

## 【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】	2024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】	北添 道生
【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】**

2024年11月22日から2025年 5月21日までとします。

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

れます。

( 8 ) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

( 9 ) 【払込期日】

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

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

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 12 ) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、原則として、営業日の午後3時半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所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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



る旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

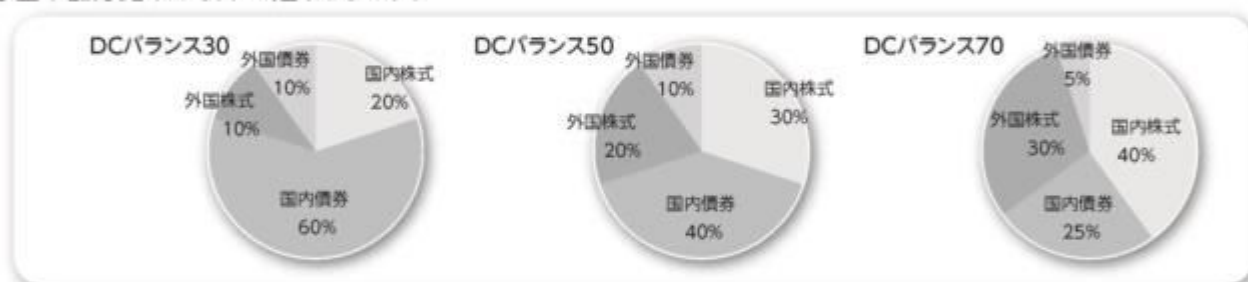
### <ファンドの特色>

## 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、円換算ベース)]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(配当込み、円換算ベース)に採用されている国の株式に投資を行い、同指数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指数です。

TOPIX(東証株価指数) (配当込み) (以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIX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、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIX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、配当込みTOPIX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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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、円換算ベース)」

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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

MSCIコクサイ・インデックス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MSCIコクサイ・インデックス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

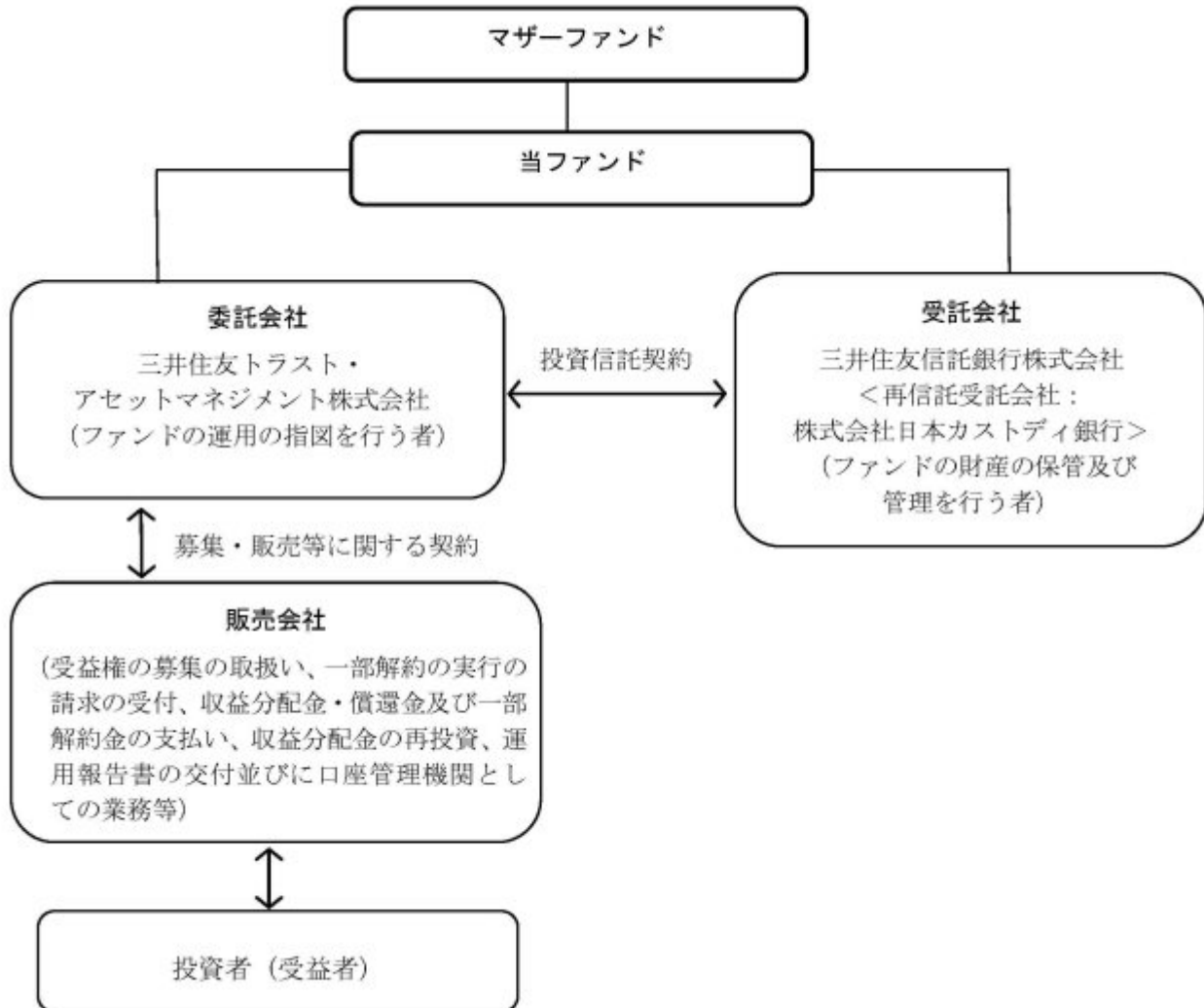
ファンドの名称を中央三井DCバランスファンド30からDCバランスファンド30、中央三井DCバランスファンド50からDCバランスファンド50、中央三井DCバランスファンド70からDCバランスファンド70に変更



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（2024年10月1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
三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 運用方針

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

#### 投資態度

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

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

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

### (2)【投資対象】

#### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

めるものをいいます。以下同じ。)

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

B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

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



益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所で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。

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

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同

様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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価格変動リスク回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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 - B P I 総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同

様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、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。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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（配当込み、円換算ベース）に採用されている国の株式に投資を行い、同指数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。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同

様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、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。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる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価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

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

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引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、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる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価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

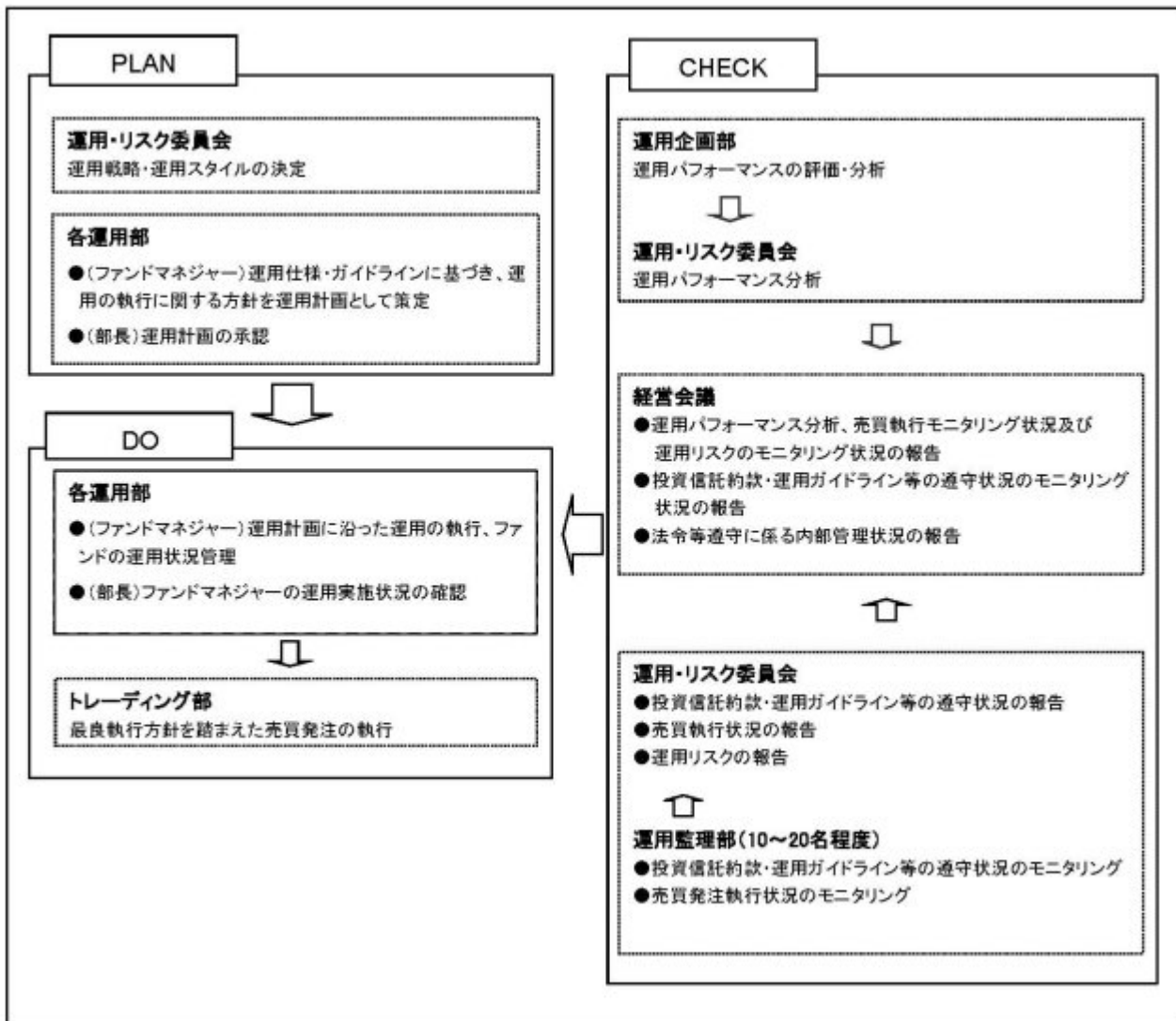
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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るものとします。
- 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。

##### 有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、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。

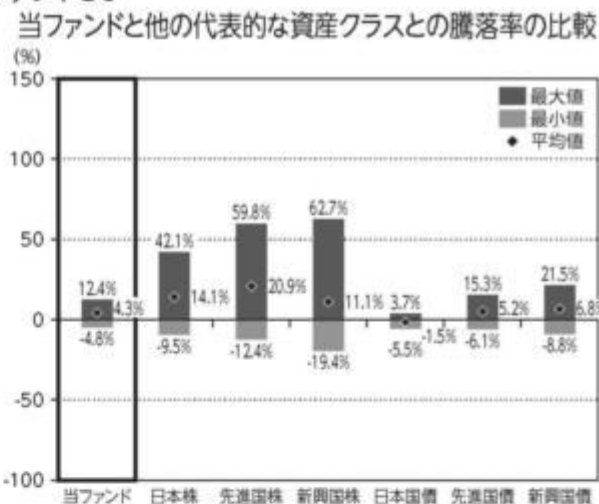
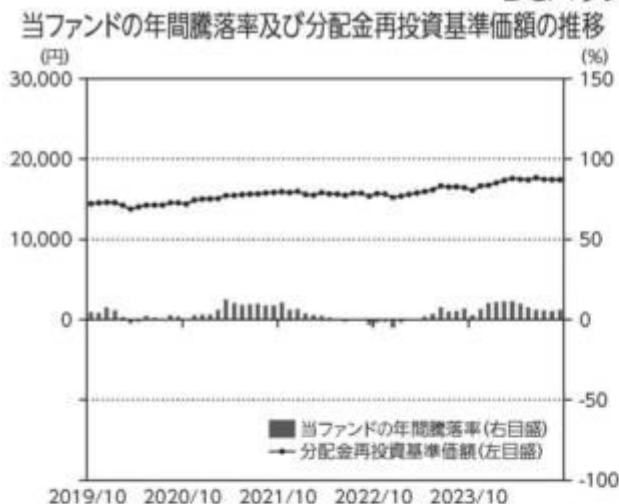
## （２）リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

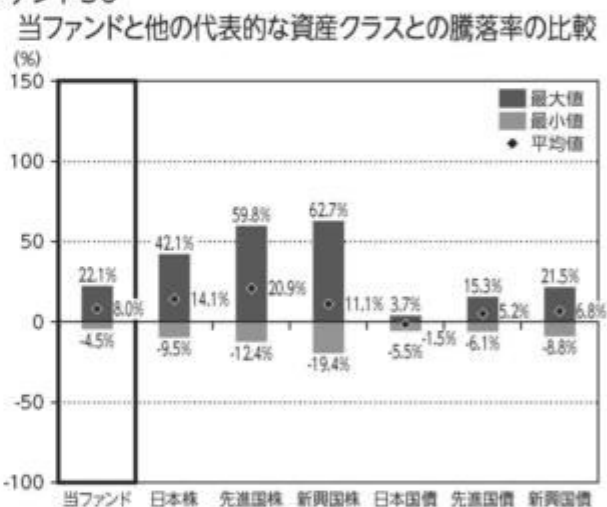
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 〔参考情報〕

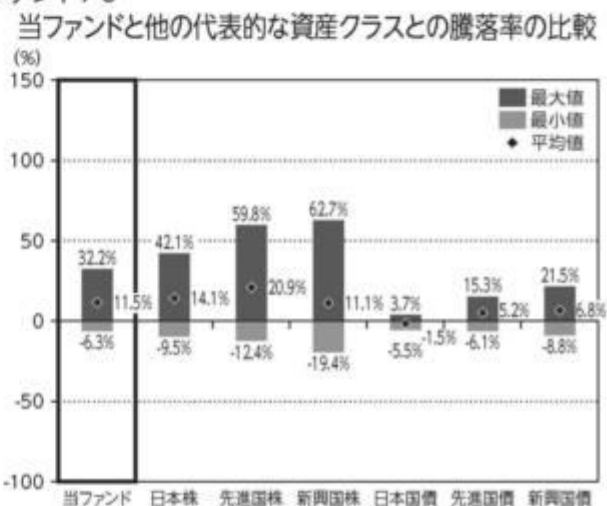
## DCバランスファンド30



## DCバランスファンド50



## DCバランスファンド70



## 【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。

- \*2019年10月～2024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総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケットベンチマークで、変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。
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 Eマージン・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Eマージン・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、野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング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フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社は、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、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としてあり、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、遅延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グローバルディバースファイド(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い、投資信託財産に繰り入れられます。

### （３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．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

（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。

ロ．有価証券の貸付の指図を行った場合は、ファンドの品貸料及びマザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率（ ）を乗じて得た額

2024年11月21日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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、2024年 9月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

#### （参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
DCバランスファンド30	0.24%	0.23%	0.01%
DCバランスファンド50	0.25%	0.24%	0.01%
DCバランスファンド70	0.26%	0.25%	0.01%

※対象期間は2023年2月22日～2024年2月21日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

#### 5【運用状況】

以下は、2024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	30,344,237,194	99.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		140,864,636	0.46



合計(純資産総額)	30,485,101,830	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	14,012,133,881	1.3036	18,266,267,466	1.2896	18,070,047,852	59.28
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,928,738,468	3.1031	5,985,068,341	3.2218	6,214,009,596	20.38
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	444,607,858	6.3707	2,832,463,281	6.9856	3,105,852,652	10.19
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	968,028,800	3.0134	2,917,057,986	3.0519	2,954,327,094	9.69

(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	99.54
合計	99.54

(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
第17期計算期間末 (2023年 2月21日)	27,150,159,121	27,150,159,121	15,540	15,540
第18期計算期間末 (2024年 2月21日)	30,252,420,386	30,252,420,386	17,250	17,250
2023年 9月末日	28,864,702,402		16,430	

10月末日	28,371,149,967		16,115
11月末日	29,391,817,124		16,672
12月末日	29,512,158,627		16,735
2024年 1月末日	30,053,408,916		17,052
2月末日	30,518,706,429		17,354
3月末日	30,732,174,753		17,591
4月末日	30,307,671,280		17,494
5月末日	30,326,851,657		17,419
6月末日	30,845,686,877		17,666
7月末日	30,500,015,479		17,466
8月末日	30,450,928,978		17,447
9月末日	30,485,101,830		17,443

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第17期計算期間	2022年 2月22日～2023年 2月21日	0
第18期計算期間	2023年 2月22日～2024年 2月21日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	2022年 2月22日～2023年 2月21日	0.1
第18期計算期間	2023年 2月22日～2024年 2月21日	11.0
第19期中間計算期間	2024年 2月22日～2024年 8月21日	0.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第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期計算期間	2022年 2月22日～2023年 2月21日	2,609,724,470	1,039,148,108	17,471,609,523
第18期計算期間	2023年 2月22日～2024年 2月21日	1,488,749,899	1,422,505,294	17,537,854,128
第19期中間計算期間	2024年 2月22日～2024年 8月21日	827,623,511	969,017,562	17,396,460,077

(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	35,618,896,523	99.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		158,486,173	0.44
合計(純資産総額)		35,777,382,696	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	10,814,502,926	1.3019	14,080,384,628	1.2896	13,946,382,973	38.98
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,392,548,511	3.1083	10,545,058,537	3.2218	10,930,112,792	30.55
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,049,324,644	6.3781	6,692,697,512	6.9856	7,330,162,233	20.49
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,118,070,227	3.0167	3,372,882,454	3.0519	3,412,238,525	9.54

(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	99.56
合計	99.56

(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
第17期計算期間末	(2023年 2月21日)	28,823,272,052	28,823,272,052	18,291	18,291
第18期計算期間末	(2024年 2月21日)	34,746,439,126	34,746,439,126	21,538	21,538
	2023年 9月末日	32,125,461,072		19,977	
	10月末日	31,456,255,257		19,529	
	11月末日	32,880,577,681		20,383	
	12月末日	33,093,232,916		20,475	
	2024年 1月末日	34,262,520,369		21,181	
	2月末日	35,189,549,575		21,751	
	3月末日	35,627,014,414		22,243	
	4月末日	35,417,520,690		22,182	
	5月末日	35,721,219,037		22,241	
	6月末日	36,545,391,382		22,704	
	7月末日	35,990,522,160		22,313	
	8月末日	35,786,183,244		22,140	
	9月末日	35,777,382,696		22,112	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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

第17期計算期間	2022年 2月22日～2023年 2月21日	0
第18期計算期間	2023年 2月22日～2024年 2月21日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	2022年 2月22日～2023年 2月21日	2.7
第18期計算期間	2023年 2月22日～2024年 2月21日	17.8
第19期中間計算期間	2024年 2月22日～2024年 8月21日	2.4

(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期計算期間	2022年 2月22日～2023年 2月21日	2,220,576,384	974,529,247	15,757,788,195
第18期計算期間	2023年 2月22日～2024年 2月21日	1,497,503,947	1,122,812,717	16,132,479,425
第19期中間計算期間	2024年 2月22日～2024年 8月21日	812,731,529	847,410,282	16,097,800,672

(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	18,958,590,681	99.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		88,869,029	0.47
合計(純資産総額)		19,047,459,710	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	日本株式マザーファンド	2,363,579,050	3.1010	7,329,567,526	3.2218	7,614,978,983	39.98
日本	親投資信託受 益証券	外国株式マザーファンド	818,718,207	6.3892	5,231,025,367	6.9856	5,719,237,906	30.03
日本	親投資信託受 益証券	日本債券マザーファンド	3,634,373,436	1.3003	4,725,997,594	1.2896	4,686,887,983	24.61
日本	親投資信託受 益証券	外国債券マザーファンド	307,181,038	3.0275	930,008,171	3.0519	937,485,809	4.92

(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	99.53
合計	99.53

(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
第17期計算期間末	(2023年 2月21日)	13,550,734,992	13,550,734,992	20,583	20,583
第18期計算期間末	(2024年 2月21日)	17,751,833,087	17,751,833,087	25,549	25,549
	2023年 9月末日	15,852,237,314		23,134	
	10月末日	15,499,285,741		22,522	
	11月末日	16,345,391,916		23,696	

12月末日	16,449,694,782		23,825
2024年 1月末日	17,317,538,728		24,995
2月末日	18,083,881,831		25,900
3月末日	18,532,127,855		26,703
4月末日	18,502,606,106		26,662
5月末日	18,962,087,371		26,875
6月末日	19,577,450,335		27,591
7月末日	19,193,972,501		26,994
8月末日	19,052,472,239		26,718
9月末日	19,047,459,710		26,660

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第17期計算期間	2022年 2月22日～2023年 2月21日	0
第18期計算期間	2023年 2月22日～2024年 2月21日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	2022年 2月22日～2023年 2月21日	5.1
第18期計算期間	2023年 2月22日～2024年 2月21日	24.1
第19期中間計算期間	2024年 2月22日～2024年 8月21日	3.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第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期計算期間	2022年 2月22日～2023年 2月21日	1,280,124,964	548,046,327	6,583,572,514
第18期計算期間	2023年 2月22日～2024年 2月21日	995,747,661	631,164,274	6,948,155,901
第19期中間計算期間	2024年 2月22日～2024年 8月21日	621,444,869	472,039,381	7,097,561,389

(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	411,880,061,440	98.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,913,731,037	1.65
合計(純資産総額)		418,793,792,477	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	6,301,050,000	1.50

(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	5,881,900	2,967.35	17,453,655,965	2,542.50	14,954,730,750	3.57
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	3,874,000	2,938.59	11,384,105,408	2,777.50	10,760,035,000	2.57
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,685,400	2,334.90	6,270,140,460	3,781.00	10,153,497,400	2.42
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,636,400	1,313.68	8,718,105,952	1,453.50	9,646,007,400	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	110,700	66,596.38	7,372,219,266	68,360.00	7,567,452,000	1.81
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	819,200	6,233.45	5,106,442,240	8,705.00	7,131,136,000	1.70



日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,272,500	2,477.50	5,630,118,750	3,045.00	6,919,762,500	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,247,900	2,612.71	5,873,110,809	2,952.50	6,636,924,750	1.58
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	786,900	6,651.62	5,234,159,778	7,678.00	6,041,818,200	1.44
日本	株式	信越化学工業	化学	993,900	5,880.04	5,844,171,756	5,977.00	5,940,540,300	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	234,200	28,647.23	6,709,181,266	25,290.00	5,922,918,000	1.41
日本	株式	三井物産	卸売業	1,753,700	2,985.21	5,235,162,777	3,178.00	5,573,258,600	1.33
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,064,000	3,892.18	4,141,279,520	5,231.00	5,565,784,000	1.33
日本	株式	任天堂	その他製品	698,600	8,087.50	5,649,927,500	7,636.00	5,334,509,600	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	33,008,900	189.02	6,239,342,278	146.80	4,845,706,520	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	547,400	6,780.95	3,711,892,030	8,427.00	4,612,939,800	1.10
日本	株式	第一三共	医薬品	966,700	4,447.03	4,298,943,901	4,709.00	4,552,190,300	1.09
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,470,900	2,597.13	3,820,118,517	2,936.00	4,318,562,400	1.03
日本	株式	HOYA	精密機器	217,800	18,605.47	4,052,271,366	19,785.00	4,309,173,000	1.03
日本	株式	三菱重工業	機械	1,954,300	983.64	1,922,327,652	2,117.50	4,138,230,250	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	982,100	4,360.78	4,282,722,038	4,103.00	4,029,556,300	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,621,600	1,604.36	4,205,990,176	1,507.50	3,952,062,000	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	816,200	5,034.07	4,108,807,934	4,594.00	3,749,622,800	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	17,729,000	198.25	3,514,880,624	187.20	3,318,868,800	0.79
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	65,800	39,954.66	2,629,016,628	47,420.00	3,120,236,000	0.75
日本	株式	富士通	電気機器	1,028,300	2,072.29	2,130,935,807	2,935.50	3,018,574,650	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,224,100	2,208.73	2,703,706,393	2,303.50	2,819,714,350	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	988,400	3,043.78	3,008,472,152	2,806.50	2,773,944,600	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	662,000	3,806.51	2,519,909,620	4,179.00	2,766,498,000	0.66
日本	株式	ダイキン工業	機械	133,400	24,318.16	3,244,042,544	20,075.00	2,678,005,000	0.64

(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	0.08
		鉱業	0.27
		建設業	2.19
		食料品	3.22
		繊維製品	0.39
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.71
		医薬品	4.57
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.85
		非鉄金属	0.79

金属製品	0.50
機械	5.45
電気機器	17.39
輸送用機器	7.10
精密機器	2.39
その他製品	2.47
電気・ガス業	1.35
陸運業	2.35
海運業	0.79
空運業	0.38
倉庫・運輸関連業	0.15
情報・通信業	7.43
卸売業	7.25
小売業	4.44
銀行業	7.29
証券、商品先物取引業	0.80
保険業	2.99
その他金融業	1.19
不動産業	1.92
サービス業	4.67
小計	98.35
合計	98.35

(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	東証株価指数先物	買建	238円		6,332,804,300	6,301,050,000	1.50

(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	350,198,033,330	84.79
地方債証券	日本	21,032,992,532	5.09
特殊債券	日本	21,820,996,692	5.28
	国際機関	198,870,000	0.05

	小計	22,019,866,692	5.33
社債券	日本	18,085,854,000	4.38
	フランス	896,901,000	0.22
	韓国	99,418,000	0.02
	小計	19,082,173,000	4.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		672,557,630	0.16
合計(純資産総額)		413,005,623,184	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368回利付国債(10年)	4,285,000,000	96.41	4,131,432,800	96.44	4,132,625,400	0.200	2032/9/20	1.00
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	3,975,000,000	98.13	3,900,809,500	97.56	3,878,328,000	0.100	2030/9/20	0.94
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	3,890,000,000	99.76	3,880,664,000	98.95	3,849,427,300	0.100	2028/3/20	0.93
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	3,820,000,000	99.98	3,819,432,800	99.39	3,796,850,800	0.100	2026/12/20	0.92
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	3,700,000,000	98.64	3,649,718,400	97.72	3,615,714,000	0.100	2030/6/20	0.88
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	3,630,000,000	100.07	3,632,673,600	99.46	3,610,470,600	0.100	2026/9/20	0.87
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	3,700,000,000	97.15	3,594,550,000	96.50	3,570,722,000	0.100	2031/12/20	0.86
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	3,600,000,000	98.45	3,544,436,000	98.28	3,538,152,000	0.600	2033/12/20	0.86
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	3,435,000,000	100.20	3,441,870,000	99.32	3,411,916,800	0.100	2027/3/20	0.83
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	3,475,000,000	97.59	3,391,572,300	96.99	3,370,402,500	0.100	2031/6/20	0.82
日本	国債証券	第374回利付国債(10年)	3,315,000,000	98.02	3,249,427,700	99.78	3,307,707,000	0.800	2034/3/20	0.80
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	3,225,000,000	99.94	3,223,269,800	99.27	3,201,651,000	0.005	2026/9/20	0.78
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	3,280,000,000	98.16	3,219,648,000	97.17	3,187,340,000	0.400	2033/6/20	0.77
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	3,250,000,000	98.86	3,213,093,300	98.06	3,186,950,000	0.100	2029/9/20	0.77
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	3,070,000,000	100.18	3,075,774,250	99.56	3,056,614,800	0.100	2026/6/20	0.74
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	3,050,000,000	100.53	3,066,244,500	100.02	3,050,732,000	0.300	2025/12/20	0.74
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	3,145,000,000	97.27	3,059,217,600	96.75	3,042,850,400	0.100	2031/9/20	0.74
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	3,040,000,000	100.20	3,046,188,400	99.67	3,029,998,400	0.100	2026/3/20	0.73
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	3,055,000,000	99.11	3,027,818,800	98.36	3,004,898,000	0.100	2029/3/20	0.73
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	3,070,000,000	97.89	3,005,311,500	97.19	2,983,733,000	0.100	2031/3/20	0.72
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	3,030,000,000	99.22	3,006,366,000	98.17	2,974,793,400	0.100	2029/6/20	0.72

日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	3,000,000,000	98.75	2,962,652,600	97.84	2,935,350,000	0.100	2030/3/20	0.71
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	3,010,000,000	98.13	2,953,910,400	97.38	2,931,168,100	0.100	2030/12/20	0.71
日本	国債証券	第372回利付国債（10年）	2,900,000,000	101.59	2,946,358,800	100.33	2,909,715,000	0.800	2033/9/20	0.70
日本	国債証券	第347回利付国債（10年）	2,925,000,000	100.06	2,926,826,300	99.24	2,902,945,500	0.100	2027/6/20	0.70
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	2,988,000,000	97.61	2,916,586,800	97.00	2,898,449,640	0.200	2032/3/20	0.70
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	2,920,000,000	99.41	2,902,895,500	98.69	2,881,806,400	0.100	2028/9/20	0.70
日本	国債証券	第147回利付国債（5年）	2,890,000,000	99.98	2,889,529,500	99.53	2,876,503,700	0.005	2026/3/20	0.70
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	2,910,000,000	99.51	2,895,741,000	98.56	2,868,096,000	0.500	2032/12/20	0.69
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	2,860,000,000	99.36	2,841,953,400	98.55	2,818,530,000	0.100	2028/12/20	0.68

(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	84.79
地方債証券	5.09
特殊債券	5.33
社債券	4.62
合計	99.84

(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	389,084,526,246	69.95
	イギリス	20,766,821,603	3.73
	カナダ	18,005,924,772	3.24
	スイス	16,327,806,558	2.94
	フランス	15,415,373,075	2.77
	ドイツ	13,059,812,313	2.35
	アイルランド	10,021,358,106	1.80
	オーストラリア	10,009,669,645	1.80
	オランダ	9,824,111,265	1.77
	デンマーク	4,902,636,690	0.88
	スウェーデン	4,899,776,164	0.88

	スペイン	3,954,319,187	0.71
	イタリア	3,149,048,361	0.57
	香港	2,247,733,153	0.40
	シンガポール	1,610,226,319	0.29
	フィンランド	1,488,936,082	0.27
	ベルギー	1,154,658,563	0.21
	イスラエル	1,107,744,841	0.20
	ジャージー	870,616,443	0.16
	ノルウェー	814,700,727	0.15
	ケイマン	775,357,684	0.14
	バミューダ	680,290,837	0.12
	キュラソー	498,070,842	0.09
	ニュージーランド	379,251,969	0.07
	リベリア	367,307,419	0.07
	オーストリア	281,655,415	0.05
	ルクセンブルク	250,138,446	0.04
	ポルトガル	246,430,803	0.04
	パナマ	152,260,519	0.03
	マン島	50,638,232	0.01
	小計	532,397,202,279	95.72
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	オーストラリア	36,337,481	0.01
	香港	34,188,407	0.01
	小計	70,525,888	0.01
投資証券	アメリカ	9,241,180,031	1.66
	オーストラリア	757,377,636	0.14
	フランス	205,544,537	0.04
	イギリス	173,648,837	0.03
	シンガポール	132,937,608	0.02
	香港	108,196,177	0.02
	カナダ	28,940,064	0.01
	ベルギー	28,098,677	0.01
	小計	10,675,923,567	1.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,087,779,832	2.35
合計(純資産総額)		556,231,431,566	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	9,877,692,094	1.78
	買建	カナダ	304,611,678	0.05

