700	1,958.00	328,356,600
川田テクノロジーズ	2,200	3,825.00	8,415,000
RS Technologies	3,500	5,250.00	18,375,000
ジェイテックコーポレーション	1,200	1,503.00	1,803,600
信和	6,800	832.00	5,657,600
東洋製罐グループホールディングス	69,400	1,588.00	110,207,200
ホッカカンホールディングス	6,000	1,398.00	8,388,000
コロナ	6,000	901.00	5,406,000
横河ブリッジホールディングス	18,700	2,062.00	38,559,400
駒井ハルテック	2,000	2,048.00	4,096,000
高田機工	1,000	2,888.00	2,888,000
三和ホールディングス	102,800	1,281.00	131,686,800
文化シャッター	34,600	1,057.00	36,572,200
三協立山	14,000	639.00	8,946,000
アルインコ	7,900	912.00	7,204,800
東洋シャッター	2,400	562.00	1,348,800
LIXIL	171,500	2,600.00	445,900,000
日本フィルコン	7,600	519.00	3,944,400
ノーリツ	20,900	1,567.00	32,750,300
長府製作所	11,100	1,982.00	22,000,200
リンナイ	20,500	9,600.00	196,800,000
ダイニチ工業	5,200	697.00	3,624,400
日東精工	13,700	510.00	6,987,000
三洋工業	1,300	1,844.00	2,397,200
岡部	22,100	721.00	15,934,100
ジーテクト	13,500	1,456.00	19,656,000
東プレ	20,300	1,225.00	24,867,500
高周波熱錬	19,500	597.00	11,641,500
東京製綱	6,700	844.00	5,654,800
サンコール	9,300	492.00	4,575,600
モリテック スチール	8,500	311.00	2,643,500
パイオラックス	15,600	1,767.00	27,565,200
エイチワン	10,700	657.00	7,029,900
日本発條	100,200	894.00	89,578,800

中央発條	5,200	791.00	4,113,200
アドバネクス	1,400	1,658.00	2,321,200
立川ブラインド工業	4,800	1,088.00	5,222,400
三益半導体工業	8,500	2,355.00	20,017,500
日本ドライケミカル	2,700	1,776.00	4,795,200
日本製鋼所	33,100	3,675.00	121,642,500
三浦工業	47,200	3,155.00	148,916,000
タクマ	37,000	1,446.00	53,502,000
ツガミ	24,100	1,270.00	30,607,000
オークマ	12,700	4,755.00	60,388,500
芝浦機械	12,400	3,055.00	37,882,000
アマダ	172,200	1,038.00	178,743,600
アイダエンジニアリング	28,700	974.00	27,953,800
滝澤鉄工所	3,200	1,204.00	3,852,800
F U J I	50,200	2,323.00	116,614,600
牧野フライス製作所	12,000	3,700.00	44,400,000
オーエスジー	50,500	1,973.00	99,636,500
ダイジェット工業	1,400	1,005.00	1,407,000
旭ダイヤモンド工業	28,800	573.00	16,502,400
D M G 森精機	64,700	1,691.00	109,407,700
ソディック	24,200	767.00	18,561,400
ディスコ	16,100	33,950.00	546,595,000
日東工器	6,000	1,604.00	9,624,000
日進工具	8,600	1,416.00	12,177,600
パンチ工業	9,200	494.00	4,544,800
富士ダイス	5,600	617.00	3,455,200
豊和工業	5,800	824.00	4,779,200
O K K	4,200	733.00	3,078,600
東洋機械金属	7,200	564.00	4,060,800
津田駒工業	2,100	589.00	1,236,900
エンシュウ	2,700	650.00	1,755,000
島精機製作所	16,000	1,829.00	29,264,000
オプトラン	13,700	1,905.00	26,098,500
N C ホールディングス	3,100	1,855.00	5,750,500
イワキポンプ	7,000	1,022.00	7,154,000
フリー	9,700	1,013.00	9,826,100
ヤマシンフィルタ	22,100	359.00	7,933,900
日阪製作所	13,500	821.00	11,083,500
やまびこ	21,200	1,313.00	27,835,600
野村マイクロ・サイエンス	2,900	3,495.00	10,135,500
平田機工	5,200	5,270.00	27,404,000
ペガサスミシン製造	11,200	531.00	5,947,200

マルマエ	4,500	2,396.00	10,782,000
タツモ	5,100	1,575.00	8,032,500
ナブテスコ	62,200	3,155.00	196,241,000
三井海洋開発	11,600	1,176.00	13,641,600
レオン自動機	11,700	1,014.00	11,863,800
S M C	32,300	67,490.00	2,179,927,000
ホソカワミクロン	7,700	2,647.00	20,381,900
ユニオンツール	4,100	3,590.00	14,719,000
オイレス工業	15,300	1,556.00	23,806,800
日精エー・エス・ビー機械	3,700	2,957.00	10,940,900
サトーホールディングス	14,400	2,001.00	28,814,400
技研製作所	9,700	3,675.00	35,647,500
日本エアーテック	5,100	1,023.00	5,217,300
カワタ	3,500	1,009.00	3,531,500
日精樹脂工業	7,800	1,002.00	7,815,600
オカダアイヨン	3,500	1,423.00	4,980,500
ワイエイシイホールディングス	4,300	1,069.00	4,596,700
小松製作所	499,500	2,725.50	1,361,387,250
住友重機械工業	63,100	2,747.00	173,335,700
日立建機	44,200	2,921.00	129,108,200
日工	15,300	623.00	9,531,900
巴工業	4,400	2,310.00	10,164,000
井関農機	10,300	1,218.00	12,545,400
T O W A	9,400	2,314.00	21,751,600
丸山製作所	2,300	1,509.00	3,470,700
北川鉄工所	5,100	1,344.00	6,854,400
ローツェ	5,400	10,410.00	56,214,000
タカキタ	3,900	615.00	2,398,500
クボタ	533,800	2,058.00	1,098,560,400
荏原実業	5,100	2,157.00	11,000,700
三菱化工機	3,600	2,008.00	7,228,800
月島機械	20,400	1,042.00	21,256,800
帝国電機製作所	7,700	1,397.00	10,756,900
新東工業	24,500	700.00	17,150,000
澁谷工業	9,700	2,438.00	23,648,600
アイチ コーポレーション	15,900	859.00	13,658,100
小森コーポレーション	28,200	736.00	20,755,200
鶴見製作所	8,600	1,785.00	15,351,000
住友精密工業	1,700	1,922.00	3,267,400
日本ギア工業	4,100	272.00	1,115,200
酒井重工業	2,000	2,963.00	5,926,000
荏原製作所	45,800	5,650.00	258,770,000

石井鐵工所	1,600	3,005.00	4,808,000
西島製作所	10,100	959.00	9,685,900
北越工業	10,400	896.00	9,318,400
ダイキン工業	140,400	21,450.00	3,011,580,000
オルガノ	3,200	7,740.00	24,768,000
トーヨーカネツ	4,200	2,403.00	10,092,600
栗田工業	59,700	4,730.00	282,381,000
椿本チエイン	14,500	3,285.00	47,632,500
大同工業	5,000	925.00	4,625,000
木村化工機	9,400	819.00	7,698,600
アネスト岩田	17,200	816.00	14,035,200
ダイフク	60,700	8,380.00	508,666,000
サムコ	2,800	2,298.00	6,434,400
加藤製作所	5,400	819.00	4,422,600
油研工業	1,900	1,752.00	3,328,800
タダノ	57,700	980.00	56,546,000
フジテック	40,900	2,693.00	110,143,700
C K D	32,600	2,020.00	65,852,000
キトー	9,400	1,676.00	15,754,400
平和	30,800	1,945.00	59,906,000
理想科学工業	9,300	2,171.00	20,190,300
S A N K Y O	23,800	3,225.00	76,755,000
日本金銭機械	11,300	628.00	7,096,400
マースグループホールディングス	7,000	1,635.00	11,445,000
フクシマガリレイ	7,600	3,855.00	29,298,000
オーイズミ	4,000	394.00	1,576,000
ダイコク電機	5,100	1,243.00	6,339,300
竹内製作所	16,800	2,602.00	43,713,600
アマノ	28,900	2,255.00	65,169,500
J U K I	15,300	676.00	10,342,800
ジャノメ	9,400	719.00	6,758,600
マックス	14,700	1,711.00	25,151,700
グローリー	28,300	2,087.00	59,062,100
新晃工業	10,300	1,720.00	17,716,000
大和冷機工業	16,000	1,127.00	18,032,000
セガサミーホールディングス	109,300	2,145.00	234,448,500
日本ピストンリング	4,100	1,370.00	5,617,000
リケン	4,800	2,572.00	12,345,600
T P R	14,900	1,416.00	21,098,400
ツバキ・ナカシマ	24,200	964.00	23,328,800
ホシザキ	32,200	7,870.00	253,414,000
大豊工業	9,100	718.00	6,533,800

日本精工	207,600	738.00	153,208,800
N T N	236,900	226.00	53,539,400
ジェイテクト	105,800	1,029.00	108,868,200
不二越	9,400	4,190.00	39,386,000
日本トムソン	30,300	534.00	16,180,200
T H K	62,200	2,704.00	168,188,800
ユーシン精機	8,600	684.00	5,882,400
前澤給装工業	8,300	980.00	8,134,000
イーグル工業	13,700	1,063.00	14,563,100
前澤工業	6,700	625.00	4,187,500
日本ピラー工業	11,200	2,827.00	31,662,400
キッツ	37,200	671.00	24,961,200
マキタ	134,200	4,136.00	555,051,200
三井E & Sホールディングス	39,800	359.00	14,288,200
日立造船	93,400	773.00	72,198,200
三菱重工業	173,200	3,339.00	578,314,800
I H I	68,900	2,678.00	184,514,200
スター精密	16,600	1,493.00	24,783,800
日清紡ホールディングス	67,400	1,041.00	70,163,400
イビデン	57,900	5,440.00	314,976,000
コニカミノルタ	241,900	501.00	121,191,900
ブラザー工業	134,800	2,091.00	281,866,800
ミネベアミツミ	190,200	2,516.00	478,543,200
日立製作所	530,100	6,009.00	3,185,370,900
東芝	192,600	4,516.00	869,781,600
三菱電機	1,102,100	1,425.00	1,570,492,500
富士電機	66,400	6,060.00	402,384,000
東洋電機製造	4,300	963.00	4,140,900
安川電機	118,600	4,665.00	553,269,000
シンフォニアテクノロジー	13,300	1,280.00	17,024,000
明電舎	18,700	2,367.00	44,262,900
オリジン	2,800	1,233.00	3,452,400
山洋電気	5,000	4,910.00	24,550,000
デンヨー	9,400	1,715.00	16,121,000
P H Cホールディングス	13,000	1,551.00	20,163,000
東芝テック	11,800	4,910.00	57,938,000
芝浦メカトロニクス	2,000	7,680.00	15,360,000
マブチモーター	26,000	4,180.00	108,680,000
日本電産	285,700	9,956.00	2,844,429,200
トレックス・セミコンダクター	5,700	2,485.00	14,164,500
東光高岳	6,500	1,435.00	9,327,500
ダイヘン	12,100	4,150.00	50,215,000

ヤーマン	18,600	931.00	17,316,600
JVCケンウッド	92,900	189.00	17,558,100
ミマキエンジニアリング	10,600	726.00	7,695,600
I-PEX	5,400	1,466.00	7,916,400
日新電機	25,800	1,414.00	36,481,200
大崎電気工業	20,200	487.00	9,837,400
オムロン	91,700	7,867.00	721,403,900
日東工業	14,700	1,597.00	23,475,900
I D E C	13,600	2,407.00	32,735,200
正興電機製作所	4,000	1,080.00	4,320,000
不二電機工業	2,500	1,064.00	2,660,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,100	2,395.00	86,459,500
サクサホールディングス	2,600	1,402.00	3,645,200
メルコホールディングス	3,200	3,730.00	11,936,000
テクノメディカ	2,800	1,541.00	4,314,800
日本電気	140,000	5,120.00	716,800,000
富士通	99,200	16,150.00	1,602,080,000
沖電気工業	44,800	887.00	39,737,600
岩崎通信機	4,500	816.00	3,672,000
電気興業	5,800	2,362.00	13,699,600
サンケン電気	10,300	5,220.00	53,766,000
ナカヨ	2,000	1,123.00	2,246,000
アイホン	6,200	2,114.00	13,106,800
ルネサスエレクトロニクス	598,100	1,392.00	832,555,200
セイコーエプソン	136,700	1,838.00	251,254,600
ワコム	86,100	850.00	73,185,000
アルバック	21,900	5,800.00	127,020,000
アクセル	5,100	1,111.00	5,666,100
E I Z O	8,600	3,665.00	31,519,000
日本信号	28,100	881.00	24,756,100
京三製作所	23,700	422.00	10,001,400
能美防災	14,800	2,021.00	29,910,800
ホーチキ	8,400	1,213.00	10,189,200
星和電機	5,900	484.00	2,855,600
エレコム	25,600	1,548.00	39,628,800
パナソニック	1,175,500	1,209.00	1,421,179,500
シャープ	125,600	1,181.00	148,333,600
アンリツ	71,000	1,624.00	115,304,000
富士通ゼネラル	29,900	2,567.00	76,753,300
ソニーグループ	690,400	11,890.00	8,208,856,000
T D K	159,800	4,760.00	760,648,000
帝国通信工業	5,300	1,374.00	7,282,200

タムラ製作所	42,500	601.00	25,542,500
アルプスアルパイン	98,000	1,209.00	118,482,000
池上通信機	3,200	642.00	2,054,400
日本電波工業	10,400	1,141.00	11,866,400
鈴木	5,600	829.00	4,642,400
メイコー	9,100	3,850.00	35,035,000
日本トリム	2,300	2,700.00	6,210,000
ローランド ディー・ジー・	6,700	2,839.00	19,021,300
フォスター電機	11,100	773.00	8,580,300
S M K	2,600	2,180.00	5,668,000
ヨコオ	8,400	2,624.00	22,041,600
ホシデン	27,100	1,206.00	32,682,600
ヒロセ電機	17,000	16,980.00	288,660,000
日本航空電子工業	25,300	1,847.00	46,729,100
T O A	11,800	767.00	9,050,600
マクセル	22,300	1,212.00	27,027,600
古野電気	13,600	1,052.00	14,307,200
ユニデンホールディングス	2,400	3,435.00	8,244,000
スミダコーポレーション	10,900	839.00	9,145,100
アイコム	4,100	2,358.00	9,667,800
リオン	4,500	2,079.00	9,355,500
本多通信工業	9,900	490.00	4,851,000
横河電機	110,300	1,815.00	200,194,500
新電元工業	4,200	2,984.00	12,532,800
アズビル	64,600	4,110.00	265,506,000
東亜ディーケーケー	6,000	912.00	5,472,000
日本光電工業	45,700	3,140.00	143,498,000
チノー	3,500	1,503.00	5,260,500
共和電業	10,600	379.00	4,017,400
日本電子材料	5,500	1,993.00	10,961,500
堀場製作所	20,400	6,560.00	133,824,000
アドバンテスト	81,900	9,380.00	768,222,000
小野測器	5,700	483.00	2,753,100
エスベック	9,200	2,035.00	18,722,000
キーエンス	99,900	52,500.00	5,244,750,000
日置電機	5,400	6,570.00	35,478,000
シスメックス	93,300	8,330.00	777,189,000
日本マイクロニクス	19,500	1,697.00	33,091,500
メガチップス	10,400	3,805.00	39,572,000
O B A R A G R O U P	5,200	3,140.00	16,328,000
澤藤電機	1,700	1,534.00	2,607,800
原田工業	5,800	991.00	5,747,800

コーセル	14,100	819.00	11,547,900
イリソ電子工業	9,400	4,100.00	38,540,000
オブテックスグループ	18,400	1,606.00	29,550,400
千代田インテグレ	4,900	1,917.00	9,393,300
アイ・オー・データ機器	4,800	1,297.00	6,225,600
レーザーテック	48,400	21,170.00	1,024,628,000
スタンレー電気	77,300	2,841.00	219,609,300
岩崎電気	4,300	2,281.00	9,808,300
ウシオ電機	56,800	1,869.00	106,159,200
岡谷電機産業	9,500	307.00	2,916,500
ハリオス テクノ ホールディング	11,200	292.00	3,270,400
エノモト	3,400	1,500.00	5,100,000
日本セラミック	10,500	2,490.00	26,145,000
遠藤照明	5,600	1,009.00	5,650,400
古河電池	8,300	1,256.00	10,424,800
双信電機	6,100	556.00	3,391,600
山一電機	8,300	1,915.00	15,894,500
図研	7,300	2,988.00	21,812,400
日本電子	23,000	6,510.00	149,730,000
カシオ計算機	79,800	1,296.00	103,420,800
ファナック	96,700	21,525.00	2,081,467,500
日本シイエムケイ	22,600	594.00	13,424,400
エンプラス	2,900	2,619.00	7,595,100
大真空	15,300	1,073.00	16,416,900
ローム	49,400	9,210.00	454,974,000
浜松ホトニクス	79,200	5,640.00	446,688,000
三井ハイテック	10,900	8,160.00	88,944,000
新光電気工業	32,500	4,755.00	154,537,500
京セラ	155,100	6,854.00	1,063,055,400
太陽誘電	53,600	5,150.00	276,040,000
村田製作所	323,800	7,938.00	2,570,324,400
双葉電子工業	19,700	675.00	13,297,500
北陸電気工業	4,600	1,296.00	5,961,600
ニチコン	35,200	1,226.00	43,155,200
日本ケミコン	10,400	1,899.00	19,749,600
K O A	17,000	1,414.00	24,038,000
市光工業	14,200	506.00	7,185,200
小糸製作所	60,600	6,250.00	378,750,000
ミツバ	20,300	394.00	7,998,200
S C R E E Nホールディングス	19,100	11,560.00	220,796,000
キヤノン電子	10,500	1,612.00	16,926,000
キヤノン	547,700	2,823.00	1,546,157,100

リコー	305,900	1,048.00	320,583,200
象印マホービン	30,200	1,427.00	43,095,400
MUTOHホールディングス	1,600	2,043.00	3,268,800
東京エレクトロン	69,900	55,140.00	3,854,286,000
トヨタ紡織	45,000	2,160.00	97,200,000
芦森工業	2,100	905.00	1,900,500
ユニプレス	16,400	814.00	13,349,600
豊田自動織機	89,200	9,090.00	810,828,000
モリタホールディングス	17,700	1,247.00	22,071,900
三櫻工業	15,200	713.00	10,837,600
デンソー	242,700	8,431.00	2,046,203,700
東海理化電機製作所	29,000	1,563.00	45,327,000
川崎重工業	80,400	2,084.00	167,553,600
名村造船所	33,100	279.00	9,234,900
日本車輛製造	4,000	2,105.00	8,420,000
三菱ロジスネクスト	14,600	937.00	13,680,200
近畿車輛	1,700	1,066.00	1,812,200
日産自動車	1,299,800	598.10	777,410,380
いすゞ自動車	345,800	1,638.00	566,420,400
トヨタ自動車	5,582,600	2,173.00	12,130,989,800
日野自動車	137,600	1,095.00	150,672,000
三菱自動車工業	407,900	325.00	132,567,500
エフテック	7,700	527.00	4,057,900
レシップホールディングス	4,400	540.00	2,376,000
G M B	2,000	778.00	1,556,000
ファルテック	1,900	708.00	1,345,200
武蔵精密工業	24,600	1,875.00	46,125,000
日産車体	16,100	673.00	10,835,300
新明和工業	31,100	935.00	29,078,500
極東開発工業	20,500	1,476.00	30,258,000
トピー工業	9,100	1,118.00	10,173,800
ティラド	3,200	2,524.00	8,076,800
曙ブレーキ工業	60,500	171.00	10,345,500
タチエス	19,300	1,145.00	22,098,500
N O K	53,300	1,233.00	65,718,900
フタバ産業	27,600	403.00	11,122,800
K Y B	11,500	3,095.00	35,592,500
大同メタル工業	21,100	636.00	13,419,600
プレス工業	54,600	380.00	20,748,000
ミクニ	14,000	407.00	5,698,000
太平洋工業	23,100	1,016.00	23,469,600
河西工業	13,500	288.00	3,888,000

アイシン	80,700	4,375.00	353,062,500	
マツダ	345,900	931.00	322,032,900	
今仙電機製作所	7,200	592.00	4,262,400	
本田技研工業	867,800	3,662.00	3,177,883,600	
スズキ	252,100	4,864.00	1,226,214,400	
S U B A R U	315,800	1,975.50	623,862,900	
安永	5,300	832.00	4,409,600	
ヤマハ発動機	143,800	2,646.00	380,494,800	
T B K	12,100	406.00	4,912,600	
エクセディ	16,600	1,721.00	28,568,600	
豊田合成	35,600	2,257.00	80,349,200	
愛三工業	17,300	749.00	12,957,700	
盟和産業	1,600	1,012.00	1,619,200	
日本プラスト	8,600	548.00	4,712,800	
ヨロズ	10,300	973.00	10,021,900	
エフ・シー・シー	18,000	1,459.00	26,262,000	
シマノ	44,300	26,620.00	1,179,266,000	
テイ・エス テック	46,500	1,568.00	72,912,000	
ジャムコ	6,400	811.00	5,190,400	
テルモ	311,900	3,636.00	1,134,068,400	
クリエートメディック	3,300	978.00	3,227,400	
日機装	33,100	782.00	25,884,200	
日本エム・ディ・エム	6,400	1,564.00	10,009,600	
島津製作所	141,800	4,020.00	570,036,000	
J M S	9,300	609.00	5,663,700	
長野計器	8,000	1,281.00	10,248,000	
ブイ・テクノロジー	4,800	3,525.00	16,920,000	
東京計器	7,000	1,046.00	7,322,000	
愛知時計電機	4,800	1,892.00	9,081,600	
インターアクション	5,500	2,002.00	11,011,000	
オーバル	9,900	270.00	2,673,000	
東京精密	18,600	4,725.00	87,885,000	
マニー	43,900	1,579.00	69,318,100	
ニコン	168,300	1,250.00	210,375,000	
トプコン	51,800	1,490.00	77,182,000	
オリンパス	578,000	2,317.50	1,339,515,000	
理研計器	8,900	4,745.00	42,230,500	
タムロン	8,600	2,310.00	19,866,000	
H O Y A	215,100	14,975.00	3,221,122,500	
シード	5,200	510.00	2,652,000	
ノーリツ鋼機	9,900	1,790.00	17,721,000	
エー・アンド・デイ	10,100	912.00	9,211,200	

朝日インテック	120,800	2,289.00	276,511,200
シチズン時計	129,100	506.00	65,324,600
リズム	3,500	1,455.00	5,092,500
大研医器	8,800	527.00	4,637,600
メニコン	36,500	2,895.00	105,667,500
シンシア	1,200	492.00	590,400
松風	4,600	1,784.00	8,206,400
セイコーホールディングス	15,600	2,344.00	36,566,400
ニプロ	82,200	1,101.00	90,502,200
中本パックス	3,100	1,680.00	5,208,000
スノーピーク	14,400	2,549.00	36,705,600
パラマウントベッドホールディングス	21,100	1,990.00	41,989,000
トランザクション	6,000	974.00	5,844,000
粧美堂	3,200	418.00	1,337,600
ニホンフラッシュ	9,400	1,028.00	9,663,200
前田工織	12,100	3,225.00	39,022,500
永大産業	14,400	299.00	4,305,600
アートネイチャー	9,400	725.00	6,815,000
バンダイナムコホールディングス	98,800	7,790.00	769,652,000
アイフィスジャパン	2,800	672.00	1,881,600
共立印刷	18,500	163.00	3,015,500
S H O E I	10,300	4,590.00	47,277,000
フランスベッドホールディングス	14,200	915.00	12,993,000
パイロットコーポレーション	18,600	4,645.00	86,397,000
萩原工業	7,100	1,213.00	8,612,300
フジシールインターナショナル	26,800	1,743.00	46,712,400
タカラトミー	46,100	1,267.00	58,408,700
広済堂ホールディングス	6,800	870.00	5,916,000
エステールホールディングス	2,600	653.00	1,697,800
タカノ	3,800	703.00	2,671,400
プロネクサス	8,500	1,081.00	9,188,500
ホクシン	7,800	149.00	1,162,200
ウッドワン	3,400	1,014.00	3,447,600
大建工業	6,500	2,231.00	14,501,500
凸版印刷	167,500	2,273.00	380,727,500
大日本印刷	130,300	2,952.00	384,645,600
共同印刷	3,200	2,834.00	9,068,800
N I S S H A	22,600	1,356.00	30,645,600
光村印刷	1,000	1,497.00	1,497,000
T A K A R A & C O M P A N Y	5,400	1,846.00	9,968,400
アシックス	97,500	2,252.00	219,570,000
ツツミ	2,700	1,869.00	5,046,300

ローランド	7,700	4,080.00	31,416,000
小松ウオール工業	3,400	1,877.00	6,381,800
ヤマハ	64,100	5,460.00	349,986,000
河合楽器製作所	3,100	2,971.00	9,210,100
クリナップ	10,200	552.00	5,630,400
ピジョン	66,600	2,311.00	153,912,600
兼松サステック	700	1,703.00	1,192,100
キングジム	8,900	881.00	7,840,900
リンテック	23,600	2,614.00	61,690,400
イトーキ	20,300	359.00	7,287,700
任天堂	62,200	58,770.00	3,655,494,000
三菱鉛筆	18,100	1,250.00	22,625,000
タカラスタンダード	22,800	1,346.00	30,688,800
コクヨ	52,900	1,591.00	84,163,900
ナカバヤシ	9,900	507.00	5,019,300
グローブライド	9,900	2,630.00	26,037,000
オカムラ	37,900	1,173.00	44,456,700
美津濃	10,900	2,272.00	24,764,800
東京電力ホールディングス	824,800	367.00	302,701,600
中部電力	337,200	1,136.00	383,059,200
関西電力	417,600	1,160.00	484,416,000
中国電力	172,200	905.00	155,841,000
北陸電力	100,800	558.00	56,246,400
東北電力	258,100	739.00	190,735,900
四国電力	99,200	814.00	80,748,800
九州電力	227,200	845.00	191,984,000
北海道電力	95,800	506.00	48,474,800
沖縄電力	23,400	1,417.00	33,157,800
電源開発	94,000	1,852.00	174,088,000
エフオン	6,700	536.00	3,591,200
イーレックス	16,200	1,664.00	26,956,800
レノバ	21,500	1,347.00	28,960,500
東京瓦斯	211,300	2,323.00	490,849,900
大阪瓦斯	199,600	2,111.00	421,355,600
東邦瓦斯	50,600	2,992.00	151,395,200
北海道瓦斯	5,500	1,511.00	8,310,500
広島ガス	21,000	349.00	7,329,000
西部ガスホールディングス	12,400	2,237.00	27,738,800
静岡ガス	28,700	845.00	24,251,500
メタウォーター	11,400	2,042.00	23,278,800
SBSホールディングス	8,200	3,030.00	24,846,000
東武鉄道	107,700	2,923.00	314,807,100

相鉄ホールディングス	35,300	2,237.00	78,966,100	
東急	278,000	1,583.00	440,074,000	
京浜急行電鉄	141,500	1,270.00	179,705,000	
小田急電鉄	163,900	2,127.00	348,615,300	
京王電鉄	57,200	5,280.00	302,016,000	
京成電鉄	76,700	3,400.00	260,780,000	
富士急行	13,100	4,070.00	53,317,000	
新京成電鉄	2,500	2,033.00	5,082,500	
東日本旅客鉄道	194,000	7,173.00	1,391,562,000	
西日本旅客鉄道	133,600	5,091.00	680,157,600	
東海旅客鉄道	91,600	15,930.00	1,459,188,000	
西武ホールディングス	143,900	1,233.00	177,428,700	
鴻池運輸	17,500	1,163.00	20,352,500	
西日本鉄道	30,500	2,656.00	81,008,000	
ハマキョウレックス	7,800	2,899.00	22,612,200	
サカイ引越センター	5,100	4,475.00	22,822,500	
近鉄グループホールディングス	104,400	3,580.00	373,752,000	
阪急阪神ホールディングス	130,500	3,510.00	458,055,000	
南海電気鉄道	46,600	2,384.00	111,094,400	
京阪ホールディングス	46,500	3,065.00	142,522,500	
神戸電鉄	2,500	3,410.00	8,525,000	
名古屋鉄道	85,800	2,130.00	182,754,000	
山陽電気鉄道	8,000	1,996.00	15,968,000	
アルプス物流	7,300	1,053.00	7,686,900	
ヤマトホールディングス	146,300	2,186.00	319,811,800	
山九	27,500	3,990.00	109,725,000	
丸運	5,900	246.00	1,451,400	
丸全昭和運輸	8,500	3,190.00	27,115,000	
センコーグループホールディングス	52,300	940.00	49,162,000	
トナミホールディングス	2,500	3,810.00	9,525,000	
ニッコンホールディングス	35,000	2,179.00	76,265,000	
日本石油輸送	1,100	2,641.00	2,905,100	
福山通運	17,200	4,100.00	70,520,000	
セイノーホールディングス	71,100	1,217.00	86,528,700	
エスライン	3,100	923.00	2,861,300	
神奈川中央交通	2,600	3,570.00	9,282,000	
日立物流	20,100	5,950.00	119,595,000	
丸和運輸機関	22,000	1,051.00	23,122,000	
C & F ロジホールディングス	10,500	1,246.00	13,083,000	
九州旅客鉄道	80,700	2,576.00	207,883,200	
S Gホールディングス	197,200	2,517.00	496,352,400	
NIPPON EXPRESSホールディングス	36,100	7,330.00	264,613,000	

日本郵船	87,500	10,190.00	891,625,000
商船三井	58,000	9,160.00	531,280,000
川崎汽船	32,100	7,620.00	244,602,000
N S ユナイテッド海運	6,300	4,145.00	26,113,500
飯野海運	51,700	863.00	44,617,100
共栄タンカー	3,800	1,028.00	3,906,400
乾汽船	7,100	2,616.00	18,573,600
日本航空	239,300	2,365.00	565,944,500
A N A ホールディングス	265,100	2,612.50	692,573,750
パスコ	2,000	1,310.00	2,620,000
トランコム	2,900	7,220.00	20,938,000
日新	8,300	1,716.00	14,242,800
三菱倉庫	33,100	2,764.00	91,488,400
三井倉庫ホールディングス	11,100	2,340.00	25,974,000
住友倉庫	36,900	2,134.00	78,744,600
澁澤倉庫	6,200	2,223.00	13,782,600
東陽倉庫	17,500	322.00	5,635,000
日本トランスシティ	23,000	617.00	14,191,000
ケイヒン	1,800	1,421.00	2,557,800
中央倉庫	6,400	980.00	6,272,000
川西倉庫	1,900	1,165.00	2,213,500
安田倉庫	8,600	981.00	8,436,600
ファイズホールディングス	2,200	659.00	1,449,800
東洋埠頭	3,200	1,516.00	4,851,200
上組	57,400	2,192.00	125,820,800
サンリツ	2,900	835.00	2,421,500
キムラユニティー	2,700	1,371.00	3,701,700
キューソー流通システム	5,200	945.00	4,914,000
近鉄エクスプレス	19,700	2,949.00	58,095,300
東海運	5,900	308.00	1,817,200
エーアイティー	6,500	1,407.00	9,145,500
内外トランスライン	4,000	1,885.00	7,540,000
日本コンセプト	3,300	1,456.00	4,804,800
N E C ネットエスアイ	35,800	1,758.00	62,936,400
クロスキャット	2,900	1,767.00	5,124,300
システナ	154,600	386.00	59,675,600
デジタルアーツ	5,800	6,000.00	34,800,000
日鉄ソリューションズ	15,700	3,530.00	55,421,000
キューブシステム	5,600	907.00	5,079,200
WOW WORLD	1,600	1,110.00	1,776,000
コア	4,600	1,522.00	7,001,200
ラクーンホールディングス	7,700	1,117.00	8,600,900

ソリトンシステムズ	5,500	1,497.00	8,233,500
ソフトクリエイトホールディングス	4,700	4,075.00	19,152,500
T I S	103,200	2,584.00	266,668,800
J N S ホールディングス	5,000	414.00	2,070,000
グリー	49,300	808.00	39,834,400
G M O ペパボ	1,200	2,286.00	2,743,200
コーエーテクモホールディングス	34,500	3,985.00	137,482,500
三菱総合研究所	4,700	3,710.00	17,437,000
電算	1,200	2,282.00	2,738,400
A G S	5,600	792.00	4,435,200
ファインデックス	9,200	694.00	6,384,800
ブレインパッド	8,500	1,060.00	9,010,000
K L a b	19,800	398.00	7,880,400
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	15,800	1,029.00	16,258,200
ネクソン	244,000	2,508.00	611,952,000
アイスタイル	33,500	189.00	6,331,500
エムアップホールディングス	12,600	883.00	11,125,800
エイチーム	7,600	709.00	5,388,400
エニグモ	11,800	674.00	7,953,200
テクノスジャパン	8,600	440.00	3,784,000
コロプラ	35,700	630.00	22,491,000
ブロードリーフ	53,900	328.00	17,679,200
クロス・マーケティンググループ	4,200	850.00	3,570,000
デジタルハーツホールディングス	5,000	1,471.00	7,355,000
システム情報	8,200	1,008.00	8,265,600
メディアドゥ	3,800	2,427.00	9,222,600
じげん	30,900	298.00	9,208,200
ブイキューブ	11,100	758.00	8,413,800
エンカレッジ・テクノロジー	2,600	522.00	1,357,200
サイバーリンクス	3,700	900.00	3,330,000
フィックスターズ	11,600	678.00	7,864,800
C A R T A H O L D I N G S	4,400	2,353.00	10,353,200
オブティム	7,600	875.00	6,650,000
セレス	4,000	1,321.00	5,284,000
S H I F T	5,500	19,920.00	109,560,000
ティーガイア	9,700	1,724.00	16,722,800
セック	1,600	2,075.00	3,320,000
テクマトリックス	18,300	1,557.00	28,493,100
プロシップ	3,600	1,430.00	5,148,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	29,400	2,838.00	83,437,200
G M O ペイメントゲートウェイ	21,000	10,190.00	213,990,000
ザッパラス	4,400	492.00	2,164,800