買建	ドイツ	1,694,427,822	0.30
買建	イギリス	704,029,603	0.13
買建	オーストラリア	407,508,075	0.07

(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		2,143,945,090	0.39
	売建		100,312,710	0.02

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	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	840,982	27,094.58	22,786,061,616	32,512.46	27,342,399,270	4.92
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	407,617	57,923.93	23,610,781,823	61,091.29	24,901,850,231	4.48
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,420,170	9,875.42	14,024,786,270	17,327.42	24,607,884,902	4.42
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	540,702	24,188.46	13,078,753,273	26,828.95	14,506,471,303	2.61
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	126,513	65,115.45	8,237,951,869	80,979.29	10,244,933,270	1.84
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	339,109	20,634.88	6,997,476,731	23,400.58	7,935,348,470	1.43
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	291,845	20,777.41	6,063,784,699	23,591.84	6,885,161,041	1.24
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	255,292	17,600.92	4,493,374,120	24,648.04	6,292,448,372	1.13
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	165,703	26,507.19	4,392,321,615	37,175.45	6,160,084,552	1.11
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	46,637	101,429.26	4,730,356,488	125,286.96	5,843,008,266	1.05
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	76,458	56,559.47	4,324,424,489	65,294.69	4,992,301,645	0.90
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	165,783	25,144.32	4,168,501,892	30,044.66	4,980,894,698	0.90
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	53,134	73,116.98	3,884,998,019	83,047.45	4,412,643,235	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	258,975	14,572.01	3,773,788,447	16,530.98	4,281,112,773	0.77

アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	90,877	39,500.79	3,589,713,980	39,275.01	3,569,195,456	0.64
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	47,929	65,767.01	3,152,147,147	70,457.23	3,376,944,922	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	136,261	22,730.39	3,097,266,348	24,770.79	3,375,292,821	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	57,246	50,878.33	2,912,581,164	57,024.91	3,264,448,393	0.59
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	25,594	102,051.48	2,611,905,776	126,404.54	3,235,197,863	0.58
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	138,939	22,588.25	3,138,389,404	23,036.62	3,200,685,224	0.58
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	186,690	17,445.56	3,256,911,672	17,029.16	3,179,175,747	0.57
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	255,397	8,131.73	2,076,819,740	11,386.99	2,908,205,486	0.52
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	101,944	24,739.42	2,522,035,607	27,802.37	2,834,285,490	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	23,068	132,862.31	3,064,867,915	120,736.33	2,785,145,868	0.50
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	24,876	79,653.97	1,981,472,287	100,960.06	2,511,482,589	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	236,265	8,600.95	2,032,103,490	10,246.58	2,420,909,807	0.44
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	146,220	18,089.17	2,644,998,511	16,226.97	2,372,708,094	0.43
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	95,561	16,519.13	1,578,584,835	24,084.26	2,301,515,989	0.41
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	406,600	4,728.42	1,922,579,413	5,623.56	2,286,540,309	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	55,941	40,680.78	2,275,723,925	39,484.82	2,208,820,718	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.97
		素材	3.67
		資本財	7.05
		商業・専門サービス	1.55
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.70
		耐久消費財・アパレル	1.31

	消費者サービス	1.89
	メディア・娯楽	6.19
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.75
	生活必需品流通・小売り	1.74
	食品・飲料・タバコ	3.08
	家庭用品・パーソナル用品	1.59
	ヘルスケア機器・サービス	4.01
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.61
	銀行	5.44
	金融サービス	6.64
	保険	3.07
	エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.04
	ソフトウェア・サービス	9.53
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.40
	電気通信サービス	1.17
	公益事業	2.72
	半導体・半導体製造装置	8.76
	不動産管理・開発	0.29
	小計	95.72
新株予約権証券		
投資信託受益証券		0.01
投資証券		1.92
合計		97.65

(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	239	アメリカドル	68,261,569.4	9,742,973,800	69,205,437.5	9,877,692,094	1.78
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	10	カナダドル	2,864,573	302,412,972	2,885,400	304,611,678	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	24	スイスフラン	2,899,778	492,121,324	2,945,520	499,884,199	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	147	ユーロ	7,218,487.9	1,150,843,525	7,492,590	1,194,543,623	0.21
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	20	オーストラリアドル	4,102,540	405,043,774	4,127,500	407,508,075	0.07
	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	44	イギリスポンド	3,685,875	704,112,701	3,685,440	704,029,603	0.13



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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	11,497,600.00	1,658,248,059	1,639,310,820	0.29
	カナダドル	買建	500,000.00	53,927,000	52,778,850	0.01
	ユーロ	買建	1,700,000.00	270,567,780	270,722,650	0.05
	イギリスポンド	買建	600,000.00	114,481,530	114,486,810	0.02
	スイスフラン	買建	200,000.00	34,334,400	33,941,000	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	800,000.00	11,477,600	11,326,960	0.00
	デンマーククローネ	買建	1,000,000.00	21,789,000	21,378,000	0.00
	アメリカドル	売建	500,000.00	71,330,000	71,344,650	0.01
	イギリスポンド	売建	100,000.00	19,093,700	19,097,530	0.00
	オーストラリアドル	売建	100,000.00	9,869,300	9,870,530	0.00

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

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

## 外国債券マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	82,799,826,467	44.92
	中国	19,575,917,577	10.62
	フランス	13,690,813,812	7.43
	イタリア	12,491,809,244	6.78
	ドイツ	10,836,290,513	5.88
	イギリス	9,745,528,158	5.29
	スペイン	8,141,685,541	4.42
	カナダ	3,502,895,650	1.90
	ベルギー	2,880,847,159	1.56
	オランダ	2,427,437,660	1.32
	オーストラリア	2,395,814,938	1.30
	オーストリア	2,073,634,404	1.12
	メキシコ	1,319,852,686	0.72
	マレーシア	970,031,568	0.53
	ポーランド	954,725,477	0.52
	フィンランド	930,901,114	0.50
	アイルランド	874,113,878	0.47
	シンガポール	743,675,044	0.40
	イスラエル	551,731,677	0.30
	ニュージーランド	494,532,676	0.27

	デンマーク	478,133,885	0.26
	スウェーデン	290,573,063	0.16
	ノルウェー	281,407,586	0.15
	小計	178,452,179,777	96.81
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,887,075,097	3.19
合計（純資産総額）		184,339,254,874	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	1,570,007,716	0.85
	買建	ドイツ	1,395,403,103	0.76

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建		3,709,317,166	2.01

(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。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,110,000	11,723.37	1,419,700,579	12,268.92	1,485,766,912	1.375	2031/11/15	0.81
アメリカ	国債証券	T 0.375% 01/31/26	10,690,000	13,234.06	1,414,721,081	13,656.64	1,459,894,882	0.375	2026/1/31	0.79
アメリカ	国債証券	T 4.125% 03/31/29	9,000,000	14,387.85	1,294,906,775	14,638.18	1,317,436,931	4.125	2029/3/31	0.71
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	11,476.94	1,047,844,765	12,068.76	1,101,878,643	0.625	2030/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	7,460,000	13,701.24	1,022,112,782	14,061.97	1,049,023,066	3.125	2028/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	6,900,000	13,907.71	959,632,500	14,439.14	996,301,112	3.875	2033/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	6,900,000	13,351.38	921,245,770	13,762.57	949,617,535	2.625	2029/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	6,250,000	14,630.80	914,425,054	15,122.68	945,168,095	4.500	2033/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	6,850,000	13,147.04	900,572,913	13,582.20	930,381,320	1.125	2026/10/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	6,750,000	13,062.02	881,686,697	13,537.60	913,788,401	2.875	2032/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	11,570.05	856,183,746	12,159.92	899,834,588	0.625	2030/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	6,390,000	13,063.70	834,770,452	13,586.66	868,188,173	2.375	2029/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	5,800,000	14,225.05	825,052,996	14,568.49	844,972,746	4.625	2026/10/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	6,000,000	13,635.73	818,143,969	14,072.00	844,320,431	3.500	2033/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	5,690,000	14,305.33	813,973,685	14,731.01	838,194,939	4.125	2032/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.75% 04/15/26	5,800,000	14,100.99	817,857,954	14,293.62	829,030,476	3.750	2026/4/15	0.45

アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	6,000,000	13,384.00	803,040,235	13,802.71	828,162,947	2.750	2029/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/15/54	5,500,000	13,711.81	754,149,864	14,607.52	803,413,790	4.250	2054/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	11,690.20	765,708,120	12,230.73	801,113,101	1.250	2031/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	12,690.98	761,458,978	13,170.74	790,244,719	1.250	2028/5/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.375% 08/31/26	5,730,000	13,583.17	778,315,833	13,697.61	784,873,607	1.375	2026/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	6,200,000	12,130.37	752,083,395	12,647.77	784,161,963	1.875	2032/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	5,590,000	13,572.19	758,685,740	13,945.72	779,566,001	2.875	2028/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	13,737.76	755,576,938	14,030.19	771,660,545	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.75% 04/30/27	5,500,000	13,443.97	739,418,424	14,009.28	770,510,623	2.750	2027/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	11,620.50	715,823,289	12,184.45	750,562,658	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	5,500,000	13,145.09	722,980,414	13,579.97	746,898,839	1.250	2026/12/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	13,451.18	726,364,125	13,822.50	746,415,456	1.625	2026/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.375% 03/31/29	5,400,000	13,107.91	707,827,497	13,599.77	734,387,665	2.375	2029/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	5,550,000	12,688.19	704,194,831	13,169.35	730,899,002	1.500	2028/11/30	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	96.81
合計	96.81

(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

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	41	アメリカドル	4,507,450.71	643,348,439	4,520,250	645,175,282	0.35
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	26	アメリカドル	2,973,385.39	424,391,296	2,983,093.88	425,776,989	0.23
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	28	アメリカドル	3,484,765.9	497,380,637	3,496,500	499,055,445	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	14	ユーロ	1,497,524.4	238,750,314	1,499,890	239,127,462	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	20	ユーロ	2,391,362	381,254,844	2,399,400	382,536,342	0.21
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	36	ユーロ	4,830,815.6	770,176,931	4,853,160	773,739,299	0.42

(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	12,480,000.00	1,796,066,138	1,777,464,000	0.96

カナダドル	買建	1,300,000.00	138,282,807	137,000,500	0.07
ユーロ	買建	7,320,000.00	1,173,060,950	1,165,197,600	0.63
イギリスポンド	買建	1,090,000.00	208,379,823	207,775,800	0.11
オフショア人民元	買建	20,660,000.00	423,114,848	421,879,266	0.23

(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：2024年9月30日

**DCバランスファンド30****基準価額・純資産の推移**

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 17,443円

純資産総額 304.85億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

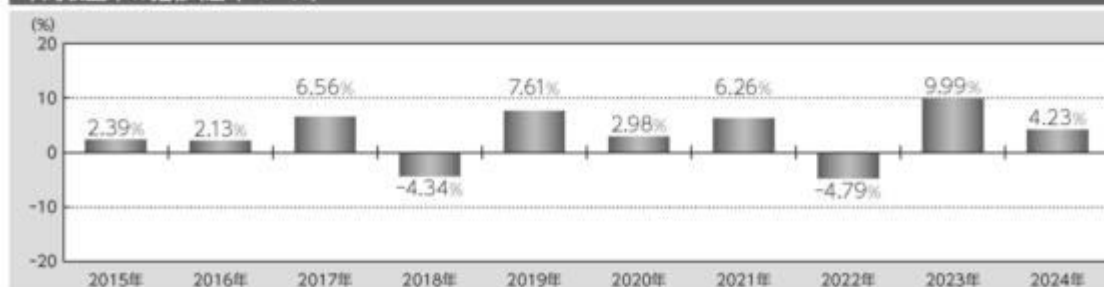
決算期	分配金
2020年2月	0円
2021年2月	0円
2022年2月	0円
2023年2月	0円
2024年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期間	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	59.3%	第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.6%
		第360回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2030/09/20	0.6%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.6%
日本株式 マザーファンド	20.4%	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%
		日立製作所	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
外国株式 マザーファンド	10.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェアおよび製品	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.5%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.5%
外国債券 マザーファンド	9.7%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 0.375% 01/31/26	アメリカ	国債	-	0.375%	2026/01/31	0.1%
		T 4.125% 03/31/29	アメリカ	国債	-	4.125%	2029/03/31	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)**

※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

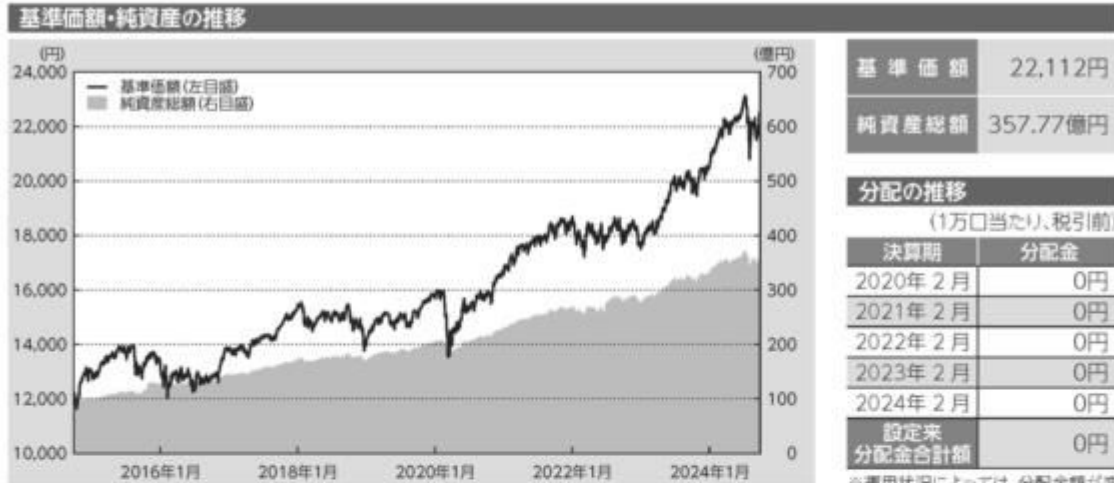
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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


**運用実績**

 当初設定日：2006年9月29日  
 作成基準日：2024年9月30日

**DCバランスファンド50**


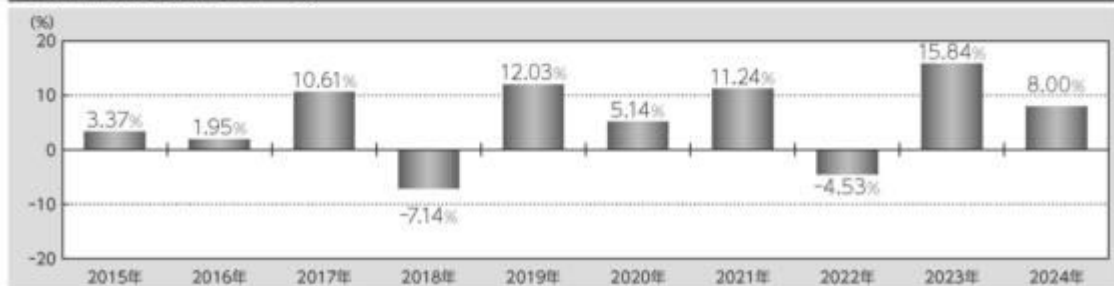
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

※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	実種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	39.0%	第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.4%
		第360回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2030/09/20	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	30.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
		日立製作所	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
外国株式 マザーファンド	20.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/消費財	-	-	1.0%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.9%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体/半導体製造装置	-	-	0.9%
外国債券 マザーファンド	9.5%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 0.375% 01/31/26	アメリカ	国債	-	0.375%	2026/01/31	0.1%
		T 4.125% 03/31/29	アメリカ	国債	-	4.125%	2029/03/31	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)**

 ※2024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：2024年9月30日

## DCバランスファンド70

## 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 26,660円

純資産総額 190.47億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年2月	0円
2021年2月	0円
2022年2月	0円
2023年2月	0円
2024年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

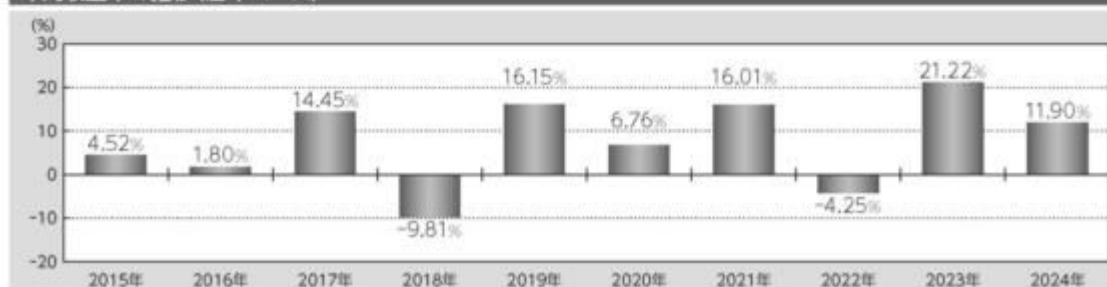
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式 マザーファンド	40.0%	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%
		日立製作所	日本	株式	電気機器	-	-	1.0%
外国株式 マザーファンド	30.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・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	-	-	1.3%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.3%
日本債券 マザーファンド	24.6%	第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.2%
		第360回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2030/09/20	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	4.9%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.0%
		T 0.375% 01/31/26	アメリカ	国債	-	0.375%	2026/01/31	0.0%
		T 4.125% 03/31/29	アメリカ	国債	-	4.125%	2029/03/31	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)

※2024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】

&lt; 申込手続 &gt;

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、営業日の午後3時半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受付分とします。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半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。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 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基づき、

#### < 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

#### < 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」の規定に基づき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。

#### < お問い合わせ先 >

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## < 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

### (1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

### (2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 反対者の買取請求権 >

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

## < 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知っ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依りて請求する権利を有します。

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

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）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、持分に依り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18期計算期間(2023年2月22日から2024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17期 (2023年 2月21日現在)	第18期 (2024年 2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	112,262,493	178,854,163
親投資信託受益証券	27,042,698,989	30,108,969,029
未収入金	62,105,900	18,925,880
流動資産合計	27,217,067,382	30,306,749,072
資産合計	27,217,067,382	30,306,749,072
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	34,723,583	19,471,862
未払受託者報酬	5,987,865	6,485,073
未払委託者報酬	25,448,359	27,561,519
未払利息	37	34
その他未払費用	748,417	810,198
流動負債合計	66,908,261	54,328,686
負債合計	66,908,261	54,328,686
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,471,609,523	17,537,854,128
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,678,549,598	12,714,566,258
(分配準備積立金)	3,813,344,225	6,139,729,162
元本等合計	27,150,159,121	30,252,420,386
純資産合計	27,150,159,121	30,252,420,386
負債純資産合計	27,217,067,382	30,306,749,072

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自	2022年 2月22日	自	2023年 2月22日
	至	2023年 2月21日	至	2024年 2月21日
<b>営業収益</b>				
受取利息		489		583
有価証券売買等損益		81,529,022		3,069,513,776
営業収益合計		81,529,511		3,069,514,359
<b>営業費用</b>				
支払利息		47,103		59,399
受託者報酬		11,563,203		12,651,264
委託者報酬		49,143,478		53,767,768
その他費用		1,445,269		1,580,916
営業費用合計		62,199,053		68,059,347
営業利益又は営業損失（ ）		19,330,458		3,001,455,012
経常利益又は経常損失（ ）		19,330,458		3,001,455,012
当期純利益又は当期純損失（ ）		19,330,458		3,001,455,012
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（ ）		3,140,834		120,152,600
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,788,248,083		9,678,549,598
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,446,832,326		944,406,545
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,446,832,326		944,406,545
剰余金減少額又は欠損金増加額		572,720,435		789,692,297
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		572,720,435		789,692,297
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,678,549,598		12,714,566,258

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第17期 (2023年 2月21日現在)	第18期 (2024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	17,471,609,523口	17,537,854,128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) 1.5540円 (15,540円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7250円 (17,250円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自 2022年 2月22日 至 2023年 2月21日			第18期 自 2023年 2月22日 至 2024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	298,121,440円	費用控除後の配当等収益額	A	388,717,282円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	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	2,232,609,306円
収益調整金額	C	6,997,151,410円	収益調整金額	C	7,337,250,802円
分配準備積立金額	D	3,515,222,785円	分配準備積立金額	D	3,518,402,574円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,810,495,635円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,476,979,964円
当ファンドの期末残存口数	F	17,471,609,523口	当ファンドの期末残存口数	F	17,537,854,128口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,187円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,684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18期 自 2023年 2月22日 至 2024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視部が、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18期 (2024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17期	第18期
	自 2022年 2月22日 至 2023年 2月21日	自 2023年 2月22日 至 2024年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	15,901,033,161円	17,471,609,523円
期中追加設定元本額	2,609,724,470円	1,488,749,899円
期中一部解約元本額	1,039,148,108円	1,422,505,294円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第17期	第18期
	(2023年 2月21日現在)	(2024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	102,877,016	2,735,915,985
合計	102,877,016	2,735,915,985

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,971,627,543	6,174,545,976	
	日本債券マザーファンド	13,650,470,265	17,826,149,119	
	外国株式マザーファンド	486,167,944	3,094,070,029	
	外国債券マザーファンド	1,001,030,821	3,014,203,905	
合計		17,109,296,573	30,108,969,029	

(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18期計算期間(2023年2月22日から2024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17期 (2023年 2月21日現在)	第18期 (2024年 2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	119,357,894	220,607,995
親投資信託受益証券	28,709,082,850	34,583,411,111
未収入金	73,631,904	7,161,223
流動資産合計	28,902,072,648	34,811,180,329
資産合計	28,902,072,648	34,811,180,329
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	43,388,166	23,906,201
未払受託者報酬	6,295,558	7,271,938
未払委託者報酬	28,329,946	32,723,648
未払利息	39	41
その他未払費用	786,887	839,375
流動負債合計	78,800,596	64,741,203
負債合計	78,800,596	64,741,203
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	15,757,788,195	16,132,479,425
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	13,065,483,857	18,613,959,701
(分配準備積立金)	6,536,302,258	11,125,593,934
元本等合計	28,823,272,052	34,746,439,126
純資産合計	28,823,272,052	34,746,439,126
負債純資産合計	28,902,072,648	34,811,180,329

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第17期		第18期	
	自 至	2022年 2月21日	自 至	2023年 2月21日
営業収益				
受取利息		535		610
有価証券売買等損益		800,197,921		5,281,238,937
営業収益合計		800,198,456		5,281,239,547
営業費用				
支払利息		49,654		65,350
受託者報酬		12,145,618		13,933,964
委託者報酬		54,655,138		62,702,734
その他費用		1,518,078		1,651,253
営業費用合計		68,368,488		78,353,301
営業利益又は営業損失（ ）		731,829,968		5,202,886,246
経常利益又は経常損失（ ）		731,829,968		5,202,886,246
当期純利益又は当期純損失（ ）		731,829,968		5,202,886,246
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（ ）		21,336,230		173,329,402
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,337,644,932		13,065,483,857
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,777,677,989		1,453,088,754
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,777,677,989		1,453,088,754
剰余金減少額又は欠損金増加額		760,332,802		934,169,754
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		760,332,802		934,169,754
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		13,065,483,857		18,613,959,701

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第17期 (2023年 2月21日現在)	第18期 (2024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	15,757,788,195口	16,132,479,425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) 1.8291円 (18,291円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1538円 (21,538円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自 2022年 2月22日 至 2023年 2月21日			第18期 自 2023年 2月22日 至 2024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	419,594,427円	費用控除後の配当等収益額	A	516,786,521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	290,899,311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	4,512,770,323円
収益調整金額	C	9,058,259,730円	収益調整金額	C	9,874,865,056円
分配準備積立金額	D	5,825,808,520円	分配準備積立金額	D	6,096,037,090円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,594,561,988円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,000,458,990円
当ファンドの期末残存口数	F	15,757,788,195口	当ファンドの期末残存口数	F	16,132,479,425口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,896円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	13,017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18期 自 2023年 2月22日 至 2024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視部が、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18期 (2024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17期	第18期
	自 2022年 2月22日 至 2023年 2月21日	自 2023年 2月22日 至 2024年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,511,741,058円	15,757,788,195円
期中追加設定元本額	2,220,576,384円	1,497,503,947円
期中一部解約元本額	974,529,247円	1,122,812,717円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第17期	第18期
	(2023年 2月21日現在)	(2024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	800,623,780	4,912,438,009
合計	800,623,780	4,912,438,009

## （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	3,373,661,148	10,565,294,617	
	日本債券マザーファンド	10,300,774,220	13,451,781,053	
	外国株式マザーファンド	1,119,848,898	7,126,942,356	
	外国債券マザーファンド	1,142,238,081	3,439,393,085	
合計		15,936,522,347	34,583,411,111	

(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18期計算期間(2023年2月22日から2024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17期 (2023年 2月21日現在)	第18期 (2024年 2月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	56,408,101	77,957,927
親投資信託受益証券	13,496,996,324	17,671,612,041
未収入金	23,520,532	35,000,000
流動資産合計	13,576,924,957	17,784,569,968
資産合計	13,576,924,957	17,784,569,968
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,147,947	11,504,837
未払受託者報酬	2,900,796	3,613,982
未払委託者報酬	13,778,666	17,166,358
未払利息	18	14
その他未払費用	362,538	451,690
流動負債合計	26,189,965	32,736,881
負債合計	26,189,965	32,736,881
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,583,572,514	6,948,155,901
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,967,162,478	10,803,677,186
(分配準備積立金)	3,336,463,004	6,278,837,422
元本等合計	13,550,734,992	17,751,833,087
純資産合計	13,550,734,992	17,751,833,087
負債純資産合計	13,576,924,957	17,784,569,968

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自 至	2022年 2月22日 2023年 2月21日	自 至	2023年 2月22日 2024年 2月21日
<b>営業収益</b>				
受取利息		262		292
有価証券売買等損益		666,474,186		3,417,090,622
<b>営業収益合計</b>		<b>666,474,448</b>		<b>3,417,090,914</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		22,795		28,305
受託者報酬		5,526,769		6,796,478
委託者報酬		26,251,928		32,283,137
その他費用		690,722		849,441
<b>営業費用合計</b>		<b>32,492,214</b>		<b>39,957,361</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>633,982,234</b>		<b>3,377,133,553</b>
経常利益又は経常損失（ ）		633,982,234		3,377,133,553
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>633,982,234</b>		<b>3,377,133,553</b>
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（ ）		22,128,526		140,415,378
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>5,603,685,587</b>		<b>6,967,162,478</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,276,629,972		1,273,093,560
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,276,629,972		1,273,093,560
剰余金減少額又は欠損金増加額		525,006,789		673,297,027
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		525,006,789		673,297,027
分配金		-		-
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>6,967,162,478</b>		<b>10,803,677,186</b>

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第17期 (2023年 2月21日現在)	第18期 (2024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	6,583,572,514口	6,948,155,901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) 2.0583円 (20,583円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5549円 (25,549円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自 2022年 2月22日 至 2023年 2月21日			第18期 自 2023年 2月22日 至 2024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	225,755,513円	費用控除後の配当等収益額	A	280,160,770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	386,098,195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	2,956,557,405円
収益調整金額	C	4,901,434,662円	収益調整金額	C	5,656,424,547円
分配準備積立金額	D	2,724,609,296円	分配準備積立金額	D	3,042,119,247円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,237,897,666円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,935,261,969円
当ファンドの期末残存口数	F	6,583,572,514口	当ファンドの期末残存口数	F	6,948,155,901口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	12,512円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	17,177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18期 自 2023年 2月22日 至 2024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視部が、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18期 (2024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17期	第18期
	自 2022年 2月22日 至 2023年 2月21日	自 2023年 2月22日 至 2024年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,851,493,877円	6,583,572,514円
期中追加設定元本額	1,280,124,964円	995,747,661円
期中一部解約元本額	548,046,327円	631,164,274円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第17期	第18期
	(2023年 2月21日現在)	(2024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	668,515,718	3,355,170,018
合計	668,515,718	3,355,170,018

## （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	2,330,704,646	7,299,067,739	
	日本債券マザーファンド	3,169,678,057	4,139,282,574	
	外国株式マザーファンド	865,591,406	5,508,796,826	
	外国債券マザーファンド	240,598,088	724,464,902	
合計		6,606,572,197	17,671,612,041	

(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

	2024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	2,948,268,072
株式	406,344,248,430
派生商品評価勘定	234,167,850
未収入金	5,877,800
未収配当金	587,123,563
差入委託証拠金	138,005,687
流動資産合計	410,257,691,402
資産合計	410,257,691,402
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	388,850
前受金	233,845,000
未払解約金	232,642,970
未払利息	560
流動負債合計	466,877,380
負債合計	466,877,380
純資産の部	
元本等	
元本	130,853,031,789
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	278,937,782,233
元本等合計	409,790,814,022
純資産合計	409,790,814,022
負債純資産合計	410,257,691,402

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024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）

	2024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	130,853,031,789口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.1317円 (1万口当たり純資産額) (31,317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

	2024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、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。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

	2024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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2024年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月22日
期首元本額	135,457,462,114円
期中追加設定元本額	8,729,771,349円
期中一部解約元本額	13,334,201,674円
期末元本額	130,853,031,789円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	576,567,828円
D C日本株式インデックスファンド	270,487,276円
D C日本株式インデックスファンドL	54,518,166,139円
D C日本株式インデックスファンドA	644,867,905円
D Cバランスファンド3 0	1,971,627,543円

区分	2024年 2月21日現在
DCバランスファンド50	3,373,661,148円
DCバランスファンド70	2,330,704,646円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	491,458,661円
日本株式インデックスe	1,347,149,121円
インデックスコレクション（国内株式）	23,815,001,211円
インデックスコレクション（バランス株式30）	10,611,511,640円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,383,136,652円
インデックスコレクション（バランス株式70）	3,480,187,247円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	8,006,512,608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）	2,646,545,443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）	598,961,275円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	22,048,056円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	324,289,169円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	42,953,168円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	103,544,958円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	28,288,814円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	402,360,229円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	283,458,240円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,162,061,062円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	542,227,938円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	38,879,327円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	826,647,388円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	14,559,142円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	103,834,259円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,347,585,336円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	33,360,091円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	37,985,167円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	11,359,221円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	366,649,762円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	172,552,809円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	2,762,006,067円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	57,705,703円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	20,015,888円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	5,991,649円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	73,462,016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）	2,659,987円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024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		12,753,773,430
合計		12,753,773,430

(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

（2024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	2,920,955,000	-	3,154,800,000	233,845,000
	合計	2,920,955,000	-	3,154,800,000	233,845,000

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,800	3,590.00	20,822,000	
ニッスイ	153,000	926.70	141,785,100	
マルハニチロ	22,700	2,882.50	65,432,750	
雪国まいたけ	13,000	955.00	12,415,000	
カネコ種苗	4,700	1,457.00	6,847,900	
サカタのタネ	17,400	3,655.00	63,597,000	
ホクト	12,300	1,844.00	22,681,200	
ホクリヨウ	1,100	1,024.00	1,126,400	
住石ホールディングス	15,100	2,083.00	31,453,300	
日鉄鉱業	6,100	5,170.00	31,537,000	
三井松島ホールディングス	9,100	3,000.00	27,300,000	
I N P E X	565,800	1,980.00	1,120,284,000	
石油資源開発	17,700	6,080.00	107,616,000	
K & O エナジーグループ	6,900	2,344.00	16,173,600	
ショーボンドホールディングス	20,800	6,262.00	130,249,600	
ミライト・ワン	50,600	1,772.00	89,663,200	
タマホーム	9,600	3,995.00	38,352,000	
サンヨーホームズ	800	758.00	606,400	
日本アクア	2,800	1,035.00	2,898,000	
ファーストコーポレーション	2,000	785.00	1,570,000	
ベステラ	1,600	1,061.00	1,697,600	
キャンディル	1,200	583.00	699,600	
ダイセキ環境ソリューション	1,400	1,025.00	1,435,000	
第一カッター興業	3,900	1,311.00	5,112,900	
安藤・間	88,600	1,221.00	108,180,600	
東急建設	46,300	809.00	37,456,700	
コムシスホールディングス	48,800	3,336.00	162,796,800	
ビーアールホールディングス	22,400	378.00	8,467,200	
高松コンストラクショングループ	11,400	2,722.00	31,030,800	
東建コーポレーション	4,400	9,600.00	42,240,000	
ソネック	700	928.00	649,600	
ヤマウラ	7,700	1,488.00	11,457,600	
オリエンタル白石	56,600	384.00	21,734,400	



大成建設	100,100	4,823.00	482,782,300	
大林組	382,700	1,415.00	541,520,500	
清水建設	303,400	881.10	267,325,740	
飛鳥建設	11,000	1,458.00	16,038,000	
長谷工コーポレーション	98,200	1,896.50	186,236,300	
松井建設	10,000	852.00	8,520,000	
銭高組	700	4,140.00	2,898,000	
鹿島建設	237,300	2,804.00	665,389,200	
不動テトラ	7,400	2,189.00	16,198,600	
大末建設	1,900	1,621.00	3,079,900	
鉄建建設	7,700	2,484.00	19,126,800	
西松建設	20,400	4,514.00	92,085,600	
三井住友建設	79,600	427.00	33,989,200	
大豊建設	3,700	3,240.00	11,988,000	
佐田建設	3,000	698.00	2,094,000	
ナカノフドー建設	3,400	646.00	2,196,400	
奥村組	17,400	5,080.00	88,392,000	
東鉄工業	13,300	3,005.00	39,966,500	
イチケン	1,200	2,406.00	2,887,200	
富士ピー・エス	2,200	453.00	996,600	
浅沼組	7,900	4,165.00	32,903,500	
戸田建設	144,800	957.80	138,689,440	
熊谷組	17,700	3,805.00	67,348,500	
北野建設	900	3,100.00	2,790,000	
植木組	1,300	1,794.00	2,332,200	
矢作建設工業	14,600	1,575.00	22,995,000	
ピーエス三菱	13,600	1,044.00	14,198,400	
日本ハウスホールディングス	22,800	306.00	6,976,800	
新日本建設	15,000	1,259.00	18,885,000	
東亜道路工業	4,300	6,430.00	27,649,000	
日本道路	11,500	2,035.00	23,402,500	
東亜建設工業	8,300	4,680.00	38,844,000	
日本国土開発	30,400	521.00	15,838,400	
若築建設	3,700	3,155.00	11,673,500	
東洋建設	27,000	1,317.00	35,559,000	
五洋建設	151,700	770.70	116,915,190	
世紀東急工業	13,700	1,930.00	26,441,000	
福田組	4,000	5,330.00	21,320,000	
住友林業	92,500	4,130.00	382,025,000	
日本基礎技術	2,900	452.00	1,310,800	
巴コーポレーション	6,000	650.00	3,900,000	
大和ハウス工業	295,900	4,357.00	1,289,236,300	

ライト工業	22,000	1,892.00	41,624,000
積水ハウス	324,600	3,337.00	1,083,190,200
日特建設	10,200	1,154.00	11,770,800
北陸電気工事	7,300	1,238.00	9,037,400
ユアテック	23,600	1,325.00	31,270,000
日本リーテック	8,900	1,261.00	11,222,900
四電工	4,500	4,150.00	18,675,000
中電工	16,600	2,988.00	49,600,800
関電工	67,000	1,595.00	106,865,000
きんでん	75,300	2,620.00	197,286,000
東京エネシス	10,600	1,150.00	12,190,000
トーエネック	3,500	5,430.00	19,005,000
住友電設	10,200	3,090.00	31,518,000
日本電設工業	20,100	2,083.00	41,868,300
エクシオグループ	52,300	3,157.00	165,111,100
新日本空調	6,400	2,844.00	18,201,600
九電工	23,100	5,608.00	129,544,800
三機工業	23,100	1,937.00	44,744,700
日揮ホールディングス	105,900	1,371.50	145,241,850
中外炉工業	3,500	2,743.00	9,600,500
ヤマト	4,000	970.00	3,880,000
太平電業	6,600	4,285.00	28,281,000
高砂熱学工業	28,700	4,315.00	123,840,500
三晃金属工業	600	4,945.00	2,967,000
朝日工業社	4,700	2,979.00	14,001,300
明星工業	19,300	1,224.00	23,623,200
大気社	12,300	4,805.00	59,101,500
ダイダン	14,100	1,830.00	25,803,000
日比谷総合設備	7,800	2,571.00	20,053,800
フィル・カンパニー	1,700	858.00	1,458,600
テスホールディングス	23,000	456.00	10,488,000
インフロニア・ホールディングス	123,400	1,492.00	184,112,800
東洋エンジニアリング	15,700	808.00	12,685,600
レイズネクスト	15,500	2,315.00	35,882,500
ニッポン	32,200	2,375.00	76,475,000
日清製粉グループ本社	99,300	2,124.00	210,913,200
日東富士製粉	1,900	5,300.00	10,070,000
昭和産業	9,800	3,455.00	33,859,000
鳥越製粉	4,200	718.00	3,015,600
中部飼料	14,900	1,265.00	18,848,500
フィード・ワン	15,700	1,034.00	16,233,800
東洋精糖	900	2,646.00	2,381,400

日本甜菜製糖	6,300	2,098.00	13,217,400
D M三井製糖ホールディングス	10,700	3,250.00	34,775,000
塩水港精糖	6,300	313.00	1,971,900
ウェルネオシュガー	5,400	2,270.00	12,258,000
森永製菓	46,000	2,698.00	124,108,000
中村屋	2,700	3,150.00	8,505,000
江崎グリコ	30,700	4,637.00	142,355,900
名糖産業	4,200	1,861.00	7,816,200
井村屋グループ	6,000	2,459.00	14,754,000
不二家	7,400	2,504.00	18,529,600
山崎製パン	71,900	3,746.00	269,337,400
第一屋製パン	900	749.00	674,100
モロゾフ	3,500	4,280.00	14,980,000
亀田製菓	6,100	4,415.00	26,931,500
寿スピリッツ	50,800	1,940.00	98,552,000
カルビー	49,200	3,163.00	155,619,600
森永乳業	37,500	3,190.00	119,625,000
六甲バター	7,900	1,371.00	10,830,900
ヤクルト本社	153,500	3,156.00	484,446,000
明治ホールディングス	131,700	3,425.00	451,072,500
雪印メグミルク	26,000	2,205.00	57,330,000
プリマハム	14,400	2,265.00	32,616,000
日本ハム	46,200	5,311.00	245,368,200
林兼産業	1,600	556.00	889,600
丸大食品	10,800	1,648.00	17,798,400
S Foods	11,800	3,195.00	37,701,000
柿安本店	4,200	2,630.00	11,046,000
伊藤ハム米久ホールディングス	16,400	4,160.00	68,224,000
サッポロホールディングス	35,400	6,758.00	239,233,200
アサヒグループホールディングス	248,200	5,434.00	1,348,718,800
キリンホールディングス	447,500	2,147.50	961,006,250
宝ホールディングス	73,300	1,205.00	88,326,500
オエノンホールディングス	32,100	346.00	11,106,600
養命酒製造	3,500	1,876.00	6,566,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	84,200	1,994.00	167,894,800
ライフドリンク カンパニー	1,600	5,080.00	8,128,000
サントリー食品インターナショナル	75,600	4,904.00	370,742,400
ダイドーグループホールディングス	12,200	3,045.00	37,149,000
伊藤園	36,400	4,217.00	153,498,800
キーコーヒー	12,000	2,055.00	24,660,000
ユニカフェ	1,600	910.00	1,456,000
ジャパンフーズ	700	1,367.00	956,900

日清オイリオグループ	15,100	5,130.00	77,463,000
不二製油グループ本社	25,000	2,366.00	59,150,000
かどや製油	600	3,880.00	2,328,000
J・オイルミルズ	11,800	1,954.00	23,057,200
キッコーマン	71,200	9,243.00	658,101,600
味の素	255,300	5,796.00	1,479,718,800
ブルドックソース	5,700	2,135.00	12,169,500
キューピー	57,700	2,723.50	157,145,950
ハウス食品グループ本社	37,000	3,155.00	116,735,000
カゴメ	46,200	3,552.00	164,102,400
焼津水産化学工業	2,100	1,346.00	2,826,600
アリアケジャパン	10,700	5,340.00	57,138,000
ピエトロ	700	1,822.00	1,275,400
エバラ食品工業	2,800	2,900.00	8,120,000
やまみ	600	4,120.00	2,472,000
ニチレイ	49,200	3,835.00	188,682,000
東洋水産	54,300	8,444.00	458,509,200
イトアンドホールディングス	5,000	2,123.00	10,615,000
大冷	700	1,934.00	1,353,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	1,216.00	5,958,400
日清食品ホールディングス	113,300	4,434.00	502,372,200
永谷園ホールディングス	5,300	2,235.00	11,845,500
一正蒲鉾	2,000	742.00	1,484,000
フジッコ	11,000	1,947.00	21,417,000
ロック・フィールド	12,000	1,660.00	19,920,000
日本たばこ産業	652,800	3,915.00	2,555,712,000
ケンコーマヨネーズ	7,400	2,088.00	15,451,200
わらべや日洋ホールディングス	7,200	2,825.00	20,340,000
なとり	6,700	2,179.00	14,599,300
イフジ産業	900	1,426.00	1,283,400
ファーマフーズ	15,400	982.00	15,122,800
ユーグレナ	66,900	621.00	41,544,900
紀文食品	8,700	1,187.00	10,326,900
ピククルスホールディングス	6,300	1,269.00	7,994,700
ミヨシ油脂	1,800	1,276.00	2,296,800
理研ビタミン	9,300	2,407.00	22,385,100
片倉工業	10,300	1,829.00	18,838,700
ゲンゼ	7,800	5,550.00	43,290,000
東洋紡	47,600	1,093.00	52,026,800
ユニチカ	37,500	157.00	5,887,500
富士紡ホールディングス	4,600	4,410.00	20,286,000
倉敷紡績	8,300	3,150.00	26,145,000

シキボウ	4,400	1,205.00	5,302,000
日本毛織	29,100	1,372.00	39,925,200
トーア紡コーポレーション	1,900	418.00	794,200
帝国繊維	12,500	2,154.00	26,925,000
帝人	105,300	1,253.50	131,993,550
東レ	732,800	693.90	508,489,920
住江織物	1,000	2,341.00	2,341,000
日本フェルト	3,400	440.00	1,496,000
イチカワ	800	1,752.00	1,401,600
日東製網	500	1,624.00	812,000
アツギ	3,500	599.00	2,096,500
ダイニック	1,500	743.00	1,114,500
セーレン	21,200	2,406.00	51,007,200
ソトー	1,600	687.00	1,099,200
東海染工	600	816.00	489,600
小松マテーレ	15,900	777.00	12,354,300
ワコールホールディングス	22,400	3,695.00	82,768,000
ホギメディカル	14,500	3,525.00	51,112,500
T S Iホールディングス	35,600	705.00	25,098,000
マツオカコーポレーション	1,500	1,556.00	2,334,000
ワールド	15,100	1,998.00	30,169,800
三陽商会	3,600	2,795.00	10,062,000
ナイガイ	1,800	255.00	459,000
オンワードホールディングス	64,600	524.00	33,850,400
ルックホールディングス	2,700	2,432.00	6,566,400
ゴールドウイン	19,400	8,975.00	174,115,000
デサント	18,900	3,210.00	60,669,000
キング	2,300	700.00	1,610,000
ヤマトインターナショナル	4,000	304.00	1,216,000
特種東海製紙	6,000	3,815.00	22,890,000
王子ホールディングス	455,300	559.90	254,922,470
日本製紙	61,700	1,145.00	70,646,500
三菱製紙	6,600	535.00	3,531,000
北越コーポレーション	53,700	1,341.00	72,011,700
中越パルプ工業	2,000	1,790.00	3,580,000
大王製紙	48,300	1,086.00	52,453,800
阿波製紙	1,300	486.00	631,800
レンゴー	99,500	1,011.50	100,644,250
トーモク	6,300	2,325.00	14,647,500
ザ・パック	8,100	3,795.00	30,739,500
北の達人コーポレーション	46,000	225.00	10,350,000
クラレ	159,300	1,503.00	239,427,900

旭化成	739,400	1,047.50	774,521,500
共和レザー	2,800	850.00	2,380,000
巴川コーポレーション	1,400	834.00	1,167,600
レゾナック・ホールディングス	105,600	3,394.00	358,406,400
住友化学	811,000	310.40	251,734,400
住友精化	5,000	5,050.00	25,250,000
日産化学	51,300	6,297.00	323,036,100
ラサ工業	4,200	2,300.00	9,660,000
クレハ	23,900	2,706.00	64,673,400
多木化学	4,200	3,500.00	14,700,000
テイカ	7,800	1,401.00	10,927,800
石原産業	18,100	1,517.00	27,457,700
片倉コープアグリ	1,200	1,071.00	1,285,200
日本曹達	12,900	5,950.00	76,755,000
東ソー	145,900	2,036.00	297,052,400
トクヤマ	35,300	2,327.50	82,160,750
セントラル硝子	11,700	2,891.00	33,824,700
東亜合成	54,800	1,542.50	84,529,000
大阪ソーダ	7,600	11,390.00	86,564,000
関東電化工業	21,100	923.00	19,475,300
デンカ	39,700	2,511.50	99,706,550
信越化学工業	991,100	6,105.00	6,050,665,500
日本カーバイド工業	3,400	1,827.00	6,211,800
堺化学工業	8,300	1,957.00	16,243,100
第一稀元素化学工業	10,600	920.00	9,752,000
エア・ウォーター	103,100	2,176.00	224,345,600
日本酸素ホールディングス	106,000	4,156.00	440,536,000
日本化学工業	3,800	2,140.00	8,132,000
東邦アセチレン	5,100	397.00	2,024,700
日本パーカライズニング	48,700	1,266.00	61,654,200
高压ガス工業	15,900	885.00	14,071,500
チタン工業	600	1,095.00	657,000
四国化成ホールディングス	14,000	1,756.00	24,584,000
戸田工業	2,500	1,632.00	4,080,000
ステラ ケミファ	5,900	3,815.00	22,508,500
保土谷化学工業	3,300	3,600.00	11,880,000
日本触媒	15,900	5,643.00	89,723,700
大日精化工業	7,600	2,749.00	20,892,400
カネカ	27,700	3,699.00	102,462,300
三菱瓦斯化学	81,600	2,572.00	209,875,200
三井化学	90,100	4,040.00	364,004,000
J S R	119,000	4,062.00	483,378,000

東京応化工業	52,100	4,141.00	215,746,100
大阪有機化学工業	9,100	2,953.00	26,872,300
三菱ケミカルグループ	799,000	863.70	690,096,300
KHネオケム	16,700	2,258.00	37,708,600
ダイセル	140,500	1,452.00	204,006,000
住友ベークライト	15,300	8,104.00	123,991,200
積水化学工業	219,600	2,102.00	461,599,200
日本ゼオン	74,900	1,310.00	98,119,000
アイカ工業	27,600	3,554.00	98,090,400
UBE	52,000	2,560.00	133,120,000
積水樹脂	15,700	2,515.00	39,485,500
タキロンシーアイ	25,600	644.00	16,486,400
旭有機材	7,300	3,985.00	29,090,500
ニチバン	5,900	1,845.00	10,885,500
リケンテクノス	23,500	961.00	22,583,500
大倉工業	5,100	3,110.00	15,861,000
積水化成成品工業	15,300	454.00	6,946,200
群栄化学工業	2,600	3,565.00	9,269,000
タイガースポリマー	2,200	1,142.00	2,512,400
ミライアル	1,700	1,450.00	2,465,000
ダイキアクシス	2,000	700.00	1,400,000
ダイキョーニシカワ	24,100	735.00	17,713,500
竹本容器	1,800	769.00	1,384,200
森六ホールディングス	5,700	2,762.00	15,743,400
恵和	7,900	1,177.00	9,298,300
日本化薬	83,500	1,282.50	107,088,750
カーリットホールディングス	10,600	981.00	10,398,600
日本精化	6,500	2,617.00	17,010,500
扶桑化学工業	11,600	4,555.00	52,838,000
トリケミカル研究所	13,300	4,285.00	56,990,500
ADEKA	38,100	2,957.50	112,680,750
日油	33,000	7,060.00	232,980,000
新日本理化	6,700	209.00	1,400,300
ハリマ化成グループ	5,800	902.00	5,231,600
花王	247,100	5,651.00	1,396,362,100
第一工業製薬	4,200	3,455.00	14,511,000
石原ケミカル	4,900	1,892.00	9,270,800
日華化学	1,900	881.00	1,673,900
ニイタカ	1,000	1,915.00	1,915,000
三洋化成工業	6,700	4,165.00	27,905,500
有機合成薬品工業	3,900	300.00	1,170,000
大日本塗料	12,200	1,091.00	13,310,200

日本ペイントホールディングス	580,300	1,122.00	651,096,600
関西ペイント	107,100	2,309.00	247,293,900
神東塗料	4,000	127.00	508,000
中国塗料	22,400	2,117.00	47,420,800
日本特殊塗料	3,500	1,372.00	4,802,000
藤倉化成	12,600	458.00	5,770,800
太陽ホールディングス	19,000	3,140.00	59,660,000
D I C	42,700	2,988.00	127,587,600
サカタインクス	24,300	1,385.00	33,655,500
a r t i e n c e	23,800	2,956.00	70,352,800
T & K T O K A	10,000	1,408.00	14,080,000
富士フィルムホールディングス	203,000	9,389.00	1,905,967,000
資生堂	228,500	4,154.00	949,189,000
ライオン	143,200	1,337.50	191,530,000
高砂香料工業	7,700	3,400.00	26,180,000
マンダム	23,600	1,315.00	31,034,000
ミルボン	14,900	3,424.00	51,017,600
ファンケル	47,900	2,169.50	103,919,050
コーセー	22,300	8,485.00	189,215,500
コタ	10,100	1,598.00	16,139,800
シーボン	700	1,488.00	1,041,600
ポーラ・オルビスホールディングス	56,100	1,478.00	82,915,800
ノエビアホールディングス	9,800	5,270.00	51,646,000
アジュバンホールディングス	1,200	934.00	1,120,800
新日本製薬	6,200	1,720.00	10,664,000
I - n e	2,200	2,059.00	4,529,800
アクシージア	5,600	843.00	4,720,800
エステー	8,400	1,553.00	13,045,200
アグロ カネショウ	4,400	1,260.00	5,544,000
コニシ	34,900	1,378.00	48,092,200
長谷川香料	20,900	3,130.00	65,417,000
小林製薬	31,800	6,168.00	196,142,400
荒川化学工業	9,300	1,118.00	10,397,400
メック	9,000	4,120.00	37,080,000
日本高純度化学	2,500	2,747.00	6,867,500
タカラバイオ	29,500	1,051.00	31,004,500
J C U	12,200	4,045.00	49,349,000
新田ゼラチン	3,300	673.00	2,220,900
O A T アグリオ	3,200	1,686.00	5,395,200
デクセリアルズ	27,400	5,906.00	161,824,400
アース製薬	9,900	4,275.00	42,322,500
北興化学工業	11,000	1,075.00	11,825,000



大成ラミック	3,300	3,045.00	10,048,500
クミアイ化学工業	43,500	823.00	35,800,500
日本農薬	20,100	698.00	14,029,800
アキレス	6,900	1,504.00	10,377,600
有沢製作所	18,500	1,140.00	21,090,000
日東電工	70,300	13,880.00	975,764,000
レック	14,000	1,083.00	15,162,000
三光合成	13,800	631.00	8,707,800
きもと	8,000	207.00	1,656,000
藤森工業	8,600	3,875.00	33,325,000
前澤化成工業	7,100	1,592.00	11,303,200
未来工業	3,900	5,210.00	20,319,000
ウェーブロックホールディングス	1,800	683.00	1,229,400
J S P	7,700	2,235.00	17,209,500
エフピコ	20,700	2,839.50	58,777,650
天馬	7,900	2,371.00	18,730,900
信越ポリマー	23,600	1,588.00	37,476,800
東リ	10,800	394.00	4,255,200
ニフコ	32,700	3,635.00	118,864,500
バルカー	9,200	4,455.00	40,986,000
ユニ・チャーム	228,000	5,230.00	1,192,440,000
ショーエイコーポレーション	1,500	614.00	921,000
協和キリン	132,200	2,879.50	380,669,900
武田薬品工業	968,500	4,431.00	4,291,423,500
アステラス製薬	959,900	1,677.00	1,609,752,300
住友ファーマ	81,200	358.00	29,069,600
塩野義製薬	138,000	7,058.00	974,004,000
わかもと製薬	5,100	207.00	1,055,700
日本新薬	28,700	4,931.00	141,519,700
中外製薬	342,500	5,890.00	2,017,325,000
科研製薬	18,700	3,541.00	66,216,700
エーザイ	133,100	6,198.00	824,953,800
ロート製薬	106,000	2,992.00	317,152,000
小野薬品工業	232,200	2,423.00	562,620,600
久光製薬	24,300	4,005.00	97,321,500
持田製薬	12,600	3,180.00	40,068,000
参天製薬	199,400	1,534.50	305,979,300
扶桑薬品工業	3,700	2,210.00	8,177,000
日本ケミファ	600	1,626.00	975,600
ツムラ	34,500	2,750.00	94,875,000
キッセイ薬品工業	18,100	3,290.00	59,549,000
生化学工業	18,500	750.00	13,875,000

栄研化学	20,100	1,877.00	37,727,700
鳥居薬品	5,900	4,030.00	23,777,000
JCRファーマ	37,000	911.00	33,707,000
東和薬品	16,800	2,999.00	50,383,200
富士製薬工業	8,100	1,730.00	14,013,000
ゼリア新薬工業	15,200	2,155.00	32,756,000
そーせいグループ	35,400	1,419.00	50,232,600
第一三共	953,300	4,931.00	4,700,722,300
杏林製薬	23,700	1,765.00	41,830,500
大幸薬品	22,600	320.00	7,232,000
ダイト	8,400	1,992.00	16,732,800
大塚ホールディングス	227,600	5,596.00	1,273,649,600
ペプチドリーム	53,000	1,556.50	82,494,500
セルソース	3,000	1,241.00	3,723,000
あすか製薬ホールディングス	11,200	2,064.00	23,116,800
サワイグループホールディングス	25,000	5,914.00	147,850,000
日本コークス工業	111,000	114.00	12,654,000
ニチレキ	13,500	2,402.00	32,427,000
ユシロ化学工業	5,700	2,134.00	12,163,800
ピーピー・カストロール	1,900	922.00	1,751,800
富士石油	29,100	330.00	9,603,000
MORESCO	1,700	1,429.00	2,429,300
出光興産	607,700	915.30	556,227,810
ENEOSホールディングス	1,732,500	635.50	1,101,003,750
コスモエネルギーホールディングス	32,400	6,354.00	205,869,600
横浜ゴム	55,300	4,083.00	225,789,900
TOYO TIRE	62,900	2,886.00	181,529,400
ブリヂストン	320,300	6,412.00	2,053,763,600
住友ゴム工業	107,300	1,808.00	193,998,400
藤倉コンポジット	7,400	1,439.00	10,648,600
オカモト	5,200	4,805.00	24,986,000
フコク	5,700	1,596.00	9,097,200
ニッタ	11,100	3,715.00	41,236,500
住友理工	17,000	1,106.00	18,802,000
三ツ星ベルト	13,300	4,920.00	65,436,000
バンドー化学	16,200	1,728.00	27,993,600
日東紡績	13,900	5,280.00	73,392,000
AGC	97,600	5,415.00	528,504,000
日本板硝子	52,200	531.00	27,718,200
石塚硝子	900	3,200.00	2,880,000
日本山村硝子	1,900	1,461.00	2,775,900
日本電気硝子	44,700	3,585.00	160,249,500

オハラ	5,300	1,164.00	6,169,200
住友大阪セメント	18,300	3,624.00	66,319,200
太平洋セメント	64,800	3,210.00	208,008,000
日本ヒューム	9,800	885.00	8,673,000
日本コンクリート工業	21,600	443.00	9,568,800
三谷セキサン	4,600	5,660.00	26,036,000
アジアパイルホールディングス	15,800	781.00	12,339,800
東海カーボン	101,100	1,008.50	101,959,350
日本カーボン	5,800	5,370.00	31,146,000
東洋炭素	7,700	7,000.00	53,900,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	8,060.00	48,360,000
TOTO	72,300	3,745.00	270,763,500
日本碍子	127,400	1,930.00	245,882,000
日本特殊陶業	91,700	4,418.00	405,130,600
MARUWA	4,000	30,850.00	123,400,000
品川リフラクトリーズ	13,600	2,048.00	27,852,800
黒崎播磨	2,200	14,250.00	31,350,000
ヨータイ	6,300	1,443.00	9,090,900
東京窯業	5,500	466.00	2,563,000
ニッカトー	2,400	579.00	1,389,600
フジミインコーポレーテッド	29,500	3,335.00	98,382,500
クニミネ工業	1,500	1,018.00	1,527,000
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,339.00	1,472,900
ニチアス	27,700	3,760.00	104,152,000
ニチハ	13,800	3,480.00	48,024,000
日本製鉄	504,100	3,566.00	1,797,620,600
神戸製鋼所	226,400	2,036.00	460,950,400
中山製鋼所	25,800	920.00	23,736,000
合同製鐵	6,300	5,930.00	37,359,000
JFEホールディングス	313,100	2,368.00	741,420,800
東京製鐵	31,700	1,656.00	52,495,200
共英製鋼	12,800	2,278.00	29,158,400
大和工業	21,200	8,459.00	179,330,800
東京鐵鋼	5,000	5,280.00	26,400,000
大阪製鐵	5,200	2,281.00	11,861,200
淀川製鋼所	12,800	4,275.00	54,720,000
中部鋼鈹	7,400	2,493.00	18,448,200
丸一鋼管	34,300	4,040.00	138,572,000
モリ工業	1,700	4,860.00	8,262,000
大同特殊鋼	70,900	1,816.00	128,754,400
日本高周波鋼業	2,000	585.00	1,170,000
日本冶金工業	8,200	4,595.00	37,679,000

山陽特殊製鋼	11,100	2,228.00	24,730,800
愛知製鋼	6,500	3,465.00	22,522,500
日本金属	1,300	850.00	1,105,000
大太平洋金属	9,600	1,375.00	13,200,000
新日本電工	56,100	299.00	16,773,900
栗本鐵工所	5,200	3,265.00	16,978,000
虹技	700	1,490.00	1,043,000
三菱製鋼	7,900	1,443.00	11,399,700
日亜鋼業	5,100	338.00	1,723,800
日本精線	1,600	5,810.00	9,296,000
エンビプロ・ホールディングス	6,100	488.00	2,976,800
シンニッタン	6,400	276.00	1,766,400
新家工業	1,100	3,770.00	4,147,000
大紀アルミニウム工業所	14,300	1,229.00	17,574,700
日本軽金属ホールディングス	32,900	1,709.00	56,226,100
三井金属鉱業	32,800	4,337.00	142,253,600
東邦亜鉛	7,200	1,045.00	7,524,000
三菱マテリアル	80,500	2,571.00	206,965,500
住友金属鉱山	130,500	4,108.00	536,094,000
D O W A ホールディングス	27,800	5,377.00	149,480,600
古河機械金属	14,900	1,733.00	25,821,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,500	2,676.00	52,182,000
東邦チタニウム	23,300	1,722.00	40,122,600
U A C J	15,800	4,135.00	65,333,000
C K サンエツ	2,700	3,860.00	10,422,000
古河電気工業	37,500	2,964.00	111,150,000
住友電気工業	421,100	2,154.50	907,259,950
フジクラ	132,800	1,755.50	233,130,400
S W C C	12,600	3,355.00	42,273,000
タツタ電線	20,100	695.00	13,969,500
カナレ電気	900	1,738.00	1,564,200
平河ヒューテック	6,800	1,305.00	8,874,000
リョービ	12,000	2,483.00	29,796,000
アーレスティ	5,600	769.00	4,306,400
A R E ホールディングス	42,300	1,953.00	82,611,900
稲葉製作所	5,600	1,509.00	8,450,400
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,970.00	22,232,000
トーカロ	31,000	1,656.00	51,336,000
アルファC o	1,800	1,623.00	2,921,400
S U M C O	200,000	2,201.50	440,300,000
川田テクノロジーズ	2,700	8,940.00	24,138,000
R S Technologies	7,500	2,637.00	19,777,500