システムリサーチ	3,200	1,762.00	5,638,400
インターネットイニシアティブ	28,800	3,405.00	98,064,000
さくらインターネット	11,800	513.00	6,053,400
ヴィンクス	3,100	971.00	3,010,100
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,400	4,170.00	10,008,000
SRAホールディングス	5,300	2,863.00	15,173,900
システムインテグレータ	3,600	535.00	1,926,000
朝日ネット	10,000	597.00	5,970,000
eBASE	13,100	618.00	8,095,800
アバント	11,700	1,044.00	12,214,800
アドソル日進	3,900	1,601.00	6,243,900
ODKソリューションズ	2,400	655.00	1,572,000
フリービット	6,500	894.00	5,811,000
コムチュア	12,200	2,762.00	33,696,400
サイバーコム	1,700	938.00	1,594,600
アステリア	7,900	706.00	5,577,400
アイル	6,100	1,295.00	7,899,500
マークライنز	5,500	2,625.00	14,437,500
メディカル・データ・ビジョン	13,800	1,015.00	14,007,000
gumi	15,200	543.00	8,253,600
ショーケース	2,600	432.00	1,123,200
モバイルファクトリー	2,600	927.00	2,410,200
テラスカイ	4,000	1,428.00	5,712,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,900	1,258.00	6,164,200
PCIホールディングス	4,900	951.00	4,659,900
パイプドHD	2,000	2,575.00	5,150,000
アイビーシー	1,900	557.00	1,058,300
ネオジャパン	3,200	1,059.00	3,388,800
PR TIMES	2,300	2,882.00	6,628,600
ラクス	37,200	1,674.00	62,272,800
ランドコンピュータ	2,600	855.00	2,223,000
ダブルスタンダード	3,300	1,816.00	5,992,800
オープンドア	6,500	1,944.00	12,636,000
マイネット	3,900	487.00	1,899,300
アカツキ	4,900	2,783.00	13,636,700
ベネフィットジャパン	900	1,921.00	1,728,900
Ubicomホールディングス	2,900	2,042.00	5,921,800
カナミックネットワーク	11,800	444.00	5,239,200
ノムラシステムコーポレーション	6,000	221.00	1,326,000
チェンジ	20,000	1,611.00	32,220,000
シンクロ・フード	5,900	261.00	1,539,900
オークネット	5,800	1,536.00	8,908,800

キャピタル・アセット・プランニング	2,300	796.00	1,830,800	
セグエグループ	2,900	523.00	1,516,700	
エイトレッド	1,600	1,905.00	3,048,000	
マクロミル	22,200	1,178.00	26,151,600	
ビーグリー	2,600	1,238.00	3,218,800	
オロ	3,500	2,412.00	8,442,000	
ユーザーローカル	3,300	1,472.00	4,857,600	
テモナ	2,600	385.00	1,001,000	
ニーズウェル	2,600	608.00	1,580,800	
マネーフォワード	16,500	4,485.00	74,002,500	
サインポスト	3,500	861.00	3,013,500	
電算システムホールディングス	4,500	2,755.00	12,397,500	
ソルクシーズ	9,400	402.00	3,778,800	
フェイス	3,000	679.00	2,037,000	
プロトコーポレーション	11,600	1,229.00	14,256,400	
ハイマックス	3,000	1,219.00	3,657,000	
野村総合研究所	209,000	3,785.00	791,065,000	
サイバネットシステム	7,800	627.00	4,890,600	
C Eホールディングス	5,900	463.00	2,731,700	
日本システム技術	2,200	2,080.00	4,576,000	
インターージホールディングス	13,500	1,759.00	23,746,500	
東邦システムサイエンス	3,000	924.00	2,772,000	
ソースネクスト	47,300	155.00	7,331,500	
インフォコム	11,900	2,011.00	23,930,900	
シンプレクス・ホールディングス	11,600	1,559.00	18,084,400	
HEROZ	3,200	888.00	2,841,600	
ラクスル	11,900	3,060.00	36,414,000	
I P S	3,000	1,975.00	5,925,000	
F I G	12,100	281.00	3,400,100	
システムサポート	3,300	1,029.00	3,395,700	
イーソル	6,800	482.00	3,277,600	
アルテリア・ネットワークス	13,800	1,312.00	18,105,600	
東海ソフト	1,800	907.00	1,632,600	
ウイングアーク1st	6,200	1,212.00	7,514,400	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	1,663.00	4,157,500	
サーバーワークス	1,900	2,302.00	4,373,800	
東名	1,100	920.00	1,012,000	
ヴィッツ	1,100	1,276.00	1,403,600	
トビラシステムズ	2,300	780.00	1,794,000	
S a n s a n	38,500	982.00	37,807,000	
L i n k - U	2,100	731.00	1,535,100	
ギフティ	9,800	834.00	8,173,200	

ベース	1,900	4,980.00	9,462,000
J M D C	10,200	5,480.00	55,896,000
フォーカスシステムズ	7,400	899.00	6,652,600
クレスコ	7,900	1,774.00	14,014,600
フジ・メディア・ホールディングス	104,300	1,255.00	130,896,500
オービック	34,100	17,660.00	602,206,000
ジャストシステム	15,400	5,330.00	82,082,000
T D C ソフト	9,600	1,105.00	10,608,000
Zホールディングス	1,572,100	557.80	876,917,380
トレンドマイクロ	57,800	5,890.00	340,442,000
I Dホールディングス	6,900	849.00	5,858,100
日本オラクル	17,600	8,130.00	143,088,000
アルファシステムズ	2,900	3,715.00	10,773,500
フューチャー	22,900	1,328.00	30,411,200
C A C H o l d i n g s	6,400	1,297.00	8,300,800
S Bテクノロジー	4,700	2,517.00	11,829,900
トーセ	3,100	719.00	2,228,900
オービックビジネスコンサルタント	10,300	4,155.00	42,796,500
伊藤忠テクノソリューションズ	49,300	2,907.00	143,315,100
アイティフォー	13,200	779.00	10,282,800
東計電算	1,300	4,975.00	6,467,500
エクスネット	1,800	986.00	1,774,800
大塚商会	58,500	4,240.00	248,040,000
サイボウズ	14,500	1,287.00	18,661,500
電通国際情報サービス	15,600	3,715.00	57,954,000
A C C E S S	12,400	581.00	7,204,400
デジタルガレージ	17,900	3,905.00	69,899,500
E Mシステムズ	18,000	706.00	12,708,000
ウェザーニューズ	3,300	7,600.00	25,080,000
C I J	7,100	808.00	5,736,800
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,590.00	4,667,000
日本エンタープライズ	11,600	172.00	1,995,200
WOWOW	5,200	1,748.00	9,089,600
スカラ	9,800	670.00	6,566,000
インテリジェント ウェイブ	6,500	577.00	3,750,500
I M A G I C A G R O U P	9,400	656.00	6,166,400
ネットワンシステムズ	41,200	2,751.00	113,341,200
システムソフト	24,200	91.00	2,202,200
アルゴグラフィックス	8,400	3,175.00	26,670,000
マーベラス	17,200	734.00	12,624,800
エイベックス	18,700	1,364.00	25,506,800
日本ユニシス	33,800	3,035.00	102,583,000

兼松エレクトロニクス	5,900	3,895.00	22,980,500
都築電気	5,600	1,385.00	7,756,000
TBSホールディングス	65,800	1,889.00	124,296,200
日本テレビホールディングス	90,400	1,328.00	120,051,200
朝日放送グループホールディングス	10,900	758.00	8,262,200
テレビ朝日ホールディングス	26,100	1,567.00	40,898,700
スカパーJSAIホールディングス	91,800	444.00	40,759,200
テレビ東京ホールディングス	7,800	2,120.00	16,536,000
日本BS放送	3,700	1,065.00	3,940,500
ビジョン	18,600	1,154.00	21,464,400
スマートバリュー	3,000	439.00	1,317,000
USEN-NEXT HOLDINGS	10,300	2,324.00	23,937,200
ワイヤレスゲート	4,800	291.00	1,396,800
コネクシオ	7,700	1,391.00	10,710,700
クロップス	2,100	917.00	1,925,700
日本電信電話	1,131,400	3,330.00	3,767,562,000
KDDI	788,500	3,793.00	2,990,780,500
ソフトバンク	1,638,100	1,472.00	2,411,283,200
光通信	12,700	14,190.00	180,213,000
エムティーアイ	10,700	474.00	5,071,800
GMOインターネット	38,300	2,463.00	94,332,900
ファイバーゲート	3,600	1,292.00	4,651,200
アイドママーケティングコミュニケーション	2,700	287.00	774,900
KADOKAWA	59,100	2,509.00	148,281,900
学研ホールディングス	15,400	1,001.00	15,415,400
ゼンリン	17,800	1,074.00	19,117,200
昭文社ホールディングス	4,600	458.00	2,106,800
インプレスホールディングス	9,000	202.00	1,818,000
アイネット	5,600	1,265.00	7,084,000
松竹	7,200	11,680.00	84,096,000
東宝	63,800	4,775.00	304,645,000
東映	3,500	17,120.00	59,920,000
エヌ・ティ・ティ・データ	288,000	2,133.00	614,304,000
ピー・シー・エー	6,400	1,420.00	9,088,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,800	1,501.00	5,703,800
DTS	20,800	2,726.00	56,700,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	50,300	5,540.00	278,662,000
シーイーシー	11,700	1,090.00	12,753,000
カブコン	102,000	2,819.00	287,538,000
アイ・エス・ビー	5,200	980.00	5,096,000
ジャステック	6,400	1,047.00	6,700,800
SSK	74,900	1,913.00	143,283,700

日本システムウエア	4,100	2,088.00	8,560,800	
アイネス	9,900	1,526.00	15,107,400	
T K C	18,300	3,040.00	55,632,000	
富士ソフト	11,600	5,530.00	64,148,000	
N S D	34,800	2,137.00	74,367,600	
コナミホールディングス	39,300	6,820.00	268,026,000	
福井コンピュータホールディングス	5,000	3,040.00	15,200,000	
J B C Cホールディングス	7,400	1,446.00	10,700,400	
ミロク情報サービス	9,600	1,396.00	13,401,600	
ソフトバンクグループ	648,500	5,160.00	3,346,260,000	
ハウスイ	900	817.00	735,300	
高千穂交易	4,200	1,567.00	6,581,400	
オルパヘルスケアホールディングス	1,800	1,528.00	2,750,400	
伊藤忠食品	2,600	5,030.00	13,078,000	
エレマテック	8,700	1,067.00	9,282,900	
J A L U X	3,100	2,558.00	7,929,800	
あらた	8,600	3,900.00	33,540,000	
トーメンデバイス	1,600	6,180.00	9,888,000	
東京エレクトロン デバイス	3,200	5,360.00	17,152,000	
フィールズ	9,500	614.00	5,833,000	
双日	119,900	1,958.00	234,764,200	
アルフレッサ ホールディングス	120,600	1,752.00	211,291,200	
横浜冷凍	30,400	867.00	26,356,800	
ラサ商事	5,800	1,014.00	5,881,200	
アルコニックス	13,500	1,344.00	18,144,000	
神戸物産	84,300	3,770.00	317,811,000	
ハイパー	2,700	476.00	1,285,200	
あい ホールディングス	15,500	1,782.00	27,621,000	
ディーブイエックス	3,700	1,048.00	3,877,600	
ダイワボウホールディングス	52,800	1,770.00	93,456,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	25,900	2,633.00	68,194,700	
ラクト・ジャパン	3,700	2,039.00	7,544,300	
グリムス	4,800	2,126.00	10,204,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,900	808.00	15,271,200	
八洲電機	7,900	956.00	7,552,400	
メディアスホールディングス	6,200	911.00	5,648,200	
レスターホールディングス	10,300	1,977.00	20,363,100	
ジュテックホールディングス	2,500	1,230.00	3,075,000	
大光	4,200	698.00	2,931,600	
O C H Iホールディングス	3,200	1,357.00	4,342,400	
T O K A Iホールディングス	52,600	907.00	47,708,200	
黒谷	3,000	666.00	1,998,000	

Cominix	1,900	745.00	1,415,500
三洋貿易	10,900	1,016.00	11,074,400
ビューティガレージ	1,800	3,260.00	5,868,000
ウイン・パートナーズ	7,900	1,044.00	8,247,600
ミタチ産業	3,000	912.00	2,736,000
シップヘルスケアホールディングス	34,800	2,301.00	80,074,800
明治電機工業	3,400	1,044.00	3,549,600
デリカフーズホールディングス	4,200	550.00	2,310,000
スターティアホールディングス	2,500	596.00	1,490,000
コメダホールディングス	23,700	2,129.00	50,457,300
ピーバンドットコム	1,500	586.00	879,000
アセンテック	3,700	699.00	2,586,300
富士興産	2,700	947.00	2,556,900
協栄産業	1,100	1,571.00	1,728,100
フルサト・マルカホールディングス	10,400	2,350.00	24,440,000
ヤマエグループホールディングス	7,300	1,054.00	7,694,200
小野建	10,500	1,622.00	17,031,000
南陽	2,200	1,948.00	4,285,600
佐島電機	6,800	907.00	6,167,600
エコートレーディング	2,300	601.00	1,382,300
伯東	6,600	2,353.00	15,529,800
コンドーテック	8,400	1,021.00	8,576,400
中山福	5,800	405.00	2,349,000
ナガイレーベン	14,400	2,145.00	30,888,000
三菱食品	10,400	3,150.00	32,760,000
松田産業	7,900	2,274.00	17,964,600
第一興商	20,600	3,610.00	74,366,000
メディバルホールディングス	117,100	2,094.00	245,207,400
S P K	4,300	1,306.00	5,615,800
萩原電気ホールディングス	4,000	2,087.00	8,348,000
アズワン	15,600	6,660.00	103,896,000
スズデン	3,800	2,168.00	8,238,400
尾家産業	2,900	1,021.00	2,960,900
シモジマ	6,700	1,023.00	6,854,100
ドウシシャ	10,200	1,547.00	15,779,400
小津産業	2,400	2,005.00	4,812,000
高速	6,500	1,521.00	9,886,500
たけびし	4,100	1,447.00	5,932,700
リックス	2,500	1,625.00	4,062,500
丸文	9,600	712.00	6,835,200
ハピネット	9,100	1,589.00	14,459,900
橋本総業ホールディングス	2,200	2,008.00	4,417,600

日本ライフライン	32,200	1,037.00	33,391,400
タカショー	8,300	673.00	5,585,900
I D O M	33,000	657.00	21,681,000
進和	6,400	2,025.00	12,960,000
エスケイジャパン	2,700	424.00	1,144,800
ダイトロン	4,600	1,789.00	8,229,400
シークス	15,500	1,130.00	17,515,000
田中商事	3,400	643.00	2,186,200
オーハシテクニカ	5,800	1,364.00	7,911,200
白銅	3,500	2,553.00	8,935,500
ダイコー通産	1,300	1,210.00	1,573,000
伊藤忠商事	759,200	3,834.00	2,910,772,800
丸紅	1,070,700	1,236.50	1,323,920,550
高島	1,600	2,377.00	3,803,200
長瀬産業	59,600	1,856.00	110,617,600
蝶理	6,100	1,781.00	10,864,100
豊田通商	109,000	5,040.00	549,360,000
三共生興	14,400	571.00	8,222,400
兼松	40,500	1,407.00	56,983,500
ツカモトコーポレーション	1,800	1,339.00	2,410,200
三井物産	843,000	3,075.00	2,592,225,000
日本紙パルプ商事	5,700	4,160.00	23,712,000
カメイ	12,900	1,042.00	13,441,800
東都水産	600	3,920.00	2,352,000
O U Gホールディングス	1,600	2,721.00	4,353,600
スターゼン	8,000	2,124.00	16,992,000
山善	45,700	1,020.00	46,614,000
椿本興業	2,200	4,115.00	9,053,000
住友商事	685,100	1,899.00	1,301,004,900
内田洋行	4,600	4,595.00	21,137,000
三菱商事	813,400	4,061.00	3,303,217,400
第一実業	4,900	4,310.00	21,119,000
キャノンマーケティングジャパン	26,900	2,466.00	66,335,400
西華産業	5,700	1,603.00	9,137,100
佐藤商事	9,000	1,225.00	11,025,000
菱洋エレクトロ	6,400	2,136.00	13,670,400
東京産業	9,800	698.00	6,840,400
ユアサ商事	10,300	2,986.00	30,755,800
神鋼商事	2,400	3,850.00	9,240,000
トルク	5,900	212.00	1,250,800
阪和興業	21,700	3,275.00	71,067,500
正栄食品工業	7,000	4,165.00	29,155,000

カナデン	8,800	1,015.00	8,932,000
菱電商事	8,600	1,761.00	15,144,600
岩谷産業	26,100	5,360.00	139,896,000
ナイス	3,700	1,838.00	6,800,600
ニチモウ	1,600	2,830.00	4,528,000
極東貿易	3,100	2,244.00	6,956,400
アステナホールディングス	15,400	416.00	6,406,400
三愛石油	26,700	933.00	24,911,100
稲畑産業	23,900	2,490.00	59,511,000
G S I クレオス	5,200	1,152.00	5,990,400
明和産業	10,000	1,114.00	11,140,000
クワザワホールディングス	4,300	609.00	2,618,700
ワキタ	23,200	1,000.00	23,200,000
東邦ホールディングス	34,800	1,874.00	65,215,200
サンゲツ	28,700	1,579.00	45,317,300
ミツウロコグループホールディングス	16,000	1,043.00	16,688,000
シナネンホールディングス	4,000	3,295.00	13,180,000
伊藤忠エネクス	24,000	1,025.00	24,600,000
サンリオ	33,500	2,427.00	81,304,500
サンワテクノス	6,600	1,349.00	8,903,400
リョーサン	12,000	2,317.00	27,804,000
新光商事	16,300	917.00	14,947,100
トーヨー	4,900	1,061.00	5,198,900
三信電気	5,000	1,695.00	8,475,000
東陽テクニカ	10,700	1,071.00	11,459,700
モスフードサービス	14,200	3,015.00	42,813,000
加賀電子	9,800	3,145.00	30,821,000
ソーダニッカ	10,700	777.00	8,313,900
立花エレテック	8,700	1,588.00	13,815,600
フォーバル	4,800	842.00	4,041,600
P A L T A C	15,200	4,450.00	67,640,000
三谷産業	12,800	315.00	4,032,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,500	2,815.00	7,037,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,003.00	2,003,000
コア商事ホールディングス	8,200	697.00	5,715,400
国際紙パルプ商事	22,600	363.00	8,203,800
ヤマタネ	5,100	1,625.00	8,287,500
丸紅建材リース	1,000	1,760.00	1,760,000
日鉄物産	7,700	5,330.00	41,041,000
泉州電業	3,100	6,260.00	19,406,000
トラスコ中山	22,600	2,533.00	57,245,800
オートバックスセブン	36,500	1,429.00	52,158,500

モリト	7,900	731.00	5,774,900
加藤産業	15,700	3,125.00	49,062,500
北恵	2,800	934.00	2,615,200
イノテック	6,600	1,429.00	9,431,400
イエローハット	18,800	1,628.00	30,606,400
J Kホールディングス	8,700	1,059.00	9,213,300
日伝	9,000	2,235.00	20,115,000
北沢産業	7,400	231.00	1,709,400
杉本商事	5,100	2,156.00	10,995,600
因幡電機産業	29,000	2,621.00	76,009,000
東テク	3,600	2,435.00	8,766,000
ミスミグループ本社	136,200	3,605.00	491,001,000
アルテック	7,400	288.00	2,131,200
タキヒヨー	3,300	1,275.00	4,207,500
蔵王産業	2,100	1,889.00	3,966,900
スズケン	42,400	3,605.00	152,852,000
ジェコス	7,500	828.00	6,210,000
グローセル	12,700	434.00	5,511,800
ローソン	24,000	4,855.00	116,520,000
サンエー	8,300	4,100.00	34,030,000
カワチ薬品	8,500	2,406.00	20,451,000
エービーシー・マート	17,000	5,220.00	88,740,000
ハードオフコーポレーション	5,100	800.00	4,080,000
アスクル	24,700	1,692.00	41,792,400
ゲオホールディングス	14,700	1,512.00	22,226,400
アダストリア	11,800	1,739.00	20,520,200
くら寿司	11,400	3,795.00	43,263,000
キャンドウ	5,300	2,066.00	10,949,800
アイケイ	3,800	408.00	1,550,400
パルグループホールディングス	9,600	1,598.00	15,340,800
エディオン	50,000	1,194.00	59,700,000
サーラコーポレーション	22,400	643.00	14,403,200
ワッツ	5,600	707.00	3,959,200
ハローズ	5,000	2,763.00	13,815,000
フジオフードグループ本社	9,200	1,317.00	12,116,400
あみやき亭	2,700	3,020.00	8,154,000
大黒天物産	3,500	4,690.00	16,415,000
ハニーズホールディングス	8,800	1,025.00	9,020,000
ファーマライズホールディングス	3,000	716.00	2,148,000
アルペン	8,400	2,141.00	17,984,400
ハブ	3,900	608.00	2,371,200
クオールホールディングス	13,500	1,292.00	17,442,000

ジズホールディングス	7,400	6,530.00	48,322,000	
ビックカメラ	64,600	1,011.00	65,310,600	
D C Mホールディングス	67,200	1,107.00	74,390,400	
M o n o t a R O	137,300	2,190.00	300,687,000	
東京一番フーズ	3,100	599.00	1,856,900	
きちりホールディングス	2,900	415.00	1,203,500	
アークランドサービスホールディングス	8,000	2,254.00	18,032,000	
J . フロント リテイリング	129,800	1,030.00	133,694,000	
ドトール・日レスホールディングス	18,900	1,606.00	30,353,400	
マツキヨココカラ&カンパニー	66,800	4,525.00	302,270,000	
ブロンコピリー	6,300	2,241.00	14,118,300	
Z O Z O	74,700	3,280.00	245,016,000	
トレジャー・ファクトリー	3,500	949.00	3,321,500	
物語コーポレーション	5,800	6,640.00	38,512,000	
三越伊勢丹ホールディングス	190,300	967.00	184,020,100	
H a m e e	3,000	1,136.00	3,408,000	
マーケットエンタープライズ	1,000	701.00	701,000	
ウエルシアホールディングス	57,500	3,090.00	177,675,000	
クリエイティブSDホールディングス	16,100	3,130.00	50,393,000	
丸善C H Iホールディングス	12,700	372.00	4,724,400	
ミサワ	2,500	647.00	1,617,500	
ティーライフ	1,600	1,346.00	2,153,600	
チムニー	3,300	1,137.00	3,752,100	
シュッピン	9,200	1,136.00	10,451,200	
オイシックス・ラ・大地	15,700	2,616.00	41,071,200	
ネクステージ	22,000	2,578.00	56,716,000	
ジョイフル本田	31,900	1,556.00	49,636,400	
鳥貴族ホールディングス	4,100	1,836.00	7,527,600	
ホットランド	8,300	1,315.00	10,914,500	
すかいらーくホールディングス	140,300	1,495.00	209,748,500	
S F Pホールディングス	5,300	1,415.00	7,499,500	
綿半ホールディングス	8,300	1,321.00	10,964,300	
ヨシックスホールディングス	2,200	2,276.00	5,007,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,800	1,057.00	33,612,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,800	1,068.00	6,194,400	
B E E N O S	5,600	1,462.00	8,187,200	
あさひ	9,100	1,306.00	11,884,600	
日本調剤	6,800	1,381.00	9,390,800	
コスモス薬品	11,000	15,760.00	173,360,000	
トーエル	5,500	910.00	5,005,000	
セブン&アイ・ホールディングス	424,700	5,726.00	2,431,832,200	

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	57,800	735.00	42,483,000	
ツルハホールディングス	23,700	9,200.00	218,040,000	
サンマルクホールディングス	8,700	1,631.00	14,189,700	
フェリシモ	2,600	1,184.00	3,078,400	
トリドールホールディングス	27,100	2,575.00	69,782,500	
TOKYO BASE	10,500	442.00	4,641,000	
ウイルプラスホールディングス	1,900	904.00	1,717,600	
JMホールディングス	7,400	1,782.00	13,186,800	
サツドラホールディングス	5,200	636.00	3,307,200	
アレンザホールディングス	8,500	1,057.00	8,984,500	
串カツ田中ホールディングス	3,000	2,032.00	6,096,000	
パロックジャパンリミテッド	7,800	850.00	6,630,000	
クスリのアオキホールディングス	10,800	6,960.00	75,168,000	
力の源ホールディングス	5,600	563.00	3,152,800	
FOOD & LIFE COMPANIES	63,600	3,755.00	238,818,000	
メディカルシステムネットワーク	10,900	513.00	5,591,700	
はるやまホールディングス	5,600	563.00	3,152,800	
ノジマ	17,700	2,550.00	45,135,000	
カップ・クリエイト	15,200	1,376.00	20,915,200	
ライトオン	8,100	712.00	5,767,200	
良品計画	125,000	1,764.00	220,500,000	
三城ホールディングス	14,400	249.00	3,585,600	
アドヴァングループ	11,300	940.00	10,622,000	
アルピス	3,600	2,215.00	7,974,000	
コナカ	12,800	353.00	4,518,400	
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,704.00	2,556,000	
G - 7ホールディングス	12,200	1,688.00	20,593,600	
イオン北海道	19,200	1,144.00	21,964,800	
コジマ	19,100	549.00	10,485,900	
ヒマラヤ	4,000	1,001.00	4,004,000	
コーナン商事	15,500	3,670.00	56,885,000	
エコス	4,100	1,954.00	8,011,400	
ワタミ	13,100	951.00	12,458,100	
マルシェ	2,600	459.00	1,193,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	217,100	1,876.00	407,279,600	
西松屋チェーン	24,000	1,356.00	32,544,000	
ゼンショーホールディングス	53,100	2,709.00	143,847,900	
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,427.00	9,846,300	
ハークスレイ	5,000	469.00	2,345,000	
サイゼリヤ	16,200	2,893.00	46,866,600	

V Tホールディングス	41,400	491.00	20,327,400
魚力	3,100	2,066.00	6,404,600
フジ・コーポレーション	5,900	1,177.00	6,944,300
ユナイテッドアローズ	11,500	1,771.00	20,366,500
ハイデイ日高	15,800	1,721.00	27,191,800
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	7,500	201.00	1,507,500
コロワイド	44,600	1,733.00	77,291,800
ピーシーデポコーポレーション	13,400	282.00	3,778,800
壱番屋	7,700	4,615.00	35,535,500
P L A N T	3,100	659.00	2,042,900
スギホールディングス	21,700	6,410.00	139,097,000
薬王堂ホールディングス	5,500	2,412.00	13,266,000
スクロール	17,000	935.00	15,895,000
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,725.00	17,422,500
木曽路	14,600	2,222.00	32,441,200
S R S ホールディングス	15,200	823.00	12,509,600
リテールパートナーズ	13,400	1,176.00	15,758,400
ケーヨー	20,200	879.00	17,755,800
上新電機	12,600	2,088.00	26,308,800
日本瓦斯	52,900	1,738.00	91,940,200
ロイヤルホールディングス	18,600	1,951.00	36,288,600
いなげや	13,500	1,394.00	18,819,000
チヨダ	10,900	750.00	8,175,000
ライフコーポレーション	10,200	2,958.00	30,171,600
リンガーハット	13,400	2,222.00	29,774,800
M r M a x H D	14,000	604.00	8,456,000
A O K I ホールディングス	21,400	610.00	13,054,000
オークワ	17,200	958.00	16,477,600
コメリ	16,800	2,776.00	46,636,800
青山商事	22,800	738.00	16,826,400
しまむら	12,700	10,080.00	128,016,000
はせがわ	6,600	304.00	2,006,400
高島屋	79,200	1,161.00	91,951,200
松屋	22,100	720.00	15,912,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,600	864.00	44,582,400
近鉄百貨店	4,200	2,592.00	10,886,400
丸井グループ	85,700	2,294.00	196,595,800
アクシアル リテイリング	8,500	3,285.00	27,922,500
イオン	417,700	2,614.00	1,091,867,800
イズミ	19,700	3,200.00	63,040,000
平和堂	20,100	1,993.00	40,059,300
フジ	13,200	2,099.00	27,706,800

ヤオコー	12,300	6,570.00	80,811,000
ゼビオホールディングス	15,000	948.00	14,220,000
ケーズホールディングス	100,300	1,253.00	125,675,900
Olympicグループ	5,900	709.00	4,183,100
日産東京販売ホールディングス	17,000	235.00	3,995,000
シルバーライフ	2,400	1,143.00	2,743,200
Genky DrugStores	4,800	3,730.00	17,904,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	1,023.00	2,659,800
ブックオフグループホールディングス	6,300	1,030.00	6,489,000
ギフト	1,800	2,320.00	4,176,000
アインホールディングス	14,600	6,470.00	94,462,000
元気寿司	3,100	2,600.00	8,060,000
ヤマダホールディングス	397,500	406.00	161,385,000
アークランドサカモト	17,100	1,544.00	26,402,400
ニトリホールディングス	43,100	16,525.00	712,227,500
グルメ杵屋	8,900	1,044.00	9,291,600
愛眼	7,900	185.00	1,461,500
ケーユーホールディングス	5,900	1,095.00	6,460,500
吉野家ホールディングス	38,000	2,395.00	91,010,000
松屋フーズホールディングス	5,300	3,650.00	19,345,000
サガミホールディングス	16,800	1,221.00	20,512,800
関西フードマーケット	8,400	1,108.00	9,307,200
王将フードサービス	7,200	6,040.00	43,488,000
プレナス	12,300	1,996.00	24,550,800
ミニストップ	8,100	1,434.00	11,615,400
アークス	20,800	2,192.00	45,593,600
パローホールディングス	24,100	2,194.00	52,875,400
ベルク	4,900	5,310.00	26,019,000
大庄	6,000	1,009.00	6,054,000
ファーストリテイリング	14,500	64,410.00	933,945,000
サンドラッグ	40,900	3,200.00	130,880,000
サクスパー ホールディングス	10,700	511.00	5,467,700
ヤマザワ	2,700	1,660.00	4,482,000
やまや	2,200	2,564.00	5,640,800
ベルーナ	23,600	727.00	17,157,200
島根銀行	3,500	555.00	1,942,500
じもとホールディングス	7,700	682.00	5,251,400
めぶきフィナンシャルグループ	564,800	281.00	158,708,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,600	2,074.00	28,206,400
九州フィナンシャルグループ	222,000	414.00	91,908,000
ゆうちょ銀行	256,600	1,014.00	260,192,400
富山第一銀行	25,900	320.00	8,288,000

コンコルディア・フィナンシャルグループ	620,800	490.00	304,192,000
西日本フィナンシャルホールディングス	71,000	843.00	59,853,000
三十三フィナンシャルグループ	10,100	1,522.00	15,372,200
第四北越フィナンシャルグループ	17,700	2,703.00	47,843,100
ひろぎんホールディングス	160,300	685.00	109,805,500
おきなわフィナンシャルグループ	9,800	2,412.00	23,637,600
十六フィナンシャルグループ	14,600	2,427.00	35,434,200
北國フィナンシャルホールディングス	10,100	3,310.00	33,431,000
新生銀行	70,900	2,162.00	153,285,800
あおぞら銀行	60,700	2,709.00	164,436,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,817,100	739.10	5,038,518,610
りそなホールディングス	1,244,200	536.70	667,762,140
三井住友トラスト・ホールディングス	205,500	4,158.00	854,469,000
三井住友フィナンシャルグループ	752,400	4,277.00	3,218,014,800
千葉銀行	362,800	774.00	280,807,200
群馬銀行	208,800	398.00	83,102,400
武蔵野銀行	16,200	1,929.00	31,249,800
千葉興業銀行	25,500	276.00	7,038,000
筑波銀行	42,400	219.00	9,285,600
七十七銀行	34,100	1,556.00	53,059,600
青森銀行	8,400	1,930.00	16,212,000
秋田銀行	7,000	1,736.00	12,152,000
山形銀行	12,200	999.00	12,187,800
岩手銀行	7,100	1,949.00	13,837,900
東邦銀行	90,700	223.00	20,226,100
東北銀行	5,200	1,019.00	5,298,800
みちのく銀行	7,000	895.00	6,265,000
ふくおかフィナンシャルグループ	91,600	2,383.00	218,282,800
静岡銀行	264,700	900.00	238,230,000
スルガ銀行	95,300	451.00	42,980,300
八十二銀行	244,800	440.00	107,712,000
山梨中央銀行	11,800	963.00	11,363,400
大垣共立銀行	21,500	2,055.00	44,182,500
福井銀行	9,300	1,476.00	13,726,800
清水銀行	4,500	1,639.00	7,375,500
富山銀行	2,000	2,274.00	4,548,000
滋賀銀行	20,400	2,262.00	46,144,800
南都銀行	17,000	2,129.00	36,193,000
百五銀行	104,300	359.00	37,443,700
京都銀行	38,900	5,580.00	217,062,000
紀陽銀行	36,800	1,551.00	57,076,800
ほくほくフィナンシャルグループ	67,800	967.00	65,562,600