ジェイテックコーポレーション	800	1,976.00	1,580,800
信和	3,200	750.00	2,400,000
東洋製罐グループホールディングス	67,200	2,474.00	166,252,800
ホッカンホールディングス	5,500	1,834.00	10,087,000
コロナ	6,300	963.00	6,066,900
横河ブリッジホールディングス	17,600	2,764.00	48,646,400
駒井ハルテック	900	2,075.00	1,867,500
高田機工	400	3,430.00	1,372,000
三和ホールディングス	113,100	2,622.50	296,604,750
文化シャッター	29,500	1,562.00	46,079,000
三協立山	12,900	879.00	11,339,100
アルインコ	8,600	1,046.00	8,995,600
東洋シャッター	1,100	718.00	789,800
L I X I L	175,800	1,961.00	344,743,800
日本フィルコン	3,300	546.00	1,801,800
ノーリツ	18,700	1,659.00	31,023,300
長府製作所	11,200	2,105.00	23,576,000
リンナイ	55,100	3,561.00	196,211,100
ダイニチ工業	2,500	696.00	1,740,000
日東精工	16,300	582.00	9,486,600
三洋工業	600	3,555.00	2,133,000
岡部	20,100	791.00	15,899,100
ジーテクト	13,400	2,010.00	26,934,000
東プレ	19,800	2,296.00	45,460,800
高周波熱錬	17,400	1,067.00	18,565,800
東京製綱	7,300	1,523.00	11,117,900
サンコール	7,500	470.00	3,525,000
モリテック スチール	4,400	261.00	1,148,400
パイオラックス	14,000	2,699.00	37,786,000
エイチワン	11,600	675.00	7,830,000
日本発條	99,600	1,464.00	145,814,400
中央発條	8,300	730.00	6,059,000
アドバネクス	600	1,035.00	621,000
立川ブラインド工業	5,100	1,466.00	7,476,600
三益半導体工業	8,700	3,075.00	26,752,500
日本ドライケミカル	1,200	2,530.00	3,036,000
日本製綱所	30,400	2,518.50	76,562,400
三浦工業	46,000	2,964.00	136,344,000
タクマ	37,300	1,850.00	69,005,000
ツガミ	24,500	1,138.00	27,881,000
オークマ	9,600	7,184.00	68,966,400
芝浦機械	11,000	3,445.00	37,895,000

アマダ	175,900	1,621.50	285,221,850
アイダエンジニアリング	24,200	851.00	20,594,200
F U J I	51,900	2,622.00	136,081,800
牧野フライス製作所	12,200	5,940.00	72,468,000
オーエスジー	48,600	2,145.50	104,271,300
ダイジェット工業	600	844.00	506,400
旭ダイヤモンド工業	25,500	872.00	22,236,000
D M G 森精機	66,800	3,433.00	229,324,400
ソディック	26,900	717.00	19,287,300
ディスコ	53,100	43,330.00	2,300,823,000
日東工器	5,400	1,926.00	10,400,400
日進工具	9,600	995.00	9,552,000
パンチ工業	4,900	422.00	2,067,800
富士ダイス	4,300	671.00	2,885,300
豊和工業	2,700	760.00	2,052,000
リケンN P R	12,000	2,866.00	34,392,000
東洋機械金属	4,100	727.00	2,980,700
エンシュウ	1,200	683.00	819,600
島精機製作所	17,600	1,388.00	24,428,800
オプトラン	18,100	1,871.00	33,865,100
N C ホールディングス	1,200	1,547.00	1,856,400
イワキポンプ	7,400	2,421.00	17,915,400
フリュー	10,400	1,203.00	12,511,200
ヤマシンフィルタ	26,600	351.00	9,336,600
日阪製作所	11,200	982.00	10,998,400
やまびこ	18,000	1,794.00	32,292,000
野村マイクロ・サイエンス	3,700	13,770.00	50,949,000
平田機工	5,300	7,600.00	40,280,000
P E G A S U S	12,200	437.00	5,331,400
マルマエ	4,800	1,875.00	9,000,000
タツモ	6,700	3,760.00	25,192,000
ナプテスコ	69,200	2,555.50	176,840,600
三井海洋開発	14,000	2,888.00	40,432,000
レオン自動機	12,300	1,422.00	17,490,600
S M C	33,000	84,440.00	2,786,520,000
ホソカワミクロン	7,100	4,335.00	30,778,500
ユニオンツール	4,900	3,925.00	19,232,500
瑞光	8,000	1,723.00	13,784,000
オイレス工業	15,000	2,055.00	30,825,000
日精エー・エス・ビー機械	4,400	4,390.00	19,316,000
サトーホールディングス	15,700	2,284.00	35,858,800
技研製作所	10,400	2,065.00	21,476,000

日本エアーテック	5,200	1,146.00	5,959,200
カワタ	1,600	1,070.00	1,712,000
日精樹脂工業	8,200	1,135.00	9,307,000
オカダアイヨン	1,700	2,783.00	4,731,100
ワイエイシイホールディングス	3,600	2,255.00	8,118,000
小松製作所	516,600	4,250.00	2,195,550,000
住友重機械工業	65,200	4,530.00	295,356,000
日立建機	43,900	4,164.00	182,799,600
日工	16,400	766.00	12,562,400
巴工業	4,300	3,750.00	16,125,000
井関農機	10,400	1,002.00	10,420,800
TOWA	12,300	7,670.00	94,341,000
丸山製作所	800	2,308.00	1,846,400
北川鉄工所	4,400	1,552.00	6,828,800
ローツェ	5,800	19,400.00	112,520,000
タカキタ	1,700	486.00	826,200
クボタ	578,300	2,199.00	1,271,681,700
荏原実業	5,800	3,100.00	17,980,000
三菱化工機	3,900	3,715.00	14,488,500
月島ホールディングス	14,900	1,357.00	20,219,300
帝国電機製作所	7,800	2,733.00	21,317,400
新東工業	22,300	1,146.00	25,555,800
澁谷工業	10,400	3,105.00	32,292,000
アイチ コーポレーション	15,400	1,092.00	16,816,800
小森コーポレーション	27,200	1,295.00	35,224,000
鶴見製作所	8,400	3,395.00	28,518,000
日本ギア工業	1,900	621.00	1,179,900
酒井重工業	1,400	6,410.00	8,974,000
荏原製作所	45,200	11,150.00	503,980,000
石井鐵工所	700	2,760.00	1,932,000
西島製作所	9,500	2,530.00	24,035,000
北越工業	11,100	2,420.00	26,862,000
ダイキン工業	131,600	21,200.00	2,789,920,000
オルガノ	13,300	6,840.00	90,972,000
トーヨーカネツ	3,700	4,430.00	16,391,000
栗田工業	61,600	5,771.00	355,493,600
椿本チエイン	15,600	4,680.00	73,008,000
大同工業	2,200	743.00	1,634,600
木村化工機	8,500	707.00	6,009,500
アネスト岩田	17,100	1,335.00	22,828,500
ダイフク	186,000	3,340.00	621,240,000
サムコ	3,000	5,030.00	15,090,000

加藤製作所	2,500	1,414.00	3,535,000
油研工業	800	2,405.00	1,924,000
タダノ	63,500	1,300.00	82,550,000
フジテック	25,800	3,720.00	95,976,000
C K D	30,500	2,733.00	83,356,500
平和	32,600	2,086.00	68,003,600
理想科学工業	8,800	3,210.00	28,248,000
S A N K Y O	25,300	8,958.00	226,637,400
日本金銭機械	13,300	1,386.00	18,433,800
マースグループホールディングス	5,600	2,877.00	16,111,200
フクシマガリレイ	7,200	5,890.00	42,408,000
オーイズミ	1,900	408.00	775,200
ダイコク電機	5,400	4,085.00	22,059,000
竹内製作所	20,000	5,110.00	102,200,000
アマノ	31,300	3,687.00	115,403,100
J U K I	17,100	498.00	8,515,800
ジャノメ	11,200	687.00	7,694,400
マックス	15,500	3,110.00	48,205,000
グローリー	26,500	2,924.00	77,486,000
新晃工業	11,100	3,170.00	35,187,000
大和冷機工業	16,900	1,459.00	24,657,100
セガサミーホールディングス	98,400	1,807.00	177,808,800
T P R	13,400	2,119.00	28,394,600
ツバキ・ナカシマ	22,100	779.00	17,215,900
ホシザキ	65,000	5,226.00	339,690,000
大豊工業	9,600	839.00	8,054,400
日本精工	204,100	809.20	165,157,720
N T N	239,100	294.30	70,367,130
ジェイテクト	98,100	1,375.50	134,936,550
不二越	8,100	3,345.00	27,094,500
日本トムソン	29,200	626.00	18,279,200
T H K	63,600	3,121.00	198,495,600
ユーシン精機	8,800	682.00	6,001,600
前澤給装工業	8,000	1,279.00	10,232,000
イーグル工業	12,200	1,775.00	21,655,000
前澤工業	3,100	1,058.00	3,279,800
日本ピラー工業	10,200	5,370.00	54,774,000
キッツ	36,900	1,307.00	48,228,300
マキタ	125,700	3,839.00	482,562,300
三井E & S	54,700	1,144.00	62,576,800
日立造船	97,300	1,113.00	108,294,900
三菱重工業	192,700	11,225.00	2,163,057,500



I H I	82,100	3,097.00	254,263,700
スター精密	20,500	1,695.00	34,747,500
日清紡ホールディングス	82,800	1,242.50	102,879,000
イビデン	57,500	7,359.00	423,142,500
コニカミノルタ	246,500	471.00	116,101,500
ブラザー工業	147,300	2,515.50	370,533,150
ミネベアミツミ	191,700	3,032.00	581,234,400
日立製作所	529,600	12,455.00	6,596,168,000
三菱電機	1,226,600	2,279.00	2,795,421,400
富士電機	67,000	8,956.00	600,052,000
東洋電機製造	1,700	1,068.00	1,815,600
安川電機	119,700	5,521.00	660,863,700
シンフォニアテクノロジー	12,200	2,524.00	30,792,800
明電舎	20,400	2,627.00	53,590,800
オリジン	1,100	1,220.00	1,342,000
山洋電気	4,800	6,160.00	29,568,000
デンヨー	8,400	2,341.00	19,664,400
PHCホールディングス	20,700	1,258.00	26,040,600
KOKUSAI ELECTRIC	42,600	4,575.00	194,895,000
ソシオネクスト	80,000	3,847.00	307,760,000
東芝テック	14,100	3,060.00	43,146,000
芝浦メカトロニクス	6,300	6,490.00	40,887,000
マブチモーター	54,300	2,715.50	147,451,650
ニデック	243,300	5,701.00	1,387,053,300
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,400	359.00	2,656,600
トレックス・セミコンダクター	5,700	1,861.00	10,607,700
東光高岳	6,700	2,419.00	16,207,300
ダブル・スコープ	31,500	768.00	24,192,000
ダイヘン	11,100	7,080.00	78,588,000
ヤーマン	19,200	1,009.00	19,372,800
JVCケンウッド	87,200	708.00	61,737,600
ミマキエンジニアリング	10,600	1,008.00	10,684,800
I - P E X	7,700	1,808.00	13,921,600
大崎電気工業	24,400	676.00	16,494,400
オムロン	84,200	5,729.00	482,381,800
日東工業	14,900	4,285.00	63,846,500
I D E C	16,300	2,823.00	46,014,900
正興電機製作所	1,800	1,142.00	2,055,600
不二電機工業	1,100	1,134.00	1,247,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	43,100	2,718.00	117,145,800
サクサホールディングス	1,100	3,115.00	3,426,500
メルコホールディングス	2,900	3,200.00	9,280,000

テクノメディカ	2,800	1,777.00	4,975,600
日本電気	144,700	9,680.00	1,400,696,000
富士通	101,400	22,600.00	2,291,640,000
沖電気工業	49,800	1,065.00	53,037,000
岩崎通信機	2,400	649.00	1,557,600
電気興業	4,700	2,084.00	9,794,800
サンケン電気	10,200	7,800.00	79,560,000
ナカヨ	800	1,148.00	918,400
アイホン	5,900	2,857.00	16,856,300
ルネサスエレクトロニクス	719,200	2,429.00	1,746,936,800
セイコーエプソン	141,400	2,428.00	343,319,200
ワコム	84,000	640.00	53,760,000
アルバック	24,100	8,844.00	213,140,400
アクセル	3,500	1,989.00	6,961,500
E I Z O	8,100	5,010.00	40,581,000
日本信号	25,100	971.00	24,372,100
京三製作所	23,100	457.00	10,556,700
能美防災	15,000	2,215.00	33,225,000
ホーチキ	8,300	2,254.00	18,708,200
星和電機	2,500	517.00	1,292,500
エレコム	26,400	1,617.00	42,688,800
パナソニック ホールディングス	1,301,800	1,427.00	1,857,668,600
シャープ	185,800	809.80	150,460,840
アンリツ	77,600	1,179.00	91,490,400
富士通ゼネラル	31,200	1,991.50	62,134,800
ソニーグループ	771,800	13,185.00	10,176,183,000
T D K	174,500	7,713.00	1,345,918,500
帝国通信工業	4,900	1,884.00	9,231,600
タムラ製作所	43,900	563.00	24,715,700
アルプスアルパイン	98,500	1,059.00	104,311,500
池上通信機	1,500	824.00	1,236,000
日本電波工業	13,300	1,351.00	17,968,300
鈴木	6,000	1,155.00	6,930,000
メイコー	11,000	4,590.00	50,490,000
日本トリム	2,500	3,240.00	8,100,000
ローランド ディー . ジー .	6,100	5,020.00	30,622,000
フォスター電機	8,200	1,075.00	8,815,000
S M K	2,600	2,494.00	6,484,400
ヨコオ	9,800	1,566.00	15,346,800
ホシデン	25,100	2,009.00	50,425,900
ヒロセ電機	16,300	15,995.00	260,718,500
日本航空電子工業	26,400	2,689.00	70,989,600

TOA	12,500	1,139.00	14,237,500
マクセル	23,800	1,578.00	37,556,400
古野電気	14,400	2,166.00	31,190,400
スミダコーポレーション	14,900	1,190.00	17,731,000
アイコム	4,200	3,410.00	14,322,000
リオン	4,600	2,777.00	12,774,200
横河電機	120,600	3,017.00	363,850,200
新電元工業	4,200	3,080.00	12,936,000
アズビル	75,100	4,461.00	335,021,100
東亜ディーケーケー	2,400	1,006.00	2,414,400
日本光電工業	46,800	4,162.00	194,781,600
チノー	4,500	2,312.00	10,404,000
共和電業	4,500	423.00	1,903,500
日本電子材料	6,700	1,980.00	13,266,000
堀場製作所	20,800	13,965.00	290,472,000
アドバンテスト	312,600	6,594.00	2,061,284,400
小野測器	2,300	571.00	1,313,300
エスベック	8,800	2,693.00	23,698,400
キーエンス	109,200	68,860.00	7,519,512,000
日置電機	5,200	6,770.00	35,204,000
シスメックス	94,200	7,890.00	743,238,000
日本マイクロニクス	19,600	6,560.00	128,576,000
メガチップス	8,700	4,185.00	36,409,500
OBARA GROUP	6,000	3,670.00	22,020,000
澤藤電機	700	1,293.00	905,100
原田工業	2,300	755.00	1,736,500
コーセル	13,200	1,530.00	20,196,000
イリソ電子工業	10,100	3,105.00	31,360,500
オブテックスグループ	20,100	1,820.00	36,582,000
千代田インテグレ	4,300	2,607.00	11,210,100
レーザーテック	50,000	39,020.00	1,951,000,000
スタンレー電気	69,900	2,556.50	178,699,350
ウシオ電機	55,500	2,028.50	112,581,750
岡谷電機産業	4,200	272.00	1,142,400
ヘリオス テクノ ホールディング	5,100	544.00	2,774,400
エノモト	1,400	1,583.00	2,216,200
日本セラミック	8,900	2,589.00	23,042,100
遠藤照明	2,300	1,538.00	3,537,400
古河電池	8,200	958.00	7,855,600
双信電機	2,400	293.00	703,200
山一電機	9,900	2,226.00	22,037,400
図研	9,500	4,345.00	41,277,500

日本電子	27,400	6,290.00	172,346,000
カシオ計算機	78,800	1,190.50	93,811,400
ファナック	532,100	4,220.00	2,245,462,000
日本シイエムケイ	23,400	581.00	13,595,400
エンプラス	3,200	9,000.00	28,800,000
大真空	16,400	875.00	14,350,000
ローム	201,800	2,615.00	527,707,000
浜松ホトニクス	87,600	5,434.00	476,018,400
三井ハイテック	9,700	8,270.00	80,219,000
新光電気工業	38,600	5,485.00	211,721,000
京セラ	678,000	2,216.50	1,502,787,000
太陽誘電	53,200	3,361.00	178,805,200
村田製作所	992,700	2,976.00	2,954,275,200
双葉電子工業	21,100	508.00	10,718,800
北陸電気工業	1,900	1,410.00	2,679,000
ニチコン	28,800	1,223.00	35,222,400
日本ケミコン	11,700	1,336.00	15,631,200
K O A	16,600	1,507.00	25,016,200
市光工業	19,900	539.00	10,726,100
小糸製作所	113,100	1,944.00	219,866,400
ミツバ	20,500	1,308.00	26,814,000
S C R E E Nホールディングス	37,300	18,060.00	673,638,000
キャノン電子	12,100	2,216.00	26,813,600
キャノン	544,200	4,216.00	2,294,347,200
リコー	273,600	1,266.00	346,377,600
象印マホービン	29,700	1,435.00	42,619,500
M U T O Hホールディングス	700	2,238.00	1,566,600
東京エレクトロン	230,900	34,520.00	7,970,668,000
イノテック	7,400	1,863.00	13,786,200
トヨタ紡織	46,000	2,422.00	111,412,000
芦森工業	1,000	2,749.00	2,749,000
ユニプレス	19,600	1,051.00	20,599,600
豊田自動織機	93,100	14,795.00	1,377,414,500
モリタホールディングス	19,200	1,623.00	31,161,600
三櫻工業	16,700	1,080.00	18,036,000
デンソー	900,200	2,677.50	2,410,285,500
東海理化電機製作所	30,800	2,395.00	73,766,000
川崎重工業	89,100	3,846.00	342,678,600
名村造船所	23,800	1,738.00	41,364,400
日本車輛製造	3,900	2,310.00	9,009,000
三菱ロジスネクスト	17,400	1,416.00	24,638,400
近畿車輛	700	2,414.00	1,689,800

日産自動車	1,471,000	566.40	833,174,400
いすゞ自動車	317,200	2,147.00	681,028,400
トヨタ自動車	5,991,200	3,429.00	20,543,824,800
日野自動車	164,100	470.00	77,127,000
三菱自動車工業	425,700	451.00	191,990,700
エフテック	3,400	706.00	2,400,400
レシップホールディングス	2,100	739.00	1,551,900
GMB	1,000	1,152.00	1,152,000
ファルテック	1,000	539.00	539,000
武蔵精密工業	26,700	1,619.00	43,227,300
日産車体	12,800	959.00	12,275,200
新明和工業	31,400	1,211.00	38,025,400
極東開発工業	18,000	2,366.00	42,588,000
トピー工業	8,900	2,956.00	26,308,400
ティラド	2,400	3,770.00	9,048,000
曙ブレーキ工業	66,600	113.00	7,525,800
タチエス	20,200	2,011.00	40,622,200
NOK	42,400	2,082.50	88,298,000
フタバ産業	29,300	1,068.00	31,292,400
カヤバ	10,500	4,915.00	51,607,500
大同メタル工業	21,400	546.00	11,684,400
プレス工業	43,700	655.00	28,623,500
ミクニ	6,200	459.00	2,845,800
太平洋工業	25,100	1,455.00	36,520,500
アイシン	84,200	5,491.00	462,342,200
マツダ	360,900	1,759.50	635,003,550
今仙電機製作所	3,100	664.00	2,058,400
本田技研工業	2,660,800	1,747.00	4,648,417,600
スズキ	200,400	6,507.00	1,304,002,800
S U B A R U	338,400	3,330.00	1,126,872,000
安永	2,200	739.00	1,625,800
ヤマハ発動機	471,600	1,378.50	650,100,600
T B K	5,400	399.00	2,154,600
エクセディ	17,900	2,876.00	51,480,400
豊田合成	31,900	2,993.50	95,492,650
愛三工業	18,100	1,494.00	27,041,400
盟和産業	700	1,027.00	718,900
日本プラスト	4,200	513.00	2,154,600
ヨロズ	10,300	929.00	9,568,700
エフ・シー・シー	19,400	2,119.00	41,108,600
シマノ	44,300	20,800.00	921,440,000
テイ・エス テック	38,900	1,957.00	76,127,300

ジャムコ	4,600	1,342.00	6,173,200
テルモ	305,100	5,658.00	1,726,255,800
クリエートメディック	1,600	951.00	1,521,600
日機装	25,400	1,176.00	29,870,400
日本エム・ディ・エム	7,300	707.00	5,161,100
島津製作所	145,000	3,838.00	556,510,000
JMS	10,100	514.00	5,191,400
長野計器	7,900	2,291.00	18,098,900
ブイ・テクノロジー	5,800	2,605.00	15,109,000
東京計器	8,400	2,261.00	18,992,400
愛知時計電機	4,500	2,552.00	11,484,000
インターアクション	5,200	1,177.00	6,120,400
オーバル	4,300	512.00	2,201,600
東京精密	22,300	9,599.00	214,057,700
マニー	43,700	2,054.00	89,759,800
ニコン	157,800	1,583.00	249,797,400
トプコン	53,000	1,769.00	93,757,000
オリンパス	671,600	2,201.00	1,478,191,600
理研計器	7,700	7,710.00	59,367,000
タムロン	6,700	6,370.00	42,679,000
HOYA	214,800	18,395.00	3,951,246,000
シード	2,500	718.00	1,795,000
ノーリツ鋼機	10,300	3,030.00	31,209,000
A & Dホロンホールディングス	15,900	2,144.00	34,089,600
朝日インテック	132,900	2,884.00	383,283,600
シチズン時計	100,400	1,073.00	107,729,200
リズム	1,100	3,695.00	4,064,500
大研医器	4,200	524.00	2,200,800
メニコン	37,500	1,700.00	63,750,000
シンシア	600	519.00	311,400
松風	4,900	2,720.00	13,328,000
セイコーグループ	15,200	3,190.00	48,488,000
ニプロ	91,000	1,262.50	114,887,500
KYORITSU	7,200	195.00	1,404,000
中本パックス	1,600	1,732.00	2,771,200
スノーピーク	15,600	1,249.00	19,484,400
パラマウントベッドホールディングス	22,700	2,503.00	56,818,100
トランザクション	7,200	2,501.00	18,007,200
粧美堂	1,300	690.00	897,000
ニホンフラッシュ	10,200	965.00	9,843,000
前田工織	9,200	3,395.00	31,234,000
永大産業	5,700	282.00	1,607,400

アートネイチャー	10,400	784.00	8,153,600
フルヤ金属	2,600	9,840.00	25,584,000
バンダイナムコホールディングス	298,900	2,984.50	892,067,050
アイフィスジャパン	1,300	624.00	811,200
SHOEI	24,700	2,106.00	52,018,200
フランスベッドホールディングス	12,900	1,319.00	17,015,100
パイロットコーポレーション	15,400	3,937.00	60,629,800
萩原工業	7,300	1,501.00	10,957,300
フジシールインターナショナル	22,100	2,074.00	45,835,400
タカラトミー	49,700	2,395.50	119,056,350
広済堂ホールディングス	24,600	650.00	15,990,000
エステールホールディングス	1,100	646.00	710,600
タカノ	1,800	1,059.00	1,906,200
プロネクサス	9,400	1,226.00	11,524,400
ホクシン	3,700	116.00	429,200
ウッドワン	1,800	1,027.00	1,848,600
TOPPANホールディングス	134,100	3,585.00	480,748,500
大日本印刷	119,200	4,589.00	547,008,800
共同印刷	3,100	3,130.00	9,703,000
NISSHA	18,700	1,534.00	28,685,800
光村印刷	400	1,671.00	668,400
TAKARA & COMPANY	7,000	2,795.00	19,565,000
アシックス	93,000	6,038.00	561,534,000
ツツミ	1,900	2,089.00	3,969,100
ローランド	8,000	4,895.00	39,160,000
小松ウオール工業	4,200	3,315.00	13,923,000
ヤマハ	68,800	3,179.00	218,715,200
河合楽器製作所	3,200	3,395.00	10,864,000
クリナップ	10,900	754.00	8,218,600
ピジョン	69,500	1,596.00	110,922,000
キングジム	9,600	878.00	8,428,800
リンテック	21,900	2,995.00	65,590,500
イトーキ	22,400	1,986.00	44,486,400
任天堂	688,900	8,401.00	5,787,448,900
三菱鉛筆	15,500	2,427.00	37,618,500
タカラスタANDARD	23,000	1,840.00	42,320,000
コクヨ	44,600	2,461.50	109,782,900
ナカバヤシ	11,700	534.00	6,247,800
グローブライド	9,800	2,025.00	19,845,000
オカムラ	32,800	2,204.00	72,291,200
美津濃	10,800	5,230.00	56,484,000
東京電力ホールディングス	983,600	779.30	766,519,480

中部電力	402,100	1,895.00	761,979,500
関西電力	421,300	1,950.00	821,535,000
中国電力	189,600	995.20	188,689,920
北陸電力	111,600	718.40	80,173,440
東北電力	287,300	979.00	281,266,700
四国電力	101,600	1,046.00	106,273,600
九州電力	251,500	1,141.50	287,087,250
北海道電力	105,400	643.20	67,793,280
沖縄電力	27,900	1,080.00	30,132,000
電源開発	89,600	2,474.00	221,670,400
エフオン	7,100	408.00	2,896,800
イーレックス	19,400	751.00	14,569,400
レノバ	29,100	1,203.00	35,007,300
東京瓦斯	230,700	3,276.00	755,773,200
大阪瓦斯	221,000	3,041.00	672,061,000
東邦瓦斯	47,200	2,910.00	137,352,000
北海道瓦斯	6,500	2,266.00	14,729,000
広島ガス	23,100	383.00	8,847,300
西部ガスホールディングス	11,200	1,864.00	20,876,800
静岡ガス	22,200	890.00	19,758,000
メタウォーター	13,100	2,223.00	29,121,300
SBSホールディングス	9,700	2,400.00	23,280,000
東武鉄道	119,900	3,823.00	458,377,700
相鉄ホールディングス	39,000	2,717.50	105,982,500
東急	306,000	1,764.50	539,937,000
京浜急行電鉄	135,000	1,299.50	175,432,500
小田急電鉄	180,400	2,084.50	376,043,800
京王電鉄	52,500	4,190.00	219,975,000
京成電鉄	70,300	7,369.00	518,040,700
富士急行	13,400	3,855.00	51,657,000
東日本旅客鉄道	200,500	8,955.00	1,795,477,500
西日本旅客鉄道	129,400	6,210.00	803,574,000
東海旅客鉄道	420,300	3,775.00	1,586,632,500
西武ホールディングス	132,000	2,162.00	285,384,000
鴻池運輸	18,600	1,797.00	33,424,200
西日本鉄道	29,100	2,393.50	69,650,850
ハマキョウレックス	8,800	3,805.00	33,484,000
サカイ引越センター	12,100	2,594.00	31,387,400
近鉄グループホールディングス	108,900	4,458.00	485,476,200
阪急阪神ホールディングス	145,300	4,296.00	624,208,800
南海電気鉄道	48,600	2,900.00	140,940,000
京阪ホールディングス	60,000	3,442.00	206,520,000



神戸電鉄	3,000	2,825.00	8,475,000
名古屋鉄道	112,400	2,120.50	238,344,200
山陽電気鉄道	8,200	2,113.00	17,326,600
アルプス物流	8,700	1,923.00	16,730,100
ヤマトホールディングス	139,500	2,390.00	333,405,000
山九	27,700	5,316.00	147,253,200
丸運	2,800	278.00	778,400
丸全昭和運輸	6,700	4,515.00	30,250,500
センコーグループホールディングス	57,700	1,067.00	61,565,900
トナミホールディングス	2,400	4,365.00	10,476,000
ニッコンホールディングス	34,900	3,178.00	110,912,200
日本石油輸送	500	2,835.00	1,417,500
福山通運	12,400	4,205.00	52,142,000
セイノーホールディングス	61,300	2,255.50	138,262,150
エスライングループ本社	1,400	871.00	1,219,400
神奈川中央交通	3,100	3,020.00	9,362,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	27,800	1,421.00	39,503,800
C & F ロジホールディングス	10,500	1,780.00	18,690,000
九州旅客鉄道	77,000	3,370.00	259,490,000
S Gホールディングス	182,900	1,924.50	351,991,050
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	37,000	8,137.00	301,069,000
日本郵船	312,400	4,845.00	1,513,578,000
商船三井	236,600	5,351.00	1,266,046,600
川崎汽船	87,500	7,167.00	627,112,500
N Sユナイテッド海運	6,000	5,220.00	31,320,000
飯野海運	40,600	1,337.00	54,282,200
共栄タンカー	1,500	1,095.00	1,642,500
乾汽船	13,500	1,031.00	13,918,500
日本航空	267,500	2,750.50	735,758,750
A N Aホールディングス	296,400	3,226.00	956,186,400
パスコ	900	1,856.00	1,670,400
ランコム	3,200	6,360.00	20,352,000
日新	8,300	2,858.00	23,721,400
三菱倉庫	26,800	4,597.00	123,199,600
三井倉庫ホールディングス	10,200	4,565.00	46,563,000
住友倉庫	29,400	2,578.00	75,793,200
澁澤倉庫	4,600	3,045.00	14,007,000
東陽倉庫	1,300	1,513.00	1,966,900
日本トランスシティ	21,900	620.00	13,578,000
ケイヒン	900	1,916.00	1,724,400
中央倉庫	5,400	1,146.00	6,188,400
川西倉庫	900	1,154.00	1,038,600