山陰合同銀行	64,500	688.00	44,376,000
中国銀行	86,900	909.00	78,992,100
鳥取銀行	3,500	1,258.00	4,403,000
伊予銀行	144,000	635.00	91,440,000
百十四銀行	11,500	1,792.00	20,608,000
四国銀行	16,500	810.00	13,365,000
阿波銀行	16,600	2,315.00	38,429,000
大分銀行	6,300	2,042.00	12,864,600
宮崎銀行	6,800	2,246.00	15,272,800
佐賀銀行	6,200	1,566.00	9,709,200
琉球銀行	23,600	860.00	20,296,000
セブン銀行	322,800	247.00	79,731,600
みずほフィナンシャルグループ	1,390,200	1,592.00	2,213,198,400
高知銀行	3,900	762.00	2,971,800
山口フィナンシャルグループ	126,600	736.00	93,177,600
長野銀行	3,600	1,270.00	4,572,000
名古屋銀行	8,100	3,125.00	25,312,500
北洋銀行	163,900	268.00	43,925,200
愛知銀行	3,900	4,825.00	18,817,500
中京銀行	3,900	1,635.00	6,376,500
大光銀行	3,700	1,477.00	5,464,900
愛媛銀行	15,200	981.00	14,911,200
トマト銀行	3,900	1,070.00	4,173,000
京葉銀行	46,300	520.00	24,076,000
栃木銀行	52,500	233.00	12,232,500
北日本銀行	3,400	1,742.00	5,922,800
東和銀行	19,100	584.00	11,154,400
福島銀行	12,500	246.00	3,075,000
大東銀行	5,200	753.00	3,915,600
トモニホールディングス	84,000	354.00	29,736,000
フィデアホールディングス	9,900	1,412.00	13,978,800
池田泉州ホールディングス	125,000	189.00	23,625,000
F P G	36,700	875.00	32,112,500
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,500	1,147.00	9,749,500
マーキュリアホールディングス	4,500	522.00	2,349,000
S B I ホールディングス	134,100	3,045.00	408,334,500
ジャフコ グループ	41,400	1,708.00	70,711,200
大和証券グループ本社	814,200	691.40	562,937,880
野村ホールディングス	1,659,900	538.30	893,524,170
岡三証券グループ	85,800	391.00	33,547,800
丸三証券	32,500	547.00	17,777,500
東洋証券	36,600	155.00	5,673,000

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	125,100	420.00	52,542,000
光世証券	2,500	476.00	1,190,000
水戸証券	29,400	280.00	8,232,000
いちよし証券	20,500	663.00	13,591,500
松井証券	53,400	817.00	43,627,800
マネックスグループ	88,800	512.00	45,465,600
極東証券	14,700	772.00	11,348,400
岩井コスモホールディングス	10,300	1,416.00	14,584,800
アイザワ証券グループ	18,000	898.00	16,164,000
マネーパートナーズグループ	12,100	235.00	2,843,500
スパークス・グループ	50,600	261.00	13,206,600
かんぽ生命保険	109,400	2,079.00	227,442,600
S O M P Oホールディングス	178,500	5,339.00	953,011,500
アニコム ホールディングス	33,400	770.00	25,718,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	243,800	3,982.00	970,811,600
第一生命ホールディングス	535,100	2,638.50	1,411,861,350
東京海上ホールディングス	358,000	7,033.00	2,517,814,000
T & Dホールディングス	282,200	1,771.00	499,776,200
アドバンスクリエイト	5,200	1,003.00	5,215,600
全国保証	26,000	4,830.00	125,580,000
あんしん保証	4,100	285.00	1,168,500
イントラスト	5,000	589.00	2,945,000
日本モーゲージサービス	6,300	1,007.00	6,344,100
C a s a	4,100	835.00	3,423,500
アルヒ	16,300	1,022.00	16,658,600
プレミアグループ	5,600	4,160.00	23,296,000
ネットプロテクションズホールディングス	24,900	563.00	14,018,700
クレディセゾン	70,000	1,357.00	94,990,000
芙蓉総合リース	11,400	7,700.00	87,780,000
みずほリース	16,900	3,220.00	54,418,000
東京センチュリー	21,100	5,700.00	120,270,000
日本証券金融	43,000	906.00	38,958,000
アイフル	183,200	363.00	66,501,600
リコーリース	9,700	3,795.00	36,811,500
イオンフィナンシャルサービス	59,300	1,240.00	73,532,000
アコム	215,200	323.00	69,509,600
ジャックス	12,100	3,265.00	39,506,500
オリエントコーポレーション	296,100	124.00	36,716,400
オリックス	660,000	2,368.00	1,562,880,000
三菱H C キャピタル	402,000	614.00	246,828,000
九州リースサービス	5,800	602.00	3,491,600
日本取引所グループ	275,400	2,192.50	603,814,500

イー・ギャランティ	16,100	2,079.00	33,471,900
アサックス	6,000	687.00	4,122,000
NECキャピタルソリューション	4,600	2,180.00	10,028,000
いちご	123,800	279.00	34,540,200
日本駐車場開発	125,200	139.00	17,402,800
スター・マイカ・ホールディングス	6,500	1,239.00	8,053,500
SREホールディングス	2,800	3,590.00	10,052,000
ADワークスグループ	22,000	141.00	3,102,000
ヒューリック	260,400	1,067.00	277,846,800
三栄建築設計	4,900	1,615.00	7,913,500
野村不動産ホールディングス	56,500	2,842.00	160,573,000
三重交通グループホールディングス	23,800	470.00	11,186,000
サムティ	17,900	2,134.00	38,198,600
ディア・ライフ	15,500	517.00	8,013,500
地主	7,400	1,783.00	13,194,200
プレサンスコーポレーション	14,500	1,868.00	27,086,000
ハウスコム	2,500	1,279.00	3,197,500
日本管理センター	6,100	1,022.00	6,234,200
サンセイランディック	4,200	805.00	3,381,000
フージャースホールディングス	13,900	691.00	9,604,900
オープンハウスグループ	34,700	5,000.00	173,500,000
東急不動産ホールディングス	321,400	664.00	213,409,600
飯田グループホールディングス	91,000	2,194.00	199,654,000
イーランド	2,300	1,371.00	3,153,300
ムゲンエステート	8,300	480.00	3,984,000
And Doホールディングス	5,400	910.00	4,914,000
シーアールイー	3,500	1,655.00	5,792,500
ケイアイスター不動産	5,000	5,000.00	25,000,000
グッドコムアセット	5,400	1,136.00	6,134,400
ジェイ・エス・ビー	2,500	3,210.00	8,025,000
テンポイノベーション	4,000	834.00	3,336,000
フェイスネットワーク	1,700	1,307.00	2,221,900
パーク24	58,800	1,768.00	103,958,400
パラカ	3,300	1,699.00	5,606,700
三井不動産	495,900	2,592.50	1,285,620,750
三菱地所	714,700	1,813.50	1,296,108,450
平和不動産	18,800	3,985.00	74,918,000
東京建物	107,800	1,816.00	195,764,800
京阪神ビルディング	17,400	1,506.00	26,204,400
住友不動産	228,300	3,639.00	830,783,700
テーオーシー	20,700	695.00	14,386,500
東京楽天地	2,000	3,960.00	7,920,000

スターツコーポレーション	15,100	2,555.00	38,580,500
フジ住宅	13,800	659.00	9,094,200
空港施設	12,300	560.00	6,888,000
明和地所	6,400	604.00	3,865,600
ゴールドクレスト	9,100	1,857.00	16,898,700
エスリード	4,700	1,774.00	8,337,800
日神グループホールディングス	19,300	508.00	9,804,400
日本エスコン	20,200	758.00	15,311,600
タカラレーベン	45,500	320.00	14,560,000
A V A N T I A	6,600	837.00	5,524,200
イオンモール	55,000	1,660.00	91,300,000
毎日コムネット	4,800	699.00	3,355,200
ファースト住建	4,700	1,197.00	5,625,900
カチタス	27,100	3,260.00	88,346,000
トーセイ	15,700	1,077.00	16,908,900
穴吹興産	2,800	1,960.00	5,488,000
サンフロンティア不動産	15,800	1,080.00	17,064,000
F Jネクストホールディングス	11,500	997.00	11,465,500
インテリックス	2,400	626.00	1,502,400
ランドビジネス	4,600	239.00	1,099,400
サンネクスタグループ	4,200	1,087.00	4,565,400
グランディハウス	9,000	572.00	5,148,000
日本空港ビルデング	41,600	5,550.00	230,880,000
明豊ファシリティワークス	5,000	710.00	3,550,000
日本工営	6,200	2,996.00	18,575,200
L I F U L L	33,000	239.00	7,887,000
ミクシィ	24,200	2,240.00	54,208,000
ジェイエシーリクルートメント	8,600	1,787.00	15,368,200
日本M & Aセンターホールディングス	172,800	1,686.00	291,340,800
メンバーズ	3,200	2,877.00	9,206,400
中広	2,200	389.00	855,800
UTグループ	15,200	3,415.00	51,908,000
アイティメディア	5,100	1,571.00	8,012,100
E・Jホールディングス	5,700	1,163.00	6,629,100
夢真ビーネックスグループ	34,400	1,550.00	53,320,000
コシダカホールディングス	28,500	635.00	18,097,500
アルトナー	2,800	875.00	2,450,000
パソナグループ	11,500	2,457.00	28,255,500
C D S	2,700	1,609.00	4,344,300
リンクアンドモチベーション	23,200	433.00	10,045,600
エス・エム・エス	35,800	3,065.00	109,727,000
サニーサイドアップグループ	3,900	731.00	2,850,900

パーソルホールディングス	105,400	2,503.00	263,816,200
リニカル	6,200	672.00	4,166,400
クックパッド	33,800	254.00	8,585,200
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,400	590.00	3,186,000
学情	4,400	1,036.00	4,558,400
スタジオアリス	4,800	2,195.00	10,536,000
シミックホールディングス	6,000	1,509.00	9,054,000
エプロ	2,500	689.00	1,722,500
N J S	2,400	2,009.00	4,821,600
総合警備保障	41,900	4,235.00	177,446,500
カカクコム	77,300	2,553.00	197,346,900
アイロムグループ	3,800	1,910.00	7,258,000
セントケア・ホールディング	7,100	818.00	5,807,800
サイネックス	2,100	605.00	1,270,500
ルネサンス	7,500	1,087.00	8,152,500
ディップ	18,600	3,460.00	64,356,000
デジタルホールディングス	7,500	1,552.00	11,640,000
新日本科学	13,000	1,538.00	19,994,000
キャリアデザインセンター	2,900	1,243.00	3,604,700
ベネフィット・ワン	38,400	2,455.00	94,272,000
エムスリー	185,900	4,001.00	743,785,900
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	327.00	2,190,900
アウトソーシング	60,500	1,310.00	79,255,000
ウェルネット	11,100	447.00	4,961,700
ワールドホールディングス	4,300	2,077.00	8,931,100
ディー・エヌ・エー	40,200	1,734.00	69,706,800
博報堂D Yホールディングス	146,700	1,518.00	222,690,600
ぐるなび	17,800	416.00	7,404,800
タカミヤ	13,200	383.00	5,055,600
ジャパンベストレスキューシステム	7,100	999.00	7,092,900
ファンコミュニケーションズ	26,800	412.00	11,041,600
ライク	2,900	1,906.00	5,527,400
ビジネス・ブレークスルー	4,400	432.00	1,900,800
エスプール	29,900	985.00	29,451,500
W D Bホールディングス	4,900	2,668.00	13,073,200
手間いらず	1,400	4,970.00	6,958,000
ティア	6,600	435.00	2,871,000
C D G	1,300	1,327.00	1,725,100
アドウェイズ	15,900	642.00	10,207,800
バリューコマース	8,300	3,325.00	27,597,500
インフォマート	115,700	618.00	71,502,600
J Pホールディングス	27,900	226.00	6,305,400

エコナックホールディングス	21,100	87.00	1,835,700
C Lホールディングス	2,400	1,032.00	2,476,800
プレステージ・インターナショナル	39,700	700.00	27,790,000
アミューズ	5,800	2,098.00	12,168,400
ドリームインキュベータ	3,000	2,532.00	7,596,000
クイック	7,300	1,578.00	11,519,400
T A C	6,600	226.00	1,491,600
電通グループ	108,600	4,805.00	521,823,000
イオンファンタジー	4,200	2,083.00	8,748,600
シーティーエス	12,100	808.00	9,776,800
ネクシィーズグループ	3,900	572.00	2,230,800
H . U . グループホールディングス	27,600	3,040.00	83,904,000
アルプス技研	9,400	1,955.00	18,377,000
ダイオーズ	2,300	1,006.00	2,313,800
日本空調サービス	11,300	788.00	8,904,400
オリエンタルランド	124,500	21,155.00	2,633,797,500
ダスキン	24,500	2,774.00	67,963,000
明光ネットワークジャパン	12,700	569.00	7,226,300
ファルコホールディングス	5,100	2,006.00	10,230,600
ラウンドワン	29,500	1,311.00	38,674,500
リゾートトラスト	48,400	1,971.00	95,396,400
ビー・エム・エル	13,600	3,265.00	44,404,000
りらいあコミュニケーションズ	15,700	1,047.00	16,437,900
リソー教育	48,600	390.00	18,954,000
早稲田アカデミー	6,000	1,001.00	6,006,000
ユー・エス・エス	118,000	1,959.00	231,162,000
東京個別指導学院	9,600	624.00	5,990,400
サイバーエージェント	259,700	1,491.00	387,212,700
楽天グループ	541,300	966.00	522,895,800
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,672.00	9,363,200
モーニングスター	18,700	578.00	10,808,600
テー・オー・ダブリュー	19,100	297.00	5,672,700
山田コンサルティンググループ	5,600	1,154.00	6,462,400
セントラルスポーツ	4,000	2,409.00	9,636,000
フルキャストホールディングス	9,100	2,273.00	20,684,300
エン・ジャパン	17,100	2,914.00	49,829,400
リソルホールディングス	1,200	4,390.00	5,268,000
テクノプロ・ホールディングス	63,100	3,305.00	208,545,500
アトラグループ	2,300	259.00	595,700
インターワークス	3,500	372.00	1,302,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,900	3,680.00	18,032,000
K e e P e r 技研	6,900	2,182.00	15,055,800

ファーストロジック	2,300	808.00	1,858,400
三機サービス	2,200	1,010.00	2,222,000
Gunosy	6,900	799.00	5,513,100
デザインワン・ジャパン	3,600	186.00	669,600
イー・ガーディアン	4,300	2,535.00	10,900,500
リブセンス	6,900	176.00	1,214,400
ジャパンマテリアル	32,500	1,728.00	56,160,000
ベクトル	15,000	1,098.00	16,470,000
ウチヤマホールディングス	5,800	324.00	1,879,200
チャーム・ケア・コーポレーション	8,000	1,064.00	8,512,000
キャリアリンク	4,000	1,418.00	5,672,000
I B J	8,900	793.00	7,057,700
アサンテ	4,800	1,561.00	7,492,800
バリューHR	4,300	2,462.00	10,586,600
M&Aキャピタルパートナーズ	8,700	4,955.00	43,108,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,373.00	5,766,600
E R Iホールディングス	3,100	1,150.00	3,565,000
アビスト	1,700	2,911.00	4,948,700
シグマクシス・ホールディングス	6,400	2,029.00	12,985,600
ウィルグループ	7,900	1,206.00	9,527,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,100	178.00	2,687,800
メドピア	8,200	2,835.00	23,247,000
レアジョブ	2,200	787.00	1,731,400
リクルートホールディングス	812,500	4,643.00	3,772,437,500
エラン	14,700	939.00	13,803,300
土木管理総合試験所	5,400	323.00	1,744,200
ネットマーケティング	5,600	408.00	2,284,800
日本郵政	1,375,400	969.50	1,333,450,300
ベルシステム24ホールディングス	15,300	1,369.00	20,945,700
鎌倉新書	12,300	492.00	6,051,600
S M N	2,600	594.00	1,544,400
グローバルキッズCOMPANY	2,200	793.00	1,744,600
エアトリ	6,900	3,205.00	22,114,500
アトラエ	7,400	1,975.00	14,615,000
ストライク	4,000	4,345.00	17,380,000
ソラスト	26,000	1,029.00	26,754,000
セラク	3,500	1,157.00	4,049,500
インソース	10,300	1,914.00	19,714,200
ベイカレント・コンサルティング	7,400	42,700.00	315,980,000
Orchestra Holdings	2,100	2,710.00	5,691,000
アイモバイル	3,200	1,222.00	3,910,400
キャリアインデックス	3,800	675.00	2,565,000

MS - J a p a n	4,500	815.00	3,667,500
船場	2,400	742.00	1,780,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	33,500	1,486.00	49,781,000
フルテック	1,600	1,312.00	2,099,200
GameWith	3,600	449.00	1,616,400
ソウルドアウト	2,700	1,804.00	4,870,800
MS&Consulting	1,800	701.00	1,261,800
ウェルビー	7,100	1,190.00	8,449,000
エル・ティー・エス	1,400	1,980.00	2,772,000
ミダックホールディングス	4,800	2,323.00	11,150,400
日総工産	8,500	848.00	7,208,000
キュービーネットホールディングス	5,000	1,702.00	8,510,000
RPAホールディングス	15,400	331.00	5,097,400
スプリックス	3,100	1,427.00	4,423,700
マネジメントソリューションズ	5,200	3,075.00	15,990,000
プロレド・パートナーズ	2,500	783.00	1,957,500
テノ・ホールディングス	1,600	582.00	931,200
フロンティア・マネジメント	3,000	792.00	2,376,000
ピアラ	2,000	525.00	1,050,000
コプロ・ホールディングス	2,200	1,054.00	2,318,800
ギークス	1,900	1,055.00	2,004,500
カーブスホールディングス	29,200	699.00	20,410,800
フォーラムエンジニアリング	7,500	854.00	6,405,000
Fast Fitness Japan	1,500	1,786.00	2,679,000
ダイレクトマーケティングミックス	12,300	1,492.00	18,351,600
ポピンズホールディングス	2,500	2,247.00	5,617,500
LITALICO	8,600	2,870.00	24,682,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,600	662.00	3,707,200
リログループ	57,700	1,712.00	98,782,400
東祥	8,000	1,708.00	13,664,000
TREホールディングス	14,500	1,529.00	22,170,500
人・夢・技術グループ	4,300	1,889.00	8,122,700
エイチ・アイ・エス	23,500	2,034.00	47,799,000
ラックランド	3,100	2,820.00	8,742,000
共立メンテナンス	18,800	4,395.00	82,626,000
イチネンホールディングス	10,900	1,301.00	14,180,900
建設技術研究所	6,400	2,320.00	14,848,000
スペース	7,700	945.00	7,276,500
燦ホールディングス	4,700	1,660.00	7,802,000
スバル興業	700	8,170.00	5,719,000
東京テアトル	4,100	1,237.00	5,071,700
タナベ経営	4,300	642.00	2,760,600

ナガワ	3,400	9,680.00	32,912,000	
東京都競馬	7,900	4,050.00	31,995,000	
カナモト	18,600	2,308.00	42,928,800	
西尾レントオール	9,800	2,811.00	27,547,800	
トランス・コスモス	13,400	3,155.00	42,277,000	
乃村工藝社	45,300	946.00	42,853,800	
藤田観光	4,600	2,399.00	11,035,400	
KNT-CTホールディングス	6,500	1,505.00	9,782,500	
日本管財	11,300	2,800.00	31,640,000	
トーカイ	9,300	1,870.00	17,391,000	
セコム	103,800	8,744.00	907,627,200	
セントラル警備保障	5,200	2,360.00	12,272,000	
丹青社	21,800	727.00	15,848,600	
メイテック	12,800	6,950.00	88,960,000	
応用地質	12,000	2,066.00	24,792,000	
船井総研ホールディングス	21,600	2,182.00	47,131,200	
進学会ホールディングス	4,000	365.00	1,460,000	
オオバ	7,600	705.00	5,358,000	
いであ	2,900	1,776.00	5,150,400	
学究社	3,500	1,644.00	5,754,000	
ベネッセホールディングス	35,200	2,358.00	83,001,600	
イオンディライト	13,000	3,040.00	39,520,000	
ナック	5,200	985.00	5,122,000	
ダイセキ	19,200	4,420.00	84,864,000	
ステップ	4,000	1,846.00	7,384,000	
合計	119,575,000		287,749,467,590	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	361,306,628
国債証券	318,881,616,100
地方債証券	20,395,641,116
特殊債券	24,146,873,196
社債券	18,165,344,000
未収入金	1,104,424,400
未収利息	874,915,185
前払費用	15,143,337
流動資産合計	383,945,263,962
資産合計	383,945,263,962
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,330
未払金	805,543,000
未払解約金	216,530,798
未払利息	426
流動負債合計	1,022,084,554
負債合計	1,022,084,554
純資産の部	
元本等	
元本	282,142,697,582
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	100,780,481,826
元本等合計	382,923,179,408
純資産合計	382,923,179,408
負債純資産合計	383,945,263,962

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 2月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

2022年 2月21日現在	
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	282,142,697,582口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 100,241,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3572円 (1万口当たり純資産額) (13,572円)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2022年 2月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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 2月21日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月23日
期首元本額	274,296,462,926円
期中追加設定元本額	21,909,998,810円

区分	2022年 2月21日現在
期中一部解約元本額	14,063,764,154円
期末元本額	282,142,697,582円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	815,593,481円
D C日本債券インデックスファンド	2,014,255,038円
D C日本債券インデックスファンドL	42,804,367,027円
D Cバランスファンド30	10,926,789,340円
D Cバランスファンド50	7,680,769,971円
D Cバランスファンド70	2,113,091,767円
日本債券インデックスe	1,201,855,630円
インデックスコレクション（国内債券）	37,207,249,604円
インデックスコレクション（バランス株式30）	58,608,402,931円
インデックスコレクション（バランス株式50）	5,922,453,515円
インデックスコレクション（バランス株式70）	2,452,298,680円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	50,339,257,993円
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	3,868,802,857円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	192,533,912円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	900,116,047円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	125,530,135円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	79,284,244円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	321,891,898円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	3,158,754,181円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,028,650,936円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,722,338,891円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	152,616,888円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	297,834,950円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,939,758,276円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	176,264,992円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	357,211,938円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,124,282,807円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	360,328,633円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	819,672,157円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	68,765,020円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	3,232,205,072円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,465,509,183円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	24,407,817,323円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	466,993,586円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	136,168,678円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	38,901,830円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	609,369,179円
私募日本債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	4,708,992円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		4,009,469,750
地方債証券		145,908,092
特殊債券		131,628,720
社債券		116,361,000
合計		4,403,367,562

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	150,150,000	-	150,140,000	10,000
	合計	150,150,000	-	150,140,000	10,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第4 2 3 回利付国債(2年)	860,000,000	860,662,200	
	第4 2 4 回利付国債(2年)	20,000,000	20,016,600	
	第4 2 5 回利付国債(2年)	1,420,000,000	1,421,164,400	

第426回利付国債(2年)	250,000,000	250,202,500	
第427回利付国債(2年)	800,000,000	800,632,000	
第428回利付国債(2年)	110,000,000	110,083,600	
第429回利付国債(2年)	490,000,000	490,392,000	
第430回利付国債(2年)	1,410,000,000	1,411,071,600	
第433回利付国債(2年)	1,690,000,000	1,690,811,200	
第135回利付国債(5年)	3,140,000,000	3,145,526,400	
第136回利付国債(5年)	2,640,000,000	2,645,570,400	
第137回利付国債(5年)	2,580,000,000	2,586,088,800	
第138回利付国債(5年)	3,560,000,000	3,568,757,600	
第139回利付国債(5年)	2,220,000,000	2,225,749,800	
第140回利付国債(5年)	2,880,000,000	2,887,689,600	
第141回利付国債(5年)	4,230,000,000	4,241,421,000	
第142回利付国債(5年)	2,010,000,000	2,015,668,200	
第143回利付国債(5年)	1,960,000,000	1,965,703,600	
第144回利付国債(5年)	2,510,000,000	2,517,479,800	
第145回利付国債(5年)	4,240,000,000	4,252,847,200	
第146回利付国債(5年)	920,000,000	922,806,000	
第147回利付国債(5年)	1,710,000,000	1,708,939,800	
第148回利付国債(5年)	3,120,000,000	3,117,285,600	
第149回利付国債(5年)	3,330,000,000	3,325,404,600	
第150回利付国債(5年)	1,290,000,000	1,287,819,900	
第1回利付国債(40年)	230,000,000	315,162,100	
第2回利付国債(40年)	350,000,000	463,676,500	
第3回利付国債(40年)	380,000,000	505,426,600	
第4回利付国債(40年)	665,000,000	891,944,550	
第5回利付国債(40年)	455,000,000	590,207,800	
第6回利付国債(40年)	430,000,000	549,071,300	
第7回利付国債(40年)	1,370,000,000	1,682,538,100	
第8回利付国債(40年)	940,000,000	1,079,026,000	
第9回利付国債(40年)	1,180,000,000	1,011,637,600	
第10回利付国債(40年)	1,390,000,000	1,395,573,900	
第11回利付国債(40年)	1,100,000,000	1,070,036,000	
第12回利付国債(40年)	640,000,000	560,268,800	
第13回利付国債(40年)	1,220,000,000	1,063,522,800	
第14回利付国債(40年)	1,030,000,000	960,732,500	
第328回利付国債(10年)	2,650,000,000	2,668,868,000	
第329回利付国債(10年)	2,525,000,000	2,553,734,500	
第330回利付国債(10年)	3,130,000,000	3,171,691,600	
第331回利付国債(10年)	880,000,000	888,940,800	
第332回利付国債(10年)	2,470,000,000	2,498,405,000	
第333回利付国債(10年)	2,680,000,000	2,714,411,200	

第334回利付国債(10年)	3,010,000,000	3,053,012,900	
第335回利付国債(10年)	1,215,000,000	1,230,795,000	
第336回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,074,967,200	
第337回利付国債(10年)	1,770,000,000	1,784,991,900	
第338回利付国債(10年)	3,410,000,000	3,451,329,200	
第339回利付国債(10年)	2,775,000,000	2,810,936,250	
第340回利付国債(10年)	3,240,000,000	3,284,550,000	
第341回利付国債(10年)	2,050,000,000	2,071,935,000	
第342回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,200,367,500	
第343回利付国債(10年)	3,595,000,000	3,606,611,850	
第344回利付国債(10年)	3,240,000,000	3,249,590,400	
第345回利付国債(10年)	2,580,000,000	2,588,075,400	
第346回利付国債(10年)	3,425,000,000	3,434,521,500	
第347回利付国債(10年)	3,415,000,000	3,424,049,750	
第348回利付国債(10年)	3,410,000,000	3,419,445,700	
第349回利付国債(10年)	2,735,000,000	2,742,138,350	
第350回利付国債(10年)	3,450,000,000	3,458,314,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,373,014,000	
第352回利付国債(10年)	2,810,000,000	2,815,507,600	
第353回利付国債(10年)	2,870,000,000	2,874,850,300	
第354回利付国債(10年)	2,780,000,000	2,783,892,000	
第355回利付国債(10年)	2,560,000,000	2,560,921,600	
第356回利付国債(10年)	2,930,000,000	2,930,000,000	
第357回利付国債(10年)	2,260,000,000	2,258,237,200	
第358回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,326,272,000	
第359回利付国債(10年)	2,410,000,000	2,404,023,200	
第360回利付国債(10年)	3,320,000,000	3,308,745,200	
第361回利付国債(10年)	2,950,000,000	2,935,869,500	
第362回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,381,298,600	
第363回利付国債(10年)	4,780,000,000	4,744,914,800	
第364回利付国債(10年)	2,590,000,000	2,566,871,300	
第365回利付国債(10年)	980,000,000	970,082,400	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	60,149,500	
第2回利付国債(30年)	100,000,000	118,194,000	
第3回利付国債(30年)	140,000,000	164,963,400	
第4回利付国債(30年)	190,000,000	235,391,000	
第5回利付国債(30年)	180,000,000	213,427,800	
第6回利付国債(30年)	20,000,000	24,251,000	
第7回利付国債(30年)	790,000,000	955,481,300	
第9回利付国債(30年)	180,000,000	201,816,000	
第10回利付国債(30年)	170,000,000	185,266,000	
第11回利付国債(30年)	460,000,000	532,270,600	

第12回利付国債(30年)	450,000,000	542,128,500
第13回利付国債(30年)	330,000,000	394,739,400
第14回利付国債(30年)	350,000,000	436,128,000
第15回利付国債(30年)	370,000,000	466,732,800
第16回利付国債(30年)	150,000,000	189,645,000
第17回利付国債(30年)	420,000,000	527,293,200
第18回利付国債(30年)	340,000,000	423,663,800
第19回利付国債(30年)	280,000,000	349,725,600
第20回利付国債(30年)	400,000,000	511,120,000
第21回利付国債(30年)	910,000,000	1,140,985,300
第22回利付国債(30年)	380,000,000	487,600,800
第23回利付国債(30年)	170,000,000	218,659,100
第24回利付国債(30年)	75,000,000	96,624,750
第25回利付国債(30年)	185,000,000	233,536,600
第26回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,881,203,100
第27回利付国債(30年)	890,000,000	1,156,394,800
第28回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,368,496,500
第29回利付国債(30年)	480,000,000	620,544,000
第30回利付国債(30年)	555,000,000	711,010,500
第31回利付国債(30年)	670,000,000	849,888,300
第32回利付国債(30年)	955,000,000	1,230,718,050
第33回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,426,218,500
第34回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,560,721,600
第35回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,682,559,000
第36回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,624,571,000
第37回利付国債(30年)	1,305,000,000	1,609,795,800
第38回利付国債(30年)	915,000,000	1,113,106,650
第39回利付国債(30年)	925,000,000	1,144,752,250
第40回利付国債(30年)	765,000,000	932,343,750
第41回利付国債(30年)	465,000,000	557,786,100
第42回利付国債(30年)	730,000,000	876,255,500
第43回利付国債(30年)	845,000,000	1,014,997,100
第44回利付国債(30年)	780,000,000	937,536,600
第45回利付国債(30年)	820,000,000	951,905,200
第46回利付国債(30年)	1,170,000,000	1,358,615,700
第47回利付国債(30年)	1,055,000,000	1,247,875,100
第48回利付国債(30年)	830,000,000	945,652,200
第49回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,219,200,800
第50回利付国債(30年)	1,030,000,000	1,037,323,300
第51回利付国債(30年)	975,000,000	872,186,250
第52回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,040,536,200
第53回利付国債(30年)	930,000,000	891,470,100
第54回利付国債(30年)	805,000,000	806,682,450

第 5 5 回利付国債（30年）	930,000,000	930,976,500	
第 5 6 回利付国債（30年）	820,000,000	819,122,600	
第 5 7 回利付国債（30年）	860,000,000	858,159,600	
第 5 8 回利付国債（30年）	1,350,000,000	1,344,195,000	
第 5 9 回利付国債（30年）	520,000,000	504,847,200	
第 6 0 回利付国債（30年）	1,250,000,000	1,270,425,000	
第 6 1 回利付国債（30年）	760,000,000	734,289,200	
第 6 2 回利付国債（30年）	800,000,000	731,936,000	
第 6 3 回利付国債（30年）	1,050,000,000	931,791,000	
第 6 4 回利付国債（30年）	1,090,000,000	965,325,800	
第 6 5 回利付国債（30年）	800,000,000	707,056,000	
第 6 6 回利付国債（30年）	720,000,000	635,760,000	
第 6 7 回利付国債（30年）	1,150,000,000	1,072,133,500	
第 6 8 回利付国債（30年）	1,130,000,000	1,052,945,300	
第 6 9 回利付国債（30年）	920,000,000	879,897,200	
第 7 0 回利付国債（30年）	1,200,000,000	1,147,332,000	
第 7 1 回利付国債（30年）	760,000,000	726,415,600	
第 7 2 回利付国債（30年）	635,000,000	606,748,850	
第 7 3 回利付国債（30年）	280,000,000	267,458,800	
第 6 1 回利付国債（20年）	390,000,000	394,449,900	
第 6 2 回利付国債（20年）	250,000,000	252,830,000	
第 6 3 回利付国債（20年）	570,000,000	583,999,200	
第 6 4 回利付国債（20年）	410,000,000	422,570,600	
第 6 5 回利付国債（20年）	370,000,000	383,035,100	
第 6 6 回利付国債（20年）	330,000,000	341,022,000	
第 6 7 回利付国債（20年）	310,000,000	322,331,800	
第 6 8 回利付国債（20年）	230,000,000	240,580,000	
第 6 9 回利付国債（20年）	530,000,000	553,277,600	
第 7 0 回利付国債（20年）	490,000,000	517,440,000	
第 7 1 回利付国債（20年）	400,000,000	420,540,000	
第 7 2 回利付国債（20年）	710,000,000	748,489,100	
第 7 3 回利付国債（20年）	540,000,000	570,423,600	
第 7 4 回利付国債（20年）	310,000,000	328,339,600	
第 7 5 回利付国債（20年）	360,000,000	383,097,600	
第 7 6 回利付国債（20年）	340,000,000	359,726,800	
第 7 7 回利付国債（20年）	290,000,000	307,716,100	
第 7 8 回利付国債（20年）	20,000,000	21,248,600	
第 7 9 回利付国債（20年）	100,000,000	106,575,000	
第 8 0 回利付国債（20年）	250,000,000	267,267,500	
第 8 1 回利付国債（20年）	180,000,000	192,733,200	
第 8 2 回利付国債（20年）	485,000,000	521,040,350	
第 8 3 回利付国債（20年）	1,570,000,000	1,694,469,600	

第84回利付国債(20年)	190,000,000	204,337,400
第85回利付国債(20年)	360,000,000	390,459,600
第86回利付国債(20年)	240,000,000	262,257,600
第87回利付国債(20年)	170,000,000	185,075,600
第88回利付国債(20年)	340,000,000	373,401,600
第89回利付国債(20年)	320,000,000	350,054,400
第90回利付国債(20年)	420,000,000	461,533,800
第91回利付国債(20年)	310,000,000	342,072,600
第92回利付国債(20年)	790,000,000	868,360,100
第93回利付国債(20年)	260,000,000	285,716,600
第94回利付国債(20年)	445,000,000	491,266,650
第95回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,231,395,000
第96回利付国債(20年)	200,000,000	221,766,000
第97回利付国債(20年)	210,000,000	235,101,300
第98回利付国債(20年)	370,000,000	412,168,900
第99回利付国債(20年)	660,000,000	738,361,800
第100回利付国債(20年)	760,000,000	858,640,400
第101回利付国債(20年)	360,000,000	411,080,400
第102回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,227,718,000
第103回利付国債(20年)	1,335,000,000	1,523,368,500
第104回利付国債(20年)	260,000,000	293,410,000
第105回利付国債(20年)	730,000,000	827,257,900
第106回利付国債(20年)	270,000,000	307,740,600
第107回利付国債(20年)	270,000,000	307,227,600
第108回利付国債(20年)	725,000,000	815,110,250
第109回利付国債(20年)	290,000,000	327,224,400
第110回利付国債(20年)	515,000,000	588,351,450
第111回利付国債(20年)	450,000,000	519,075,000
第112回利付国債(20年)	550,000,000	630,426,500
第113回利付国債(20年)	905,000,000	1,041,474,000
第114回利付国債(20年)	610,000,000	704,714,700
第115回利付国債(20年)	370,000,000	430,324,800
第116回利付国債(20年)	260,000,000	303,472,000
第117回利付国債(20年)	240,000,000	278,208,000
第118回利付国債(20年)	450,000,000	519,718,500
第119回利付国債(20年)	320,000,000	364,300,800
第120回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,492,206,800
第121回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,173,112,200
第122回利付国債(20年)	490,000,000	559,393,800
第123回利付国債(20年)	900,000,000	1,053,306,000
第124回利付国債(20年)	820,000,000	952,528,400
第125回利付国債(20年)	500,000,000	591,465,000
第126回利付国債(20年)	450,000,000	524,268,000

第127回利付国債（20年）	400,000,000	462,436,000	
第128回利付国債（20年）	810,000,000	939,033,000	
第129回利付国債（20年）	260,000,000	299,031,200	
第130回利付国債（20年）	890,000,000	1,025,716,100	
第131回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,177,362,100	
第132回利付国債（20年）	600,000,000	687,378,000	
第133回利付国債（20年）	620,000,000	716,267,400	
第134回利付国債（20年）	1,010,000,000	1,168,953,800	
第135回利付国債（20年）	155,000,000	177,864,050	
第136回利付国債（20年）	450,000,000	511,942,500	
第137回利付国債（20年）	210,000,000	241,371,900	
第138回利付国債（20年）	460,000,000	519,432,000	
第139回利付国債（20年）	800,000,000	911,432,000	
第140回利付国債（20年）	1,205,000,000	1,387,159,850	
第141回利付国債（20年）	1,040,000,000	1,199,556,800	
第142回利付国債（20年）	630,000,000	733,301,100	
第143回利付国債（20年）	830,000,000	949,686,000	
第144回利付国債（20年）	960,000,000	1,088,102,400	
第145回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,423,245,300	
第146回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,646,064,000	
第147回利付国債（20年）	1,170,000,000	1,345,219,200	
第148回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,446,682,400	
第149回利付国債（20年）	1,980,000,000	2,258,328,600	
第150回利付国債（20年）	1,890,000,000	2,134,169,100	
第151回利付国債（20年）	1,610,000,000	1,779,050,000	
第152回利付国債（20年）	1,700,000,000	1,879,435,000	
第153回利付国債（20年）	1,980,000,000	2,215,204,200	
第154回利付国債（20年）	1,350,000,000	1,492,897,500	
第155回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,111,679,000	
第156回利付国債（20年）	1,370,000,000	1,365,451,600	
第157回利付国債（20年）	1,720,000,000	1,663,257,200	
第158回利付国債（20年）	1,770,000,000	1,782,089,100	
第159回利付国債（20年）	1,730,000,000	1,763,596,600	
第160回利付国債（20年）	100,000,000	103,237,000	
第161回利付国債（20年）	1,265,000,000	1,285,746,000	
第162回利付国債（20年）	850,000,000	862,282,500	
第163回利付国債（20年）	1,445,000,000	1,464,030,650	
第164回利付国債（20年）	810,000,000	806,395,500	
第165回利付国債（20年）	1,630,000,000	1,620,203,700	
第166回利付国債（20年）	1,380,000,000	1,412,512,800	
第167回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,306,813,200	
第168回利付国債（20年）	1,890,000,000	1,837,155,600	

	第169回利付国債(20年)	860,000,000	820,156,200
	第170回利付国債(20年)	1,580,000,000	1,503,433,200
	第171回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,120,280,200
	第172回利付国債(20年)	720,000,000	694,252,800
	第173回利付国債(20年)	2,110,000,000	2,030,263,100
	第174回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,209,789,000
	第175回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,210,822,800
	第176回利付国債(20年)	2,270,000,000	2,212,205,800
	第177回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,145,544,000
	第178回利付国債(20年)	880,000,000	854,849,600
	第179回利付国債(20年)	490,000,000	475,834,100
	国債証券合計	304,865,000,000	318,881,616,100
地方債証券	第1回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	102,443,000
	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,605,000
	第7回東京都公募公債(30年)	200,000,000	259,222,000
	第11回東京都公募公債(20年)	200,000,000	221,332,000
	第16回東京都公募公債(20年)	150,000,000	168,621,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,954,000
	第18回東京都公募公債(20年)	200,000,000	228,638,000
	第20回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,189,000
	第21回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,331,000
	第729回東京都公募公債	150,000,000	152,032,500
	第740回東京都公募公債	100,000,000	101,151,000
	第786回東京都公募公債	200,000,000	199,934,000
	第800回東京都公募公債	300,000,000	297,111,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,595,000
	第14回1号宮城県公募公債(5年)	100,000,000	100,028,000
	第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	129,840,000
	第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,844,000
	第15回神奈川県公募公債(20年)	300,000,000	343,707,000
	第16回神奈川県公募公債(20年)	600,000,000	696,630,000
	第21回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,617,000
	第196回神奈川県公募公債	100,000,000	100,717,000
	第243回神奈川県公募公債	100,000,000	98,999,000
	第2回大阪府公募公債(20年)	300,000,000	346,236,000
	第376回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,286,000
	第386回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,312,000
	第403回大阪府公募公債(10年)	300,000,000	304,506,000
	第417回大阪府公募公債(10年)	108,000,000	108,687,960
	第423回大阪府公募公債(10年)	300,000,000	300,573,000
	平成25年度第2回京都府公募公債(15年)	100,000,000	105,445,000

平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,635,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	105,860,000	106,030,434	
令和元年度第3回京都府公募公債	100,000,000	99,930,000	
令和2年度第1回京都府公募公債（10年）	100,000,000	99,361,000	
第3回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	111,982,000	
第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	106,743,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	106,420,000	
第11回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	208,116,000	
平成26年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	101,321,000	
平成28年度第30回兵庫県公募公債	100,000,000	100,529,000	
令和3年度第9回兵庫県公募公債（5年）	100,000,000	99,602,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	98,353,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	114,357,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	100,720,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	100,660,000	
平成26年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,280,000	
平成27年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	101,151,000	
平成27年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	101,440,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	115,926,000	
平成25年度第8回愛知県公募公債（30年）	110,000,000	137,168,900	
平成25年度第21回愛知県公募公債（10年）	400,000,000	405,592,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	202,406,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,377,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,652,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,366,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,058,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,297,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	189,352,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	114,192,000	
平成27年度第2回広島県公募公債	162,000,000	164,966,220	
平成29年度第7回広島県公募公債	131,440,000	131,796,202	
令和2年度第7回広島県公募公債	100,000,000	99,681,000	
第5回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	113,187,000	
第7回埼玉県公募公債（15年）	400,000,000	393,712,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	100,000,000	98,242,000	
第9回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	98,940,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	195,166,000	

平成29年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	100,376,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	130,292,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	252,064,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	106,670,000	
平成25年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	101,092,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	101,094,000	
平成29年度第8回福岡県公募公債	200,000,000	200,952,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	99,051,000	
令和3年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	99,602,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	200,000,000	194,216,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	229,474,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	115,791,000	
第9回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	113,628,000	
平成26年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	101,248,000	
平成28年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,021,000	
平成29年度第5回千葉県公募公債	120,000,000	120,451,200	
令和元年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,976,000	
平成27年度第3回新潟県公募公債	200,000,000	200,366,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	200,000,000	198,840,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,727,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,426,000	
第130回共同発行市場公募地方債	350,000,000	354,921,000	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,419,000	
第134回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,437,000	
第136回共同発行市場公募地方債	600,000,000	608,208,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,287,000	
第139回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,606,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,238,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,095,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,509,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,730,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,722,000	
第175回共同発行市場公募地方債	150,000,000	150,547,500	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,153,000	
第194回共同発行市場公募地方債	160,000,000	159,198,400	
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,125,000	
令和元年度第2回奈良県公募公債（5年）	100,000,000	99,850,000	
第7回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	102,149,000	
第10回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	115,710,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	100,000,000	99,098,000	
第3回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	128,473,000	

第13回名古屋市政公募債(30年)	100,000,000	102,232,000	
第482回名古屋市政公募債(10年)	100,000,000	100,675,000	
第488回名古屋市政公募債(10年)	100,000,000	101,408,000	
第495回名古屋市政公募債(10年)	100,000,000	100,162,000	
第2回京都市公募債(20年)	100,000,000	107,310,000	
第6回京都市公募債(20年)	100,000,000	112,346,000	
平成27年度第5回京都市公募債	200,000,000	201,068,000	
平成20年度第1回神戸市公募債(20年)	100,000,000	113,785,000	
平成24年度第12回神戸市公募債(20年)	100,000,000	114,607,000	
平成26年度第3回神戸市公募債(20年)	100,000,000	112,908,000	
令和2年度第9回神戸市公募債(30年)	100,000,000	93,425,000	
第5回横浜市公募債(20年)	100,000,000	107,003,000	
第5回横浜市公募債(30年)	100,000,000	130,121,000	
第7回横浜市公募債(30年)	100,000,000	129,617,000	
平成25年度第6回横浜市公募債	100,000,000	101,271,000	
第25回横浜市公募債(20年)	100,000,000	114,435,000	
第26回横浜市公募債(20年)	100,000,000	115,384,000	
第55回横浜市公募債(5年)	100,000,000	99,723,000	
令和3年度第2回横浜市公募債	100,000,000	99,098,000	
第8回川崎市公募債(20年)	100,000,000	115,011,000	
第11回川崎市公募債(20年)	150,000,000	170,413,500	
第88回川崎市公募債	100,000,000	101,502,000	
平成25年度第6回福岡市公募債(20年)	400,000,000	452,404,000	
平成29年度第12回福岡市公募債	130,000,000	130,352,300	
平成30年度第9回福岡市公募債(10年)	100,000,000	100,820,000	
平成27年度第2回広島市公募債	100,000,000	101,490,000	
平成26年度第1回千葉市公募債	200,000,000	202,774,000	
平成27年度第1回三重県公募債	100,000,000	101,490,000	
平成25年度第1回徳島県公募債	100,000,000	101,116,000	
平成27年度第1回山梨県公募債(10年)	100,000,000	101,563,000	
地方債証券合計	19,377,300,000	20,395,641,116	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	202,426,000
	第3回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	202,896,000
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,729,000
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,886,000
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	89,242,000
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	144,936,000

第 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	164,457,000	
第 2 1 回道路債券	100,000,000	125,936,000	
第 2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	278,396,000	
第 2 7 回道路債券	100,000,000	104,931,000	
第 2 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,383,000	
第 2 8 回道路債券	300,000,000	382,941,000	
第 3 3 回道路債券	100,000,000	129,395,000	
第 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,042,000	
第 3 8 回道路債券	100,000,000	105,673,000	
第 3 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,233,000	
第 4 2 回道路債券	100,000,000	106,633,000	
第 4 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,338,000	
第 4 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,574,000	
第 8 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,604,000	
第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,562,000	
第 9 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,903,000	
第 1 0 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	127,676,000	
第 1 0 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,502,000	
第 1 0 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,173,000	
第 1 1 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,915,000	
第 1 1 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,215,000	
第 1 2 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,794,000	
第 1 2 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,334,000	
第 1 2 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,041,000	
第 1 7 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,391,000	
第 1 8 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,989,000	
第 1 8 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	210,531,970	
第 1 8 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,986,000	
第 1 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,588,000	

第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,331,000	
第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	116,000,000	117,502,200	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,300,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,179,000	
第235回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,998,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,030,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,833,000	
第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,724,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	300,588,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	243,000,000	244,088,640	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,557,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	114,785,000	
第4回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	114,655,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,290,000	
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	231,092,000	
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	115,819,000	
第9回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,878,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	106,312,000	
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	115,937,000	
第15回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,446,000	
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	348,267,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,426,000	
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	114,850,000	
第19回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,917,000	
第22回公営企業債券(20年)	200,000,000	223,256,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	341,190,000	
第24回公営企業債券(20年)	100,000,000	112,946,000	
第30回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	115,841,000	
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	400,000,000	456,024,000	
第46回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,452,000	
第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,186,000	
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,300,880	

第5 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,255,000	
第5 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	121,000,000	122,408,440	
第5 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	193,000,000	195,717,440	
第5 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,287,000	
第5 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,375,000	
第6 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,424,000	
第6 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,379,000	
第7 0 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,387,000	
第7 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,449,000	
第7 5 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,609,000	
F 7 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,041,000	
第7 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,408,000	
第7 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	426,178,300	
第8 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,712,000	
第9 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,071,000	
第9 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,418,000	
第1 0 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,969,000	
第1 1 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,000,000	
第1 1 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,553,000	
F 1 9 0 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,964,000	
第2 9 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,928,000	
第2 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	128,300,000	129,969,183	
第3 5 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,731,000	
第7 7 回株式会社日本政策金融公庫社債	300,000,000	299,961,000	
第8 7 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,920,000	
第8 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,960,000	
第1 5 9 回都市再生債券	100,000,000	80,917,000	
第1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	88,762,000	
第1 6 9 回都市再生債券	100,000,000	93,941,000	
第1 8 回政府保証中部国際空港債券	206,000,000	207,528,520	
第1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,085,000	53,659,379	
第1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	21,944,000	22,265,260	
第2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	11,137,000	11,336,575	
第5 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	197,598,000	196,679,169	
第6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,368,000	
第7 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	39,764,000	39,858,638	
第7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	72,883,000	72,534,619	
第8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	10,353,000	10,458,807	

第 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,902,000	23,326,603
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	10,541,000	10,649,888
第 9 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	83,373,000	82,970,308
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	10,891,000	11,041,840
第 1 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,286,000	13,762,834
第 1 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,352,000
第 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,728,000
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,656,000	17,552,925
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,975,000	9,991,758
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,496,000	19,614,823
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,162,000	35,960,970
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,307,000	11,464,506
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,579,000	30,782,656
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,573,000	10,657,161
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,666,000	34,088,844
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,750,000	13,076,272
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,075,000	25,460,997
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,420,000	23,691,662
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,735,000	10,842,994
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,747,000	22,863,490
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,416,000	11,612,355
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,994,000	33,449,977
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,992,000	49,059,178
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,048,000	25,721,290
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,712,000	11,980,087
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,608,000	10,734,129
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,040,000	29,321,428
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,580,000	29,037,327
第 4 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,160,000
第 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,488,000	83,955,225
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,908,000	93,460,978
第 4 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,014,000	11,209,388
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,048,000	22,055,778
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,225,000	23,214,234
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,226,000	32,648,482
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,256,000	24,320,194
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,613,000	11,864,073
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,331,000	27,526,954
第 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,234,000	29,566,644
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,389,000	32,858,946
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,190,000	32,664,039

第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,818,000	42,354,389
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,319,000	43,275,041
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,118,000	37,692,383
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,634,000	35,861,082
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,451,000	36,730,072
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,080,000	43,060,877
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,447,000
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,724,000
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,558,000	66,239,735
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,890,000	145,356,042
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,649,000	73,596,449
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,342,000	76,110,683
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,092,000	75,688,712
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,292,000	76,219,522
第115回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,944,000
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,771,000	77,028,950
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,473,000	77,602,379
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,103,000	77,322,743
第121回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,434,000	78,470,863
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,374,000	80,347,476
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,358,000	81,149,723
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,334,000	80,253,666
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,685,000	82,587,431
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,633,000	83,373,737
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,355,000	84,376,088
第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,346,000	84,439,624
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,713,000	84,352,969
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,784,000	86,065,428
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,699,000	86,841,303
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,828,000	87,328,583

第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	273,981,000	270,104,168	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	273,654,000	271,265,000	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,306,000	90,546,334	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,106,000	182,062,423	
第157回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,118,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,348,000	93,732,851	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,916,000	94,180,401	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,555,000	94,778,137	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,078,000	95,118,180	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,395,000	96,060,509	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,969,000	96,518,094	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,886,000	193,775,149	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,783,000	97,641,068	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,477,000	98,587,675	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,472,000	
第65回日本学生支援債券	100,000,000	99,959,000	
第19回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,131,000	
第24回沖縄振興開発金融公庫債券	500,000,000	500,520,000	
い第817号商工債	200,000,000	200,240,000	
い第829号商工債	100,000,000	100,023,000	
い第832号商工債	300,000,000	299,409,000	
い第835号商工債	200,000,000	199,516,000	
い第845号商工債	200,000,000	199,706,000	
第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,069,000	
第376回信金中金債（5年）	200,000,000	199,714,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,766,000	
第74回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,828,000	
第87回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,427,000	
第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,017,000	
第88回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,748,000	
第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,823,000	
第54回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,834,000	
第63回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,940,000	
第55回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,888,000	

	第57回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	400,000,000	404,348,000	
	第66回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,229,000	
	特殊債券合計	23,113,097,000	24,146,873,196	
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	99,985,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,633,000	
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	500,000,000	501,730,000	
	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	100,009,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,026,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	200,000,000	200,102,000	
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	200,070,000	
	第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	100,945,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,766,000	
	第5回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,605,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	200,000,000	198,820,000	
	第3回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,207,000	
	第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,765,000	
	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	199,642,000	
	第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,284,000	
	第2回株式会社伊藤園無担保社債	100,000,000	99,694,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,895,000	
	第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,205,000	
	第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,522,000	
	第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,603,000	
	第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,831,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,974,000	
	第11回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,694,000	
	第22回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,633,000	
	第22回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,258,000	
	第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,540,000	
	第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,901,000	

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	99,368,000	
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	96,455,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,772,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,216,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	200,000,000	198,028,000	
第1回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	99,799,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	98,311,000	
第18回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	98,158,000	
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,828,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,003,000	
第9回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	99,989,000	
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	101,083,000	
第11回日本電気硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,709,000	
第9回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	99,658,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,848,000	
第10回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	99,457,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,142,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,336,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,196,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	299,373,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,255,000	
第8回TDK株式会社無担保社債	100,000,000	99,394,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,226,000	
第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	98,958,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,552,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,808,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,087,000	
第7回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	98,917,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,103,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	94,361,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	115,666,000	
第87回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,395,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	100,422,000	
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,497,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	101,021,000	
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,114,000	

第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,747,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,821,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,944,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,141,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,780,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,641,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,765,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,752,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,745,000	
第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,943,000	
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	99,571,000	
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	99,591,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,730,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,348,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,474,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,065,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,821,000	
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	200,124,000	
第69回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,831,000	
第82回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,556,000	
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	99,382,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	99,983,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	114,275,000	
第78回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,288,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	111,469,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,006,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,450,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,246,000	
第3回東急株式会社無担保社債	100,000,000	99,813,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,775,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,738,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,879,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	91,869,000	

第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,317,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,157,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,278,000	
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,878,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,106,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,775,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,237,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,916,000	
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,959,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,871,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,205,000	
第83回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	199,642,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	111,637,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	115,113,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	113,050,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	101,818,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	101,632,000	
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	205,028,000	
第58回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,445,000	
第4回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,510,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	200,000,000	200,660,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	200,000,000	198,872,000	
第17回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,469,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	99,569,000	
第37回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	98,608,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,558,000	
第535回中部電力株式会社社債	200,000,000	197,674,000	
第509回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,775,000	
第510回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,878,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,663,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,085,000	
第377回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,483,000	
第393回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,812,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,518,000	
第426回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,229,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,388,000	
第321回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,330,000	

第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,488,000	
第521回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,240,000	
第535回東北電力株式会社社債	200,000,000	197,682,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,131,000	
第431回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,639,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,190,000	
第482回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,861,000	
第323回北海道電力株式会社社債	100,000,000	106,837,000	
第357回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,246,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,938,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,454,000	
第56回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,794,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,716,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,519,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	201,712,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,151,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,119,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,174,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	195,946,000	
第38回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	121,087,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	98,966,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	96,413,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,489,000	
社債券合計	18,000,000,000	18,165,344,000	
合計		381,589,474,412	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,448,820,753
コール・ローン	1,301,556,264
株式	292,444,866,009
投資信託受益証券	127,701,058
投資証券	6,621,374,231
派生商品評価勘定	15,425,802
未収入金	47,740,073
未収配当金	286,673,707
前払金	562,999,856
差入委託証拠金	2,674,989,572
流動資産合計	311,532,147,325
資産合計	311,532,147,325
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	584,258,844
未払解約金	142,912,530
未払利息	1,537
流動負債合計	727,172,911
負債合計	727,172,911
純資産の部	
元本等	
元本	72,835,310,492
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	237,969,663,922
元本等合計	310,804,974,414
純資産合計	310,804,974,414
負債純資産合計	311,532,147,325

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

	2022年 2月21日現在
	<p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2022年 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	72,835,310,492口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.2672円 (42,672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 2月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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 2月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2022年 2月21日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月23日
期首元本額	77,760,045,092円
期中追加設定元本額	9,752,754,241円
期中一部解約元本額	14,677,488,841円
期末元本額	72,835,310,492円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,517,133,817円
DC外国株式インデックスファンド	4,755,661,823円
DC外国株式インデックスファンドL	25,177,635,447円
DCバランスファンド30	598,190,204円
DCバランスファンド50	1,230,859,401円
DCバランスファンド70	804,289,050円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	280,156,377円

区分	2022年 2月21日現在
外国株式インデックス e	4,682,960,069円
インデックスコレクション（外国株式）	14,166,514,821円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,256,596,584円
インデックスコレクション（バランス株式50）	943,971,837円
インデックスコレクション（バランス株式70）	928,706,820円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,506,050,770円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,473,862,154円
私募外国株式パッシブファンド2（適格機関投資家専用）	121,280,693円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	453,718,432円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	25,356,150円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	284,757,815円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	34,994,620円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	67,430,436円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	346,381,789円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	260,960,740円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	194,042,836円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	3,827,843,356円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	420,511,164円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	115,496,668円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	633,510,778円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	14,241,274円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	79,386,640円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	87,377,650円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	264,892,173円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	11,110,839円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	64,532,239円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	196,897,254円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	7,997,772円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,856,882,693
投資信託受益証券	138,517
投資証券	252,592,214
合計	8,109,613,424

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2022年 2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	12,310,652,578	-	11,747,652,722	562,999,856
合計		12,310,652,578	-	11,747,652,722	562,999,856

(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 2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,337,801,577	-	1,331,968,391	5,833,186
	アメリカドル	1,072,878,686	-	1,069,095,214	3,783,472
	ユーロ	218,030,011	-	215,923,387	2,106,624
	イギリスポンド	46,892,880	-	46,949,790	56,910
合計		1,337,801,577	-	1,331,968,391	5,833,186

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカドル	BAKER HUGHES CO	42,790	29.11	1,245,616.90
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	116.02	1,307,081.32
	CHEVRON CORP	92,886	133.42	12,392,850.12
	CONOCOPHILLIPS	65,567	89.63	5,876,770.21
	COTERRA ENERGY INC	37,000	22.59	835,830.00
	DEVON ENERGY CORPORATION	33,379	54.78	1,828,501.62
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,890	131.47	1,168,768.30
	EOG RESOURCES INC	28,920	111.62	3,228,050.40
	EXXON MOBIL	205,529	77.36	15,899,723.44
	HALLIBURTON CO	41,018	32.26	1,323,240.68
	HESS CORP	12,829	93.87	1,204,258.23
	KINDER MORGAN INC	95,062	16.60	1,578,029.20
	MARATHON PETROLEUM CORP	30,365	77.02	2,338,712.30
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,347	39.56	1,714,807.32
	ONEOK INC	20,659	61.81	1,276,932.79
	PHILLIPS 66	20,389	85.07	1,734,492.23
	PIONEER NATURAL RESOURCES	11,583	233.38	2,703,240.54
	SCHLUMBERGER	69,679	40.21	2,801,792.59
	VALERO ENERGY CORP	19,008	86.72	1,648,373.76
	WILLIAMS COS	56,474	29.62	1,672,759.88
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,917	241.97	2,641,586.49
	ALBEMARLE CORP	5,885	190.76	1,122,622.60
	AMCOR PLC	72,748	11.88	864,246.24
	AVERY DENNISON CORP	4,144	180.87	749,525.28
	BALL CORP	15,147	90.61	1,372,469.67
	CELANESE CORP-SERIES A	5,419	144.25	781,690.75
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	73.27	760,469.33
	CORTEVA INC	34,769	50.70	1,762,788.30
	CROWN HOLDINGS INC	6,218	120.72	750,636.96
	DOW INC	36,681	60.59	2,222,501.79
	DUPONT DE NEMOURS INC	25,064	78.77	1,974,291.28
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	121.28	759,940.48
	ECOLAB INC	12,620	178.64	2,254,436.80
	FMC CORP	5,984	116.89	699,469.76
FREEMPORT-MCMORAN INC	72,123	43.02	3,102,731.46	
INT'L PAPER CO	17,345	46.74	810,705.30	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,577	134.79	1,560,463.83	
LINDE PLC	25,072	302.86	7,593,305.92	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,432	99.84	1,241,210.88	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,894	383.67	1,110,340.98	
MOSAIC CO/THE	16,566	45.00	745,470.00	
NEWMONT CORPORATION	37,562	67.67	2,541,820.54	

NUCOR CORP	14,049	122.93	1,727,043.57
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,374	148.47	649,407.78
PPG INDUSTRIES INC	11,026	149.64	1,649,930.64
RPM INTERNATIONAL INC	5,987	86.20	516,079.40
SEALED AIR CORP	7,368	69.31	510,676.08
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,375	268.07	3,317,366.25
STEEL DYNAMICS INC	9,667	63.95	618,204.65
VULCAN MATERIALS CO	6,162	185.31	1,141,880.22
WESTROCK CO	12,132	46.65	565,957.80
3 M COMPANY	28,021	147.62	4,136,460.02
ALLEGION PLC	4,638	114.13	529,334.94
AMETEK INC	10,723	128.22	1,374,903.06
BOEING CO	26,832	209.03	5,608,692.96
CARRIER GLOBAL CORP	41,014	44.08	1,807,897.12
CATERPILLAR	26,471	191.95	5,081,108.45
CUMMINS INC	6,913	218.05	1,507,379.65
DEERE&CO	14,394	369.10	5,312,825.40
DOVER CORP	6,691	159.03	1,064,069.73
EATON CORP	19,500	153.36	2,990,520.00
EMERSON ELECTRIC CO	29,379	92.77	2,725,489.83
FASTENAL CO	26,712	51.20	1,367,654.40
FORTIVE CORP	16,407	63.75	1,045,946.25
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	88.79	569,321.48
GENERAC HOLDINGS INC	2,918	294.76	860,109.68
GENERAL DYNAMICS CORP	11,401	215.82	2,460,563.82
GENERAL ELECTRIC CO	53,042	92.69	4,916,462.98
GRAINGER (WW) INC	2,116	473.93	1,002,835.88
HEICO CORP	2,252	141.98	319,738.96
HEICO CORP-CLASS A	3,318	117.41	389,566.38
HONEYWELL INTL INC	33,430	182.13	6,088,605.90
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	34.56	629,925.12
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	186.09	370,877.37
IDEX CORP	3,505	189.34	663,636.70
ILLINOIS TOOL WORKS	15,483	215.81	3,341,386.23
INGERSOLL-RAND INC	20,847	53.07	1,106,350.29
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	60.12	577,152.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	33,831	65.37	2,211,532.47
KORNIT DIGITAL LTD	2,600	87.84	228,384.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,818	217.62	2,136,593.16
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	251.98	399,136.32
LOCKHEED MARTIN CORP	12,232	386.46	4,727,178.72
MASCO CORP	12,110	57.56	697,051.60

NORDSON CORP	2,536	229.51	582,037.36
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,408	391.25	2,898,380.00
OTIS WORLDWIDE CORP	19,169	76.35	1,463,553.15
OWENS CORNING	4,965	98.07	486,917.55
PACCAR INC	16,159	93.81	1,515,875.79
PARKER HANNIFIN CORP	6,017	300.03	1,805,280.51
PENTAIR PLC	7,637	57.81	441,494.97
PLUG POWER INC	23,605	22.07	520,962.35
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	73,112	93.37	6,826,467.44
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,418	264.59	1,433,548.62
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,201	440.33	2,290,156.33
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	57.15	434,454.30
SMITH (A.O.) CORP	6,846	71.20	487,435.20
SNAP-ON INC	2,372	215.47	511,094.84
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	161.79	1,330,399.17
SUNRUN INC	7,884	21.56	169,979.04
TEXTRON	10,911	69.52	758,532.72
TRANE TECHNOLOGIES PLC	11,217	152.33	1,708,685.61
TRANSDIGM GROUP INC	2,661	648.96	1,726,882.56
UNITED RENTALS INC	3,357	311.82	1,046,779.74
WABTEC CORP	8,356	96.86	809,362.16
XYLEM INC	8,363	90.66	758,189.58
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,342	73.03	463,156.26
CINTAS CORP	4,399	371.57	1,634,536.43
CLARIVATE PLC	15,370	16.00	245,920.00
COPART INC	9,881	122.32	1,208,643.92
COSTAR GROUP INC	18,390	64.95	1,194,430.50
EQUIFAX INC	5,655	213.04	1,204,741.20
IHS MARKIT LTD	18,807	107.11	2,014,417.77
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,004	119.65	718,378.60
LEIDOS HOLDINGS	6,238	93.01	580,196.38
REPUBLIC SERVICES INC	10,373	117.54	1,219,242.42
ROBERT HALF INTL INC	5,212	120.38	627,420.56
ROLLINS INC	10,710	31.13	333,402.30
TRANSUNION	8,818	97.79	862,312.22
VERISK ANALYTICS INC	7,189	189.30	1,360,877.70
WASTE CONNECTIONS INC	12,201	121.00	1,476,321.00
WASTE MANAGEMENT INC	20,741	142.33	2,952,066.53
AMERCO	564	587.43	331,310.52
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	91.98	577,082.52
CSX CORP	107,460	34.66	3,724,563.60
DELTA AIR LINES INC	7,841	42.84	335,908.44