安田倉庫	7,400	1,194.00	8,835,600
ファイブホールディングス	700	1,263.00	884,100
東洋埠頭	1,400	1,382.00	1,934,800
上組	50,300	3,427.00	172,378,100
サンリツ	1,200	777.00	932,400
キムラユニティー	2,300	1,576.00	3,624,800
キューソー流通システム	4,200	924.00	3,880,800
東海運	2,800	296.00	828,800
エーアイティー	6,800	1,857.00	12,627,600
内外トランスライン	4,400	2,394.00	10,533,600
日本コンセプト	4,000	1,878.00	7,512,000
NEC ネットエスアイ	42,700	2,410.00	102,907,000
クロスキャット	6,400	1,208.00	7,731,200
システナ	165,600	288.00	47,692,800
デジタルアーツ	6,900	4,535.00	31,291,500
日鉄ソリューションズ	18,700	4,940.00	92,378,000
キューブシステム	6,300	1,108.00	6,980,400
コア	4,900	1,865.00	9,138,500
手間いらず	1,900	2,752.00	5,228,800
ラクーンホールディングス	9,100	692.00	6,297,200
ソリトンシステムズ	5,600	1,376.00	7,705,600
ソフトクリエイトホールディングス	9,000	1,869.00	16,821,000
T I S	119,700	3,374.00	403,867,800
テクミラホールディングス	2,300	460.00	1,058,000
グリー	29,400	527.00	15,493,800
GMOペパボ	1,400	1,312.00	1,836,800
コーエーテクモホールディングス	68,600	1,851.50	127,012,900
三菱総合研究所	5,400	4,880.00	26,352,000
電算	600	1,509.00	905,400
A G S	2,000	886.00	1,772,000
ファインデックス	8,700	1,119.00	9,735,300
ブレインパッド	8,200	1,356.00	11,119,200
K L a b	20,100	355.00	7,135,500
ポールトゥウィンホールディングス	18,700	515.00	9,630,500
ネクソン	244,800	2,507.50	613,836,000
アイスタイル	32,500	438.00	14,235,000
エムアップホールディングス	13,400	1,029.00	13,788,600
エイチーム	6,500	561.00	3,646,500
エニグモ	14,000	349.00	4,886,000
テクノスジャパン	4,300	601.00	2,584,300
コロブラ	42,500	582.00	24,735,000
ブロードリーフ	52,000	552.00	28,704,000

クロス・マーケティンググループ	2,300	581.00	1,336,300
デジタルハーツホールディングス	6,800	1,040.00	7,072,000
メディアドゥ	4,800	1,249.00	5,995,200
じげん	31,900	516.00	16,460,400
ブイキューブ	13,200	328.00	4,329,600
エンカレッジ・テクノロジー	1,200	630.00	756,000
サイバーリンクス	1,900	870.00	1,653,000
フィックスターズ	12,400	1,744.00	21,625,600
CARTA HOLDINGS	5,100	1,447.00	7,379,700
オブティム	9,900	1,050.00	10,395,000
セレス	4,400	1,605.00	7,062,000
SHIFT	7,300	26,220.00	191,406,000
ティーガイア	11,400	2,125.00	24,225,000
セック	1,200	5,250.00	6,300,000
テクマトリックス	20,000	1,985.00	39,700,000
プロシップ	4,900	1,476.00	7,232,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	28,500	2,251.50	64,167,750
GMOペイメントゲートウェイ	21,900	8,910.00	195,129,000
ザッパラス	1,200	434.00	520,800
システムリサーチ	3,500	3,355.00	11,742,500
インターネットイニシアティブ	52,300	2,875.00	150,362,500
さくらインターネット	12,300	5,270.00	64,821,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	2,724.00	8,989,200
SRAホールディングス	5,600	3,875.00	21,700,000
システムインテグレータ	1,500	432.00	648,000
朝日ネット	11,800	629.00	7,422,200
eBASE	15,400	739.00	11,380,600
アバントグループ	13,800	1,343.00	18,533,400
アドソル日進	4,600	1,635.00	7,521,000
ODKソリューションズ	1,100	603.00	663,300
フリービット	5,700	1,628.00	9,279,600
コムチュア	15,800	1,967.00	31,078,600
アステリア	8,600	642.00	5,521,200
アイル	5,100	3,570.00	18,207,000
マークライنز	5,900	3,165.00	18,673,500
メディカル・データ・ビジョン	13,100	570.00	7,467,000
gumi	16,200	396.00	6,415,200
ショーケース	1,200	313.00	375,600
モバイルファクトリー	1,000	733.00	733,000
テラスカイ	4,700	1,495.00	7,026,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,300	1,895.00	11,938,500
PCIホールディングス	1,800	941.00	1,693,800

アイピーシー	800	425.00	340,000
ネオジャパン	3,700	1,080.00	3,996,000
P R T I M E S	2,200	2,026.00	4,457,200
ラクス	51,800	2,138.50	110,774,300
ランドコンピュータ	2,400	870.00	2,088,000
ダブルスタンダード	3,300	1,839.00	6,068,700
オープンドア	6,400	783.00	5,011,200
アカツキ	5,200	2,400.00	12,480,000
ベネフィットジャパン	400	1,253.00	501,200
U b i c o mホールディングス	3,400	1,381.00	4,695,400
カナミックネットワーク	11,800	496.00	5,852,800
ノムラシステムコーポレーション	5,400	114.00	615,600
チェンジホールディングス	23,800	1,448.00	34,462,400
シンクロ・フード	3,100	720.00	2,232,000
オークネット	4,000	2,160.00	8,640,000
キャピタル・アセット・プランニング	1,000	751.00	751,000
セグエグループ	1,500	2,065.00	3,097,500
エイトレッド	700	1,423.00	996,100
マクロミル	21,500	781.00	16,791,500
ビーグリー	1,000	1,139.00	1,139,000
オロ	4,000	2,651.00	10,604,000
ユーザーローカル	4,000	2,278.00	9,112,000
テモナ	1,200	235.00	282,000
ニーズウェル	2,700	909.00	2,454,300
マネーフォワード	24,300	5,712.00	138,801,600
サインポスト	1,900	553.00	1,050,700
S u n A s t e r i s k	7,800	1,010.00	7,878,000
プラスアルファ・コンサルティング	6,500	2,541.00	16,516,500
電算システムホールディングス	4,800	2,652.00	12,729,600
A p p i e r G r o u p	37,400	1,804.00	67,469,600
ビジョナル	8,400	9,220.00	77,448,000
ソルクシーズ	4,000	345.00	1,380,000
フェイス	1,400	460.00	644,000
プロトコーポレーション	12,000	1,313.00	15,756,000
ハイマックス	3,400	1,396.00	4,746,400
野村総合研究所	242,400	4,071.00	986,810,400
C Eホールディングス	2,500	543.00	1,357,500
日本システム技術	3,400	3,410.00	11,594,000
インテージホールディングス	12,400	1,799.00	22,307,600
東邦システムサイエンス	3,300	1,276.00	4,210,800
ソースネクスト	50,200	134.00	6,726,800
インフォコム	14,100	2,229.00	31,428,900

シンプレクス・ホールディングス	16,500	2,568.00	42,372,000
HEROZ	3,700	1,794.00	6,637,800
ラクスル	26,400	1,053.00	27,799,200
メルカリ	53,200	2,121.50	112,863,800
I P S	3,200	2,270.00	7,264,000
F I G	5,700	311.00	1,772,700
システムサポート	4,200	1,950.00	8,190,000
イーソル	7,900	992.00	7,836,800
東海ソフト	800	1,157.00	925,600
ウイングアーク1st	11,400	2,934.00	33,447,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,900	1,164.00	3,375,600
サーバーワークス	2,200	3,875.00	8,525,000
東名	400	2,424.00	969,600
ヴィッツ	500	756.00	378,000
トピラシステムズ	1,400	854.00	1,195,600
S a n s a n	35,900	1,493.00	53,598,700
L i n k - U	1,200	672.00	806,400
ギフトィ	9,600	1,446.00	13,881,600
メドレー	14,700	4,815.00	70,780,500
ベース	3,800	3,485.00	13,243,000
J M D C	18,700	3,575.00	66,852,500
フォーカスシステムズ	7,400	1,117.00	8,265,800
クレスコ	8,700	1,967.00	17,112,900
フジ・メディア・ホールディングス	105,100	1,954.50	205,417,950
オービック	36,600	22,515.00	824,049,000
ジャストシステム	15,700	2,568.00	40,317,600
T D C ソフト	9,600	2,071.00	19,881,600
L I N E ヤフー	1,557,800	423.20	659,260,960
トレンドマイクロ	51,700	7,090.00	366,553,000
I D ホールディングス	7,400	1,651.00	12,217,400
日本オラクル	20,900	11,475.00	239,827,500
アルファシステムズ	2,900	3,465.00	10,048,500
フューチャー	23,300	1,667.00	38,841,100
C A C H o l d i n g s	5,900	1,792.00	10,572,800
S B テクノロジー	4,600	2,131.00	9,802,600
トーセ	1,400	711.00	995,400
オービックビジネスコンサルタント	15,400	6,940.00	106,876,000
アイティフォー	14,000	1,377.00	19,278,000
東計電算	3,000	3,495.00	10,485,000
エクスネット	700	1,107.00	774,900
大塚商会	54,300	6,482.00	351,972,600
サイボウズ	15,100	2,005.00	30,275,500

電通総研	13,300	5,300.00	70,490,000
A C C E S S	11,400	943.00	10,750,200
デジタルガレージ	17,500	3,390.00	59,325,000
E Mシステムズ	18,300	718.00	13,139,400
ウェザーニューズ	3,400	5,120.00	17,408,000
C I J	18,200	696.00	12,667,200
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,950.00	7,110,000
日本エンタープライズ	5,100	121.00	617,100
WOWOW	8,300	1,127.00	9,354,100
スカラ	10,200	711.00	7,252,200
インテリジェント ウェイブ	2,600	1,159.00	3,013,400
A N Y C O L O R	11,600	3,110.00	36,076,000
I M A G I C A G R O U P	11,000	682.00	7,502,000
ネットワンシステムズ	44,200	2,557.50	113,041,500
システムソフト	38,300	57.00	2,183,100
アルゴグラフィックス	10,000	4,200.00	42,000,000
マーベラス	17,800	738.00	13,136,400
エイベックス	18,600	1,293.00	24,049,800
B I P R O G Y	35,800	4,588.00	164,250,400
都築電気	5,800	2,387.00	13,844,600
T B Sホールディングス	55,000	4,253.00	233,915,000
日本テレビホールディングス	96,900	2,222.00	215,311,800
朝日放送グループホールディングス	10,300	685.00	7,055,500
テレビ朝日ホールディングス	26,600	2,087.00	55,514,200
スカパーJ S A Tホールディングス	85,000	883.00	75,055,000
テレビ東京ホールディングス	7,900	3,030.00	23,937,000
日本BS放送	1,800	897.00	1,614,600
ビジョン	16,500	1,119.00	18,463,500
スマートバリュー	1,400	411.00	575,400
U S E N - N E X T H O L D I N G S	12,300	4,450.00	54,735,000
ワイヤレスゲート	2,200	213.00	468,600
日本通信	107,800	213.00	22,961,400
クロップス	700	1,006.00	704,200
日本電信電話	32,551,000	182.00	5,924,282,000
K D D I	845,600	4,644.00	3,926,966,400
ソフトバンク	1,760,900	1,973.00	3,474,255,700
光通信	11,000	25,575.00	281,325,000
エムティーアイ	7,500	734.00	5,505,000
G M Oインターネットグループ	40,400	2,573.00	103,949,200
ファイバーゲート	5,900	997.00	5,882,300
アイドママーケティングコミュニケーション	1,400	232.00	324,800
K A D O K A W A	57,900	3,200.00	185,280,000

学研ホールディングス	18,200	980.00	17,836,000
ゼンリン	18,700	849.00	15,876,300
昭文社ホールディングス	2,100	365.00	766,500
インプレスホールディングス	5,000	176.00	880,000
アイネット	6,600	2,109.00	13,919,400
松竹	5,700	10,070.00	57,399,000
東宝	60,900	4,931.00	300,297,900
東映	3,600	20,080.00	72,288,000
NTTデータグループ	286,100	2,341.50	669,903,150
ピー・シー・エー	6,300	1,631.00	10,275,300
ビジネスブレイン太田昭和	4,300	2,260.00	9,718,000
D T S	23,100	3,835.00	88,588,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	50,000	6,750.00	337,500,000
シーイーシー	13,800	1,809.00	24,964,200
カプコン	97,900	5,978.00	585,246,200
アイ・エス・ピー	5,600	1,378.00	7,716,800
ジャステック	6,700	1,360.00	9,112,000
S C S K	76,600	2,682.50	205,479,500
N S W	4,400	2,945.00	12,958,000
アイネス	8,100	1,487.00	12,044,700
T K C	17,400	3,670.00	63,858,000
富士ソフト	22,000	6,020.00	132,440,000
N S D	39,100	2,743.00	107,251,300
コナミグループ	41,000	9,645.00	395,445,000
福井コンピュータホールディングス	6,800	2,615.00	17,782,000
J B C Cホールディングス	7,300	3,615.00	26,389,500
ミロク情報サービス	10,000	1,926.00	19,260,000
ソフトバンクグループ	539,800	8,370.00	4,518,126,000
高千穂交易	3,000	3,950.00	11,850,000
オルバヘルスケアホールディングス	900	1,860.00	1,674,000
伊藤忠食品	2,600	7,780.00	20,228,000
エレマテック	10,400	1,793.00	18,647,200
あらた	17,700	3,215.00	56,905,500
トーメンデバイス	1,700	5,160.00	8,772,000
東京エレクトロン デバイス	11,500	6,720.00	77,280,000
円谷フィールズホールディングス	19,800	1,597.00	31,620,600
双日	128,500	3,798.00	488,043,000
アルフレッサ ホールディングス	115,900	2,327.00	269,699,300
横浜冷凍	31,500	1,071.00	33,736,500
ラサ商事	4,000	1,840.00	7,360,000
アルコニックス	15,200	1,395.00	21,204,000
神戸物産	89,300	3,791.00	338,536,300

ハイパー	1,200	305.00	366,000
あい ホールディングス	18,500	2,388.00	44,178,000
ディーブイエックス	1,400	1,072.00	1,500,800
ダイワボウホールディングス	51,100	2,678.00	136,845,800
マクニカホールディングス	27,300	8,075.00	220,447,500
ラクト・ジャパン	4,500	2,224.00	10,008,000
グリムス	4,900	1,937.00	9,491,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,200	1,291.00	19,623,200
八洲電機	9,300	1,333.00	12,396,900
メディアスホールディングス	7,400	732.00	5,416,800
レスターホールディングス	9,800	2,945.00	28,861,000
ジオリーブグループ	1,200	1,337.00	1,604,400
大光	2,700	625.00	1,687,500
OCHIホールディングス	1,200	1,584.00	1,900,800
TOKAIホールディングス	62,700	1,010.00	63,327,000
黒谷	1,400	606.00	848,400
Cominix	1,000	852.00	852,000
三洋貿易	13,000	1,334.00	17,342,000
ビューティガレージ	3,700	2,241.00	8,291,700
ウイン・パートナーズ	7,800	1,283.00	10,007,400
ミタチ産業	1,400	1,142.00	1,598,800
シップヘルスケアホールディングス	41,500	2,156.50	89,494,750
明治電機工業	4,300	1,486.00	6,389,800
デリカフーズホールディングス	2,200	583.00	1,282,600
スターティアホールディングス	1,300	1,533.00	1,992,900
コメダホールディングス	28,300	2,737.00	77,457,100
ピーバンドットコム	700	380.00	266,000
アセンテック	4,400	625.00	2,750,000
富士興産	1,400	2,073.00	2,902,200
協栄産業	500	2,940.00	1,470,000
フルサト・マルカホールディングス	10,300	2,261.00	23,288,300
ヤマエグループホールディングス	6,500	2,466.00	16,029,000
小野建	11,300	1,750.00	19,775,000
南陽	1,100	2,480.00	2,728,000
佐島電機	5,600	2,449.00	13,714,400
エコートレーディング	1,000	1,264.00	1,264,000
伯東	6,600	5,980.00	39,468,000
コンドーテック	8,900	1,268.00	11,285,200
中山福	2,800	368.00	1,030,400
ナガイレーベン	14,600	2,325.00	33,945,000
三菱食品	10,700	5,070.00	54,249,000
松田産業	8,800	2,386.00	20,996,800



第一興商	44,700	1,914.50	85,578,150
メディバルホールディングス	119,600	2,361.50	282,435,400
S P K	5,100	2,060.00	10,506,000
萩原電気ホールディングス	5,000	4,775.00	23,875,000
アズワン	18,100	5,216.00	94,409,600
スズデン	4,000	2,210.00	8,840,000
尾家産業	1,200	1,713.00	2,055,600
シモジマ	7,700	1,285.00	9,894,500
ドウシシャ	10,700	2,147.00	22,972,900
小津産業	1,100	1,670.00	1,837,000
高速	6,100	2,387.00	14,560,700
たけびし	4,400	1,974.00	8,685,600
リックス	1,600	3,775.00	6,040,000
丸文	10,300	1,506.00	15,511,800
ハピネット	9,800	3,190.00	31,262,000
橋本総業ホールディングス	4,600	1,304.00	5,998,400
日本ライフライン	33,900	1,276.00	43,256,400
タカショー	10,100	502.00	5,070,200
I D O M	30,600	900.00	27,540,000
進和	7,100	2,436.00	17,295,600
エスケイジャパン	1,300	711.00	924,300
ダイトロン	4,600	2,887.00	13,280,200
シークス	16,500	1,572.00	25,938,000
田中商事	1,500	817.00	1,225,500
オーハシテクニカ	5,800	1,740.00	10,092,000
白銅	3,200	2,584.00	8,268,800
ダイコー通産	500	1,245.00	622,500
伊藤忠商事	776,000	6,648.00	5,158,848,000
丸紅	962,500	2,442.50	2,350,906,250
高島	3,500	1,355.00	4,742,500
長瀬産業	52,900	2,465.00	130,398,500
蝶理	6,600	3,075.00	20,295,000
豊田通商	101,100	9,243.00	934,467,300
三共生興	16,000	764.00	12,224,000
兼松	48,300	2,372.00	114,567,600
ツカモトコーポレーション	800	1,291.00	1,032,800
三井物産	869,800	6,373.00	5,543,235,400
日本紙パルプ商事	5,500	5,020.00	27,610,000
カメイ	12,300	1,879.00	23,111,700
東都水産	300	6,180.00	1,854,000
O U Gホールディングス	800	2,620.00	2,096,000
スターゼン	8,000	2,797.00	22,376,000

山善	35,000	1,286.00	45,010,000
椿本興業	1,900	6,870.00	13,053,000
住友商事	698,700	3,554.00	2,483,179,800
内田洋行	4,700	7,920.00	37,224,000
三菱商事	2,287,500	3,154.00	7,214,775,000
第一実業	10,900	1,992.00	21,712,800
キャノンマーケティングジャパン	26,700	4,310.00	115,077,000
西華産業	4,500	2,977.00	13,396,500
佐藤商事	8,000	1,754.00	14,032,000
菱洋エレクトロ	10,900	3,950.00	43,055,000
東京産業	10,600	727.00	7,706,200
ユアサ商事	9,000	5,050.00	45,450,000
神鋼商事	2,900	7,180.00	20,822,000
トルク	2,800	277.00	775,600
阪和興業	20,700	5,550.00	114,885,000
正栄食品工業	7,700	4,625.00	35,612,500
カナデン	8,000	1,536.00	12,288,000
RYODEN	9,300	2,617.00	24,338,100
岩谷産業	26,300	7,348.00	193,252,400
ナイス	1,600	1,618.00	2,588,800
ニチモウ	1,600	2,120.00	3,392,000
極東貿易	6,900	2,150.00	14,835,000
アステナホールディングス	21,700	474.00	10,285,800
三愛オブリ	27,800	1,886.00	52,430,800
稲畑産業	22,800	3,165.00	72,162,000
G S Iクレオス	6,200	2,384.00	14,780,800
明和産業	13,700	713.00	9,768,100
クワザワホールディングス	1,900	774.00	1,470,600
ワキタ	19,100	1,595.00	30,464,500
東邦ホールディングス	31,900	3,236.00	103,228,400
サンゲツ	26,600	3,620.00	96,292,000
ミツウロコグループホールディングス	14,700	1,492.00	21,932,400
シナネンホールディングス	3,200	4,180.00	13,376,000
伊藤忠エネクス	28,600	1,516.00	43,357,600
サンリオ	32,700	7,885.00	257,839,500
サンワテクノス	5,900	2,303.00	13,587,700
リョーサン	8,200	5,100.00	41,820,000
新光商事	15,500	1,221.00	18,925,500
トーホー	4,500	2,944.00	13,248,000
三信電気	4,700	2,312.00	10,866,400
東陽テクニカ	11,700	1,490.00	17,433,000
モスフードサービス	17,000	3,485.00	59,245,000

加賀電子	10,500	6,440.00	67,620,000
ソーダニッカ	6,000	1,185.00	7,110,000
立花エレテック	7,700	3,125.00	24,062,500
フォーバル	4,500	1,326.00	5,967,000
PALTAC	15,600	4,305.00	67,158,000
三谷産業	20,200	390.00	7,878,000
西本Wismettacホールディングス	2,900	6,690.00	19,401,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	2,402.00	960,800
コア商事ホールディングス	6,500	715.00	4,647,500
KPPグループホールディングス	29,900	627.00	18,747,300
ヤマタネ	5,100	2,558.00	13,045,800
丸紅建材リース	400	2,780.00	1,112,000
泉州電業	5,800	3,780.00	21,924,000
トラスコ中山	24,200	2,322.00	56,192,400
オートボックスセブン	40,200	1,663.00	66,852,600
モリト	8,300	1,409.00	11,694,700
加藤産業	14,300	4,735.00	67,710,500
北恵	1,300	847.00	1,101,100
イエローハット	18,300	1,900.00	34,770,000
JKホールディングス	8,900	1,030.00	9,167,000
日伝	7,100	2,726.00	19,354,600
北沢産業	3,200	329.00	1,052,800
杉本商事	5,200	2,255.00	11,726,000
因幡電機産業	29,900	3,520.00	105,248,000
東テク	3,900	6,930.00	27,027,000
ミスミグループ本社	174,300	2,083.00	363,066,900
アルテック	2,800	261.00	730,800
タキヒヨー	1,200	1,214.00	1,456,800
蔵王産業	900	2,620.00	2,358,000
スズケン	43,900	4,904.00	215,285,600
ジェコス	6,900	1,174.00	8,100,600
グローセル	11,800	748.00	8,826,400
ローソン	24,600	10,260.00	252,396,000
サンエー	8,900	4,550.00	40,495,000
カワチ薬品	9,100	2,708.00	24,642,800
エービーシー・マート	50,600	2,560.00	129,536,000
ハードオフコーポレーション	3,600	1,792.00	6,451,200
アスクル	28,000	2,021.00	56,588,000
ゲオホールディングス	13,100	1,947.00	25,505,700
アダストリア	14,000	3,470.00	48,580,000
くら寿司	13,600	4,075.00	55,420,000
キャンドウ	4,200	2,713.00	11,394,600

I Kホールディングス	2,500	375.00	937,500
パルグループホールディングス	22,800	2,261.00	51,550,800
エディオン	45,900	1,503.00	68,987,700
サーラコーポレーション	24,600	802.00	19,729,200
ワッツ	2,900	608.00	1,763,200
ハローズ	5,300	4,370.00	23,161,000
あみやき亭	2,900	4,325.00	12,542,500
大黒天物産	3,600	8,600.00	30,960,000
ハニーズホールディングス	9,300	1,623.00	15,093,900
ファーマライズホールディングス	1,600	652.00	1,043,200
アルペン	9,700	1,993.00	19,332,100
ハブ	2,000	874.00	1,748,000
クオールホールディングス	16,000	1,630.00	26,080,000
ジーンズホールディングス	6,900	3,915.00	27,013,500
ビックカメラ	61,600	1,280.00	78,848,000
D C Mホールディングス	61,200	1,401.00	85,741,200
MonotaRO	163,900	1,529.50	250,685,050
東京一番フーズ	1,700	524.00	890,800
きちりホールディングス	1,400	970.00	1,358,000
J . フロント リテイリング	132,700	1,540.00	204,358,000
ドトール・日レスホールディングス	20,600	2,065.00	42,539,000
マツキヨココカラ&カンパニー	210,100	2,641.50	554,979,150
ブロンコビリー	6,900	3,265.00	22,528,500
Z O Z O	73,700	3,398.00	250,432,600
トレジャー・ファクトリー	5,800	1,464.00	8,491,200
物語コーポレーション	19,300	4,585.00	88,490,500
三越伊勢丹ホールディングス	194,600	2,129.50	414,400,700
H a m e e	4,300	1,092.00	4,695,600
マーケットエンタープライズ	700	825.00	577,500
ウエルシアホールディングス	60,000	2,638.50	158,310,000
クリエイティブSDホールディングス	16,400	3,175.00	52,070,000
丸善C H Iホールディングス	6,800	328.00	2,230,400
ミサワ	1,400	624.00	873,600
ティーライフ	900	1,401.00	1,260,900
チムニー	1,600	1,428.00	2,284,800
シュッピン	10,300	1,070.00	11,021,000
オイシックス・ラ・大地	15,700	1,415.00	22,215,500
ネクステージ	26,500	2,282.00	60,473,000
ジョイフル本田	33,700	1,998.00	67,332,600
鳥貴族ホールディングス	4,300	4,055.00	17,436,500
ホットランド	9,000	1,826.00	16,434,000
すかいらーくホールディングス	157,900	2,171.00	342,800,900

SFPホールディングス	6,300	2,087.00	13,148,100
綿半ホールディングス	9,200	1,504.00	13,836,800
ヨシックスホールディングス	2,000	2,824.00	5,648,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,500	996.00	32,370,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,700	594.00	3,385,800
BEENOS	4,900	1,651.00	8,089,900
あさひ	10,400	1,277.00	13,280,800
日本調剤	8,100	1,421.00	11,510,100
コスモス薬品	9,800	15,030.00	147,294,000
トーエル	2,600	799.00	2,077,400
セブン&アイ・ホールディングス	397,900	6,302.00	2,507,565,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	78,200	1,081.00	84,534,200
ツルハホールディングス	24,300	11,025.00	267,907,500
サンマルクホールディングス	9,400	2,203.00	20,708,200
フェリシモ	1,400	922.00	1,290,800
トリドールホールディングス	32,400	4,217.00	136,630,800
TOKYO BASE	14,700	293.00	4,307,100
ウイルプラスホールディングス	1,300	977.00	1,270,100
JMホールディングス	8,800	2,474.00	21,771,200
サツドラホールディングス	2,400	803.00	1,927,200
アレンザホールディングス	8,900	1,141.00	10,154,900
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,743.00	5,577,600
パロックジャパンリミテッド	9,200	826.00	7,599,200
クスリのアオキホールディングス	34,800	3,041.00	105,826,800
力の源ホールディングス	5,200	1,663.00	8,647,600
FOOD & LIFE COMPANIES	61,700	3,070.00	189,419,000
メディカルシステムネットワーク	12,200	623.00	7,600,600
はるやまホールディングス	2,900	604.00	1,751,600
ノジマ	33,600	1,714.00	57,590,400
カッパ・クリエイト	18,100	1,660.00	30,046,000
ライトオン	3,900	412.00	1,606,800
良品計画	126,100	2,313.50	291,732,350
パリミキホールディングス	6,900	414.00	2,856,600
アドヴァングループ	11,300	1,175.00	13,277,500
アルビス	3,900	2,613.00	10,190,700
コナカ	5,600	420.00	2,352,000
ハウス オブ ローゼ	800	1,626.00	1,300,800
G-7ホールディングス	12,800	1,457.00	18,649,600
イオン北海道	34,200	923.00	31,566,600
コジマ	19,500	741.00	14,449,500

ヒマラヤ	1,900	942.00	1,789,800
コーナン商事	14,200	3,890.00	55,238,000
エコス	4,400	2,346.00	10,322,400
ワタミ	12,200	1,030.00	12,566,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	233,100	3,483.00	811,887,300
西松屋チェーン	22,900	2,104.00	48,181,600
ゼンショーホールディングス	58,800	6,472.00	380,553,600
幸楽苑ホールディングス	8,000	1,360.00	10,880,000
ハークスレイ	2,100	889.00	1,866,900
サイゼリヤ	17,100	4,965.00	84,901,500
V Tホールディングス	44,400	514.00	22,821,600
魚力	3,800	2,387.00	9,070,600
フジ・コーポレーション	5,700	1,747.00	9,957,900
ユナイテッドアローズ	13,700	1,770.00	24,249,000
ハイデイ日高	17,200	2,693.00	46,319,600
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	4,700	146.00	686,200
コロワイド	49,600	2,230.00	110,608,000
壱番屋	9,200	6,050.00	55,660,000
P L A N T	1,300	1,652.00	2,147,600
スギホールディングス	23,300	7,208.00	167,946,400
薬王堂ホールディングス	5,800	2,800.00	16,240,000
スクロール	17,500	922.00	16,135,000
ヨンドシーホールディングス	10,600	1,957.00	20,744,200
木曽路	17,600	2,583.00	45,460,800
S R S ホールディングス	19,300	1,183.00	22,831,900
千趣会	21,200	291.00	6,169,200
リテールパートナーズ	17,300	1,748.00	30,240,400
上新電機	10,900	2,379.00	25,931,100
日本瓦斯	61,300	2,341.00	143,503,300
ロイヤルホールディングス	20,300	2,431.00	49,349,300
いなげや	11,300	1,309.00	14,791,700
チヨダ	11,400	886.00	10,100,400
ライフコーポレーション	12,100	3,710.00	44,891,000
リンガーハット	14,900	2,348.00	34,985,200
M r M a x H D	15,300	628.00	9,608,400
A O K I ホールディングス	23,600	1,140.00	26,904,000
オークワ	16,700	863.00	14,412,100
コメリ	17,900	3,350.00	59,965,000
青山商事	24,800	1,603.00	39,754,400
しまむら	27,200	8,173.00	222,305,600
はせがわ	3,200	347.00	1,110,400

高島屋	79,800	2,284.50	182,303,100
松屋	19,700	963.00	18,971,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,100	1,804.00	92,184,400
近鉄百貨店	5,100	2,487.00	12,683,700
丸井グループ	76,700	2,467.50	189,257,250
アクシアル リテイリング	7,900	4,040.00	31,916,000
イオン	391,400	3,565.00	1,395,341,000
イズミ	20,500	3,725.00	76,362,500
平和堂	19,300	2,056.00	39,680,800
フジ	17,800	1,973.00	35,119,400
ヤオコー	13,100	8,449.00	110,681,900
ゼビオホールディングス	15,900	964.00	15,327,600
ケーズホールディングス	81,800	1,231.00	100,695,800
Olympicグループ	2,800	558.00	1,562,400
日産東京販売ホールディングス	8,200	505.00	4,141,000
シルバーライフ	2,500	842.00	2,105,000
Genky DrugStores	5,100	6,220.00	31,722,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,000	1,268.00	1,268,000
ブックオフグループホールディングス	5,800	1,233.00	7,151,400
ギフトホールディングス	5,000	2,861.00	14,305,000
アインホールディングス	16,000	4,725.00	75,600,000
元気寿司	6,600	3,510.00	23,166,000
ヤマダホールディングス	355,700	432.10	153,697,970
アークランズ	34,500	1,663.00	57,373,500
ニトリホールディングス	42,000	21,720.00	912,240,000
グルメ杵屋	9,600	1,108.00	10,636,800
愛眼	3,800	181.00	687,800
ケーユーホールディングス	5,700	1,176.00	6,703,200
吉野家ホールディングス	42,600	3,191.00	135,936,600
松屋フーズホールディングス	5,500	5,590.00	30,745,000
サガミホールディングス	17,500	1,501.00	26,267,500
関西フードマーケット	8,000	1,605.00	12,840,000
王将フードサービス	8,600	7,740.00	66,564,000
ミニストップ	8,400	1,631.00	13,700,400
アークス	21,300	3,045.00	64,858,500
パローホールディングス	22,100	2,436.00	53,835,600
ベルク	5,800	6,560.00	38,048,000
大庄	4,700	1,302.00	6,119,400
ファーストリテイリング	51,900	41,950.00	2,177,205,000
サンドラッグ	39,000	4,445.00	173,355,000
サックスパー ホールディングス	10,100	861.00	8,696,100
ヤマザワ	1,300	1,261.00	1,639,300