EXPEDITORS INTL WASH INC	7,850	106.22	833,827.00
FEDEX CORP	12,306	222.23	2,734,762.38
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,907	188.29	735,649.03
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	53.87	377,090.00
LYFT INC-A	11,829	41.26	488,064.54
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,893	270.22	3,213,726.46
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,619	287.96	1,330,087.24
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	45.98	310,548.92
UBER TECHNOLOGIES INC	59,921	34.68	2,078,060.28
UNION PACIFIC CORP	31,614	251.19	7,941,120.66
UNITED PARCEL SERVICE B	34,869	209.36	7,300,173.84
APTIV PLC	13,457	141.15	1,899,455.55
BORGWARNER INC	11,533	43.56	502,377.48
FORD MOTOR COMPANY	192,833	18.04	3,478,707.32
GENERAL MOTORS CO	63,834	48.60	3,102,332.40
LEAR CORP	2,989	171.77	513,420.53
LUCID GROUP INC	20,820	26.59	553,603.80
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	8,920	66.37	592,020.40
TESLA INC	40,697	856.98	34,876,515.06
DR HORTON INC	16,141	83.44	1,346,805.04
GARMIN LTD	7,784	114.52	891,423.68
HASBRO INC	6,002	97.98	588,075.96
LENNAR CORP-CL A	12,818	89.43	1,146,313.74
LULULEMON ATHLETICA INC	5,782	308.66	1,784,672.12
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	148.26	419,575.80
NEWELL BRANDS INC	17,598	25.86	455,084.28
NIKE B	62,119	142.95	8,879,911.05
NVR INC	164	4,996.04	819,350.56
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,862	29.63	381,101.06
PULTE GROUP INC	12,386	48.13	596,138.18
VF CORP	16,318	59.17	965,536.06
WHIRLPOOL CORP	3,060	204.54	625,892.40
AIRBNB INC-CLASS A	11,744	174.90	2,054,025.60
ARAMARK	11,643	37.77	439,756.11
BOOKING HOLDINGS INC	1,990	2,616.41	5,206,655.90
CAESARS ENTERTAINMENT INC	9,663	79.28	766,082.64
CARNIVAL CORPORATION	42,799	22.17	948,853.83
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,390	1,523.32	2,117,414.80
DARDEN RESTAURANTS INC	6,041	144.74	874,374.34
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	435.62	782,809.14
DRAFTKINGS INC - CL A	16,662	17.29	288,085.98
EXPEDIA GROUP INC	7,394	209.17	1,546,602.98

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,946	150.41	1,947,207.86
LAS VEGAS SANDS CORP	15,969	47.12	752,459.28
MARRIOTT INTL A	13,789	174.92	2,411,971.88
MCDONALD'S CORP	35,880	250.60	8,991,528.00
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	11.12	116,882.32
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,299	43.56	797,104.44
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,621	83.69	888,871.49
STARBUCKS CORP	56,825	93.34	5,304,045.50
VAIL RESORTS INC	1,853	266.00	492,898.00
WYNN RESORTS LTD	5,210	93.15	485,311.50
YUM BRANDS INC	14,073	125.80	1,770,383.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	38,655	81.05	3,132,987.75
ALPHABET INC-CL A	14,563	2,608.06	37,981,177.78
ALPHABET INC-CL C	13,900	2,609.35	36,269,965.00
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	24,885	17.90	445,441.50
CABLE ONE INC	247	1,474.87	364,292.89
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,332	596.83	3,779,127.56
COMCAST CORP-CL A	219,639	46.64	10,243,962.96
DISCOVERY INC - A	7,886	29.86	235,475.96
DISCOVERY INC-C	14,119	29.74	419,899.06
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	28.96	364,982.88
ELECTRONIC ARTS INC	13,548	129.33	1,752,162.84
FOX CORP - CLASS A	15,560	42.38	659,432.80
FOX CORP- CLASS B	6,975	38.54	268,816.50
IAC/INTERACTIVECORP	3,853	109.55	422,096.15
INTERPUBLIC GROUP OF COS	17,946	36.11	648,030.06
LIBERTY BROADBAND-A	1,450	145.68	211,236.00
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	148.28	1,097,568.56
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	63.03	623,051.55
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	51.16	405,596.48
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	51.10	162,038.10
LIVE NATION ENTERTAINMENT	7,518	117.44	882,913.92
MATCH GROUP INC	13,189	107.56	1,418,608.84
META PLATFORMS INC-CLASS A	115,331	206.16	23,776,638.96
NETFLIX INC	21,478	391.29	8,404,126.62
NEWS CORP-CLASS A	17,936	22.15	397,282.40
OMNICOM GROUP	9,954	84.12	837,330.48
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	30,808	28.38	874,331.04
PINTEREST INC- CLASS A	27,343	23.86	652,403.98
ROKU INC	5,586	112.46	628,201.56
SEA LTD-ADR	6,817	127.69	870,462.73
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	6.03	283,988.88

SNAP INC - A	52,578	38.01	1,998,489.78
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,342	158.50	846,707.00
THE WALT DISNEY CO	88,209	151.36	13,351,314.24
TWITTER INC	37,195	34.32	1,276,532.40
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	11,800	52.54	619,972.00
ADVANCE AUTO PARTS	3,129	218.80	684,625.20
AMAZON.COM	22,027	3,052.03	67,227,064.81
AUTOZONE INC	1,082	1,920.01	2,077,450.82
BATH & BODY WORKS INC	13,789	52.28	720,888.92
BEST BUY COMPANY INC	10,832	97.71	1,058,394.72
BURLINGTON STORES INC	3,076	221.06	679,980.56
CARMAX INC	7,628	105.64	805,821.92
CARVANA CO	3,698	126.40	467,427.20
CHEWY INC - CLASS A	3,947	44.17	174,338.99
DOLLAR GENERAL CORP	11,647	199.97	2,329,050.59
DOLLAR TREE INC	10,956	142.84	1,564,955.04
DOORDASH INC - A	5,536	96.21	532,618.56
EBAY	32,206	55.46	1,786,144.76
ETSY INC	5,869	127.30	747,123.70
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,800	70.69	127,242.00
GENUINE PARTS CO	6,685	126.86	848,059.10
HOME DEPOT	51,131	346.87	17,735,809.97
LKQ CORP	13,325	49.17	655,190.25
LOWES COMPANIES	33,595	222.69	7,481,270.55
MERCADOLIBRE INC	2,180	937.26	2,043,226.80
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	676.96	2,290,155.68
POOL CORP	1,855	454.83	843,709.65
ROSS STORES INC	16,636	93.47	1,554,966.92
TARGET (DAYTON HUDSON)	23,475	204.39	4,798,055.25
TJX COMPANIES INC	58,528	66.15	3,871,627.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,411	214.18	1,158,927.98
ULTA BEAUTY INC	2,478	375.83	931,306.74
WAYFAIR INC- CLASS A	3,788	128.09	485,204.92
COSTCO WHOLESALE CORP	21,257	512.67	10,897,826.19
KROGER CO	33,615	45.59	1,532,507.85
SYSCO CORP	25,975	83.55	2,170,211.25
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,374	46.61	1,602,172.14
WALMART INC	74,251	137.99	10,245,895.49
ALTRIA GROUP INC	90,586	51.74	4,686,919.64
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,451	76.39	2,173,371.89
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,377	66.52	956,358.04
BUNGE LIMITED	6,422	99.30	637,704.60

CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	44.95	437,902.90
COCA-COLA CO	199,430	62.54	12,472,352.20
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	9,216	55.40	510,566.40
CONAGRA BRANDS INC	22,663	36.02	816,321.26
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,917	215.85	1,708,884.45
GENERAL MILLS INC	28,545	68.15	1,945,341.75
HERSHEY FOODS CORPORATION	6,862	202.59	1,390,172.58
HORMEL FOODS CORP	13,714	47.45	650,729.30
JM SMUCKER CO	5,275	138.99	733,172.25
KELLOGG CO	11,938	66.07	788,743.66
KEURIG DR PEPPER INC	32,694	38.48	1,258,065.12
KRAFT HEINZ CO/THE	32,632	38.46	1,255,026.72
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,562	97.79	1,130,647.98
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	8,727	49.00	427,623.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	67,011	66.00	4,422,726.00
MONSTER BEVERAGE CORP	18,482	81.27	1,502,032.14
PEPSICO INC	66,328	167.71	11,123,868.88
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	75,028	111.61	8,373,875.08
TYSON FOODS INC	13,674	92.27	1,261,699.98
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,548	98.78	1,140,711.44
CLOROX COMPANY	5,866	150.55	883,126.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	38,122	79.55	3,032,605.10
ESTEE LAUDER CO-CL A	11,283	302.99	3,418,636.17
KIMBERLY-CLARK CORP	15,902	133.15	2,117,351.30
PROCTER & GAMBLE CO	117,178	159.90	18,736,762.20
ABBOTT LABORATORIES	85,273	116.79	9,959,033.67
ABIOMED INC	2,088	298.38	623,017.44
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,719	498.65	1,854,479.35
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,105	141.50	1,005,357.50
ANTHEM INC	11,878	446.24	5,300,438.72
BAXTER INTERNATIONAL	23,872	82.35	1,965,859.20
BECTON DICKINSON & CO	13,583	264.04	3,586,455.32
BOSTON SCIENTIFIC CORP	66,997	42.55	2,850,722.35
CARDINAL HEALTH	13,608	54.18	737,281.44
CENTENE CORP	29,043	82.06	2,383,268.58
CERNER CORP	14,251	91.45	1,303,253.95
CIGNA CORP	16,426	228.65	3,755,804.90
CVS HEALTH CORP	63,675	102.13	6,503,127.75
DAVITA INC	3,582	115.49	413,685.18
DENTSPLY SIRONA INC	10,094	55.09	556,078.46
DEXCOM INC	4,780	381.24	1,822,327.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	30,691	105.62	3,241,583.42

HCA HEALTHCARE INC	12,661	244.10	3,090,550.10
HENRY SCHEIN INC	6,547	83.47	546,478.09
HOLOGIC INC	11,926	70.05	835,416.30
HUMANA INC	6,360	421.75	2,682,330.00
IDEXX LABORATORIES INC	4,215	489.45	2,063,031.75
INMODE LTD	3,100	41.58	128,898.00
INSULET CORP	3,546	234.18	830,402.28
INTUITIVE SURGICAL INC	17,151	280.78	4,815,657.78
LABORATORY CRP OF AMER	4,533	264.47	1,198,842.51
MASIMO CORP	2,735	154.34	422,119.90
MCKESSON CORP	7,488	270.81	2,027,825.28
MEDTRONIC PLC	64,812	100.58	6,518,790.96
MOLINA HEALTHCARE INC	2,739	314.87	862,428.93
NOVOCURE LTD	4,504	76.00	342,304.00
OAK STREET HEALTH INC	4,376	15.75	68,922.00
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	131.38	820,599.48
RESMED INC	6,751	231.73	1,564,409.23
STERIS PLC	5,122	226.03	1,157,725.66
STRYKER CORP	16,646	248.14	4,130,538.44
TELADOC HEALTH INC	6,270	65.00	407,550.00
TELEFLEX INC	2,162	315.78	682,716.36
THE COOPER COS INC	2,279	388.98	886,485.42
UNITEDHEALTH GROUP INC	45,683	467.81	21,370,964.23
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	134.79	525,411.42
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,903	217.90	1,504,163.70
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,671	121.02	1,170,384.42
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,216	81.56	262,296.96
ABBVIE INC	84,795	144.03	12,213,023.85
AGILENT TECHNOLOGIES	14,398	132.05	1,901,255.90
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,417	147.50	799,007.50
AMGEN	27,728	220.77	6,121,510.56
AVANTOR INC	24,065	34.00	818,210.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,027	583.76	599,521.52
BIO-TECHNE CORP	1,796	401.01	720,213.96
BIOGEN INC	7,191	209.79	1,508,599.89
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,381	84.86	711,211.66
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	107,603	67.55	7,268,582.65
CATALENT INC	8,308	99.04	822,824.32
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,324	293.61	682,349.64
DANAHER CORP	30,829	266.93	8,229,184.97
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	25.51	530,046.78
EXACT SCIENCES CORP	9,063	74.13	671,840.19

GILEAD SCIENCES INC	61,511	61.05	3,755,246.55
HORIZON THERAPEUTICS PLC	10,243	93.37	956,388.91
ILLUMINA INC	7,260	311.97	2,264,902.20
INCYTE CORP	8,608	68.53	589,906.24
IQVIA HOLDINGS INC	9,501	228.27	2,168,793.27
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	137.89	367,201.07
JOHNSON & JOHNSON	127,558	163.36	20,837,874.88
LILLY (ELI) & CO	39,135	240.31	9,404,531.85
MERCK & CO	121,654	76.37	9,290,715.98
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,109	1,408.46	1,561,982.14
MODERNA INC	16,456	145.74	2,398,297.44
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	85.32	401,686.56
NOVAVAX INC	3,227	81.89	264,259.03
PERKINELMER INC	5,174	179.21	927,232.54
PFIZER	272,114	48.53	13,205,692.42
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,174	615.13	3,182,682.62
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,093	39.41	713,045.13
SEAGEN INC	6,223	120.26	748,377.98
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	8.15	463,384.55
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19,105	537.14	10,262,059.70
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,167	229.61	2,793,664.87
VIATRIS INC	57,073	14.71	839,543.83
WATERS CORP	2,876	316.18	909,333.68
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,434	369.49	1,268,828.66
ZOETIS INC	23,191	191.32	4,436,902.12
BANK OF AMERICA CORP	366,345	45.96	16,837,216.20
CITIGROUP	97,674	64.14	6,264,810.36
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,818	53.25	1,055,308.50
FIFTH THIRD BANCORP	33,182	48.23	1,600,367.86
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	578	771.82	446,111.96
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,838	168.59	1,489,998.42
HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,030	15.85	1,094,125.50
JPMORGAN CHASE & CO	144,686	152.14	22,012,528.04
KEY CORP	44,974	25.64	1,153,133.36
M & T BANK CORP	5,956	182.35	1,086,076.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,656	201.17	4,155,367.52
REGIONS FINL CORP	46,064	23.70	1,091,716.80
SIGNATURE BANK	3,120	335.25	1,045,980.00
SVB FINANCIAL GROUP	2,803	613.13	1,718,603.39
TRUIST FINANCIAL CORP	65,536	62.32	4,084,203.52
US BANCORP	69,143	57.10	3,948,065.30
WEBSTER FINANCIAL CORP	8,680	59.70	518,196.00

WELLS FARGO & CO	198,525	55.63	11,043,945.75
ALLY FINANCIAL INC	18,129	49.76	902,099.04
AMERICAN EXPRESS	33,082	194.88	6,447,020.16
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,496	300.56	1,651,877.76
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,489	64.17	993,929.13
BANK NEW YORK CO	38,892	56.38	2,192,730.96
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,242	314.80	20,223,381.60
BLACKROCK INC	7,350	756.02	5,556,747.00
BLACKSTONE INC	33,248	123.86	4,118,097.28
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,406	153.96	3,295,667.76
CARLYLE GROUP INC/THE	7,865	45.71	359,509.15
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,962	118.81	589,535.22
CME GROUP INC	17,634	236.62	4,172,557.08
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,030	189.16	383,994.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	123.81	1,768,625.85
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	33.17	612,351.37
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,750	403.01	705,267.50
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	30.37	447,896.76
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	42.78	97,795.08
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,151	346.04	5,588,892.04
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	27,704	122.87	3,403,990.48
INVESCO LTD	19,405	22.47	436,030.35
KKR & CO INC	24,952	59.14	1,475,661.28
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,762	372.01	655,481.62
MOODY'S CORP	7,905	323.58	2,557,899.90
MORGAN STANLEY	65,965	95.42	6,294,380.30
MSCI INC	3,869	527.00	2,038,963.00
NASDAQ INC	5,320	171.54	912,592.80
NORTHERN TRUST CORP	9,186	118.52	1,088,724.72
PRICE T ROWE GROUP INC	10,575	143.47	1,517,195.25
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,550	108.52	927,846.00
ROBINHOOD MARKETS INC - A	11,150	11.81	131,681.50
S&P GLOBAL INC	11,657	378.67	4,414,156.19
SCHWAB (CHARLES) CORP	69,946	85.61	5,988,077.06
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	59.07	371,491.23
SOFI TECHNOLOGIES INC	28,600	11.39	325,754.00
STATE STREET CORP	17,185	93.39	1,604,907.15
SYNCHRONY FINANCIAL	27,139	43.42	1,178,375.38
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,522	80.67	364,789.74
UPSTART HOLDINGS INC	1,260	130.05	163,863.00
AFLAC	31,141	63.17	1,967,176.97
ALLEGHANY CORP	647	687.80	445,006.60

ALLSTATE CORP	14,193	125.89	1,786,756.77
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	134.65	512,073.95
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	61.73	2,484,385.58
AON PLC	10,695	283.80	3,035,241.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,793	47.10	885,150.30
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,383	154.28	1,601,889.24
ASSURANT INC	2,684	165.54	444,309.36
BROWN & BROWN INC	11,065	66.14	731,839.10
CHUBB LTD	21,140	204.71	4,327,569.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,076	125.58	888,604.08
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	181.81	262,533.64
EVEREST RE GROUP LTD	1,834	304.42	558,306.28
FNF GROUP	12,836	47.75	612,919.00
GLOBE LIFE INC	4,559	105.08	479,059.72
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	70.53	1,175,946.69
LINCOLN NATIONAL CORP	8,416	69.65	586,174.40
LOEWS CORP	10,482	61.60	645,691.20
MARKEL CORP	639	1,253.00	800,667.00
MARSH & MCLENNAN COS	24,739	152.19	3,765,028.41
METLIFE INC	35,762	69.55	2,487,247.10
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	72.48	922,308.00
PROGRESSIVE CORP	28,960	106.41	3,081,633.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,486	114.07	2,108,698.02
TRAVELERS COS INC/THE	11,830	170.63	2,018,552.90
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	225.61	1,355,690.49
WR BERKLEY CORP	6,553	90.47	592,849.91
CBRE GROUP INC-A	16,391	99.69	1,634,018.79
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	5.58	358,794.00
WEYERHAEUSER CO	36,674	39.18	1,436,887.32
ZILLOW GROUP INC-A	3,140	60.80	190,912.00
ZILLOW GROUP INC-C	7,537	60.81	458,324.97
ACCENTURE PLC-CL A	30,517	321.18	9,801,450.06
ADOBE INC	22,891	442.56	10,130,640.96
AFFIRM HOLDINGS INC	4,720	37.33	176,197.60
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	7,539	100.33	756,387.87
ANSYS INC	4,382	299.57	1,312,715.74
ASANA INC - CL A	3,840	63.14	242,457.60
AUTODESK INC	10,882	216.84	2,359,652.88
AUTOMATIC DATA PROCESS	20,090	200.45	4,027,040.50
AVALARA INC	4,011	93.40	374,627.40
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,879	37.46	295,147.34
BILL.COM HOLDINGS INC	3,830	224.23	858,800.90

BLACK KNIGHT INC	8,009	55.86	447,382.74
BLOCK INC	22,640	97.72	2,212,380.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,360	142.38	763,156.80
CADENCE DESIGN SYSTEMS	13,022	134.95	1,757,318.90
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	66.85	465,476.55
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	130.79	742,364.04
CITRIX SYSTEMS INC	5,416	101.88	551,782.08
CLOUDFLARE INC - CLASS A	11,647	95.87	1,116,597.89
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	24,980	86.36	2,157,272.80
COUPA SOFTWARE INC	3,189	115.97	369,828.33
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,298	164.93	1,533,519.14
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	140.75	295,575.00
DATADOG INC - CLASS A	8,853	159.02	1,407,804.06
DOCUSIGN INC	9,538	110.28	1,051,850.64
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	23.02	379,945.10
DYNATRACE INC	8,780	41.64	365,599.20
EPAM SYSTEMS INC	2,842	443.23	1,259,659.66
FAIR ISAAC CORP	1,345	498.20	670,079.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	30,439	95.64	2,911,185.96
FISERV INC	28,111	94.13	2,646,088.43
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	233.51	905,785.29
FORTINET INC	6,902	304.85	2,104,074.70
GARTNER INC	4,134	288.23	1,191,542.82
GLOBAL PAYMENTS INC	14,011	136.62	1,914,182.82
GODADDY INC - CLASS A	8,747	83.62	731,424.14
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,640	87.81	319,628.40
HUBSPOT INC	2,233	497.59	1,111,118.47
INTL BUSINESS MACHINES CORP	43,137	124.35	5,364,085.95
INTUIT INC	13,160	481.20	6,332,592.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	172.46	606,024.44
MASTERCARD INC-CLASS A	42,363	369.95	15,672,191.85
MICROSOFT CORP	345,008	287.93	99,338,153.44
MONGODB INC	2,666	390.18	1,040,219.88
NORTONLIFELOCK INC	25,891	27.97	724,171.27
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15,640	55.15	862,546.00
OKTA INC	6,285	164.67	1,034,950.95
ORACLE CORP	81,320	74.57	6,064,032.40
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	74,206	11.02	817,750.12
PALO ALTO NETWORKS INC	4,839	482.17	2,333,220.63
PAYCHEX INC	15,091	115.84	1,748,141.44
PAYCOM SOFTWARE INC	2,306	318.57	734,622.42
PAYPAL HOLDINGS INC	54,270	103.65	5,625,085.50

PTC INC	5,381	108.86	585,775.66
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,503	146.88	514,520.64
SALESFORCE.COM INC	47,514	196.84	9,352,655.76
SERVICENOW INC	9,533	556.01	5,300,443.33
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,361	273.77	2,836,530.97
SPLUNK INC	7,452	114.70	854,744.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,662	73.92	788,135.04
SYNOPSYS INC	7,555	287.63	2,173,044.65
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	21,590	78.05	1,685,099.50
TWILIO INC - A	7,960	158.33	1,260,306.80
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	411.28	834,075.84
UNITY SOFTWARE INC	2,516	99.09	249,310.44
VERISIGN INC	4,769	208.22	993,001.18
VISA INC-CLASS A SHARES	81,833	222.69	18,223,390.77
VMWARE INC-CLASS A	10,056	122.67	1,233,569.52
WESTERN UNION CO	20,387	19.73	402,235.51
WIX.COM LTD	2,353	86.12	202,640.36
WORKDAY INC-CLASS A	9,326	214.47	2,000,147.22
ZENDESK INC	5,395	115.06	620,748.70
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,363	126.96	1,315,686.48
ZSCALER INC	4,184	255.22	1,067,840.48
AMPHENOL CORPORATION	27,943	76.23	2,130,094.89
APPLE INC	798,812	167.30	133,641,247.60
ARISTA NETWORKS INC	11,492	125.92	1,447,072.64
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	123.74	476,522.74
CDW CORP/DE	6,651	181.76	1,208,885.76
CISCO SYSTEMS	202,087	57.21	11,561,397.27
COGNEX CORP	8,069	65.72	530,294.68
CORNING	40,515	41.70	1,689,475.50
DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	58.90	825,130.10
F5 INC	2,841	201.69	573,001.29
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	59,737	17.33	1,035,242.21
HP INC	58,057	36.20	2,101,663.40
IPG PHOTONICS CORP	1,782	136.81	243,795.42
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	34.32	559,690.56
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8,628	160.59	1,385,570.52
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,906	217.81	1,722,005.86
NETAPP INC	10,843	90.90	985,628.70
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	108.64	1,073,363.20
TE CONNECTIVITY LTD	15,454	143.48	2,217,339.92
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,150	419.92	902,828.00
TRIMBLE IMS HOLDINGS	11,609	68.35	793,475.15

WESTERN DIGITAL CORP	15,203	55.53	844,222.59
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,482	420.31	1,043,209.42
AT&T INC	342,473	23.87	8,174,830.51
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	26.55	207,913.05
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,877	26.54	500,995.58
LUMEN TECHNOLOGIES INC	42,975	9.94	427,171.50
T-MOBILE US INC	30,205	123.98	3,744,815.90
VERIZON COMMUNICATIONS	201,261	53.83	10,833,879.63
AES CORP	30,838	21.26	655,615.88
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	57.10	723,057.30
AMEREN CORPORATION	13,199	84.67	1,117,559.33
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,953	85.71	2,138,721.63
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,442	148.26	1,251,610.92
ATMOS ENERGY CORP	6,189	106.04	656,281.56
CENTERPOINT ENERGY INC	27,008	26.61	718,682.88
CMS ENERGY CORP	13,272	62.51	829,632.72
CONSOLIDATED EDISON INC	17,915	84.61	1,515,788.15
CONSTELLATION ENERGY	16,151	45.41	733,416.91
DOMINION ENERGY INC	38,186	79.15	3,022,421.90
DTE ENERGY COMPANY	9,012	119.35	1,075,582.20
DUKE ENERGY CORP	37,403	99.81	3,733,193.43
EDISON INTL	17,598	59.94	1,054,824.12
ENERGY CORP	9,296	104.62	972,547.52
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,385	45.52	518,245.20
EVERGY INC	10,471	60.97	638,416.87
EVERSOURCE ENERGY	15,980	82.82	1,323,463.60
EXELON CORP	48,454	41.63	2,017,140.02
FIRSTENERGY CORP	25,172	40.98	1,031,548.56
NEXTERA ENERGY INC	94,384	74.15	6,998,573.60
NISOURCE INC	20,005	28.45	569,142.25
NRG ENERGY INC	12,298	38.43	472,612.14
PG&E CORP	68,966	11.41	786,902.06
PPL CORPORATION	35,742	26.10	932,866.20
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	23,582	64.68	1,525,283.76
SEMPRA ENERGY	15,948	135.51	2,161,113.48
SOUTHERN CO	51,635	63.77	3,292,763.95
UGI CORP	9,579	38.04	364,385.16
VISTRA CORP	23,603	21.45	506,284.35
WEC ENERGY GROUP INC	14,672	90.00	1,320,480.00
XCEL ENERGY INC	26,807	66.00	1,769,262.00
ADVANCED MICRO DEVICES	79,705	113.83	9,072,820.15
ANALOG DEVICES	26,323	160.36	4,221,156.28

	APPLIED MATERIALS	44,314	133.35	5,909,271.90
	BROADCOM INC	19,933	579.99	11,560,940.67
	ENPHASE ENERGY INC	6,604	140.35	926,871.40
	ENTEGRIS INC	6,990	130.19	910,028.10
	INTEL CORP	197,298	45.04	8,886,301.92
	KLA CORP	7,254	358.30	2,599,108.20
	LAM RESEARCH CORP	6,748	569.99	3,846,292.52
	MARVELL TECHNOLOGY INC	40,684	67.34	2,739,660.56
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27,084	71.78	1,944,089.52
	MICRON TECHNOLOGY	54,679	90.80	4,964,853.20
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,981	457.35	906,010.35
	NVIDIA CORP	120,952	236.42	28,595,471.84
	NXP SEMICONDUCTORS NV	13,089	187.09	2,448,821.01
	ON SEMICONDUCTOR CORP	21,863	60.20	1,316,152.60
	QORVO INC	5,297	133.20	705,560.40
	QUALCOMM	54,258	167.64	9,095,811.12
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,742	136.58	1,057,402.36
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,629	257.91	678,045.39
	TERADYNE INC	7,707	114.83	884,994.81
	TEXAS INSTRUMENTS	44,415	166.74	7,405,757.10
	アメリカドル 小計	15,329,645		1,842,822,948.05 (212,035,208,402)
カナダドル	CAMECO CORP	19,186	25.83	495,574.38
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	58,757	66.19	3,889,125.83
	CENOVUS ENERGY INC	65,155	19.60	1,277,038.00
	ENBRIDGE	98,735	52.55	5,188,524.25
	IMPERIAL OIL	11,645	55.40	645,133.00
	KEYERA CORP	10,963	30.03	329,218.89
	PARKLAND CORP	8,544	33.67	287,676.48
	PEMBINA PIPELINE CORP	25,294	42.23	1,068,165.62
	SUNCOR ENERGY	70,924	37.06	2,628,443.44
	TC ENERGY CORP	48,340	66.81	3,229,595.40
	TOURMALINE OIL CORP	16,810	46.13	775,445.30
	AGNICO EAGLE MINES	20,453	70.09	1,433,550.77
	BARRICK GOLD CORP	82,748	29.53	2,443,548.44
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	62.89	459,222.78
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	26,720	33.95	907,144.00
	FRANCO-NEVADA CORP	9,313	188.61	1,756,524.93
	IVANHOE MINES LTD-CL A	26,291	11.12	292,355.92
	KINROSS GOLD CORP	56,706	7.42	420,758.52
	LUNDIN MINING CORP	30,173	11.66	351,817.18
	NUTRIEN LTD	28,517	96.69	2,757,308.73

PAN AMERICAN SILVER CORP	9,343	30.50	284,961.50
TECK RESOURCES LTD-CL B	20,669	45.30	936,305.70
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,500	123.19	554,355.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	20,697	55.49	1,148,476.53
BALLARD POWER SYSTEMS INC	10,643	12.26	130,483.18
CAE INC	16,864	32.44	547,068.16
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	107.93	460,753.17
WSP GLOBAL INC	5,400	149.99	809,946.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,920	36.28	251,057.60
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,665	65.43	370,660.95
THOMSON REUTERS CORP	7,995	127.80	1,021,761.00
AIR CANADA	6,737	25.40	171,119.80
CANADIAN NATL RAILWAY CO	34,564	159.13	5,500,169.32
CP RAILWAY LIMITED	44,278	92.33	4,088,187.74
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	130.44	603,937.20
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,183	98.78	1,302,216.74
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	48.46	484,600.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,329	72.78	970,084.62
QUEBECOR INC -CL B	5,999	30.10	180,569.90
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,310	37.30	794,863.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	192.39	497,520.54
DOLLARAMA INC	13,514	64.29	868,815.06
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	39,890	49.66	1,980,937.40
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	39.43	289,021.90
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	98.17	890,205.56
METRO INC	11,419	66.93	764,273.67
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	137.93	511,030.65
SAPUTO INC	11,041	30.97	341,939.77
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	30.54	444,173.76
CANOPY GROWTH CORP	9,718	9.80	95,236.40
BANK MONTREAL	31,608	146.48	4,629,939.84
BANK NOVA SCOTIA	59,175	91.87	5,436,407.25
CANADIAN IMPERIAL BANK	22,299	160.61	3,581,442.39
NATIONAL BANK OF CANADA	16,160	101.64	1,642,502.40
ROYAL BANK OF CANADA	68,610	141.05	9,677,440.50
TORONTO-DOMINION BANK	87,827	106.23	9,329,862.21
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	69,288	67.91	4,705,348.08
IGM FINANCIAL INC	3,890	44.71	173,921.90
ONEX CORP	3,361	87.37	293,650.57
TMX GROUP LTD	2,508	124.83	313,073.64
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	645.67	773,512.66
GREAT-WEST LIFECO INC	12,491	39.03	487,523.73

	IA FINANCIAL CORP INC	5,415	79.17	428,705.55
	INTACT FINANCIAL CORP	8,967	183.61	1,646,430.87
	MANULIFE FINANCIAL CORP	90,426	26.90	2,432,459.40
	POWER CORP OF CANADA	25,684	40.29	1,034,808.36
	SUN LIFE FINANCIAL INC	27,175	67.68	1,839,204.00
	FIRSTSERVICE CORP	2,028	175.97	356,867.16
	BLACKBERRY LIMITED	25,075	8.49	212,886.75
	CGI INC - CL A	11,043	105.52	1,165,257.36
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	932	2,058.83	1,918,829.56
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,859	33.93	198,795.87
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,153	67.65	145,650.45
	OPEN TEXT CORP	12,469	54.51	679,685.19
	SHOPIFY INC - CLASS A	5,424	837.00	4,539,888.00
	BCE INC	3,102	66.72	206,965.44
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	16,322	66.33	1,082,638.26
	TELUS CORP	23,120	32.13	742,845.60
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	37,267	17.75	661,489.25
	ALTAGAS INCOME LTD	14,516	27.62	400,931.92
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	44.36	277,871.04
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	34.98	209,110.44
	EMERA INC	11,366	58.80	668,320.80
	FORTIS INC	22,342	57.76	1,290,473.92
	HYDRO ONE LTD	14,776	31.27	462,045.52
	NORTHLAND POWER INC	9,907	36.93	365,865.51
	カナダドル 小計	1,878,411		121,943,555.07 (11,012,722,458)
ユーロ	ENI	126,764	13.47	1,707,511.08
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	10.00	237,220.00
	NESTE OIL OYJ	19,525	35.27	688,646.75
	OMV AG	5,822	54.16	315,319.52
	REPSOL SA	68,089	11.73	798,956.32
	TENARIS SA	19,529	11.30	220,775.34
	TOTALENERGIES SE	122,539	50.66	6,207,825.74
	AIR LIQUIDE	23,018	150.74	3,469,733.32
	AKZO NOBEL	9,224	91.36	842,704.64
	ARCELORMITTAL	35,308	26.94	951,197.52
	ARKEMA	2,799	126.50	354,073.50
	BASF SE	44,781	67.26	3,011,970.06
	COVESTRO AG	10,438	52.80	551,126.40
	CRH PLC	36,478	43.28	1,578,767.84
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	29.00	278,487.00
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	37.66	122,244.36

HEIDELBERGCEMENT AG	6,738	65.70	442,686.60
KONINKLIJKE DSM NV	8,702	160.80	1,399,281.60
LANXESS	3,921	51.06	200,206.26
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,335	48.77	552,807.95
SOLVAY SA	3,676	108.30	398,110.80
STORA ENSO OYJ R	26,361	18.28	482,010.88
SYMRISE AG	5,851	103.30	604,408.30
UMICORE	9,946	36.77	365,714.42
UPM KYMMENE OYJ	24,581	33.05	812,402.05
VOESTALPINE AG	5,948	30.72	182,722.56
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,930	22.32	243,957.60
AIRBUS SE	28,672	115.00	3,297,280.00
ALSTOM	16,908	25.64	433,521.12
BOUYGUES ORD	11,344	32.70	370,948.80
BRENTAG SE	6,989	78.50	548,636.50
CNH INDUSTRIAL NV	46,753	13.88	649,165.40
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	20,876	31.27	652,896.90
DASSAULT AVIATION SA	1,210	115.00	139,150.00
EIFFAGE	3,659	96.78	354,118.02
FERROVIAL SA	22,126	24.59	544,078.34
GEA GROUP AG	7,649	41.18	314,985.82
IMCD NV	3,050	139.65	425,932.50
KINGSPAN GROUP PLC	7,694	88.38	679,995.72
KION GROUP AG	3,430	79.60	273,028.00
KNORR-BREMSE AG	3,221	91.78	295,623.38
KONE OYJ-B	15,737	52.50	826,192.50
LEGRAND SA	13,075	86.02	1,124,711.50
MTU AERO ENGINES AG	2,396	208.00	498,368.00
PRYSMIAN SPA	11,275	28.84	325,171.00
RATIONAL AG	268	663.60	177,844.80
SAFRAN SA	17,120	113.44	1,942,092.80
SAINT-GOBAIN	25,279	61.85	1,563,506.15
SCHNEIDER ELECTRIC SE	26,108	144.84	3,781,482.72
SIEMENS	36,928	136.34	5,034,763.52
SIEMENS ENERGY AG	18,121	18.42	333,788.82
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	16.28	200,602.16
THALES SA	4,746	84.44	400,752.24
VINCI S.A.	26,015	100.98	2,626,994.70
WARTSILA OYJ	18,738	10.17	190,565.46
BUREAU VERITAS SA	12,892	24.47	315,467.24
RANDSTAD NV	5,866	65.68	385,278.88
TELEPERFORMANCE	2,688	330.40	888,115.20

WOLTERS KLUWER	12,334	87.02	1,073,304.68
ADP	1,532	132.65	203,219.80
AENA SME SA	3,518	149.55	526,116.90
ATLANTIA SPA	26,089	16.54	431,512.06
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	7.53	290,051.46
DEUTSCHE POST AG-REG	48,367	49.15	2,377,238.05
GETLINK	18,993	14.32	272,074.72
INPOST SA	7,867	5.67	44,629.49
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,643	95.38	1,587,409.34
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	80.10	206,818.20
CONTINENTAL AG	4,993	87.51	436,937.43
FAURECIA	5,347	39.64	211,955.08
FERRARI NV	6,331	194.50	1,231,379.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	41,753	75.59	3,156,109.27
MICHELIN	8,304	135.45	1,124,776.80
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	6,979	84.22	587,771.38
RENAULT SA	8,441	36.32	306,619.32
STELLANTIS NV	95,050	16.69	1,586,574.60
VALEO SA	10,032	26.08	261,634.56
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,638	180.10	1,555,703.80
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	242.20	401,325.40
ADIDAS AG	9,292	229.40	2,131,584.80
ESSILORLUXOTTICA	14,035	166.98	2,343,564.30
HERMES INTERNATIONAL	1,565	1,203.00	1,882,695.00
KERING	3,523	666.60	2,348,431.80
LVMH	13,333	686.30	9,150,437.90
MONCLER SPA	9,963	55.08	548,762.04
PUMA SE	4,644	90.30	419,353.20
SEB SA	1,310	135.10	176,981.00
ACCOR	7,911	32.89	260,192.79
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,339	126.35	1,053,632.65
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	36.61	195,204.52
SODEXO	3,888	79.98	310,962.24
BOLLORE	37,200	4.78	178,039.20
PUBLICIS GROUPE	10,059	62.58	629,492.22
SCOUT24 SE	4,128	51.04	210,693.12
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	45.64	226,785.16
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	33,016	19.76	652,528.22
VIVENDI SE	33,016	11.45	378,033.20
DELIVERY HERO SE	7,305	47.07	343,846.35
INDITEX	50,337	25.35	1,276,042.95
JUST EAT TAKEAWAY	8,459	35.99	304,481.70

PROSUS	45,879	64.55	2,961,489.45
ZALANDO SE	11,285	59.48	671,231.80
CARREFOUR	30,831	18.18	560,507.58
COLRUYT SA	2,228	35.92	80,029.76
HELLOFRESH SE	7,756	47.87	371,279.72
JERONIMO MARTINS	13,062	19.99	261,109.38
KESKO OYJ-B SHS	14,326	26.17	374,911.42
KONINKLIJKE AHOLD NV	50,995	27.08	1,381,199.57
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	37,611	55.82	2,099,446.02
DANONE (GROUPE)	32,878	55.88	1,837,222.64
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	10.57	281,669.36
HEINEKEN HOLDING NV	5,127	78.70	403,494.90
HEINEKEN NV	11,984	98.30	1,178,027.20
JDE PEET'S BV	4,123	27.12	111,836.37
KERRY GROUP PLC-A	7,323	109.75	803,699.25
PERNOD-RICARD	10,396	197.10	2,049,051.60
REMY COINTREAU	1,020	177.00	180,540.00
BEIERSDORF AG	4,515	91.12	411,406.80
HENKEL AG & CO KGAA	4,647	71.50	332,260.50
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	8,553	73.74	630,698.22
LOREAL	12,190	360.75	4,397,542.50
AMPLIFON SPA	6,606	35.54	234,777.24
BIOMERIEUX	2,374	99.88	237,115.12
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	132.20	276,430.20
DIASORIN SPA	1,418	117.30	166,331.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,705	59.36	576,088.80
FRESENIUS SE&CO KGAA	20,026	37.07	742,463.95
KONINKLIJKE PHILIPS	42,449	30.02	1,274,318.98
ORPEA	2,344	36.71	86,048.24
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	399.10	485,305.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	52.98	772,289.46
ARGENX SE	2,207	247.90	547,115.30
BAYER	48,711	54.00	2,630,394.00
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	85.50	554,895.00
GRIFOLS SA	14,240	14.60	207,904.00
IPSEN	1,866	98.86	184,472.76
MERCK KGAA	5,937	177.30	1,052,630.10
ORION OYJ-CLASS B	5,393	44.94	242,361.42
QIAGEN N.V.	11,006	43.14	474,798.84
RECORDATI SPA	5,195	46.20	240,009.00
SANOFI	54,817	93.03	5,099,625.51
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,235	331.00	408,785.00

UCB (GROUPE)	6,718	87.12	585,272.16
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	12.66	249,787.62
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	5.71	1,876,489.10
BANCO SANTANDER SA	847,548	3.32	2,815,554.45
BNP PARIBAS	54,846	61.92	3,396,064.32
CAIXABANK	190,947	3.23	617,904.49
COMMERZBANK AG	46,222	9.21	425,704.62
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	13.05	841,785.60
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	40.26	729,470.94
FINECOBANK SPA	27,362	15.98	437,381.57
ING GROEP NV-CVA	193,144	12.61	2,435,545.84
INTESA SANPAOLO	823,869	2.72	2,242,571.41
KBC GROEP NV	12,855	74.42	956,669.10
MEDIOBANCA	29,447	10.20	300,506.63
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	24.88	195,706.08
SOCIETE GENERALE	38,744	32.37	1,254,143.28
UNICREDIT SPA	97,909	14.63	1,432,604.48
AMUNDI SA	2,812	66.60	187,279.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	95,207	13.56	1,291,387.74
DEUTSCHE BOERSE	8,787	156.35	1,373,847.45
EURAZEO SA	2,340	69.95	163,683.00
EURONEXT NV	4,500	80.80	363,600.00
EXOR NV	4,845	72.22	349,905.90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	93.50	521,917.00
SOFINA	752	341.80	257,033.60
WENDEL	1,047	91.35	95,643.45
AEGON	79,881	4.75	380,073.79
AGEAS	8,621	42.75	368,547.75
ALLIANZ SE-REG	19,980	214.10	4,277,718.00
ASSICURAZIONI GENERALI	50,794	18.54	941,720.76
AXA SA	95,834	26.92	2,579,851.28
CNP ASSURANCES	8,406	21.80	183,250.80
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	173.10	515,145.60
MUENCHENER RUECKVERSICH.	6,508	261.60	1,702,492.80
NN GROUP NV	13,557	49.76	674,596.32
POSTE ITALIANE SPA	25,777	11.03	284,449.19
SAMPO OYJ-A SHS	22,572	43.36	978,721.92
AROUNDTOWN SA	52,418	5.46	286,621.62
LEG IMMOBILIEN SE	3,774	112.85	425,895.90
VONOVIA SE	36,313	46.61	1,692,548.93
ADYEN NV	967	1,823.40	1,763,227.80
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	20,738	61.34	1,272,068.92

BECHTLE AG	4,296	46.25	198,690.00
CAPGEMINI SA	7,448	185.95	1,384,955.60
DASSAULT SYSTEMES SA	33,230	40.69	1,352,128.70
ELENRED	12,673	37.69	477,645.37
NEMETSCHKE SE	3,320	74.90	248,668.00
NEXI SPA	19,721	12.29	242,469.69
SAP SE	50,282	102.26	5,141,837.32
WORLDLINE SA	10,832	44.16	478,395.28
NOKIA OYJ	272,288	5.02	1,368,247.20
CELLNEX TELECOM SA	25,019	38.32	958,728.08
DEUTSCHE TELEKOM	164,526	17.07	2,809,445.97
ELISA A	6,367	51.14	325,608.38
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	8.75	130,292.76
KPN (KON.)	173,861	3.09	538,273.65
ORANGE	97,536	11.01	1,074,066.43
PROXIMUS	7,531	18.60	140,076.60
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.40	198,985.01
TELEFONICA	251,947	4.36	1,100,756.44
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.63	107,838.80
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	34.19	201,344.91
E.ON SE	109,829	12.12	1,331,786.45
EDP RENOVAVEIS SA	11,245	18.40	206,908.00
ELECTRICITE DE FRANCE	21,082	8.14	171,607.48
ELIA GROUP SA/NV	1,959	118.00	231,162.00
ENAGAS	11,944	18.31	218,694.64
ENDESA	17,138	18.77	321,680.26
ENEL	398,046	6.43	2,561,426.01
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	3.96	552,001.68
ENGIE	83,973	14.48	1,215,929.04
FORTUM OYJ	20,155	22.77	458,929.35
IBERDROLA SA	284,072	9.29	2,639,028.88
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,726	24.28	236,147.28
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	16.97	395,333.12
RWE STAMM	31,648	38.34	1,213,384.32
SNAM SPA	90,959	4.81	437,694.70
TERNA SPA	63,339	6.74	427,031.53
UNIPER SE	4,137	38.41	158,902.17
VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,290	32.56	1,018,802.40
VERBUND AG	3,100	94.00	291,400.00
ASM INTERNATIONAL NV	2,248	286.00	642,928.00
ASML HOLDING NV	20,078	570.40	11,452,491.20
INFINEON TECHNOLOGIES	64,521	31.31	2,020,152.51

	STMICROELECTRONICS	31,427	38.25	1,202,082.75
	ユーロ 小計	8,910,983		228,991,995.13 (29,851,396,485)
イギリスポンド	BP PLC	986,438	3.91	3,860,918.33
	SHELL PLC-NEW	381,017	19.57	7,456,502.69
	ANGLO AMERICAN PLC	63,630	35.26	2,243,593.80
	ANTOFAGASTA PLC	17,358	14.04	243,706.32
	BHP GROUP LIMITED	104,515	25.55	2,670,358.25
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,013	70.60	495,117.80
	GLENCORE PLC	495,828	4.22	2,092,394.16
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,824	17.94	158,302.56
	MONDI PLC	22,378	19.24	430,552.72
	RIO TINTO PLC REG	54,588	56.57	3,088,043.16
	ASHTED GROUP PLC	22,405	47.78	1,070,510.90
	BAE SYSTEMS PLC	156,168	5.97	932,947.63
	BUNZL PLC	15,472	27.36	423,313.92
	DCC PLC	4,499	61.84	278,218.16
	FERGUSON PLC	10,338	111.75	1,155,271.50
	MELROSE INDUSTRIES PLC	215,001	1.54	332,069.04
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	385,471	1.17	451,232.35
	SMITHS GROUP PLC	20,046	15.14	303,596.67
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	116.90	429,256.80
	EXPERIAN PLC	46,007	28.28	1,301,077.96
	INTERTEK GROUP PLC	7,435	51.60	383,646.00
	RELX PLC	95,541	22.33	2,133,430.53
	RENTOKIL INITIAL PLC	85,410	4.90	419,277.69
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	6.03	307,397.34
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	39.49	238,835.52
	BURBERRY GROUP PLC	18,587	20.33	377,873.71
	PERSIMMON PLC	14,327	24.14	345,853.78
	TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.48	246,498.25
	COMPASS GROUP PLC	83,254	17.48	1,455,279.92
	ENTAIN PLC	26,944	16.50	444,576.00
	INTERCONTINENTAL HOTELS	7,987	49.74	397,273.38
WHITBREAD PLC	10,170	31.11	316,388.70	
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	6.33	277,823.70	
INFORMA PLC	69,112	6.01	415,363.12	
PEARSON	34,302	6.21	213,015.42	
WPP PLC	56,693	11.84	671,245.12	
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.65	189,444.81	
KINGFISHER PLC	96,593	3.23	311,995.39	
NEXT PLC	6,143	68.50	420,795.50	

OCADO GROUP PLC	23,500	13.00	305,500.00
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.77	227,928.02
TESCO PLC	359,660	2.94	1,058,119.72
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,871	19.07	302,739.32
BRITISH AMERICAN TOBACCO	105,999	34.09	3,613,505.91
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	24.25	221,038.75
DIAGEO	113,071	36.58	4,136,702.53
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	17.79	811,526.43
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	35,301	62.73	2,214,431.73
UNILEVER PLC	126,231	38.57	4,869,360.82
SMITH & NEPHEW PLC	42,096	11.96	503,468.16
ASTRAZENECA	74,467	88.01	6,553,840.67
GLAXOSMITHKLINE	243,607	15.67	3,817,321.69
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	19.68	169,015.41
BARCLAYS	811,088	1.91	1,550,475.82
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	987,703	5.44	5,377,055.13
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,308,712	0.51	1,694,722.28
NATWEST GROUP PLC	302,525	2.34	709,421.12
STANDARD CHARTERED PLC	124,429	5.79	720,692.76
3I GROUP PLC	45,010	13.13	590,981.30
ABRDN PLC	100,722	2.33	235,085.14
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	12.77	233,092.65
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,399	66.20	1,085,613.80
M&G PLC	118,170	2.13	252,174.78
SCHRODERS PLC	5,525	32.28	178,347.00
ST JAMES' S PLACE PLC	26,728	15.16	405,330.12
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	29.63	292,507.36
AVIVA PIC	182,528	4.32	788,886.01
LEGAL & GENERAL GROUP	289,782	2.72	789,366.16
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	29,063	6.47	188,037.61
PRUDENTIAL	122,059	11.59	1,415,274.10
AVEVA GROUP PLC	4,523	25.19	113,934.37
SAGE GROUP PLC	48,541	6.68	324,545.12
HALMA PLC	17,484	22.86	399,684.24
BT GROUP PLC	413,941	1.97	816,912.56
VODAFONE GROUP PLC	1,374,547	1.37	1,891,101.76
NATIONAL GRID PLC	179,691	10.89	1,957,913.13
SEVERN TRENT PLC	11,927	28.51	340,038.77
SSE PLC	50,382	16.12	812,157.84
UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.61	368,510.34
イギリスポンド 小計	13,933,912		91,319,359.03 (14,296,958,849)

スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	16.56	144,866.88
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	921.00	285,510.00
	GIVAUDAN-REG	454	3,650.00	1,657,100.00
	HOLCIM LTD	24,228	50.06	1,212,853.68
	SIKA AG-BR	6,975	293.40	2,046,465.00
	ABB LTD	79,686	31.69	2,525,249.34
	GEBERIT AG-REG	1,777	600.80	1,067,621.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	206.40	188,030.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	209.30	422,995.30
	VAT GROUP AG	1,440	338.80	487,872.00
	ADECCO GROUP AG-REG	6,959	47.12	327,908.08
	SGS SA	277	2,587.00	716,599.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	248.70	678,951.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	25,653	129.35	3,318,215.55
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,285	286.20	367,767.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	55.20	165,820.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	149	2,098.00	312,602.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	103,600.00	518,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	10,010.00	550,550.00
	NESTLE SA - REGISTERED	136,031	118.20	16,078,864.20
	ALCON INC	24,786	70.44	1,745,925.84
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,490	324.30	807,507.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	468	1,433.00	670,644.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	390	500.00	195,000.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,643	599.60	2,184,342.80
	NOVARTIS	106,634	79.83	8,512,592.22
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,599	372.00	594,828.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	33,666	342.55	11,532,288.30
	VIFOR PHARMA AG	2,126	162.10	344,624.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG	129,034	8.28	1,069,175.72
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,425	58.30	607,777.50
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,050	1,232.00	1,293,600.00
	UBS GROUP AG	170,843	18.65	3,186,221.95
BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	157.60	367,838.40	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,676	586.60	983,141.60	
SWISS RE LTD	13,932	97.80	1,362,549.60	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,419	433.80	3,218,362.20	
SWISS PRIME SITE-REG	3,622	89.80	325,255.60	
TEMENOS AG - REG	3,520	97.74	344,044.80	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	68.24	566,255.52	
SWISSCOM	1,176	549.00	645,624.00	
	831,829		73,631,441.48	

	スイスフラン 小計			(9,201,721,241)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	9,250	322.30	2,981,275.00
	BOLIDEN AB	13,081	403.50	5,278,183.50
	SCA SV CELLULOSA B	26,880	163.65	4,398,912.00
	ALFA LAVAL AB	14,260	293.90	4,191,014.00
	ASSA ABLOY AB-B	50,678	268.70	13,617,178.60
	ATLAS COPCO A	33,072	494.00	16,337,568.00
	ATLAS COPCO B	17,773	435.30	7,736,586.90
	EPIROC AB-A	29,649	190.10	5,636,274.90
	EPIROC AB-B	17,442	163.60	2,853,511.20
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	115.15	2,514,991.15
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	259.80	2,099,443.80
	LIFCO AB-B SHS	13,590	202.70	2,754,693.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	65,860	77.20	5,084,392.00
	SANDVIK AB	51,973	237.20	12,327,995.60
	SKANSKA B	14,869	235.00	3,494,215.00
	SKF AB-B	18,340	186.20	3,414,908.00
	VOLVO AB-A SHS	8,748	208.80	1,826,582.40
	VOLVO B	71,980	205.45	14,788,291.00
	SECURITAS B	15,577	114.85	1,789,018.45
	ELECTROLUX AB-SER B	12,053	179.35	2,161,705.55
	EVOLUTION AB	7,849	991.90	7,785,423.10
	EMBRACER GROUP AB	22,878	81.41	1,862,497.98
	HENNES & MAURITZ B	33,524	173.90	5,829,823.60
	SWEDISH MATCH AB	74,128	70.90	5,255,675.20
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	263.80	8,350,589.00
	GETINGE AB-B SHS	12,650	351.00	4,440,150.00
	NORDEA BANK ABP	161,977	109.32	17,707,325.64
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	74,165	118.45	8,784,844.25
	SVENSKA HANDELSBK A	70,420	95.26	6,708,209.20
	SWEDBANK AB-A	40,897	166.20	6,797,081.40
	EQT AB	15,478	321.80	4,980,820.40
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	280.60	1,921,548.80
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	276.10	2,383,019.10
INVESTOR AB-A SHS	23,000	209.10	4,809,300.00	
INVESTOR AB-B SHS	90,842	194.26	17,646,966.92	
KINNEVIK AB - B	10,757	237.95	2,559,628.15	
LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	462.00	1,890,966.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,413	588.40	3,185,009.20	
SAGAX AB-B	9,400	254.00	2,387,600.00	
SINCH AB	27,717	67.08	1,859,256.36	
ERICSSON (LM) B	134,930	94.13	12,700,960.90	

	HEXAGON AB-B SHS	90,307	122.15	11,031,000.05	
	TELE2 AB-B SHS	24,520	130.70	3,204,764.00	
	TELIA CO AB	138,487	37.20	5,152,408.83	
	スウェーデンクローナ 小計	1,635,563		264,521,608.13 (3,237,744,483)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	8,070	256.80	2,072,376.00	
	EQUINOR ASA	43,502	268.30	11,671,586.60	
	NORSK HYDRO	61,358	77.20	4,736,837.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,882	448.30	4,430,100.60	
	ADEVINTA ASA	16,857	80.10	1,350,245.70	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	204.20	960,965.20	
	SCHIBSTED ASA-CL A	4,047	230.50	932,833.50	
	MOWI ASA	23,314	228.60	5,329,580.40	
	ORKLA	39,803	83.96	3,341,859.88	
	DNB BANK ASA	41,479	209.00	8,669,111.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	213.70	2,383,396.10	
	TELENOR ASA	30,180	136.50	4,119,570.00	
	ノルウェークローネ 小計	294,351		49,998,462.58 (641,480,274)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	460.20	2,445,502.80	
	NOVOZYMES A/S	10,786	390.60	4,213,011.60	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	428	2,700.00	1,155,600.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	48,316	164.35	7,940,734.60	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	21,940.00	3,334,880.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	301	22,940.00	6,904,940.00	
	DSV A/S	10,182	1,212.50	12,345,675.00	
	PANDORA A/S	4,249	695.60	2,955,604.40	
	CARLSBERG AS-B	4,526	1,058.00	4,788,508.00	
	AMBU A/S-B	8,639	106.05	916,165.95	
	COLOPLAST-B	5,263	909.40	4,786,172.20	
	DEMANT A/S	4,463	267.90	1,195,637.70	
	GN STORE NORD A/S	6,740	332.90	2,243,746.00	
	GENMAB A/S	3,223	2,099.00	6,765,077.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	81,951	661.80	54,235,171.80	
	DANSKE BANK A/S	31,666	125.40	3,970,916.40	
TRYG A/S	16,972	151.80	2,576,349.60		
ORSTED A/S	9,594	671.80	6,445,249.20		
	デンマーククローネ 小計	252,765		129,218,942.25 (2,265,208,057)	
ロシアルーブル	RASPADSKAYA OJSC	14,595	487.00	7,107,765.00	
	ロシアルーブル 小計	14,595		7,107,765.00 (10,448,414)	

オーストラリア ドル	AMPOL LTD	12,821	31.25	400,656.25
	SANTOS	153,046	7.00	1,071,322.00
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	25.57	264,521.65
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,027	27.44	1,317,860.88
	BHP GROUP LTD	142,775	47.96	6,847,489.00
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	19.08	411,154.92
	EVOLUTION MINING LTD	88,310	4.14	365,603.40
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	78,225	19.85	1,552,766.25
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	20,170	46.17	931,248.90
	NEWCREST MINING LIMITED	37,270	24.36	907,897.20
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	9.58	556,808.76
	ORICA LTD	19,570	14.85	290,614.50
	RIO TINTO LTD	17,196	119.25	2,050,623.00
	SOUTH32 LTD	217,613	4.57	994,491.41
	REECE LTD	12,870	20.28	261,003.60
	BRAMBLES LTD	66,936	10.13	678,061.68
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.71	347,270.84
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	5.31	212,123.88
	TRANSURBAN GROUP	153,930	12.91	1,987,236.30
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	27,473	39.84	1,094,524.32
	CROWN RESORTS LTD	18,801	12.31	231,440.31
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,685	101.40	272,259.00
	IDP EDUCATION LTD	12,550	27.49	344,999.50
	TABCORP HOLDINGS LTD	98,817	5.25	518,789.25
	REA GROUP LTD	3,000	133.67	401,010.00
	SEEK LTD	17,113	27.20	465,473.60
	WESFARMERS LTD	56,329	50.41	2,839,544.89
	COLES GROUP LTD	60,959	16.55	1,008,871.45
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	58,785	6.51	382,690.35
	WOOLWORTHS GROUP LTD	63,525	34.01	2,160,485.25
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.95	412,036.00
	COCHLEAR LIMITED	3,460	191.08	661,136.80
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	64.26	619,530.66
	SONIC HEALTHCARE LTD	20,560	37.60	773,056.00
CSL LIMITED	22,037	265.57	5,852,366.09	
AUST AND NZ BANKING GROUP	140,921	28.15	3,966,926.15	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	85,598	97.75	8,367,204.50	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	161,135	30.58	4,927,508.30	
WESTPAC BANKING	178,990	23.53	4,211,634.70	
ASX LTD	8,713	81.91	713,681.83	
MACQUARIE GROUP LIMITED	17,378	191.11	3,321,109.58	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,690	21.70	145,173.00	

	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	4.76	545,043.80
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.24	418,776.48
	QBE INSURANCE GROUP	66,253	11.55	765,222.15
	SUNCORP GROUP LIMITED	57,398	11.42	655,485.16
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	22.80	500,916.00
	WISETECH GLOBAL LTD	6,445	45.39	292,538.55
	XERO LTD	7,073	103.00	728,519.00
	TELSTRA CORP	199,810	3.91	781,257.10
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	5.65	496,538.95
	オーストラリアドル 小計	3,092,556		70,324,503.14 (5,817,242,899)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	7.12	460,386.32
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,554	28.81	707,400.74
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	9.40	206,800.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.53	474,102.50
	MERCURY NZ LTD	19,343	5.92	114,510.56
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	5.05	323,691.87
	ニュージーランドドル 小計	299,135		2,286,891.99 (176,273,634)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	121,448	59.75	7,256,518.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	69,000	133.00	9,177,000.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	21.65	2,208,300.00
	MTR CORP	82,500	42.80	3,531,000.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	32.80	2,656,800.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	97,000	48.65	4,719,050.00
	SANDS CHINA LTD	127,000	24.05	3,054,350.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	89,600	16.22	1,453,312.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	23.10	1,917,300.00
	WH GROUP LTD	446,619	5.73	2,559,126.87
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	161,500	31.35	5,063,025.00
	HANG SENG BANK	33,600	166.00	5,577,600.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	58,600	434.20	25,444,120.00
	AIA GROUP LTD	582,800	88.00	51,286,400.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	111,948	53.05	5,938,841.40
	ESR CAYMAN LTD	92,400	25.70	2,374,680.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	16.32	1,876,800.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	34.60	2,759,730.60
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	32.95	2,512,437.50
	SINO LAND CO	116,600	10.40	1,212,640.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	58,500	98.60	5,768,100.00
	SWIRE PACIFIC A	20,000	48.20	964,000.00
SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	21.15	1,459,350.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	37.00	2,997,000.00	

	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	50.90	1,628,800.00	
	CLP HOLDINGS	72,500	79.85	5,789,125.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	519,990	12.12	6,302,278.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	50.05	3,678,675.00	
	香港ドル 小計	3,654,116		171,166,360.17 (2,524,703,812)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,200	6.05	485,210.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.86	288,728.00	
	SINGAPORE AIRLINES	54,650	5.42	296,203.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.79	252,563.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	81,700	4.71	384,807.00	
	DBS GROUP	89,600	36.45	3,265,920.00	
	OCBC BANK	171,350	13.27	2,273,814.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	53,600	32.57	1,745,752.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.62	408,850.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	118,900	3.75	445,875.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	7.34	161,480.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	7.30	181,040.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	18.06	258,258.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	364,580	2.55	929,679.00	
	シンガポールドル 小計	1,512,680		11,378,179.50 (973,403,256)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	28,484	33.68	959,341.12	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	563.00	702,624.00	
	BANK HAPOLIM BM	63,371	33.80	2,141,939.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	34.53	2,440,994.76	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	21.38	1,373,173.26	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	124.50	780,864.00	
	AZRIELI GROUP	1,471	282.50	415,557.50	
	NICE LTD	3,165	738.60	2,337,669.00	
	イスラエルシェケル 小計	238,930		11,152,163.44 (400,353,745)	
	合 計	51,879,471		292,444,866,009 (292,444,866,009)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	63,405	627,709.50	
		LENLEASE GROUP	36,448	375,778.88	
		オーストラリアドル 小計	99,853	1,003,488.38 (83,008,558)	

	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	1,028,300.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	2,001,700.00	
	香港ドル 小計		315,000	3,030,000.00	(44,692,500)
投資信託受益証券合計			414,853	127,701,058	(127,701,058)
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	24,811	333,459.84	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,074	1,313,005.14	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	21,941	5,012,202.04	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	505,542.33	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,501	1,528,320.09	
		BOSTON PROPERTIES	6,840	829,008.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	824,556.70	
		CROWN CASTLE INTL CORP	21,001	3,409,302.34	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,046	1,899,019.20	
		DUKE REALTY CORP	17,311	916,098.12	
		EQUINIX INC	4,363	3,023,297.22	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	676,926.81	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	16,454	1,388,059.44	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,024	953,860.32	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,789	1,272,801.72	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,947	791,568.31	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,496	620,998.56	
		INVITATION HOMES INC	27,833	1,074,910.46	
		IRON MOUNTAIN INC	13,240	569,452.40	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,097	555,488.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,299	1,083,327.56	
		PROLOGIS INC	35,850	5,110,417.50	
		PUBLIC STORAGE	7,808	2,682,516.48	
		REALTY INCOME CORP	27,563	1,836,522.69	
		REGENCY CENTERS CORP	7,026	467,229.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,181	1,506,738.42	
		SIMON PROPERTY GROUP	16,262	2,292,128.90	
		SUN COMMUNITIES INC	5,410	1,002,797.60	
		UDR INC	14,820	803,836.80	
		VENTAS INC	20,307	1,075,052.58	
VICI PROPERTIES INC	29,321	818,642.32			
VORNADO REALTY TRUST	7,639	339,859.11			
WELLTOWER INC	21,176	1,754,643.36			
WP CAREY INC	8,887	678,611.32			
アメリカドル 小計		573,492	48,950,201.18	(5,632,210,147)	

カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	277,578.44	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	221,299.30	
カナダドル 小計		14,014	498,877.74	(45,053,648)
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	
	COVIVIO(FP)	3,076	230,576.96	
	GECINA SA	1,966	230,316.90	
	KLEPIERRE	8,356	218,927.20	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	440,743.10	
ユーロ 小計		1,625,167	1,120,564.16	(146,076,743)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	212,563.55	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	258,148.48	
	SEGRO PLC	55,104	697,341.12	
イギリスポンド 小計		126,411	1,168,053.15	(182,870,401)
オーストラリアドル	DEXUS	49,283	525,849.61	
	GOODMAN GROUP	76,627	1,767,018.62	
	GPT GROUP	85,529	423,368.55	
	MIRVAC GROUP	176,235	454,686.30	
	SCENTRE GROUP	234,255	744,930.90	
	STOCKLAND	121,481	500,501.72	
	VICINITY CENTERS	163,023	308,928.58	
オーストラリアドル 小計		906,433	4,725,284.28	(390,875,515)
香港ドル	LINK REIT	107,800	7,109,410.00	
香港ドル 小計		107,800	7,109,410.00	(104,863,797)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	135,809	384,339.47	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	214,690	459,436.60	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	132,200	244,570.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	174,778	307,609.28	
シンガポールドル 小計		657,477	1,395,955.35	(119,423,980)
投資証券合計		4,010,794	6,621,374,231	(6,621,374,231)
合計			6,749,075,289	(6,749,075,289)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 608銘柄	97.4%			70.9%
	投資証券 34銘柄			2.6%	1.9%
カナダドル	株式 86銘柄	99.6%			3.7%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 227銘柄	99.5%			10.0%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79銘柄	98.7%			4.8%
	投資証券 3銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデンクローナ	株式 44銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
ロシアルーブル	株式 1銘柄	100.0%			0.0%
オーストラリアドル	株式 51銘柄	92.5%			1.9%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.3%		0.0%
	投資証券 7銘柄			6.2%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 28銘柄	94.4%			0.8%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.7%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	89.1%			0.3%
	投資証券 4銘柄			10.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	254,280,837
コール・ローン	1,642,872,864
国債証券	145,640,296,010
派生商品評価勘定	278,609
未収入金	34,112
未収利息	797,763,368
前払金	29,529,825
前払費用	32,624,683
差入委託証拠金	232,243,790
流動資産合計	148,629,924,098
資産合計	148,629,924,098
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41,309,412
未払金	1,202,690
未払解約金	124,797,403
未払利息	1,940
流動負債合計	167,311,445
負債合計	167,311,445
純資産の部	
元本等	
元本	56,823,232,074
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	91,639,380,579
元本等合計	148,462,612,653
純資産合計	148,462,612,653
負債純資産合計	148,629,924,098

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

	2022年 2月21日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,823,232,074口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 2.6127円
の額	(1万口当たり純資産額) (26,127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 2月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2022年 2月21日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 2月23日
期首元本額	55,567,630,111円
期中追加設定元本額	6,890,954,283円
期中一部解約元本額	5,635,352,320円
期末元本額	56,823,232,074円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,019,468,336円
DC外国債券インデックスファンド	1,920,335,341円
DC外国債券インデックスファンドL	14,024,697,653円
DCバランスファンド30	885,327,952円
DCバランスファンド50	912,196,482円
DCバランスファンド70	211,943,275円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	477,457,801円
外国債券インデックスe	1,060,399,107円
インデックスコレクション（外国債券）	8,556,812,811円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,651,183,734円
インデックスコレクション（バランス株式50）	733,741,115円
インデックスコレクション（バランス株式70）	234,006,102円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,243,274,144円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,745,322,200円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	471,253,959円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	99,479,909円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	460,770,138円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	270,360,028円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	173,744,287円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	278,679,291円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,418,818,214円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	579,994,903円