やまや	1,100	3,360.00	3,696,000	
ペルーナ	28,200	615.00	17,343,000	
いよぎんホールディングス	127,900	1,084.00	138,643,600	
しずおかフィナンシャルグループ	238,700	1,437.50	343,131,250	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	90,500	1,117.50	101,133,750	
楽天銀行	37,400	2,659.00	99,446,600	
京都フィナンシャルグループ	136,200	2,591.00	352,894,200	
島根銀行	1,400	527.00	737,800	
じもとホールディングス	4,200	543.00	2,280,600	
めぶきフィナンシャルグループ	533,200	441.00	235,141,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,800	4,110.00	56,718,000	
九州フィナンシャルグループ	208,000	957.80	199,222,400	
ゆうちょ銀行	1,180,900	1,538.50	1,816,814,650	
富山第一銀行	34,100	882.00	30,076,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	576,600	726.80	419,072,880	
西日本フィナンシャルホールディングス	60,600	1,626.00	98,535,600	
三十三フィナンシャルグループ	9,600	1,936.00	18,585,600	
第四北越フィナンシャルグループ	16,900	4,215.00	71,233,500	
ひろぎんホールディングス	152,900	1,039.50	158,939,550	
おきなわフィナンシャルグループ	9,200	2,493.00	22,935,600	
十六フィナンシャルグループ	13,900	4,225.00	58,727,500	
北國フィナンシャルホールディングス	11,300	4,690.00	52,997,000	
プロクレアホールディングス	12,300	1,831.00	22,521,300	
あいちフィナンシャルグループ	16,500	2,615.00	43,147,500	
あおぞら銀行	77,200	2,404.50	185,627,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,544,300	1,475.50	9,656,114,650	
りそなホールディングス	1,253,000	809.80	1,014,679,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	385,800	2,956.00	1,140,424,800	
三井住友フィナンシャルグループ	764,000	8,001.00	6,112,764,000	
千葉銀行	299,500	1,173.50	351,463,250	
群馬銀行	208,500	781.00	162,838,500	
武蔵野銀行	14,400	2,763.00	39,787,200	
千葉興業銀行	17,800	833.00	14,827,400	
筑波銀行	47,200	246.00	11,611,200	
七十七銀行	31,300	3,685.00	115,340,500	
秋田銀行	7,200	2,051.00	14,767,200	
山形銀行	11,900	1,105.00	13,149,500	
岩手銀行	6,800	2,513.00	17,088,400	
東邦銀行	85,000	318.00	27,030,000	
東北銀行	2,300	1,199.00	2,757,700	
ふくおかフィナンシャルグループ	93,600	3,636.00	340,329,600	
スルガ銀行	94,700	776.00	73,487,200	



八十二銀行	230,600	888.30	204,841,980
山梨中央銀行	12,000	1,724.00	20,688,000
大垣共立銀行	20,500	2,063.00	42,291,500
福井銀行	9,600	1,772.00	17,011,200
清水銀行	4,300	1,574.00	6,768,200
富山銀行	800	1,785.00	1,428,000
滋賀銀行	17,900	3,975.00	71,152,500
南都銀行	16,200	2,697.00	43,691,400
百五銀行	101,100	606.00	61,266,600
紀陽銀行	38,400	1,820.00	69,888,000
ほくほくフィナンシャルグループ	66,500	1,686.50	112,152,250
山陰合同銀行	67,300	1,024.00	68,915,200
鳥取銀行	1,600	1,401.00	2,241,600
百十四銀行	10,600	2,677.00	28,376,200
四国銀行	15,800	1,065.00	16,827,000
阿波銀行	15,100	2,518.00	38,021,800
大分銀行	6,500	2,632.00	17,108,000
宮崎銀行	6,500	2,722.00	17,693,000
佐賀銀行	6,300	1,907.00	12,014,100
琉球銀行	22,900	1,126.00	25,785,400
セブン銀行	336,800	299.40	100,837,920
みずほフィナンシャルグループ	1,450,500	2,727.00	3,955,513,500
高知銀行	1,600	983.00	1,572,800
山口フィナンシャルグループ	105,400	1,500.50	158,152,700
名古屋銀行	7,000	5,890.00	41,230,000
北洋銀行	162,800	344.00	56,003,200
大光銀行	1,500	1,380.00	2,070,000
愛媛銀行	14,500	1,093.00	15,848,500
トマト銀行	1,700	1,207.00	2,051,900
京葉銀行	45,100	713.00	32,156,300
栃木銀行	53,700	305.00	16,378,500
北日本銀行	3,600	2,122.00	7,639,200
東和銀行	19,700	662.00	13,041,400
福島銀行	5,000	238.00	1,190,000
大東銀行	2,100	744.00	1,562,400
トモニホールディングス	87,300	403.00	35,181,900
フィデアホールディングス	11,100	1,590.00	17,649,000
池田泉州ホールディングス	149,100	364.00	54,272,400
F P G	36,400	1,829.00	66,575,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	17,500	886.00	15,505,000
マーキュリアホールディングス	2,500	749.00	1,872,500
S B I ホールディングス	157,400	3,943.00	620,628,200

ジャフコ グループ	32,100	1,743.00	55,950,300
大和証券グループ本社	832,500	1,084.50	902,846,250
野村ホールディングス	1,807,200	836.30	1,511,361,360
岡三証券グループ	94,500	731.00	69,079,500
丸三証券	35,800	966.00	34,582,800
東洋証券	28,800	368.00	10,598,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	127,700	570.00	72,789,000
光世証券	1,200	652.00	782,400
水戸証券	31,300	474.00	14,836,200
いちよし証券	20,200	792.00	15,998,400
松井証券	53,000	847.00	44,891,000
マネックスグループ	105,400	868.00	91,487,200
極東証券	14,300	1,016.00	14,528,800
岩井コスモホールディングス	12,300	2,187.00	26,900,100
アイザワ証券グループ	15,600	1,118.00	17,440,800
マネーパートナーズグループ	5,200	301.00	1,565,200
スパークス・グループ	12,000	1,827.00	21,924,000
かんぽ生命保険	109,400	2,653.00	290,238,200
F P パートナー	2,100	6,770.00	14,217,000
S O M P O ホールディングス	161,700	8,718.00	1,409,700,600
アニコム ホールディングス	36,500	586.00	21,389,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	240,600	7,249.00	1,744,109,400
第一生命ホールディングス	525,100	3,311.00	1,738,606,100
東京海上ホールディングス	1,062,200	4,321.00	4,589,766,200
T & D ホールディングス	288,600	2,470.50	712,986,300
アドバンスクリエイト	6,200	1,024.00	6,348,800
全国保証	28,100	5,515.00	154,971,500
あんしん保証	3,200	258.00	825,600
イントラスト	2,200	811.00	1,784,200
日本モーゲージサービス	3,200	530.00	1,696,000
C a s a	2,200	821.00	1,806,200
S B I アルヒ	10,600	899.00	9,529,400
プレミアグループ	18,200	1,797.00	32,705,400
ネットプロテクションズホールディングス	36,800	194.00	7,139,200
クレディセゾン	68,200	2,862.00	195,188,400
芙蓉総合リース	9,900	13,745.00	136,075,500
みずほリース	18,000	5,390.00	97,020,000
東京センチュリー	80,500	1,585.50	127,632,750
日本証券金融	39,700	1,635.00	64,909,500
アイフル	158,800	428.00	67,966,400
リコーリース	10,200	5,100.00	52,020,000
イオンフィナンシャルサービス	61,900	1,340.00	82,946,000

アコム	192,400	388.50	74,747,400
ジャックス	11,500	5,540.00	63,710,000
オリエントコーポレーション	35,300	1,072.00	37,841,600
オリックス	655,100	3,096.00	2,028,189,600
三菱HCキャピタル	479,100	1,039.00	497,784,900
九州リースサービス	2,200	1,276.00	2,807,200
日本取引所グループ	280,400	3,797.00	1,064,678,800
イー・ギャランティ	17,600	1,938.00	34,108,800
アサックス	2,500	748.00	1,870,000
NECキャピタルソリューション	5,300	3,710.00	19,663,000
Robot Home	32,300	160.00	5,168,000
大東建託	39,400	17,290.00	681,226,000
いちご	124,900	398.00	49,710,200
日本駐車場開発	116,000	181.00	20,996,000
スター・マイカ・ホールディングス	13,200	531.00	7,009,200
SREホールディングス	4,800	3,325.00	15,960,000
ADワークスグループ	12,100	231.00	2,795,100
ヒューリック	250,900	1,521.50	381,744,350
野村不動産ホールディングス	59,900	3,711.00	222,288,900
三重交通グループホールディングス	23,700	602.00	14,267,400
サムティ	17,300	2,493.00	43,128,900
ディア・ライフ	18,800	921.00	17,314,800
地主	8,400	2,109.00	17,715,600
プレサンスコーポレーション	17,300	1,652.00	28,579,600
ハウスコム	1,200	964.00	1,156,800
JPMC	6,600	1,210.00	7,986,000
サンセイランディック	1,800	1,023.00	1,841,400
フージャースホールディングス	16,600	1,059.00	17,579,400
オープンハウスグループ	39,500	4,923.00	194,458,500
東急不動産ホールディングス	323,500	982.20	317,741,700
飯田グループホールディングス	103,200	1,946.50	200,878,800
イーランド	1,000	1,570.00	1,570,000
ムゲンエステート	3,500	1,364.00	4,774,000
And Doホールディングス	6,500	1,113.00	7,234,500
シーアールイー	6,300	1,310.00	8,253,000
ケイアイスター不動産	5,300	3,675.00	19,477,500
グッドコムアセット	10,600	748.00	7,928,800
ジェイ・エス・ビー	5,500	2,680.00	14,740,000
ロードスターキャピタル	7,200	2,214.00	15,940,800
テンポイノベーション	1,800	912.00	1,641,600
フェイスネットワーク	1,500	1,478.00	2,217,000
霞ヶ関キャピタル	2,600	12,910.00	33,566,000

パーク24	70,000	1,734.50	121,415,000
パラカ	4,000	1,960.00	7,840,000
三井不動産	497,100	4,051.00	2,013,752,100
三菱地所	702,600	2,120.00	1,489,512,000
平和不動産	17,600	3,980.00	70,048,000
東京建物	94,100	2,178.00	204,949,800
京阪神ビルディング	19,000	1,585.00	30,115,000
住友不動産	155,500	4,614.00	717,477,000
テオオーシー	19,800	678.00	13,424,400
レオパレス21	107,500	419.00	45,042,500
スターツコーポレーション	15,600	2,983.00	46,534,800
フジ住宅	14,300	714.00	10,210,200
空港施設	14,400	601.00	8,654,400
明和地所	5,000	1,080.00	5,400,000
ゴールドクレスト	8,900	2,226.00	19,811,400
エスリード	5,200	3,340.00	17,368,000
日神グループホールディングス	18,100	508.00	9,194,800
日本エスコン	20,100	987.00	19,838,700
MIRARTHホールディングス	49,400	489.00	24,156,600
AVANTIA	3,100	893.00	2,768,300
イオンモール	56,000	1,828.00	102,368,000
毎日コムネット	2,300	732.00	1,683,600
ファースト住建	2,300	1,104.00	2,539,200
カチタス	29,100	1,959.00	57,006,900
トーセイ	18,100	2,034.00	36,815,400
穴吹興産	1,300	2,083.00	2,707,900
サンフロンティア不動産	16,200	1,698.00	27,507,600
FJネクストホールディングス	11,700	1,170.00	13,689,000
インテリックス	1,200	550.00	660,000
ランドビジネス	1,700	265.00	450,500
サンネクスタグループ	2,000	966.00	1,932,000
グランディハウス	7,300	642.00	4,686,600
日本空港ビルデング	38,100	5,832.00	222,199,200
明豊ファシリティワークス	2,700	936.00	2,527,200
LIFULL	39,300	166.00	6,523,800
MIXI	24,100	2,429.00	58,538,900
ジェイエイシーリクルートメント	40,800	746.00	30,436,800
日本M&Aセンターホールディングス	179,000	1,021.00	182,759,000
メンバーズ	4,000	925.00	3,700,000
中広	1,200	406.00	487,200
UTグループ	14,500	3,345.00	48,502,500
アイティメディア	4,400	1,945.00	8,558,000

ケアネット	17,400	666.00	11,588,400
E・Jホールディングス	6,700	1,686.00	11,296,200
オープンアップグループ	33,700	2,186.00	73,668,200
コシダカホールディングス	33,800	914.00	30,893,200
アルトナー	1,900	2,461.00	4,675,900
パソナグループ	13,700	2,698.00	36,962,600
C D S	1,300	1,710.00	2,223,000
リンクアンドモチベーション	32,300	606.00	19,573,800
エス・エム・エス	39,400	2,582.50	101,750,500
サニーサイドアップグループ	2,000	653.00	1,306,000
パーソルホールディングス	1,142,600	222.90	254,685,540
リニカル	3,600	447.00	1,609,200
クックパッド	32,300	128.00	4,134,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,700	732.00	1,976,400
学情	5,800	1,876.00	10,880,800
スタジオアリス	5,700	2,065.00	11,770,500
エプコ	1,600	900.00	1,440,000
N J S	2,500	2,733.00	6,832,500
総合警備保障	187,600	816.40	153,156,640
カカクコム	74,200	1,705.50	126,548,100
アイロムグループ	4,500	1,830.00	8,235,000
セントケア・ホールディング	7,700	922.00	7,099,400
サイネックス	1,100	827.00	909,700
ルネサンス	8,500	1,074.00	9,129,000
ディップ	17,300	2,709.00	46,865,700
デジタルホールディングス	6,000	1,148.00	6,888,000
新日本科学	10,300	1,630.00	16,789,000
キャリアデザインセンター	1,100	1,773.00	1,950,300
ベネフィット・ワン	39,100	2,168.50	84,788,350
エムスリー	221,700	2,059.00	456,480,300
ツカダ・グローバルホールディング	3,200	400.00	1,280,000
アウトソーシング	72,100	1,729.00	124,660,900
ウェルネット	4,700	540.00	2,538,000
ワールドホールディングス	5,100	2,494.00	12,719,400
ディー・エヌ・エー	40,000	1,260.50	50,420,000
博報堂D Yホールディングス	143,200	1,448.50	207,425,200
ぐるなび	21,600	293.00	6,328,800
タカミヤ	15,600	523.00	8,158,800
ファンコミュニケーションズ	16,200	403.00	6,528,600
ライク	4,300	1,550.00	6,665,000
A o b a - B B T	2,300	388.00	892,400
エスプール	32,800	313.00	10,266,400

WDBホールディングス	5,800	2,290.00	13,282,000
ティア	3,300	463.00	1,527,900
CDG	700	1,239.00	867,300
アドウェイズ	15,800	465.00	7,347,000
バリューコマース	10,000	1,161.00	11,610,000
インフォマート	116,900	378.00	44,188,200
JPホールディングス	29,100	478.00	13,909,800
エコナックホールディングス	5,600	139.00	778,400
CLホールディングス	2,900	1,006.00	2,917,400
プレステージ・インターナショナル	50,700	603.00	30,572,100
アミューズ	6,400	1,499.00	9,593,600
ドリームインキュベータ	3,800	3,040.00	11,552,000
クイック	7,900	2,415.00	19,078,500
TAC	3,300	191.00	630,300
電通グループ	110,300	4,283.00	472,414,900
イオンファンタジー	4,100	2,511.00	10,295,100
シーティーエス	13,500	735.00	9,922,500
NEXYZ Group	1,800	641.00	1,153,800
H.U.グループホールディングス	32,900	2,719.50	89,471,550
アルプス技研	10,700	2,933.00	31,383,100
日本空調サービス	12,300	895.00	11,008,500
オリエンタルランド	593,600	5,385.00	3,196,536,000
ダスキン	25,000	3,355.00	83,875,000
明光ネットワークジャパン	13,900	731.00	10,160,900
ファルコホールディングス	5,100	2,307.00	11,765,700
ラウンドワン	105,800	701.00	74,165,800
リゾートトラスト	48,800	2,512.50	122,610,000
ビー・エム・エル	13,900	2,730.00	37,947,000
リソー教育	58,100	233.00	13,537,300
早稲田アカデミー	6,300	1,610.00	10,143,000
ユー・エス・エス	125,900	2,612.00	328,850,800
東京個別指導学院	13,700	449.00	6,151,300
サイバーエージェント	248,100	1,053.50	261,373,350
楽天グループ	961,500	767.30	737,758,950
クリーク・アンド・リバー社	5,700	1,944.00	11,080,800
SBIグローバルアセットマネジメント	21,500	733.00	15,759,500
テー・オー・ダブリュー	22,600	374.00	8,452,400
山田コンサルティンググループ	5,300	1,751.00	9,280,300
セントラルスポーツ	4,300	2,443.00	10,504,900
フルキャストホールディングス	10,800	1,514.00	16,351,200
エン・ジャパン	18,300	2,742.00	50,178,600
リソルホールディングス	500	5,950.00	2,975,000

テクノプロ・ホールディングス	65,700	3,260.00	214,182,000
アトラグループ	1,500	174.00	261,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,900	1,345.00	7,935,500
K e e P e r 技研	7,000	6,540.00	45,780,000
ファーストロジック	1,500	501.00	751,500
三機サービス	1,000	1,361.00	1,361,000
G u n o s y	9,200	692.00	6,366,400
デザインワン・ジャパン	2,500	130.00	325,000
イー・ガーディアン	4,400	1,347.00	5,926,800
リブセンス	3,000	236.00	708,000
ジャパンマテリアル	34,400	2,668.00	91,779,200
ベクトル	13,900	1,231.00	17,110,900
ウチヤマホールディングス	2,600	364.00	946,400
チャーム・ケア・コーポレーション	9,500	1,331.00	12,644,500
キャリアリンク	4,200	2,649.00	11,125,800
I B J	8,800	582.00	5,121,600
アサンテ	5,700	1,674.00	9,541,800
バリューHR	9,900	1,334.00	13,206,600
M & A キャピタルパートナーズ	9,200	2,475.00	22,770,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,400	1,060.00	4,664,000
E R I ホールディングス	1,500	1,882.00	2,823,000
アビスト	800	3,165.00	2,532,000
シグマクシス・ホールディングス	15,300	1,732.00	26,499,600
ウィルグループ	9,500	1,138.00	10,811,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	7,300	141.00	1,029,300
メドピア	10,100	803.00	8,110,300
レアジョブ	1,200	928.00	1,113,600
リクルートホールディングス	830,400	5,936.00	4,929,254,400
エラン	15,000	940.00	14,100,000
土木管理総合試験所	2,900	328.00	951,200
日本郵政	1,318,200	1,406.00	1,853,389,200
ベルシステム24ホールディングス	12,100	1,782.00	21,562,200
鎌倉新書	9,900	605.00	5,989,500
S M N	1,600	379.00	606,400
グローバルキッズCOMPANY	1,200	628.00	753,600
エアトリ	8,300	1,593.00	13,221,900
アトラエ	6,900	477.00	3,291,300
ストライク	4,800	5,260.00	25,248,000
ソラスト	31,200	527.00	16,442,400
セラク	3,600	1,157.00	4,165,200
インソース	24,600	802.00	19,729,200
バイカレント・コンサルティング	82,500	3,134.00	258,555,000

Orchestra Holdings	2,600	1,105.00	2,873,000
アイモバイル	15,400	460.00	7,084,000
キャリアインデックス	2,600	177.00	460,200
MS - Japan	3,700	1,195.00	4,421,500
船場	1,200	1,275.00	1,530,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	36,400	2,225.00	80,990,000
フルテック	900	1,142.00	1,027,800
GameWith	2,400	304.00	729,600
MS&Consulting	1,000	594.00	594,000
ウェルビー	5,800	1,086.00	6,298,800
エル・ティー・エス	1,400	2,660.00	3,724,000
ミダックホールディングス	6,900	1,582.00	10,915,800
キュービーネットホールディングス	5,500	1,326.00	7,293,000
RPAホールディングス	15,900	256.00	4,070,400
スプリックス	1,700	806.00	1,370,200
マネジメントソリューションズ	4,900	2,868.00	14,053,200
プロレド・パートナーズ	3,200	358.00	1,145,600
テノ・ホールディングス	1,000	504.00	504,000
フロンティア・マネジメント	2,900	1,855.00	5,379,500
コプロ・ホールディングス	1,700	1,789.00	3,041,300
ギークス	1,000	474.00	474,000
アンビスホールディングス	12,100	2,486.00	30,080,600
カーブスホールディングス	30,900	741.00	22,896,900
フォーラムエンジニアリング	14,700	978.00	14,376,600
Fast Fitness Japan	4,000	966.00	3,864,000
ダイレクトマーケティングミックス	12,000	312.00	3,744,000
ポピンズ	1,800	1,400.00	2,520,000
LITALICO	8,800	2,127.00	18,717,600
コンフィデンス・インターワークス	500	1,616.00	808,000
アドバンテッジリスクマネジメント	2,900	409.00	1,186,100
リログループ	56,300	1,308.50	73,668,550
東祥	8,000	795.00	6,360,000
ID&Eホールディングス	6,800	3,765.00	25,602,000
ビーウィズ	2,900	1,782.00	5,167,800
TREホールディングス	21,600	1,213.00	26,200,800
人・夢・技術グループ	4,300	1,737.00	7,469,100
NISSOホールディングス	9,900	823.00	8,147,700
大栄環境	20,500	2,675.00	54,837,500
日本管財ホールディングス	11,800	2,579.00	30,432,200
M&A総研ホールディングス	5,400	6,700.00	36,180,000
エイチ・アイ・エス	32,700	1,670.00	54,609,000
ラックランド	5,200	2,580.00	13,416,000



共立メンテナンス	17,600	6,344.00	111,654,400	
イチネンホールディングス	12,000	1,638.00	19,656,000	
建設技術研究所	5,800	6,040.00	35,032,000	
スペース	7,500	990.00	7,425,000	
燦ホールディングス	10,100	1,024.00	10,342,400	
スバル興業	3,000	3,085.00	9,255,000	
東京テアトル	1,800	1,143.00	2,057,400	
タナベコンサルティンググループ	3,200	1,028.00	3,289,600	
ナガワ	3,100	7,100.00	22,010,000	
東京都競馬	9,400	4,130.00	38,822,000	
カナモト	17,500	2,942.00	51,485,000	
ニシオホールディングス	10,500	3,850.00	40,425,000	
トランス・コスモス	14,000	2,995.00	41,930,000	
乃村工藝社	49,100	883.00	43,355,300	
藤田観光	4,500	6,740.00	30,330,000	
KNT-CTホールディングス	6,700	1,202.00	8,053,400	
トーカイ	10,000	2,122.00	21,220,000	
セコム	114,200	10,950.00	1,250,490,000	
セントラル警備保障	6,100	2,611.00	15,927,100	
丹青社	21,900	805.00	17,629,500	
メイテックグループホールディングス	40,500	3,043.00	123,241,500	
応用地質	10,600	2,366.00	25,079,600	
船井総研ホールディングス	23,400	2,612.00	61,120,800	
進学会ホールディングス	2,000	265.00	530,000	
オオバ	3,600	995.00	3,582,000	
いであ	1,400	2,299.00	3,218,600	
学究社	4,600	2,114.00	9,724,400	
ベネッセホールディングス	37,800	2,595.50	98,109,900	
イオンディライト	12,100	3,530.00	42,713,000	
ナック	9,800	527.00	5,164,600	
ダイセキ	22,900	4,020.00	92,058,000	
ステップ	4,200	2,050.00	8,610,000	
合 計	167,307,000		406,344,248,430	

## (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

	2024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	1,131,042,039
国債証券	347,265,162,290
地方債証券	21,302,814,924
特殊債券	22,525,511,519
社債券	18,950,930,000
未収入金	207,294,540
未収利息	968,353,019
前払費用	42,544,100
流動資産合計	412,393,652,431
資産合計	412,393,652,431
負債の部	
流動負債	
未払金	299,963,700
未払解約金	857,542,127
未払利息	215
流動負債合計	1,157,506,042
負債合計	1,157,506,042
純資産の部	
元本等	
元本	314,899,994,159
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	96,336,152,230
元本等合計	411,236,146,389
純資産合計	411,236,146,389
負債純資産合計	412,393,652,431

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2024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	314,899,994,159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 99,355,000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 1.3059円 (1万口当たり純資産額) (13,059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

	2024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、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引を行っております。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

	2024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	2024年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月22日
期首元本額	292,213,934,672円
期中追加設定元本額	36,404,803,342円
期中一部解約元本額	13,718,743,855円
期末元本額	314,899,994,159円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	768,123,998円
D C日本債券インデックスファンド	1,777,911,432円
D C日本債券インデックスファンドL	44,332,392,810円
D Cバランスファンド3 0	13,650,470,265円
D Cバランスファンド5 0	10,300,774,220円
D Cバランスファンド7 0	3,169,678,057円
日本債券インデックスe	907,772,798円
インデックスコレクション（国内債券）	37,961,789,755円
インデックスコレクション（バランス株式3 0）	73,424,797,056円
インデックスコレクション（バランス株式5 0）	10,366,062,264円
インデックスコレクション（バランス株式7 0）	4,859,925,415円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	56,331,543,846円

区分	2024年 2月21日現在
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	6,779,101,171円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	117,451,346円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	696,054,493円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	115,378,843円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	91,113,065円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	98,422,978円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	2,305,392,498円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,006,256,370円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,821,782,623円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	143,788,414円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	225,110,412円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,871,309,102円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	134,849,034円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	349,048,385円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,082,275,764円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	309,014,483円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	791,672,838円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	52,610,608円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	2,742,553,340円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,343,809,539円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	20,888,524,456円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	423,686,843円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	104,377,507円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	40,156,341円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	510,361,234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）	4,650,556円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024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	1,098,841,680
地方債証券	93,859,410
特殊債券	80,017,594
社債券	63,301,000
合計	1,336,019,684

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第446回利付国債(2年)	905,000,000	904,900,450	
	第447回利付国債(2年)	1,044,000,000	1,043,759,880	
	第448回利付国債(2年)	1,050,000,000	1,049,622,000	
	第449回利付国債(2年)	2,205,000,000	2,203,875,450	
	第450回利付国債(2年)	1,150,000,000	1,149,137,500	

第452回利付国債(2年)	3,720,000,000	3,714,903,600	
第453回利付国債(2年)	630,000,000	628,935,300	
第454回利付国債(2年)	1,020,000,000	1,019,653,200	
第455回利付国債(2年)	400,000,000	399,112,000	
第456回利付国債(2年)	2,060,000,000	2,058,455,000	
第143回利付国債(5年)	2,150,000,000	2,151,956,500	
第144回利付国債(5年)	2,790,000,000	2,791,646,100	
第145回利付国債(5年)	2,605,000,000	2,605,390,750	
第146回利付国債(5年)	2,230,000,000	2,228,974,200	
第147回利付国債(5年)	2,810,000,000	2,802,441,100	
第148回利付国債(5年)	2,750,000,000	2,741,392,500	
第149回利付国債(5年)	3,145,000,000	3,133,678,000	
第150回利付国債(5年)	2,610,000,000	2,599,351,200	
第151回利付国債(5年)	2,110,000,000	2,099,998,600	
第152回利付国債(5年)	1,375,000,000	1,372,470,000	
第153回利付国債(5年)	2,945,000,000	2,927,477,250	
第154回利付国債(5年)	2,650,000,000	2,639,638,500	
第155回利付国債(5年)	910,000,000	912,238,600	
第156回利付国債(5年)	2,060,000,000	2,057,260,200	
第157回利付国債(5年)	760,000,000	758,160,800	
第158回利付国債(5年)	2,210,000,000	2,195,745,500	
第159回利付国債(5年)	390,000,000	386,915,100	
第160回利付国債(5年)	1,720,000,000	1,713,739,200	
第161回利付国債(5年)	900,000,000	900,378,000	
第162回利付国債(5年)	750,000,000	749,317,500	
第163回利付国債(5年)	1,980,000,000	1,987,128,000	
第164回利付国債(5年)	1,640,000,000	1,628,323,200	
第1回利付国債(40年)	270,000,000	314,085,600	
第2回利付国債(40年)	560,000,000	627,984,000	
第3回利付国債(40年)	585,000,000	654,995,250	
第4回利付国債(40年)	665,000,000	743,170,750	
第5回利付国債(40年)	495,000,000	530,783,550	
第6回利付国債(40年)	830,000,000	869,906,400	
第7回利付国債(40年)	990,000,000	990,000,000	
第8回利付国債(40年)	890,000,000	824,807,500	
第9回利付国債(40年)	1,180,000,000	799,391,000	
第10回利付国債(40年)	1,270,000,000	1,008,989,600	
第11回利付国債(40年)	1,080,000,000	823,219,200	
第12回利付国債(40年)	970,000,000	655,884,900	
第13回利付国債(40年)	1,350,000,000	901,125,000	
第14回利付国債(40年)	1,545,000,000	1,099,870,050	
第15回利付国債(40年)	1,861,000,000	1,461,908,550	