区分	2022年 2月21日現在
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,118,817,386円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	346,296,438円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	217,001,162円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,529,807,127円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	91,720,485円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	186,333,987円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	93,770,276円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	47,398,598円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	71,568,737円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	228,508,569円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	69,775,817円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,374,122,073円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	18,844,637円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	590,217,281
合計	590,217,281

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益	
			(円)		(円)
市場取引	債券先物取引 買建	1,901,576,874	うち1年超	1,872,047,049	29,529,825
			-		
合計		1,901,576,874	-	1,872,047,049	29,529,825

(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 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,806,219,638	-	1,794,718,660	11,500,978
	アメリカドル	922,819,836	-	919,087,303	3,732,533
	カナダドル	71,895,912	-	71,320,963	574,949
	ユーロ	695,810,882	-	688,500,912	7,309,970
	イギリスポンド	115,693,008	-	115,809,482	116,474
	合計	1,806,219,638	-	1,794,718,660	11,500,978

(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	5,000,000.00	4,874,121.10	
		T 0.125% 06/30/23	6,630,000.00	6,525,111.34	
		T 0.125% 10/15/23	5,200,000.00	5,091,226.55	
		T 0.25% 03/15/24	4,500,000.00	4,383,984.37	
		T 0.25% 04/15/23	6,500,000.00	6,429,921.87	
		T 0.25% 05/15/24	5,070,000.00	4,925,227.72	
		T 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,124,226.56	
		T 0.25% 06/15/24	10,610,000.00	10,292,114.42	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	4,099,550.80	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,089,312.50	
		T 0.25% 09/30/25	7,000,000.00	6,627,304.67	
		T 0.375% 01/31/26	1,700,000.00	1,607,296.87	

T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,697,500.00	
T 0.375% 08/15/24	5,500,000.00	5,337,578.12	
T 0.375% 09/15/24	4,600,000.00	4,456,609.39	
T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,684,531.24	
T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,575,314.86	
T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,321,855.46	
T 0.5% 03/15/23	3,980,000.00	3,954,114.43	
T 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	3,855,156.24	
T 0.5% 05/31/27	5,500,000.00	5,131,113.29	
T 0.5% 06/30/27	2,500,000.00	2,329,003.90	
T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	1,021,839.84	
T 0.5% 10/31/27	3,580,000.00	3,316,394.54	
T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,202,109.39	
T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	6,681,968.75	
T 0.625% 07/31/26	4,000,000.00	3,795,781.24	
T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	8,214,146.87	
T 0.625% 10/15/24	3,250,000.00	3,165,322.25	
T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,447,359.37	
T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,791,757.82	
T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,279,062.50	
T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,634,091.79	
T 0.75% 04/30/26	3,500,000.00	3,349,199.21	
T 0.75% 08/31/26	3,000,000.00	2,860,664.07	
T 0.75% 11/15/24	5,230,000.00	5,104,561.74	
T 0.875% 09/30/26	5,000,000.00	4,790,234.40	
T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	5,648,431.28	
T 1.125% 02/15/31	5,600,000.00	5,237,312.52	
T 1.125% 05/15/40	3,050,000.00	2,515,535.17	
T 1.125% 08/15/40	4,000,000.00	3,284,687.52	
T 1.125% 08/31/28	4,000,000.00	3,806,562.52	
T 1.125% 10/31/26	2,700,000.00	2,614,359.37	
T 1.25% 03/31/28	5,300,000.00	5,103,941.39	
T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	4,024,800.00	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,768,671.86	
T 1.25% 06/30/28	1,000,000.00	960,742.19	
T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	3,945,756.83	
T 1.25% 08/15/31	6,550,000.00	6,170,304.68	
T 1.25% 09/30/28	3,800,000.00	3,643,250.00	
T 1.25% 11/30/26	3,000,000.00	2,922,304.68	
T 1.375% 08/15/50	1,400,000.00	1,136,078.13	
T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,450,067.37	
T 1.375% 09/30/23	3,550,000.00	3,548,890.62	

T 1.375% 10/31/28	1,700,000.00	1,642,492.19
T 1.375% 11/15/31	4,050,000.00	3,851,296.87
T 1.375% 11/15/40	4,650,000.00	3,983,742.18
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,767,106.25
T 1.5% 02/28/23	1,760,000.00	1,767,184.37
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,014,765.64
T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	5,228,367.21
T 1.5% 09/30/24	3,000,000.00	2,990,039.07
T 1.5% 11/30/28	3,800,000.00	3,699,953.14
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,711,816.43
T 1.625% 04/30/23	5,800,000.00	5,827,300.77
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,358,656.25
T 1.625% 05/15/31	4,200,000.00	4,096,312.50
T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,370,645.49
T 1.625% 08/15/29	2,260,000.00	2,218,860.94
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,131,607.41
T 1.625% 11/15/50	5,400,000.00	4,661,296.90
T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	3,003,487.50
T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,760,971.67
T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	2,008,281.26
T 1.75% 08/15/41	3,800,000.00	3,458,296.89
T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	3,189,309.37
T 1.875% 02/15/41	4,750,000.00	4,428,261.74
T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	4,124,531.25
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	3,989,483.58
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,803,867.19
T 1.875% 11/15/51	3,400,000.00	3,122,687.50
T 1% 07/31/28	2,000,000.00	1,889,687.50
T 1% 12/15/24	3,070,000.00	3,015,075.79
T 2.125% 02/29/24	1,400,000.00	1,417,335.93
T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,214,718.75
T 2.125% 05/15/25	3,850,000.00	3,899,027.36
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,519,453.12
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,228,187.50
T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,731,851.57
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,418,046.88
T 2.25% 01/31/24	5,090,000.00	5,164,759.37
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,979,828.12
T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,525,722.66
T 2.25% 04/30/24	2,600,000.00	2,639,304.69
T 2.25% 05/15/41	1,600,000.00	1,582,500.00
T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,369,118.76
T 2.25% 08/15/46	2,180,000.00	2,141,850.00

T 2.25% 08/15/49	4,110,000.00	4,092,339.86	
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,540,625.00	
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,081,445.30	
T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,592,382.84	
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	5,368,076.58	
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,549,697.27	
T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	2,947,804.70	
T 2.375% 02/29/24	4,280,000.00	4,354,231.25	
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,860,523.44	
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,696,328.11	
T 2.375% 05/15/29	3,890,000.00	4,015,513.30	
T 2.375% 05/15/51	1,600,000.00	1,642,375.00	
T 2.375% 08/15/24	5,460,000.00	5,561,948.46	
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	2,057,423.43	
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	4,094,687.52	
T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	2,204,757.81	
T 2.5% 02/15/46	2,250,000.00	2,313,632.81	
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	667,214.84	
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,776,023.45	
T 2.5% 05/15/46	2,510,000.00	2,581,770.30	
T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,508,825.19	
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,391,923.83	
T 2.625% 02/15/29	5,390,000.00	5,643,498.43	
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,570,019.52	
T 2.625% 06/30/23	6,000,000.00	6,106,757.82	
T 2.75% 02/15/24	3,900,000.00	3,995,976.58	
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,898,939.46	
T 2.75% 04/30/23	4,200,000.00	4,275,386.72	
T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	2,065,546.88	
T 2.75% 07/31/23	4,000,000.00	4,081,093.76	
T 2.75% 08/15/42	850,000.00	908,371.09	
T 2.75% 08/15/47	2,450,000.00	2,658,441.41	
T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	5,166,210.95	
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,549,864.27	
T 2.75% 11/15/42	1,040,000.00	1,111,175.00	
T 2.75% 11/15/47	2,500,000.00	2,712,890.62	
T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,382,476.57	
T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,715,927.33	
T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	1,142,613.28	
T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	4,943,812.50	
T 2.875% 07/31/25	5,000,000.00	5,187,109.40	
T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,447,078.14	

T 2.875% 08/15/45	1,480,000.00	1,622,218.75
T 2.875% 09/30/23	1,650,000.00	1,688,833.01
T 2.875% 11/30/23	6,000,000.00	6,149,296.86
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,559,667.98
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	6,105,300.81
T 2% 02/15/50	3,370,000.00	3,182,017.18
T 2% 04/30/24	3,000,000.00	3,029,531.25
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,514,765.62
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	1,009,921.88
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,779,589.86
T 2% 08/15/51	5,870,000.00	5,543,481.25
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,722,148.45
T 2% 11/15/41	1,500,000.00	1,425,117.19
T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	1,132,656.25
T 3.125% 02/15/43	1,100,000.00	1,243,515.62
T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,633,406.25
T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,760,097.66
T 3.125% 11/15/28	3,960,000.00	4,262,878.14
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	983,032.03
T 3.375% 05/15/44	1,700,000.00	2,003,875.00
T 3.375% 11/15/48	1,000,000.00	1,221,953.13
T 3.5% 02/15/39	900,000.00	1,070,789.06
T 3.625% 02/15/44	1,600,000.00	1,952,125.00
T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	1,947,000.00
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,352,570.31
T 3.75% 11/15/43	900,000.00	1,116,000.00
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	846,228.12
T 3% 02/15/47	2,400,000.00	2,708,250.00
T 3% 02/15/48	3,100,000.00	3,530,609.37
T 3% 02/15/49	1,940,000.00	2,225,543.75
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,223,148.44
T 3% 05/15/45	600,000.00	669,937.50
T 3% 05/15/47	1,900,000.00	2,149,226.57
T 3% 08/15/48	2,710,000.00	3,093,634.37
T 3% 09/30/25	3,660,000.00	3,817,265.62
T 3% 10/31/25	1,000,000.00	1,043,398.44
T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,284,789.06
T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,105,664.06
T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,172,531.25
T 4.375% 02/15/38	500,000.00	655,273.44
T 4.375% 05/15/40	750,000.00	993,339.84
T 4.375% 05/15/41	550,000.00	730,167.97
T 4.375% 11/15/39	650,000.00	858,203.12

	T 4.5% 02/15/36	600,000.00	786,750.00	
	T 4.5% 05/15/38	970,000.00	1,290,024.22	
	T 4.5% 08/15/39	750,000.00	1,004,589.84	
	T 4.625% 02/15/40	700,000.00	952,054.69	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,038,808.59	
	T 5.0% 05/15/37	650,000.00	901,519.53	
	T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,091,179.69	
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	966,796.87	
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	697,664.06	
	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,293,468.75	
	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	959,400.00	
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,447,716.79	
	アメリカドル 小計	607,580,000.00	605,807,167.68 (69,704,172,713)	
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	1,000,000.00	991,190.00	
	CAN 0.25% 03/01/26	890,000.00	840,872.00	
	CAN 0.25% 04/01/24	990,000.00	964,428.30	
	CAN 0.25% 05/01/23	300,000.00	296,391.00	
	CAN 0.25% 08/01/23	640,000.00	630,060.80	
	CAN 0.5% 09/01/25	1,330,000.00	1,278,276.30	
	CAN 0.5% 11/01/23	530,000.00	521,944.00	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	2,069,950.40	
	CAN 0.75% 02/01/24	430,000.00	423,924.10	
	CAN 1.25% 03/01/25	450,000.00	445,248.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	1,940,000.00	1,859,024.40	
	CAN 1.5% 06/01/23	2,010,000.00	2,014,944.60	
	CAN 1.5% 06/01/26	840,000.00	834,212.40	
	CAN 1.5% 06/01/31	1,100,000.00	1,065,163.00	
	CAN 1.5% 09/01/24	660,000.00	659,062.80	
	CAN 1.5% 12/01/31	1,230,000.00	1,185,055.80	
	CAN 1.75% 03/01/23	700,000.00	703,689.00	
	CAN 1.75% 12/01/53	740,000.00	666,022.20	
	CAN 1% 06/01/27	940,000.00	906,714.60	
	CAN 1% 09/01/26	1,220,000.00	1,182,167.80	
	CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	679,989.70	
	CAN 2.25% 06/01/25	670,000.00	683,781.90	
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	403,400.40	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,780,000.00	1,818,394.60	
	CAN 2.75% 12/01/48	810,000.00	906,219.90	
	CAN 2.75% 12/01/64	290,000.00	331,371.40	
	CAN 2% 06/01/28	500,000.00	508,210.00	
	CAN 2% 09/01/23	1,180,000.00	1,191,469.60	

	CAN 2% 12/01/51	2,280,000.00	2,203,300.80
	CAN 3.5% 12/01/45	690,000.00	859,167.30
	CAN 4.0% 06/01/41	490,000.00	630,590.80
	CAN 5.75% 06/01/29	960,000.00	1,221,273.60
	CAN 5.75% 06/01/33	750,000.00	1,032,210.00
	CAN 5% 06/01/37	390,000.00	535,134.60
	カナダドル 小計	32,110,000.00	32,542,856.10 (2,938,945,334)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	7,574,720.00
	MBONO 10% 12/05/24	20,780,000.00	21,973,811.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	20,410,000.00	19,039,060.30
	MBONO 6.75% 03/09/23	15,370,000.00	15,279,778.10
	MBONO 7.5% 06/03/27	22,800,000.00	22,588,644.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	13,660,000.00	13,628,308.80
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	13,558,223.40
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,970,000.00	4,930,985.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	20,740,000.00	21,634,516.20
	MBONO 8.5% 11/18/38	11,910,000.00	12,481,203.60
	MBONO 8% 09/05/24	10,270,000.00	10,338,809.00
	MBONO 8% 11/07/47	13,080,000.00	12,969,866.40
	MBONO 8% 12/07/23	13,220,000.00	13,286,893.20
		メキシコペソ 小計	187,590,000.00
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	730,000.00	708,392.00
	BGB 0.2% 10/22/23	640,000.00	647,193.60
	BGB 0.4% 06/22/40	400,000.00	358,496.00
	BGB 0.5% 10/22/24	490,000.00	500,388.00
	BGB 0.65% 06/22/71	300,000.00	218,040.00
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,134,419.00
	BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	776,647.50
	BGB 0.8% 06/22/28	980,000.00	1,015,378.00
	BGB 0.9% 06/22/29	990,000.00	1,029,887.10
	BGB 0% 10/22/27	600,000.00	594,042.00
	BGB 0% 10/22/31	940,000.00	885,066.40
	BGB 1.25% 04/22/33	550,000.00	587,295.50
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	430,776.00
	BGB 1.6% 06/22/47	640,000.00	698,502.40
	BGB 1.7% 06/22/50	710,000.00	788,696.40
	BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	586,107.30
	BGB 1% 06/22/26	1,080,000.00	1,125,932.40
	BGB 1% 06/22/31	1,100,000.00	1,144,550.00
	BGB 2.15% 06/22/66	430,000.00	544,478.90
	BGB 2.25% 06/22/23	830,000.00	860,618.70

BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	480,810.20
BGB 2.6% 06/22/24	1,000,000.00	1,068,620.00
BGB 3.75% 06/22/45	580,000.00	896,036.20
BGB 3% 06/22/34	460,000.00	581,927.60
BGB 4.25% 03/28/41	1,110,000.00	1,728,558.60
BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	891,705.00
BGB 4% 03/28/32	620,000.00	829,454.60
BGB 5.5% 03/28/28	1,190,000.00	1,580,236.70
BGB 5% 03/28/35	1,270,000.00	1,937,473.90
BKO 0% 03/10/23	780,000.00	785,600.40
BKO 0% 06/16/23	620,000.00	625,059.20
BKO 0% 09/15/23	700,000.00	706,307.00
BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,177,887.50
BTPS 0.3% 08/15/23	1,100,000.00	1,107,271.00
BTPS 0.35% 02/01/25	1,740,000.00	1,733,127.00
BTPS 0.5% 02/01/26	1,500,000.00	1,485,045.00
BTPS 0.5% 07/15/28	730,000.00	694,376.00
BTPS 0.6% 06/15/23	720,000.00	728,575.20
BTPS 0.6% 08/01/31	850,000.00	765,918.00
BTPS 0.65% 10/15/23	1,130,000.00	1,143,164.50
BTPS 0.85% 01/15/27	1,100,000.00	1,093,334.00
BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,210,482.00
BTPS 0.95% 03/01/37	600,000.00	514,536.00
BTPS 0.95% 03/15/23	860,000.00	871,911.00
BTPS 0.95% 06/01/32	360,000.00	330,544.80
BTPS 0.95% 08/01/30	1,630,000.00	1,544,245.70
BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	991,300.00
BTPS 0.95% 12/01/31	1,120,000.00	1,038,195.20
BTPS 0% 01/15/24	300,000.00	299,418.00
BTPS 0% 04/01/26	1,050,000.00	1,014,783.00
BTPS 0% 04/15/24	980,000.00	974,894.20
BTPS 0% 08/01/26	600,000.00	576,246.00
BTPS 0% 08/15/24	1,610,000.00	1,595,993.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,188,146.70
BTPS 1.35% 04/01/30	750,000.00	738,885.00
BTPS 1.45% 03/01/36	1,130,000.00	1,053,634.60
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,100,452.20
BTPS 1.45% 11/15/24	1,520,000.00	1,561,435.20
BTPS 1.5% 04/30/45	710,000.00	607,902.00
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,545,315.00
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,393,699.50
BTPS 1.65% 03/01/32	1,340,000.00	1,327,953.40
BTPS 1.65% 12/01/30	1,830,000.00	1,827,072.00

BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	635,272.50
BTPS 1.75% 07/01/24	1,840,000.00	1,901,235.20
BTPS 1.8% 03/01/41	650,000.00	603,726.50
BTPS 1.85% 05/15/24	750,000.00	776,895.00
BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	853,784.00
BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	1,092,624.00
BTPS 2.1% 07/15/26	1,470,000.00	1,548,306.90
BTPS 2.15% 03/01/72	310,000.00	264,033.20
BTPS 2.15% 09/01/52	360,000.00	334,440.00
BTPS 2.2% 06/01/27	1,110,000.00	1,175,867.40
BTPS 2.25% 09/01/36	990,000.00	1,016,185.50
BTPS 2.45% 09/01/33	990,000.00	1,050,340.50
BTPS 2.45% 09/01/50	720,000.00	718,560.00
BTPS 2.45% 10/01/23	870,000.00	905,548.20
BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	704,127.60
BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,374,152.00
BTPS 2.7% 03/01/47	1,240,000.00	1,318,529.20
BTPS 2.8% 03/01/67	600,000.00	608,286.00
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,381,728.60
BTPS 2.95% 09/01/38	850,000.00	947,588.50
BTPS 2% 02/01/28	930,000.00	973,961.10
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,101,240.00
BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	759,780.00
BTPS 3.25% 09/01/46	980,000.00	1,142,778.00
BTPS 3.35% 03/01/35	1,100,000.00	1,272,788.00
BTPS 3.45% 03/01/48	1,120,000.00	1,348,166.40
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	2,248,330.50
BTPS 3.75% 09/01/24	1,040,000.00	1,128,961.60
BTPS 3.85% 09/01/49	840,000.00	1,078,744.80
BTPS 3% 08/01/29	1,210,000.00	1,345,132.80
BTPS 4.5% 03/01/24	1,130,000.00	1,229,394.80
BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	1,068,514.20
BTPS 4.5% 05/01/23	1,050,000.00	1,110,249.00
BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,724,487.10
BTPS 4.75% 09/01/28	1,810,000.00	2,202,824.30
BTPS 4.75% 09/01/44	1,180,000.00	1,688,344.00
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	2,250,000.00
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	2,033,971.20
BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	2,268,609.00
BTPS 5.75% 02/01/33	1,320,000.00	1,841,571.60
BTPS 5% 03/01/25	1,740,000.00	1,974,760.80
BTPS 5% 08/01/34	1,260,000.00	1,691,398.80

BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	2,283,184.00
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,685,183.30
BTPS 6% 05/01/31	1,940,000.00	2,665,909.20
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	452,592.00
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,074,176.00
DBR 0.25% 02/15/27	1,230,000.00	1,252,595.10
DBR 0.25% 02/15/29	910,000.00	925,770.30
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,322,802.00
DBR 0.5% 02/15/25	1,140,000.00	1,169,583.00
DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,364,584.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,558,667.30
DBR 0.5% 08/15/27	1,510,000.00	1,557,112.00
DBR 0% 02/15/30	1,660,000.00	1,652,613.00
DBR 0% 02/15/31	1,240,000.00	1,226,794.00
DBR 0% 05/15/35	1,500,000.00	1,441,125.00
DBR 0% 05/15/36	1,320,000.00	1,256,666.40
DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,632,409.20
DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,424,605.40
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,469,003.60
DBR 0% 08/15/31	2,310,000.00	2,276,181.60
DBR 0% 08/15/50	2,020,000.00	1,783,821.60
DBR 0% 08/15/52	510,000.00	442,414.80
DBR 0% 11/15/27	1,580,000.00	1,585,135.00
DBR 0% 11/15/28	1,510,000.00	1,510,256.70
DBR 1.25% 08/15/48	1,880,000.00	2,280,082.80
DBR 1.5% 02/15/23	950,000.00	970,653.00
DBR 1.5% 05/15/23	2,290,000.00	2,351,165.90
DBR 1.5% 05/15/24	1,020,000.00	1,065,012.60
DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,307,412.50
DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,667,106.70
DBR 1% 08/15/25	1,880,000.00	1,963,058.40
DBR 2.5% 07/04/44	1,670,000.00	2,460,527.90
DBR 2.5% 08/15/46	1,830,000.00	2,758,523.70
DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	1,965,033.00
DBR 3.25% 07/04/42	1,240,000.00	1,963,738.40
DBR 4.0% 01/04/37	1,670,000.00	2,590,136.60
DBR 4.25% 07/04/39	1,090,000.00	1,824,616.40
DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	916,363.00
DBR 4.75% 07/04/34	1,440,000.00	2,250,288.00
DBR 4.75% 07/04/40	1,250,000.00	2,249,925.00
DBR 5.5% 01/04/31	1,640,000.00	2,437,614.00
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,009,025.00
DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,547,757.50

DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	911,956.10
DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,723,796.40
FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	2,065,211.00
FRTR 0.5% 05/25/25	3,160,000.00	3,225,064.40
FRTR 0.5% 05/25/26	2,930,000.00	2,988,277.70
FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	2,858,328.30
FRTR 0.5% 05/25/40	1,260,000.00	1,160,056.80
FRTR 0.5% 05/25/72	390,000.00	266,397.30
FRTR 0.5% 06/25/44	790,000.00	703,084.20
FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	3,051,404.80
FRTR 0.75% 05/25/52	1,930,000.00	1,699,442.20
FRTR 0.75% 05/25/53	570,000.00	495,358.50
FRTR 0.75% 11/25/28	2,990,000.00	3,078,653.50
FRTR 0% 02/25/23	610,000.00	613,794.20
FRTR 0% 02/25/24	1,850,000.00	1,864,578.00
FRTR 0% 02/25/26	1,690,000.00	1,690,084.50
FRTR 0% 02/25/27	1,120,000.00	1,112,294.40
FRTR 0% 03/25/23	1,880,000.00	1,892,878.00
FRTR 0% 03/25/24	2,240,000.00	2,256,755.20
FRTR 0% 03/25/25	3,280,000.00	3,294,989.60
FRTR 0% 11/25/29	2,760,000.00	2,670,217.20
FRTR 0% 11/25/30	3,330,000.00	3,177,419.40
FRTR 0% 11/25/31	2,460,000.00	2,313,703.80
FRTR 1.25% 05/25/34	2,400,000.00	2,530,560.00
FRTR 1.25% 05/25/36	2,410,000.00	2,535,199.50
FRTR 1.5% 05/25/31	3,230,000.00	3,505,680.50
FRTR 1.5% 05/25/50	1,960,000.00	2,112,311.60
FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,676,544.00
FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	970,479.00
FRTR 1.75% 06/25/39	1,910,000.00	2,185,402.90
FRTR 1.75% 11/25/24	2,020,000.00	2,131,908.00
FRTR 1% 05/25/27	2,180,000.00	2,277,838.40
FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,327,785.60
FRTR 2.25% 05/25/24	2,990,000.00	3,165,692.40
FRTR 2.5% 05/25/30	2,900,000.00	3,387,867.00
FRTR 2.75% 10/25/27	3,280,000.00	3,762,422.40
FRTR 2% 05/25/48	1,980,000.00	2,377,326.60
FRTR 3.25% 05/25/45	1,620,000.00	2,348,141.40
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,578,172.00
FRTR 4.25% 10/25/23	2,870,000.00	3,099,198.20
FRTR 4.5% 04/25/41	2,340,000.00	3,794,286.60
FRTR 4.75% 04/25/35	1,810,000.00	2,715,343.90

FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	1,878,663.20
FRTR 4% 04/25/60	1,080,000.00	1,974,844.80
FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	2,381,680.00
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,420,575.00
FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	3,291,671.50
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,778,773.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,217,425.00
IRISH 0.2% 05/15/27	460,000.00	461,265.00
IRISH 0.2% 10/18/30	470,000.00	456,581.50
IRISH 0.35% 10/18/32	170,000.00	162,326.20
IRISH 0.4% 05/15/35	250,000.00	234,580.00
IRISH 0.55% 04/22/41	220,000.00	201,570.60
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	458,334.80
IRISH 0% 10/18/31	460,000.00	430,481.80
IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	577,186.50
IRISH 1.3% 05/15/33	380,000.00	400,565.60
IRISH 1.35% 03/18/31	420,000.00	450,408.00
IRISH 1.5% 05/15/50	400,000.00	427,872.00
IRISH 1.7% 05/15/37	470,000.00	521,215.90
IRISH 1% 05/15/26	730,000.00	760,389.90
IRISH 2.4% 05/15/30	720,000.00	834,386.40
IRISH 2% 02/18/45	580,000.00	692,873.80
IRISH 3.4% 03/18/24	510,000.00	549,570.90
IRISH 3.9% 03/20/23	310,000.00	324,728.10
IRISH 5.4% 03/13/25	700,000.00	819,896.00
NETHER 0.25% 07/15/25	920,000.00	933,818.40
NETHER 0.25% 07/15/29	870,000.00	873,410.40
NETHER 0.5% 01/15/40	620,000.00	619,349.00
NETHER 0.5% 07/15/26	1,260,000.00	1,291,689.00
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	935,100.00
NETHER 0.75% 07/15/28	1,040,000.00	1,082,463.20
NETHER 0% 01/15/24	1,080,000.00	1,089,871.20
NETHER 0% 01/15/26	640,000.00	641,440.00
NETHER 0% 01/15/27	750,000.00	749,325.00
NETHER 0% 01/15/29	450,000.00	443,574.00
NETHER 0% 01/15/38	530,000.00	485,729.10
NETHER 0% 01/15/52	580,000.00	484,068.00
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	831,096.00
NETHER 0% 07/15/31	700,000.00	677,831.00
NETHER 1.75% 07/15/23	820,000.00	847,338.80
NETHER 2.5% 01/15/33	920,000.00	1,125,160.00
NETHER 2.75% 01/15/47	1,210,000.00	1,841,123.90
NETHER 2% 07/15/24	1,110,000.00	1,173,614.10

NETHER 3.75% 01/15/42	1,150,000.00	1,855,134.00	
NETHER 4% 01/15/37	1,070,000.00	1,608,809.20	
NETHER 5.5% 01/15/28	650,000.00	858,344.50	
OBL 0% 04/05/24	1,880,000.00	1,899,345.20	
OBL 0% 04/10/26	1,500,000.00	1,512,030.00	
OBL 0% 04/11/25	1,420,000.00	1,433,717.20	
OBL 0% 04/14/23	1,110,000.00	1,118,624.70	
OBL 0% 10/09/26	630,000.00	634,284.00	
OBL 0% 10/10/25	2,770,000.00	2,795,013.10	
OBL 0% 10/18/24	1,390,000.00	1,404,122.40	
RAGB 0.25% 10/20/36	360,000.00	331,797.60	
RAGB 0.5% 02/20/29	700,000.00	708,708.00	
RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	664,527.50	
RAGB 0.7% 04/20/71	200,000.00	163,522.00	
RAGB 0.75% 02/20/28	730,000.00	754,090.00	
RAGB 0.75% 03/20/51	360,000.00	341,989.20	
RAGB 0.75% 10/20/26	900,000.00	930,294.00	
RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	147,102.00	
RAGB 0% 02/20/30	660,000.00	637,942.80	
RAGB 0% 02/20/31	720,000.00	687,247.20	
RAGB 0% 04/20/23	230,000.00	231,492.70	
RAGB 0% 04/20/25	370,000.00	371,668.70	
RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	654,569.50	
RAGB 0% 07/15/24	590,000.00	594,761.30	
RAGB 0% 10/20/40	220,000.00	187,583.00	
RAGB 1.2% 10/20/25	640,000.00	670,899.20	
RAGB 1.5% 02/20/47	540,000.00	616,572.00	
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	223,314.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	589,428.00	
RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	777,870.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	360,000.00	485,967.60	
RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	640,568.60	
RAGB 3.15% 06/20/44	420,000.00	621,759.60	
RAGB 3.8% 01/26/62	220,000.00	417,973.60	
RAGB 4.15% 03/15/37	920,000.00	1,376,025.60	
RAGB 4.85% 03/15/26	730,000.00	879,328.80	
RAGB 6.25% 07/15/27	690,000.00	922,467.90	
RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	248,294.70	
RFGB 0.125% 04/15/52	210,000.00	170,226.00	
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	356,258.20	
RFGB 0.25% 09/15/40	210,000.00	190,522.50	
RFGB 0.5% 04/15/26	600,000.00	613,626.00	

RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	388,546.20
RFGB 0.5% 09/15/28	290,000.00	294,535.60
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	293,804.80
RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	276,879.60
RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	310,893.00
RFGB 0% 09/15/23	150,000.00	151,290.00
RFGB 0% 09/15/24	290,000.00	292,398.30
RFGB 0% 09/15/30	400,000.00	384,620.00
RFGB 1.125% 04/15/34	270,000.00	285,903.00
RFGB 1.375% 04/15/47	250,000.00	285,260.00
RFGB 1.5% 04/15/23	440,000.00	450,582.00
RFGB 2.625% 07/04/42	320,000.00	435,561.60
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	442,361.80
RFGB 2% 04/15/24	310,000.00	326,352.50
RFGB 4% 07/04/25	320,000.00	365,577.60
SPGB 0.1% 04/30/31	1,220,000.00	1,119,825.80
SPGB 0.25% 07/30/24	1,000,000.00	1,007,940.00
SPGB 0.35% 07/30/23	1,170,000.00	1,181,992.50
SPGB 0.5% 04/30/30	1,780,000.00	1,725,994.80
SPGB 0.5% 10/31/31	1,180,000.00	1,112,704.60
SPGB 0.6% 10/31/29	1,200,000.00	1,179,108.00
SPGB 0.7% 04/30/32	530,000.00	504,729.60
SPGB 0.8% 07/30/27	590,000.00	596,484.10
SPGB 0.85% 07/30/37	640,000.00	581,273.60
SPGB 0% 01/31/25	1,040,000.00	1,038,065.60
SPGB 0% 01/31/26	1,070,000.00	1,055,426.60
SPGB 0% 01/31/28	1,080,000.00	1,037,944.80
SPGB 0% 04/30/23	860,000.00	865,082.60
SPGB 0% 05/31/24	660,000.00	660,891.00
SPGB 1.2% 10/31/40	950,000.00	886,331.00
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,228,176.00
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,520,356.40
SPGB 1.4% 04/30/28	1,020,000.00	1,065,777.60
SPGB 1.4% 07/30/28	1,760,000.00	1,838,337.60
SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	784,590.00
SPGB 1.45% 10/31/27	1,680,000.00	1,759,396.80
SPGB 1.45% 10/31/71	220,000.00	166,936.00
SPGB 1.5% 04/30/27	1,970,000.00	2,068,598.50
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,310,100.00
SPGB 1.85% 07/30/35	1,290,000.00	1,364,549.10
SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,428,453.40
SPGB 1.95% 07/30/30	1,350,000.00	1,462,171.50
SPGB 1% 07/30/42	340,000.00	302,980.80

	SPGB 1% 10/31/50	1,040,000.00	844,064.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,760,000.00	1,882,372.80	
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,090,000.00	1,220,691.00	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,060,000.00	1,266,615.20	
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,677,390.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,359,193.00	
	SPGB 3.45% 07/30/66	980,000.00	1,318,854.60	
	SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,630,080.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,310,000.00	1,805,717.10	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,425,164.40	
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,623,544.50	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	1,982,994.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,261,929.50	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,180,000.00	1,824,964.40	
	SPGB 5.15% 10/31/28	1,100,000.00	1,418,802.00	
	SPGB 5.15% 10/31/44	950,000.00	1,579,831.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	1,790,000.00	1,890,275.80	
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	2,113,027.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,691,459.20	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,192,216.50	
	ユーロ 小計	384,510,000.00	426,874,467.50 (55,647,355,583)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,450,000.00	1,389,593.00	
	UKT 0.125% 01/31/23	2,050,000.00	2,031,837.00	
	UKT 0.125% 01/31/24	980,000.00	958,890.80	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,320,000.00	1,237,896.00	
	UKT 0.25% 01/31/25	110,000.00	106,778.10	
	UKT 0.25% 07/31/31	1,890,000.00	1,704,609.90	
	UKT 0.375% 10/22/26	620,000.00	594,883.80	
	UKT 0.375% 10/22/30	1,090,000.00	1,007,541.50	
	UKT 0.5% 01/31/29	260,000.00	246,318.80	
	UKT 0.5% 10/22/61	730,000.00	547,456.20	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,160,000.00	1,138,574.80	
	UKT 0.625% 07/31/35	960,000.00	854,937.60	
	UKT 0.625% 10/22/50	670,000.00	539,470.60	
	UKT 0.75% 07/22/23	940,000.00	934,745.40	
	UKT 0.875% 01/31/46	400,000.00	347,440.00	
	UKT 0.875% 07/31/33	400,000.00	377,036.00	
	UKT 0.875% 10/22/29	550,000.00	534,864.00	
	UKT 1.125% 01/31/39	310,000.00	290,780.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	740,000.00	741,924.00	
	UKT 1.25% 07/31/51	360,000.00	339,631.20	

UKT 1.25% 10/22/41	1,440,000.00	1,367,049.60	
UKT 1.5% 07/22/26	440,000.00	445,592.40	
UKT 1.5% 07/22/47	1,010,000.00	1,007,879.00	
UKT 1.5% 07/31/53	260,000.00	264,573.40	
UKT 1.625% 10/22/28	480,000.00	492,787.20	
UKT 1.625% 10/22/54	720,000.00	753,991.20	
UKT 1.625% 10/22/71	710,000.00	815,456.30	
UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	634,608.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,050,000.00	1,151,661.00	
UKT 1.75% 09/07/37	1,110,000.00	1,142,334.30	
UKT 1% 04/22/24	1,450,000.00	1,443,170.50	
UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,177,817.60	
UKT 2.5% 07/22/65	860,000.00	1,202,357.40	
UKT 2.75% 09/07/24	980,000.00	1,016,426.60	
UKT 2% 09/07/25	1,090,000.00	1,118,852.30	
UKT 3.25% 01/22/44	1,240,000.00	1,636,180.00	
UKT 3.5% 01/22/45	1,280,000.00	1,766,233.60	
UKT 3.5% 07/22/68	910,000.00	1,608,597.90	
UKT 3.75% 07/22/52	800,000.00	1,246,744.00	
UKT 4.25% 03/07/36	790,000.00	1,065,014.80	
UKT 4.25% 06/07/32	1,070,000.00	1,360,044.90	
UKT 4.25% 09/07/39	670,000.00	953,108.50	
UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	876,420.00	
UKT 4.25% 12/07/40	970,000.00	1,401,698.50	
UKT 4.25% 12/07/46	910,000.00	1,421,456.40	
UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	1,317,311.10	
UKT 4.25% 12/07/55	990,000.00	1,736,747.10	
UKT 4.5% 09/07/34	1,080,000.00	1,452,081.60	
UKT 4.5% 12/07/42	1,120,000.00	1,713,264.00	
UKT 4.75% 12/07/30	850,000.00	1,094,315.50	
UKT 4.75% 12/07/38	880,000.00	1,304,538.40	
UKT 4% 01/22/60	780,000.00	1,391,395.20	
UKT 5% 03/07/25	600,000.00	666,966.00	
UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	589,333.50	
イギリスポンド 小計	47,300,000.00	54,561,216.50 (8,542,104,055)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,150,000.00	3,023,149.50
	SGB 0.75% 05/12/28	3,860,000.00	3,915,275.20
	SGB 0.75% 11/12/29	3,840,000.00	3,897,216.00
	SGB 1.5% 11/13/23	6,100,000.00	6,258,112.00
	SGB 1% 11/12/26	4,940,000.00	5,065,278.40
	SGB 2.25% 06/01/32	2,390,000.00	2,787,863.30
	SGB 2.5% 05/12/25	4,630,000.00	4,955,998.30

	SGB 3.5% 03/30/39	2,610,000.00	3,771,293.40	
スウェーデンクローナ 小計		31,520,000.00	33,674,186.10	(412,172,037)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	1,800,000.00	1,670,724.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	3,280,000.00	3,102,748.80	
	NGB 1.5% 02/19/26	3,110,000.00	3,058,187.40	
	NGB 1.75% 02/17/27	3,210,000.00	3,174,850.50	
	NGB 1.75% 03/13/25	3,120,000.00	3,107,582.40	
	NGB 1.75% 09/06/29	2,470,000.00	2,417,512.50	
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,506,962.90	
	NGB 2% 05/24/23	4,940,000.00	4,979,569.40	
	NGB 3% 03/14/24	3,510,000.00	3,600,136.80	
ノルウェークローネ 小計		27,950,000.00	27,618,274.70	(354,342,464)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	2,850,000.00	2,564,943.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	4,350,000.00	4,422,775.50	
	DGB 0.5% 11/15/29	6,090,000.00	6,175,503.60	
	DGB 0% 11/15/24	280,000.00	281,100.40	
	DGB 0% 11/15/31	3,170,000.00	3,025,701.60	
	DGB 1.5% 11/15/23	4,170,000.00	4,308,152.10	
	DGB 1.75% 11/15/25	3,540,000.00	3,768,400.80	
	DGB 4.5% 11/15/39	6,800,000.00	11,320,980.00	
デンマーククローネ 小計		31,250,000.00	35,867,557.00	(628,758,274)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,430,000.00	1,213,069.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	720,000.00	658,987.20	
	POLGB 0% 04/25/23	1,060,000.00	1,019,486.80	
	POLGB 1.25% 10/25/30	1,200,000.00	977,136.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	2,470,000.00	2,389,082.80	
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,880,000.00	1,839,429.60	
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,820,000.00	3,619,602.80	
	POLGB 2.5% 07/25/27	2,010,000.00	1,875,068.70	
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,890,000.00	1,778,849.10	
	POLGB 2.75% 10/25/29	3,410,000.00	3,154,625.10	
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,470,000.00	2,432,727.70	
	POLGB 4% 10/25/23	1,980,000.00	1,994,909.40	
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,008,432.00	
ポーランドズロチ 小計		25,240,000.00	23,961,406.20	(689,487,067)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,520,000.00	1,470,235.20	
	ACGB 0.25% 11/21/25	1,340,000.00	1,267,747.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	780,000.00	733,551.00	

	ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	1,042,575.60
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,124,204.90
	ACGB 1.75% 06/21/51	990,000.00	791,208.00
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,060,000.00	1,014,144.40
	ACGB 1% 11/21/31	1,810,000.00	1,624,348.30
	ACGB 1% 12/21/30	1,480,000.00	1,344,062.00
	ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	639,059.40
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,260,000.00	1,296,237.60
	ACGB 2.75% 04/21/24	620,000.00	640,739.00
	ACGB 2.75% 05/21/41	810,000.00	820,222.20
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	659,559.60
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,400,000.00	1,459,682.00
	ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	804,272.70
	ACGB 2.75% 11/21/29	940,000.00	983,785.20
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,250,000.00	1,312,975.00
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,180,000.00	1,272,901.40
	ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	711,321.00
	ACGB 3.75% 04/21/37	660,000.00	769,124.40
	ACGB 3% 03/21/47	730,000.00	762,280.60
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,317,828.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,040,000.00	1,276,121.60
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,080,000.00	1,230,886.80
	ACGB 5.5% 04/21/23	1,130,000.00	1,192,624.60
	オーストラリアドル 小計	27,290,000.00	27,561,697.70 (2,279,903,633)
シンガポ ールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	210,000.00	202,238.40
	SIGB 1.625% 07/01/31	90,000.00	87,283.80
	SIGB 1.75% 02/01/23	520,000.00	524,165.20
	SIGB 1.875% 03/01/50	390,000.00	365,749.80
	SIGB 1.875% 10/01/51	150,000.00	141,541.50
	SIGB 2.125% 06/01/26	550,000.00	560,730.50
	SIGB 2.25% 08/01/36	440,000.00	445,231.60
	SIGB 2.375% 06/01/25	500,000.00	514,735.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	237,580.80
	SIGB 2.625% 05/01/28	190,000.00	198,312.50
	SIGB 2.75% 03/01/46	460,000.00	509,417.80
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	329,769.00
	SIGB 2.75% 07/01/23	540,000.00	552,349.80
	SIGB 2.875% 07/01/29	560,000.00	595,862.40
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	491,997.60
	SIGB 2% 02/01/24	270,000.00	274,106.70
	SIGB 3.375% 09/01/33	420,000.00	475,263.60
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	573,878.70

	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	530,573.40
シンガポールドル 小計		7,320,000.00	7,610,788.10 (651,102,921)
マレーシア リンギット	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,320,826.00
	MGS 3.502% 05/31/27	770,000.00	773,857.70
	MGS 3.733% 06/15/28	560,000.00	565,471.20
	MGS 3.757% 05/22/40	150,000.00	141,864.00
	MGS 3.8% 08/17/23	550,000.00	561,973.50
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	246,072.50
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	856,104.20
	MGS 3.882% 03/14/25	690,000.00	708,712.80
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,917,537.30
	MGS 3.892% 03/15/27	780,000.00	797,550.00
	MGS 3.899% 11/16/27	1,960,000.00	2,009,117.60
	MGS 3.9% 11/30/26	1,140,000.00	1,171,008.00
	MGS 3.906% 07/15/26	750,000.00	769,822.50
	MGS 3.955% 09/15/25	1,030,000.00	1,062,475.90
	MGS 4.059% 09/30/24	1,060,000.00	1,092,669.20
	MGS 4.065% 06/15/50	470,000.00	445,372.00
	MGS 4.181% 07/15/24	1,180,000.00	1,217,653.80
	MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	882,631.50
	MGS 4.254% 05/31/35	1,270,000.00	1,299,489.40
	MGS 4.392% 04/15/26	1,160,000.00	1,213,545.60
	MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,329,111.00
	MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,234,460.40
	MGS 4.736% 03/15/46	640,000.00	666,630.40
MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,259,226.40	
MGS 4.893% 06/08/38	1,360,000.00	1,471,275.20	
MGS 4.921% 07/06/48	1,450,000.00	1,544,351.50	
MGS 4.935% 09/30/43	530,000.00	571,520.20	
マレーシアリンギット 小計		26,230,000.00	27,130,329.80 (745,318,994)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	1,700,000.00	1,693,375.78
	ILGOV 0.5% 02/27/26	490,000.00	483,946.49
	ILGOV 0.5% 04/30/25	660,000.00	654,245.79
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,070,000.00	975,378.29
	ILGOV 1.5% 11/30/23	820,000.00	837,005.98
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,040,000.00	1,082,647.80
	ILGOV 1% 03/31/30	1,480,000.00	1,426,410.81
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,100,000.00	1,169,380.63
	ILGOV 2% 03/31/27	1,240,000.00	1,297,575.92
	ILGOV 3.75% 03/31/24	2,000,000.00	2,133,208.20

	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,520,000.00	1,828,566.22	
	ILGOV 4.25% 03/31/23	490,000.00	511,719.10	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,130,000.00	1,697,695.72	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,550,000.00	1,924,093.58	
	イスラエルシェケル 小計	16,290,000.00	17,715,250.31 (635,963,313)	
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	7,460,000.00	7,366,750.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	1,760,000.00	1,768,888.00	
	CGB 2.56% 10/21/23	14,620,000.00	14,708,889.60	
	CGB 2.68% 05/21/30	4,740,000.00	4,668,947.40	
	CGB 2.69% 08/12/26	4,370,000.00	4,403,780.10	
	CGB 2.84% 04/08/24	6,020,000.00	6,095,551.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	6,010,000.00	6,080,918.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	2,620,000.00	2,639,676.20	
	CGB 2.91% 10/14/28	5,040,000.00	5,085,612.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	510,000.00	518,369.10	
	CGB 3.02% 05/27/31	1,450,000.00	1,469,749.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	7,210,000.00	7,358,021.30	
	CGB 3.27% 11/19/30	2,030,000.00	2,102,308.60	
	CGB 3.28% 12/03/27	540,000.00	559,499.40	
	CGB 3.39% 03/16/50	2,760,000.00	2,750,643.60	
	CGB 3.53% 10/18/51	1,390,000.00	1,436,995.90	
	CGB 3.72% 04/12/51	1,150,000.00	1,218,137.50	
	CGB 3.81% 09/14/50	460,000.00	493,580.00	
	CGB 3.86% 07/22/49	380,000.00	411,072.60	
CGB 4.08% 10/22/48	2,030,000.00	2,273,092.50		
	香港・オフショア人民元 小計	72,550,000.00	73,410,481.80 (1,335,872,560)	
	合計		145,640,296,010 (145,640,296,010)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 194銘柄	100.0%	47.9%
カナダドル	国債証券 34銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 338銘柄	100.0%	38.2%

イギリスポンド	国債証券	54銘柄	100.0%	5.9%
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	13銘柄	100.0%	0.5%
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	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	27銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.4%
香港・オフショア人民元	国債証券	20銘柄	100.0%	0.9%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

【DCバランスファンド30】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期中間計算期間(2022年2月22日から2022年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 (2022年 2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2022年 8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	107,067,401	109,133,573
親投資信託受益証券	24,590,802,639	27,288,024,484
未収入金	34,023,669	36,552,040
流動資産合計	24,731,893,709	27,433,710,097
資産合計	24,731,893,709	27,433,710,097
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,989,427	9,630,581
未払受託者報酬	5,511,264	5,575,338
未払委託者報酬	23,422,802	23,695,119
未払利息	126	135
その他未払費用	688,846	696,852
流動負債合計	42,612,465	39,598,025
負債合計	42,612,465	39,598,025
純資産の部		
元本等		
元本	15,901,033,161	17,184,918,623
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	8,788,248,083	10,209,193,449
(分配準備積立金)	3,737,419,952	3,618,020,885
元本等合計	24,689,281,244	27,394,112,072
純資産合計	24,689,281,244	27,394,112,072
負債純資産合計	24,731,893,709	27,433,710,097

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期中間計算期間 自 2021年 2月23日 至 2021年 8月22日	第17期中間計算期間 自 2022年 2月22日 至 2022年 8月21日
営業収益		
受取利息	109	302
有価証券売買等損益	526,627,771	737,685,169
営業収益合計	526,627,880	737,685,471
営業費用		
支払利息	25,460	12,954
受託者報酬	5,165,511	5,575,338
委託者報酬	21,953,375	23,695,119
その他費用	645,629	696,852
営業費用合計	27,789,975	29,980,263
営業利益又は営業損失（ ）	498,837,905	707,705,208
経常利益又は経常損失（ ）	498,837,905	707,705,208
中間純利益又は中間純損失（ ）	498,837,905	707,705,208
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	13,170,477	2,728,271
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,853,290,502	8,788,248,083
剰余金増加額又は欠損金減少額	622,419,594	1,009,991,996
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	622,419,594	1,009,991,996
剰余金減少額又は欠損金増加額	248,046,804	294,023,567
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	248,046,804	294,023,567
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,713,330,720	10,209,193,449

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2022年 2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2022年 8月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	15,901,033,161口	17,184,918,623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) 1.5527円 (15,527円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5941円 (15,941円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第17期中間計算期間 (2022年 8月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
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。

（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16期	第17期中間計算期間
	自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日	自 2022年 2月22日 至 2022年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,863,838,450円	15,901,033,161円
期中追加設定元本額	2,000,986,753円	1,817,486,070円
期中一部解約元本額	963,792,042円	533,600,608円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

【DCバランスファンド50】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期中間計算期間(2022年2月22日から2022年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 (2022年 2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2022年 8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	104,022,579	113,972,268
親投資信託受益証券	25,745,695,813	28,774,009,491
未収入金	36,534,439	41,043,231
流動資産合計	25,886,252,831	28,929,024,990
資産合計	25,886,252,831	28,929,024,990
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,213,769	13,707,571
未払受託者報酬	5,804,985	5,850,060
未払委託者報酬	26,122,405	26,325,192
未払利息	122	141
その他未払費用	725,560	731,191
流動負債合計	36,866,841	46,614,155
負債合計	36,866,841	46,614,155
純資産の部		
元本等		
元本	14,511,741,058	15,487,503,963
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	11,337,644,932	13,394,906,872
(分配準備積立金)	6,210,096,248	5,984,493,218
元本等合計	25,849,385,990	28,882,410,835
純資産合計	25,849,385,990	28,882,410,835
負債純資産合計	25,886,252,831	28,929,024,990

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期中間計算期間 自 2021年 2月23日 至 2021年 8月22日	第17期中間計算期間 自 2022年 2月22日 至 2022年 8月21日
営業収益		
受取利息	102	335
有価証券売買等損益	828,513,484	1,311,827,525
営業収益合計	828,513,586	1,311,827,860
営業費用		
支払利息	25,845	13,817
受託者報酬	5,401,808	5,850,060
委託者報酬	24,308,104	26,325,192
その他費用	675,166	731,191
営業費用合計	30,410,923	32,920,260
営業利益又は営業損失（ ）	798,102,663	1,278,907,600
経常利益又は経常損失（ ）	798,102,663	1,278,907,600
中間純利益又は中間純損失（ ）	798,102,663	1,278,907,600
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	20,272,046	9,518,462
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,900,018,430	11,337,644,932
剰余金増加額又は欠損金減少額	654,163,465	1,217,226,543
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	654,163,465	1,217,226,543
剰余金減少額又は欠損金増加額	321,976,442	429,353,741
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	321,976,442	429,353,741
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	11,010,036,070	13,394,906,872

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2022年 2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2022年 8月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,511,741,058口	15,487,503,963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) 1.7813円 (17,813円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8649円 (18,649円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第17期中間計算期間 (2022年 8月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
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。

（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16期	第17期中間計算期間
	自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日	自 2022年 2月22日 至 2022年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	13,793,194,595円	14,511,741,058円
期中追加設定元本額	1,696,091,500円	1,526,596,913円
期中一部解約元本額	977,545,037円	550,834,008円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

【DCバランスファンド70】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期中間計算期間(2022年2月22日から2022年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 (2022年 2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2022年 8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,755,933	59,378,707
親投資信託受益証券	11,409,032,905	13,224,575,001
未収入金	16,846,615	29,639,671
流動資産合計	11,479,635,453	13,313,593,379
資産合計	11,479,635,453	13,313,593,379
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,455,978	19,935,150
未払受託者報酬	2,553,207	2,625,973
未払委託者報酬	12,127,656	12,473,262
未払利息	63	73
その他未払費用	319,085	328,184
流動負債合計	24,455,989	35,362,642
負債合計	24,455,989	35,362,642
純資産の部		
元本等		
元本	5,851,493,877	6,369,208,393
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	5,603,685,587	6,909,022,344
(分配準備積立金)	2,975,107,003	2,823,718,520
元本等合計	11,455,179,464	13,278,230,737
純資産合計	11,455,179,464	13,278,230,737
負債純資産合計	11,479,635,453	13,313,593,379

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期中間計算期間 自 2021年 2月23日 至 2021年 8月22日	第17期中間計算期間 自 2022年 2月22日 至 2022年 8月21日
営業収益		
受取利息	47	169
有価証券売買等損益	447,036,548	807,915,921
営業収益合計	447,036,595	807,916,090
営業費用		
支払利息	12,009	6,298
受託者報酬	2,324,110	2,625,973
委託者報酬	11,039,478	12,473,262
その他費用	290,448	328,184
営業費用合計	13,666,045	15,433,717
営業利益又は営業損失（ ）	433,370,550	792,482,373
経常利益又は経常損失（ ）	433,370,550	792,482,373
中間純利益又は中間純損失（ ）	433,370,550	792,482,373
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	16,032,424	8,177,541
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,641,301,914	5,603,685,587
剰余金増加額又は欠損金減少額	453,259,295	822,724,665
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	453,259,295	822,724,665
剰余金減少額又は欠損金増加額	234,553,634	301,692,740
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	234,553,634	301,692,740
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,277,345,701	6,909,022,344

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2022年 2月21日現在)	第17期中間計算期間 (2022年 8月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,851,493,877口	6,369,208,393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) 1.9577円 (19,577円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0848円 (20,848円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第17期中間計算期間 (2022年 8月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
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。

（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16期	第17期中間計算期間
	自 2021年 2月23日 至 2022年 2月21日	自 2022年 2月22日 至 2022年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,431,547,507円	5,851,493,877円
期中追加設定元本額	999,992,239円	833,252,386円
期中一部解約元本額	580,045,869円	315,537,870円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

項目	2022年 8月21日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,232,111,658
株式	306,778,114,840
派生商品評価勘定	42,798,600
未収入金	888,902,296
未収配当金	421,261,984
差入委託証拠金	88,421,600
流動資産合計	309,451,610,978
資産合計	309,451,610,978
負債の部	
流動負債	

	2022年 8月21日現在
項目	金額（円）
前受金	42,804,100
未払解約金	569,697,500
未払利息	509
流動負債合計	612,502,109
負債合計	612,502,109
純資産の部	
元本等	
元本	135,005,348,584
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	173,833,760,285
元本等合計	308,839,108,869
純資産合計	308,839,108,869
負債純資産合計	309,451,610,978

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

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,005,348,584口

		2022年 8月21日現在	
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)	2.2876円 (22,876円)	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

		2022年 8月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。		
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。		

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 2月22日
期首元本額	134,184,060,378円

区分	2022年 8月21日現在
期中追加設定元本額	5,331,299,634円
期中一部解約元本額	4,510,011,428円
期末元本額	135,005,348,584円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	611,021,319円
D C日本株式インデックスファンド	288,272,502円
D C日本株式インデックスファンドL	53,731,351,537円
D C日本株式インデックスファンドA	659,179,974円
D Cバランスファンド3 0	2,436,464,958円
D Cバランスファンド5 0	3,822,671,703円
D Cバランスファンド7 0	2,321,652,832円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	577,127,112円
日本株式インデックスe	1,452,760,561円
インデックスコレクション(国内株式)	21,315,541,668円
インデックスコレクション(バランス株式3 0)	12,420,763,910円
インデックスコレクション(バランス株式5 0)	2,993,788,174円
インデックスコレクション(バランス株式7 0)	2,732,494,745円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	7,502,506,689円
日本株式パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	2,746,666,101円
日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	927,870,185円
バランスVA3 0(適格機関投資家専用)	47,354,650円
バランスVA5 0(適格機関投資家専用)	516,140,634円
VAバランスファンド(株2 5 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	64,915,130円
VAバランスファンド(株5 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	130,480,178円
VAバランスファンド(株6 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	78,235,133円
バランスVA2 5(適格機関投資家専用)	656,174,219円
バランスVA3 7 . 5(適格機関投資家専用)	410,327,452円
バランスVA5 0 L(適格機関投資家専用)	7,163,310,347円
バランスVA7 5(適格機関投資家専用)	690,857,507円
VAバランスファンド(株4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	66,863,611円
VAポートフォリオ4 0(適格機関投資家専用)	1,171,039,154円
VAポートフォリオ2 0(適格機関投資家専用)	24,807,347円
バランスVA4 0(適格機関投資家専用)	142,357,797円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,890,034,121円
VAバランスファンド2(株4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	51,275,627円
VAバランス5 0 - 5 0(適格機関投資家専用)	53,297,920円
VAファンド2 5(適格機関投資家専用)	20,199,156円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	565,941,963円
バランスVA2 5 L(適格機関投資家専用)	255,885,626円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	4,224,651,970円
世界バランスVA2 5(適格機関投資家専用)	81,002,114円
国内バランスVA3 0(適格機関投資家専用)	33,661,228円

区分	2022年 8月21日現在
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	8,081,091円
V Aバランス2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	116,013,137円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	2,307,502円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,952,695,900	-	1,995,500,000	42,804,100
合計		1,952,695,900	-	1,995,500,000	42,804,100

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	310,258,336
国債証券	326,197,501,910
地方債証券	20,269,363,186
特殊債証券	23,334,707,976
社債証券	17,468,247,000
未収入金	399,322,000
未収利息	865,677,624
前払費用	20,179,573
流動資産合計	388,865,257,605
資産合計	388,865,257,605
負債の部	
流動負債	
未払金	399,806,000
未払解約金	186,936,303
未払利息	128
流動負債合計	586,742,431
負債合計	586,742,431
純資産の部	
元本等	
元本	287,346,926,894

	2022年 8月21日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	100,931,588,280
元本等合計	388,278,515,174
純資産合計	388,278,515,174
負債純資産合計	388,865,257,605

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

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	287,346,926,894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 100,445,000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 1.3513円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,513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）

金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) 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。

(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21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 2月22日
期首元本額	282,142,697,582円
期中追加設定元本額	12,657,711,695円
期中一部解約元本額	7,453,482,383円
期末元本額	287,346,926,894円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	798,454,215円
D C 日本債券インデックスファンド	1,977,863,009円
D C 日本債券インデックスファンド L	44,276,266,640円
D C バランスファンド 3 0	11,888,869,726円
D C バランスファンド 5 0	8,262,451,729円
D C バランスファンド 7 0	2,328,982,038円
日本債券インデックス e	1,124,975,393円
インデックスコレクション(国内債券)	37,395,789,815円
インデックスコレクション(バランス株式 3 0)	60,883,348,891円

区分	2022年 8月21日現在
インデックスコレクション（バランス株式50）	6,504,603,466円
インデックスコレクション（バランス株式70）	2,758,462,629円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	50,934,377,959円
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	4,464,233,163円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	179,554,646円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	828,209,583円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	124,793,603円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	82,175,706円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	195,157,818円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	2,844,747,133円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	985,987,949円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,274,993,392円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	140,190,719円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	277,098,507円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,911,278,370円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	164,440,328円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	339,968,746円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,036,207,718円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	339,951,994円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	794,961,468円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	66,963,551円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	3,136,623,676円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,419,853,989円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	23,418,339,396円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	441,246,590円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	127,469,572円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	38,179,872円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	576,747,162円
私募日本債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	3,106,733円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	

	2022年 8月21日現在
項目	金額（円）
流動資産	
預金	11,689,546,884
コール・ローン	1,188,134,338
株式	337,674,429,898
投資信託受益証券	156,802,004
投資証券	8,336,916,258
派生商品評価勘定	1,652,949,130
未収入金	1,627,715
未収配当金	482,976,703
差入委託証拠金	3,731,684,739
流動資産合計	364,915,067,669
資産合計	364,915,067,669
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,201,979
前受金	1,646,212,041
未払解約金	224,219,945
未払利息	491
流動負債合計	1,871,634,456
負債合計	1,871,634,456
純資産の部	
元本等	
元本	74,701,782,174
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	288,341,651,039
元本等合計	363,043,433,213
純資産合計	363,043,433,213
負債純資産合計	364,915,067,669

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21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</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)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>

2022年 8月21日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <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。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2022年 8月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	74,701,782,174口

		2022年 8月21日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.8599円 (48,599円)	

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

		2022年 8月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。		
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。		

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 2月22日
期首元本額	72,835,310,492円

区分	2022年 8月21日現在
期中追加設定元本額	4,955,132,256円
期中一部解約元本額	3,088,660,574円
期末元本額	74,701,782,174円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,502,104,796円
D C外国株式インデックスファンド	4,929,154,849円
D C外国株式インデックスファンドL	26,679,015,180円
D Cバランスファンド30	624,926,965円
D Cバランスファンド50	1,270,073,530円
D Cバランスファンド70	851,151,287円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	281,061,554円
外国株式インデックスe	4,630,795,556円
インデックスコレクション（外国株式）	15,619,744,912円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,231,098,176円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,001,039,595円
インデックスコレクション（バランス株式70）	999,245,530円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,088,448,004円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,454,582,824円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	412,824,573円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	24,271,476円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	246,695,128円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	32,030,058円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	64,365,416円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	193,408,828円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	221,731,022円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	175,631,321円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	3,461,546,088円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	390,340,658円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	98,989,093円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	577,814,955円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	12,235,915円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	69,112,781円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	75,899,711円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	236,619,272円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	9,965,015円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	59,200,817円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	171,614,304円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	5,042,985円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

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	14,940,659,674	-	16,586,871,715	1,646,212,041
	合計	14,940,659,674	-	16,586,871,715	1,646,212,041

(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21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,001,481,948	-	1,007,013,004	5,531,056
	アメリカドル	786,918,438	-	793,534,924	6,616,486
	ユーロ	165,678,000	-	164,839,560	838,440
	イギリスポンド	48,885,510	-	48,638,520	246,990
	売建	230,324,144	-	230,320,090	4,054
	アメリカドル	179,470,224	-	179,467,590	2,634
	カナダドル	27,341,470	-	27,340,300	1,170
	オーストラリアドル	23,512,450	-	23,512,200	250
	合計	1,231,806,092	-	1,237,333,094	5,535,110

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	314,637,350
コール・ローン	2,198,570,741
国債証券	154,177,868,555
派生商品評価勘定	28,873,434
未収入金	250,284
未収利息	777,369,663
前払費用	35,756,894
差入委託証拠金	223,367,178
流動資産合計	157,756,694,099
資産合計	157,756,694,099
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,019,478
前受金	7,457,439
未払金	3,406,693
未払解約金	264,732,713
未払利息	908
流動負債合計	291,617,231
負債合計	291,617,231
純資産の部	
元本等	
元本	57,485,481,880
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	99,979,594,988
元本等合計	157,465,076,868
純資産合計	157,465,076,868
負債純資産合計	157,756,694,099

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21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2022年 8月21日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,485,481,880口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.7392円 (1万口当たり純資産額) (27,392円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p>

	2022年 8月21日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 2月22日
期首元本額	56,823,232,074円
期中追加設定元本額	3,397,465,980円
期中一部解約元本額	2,735,216,174円
期末元本額	57,485,481,880円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,975,589,284円
DC外国債券インデックスファンド	1,902,717,793円
DC外国債券インデックスファンドL	14,408,800,130円
DCバランスファンド30	953,510,160円
DCバランスファンド50	982,689,959円
DCバランスファンド70	229,957,074円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	474,981,590円
外国債券インデックスe	1,037,303,241円
インデックスコレクション（外国債券）	8,958,493,874円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,790,700,984円
インデックスコレクション（バランス株式50）	798,092,951円

区分	2022年 8月21日現在
インデックスコレクション（バランス株式70）	256,978,267円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,975,724,362円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,801,040,052円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	422,214,624円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	94,096,916円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	416,131,284円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	250,207,347円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	167,654,531円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	157,053,224円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,246,932,525円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	541,934,099円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,774,365,840円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	316,831,542円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	187,954,345円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,414,400,495円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	79,678,251円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	172,317,505円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	82,346,779円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	42,802,652円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	65,006,068円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	218,126,210円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	65,480,998円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,211,336,315円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	12,030,609円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	1,830,573,937	-	1,838,031,376	7,457,439
	合計	1,830,573,937	-	1,838,031,376	7,457,439

（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21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,876,217,817	-	1,881,614,334	5,396,517
	アメリカドル	1,060,358,802	-	1,069,274,400	8,915,598
	カナダドル	75,339,144	-	75,566,736	227,592
	ユーロ	637,860,300	-	634,632,306	3,227,994
	イギリスポンド	102,659,571	-	102,140,892	518,679
合計		1,876,217,817	-	1,881,614,334	5,396,517

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DCバランスファンド30】

【純資産額計算書】

(2022年 9月30日現在)

資産総額	26,701,343,010円
負債総額	15,119,628円
純資産総額（ - ）	26,686,223,382円
発行済口数	17,355,494,895口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5376円
（1万口当たり純資産額）	（15,376円）

【DCバランスファンド50】

【純資産額計算書】

(2022年 9月30日現在)

資産総額	27,746,115,171円
負債総額	19,749,835円
純資産総額（ - ）	27,726,365,336円
発行済口数	15,629,555,051口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7740円
（1万口当たり純資産額）	（17,740円）

【DCバランスファンド70】

【純資産額計算書】

(2022年 9月30日現在)

資産総額	12,590,925,270円
負債総額	18,435,138円
純資産総額（ - ）	12,572,490,132円
発行済口数	6,426,745,295口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9563円
（1万口当たり純資産額）	（19,563円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	289,184,048,088円
負債総額	232,541,912円
純資産総額（ - ）	288,951,506,176円
発行済口数	135,738,102,827口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1287円
（1万口当たり純資産額）	（21,287円）

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	386,929,390,146円
負債総額	3,342,565,807円
純資産総額（ - ）	383,586,824,339円
発行済口数	288,467,903,802口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3297円
（1万口当たり純資産額）	（13,297円）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	333,564,070,200円
負債総額	1,287,640,485円
純資産総額（ - ）	332,276,429,715円
発行済口数	75,482,534,463口
1口当たり純資産額（ / ）	4.4020円
（1万口当たり純資産額）	（44,020円）

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	156,019,409,375円
負債総額	405,203,744円
純資産総額（ - ）	155,614,205,631円
発行済口数	57,633,211,481口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7001円
（1万口当たり純資産額）	（27,001円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2022年11月21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

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、現時点で評価中であり、現時点で評価中であり、現時点で評価中であります。

（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)	
	金額	単位	金額	単位
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
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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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21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4月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド30の2021年2月23日から2022年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド30の2022年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年4月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド50の2021年2月23日から2022年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド50の2022年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年4月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド70の2021年2月23日から2022年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド70の2022年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド30の2022年2月22日から2022年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド30の2022年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年2月22日から2022年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド50の2022年2月22日から2022年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド50の2022年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年2月22日から2022年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド70の2022年2月22日から2022年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド70の2022年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年2月22日から2022年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。