第16回利付国債(40年)	1,310,000,000	1,127,412,200	
第338回利付国債(10年)	2,950,000,000	2,962,154,000	
第339回利付国債(10年)	2,970,000,000	2,983,543,200	
第340回利付国債(10年)	2,930,000,000	2,944,269,100	
第341回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,608,268,000	
第342回利付国債(10年)	3,040,000,000	3,037,780,800	
第343回利付国債(10年)	2,995,000,000	2,992,214,650	
第344回利付国債(10年)	3,460,000,000	3,455,986,400	
第345回利付国債(10年)	3,260,000,000	3,255,403,400	
第346回利付国債(10年)	3,455,000,000	3,448,642,800	
第347回利付国債(10年)	2,955,000,000	2,946,696,450	
第348回利付国債(10年)	2,910,000,000	2,898,621,900	
第349回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,173,667,200	
第350回利付国債(10年)	3,750,000,000	3,725,812,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	1,840,000,000	1,825,445,600	
第352回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,643,486,900	
第353回利付国債(10年)	2,860,000,000	2,826,738,200	
第354回利付国債(10年)	2,475,000,000	2,442,948,750	
第355回利付国債(10年)	3,060,000,000	3,018,414,600	
第356回利付国債(10年)	2,700,000,000	2,660,904,000	
第357回利付国債(10年)	2,640,000,000	2,598,604,800	
第358回利付国債(10年)	2,980,000,000	2,929,608,200	
第359回利付国債(10年)	3,100,000,000	3,041,689,000	
第360回利付国債(10年)	3,475,000,000	3,402,754,750	
第361回利付国債(10年)	2,870,000,000	2,804,391,800	
第362回利付国債(10年)	3,150,000,000	3,071,281,500	
第363回利付国債(10年)	3,415,000,000	3,319,653,200	
第364回利付国債(10年)	3,555,000,000	3,446,145,900	
第365回利付国債(10年)	4,255,000,000	4,112,883,000	
第366回利付国債(10年)	3,068,000,000	2,981,543,760	
第367回利付国債(10年)	3,145,000,000	3,047,662,250	
第368回利付国債(10年)	3,975,000,000	3,840,605,250	
第369回利付国債(10年)	3,050,000,000	3,016,846,500	
第370回利付国債(10年)	3,046,000,000	3,006,858,900	
第371回利付国債(10年)	3,440,000,000	3,356,992,800	
第372回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,222,952,700	
第373回利付国債(10年)	780,000,000	771,404,400	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	56,714,500	
第2回利付国債(30年)	100,000,000	111,970,000	
第3回利付国債(30年)	140,000,000	156,427,600	
第4回利付国債(30年)	190,000,000	221,112,500	
第5回利付国債(30年)	180,000,000	202,010,400	

第6回利付国債(30年)	205,000,000	234,118,200
第7回利付国債(30年)	130,000,000	148,045,300
第9回利付国債(30年)	180,000,000	191,988,000
第10回利付国債(30年)	170,000,000	176,779,600
第11回利付国債(30年)	375,000,000	409,972,500
第12回利付国債(30年)	430,000,000	486,201,000
第13回利付国債(30年)	130,000,000	145,802,800
第14回利付国債(30年)	350,000,000	406,357,000
第15回利付国債(30年)	370,000,000	433,910,100
第16回利付国債(30年)	335,000,000	393,403,900
第17回利付国債(30年)	405,000,000	472,136,850
第18回利付国債(30年)	380,000,000	439,534,600
第19回利付国債(30年)	345,000,000	399,351,300
第20回利付国債(30年)	250,000,000	295,180,000
第21回利付国債(30年)	585,000,000	677,962,350
第22回利付国債(30年)	475,000,000	561,725,500
第23回利付国債(30年)	180,000,000	213,010,200
第24回利付国債(30年)	150,000,000	177,613,500
第25回利付国債(30年)	185,000,000	214,653,650
第26回利付国債(30年)	1,210,000,000	1,418,942,800
第27回利付国債(30年)	890,000,000	1,055,878,200
第28回利付国債(30年)	905,000,000	1,073,773,450
第29回利付国債(30年)	880,000,000	1,032,776,800
第30回利付国債(30年)	810,000,000	938,085,300
第31回利付国債(30年)	900,000,000	1,028,898,000
第32回利付国債(30年)	1,275,000,000	1,473,874,500
第33回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,574,865,200
第34回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,534,747,500
第35回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,512,603,300
第36回利付国債(30年)	1,365,000,000	1,504,816,950
第37回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,540,558,000
第38回利付国債(30年)	935,000,000	996,541,700
第39回利付国債(30年)	825,000,000	891,800,250
第40回利付国債(30年)	705,000,000	748,900,350
第41回利付国債(30年)	655,000,000	682,837,500
第42回利付国債(30年)	838,000,000	872,601,020
第43回利付国債(30年)	825,000,000	858,041,250
第44回利付国債(30年)	920,000,000	955,686,800
第45回利付国債(30年)	932,000,000	933,472,560
第46回利付国債(30年)	1,145,000,000	1,145,000,000
第47回利付国債(30年)	1,155,000,000	1,174,600,350
第48回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,018,066,400
第49回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,074,843,000

第50回利付国債（30年）	1,130,000,000	976,173,100	
第51回利付国債（30年）	1,169,000,000	896,903,560	
第52回利付国債（30年）	1,140,000,000	914,576,400	
第53回利付国債（30年）	985,000,000	806,163,400	
第54回利付国債（30年）	925,000,000	790,310,750	
第55回利付国債（30年）	1,005,000,000	856,079,100	
第56回利付国債（30年）	780,000,000	662,407,200	
第57回利付国債（30年）	900,000,000	762,003,000	
第58回利付国債（30年）	1,390,000,000	1,173,299,000	
第59回利付国債（30年）	990,000,000	812,641,500	
第60回利付国債（30年）	940,000,000	806,849,000	
第61回利付国債（30年）	885,000,000	721,682,100	
第62回利付国債（30年）	840,000,000	647,992,800	
第63回利付国債（30年）	920,000,000	687,580,400	
第64回利付国債（30年）	980,000,000	729,492,400	
第65回利付国債（30年）	560,000,000	415,195,200	
第66回利付国債（30年）	970,000,000	716,315,900	
第67回利付国債（30年）	1,070,000,000	832,492,100	
第68回利付国債（30年）	840,000,000	651,184,800	
第69回利付国債（30年）	1,185,000,000	940,676,700	
第70回利付国債（30年）	1,190,000,000	941,444,700	
第71回利付国債（30年）	780,000,000	614,967,600	
第72回利付国債（30年）	1,220,000,000	958,554,000	
第73回利付国債（30年）	1,135,000,000	889,510,850	
第74回利付国債（30年）	1,385,000,000	1,175,075,550	
第75回利付国債（30年）	1,083,000,000	990,706,740	
第76回利付国債（30年）	1,126,000,000	1,053,936,000	
第77回利付国債（30年）	1,062,000,000	1,041,450,300	
第78回利付国債（30年）	1,239,000,000	1,156,544,550	
第79回利付国債（30年）	930,000,000	824,482,200	
第80回利付国債（30年）	1,140,000,000	1,167,018,000	
第81回利付国債（30年）	70,000,000	68,276,600	
第75回利付国債（20年）	360,000,000	368,038,800	
第76回利付国債（20年）	350,000,000	357,063,000	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	296,165,400	
第78回利付国債（20年）	120,000,000	122,926,800	
第79回利付国債（20年）	100,000,000	102,571,000	
第80回利付国債（20年）	250,000,000	256,760,000	
第81回利付国債（20年）	180,000,000	185,407,200	
第82回利付国債（20年）	485,000,000	500,330,850	
第83回利付国債（20年）	470,000,000	486,896,500	
第84回利付国債（20年）	190,000,000	196,484,700	



第 8 5 回利付国債(20年)	360,000,000	374,608,800
第 8 6 回利付国債(20年)	240,000,000	250,730,400
第 8 7 回利付国債(20年)	170,000,000	177,250,500
第 8 8 回利付国債(20年)	290,000,000	304,505,800
第 8 9 回利付国債(20年)	320,000,000	335,264,000
第 9 0 回利付国債(20年)	610,000,000	642,159,200
第 9 1 回利付国債(20年)	310,000,000	327,139,900
第 9 2 回利付国債(20年)	1,190,000,000	1,255,438,100
第 9 3 回利付国債(20年)	400,000,000	422,556,000
第 9 4 回利付国債(20年)	445,000,000	471,455,250
第 9 5 回利付国債(20年)	950,000,000	1,016,528,500
第 9 6 回利付国債(20年)	530,000,000	563,612,600
第 9 7 回利付国債(20年)	570,000,000	610,356,000
第 9 8 回利付国債(20年)	370,000,000	394,882,500
第 9 9 回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,381,448,100
第 1 0 0 回利付国債(20年)	660,000,000	711,862,800
第 1 0 1 回利付国債(20年)	360,000,000	391,190,400
第 1 0 2 回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,167,145,300
第 1 0 3 回利付国債(20年)	920,000,000	999,589,200
第 1 0 4 回利付国債(20年)	260,000,000	280,272,200
第 1 0 5 回利付国債(20年)	730,000,000	788,947,500
第 1 0 6 回利付国債(20年)	400,000,000	434,104,000
第 1 0 7 回利付国債(20年)	500,000,000	541,900,000
第 1 0 8 回利付国債(20年)	925,000,000	993,727,500
第 1 0 9 回利付国債(20年)	642,000,000	691,755,000
第 1 1 0 回利付国債(20年)	515,000,000	560,041,900
第 1 1 1 回利付国債(20年)	450,000,000	493,632,000
第 1 1 2 回利付国債(20年)	880,000,000	960,722,400
第 1 1 3 回利付国債(20年)	1,525,000,000	1,670,942,500
第 1 1 4 回利付国債(20年)	920,000,000	1,011,613,600
第 1 1 5 回利付国債(20年)	370,000,000	408,953,600
第 1 1 6 回利付国債(20年)	330,000,000	365,966,700
第 1 1 7 回利付国債(20年)	935,000,000	1,031,351,750
第 1 1 8 回利付国債(20年)	450,000,000	494,860,500
第 1 1 9 回利付国債(20年)	320,000,000	347,948,800
第 1 2 0 回利付国債(20年)	895,000,000	961,829,650
第 1 2 1 回利付国債(20年)	970,000,000	1,062,877,500
第 1 2 2 回利付国債(20年)	700,000,000	762,538,000
第 1 2 3 回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,311,511,000
第 1 2 4 回利付国債(20年)	650,000,000	718,133,000
第 1 2 5 回利付国債(20年)	670,000,000	751,123,600
第 1 2 6 回利付国債(20年)	590,000,000	653,118,200
第 1 2 7 回利付国債(20年)	670,000,000	737,080,400

第128回利付国債（20年）	960,000,000	1,057,180,800	
第129回利付国債（20年）	560,000,000	612,724,000	
第130回利付国債（20年）	890,000,000	975,155,200	
第131回利付国債（20年）	575,000,000	625,818,500	
第132回利付国債（20年）	600,000,000	653,478,000	
第133回利付国債（20年）	790,000,000	866,353,500	
第134回利付国債（20年）	725,000,000	795,955,750	
第135回利付国債（20年）	580,000,000	632,275,400	
第136回利付国債（20年）	530,000,000	573,449,400	
第137回利付国債（20年）	330,000,000	359,914,500	
第138回利付国債（20年）	460,000,000	494,187,200	
第139回利付国債（20年）	645,000,000	698,341,500	
第140回利付国債（20年）	945,000,000	1,031,458,050	
第141回利付国債（20年）	660,000,000	720,838,800	
第142回利付国債（20年）	780,000,000	858,444,600	
第143回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,430,470,800	
第144回利付国債（20年）	550,000,000	591,310,500	
第145回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,126,057,800	
第146回利付国債（20年）	1,280,000,000	1,399,884,800	
第147回利付国債（20年）	1,605,000,000	1,739,370,600	
第148回利付国債（20年）	1,935,000,000	2,077,686,900	
第149回利付国債（20年）	1,900,000,000	2,039,460,000	
第150回利付国債（20年）	1,960,000,000	2,082,774,400	
第151回利付国債（20年）	1,775,000,000	1,848,485,000	
第152回利付国債（20年）	1,795,000,000	1,867,069,250	
第153回利付国債（20年）	1,585,000,000	1,663,822,050	
第154回利付国債（20年）	1,945,000,000	2,017,801,350	
第155回利付国債（20年）	1,505,000,000	1,525,151,950	
第156回利付国債（20年）	1,435,000,000	1,352,444,450	
第157回利付国債（20年）	1,960,000,000	1,794,850,400	
第158回利付国債（20年）	2,205,000,000	2,088,840,600	
第159回利付国債（20年）	1,810,000,000	1,729,654,100	
第160回利付国債（20年）	840,000,000	810,398,400	
第161回利付国債（20年）	1,630,000,000	1,546,967,800	
第162回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,201,381,900	
第163回利付国債（20年）	1,665,000,000	1,568,862,900	
第164回利付国債（20年）	1,475,000,000	1,365,496,000	
第165回利付国債（20年）	1,535,000,000	1,414,901,600	
第166回利付国債（20年）	810,000,000	765,450,000	
第167回利付国債（20年）	1,300,000,000	1,188,460,000	
第168回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,487,658,800	
第169回利付国債（20年）	1,255,000,000	1,101,664,100	

	第170回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,162,233,800
	第171回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,112,729,600
	第172回利付国債(20年)	790,000,000	695,018,300
	第173回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,181,614,500
	第174回利付国債(20年)	1,525,000,000	1,327,863,250
	第175回利付国債(20年)	1,530,000,000	1,348,909,200
	第176回利付国債(20年)	1,310,000,000	1,149,132,000
	第177回利付国債(20年)	1,425,000,000	1,222,065,750
	第178回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,469,235,300
	第179回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,359,698,500
	第180回利付国債(20年)	1,610,000,000	1,466,436,300
	第181回利付国債(20年)	1,565,000,000	1,446,670,350
	第182回利付国債(20年)	1,565,000,000	1,493,573,400
	第183回利付国債(20年)	1,533,000,000	1,535,284,170
	第184回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,660,960,000
	第185回利付国債(20年)	1,710,000,000	1,617,215,400
	第186回利付国債(20年)	1,430,000,000	1,445,301,000
	第187回利付国債(20年)	330,000,000	321,387,000
	国債証券合計	352,538,000,000	347,265,162,290
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	86,246,000
	第7回東京都公募公債(30年)	200,000,000	234,056,000
	第11回東京都公募公債(20年)	200,000,000	211,910,000
	第16回東京都公募公債(20年)	150,000,000	161,094,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,774,000
	第18回東京都公募公債(20年)	200,000,000	217,402,000
	第20回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,806,000
	第21回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,756,000
	第760回東京都公募公債	140,000,000	139,244,000
	第786回東京都公募公債	200,000,000	197,574,000
	第800回東京都公募公債	300,000,000	293,112,000
	第830回東京都公募公債	100,000,000	96,622,000
	平成27年度第1回北海道公募公債	200,000,000	200,662,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	99,949,000
	平成30年度第3回北海道公募公債	100,000,000	99,123,000
	令和4年度第1回北海道公募公債	100,000,000	96,859,000
	第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	118,301,000
	第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,520,000
	第15回神奈川県公募公債(20年)	300,000,000	327,354,000
	第16回神奈川県公募公債(20年)	600,000,000	661,620,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	300,000,000	324,237,000
	第21回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,334,000
	第243回神奈川県公募公債	100,000,000	97,675,000

第2回大阪府公募公債(20年)	300,000,000	329,301,000	
第183回大阪府公募公債(5年)	240,000,000	238,572,000	
第403回大阪府公募公債(10年)	300,000,000	301,218,000	
第417回大阪府公募公債(10年)	108,000,000	107,908,200	
第423回大阪府公募公債(10年)	300,000,000	298,536,000	
平成19年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	107,042,000	
平成25年度第2回京都府公募公債(15年)	100,000,000	102,672,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,505,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	105,860,000	105,532,892	
令和2年度第1回京都府公募公債(10年)	100,000,000	97,768,000	
令和5年度第6回京都府公募公債	100,000,000	99,576,000	
第3回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	107,007,000	
第4回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,596,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,050,000	
第11回兵庫県公募公債(15年)	200,000,000	202,382,000	
平成28年度第30回兵庫県公募公債	100,000,000	99,801,000	
令和3年度第9回兵庫県公募公債(5年)	100,000,000	99,263,000	
令和5年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	99,230,000	
令和5年度第4回兵庫県公募公債(グリーン bond・10年)	100,000,000	98,838,000	
令和5年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	100,002,000	
第4回静岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,996,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	82,681,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,110,000	
平成27年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	100,330,000	
平成27年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	100,441,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,629,000	
令和4年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	96,739,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	110,158,000	
平成25年度第8回愛知県公募公債(30年)	110,000,000	118,972,700	
平成25年度第17回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	107,205,000	
平成27年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,820,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,556,000	
平成29年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,368,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,711,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,607,000	
	200,000,000	198,354,000	

平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）			
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	97,663,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	97,633,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	153,874,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	108,629,000	
平成27年度第2回広島県公募公債	162,000,000	162,989,820	
平成29年度第7回広島県公募公債	131,440,000	130,514,662	
令和2年度第7回広島県公募公債	100,000,000	97,513,000	
第2回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	99,403,000	
第5回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	107,931,000	
第7回埼玉県公募公債（15年）	400,000,000	373,028,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	100,000,000	92,537,000	
第9回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	83,131,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	183,828,000	
平成29年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	99,711,000	
令和4年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	98,460,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	118,421,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,129,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	227,892,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	103,378,000	
平成29年度第8回福岡県公募公債	200,000,000	198,932,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,866,000	
令和3年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	99,289,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	200,000,000	182,826,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	218,114,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	110,132,000	
第9回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	108,397,000	
平成28年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	99,607,000	
平成29年度第5回千葉県公募公債	120,000,000	119,408,400	
令和元年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	97,598,000	
令和4年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	99,907,000	
平成27年度第3回新潟県公募公債	200,000,000	199,418,000	
平成28年度第1回新潟県公募公債	120,000,000	119,371,200	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	200,000,000	194,512,000	
第13回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	100,466,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	98,880,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,311,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,438,000	

第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,536,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,936,000	
第171回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,636,000	
第175回共同発行市場公募地方債	150,000,000	149,373,000	
第178回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,515,000	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,157,000	
第194回共同発行市場公募地方債	160,000,000	156,995,200	
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,423,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,554,000	
第231回共同発行市場公募地方債	200,000,000	193,762,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	193,498,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,098,000	
平成27年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	100,449,000	
令和3年度第4回奈良県公募公債（5年）	100,000,000	99,286,000	
第7回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	86,098,000	
第10回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	110,007,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	92,058,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	100,000,000	96,878,000	
第3回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	116,930,000	
第13回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	86,163,000	
第495回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	99,711,000	
第522回名古屋市公募公債（10年）	200,000,000	196,920,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	103,007,000	
第6回京都市公募公債（20年）	100,000,000	107,233,000	
平成27年度第5回京都市公募公債	200,000,000	199,838,000	
令和4年度第3回京都市公募公債	200,000,000	196,756,000	
令和4年度第4回京都市公募公債	100,000,000	100,373,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,334,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,217,000	
平成26年度第3回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	105,934,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	77,078,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	102,659,000	
第5回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	118,531,000	
第7回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	117,458,000	
第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	108,215,000	
第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	108,814,000	
平成28年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	99,891,000	
平成29年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	99,592,000	
第55回横浜市公募公債（5年）	100,000,000	99,448,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	96,943,000	
	200,000,000	207,840,000	

	平成25年度第5回札幌市公募公債（15年）			
	第8回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	109,434,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	150,000,000	162,630,000	
	第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	195,190,000	
	第66回川崎市公募公債（5年）	200,000,000	198,728,000	
	第88回川崎市公募公債	100,000,000	100,425,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	400,000,000	424,788,000	
	平成29年度第12回福岡市公募公債	130,000,000	129,080,900	
	平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	99,328,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,428,000	
	令和3年度第3回仙台市公募公債（5年）	135,000,000	133,969,950	
	令和3年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	97,345,000	
	平成27年度第1回三重県公募公債	100,000,000	100,428,000	
	令和3年度第2回三重県公募公債	100,000,000	96,908,000	
	令和5年度第5回福井県公募公債	100,000,000	99,663,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,479,000	
	地方債証券合計	21,012,300,000	21,302,814,924	
特殊債券	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	63,136,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,974,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	156,670,500	
	第21回道路債券	100,000,000	116,617,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	234,560,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,056,000	
	第28回道路債券	300,000,000	353,511,000	
	第33回道路債券	100,000,000	118,818,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,360,000	
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,467,000	
	第42回道路債券	100,000,000	102,186,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,309,000	
	第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,496,000	
	第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,315,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,073,000	
	第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,143,000	

第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,987,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,364,000	
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,397,000	
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,685,000	
第155回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,690,000	
第176回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,908,000	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,231,000	
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,629,000	
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	103,460,000	
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,158,000	
第246回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,743,000	
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,476,000	
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,431,000	
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	100,222,000	
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	99,586,000	
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	99,466,000	
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	299,055,000	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,070,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,593,000	
第307回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,170,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	195,280,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,872,000	
第327回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,562,000	
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	241,746,120	
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	99,166,000	
第400回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	366,820,000	
	100,000,000	108,913,000	



第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）			
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,024,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	219,410,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,965,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	102,084,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,812,000	
第15回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,023,000	
第15回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	329,145,000	
第17回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,330,000	
第17回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,710,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,733,000	
第22回公営企業債券（20年）	200,000,000	212,898,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	400,000,000	429,820,000	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,602,000	
第30回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,702,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	400,000,000	426,880,000	
第70回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,374,000	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,468,000	
第75回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,451,000	
F76回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,006,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,692,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	422,389,300	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,222,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,110,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,622,000	
第96回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,580,000	
第103回政府保証地方公共団体金融機構債券	133,000,000	132,245,890	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	112,444,040	
第107回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,101,000	
第110回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	148,438,500	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,196,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,926,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,398,000	
第33回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,896,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,756,000	

第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,930,000	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,847,000	
第159回都市再生債券	100,000,000	62,462,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	69,037,000	
第169回都市再生債券	100,000,000	72,728,000	
第191回都市再生債券	100,000,000	98,741,000	
第5回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	124,329,000	122,876,837	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,908,000	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	44,338,000	43,805,944	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	54,527,000	53,845,957	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,502,000	10,608,490	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,497,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,078,000	13,533,768	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,649,000	15,265,136	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,942,000	27,823,272	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,163,000	10,245,320	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,985,000	19,796,418	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,981,000	18,729,908	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,194,000	17,854,249	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,678,000	38,864,480	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,920,000	19,956,453	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,511,000	23,232,252	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,384,000	23,264,586	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,146,000	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,756,000	66,568,277	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,228,000	72,933,182	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,717,000	17,317,474	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,313,000	17,900,776	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,246,000	18,876,034	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,588,000	21,243,110	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,713,000	22,417,803	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,404,000	25,179,803	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,298,000	24,054,486	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,458,000	32,963,371	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,977,000	34,806,718	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,375,000	30,083,231	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,802,000	28,259,064	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,399,000	28,872,127	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,491,000	34,350,044	
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,404,000	

第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,578,000	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,344,000	54,790,006	
第 1 0 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,242,000	122,026,350	
第 1 1 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,478,000	62,145,169	
第 1 1 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,272,000	64,365,176	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,138,000	64,411,525	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,647,000	63,741,190	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,015,000	64,314,965	
第 1 1 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,396,000	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,576,000	65,116,909	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,846,000	65,221,038	
第 1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,335,000	64,823,404	
第 1 2 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,865,000	65,953,387	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,502,000	67,361,840	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,870,000	68,474,142	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,525,000	67,347,848	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,675,000	69,240,379	
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,498,000	69,780,471	
第 1 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,158,000	70,645,135	
第 1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,406,000	70,954,305	
第 1 4 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,150,000	70,283,077	
第 1 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,097,000	71,716,856	
第 1 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,428,000	72,783,868	
第 1 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,842,000	73,510,703	
第 1 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	246,534,000	230,070,459	
第 1 5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	245,043,000	230,043,917	
第 1 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,084,000	77,047,325	
	165,442,000	154,775,954	

第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第157回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,261,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,872,000	79,727,908	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,899,000	79,633,564	
第162回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,680,000	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,332,000	80,895,673	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,106,000	81,431,915	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,050,000	81,946,258	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,788,000	81,559,023	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,384,000	165,502,871	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,445,000	83,454,868	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,801,000	84,967,943	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,286,000	172,262,092	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,324,000	87,369,894	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,656,000	88,488,998	
第184回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,811,000	
第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,348,000	179,147,200	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,090,000	94,137,198	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,727,000	95,308,673	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,897,000	96,000,702	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,703,000	96,628,267	
第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,181,000	96,970,428	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,539,000	98,145,829	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,401,000	99,749,897	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	191,142,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	500,000,000	490,910,000	
い第845号商工債	200,000,000	199,230,000	
い第853号商工債	100,000,000	99,245,000	
い第876号商工債	400,000,000	397,672,000	
い第878号商工債	100,000,000	99,223,000	

	第376回信金中金債(5年)	200,000,000	198,876,000	
	第379回信金中金債(5年)	100,000,000	99,337,000	
	第386回信金中金債(5年)	100,000,000	99,178,000	
	第394回信金中金債(5年)	100,000,000	99,148,000	
	第20回アンデス開発公社円貨債券(2023)	200,000,000	199,536,000	
	第34回国際協力機構債券	100,000,000	99,911,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	195,608,000	
	第74回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,528,000	
	第87回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,929,000	
	第102回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,895,000	
	第103回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,831,000	
	第88回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,385,000	
	第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,605,000	
	第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,710,000	
	第103回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,268,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,494,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,970,000	
	第54回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,576,000	
	第56回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,678,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	298,872,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,884,000	
	第66回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,816,000	
	特殊債券合計	22,479,787,000	22,525,511,519	
社債券	第41回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,208,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	300,000,000	298,527,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,138,000	
	第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債(2023)	100,000,000	99,478,000	
	第8回ビー・エヌ・ピー・パリパ円貨社債(2023)	200,000,000	199,180,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,167,000	
	第17回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	100,000,000	99,751,000	
	第12回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,524,000	
	第5回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,660,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	200,000,000	198,482,000	
	第3回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,254,000	
	第2回DM三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,720,000	
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	99,263,000		

第22回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,135,000	
第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,928,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,851,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,657,000	
第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,813,000	
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	98,220,000	
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	99,650,000	
第16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	99,909,000	
第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,449,000	
第19回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,707,000	
第31回レンゴー株式会社無担保社債	100,000,000	99,977,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,778,000	
第22回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,599,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,410,000	
第12回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	98,457,000	
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	99,087,000	
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	99,767,000	
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	81,488,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,118,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	98,063,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	200,000,000	189,826,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	199,510,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,738,000	
第3回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	99,252,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,801,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,293,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,275,000	
第9回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	99,383,000	
第9回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	98,681,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,391,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,139,000	
第14回株式会社L I X I L 無担保社債	100,000,000	99,377,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	98,704,000	
第53回日本精工株式会社無担保社債	100,000,000	99,442,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	97,109,000	

第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	96,288,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,044,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	300,000,000	299,277,000	
第8回TDK株式会社無担保社債	100,000,000	98,990,000	
第15回株式会社デンソー無担保社債	200,000,000	198,690,000	
第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	99,059,000	
第25回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,663,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,423,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	100,317,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,265,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	85,136,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	108,699,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	96,554,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	198,826,000	
第87回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,411,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,340,000	
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	96,770,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	99,321,000	
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	103,075,000	
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	102,859,000	
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,340,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,542,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	97,350,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,236,000	
第28回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,958,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,972,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,457,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,658,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,598,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,660,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,760,000	
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	99,649,000	

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	99,243,000	
第20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	99,886,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,095,000	
第217回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,520,000	
第3回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	94,585,000	
第7回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,531,000	
第82回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,359,000	
第38回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,846,000	
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	98,843,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,574,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,838,000	
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	99,195,000	
第1回損害保険ジャパン株式会社無担保社債	100,000,000	99,355,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	107,722,000	
第78回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	86,678,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	106,625,000	
第118回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,557,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	85,683,000	
第143回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,530,000	
第111回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,615,000	
第3回東急株式会社無担保社債	100,000,000	97,566,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	85,339,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	86,879,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	76,194,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,151,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,684,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,191,000	
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	79,823,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	77,881,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	84,902,000	
第176回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	69,114,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	73,928,000	
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	83,027,000	



第5 1 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,067,000	
第7 1 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,387,000	
第8 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,838,000	
第1 0 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	109,068,000	
第1 3 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,366,000	
第3 1 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	77,661,000	
第5 6 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	79,066,000	
第4 5 回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	197,402,000	
第5 8 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	99,425,000	
第2 5 回K D D I 株式会社無担保社債	200,000,000	196,896,000	
第1 7 回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	96,891,000	
第3 1 回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	85,713,000	
第3 7 回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	83,566,000	
第5 3 5 回中部電力株式会社社債	200,000,000	194,380,000	
第5 0 9 回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,791,000	
第5 1 0 回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,731,000	
第5 3 6 回関西電力株式会社社債	200,000,000	194,018,000	
第5 4 1 回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,598,000	
第5 5 4 回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,950,000	
第3 9 3 回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,454,000	
第4 2 5 回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,288,000	
第4 2 6 回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,951,000	
第4 4 3 回中国電力株式会社社債	200,000,000	199,212,000	
第4 4 5 回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,984,000	
第4 4 8 回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,281,000	
第3 0 7 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,400,000	
第3 2 1 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,578,000	
第3 6 4 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,031,000	
第5 0 8 回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,543,000	
第5 2 1 回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,799,000	
第5 3 5 回東北電力株式会社社債	200,000,000	195,834,000	
第2 9 6 回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,318,000	
第4 6 8 回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,841,000	
第5 0 7 回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,760,000	
第5 1 6 回九州電力株式会社社債	300,000,000	294,348,000	
第3 2 3 回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,937,000	
第3 2 6 回北海道電力株式会社社債	200,000,000	201,200,000	
第3 5 7 回北海道電力株式会社社債	100,000,000	98,429,000	
第3 8 5 回北海道電力株式会社社債	100,000,000	98,995,000	
第5 6 回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	94,981,000	
第5 7 回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,656,000	

第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,561,000	
第8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,086,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,808,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,883,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,441,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	180,162,000	
第66回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,630,000	
第4回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	100,492,000	
第38回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,682,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	95,845,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	84,378,000	
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	99,126,000	
社債券合計	19,400,000,000	18,950,930,000	
合計		410,044,418,733	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,707,321,141
コール・ローン	1,377,107,111
株式	480,556,888,077
投資信託受益証券	82,729,325
投資証券	9,253,953,863
派生商品評価勘定	332,136,216
未収入金	2,962,193
未収配当金	444,115,149
差入委託証拠金	3,153,857,902
流動資産合計	500,911,070,977
資産合計	500,911,070,977
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,057,097
前受金	319,124,804
未払金	23,632,121

	2024年 2月21日現在
項目	金額（円）
未払解約金	399,290,566
未払利息	261
流動負債合計	748,104,849
負債合計	748,104,849
純資産の部	
元本等	
元本	78,589,889,137
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	421,573,076,991
元本等合計	500,162,966,128
純資産合計	500,162,966,128
負債純資産合計	500,911,070,977

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024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) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、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) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金

2024年 2月21日現在	
	株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024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	78,589,889,137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 6.3642円 (1万口当たり純資産額) (63,642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

2024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、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引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

2024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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2024年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月22日
期首元本額	77,030,384,517円
期中追加設定元本額	8,332,198,166円
期中一部解約元本額	6,772,693,546円
期末元本額	78,589,889,137円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,420,472,913円
D C外国株式インデックスファンド	5,160,843,476円
D C外国株式インデックスファンドL	29,890,254,624円
D Cバランスファンド3 0	486,167,944円
D Cバランスファンド5 0	1,119,848,898円
D Cバランスファンド7 0	865,591,406円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	253,576,081円
外国株式インデックスe	4,260,430,555円
インデックスコレクション（外国株式）	18,950,842,844円
インデックスコレクション（バランス株式3 0）	2,641,884,465円
インデックスコレクション（バランス株式5 0）	1,111,742,305円
インデックスコレクション（バランス株式7 0）	1,290,414,275円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,042,907,297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）	1,567,719,629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）	291,453,627円
バランスVA3 0（適格機関投資家専用）	10,988,289円
バランスVA5 0（適格機関投資家専用）	158,125,044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）	20,964,175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）	50,542,747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）	69,008,497円
バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	133,395,116円
バランスVA3 7 . 5（適格機関投資家専用）	121,025,038円
バランスVA5 0 L（適格機関投資家専用）	2,484,663,890円
バランスVA7 5（適格機関投資家専用）	296,927,359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）	56,943,856円
VAポートフォリオ4 0（適格機関投資家専用）	403,492,511円
VAポートフォリオ2 0（適格機関投資家専用）	7,107,218円
バランスVA4 0（適格機関投資家専用）	51,542,171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）	48,854,732円
VAバランス5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	166,882,563円
VAファンド2 5（適格機関投資家専用）	5,545,007円
バランスVA2 5 L（適格機関投資家専用）	36,237,309円
VAバランス2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	107,587,172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）	5,906,104円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024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	3,221,568,459
投資信託受益証券	1,916,069
投資証券	39,654,472
合計	3,259,306,862

(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

（2024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	10,126,749,810	-	10,445,874,614	319,124,804
合計		10,126,749,810	-	10,445,874,614	319,124,804

## （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

（2024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	1,194,793,973	-	1,201,748,288	6,954,315
	アメリカドル	911,979,473	-	916,723,184	4,743,711
	ユーロ	226,487,220	-	228,346,194	1,858,974
	イギリスポンド	56,327,280	-	56,678,910	351,630
合計		1,194,793,973	-	1,201,748,288	6,954,315

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	17,739	30.98	549,554.22	
	BAKER HUGHES CO	56,594	29.05	1,644,055.70	
	CHENIERE ENERGY INC	13,711	161.10	2,208,842.10	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,333	77.65	414,107.45	
	CHEVRON CORP	101,663	154.00	15,656,102.00	
	CONOCOPHILLIPS	68,083	109.54	7,457,811.82	
	COTERRA ENERGY INC	41,058	24.63	1,011,258.54	

DEVON ENERGY CORPORATION	36,666	43.41	1,591,671.06
DIAMONDBACK ENERGY INC	9,733	178.06	1,733,057.98
EOG RESOURCES INC	33,038	113.13	3,737,588.94
EQT CORPORATION	22,739	33.73	766,986.47
EXXON MOBIL	223,505	102.75	22,965,138.75
HALLIBURTON CO	51,295	35.13	1,801,993.35
HESS CORP	15,786	146.68	2,315,490.48
HF SINCLAIR CORP	8,443	59.36	501,176.48
KINDER MORGAN INC	105,760	17.06	1,804,265.60
MARATHON OIL CORP	36,460	23.17	844,778.20
MARATHON PETROLEUM CORP	23,304	164.29	3,828,614.16
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,623	59.56	2,300,385.88
ONEOK INC	31,717	71.69	2,273,791.73
OVINTIV INC	13,202	44.34	585,376.68
PHILLIPS 66	24,974	141.14	3,524,830.36
PIONEER NATURAL RESOURCES	12,982	229.14	2,974,695.48
SCHLUMBERGER	78,329	48.52	3,800,523.08
TARGA RESOURCES CORP	11,099	96.36	1,069,499.64
TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,490.98	521,843.00
VALERO ENERGY CORP	20,196	135.03	2,727,065.88
WILLIAMS COS	67,360	34.11	2,297,649.60
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,269	228.09	2,798,436.21
ALBEMARLE CORP	6,375	114.82	731,977.50
AMCOR PLC	82,838	9.12	755,482.56
AVERY DENNISON CORP	4,953	209.71	1,038,693.63
BALL CORP	17,147	61.88	1,061,056.36
CELANESE CORP-SERIES A	5,419	149.37	809,436.03
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	77.19	801,155.01
CLEVELAND-CLIFFS INC	27,048	19.58	529,599.84
CORTEVA INC	40,775	54.36	2,216,529.00
CROWN HOLDINGS INC	6,218	73.14	454,784.52
DOW INC	38,891	54.71	2,127,726.61
DUPONT DE NEMOURS INC	26,563	67.97	1,805,487.11
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	84.51	529,539.66
ECOLAB INC	14,774	216.39	3,196,945.86
FMC CORP	6,569	50.99	334,953.31
FREEPORT-MCMORAN INC	81,305	38.14	3,100,972.70
INT'L PAPER CO	17,345	35.74	619,910.30
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,928	82.03	1,142,513.84
LINDE PLC	27,416	435.96	11,952,279.36
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,698	96.27	1,414,976.46
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,496	533.14	1,863,857.44

MOSAIC CO/THE	18,682	30.36	567,185.52
NEWMONT CORPORATION	65,758	33.19	2,182,508.02
NUCOR CORP	14,369	183.99	2,643,752.31
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,174	169.61	877,562.14
PPG INDUSTRIES INC	12,407	141.16	1,751,372.12
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	3,200	317.57	1,016,224.00
RPM INTERNATIONAL INC	6,687	108.84	727,813.08
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,583	311.26	4,227,844.58
STEEL DYNAMICS INC	9,667	122.61	1,185,270.87
VULCAN MATERIALS CO	7,535	251.38	1,894,148.30
WESTLAKE CORP	2,096	132.81	278,369.76
WESTROCK CO	14,176	43.78	620,625.28
3 M COMPANY	29,781	91.82	2,734,491.42
AECOM	7,200	87.85	632,520.00
AERCAP HOLDINGS NV	10,161	77.94	791,948.34
ALLEGION PLC	4,638	132.06	612,494.28
AMETEK INC	12,923	174.81	2,259,069.63
AXON ENTERPRISE INC	3,591	267.70	961,310.70
BOEING CO	32,250	203.37	6,558,682.50
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	8,000	182.90	1,463,200.00
CARLISLE COS INC	2,870	346.92	995,660.40
CARRIER GLOBAL CORP	47,961	53.43	2,562,556.23
CATERPILLAR	28,947	313.74	9,081,831.78
CNH INDUSTRIAL NV	57,411	11.94	685,487.34
CUMMINS INC	7,929	261.84	2,076,129.36
DEERE&CO	15,208	357.38	5,435,035.04
DOVER CORP	7,491	160.08	1,199,159.28
EATON CORP	21,840	276.09	6,029,805.60
EMERSON ELECTRIC CO	32,395	104.80	3,394,996.00
FASTENAL CO	31,790	70.08	2,227,843.20
FERGUSON PLC	11,566	202.07	2,337,141.62
FORTIVE CORP	20,480	83.74	1,714,995.20
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	79.32	508,599.84
GENERAL DYNAMICS CORP	12,920	268.93	3,474,575.60
GENERAL ELECTRIC CO	61,157	148.62	9,089,153.34
GRACO INC	8,952	88.01	787,865.52
GRAINGER (WW) INC	2,535	935.15	2,370,605.25
HEICO CORP	2,252	192.57	433,667.64
HEICO CORP-CLASS A	4,228	156.01	659,610.28
HONEYWELL INTL INC	37,375	198.94	7,435,382.50
HOWMET AEROSPACE INC	22,727	63.11	1,434,300.97
HUBBELL INC	2,787	355.35	990,360.45



HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	284.80	567,606.40
IDEX CORP	3,918	230.35	902,511.30
ILLINOIS TOOL WORKS	17,252	255.60	4,409,611.20
INGERSOLL-RAND INC	22,994	86.74	1,994,499.56
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	42.05	403,680.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	39,654	56.63	2,245,606.02
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,469	211.83	2,217,648.27
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	448.86	710,994.24
LOCKHEED MARTIN CORP	12,498	424.27	5,302,526.46
MASCO CORP	12,110	73.97	895,776.70
NORDSON CORP	3,191	264.11	842,775.01
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,890	453.91	3,581,349.90
OTIS WORLDWIDE CORP	23,094	91.02	2,102,015.88
OWENS CORNING	4,965	141.56	702,845.40
PACCAR INC	29,938	107.41	3,215,640.58
PARKER HANNIFIN CORP	6,957	519.53	3,614,370.21
PENTAIR PLC	9,772	74.61	729,088.92
QUANTA SERVICES INC	8,208	209.20	1,717,113.60
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,432	272.62	1,753,491.84
RTX CORP	82,322	90.98	7,489,655.56
SMITH (A.O.) CORP	6,846	79.64	545,215.44
SNAP-ON INC	2,772	269.04	745,778.88
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	88.46	727,406.58
TEXTRON	10,911	84.58	922,852.38
TORO CO	5,600	93.75	525,000.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,377	276.16	3,418,032.32
TRANSDIGM GROUP INC	3,041	1,159.01	3,524,549.41
UNITED RENTALS INC	3,678	643.91	2,368,300.98
VERTIV HOLDINGS CO-A	21,018	62.02	1,303,536.36
WABTEC CORP	10,381	134.40	1,395,206.40
WATSCO INC	2,000	377.91	755,820.00
XYLEM INC	12,709	124.10	1,577,186.90
AUTOMATIC DATA PROCESS	23,247	252.94	5,880,096.18
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,038	145.10	1,021,213.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	6,756	195.16	1,318,500.96
CINTAS CORP	5,087	614.64	3,126,673.68
COPART INC	46,764	48.52	2,268,989.28
DAYFORCE INC	9,041	71.54	646,793.14
EQUIFAX INC	6,976	257.85	1,798,761.60
JACOBS SOLUTIONS INC	6,625	145.37	963,076.25
LEIDOS HOLDINGS	6,940	123.50	857,090.00
PAYCHEX INC	17,989	124.49	2,239,450.61

PAYCOM SOFTWARE INC	2,625	190.05	498,881.25
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,200	176.06	387,332.00
REPUBLIC SERVICES INC	12,099	180.01	2,177,940.99
ROBERT HALF INC	5,212	80.03	417,116.36
ROLLINS INC	15,210	40.95	622,849.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	12,962	64.01	829,697.62
TRANSUNION	10,758	74.60	802,546.80
VERALTO CORP	12,852	85.77	1,102,316.04
VERISK ANALYTICS INC	8,140	248.51	2,022,871.40
WASTE CONNECTIONS INC	13,987	167.21	2,338,766.27
WASTE MANAGEMENT INC	22,353	201.79	4,510,611.87
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	71.64	449,469.36
CSX CORP	112,980	36.86	4,164,442.80
DELTA AIR LINES INC	7,841	40.60	318,344.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,512	115.57	983,731.84
FEDEX CORP	13,559	239.54	3,247,922.86
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	134,628	3.49	469,851.72
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,321	199.73	863,033.33
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,000	56.80	568,000.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,643	253.79	3,208,666.97
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,632	419.41	2,362,117.12
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	33.86	228,690.44
U-HAUL HOLDING CO	5,076	65.23	331,107.48
UBER TECHNOLOGIES INC	102,910	76.60	7,882,906.00
UNION PACIFIC CORP	34,272	247.14	8,469,982.08
UNITED PARCEL SERVICE B	40,861	148.64	6,073,579.04
APTIV PLC	16,326	77.76	1,269,509.76
BORGWARNER INC	11,533	30.16	347,835.28
FORD MOTOR COMPANY	217,837	12.25	2,668,503.25
GENERAL MOTORS CO	75,461	39.01	2,943,733.61
LEAR CORP	2,989	136.11	406,832.79
LUCID GROUP INC	45,820	3.68	168,617.60
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	40,190	15.89	638,619.10
TESLA INC	159,515	193.76	30,907,626.40
DECKERS OUTDOOR CORP	1,600	860.68	1,377,088.00
DR HORTON INC	17,138	143.47	2,458,788.86
GARMIN LTD	9,152	122.75	1,123,408.00
HASBRO INC	7,256	50.19	364,178.64
LENNAR CORP-CL A	14,595	150.99	2,203,699.05
LULULEMON ATHLETICA INC	6,410	444.60	2,849,886.00
NIKE B	69,265	103.30	7,155,074.50
NVR INC	188	7,420.02	1,394,963.76

PULTE GROUP INC	12,386	103.04	1,276,253.44
VF CORP	16,318	16.20	264,351.60
AIRBNB INC-CLASS A	23,073	148.15	3,418,264.95
BOOKING HOLDINGS INC	1,999	3,700.86	7,398,019.14
CAESARS ENTERTAINMENT INC	12,243	41.65	509,920.95
CARNIVAL CORPORATION	57,539	14.76	849,275.64
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,518	2,580.20	3,916,743.60
DARDEN RESTAURANTS INC	6,950	165.31	1,148,904.50
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	417.15	749,618.55
DOORDASH INC - A	14,879	115.48	1,718,226.92
DRAFTKINGS INC	24,000	41.32	991,680.00
EXPEDIA GROUP INC	8,454	135.99	1,149,659.46
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,280	197.09	2,814,445.20
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,200	132.28	423,296.00
LAS VEGAS SANDS CORP	19,449	53.06	1,031,963.94
MARRIOTT INTL A	14,322	242.94	3,479,386.68
MCDONALD'S CORP	40,896	292.65	11,968,214.40
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,799	42.36	669,245.64
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,881	115.14	1,483,118.34
STARBUCKS CORP	64,570	93.46	6,034,712.20
VAIL RESORTS INC	2,160	228.14	492,782.40
WYNN RESORTS LTD	5,210	103.23	537,828.30
YUM BRANDS INC	14,772	133.95	1,978,709.40
ALPHABET INC-CL A	331,772	141.12	46,819,664.64
ALPHABET INC-CL C	291,656	142.20	41,473,483.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,239	295.13	1,546,186.07
COMCAST CORP-CL A	233,579	41.66	9,730,901.14
ELECTRONIC ARTS INC	14,435	141.04	2,035,912.40
FOX CORP - CLASS A	15,560	30.09	468,200.40
FOX CORP- CLASS B	6,975	27.63	192,719.25
INTERPUBLIC GROUP OF COS	22,646	32.60	738,259.60
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	60.90	450,781.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	12,328	67.35	830,290.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	7,928	29.87	236,809.36
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,618	92.05	793,286.90
MATCH GROUP INC	14,456	36.15	522,584.40
META PLATFORMS INC-CLASS A	124,375	471.75	58,673,906.25
NETFLIX INC	24,933	575.13	14,339,716.29
NEWS CORP-CLASS A	22,307	26.25	585,558.75
OMNICOM GROUP	10,921	88.36	964,979.56
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	30,808	11.95	368,155.60
PINTEREST INC- CLASS A	35,629	35.11	1,250,934.19

ROBLOX CORP -CLASS A	24,726	41.41	1,023,903.66
ROKU INC	6,927	67.25	465,840.75
SEA LTD-ADR	19,867	44.69	887,856.23
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	4.73	222,764.08
SNAP INC - A	62,654	10.95	686,061.30
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,959	151.94	1,361,230.46
THE WALT DISNEY CO	102,577	109.44	11,226,026.88
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	23,690	82.56	1,955,846.40
WARNER BROS DISCOVERY INC	122,994	9.89	1,216,410.66
AMAZON.COM	519,518	167.08	86,801,067.44
AUTOZONE INC	975	2,696.15	2,628,746.25
BATH & BODY WORKS INC	13,789	47.36	653,047.04
BEST BUY COMPANY INC	10,832	73.27	793,660.64
BURLINGTON STORES INC	3,549	193.73	687,547.77
CARMAX INC	9,366	70.66	661,801.56
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,000	166.45	665,800.00
EBAY	29,667	43.59	1,293,184.53
ETSY INC	6,573	75.87	498,693.51
GENUINE PARTS CO	7,768	144.28	1,120,767.04
GLOBAL-E ONLINE LTD	6,000	40.31	241,860.00
HOME DEPOT	56,243	362.57	20,392,024.51
LKQ CORP	13,325	49.86	664,384.50
LOWES COMPANIES	32,948	225.51	7,430,103.48
MERCADOLIBRE INC	2,509	1,740.01	4,365,685.09
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	1,035.63	3,503,536.29
POOL CORP	2,087	384.77	803,014.99
ROSS STORES INC	18,500	144.45	2,672,325.00
TJX COMPANIES INC	64,603	97.36	6,289,748.08
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,763	236.42	1,362,488.46
ULTA BEAUTY INC	2,749	541.29	1,488,006.21
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	19,000	21.28	404,320.00
COSTCO WHOLESALE CORP	24,829	725.69	18,018,157.01
DOLLAR GENERAL CORP	12,157	142.49	1,732,250.93
DOLLAR TREE INC	11,506	146.29	1,683,212.74
KROGER CO	38,327	48.00	1,839,696.00
SYSCO CORP	28,275	79.07	2,235,704.25
TARGET (DAYTON HUDSON)	26,160	149.89	3,921,122.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,229	22.31	897,508.99
WALMART INC	83,029	175.86	14,601,479.94
ALTRIA GROUP INC	100,574	40.25	4,048,103.50
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,271	53.40	1,616,471.40
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	17,835	58.51	1,043,525.85

BUNGE GLOBAL SA	8,498	91.67	779,011.66
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,059	42.16	424,087.44
CELSIUS HOLDINGS INC	9,664	63.56	614,243.84
COCA-COLA CO	230,231	60.70	13,975,021.70
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,052	68.34	823,633.68
CONAGRA BRANDS INC	26,163	28.48	745,122.24
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,454	245.26	2,318,688.04
DARLING INGREDIENTS INC	8,500	42.18	358,530.00
GENERAL MILLS INC	31,192	65.78	2,051,809.76
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,990	193.57	1,546,624.30
HORMEL FOODS CORP	15,714	29.44	462,620.16
JM SMUCKER CO	5,275	125.88	664,017.00
KELLANOVA	16,208	56.13	909,755.04
KEURIG DR PEPPER INC	60,387	31.23	1,885,886.01
KRAFT HEINZ CO/THE	49,492	35.62	1,762,905.04
LAMB WESTON HOLDINGS INC	8,000	102.16	817,280.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,652	68.06	929,155.12
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	10,122	62.72	634,851.84
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	76,844	73.19	5,624,212.36
MONSTER BEVERAGE CORP	43,508	55.40	2,410,343.20
PEPSICO INC	77,137	168.65	13,009,155.05
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	87,258	89.64	7,821,807.12
TYSON FOODS INC	14,778	54.05	798,750.90
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,150	98.05	1,387,407.50
CLOROX COMPANY	6,394	152.24	973,422.56
COLGATE-PALMOLIVE CO	43,378	84.61	3,670,212.58
ESTEE LAUDER CO-CL A	12,383	145.11	1,796,897.13
KENVUE INC	99,317	19.06	1,892,982.02
KIMBERLY-CLARK CORP	18,647	119.15	2,221,790.05
PROCTER & GAMBLE CO	131,778	158.51	20,888,130.78
ABBOTT LABORATORIES	97,490	116.64	11,371,233.60
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,193	313.53	1,314,631.29
BAXTER INTERNATIONAL	26,594	41.77	1,110,831.38
BECTON DICKINSON & CO	16,036	240.66	3,859,223.76
BOSTON SCIENTIFIC CORP	81,576	66.22	5,401,962.72
CARDINAL HEALTH	14,569	105.37	1,535,135.53
CENCORA INC	9,745	232.36	2,264,348.20
CENTENE CORP	29,946	79.29	2,374,418.34
COOPER COS INC/THE	10,244	95.70	980,350.80
CVS HEALTH CORP	70,812	76.31	5,403,663.72
DAVITA INC	3,582	123.00	440,586.00
DEXCOM INC	22,165	117.87	2,612,588.55

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	34,369	86.90	2,986,666.10
ELEVANCE HEALTH INC	13,315	508.91	6,776,136.65
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	23,005	86.39	1,987,401.95
HCA HEALTHCARE INC	11,263	308.58	3,475,536.54
HENRY SCHEIN INC	7,493	75.64	566,770.52
HOLOGIC INC	12,961	74.58	966,631.38
HUMANA INC	6,841	367.14	2,511,604.74
IDEXX LABORATORIES INC	4,442	551.21	2,448,474.82
INSULET CORP	3,546	192.21	681,576.66
INTUITIVE SURGICAL INC	19,697	377.64	7,438,375.08
LABORATORY CRP OF AMER	5,238	215.67	1,129,679.46
MCKESSON CORP	7,488	506.74	3,794,469.12
MEDTRONIC PLC	73,530	85.85	6,312,550.50
MOLINA HEALTHCARE INC	3,016	401.49	1,210,893.84
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	123.80	773,254.80
RESMED INC	8,586	180.66	1,551,146.76
STERIS PLC	5,851	229.25	1,341,341.75
STRYKER CORP	19,207	348.07	6,685,380.49
TELEFLEX INC	2,672	250.95	670,538.40
THE CIGNA GROUP	16,677	341.35	5,692,693.95
UNITEDHEALTH GROUP INC	52,063	521.06	27,127,946.78
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	162.43	633,152.14
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,403	218.76	1,838,240.28
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,864	124.98	1,482,762.72
ABBVIE INC	98,887	175.75	17,379,390.25
AGILENT TECHNOLOGIES	15,996	134.14	2,145,703.44
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,056	149.69	1,056,212.64
AMGEN	29,982	283.51	8,500,196.82
AVANTOR INC	34,993	24.05	841,581.65
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,302	343.76	447,575.52
BIO-TECHNE CORP	8,884	70.33	624,811.72
BIOGEN INC	8,034	219.21	1,761,133.14
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,231	88.67	907,182.77
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	117,926	49.86	5,879,790.36
CATALENT INC	11,603	57.98	672,741.94
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,641	238.94	631,040.54
DANAHER CORP	39,340	247.77	9,747,271.80
ELI LILLY & CO	45,116	755.66	34,092,356.56
EXACT SCIENCES CORP	9,063	62.74	568,612.62
GILEAD SCIENCES INC	70,144	72.04	5,053,173.76
ILLUMINA INC	8,558	140.05	1,198,547.90
INCYTE CORP	10,628	58.82	625,138.96

IQVIA HOLDINGS INC	10,091	234.76	2,368,963.16
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,254	126.36	411,175.44
JOHNSON & JOHNSON	134,646	157.86	21,255,217.56
MERCK & CO	142,254	127.37	18,118,891.98
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,168	1,184.37	1,383,344.16
MODERNA INC	17,875	86.99	1,554,946.25
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	132.65	624,516.20
PFIZER	316,987	27.59	8,745,671.33
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,923	946.87	5,608,311.01
REPLIGEN CORP	2,737	199.73	546,661.01
REVVITY INC	6,426	101.98	655,323.48
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	23,158	30.30	701,687.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	13.07	743,120.99
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,601	548.14	11,840,372.14
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,421	214.16	518,481.36
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,517	420.64	6,106,430.88
VIATRIS INC	63,857	13.24	845,466.68
WATERS CORP	3,306	323.95	1,070,978.70
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,264	350.18	1,493,167.52
ZOETIS INC	26,169	186.55	4,881,826.95
BANK OF AMERICA CORP	401,937	33.96	13,649,780.52
CITIGROUP	107,016	55.42	5,930,826.72
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,193	31.37	790,304.41
FIFTH THIRD BANCORP	37,082	33.80	1,253,371.60
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	573	1,510.06	865,264.38
HUNTINGTON BANCSHARES INC	78,770	12.76	1,005,105.20
JPMORGAN CHASE & CO	163,426	179.73	29,372,554.98
KEY CORP	48,984	14.19	695,082.96
M & T BANK CORP	9,606	137.36	1,319,480.16
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,205	146.70	3,110,773.50
REGIONS FINL CORP	49,382	18.42	909,616.44
TRUIST FINANCIAL CORP	76,097	35.56	2,706,009.32
US BANCORP	85,114	41.14	3,501,589.96
WELLS FARGO & CO	205,910	51.77	10,659,960.70
ALLY FINANCIAL INC	18,129	36.69	665,153.01
AMERICAN EXPRESS	35,633	212.49	7,571,656.17
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,866	396.78	2,327,511.48
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	22,034	109.60	2,414,926.40
ARES MANAGEMENT CORP - A	9,376	132.61	1,243,351.36
BANK NEW YORK CO	45,067	54.87	2,472,826.29
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	73,282	407.15	29,836,766.30
BLACKROCK INC	8,457	798.11	6,749,616.27

BLACKSTONE INC	39,953	126.33	5,047,262.49
BLOCK INC	30,502	65.73	2,004,896.46
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,406	137.39	2,803,580.34
CARLYLE GROUP INC/THE	10,351	44.26	458,135.26
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,992	191.72	1,148,786.24
CME GROUP INC	19,867	210.99	4,191,738.33
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,291	173.30	1,783,430.30
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	124.42	1,777,339.70
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	34.34	633,950.74
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,972	456.86	900,927.92
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	31,029	62.96	1,953,585.84
FISERV INC	34,179	147.93	5,056,099.47
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	272.91	1,058,617.89
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	27.10	399,670.80
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	49.76	113,751.36
GLOBAL PAYMENTS INC	15,111	130.80	1,976,518.80
GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,693	384.52	7,187,832.36
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	32,467	136.43	4,429,472.81
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	173.10	608,273.40
KKR & CO INC	33,954	93.14	3,162,475.56
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,096	255.86	1,048,002.56
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,112	213.98	451,925.76
MASTERCARD INC-CLASS A	47,345	451.75	21,388,103.75
MOODY'S CORP	9,174	375.32	3,443,185.68
MORGAN STANLEY	70,454	85.35	6,013,248.90
MSCI INC	4,355	556.56	2,423,818.80
NASDAQ INC	17,953	55.54	997,109.62
NORTHERN TRUST CORP	11,862	79.61	944,333.82
PAYPAL HOLDINGS INC	57,102	58.63	3,347,890.26
PRICE T ROWE GROUP INC	11,505	109.41	1,258,762.05
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,494	116.45	1,338,476.30
ROBINHOOD MARKETS INC - A	24,000	14.09	338,160.00
S&P GLOBAL INC	18,434	426.01	7,853,068.34
SCHWAB (CHARLES) CORP	82,257	63.58	5,229,900.06
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	66.27	416,772.03
STATE STREET CORP	17,821	71.55	1,275,092.55
SYNCHRONY FINANCIAL	23,931	40.48	968,726.88
TOAST INC-CLASS A	20,887	21.78	454,918.86
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,542	102.50	670,555.00
VISA INC-CLASS A SHARES	89,644	275.15	24,665,546.60
AFLAC	31,141	78.78	2,453,287.98
ALLSTATE CORP	14,193	159.72	2,266,905.96



AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	123.59	470,012.77
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	68.13	2,741,959.98
AON PLC	11,563	315.50	3,648,126.50
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,703	85.37	1,767,415.11
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,870	241.74	2,869,453.80
ASSURANT INC	2,684	174.63	468,706.92
BROWN & BROWN INC	13,365	82.70	1,105,285.50
CHUBB LTD	23,361	250.51	5,852,164.11
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,751	110.94	859,895.94
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	355.48	513,313.12
EVEREST GROUP LTD	2,474	368.11	910,704.14
FNF GROUP	12,836	52.13	669,140.68
GLOBE LIFE INC	4,559	125.85	573,750.15
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	93.43	1,557,758.39
LOEWS CORP	10,482	73.87	774,305.34
MARKEL GROUP INC	702	1,453.13	1,020,097.26
MARSH & MCLENNAN COS	27,850	200.89	5,594,786.50
METLIFE INC	35,762	68.62	2,453,988.44
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	80.30	1,021,817.50
PROGRESSIVE CORP	32,935	189.48	6,240,523.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,869	107.31	2,239,452.39
TRAVELERS COS INC/THE	12,320	220.10	2,711,632.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	275.64	1,656,320.76
WR BERKLEY CORP	11,919	81.98	977,119.62
WEYERHAEUSER CO	40,664	33.06	1,344,351.84
ACCENTURE PLC-CL A	35,320	362.95	12,819,394.00
ADOBE INC	25,550	541.91	13,845,800.50
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	8,949	108.36	969,713.64
ANSYS INC	4,871	332.14	1,617,853.94
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,805	175.36	316,524.80
ATLASSIAN CORP-CL A	9,024	204.78	1,847,934.72
AUTODESK INC	12,108	255.26	3,090,688.08
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,819	52.33	618,488.27
BILL HOLDINGS, INC.	4,833	63.05	304,720.65
CADENCE DESIGN SYSTEMS	15,429	292.07	4,506,348.03
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	160.10	908,727.60
CLOUDFLARE INC - CLASS A	16,221	97.99	1,589,495.79
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	28,407	76.74	2,179,953.18
CONFLUENT INC-CLASS A	9,000	32.72	294,480.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	12,526	323.71	4,054,791.46
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	250.00	525,000.00
DATADOG INC - CLASS A	14,659	127.66	1,871,367.94

DOCUSIGN INC	9,538	49.98	476,709.24
DROPBOX INC-CLASS A	16,505	24.23	399,916.15
DYNATRACE INC	14,980	50.26	752,894.80
EPAM SYSTEMS INC	3,061	297.81	911,596.41
FAIR ISAAC CORP	1,345	1,259.20	1,693,624.00
FORTINET INC	36,982	67.91	2,511,447.62
GARTNER INC	4,549	445.00	2,024,305.00
GEN DIGITAL INC	29,838	21.70	647,484.60
GODADDY INC - CLASS A	8,747	108.90	952,548.30
HUBSPOT INC	2,683	595.34	1,597,297.22
INTL BUSINESS MACHINES CORP	51,075	183.44	9,369,198.00
INTUIT INC	15,703	645.91	10,142,724.73
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,500	242.88	850,080.00
MICROSOFT CORP	394,718	402.79	158,988,463.22
MONDAY.COM LTD	1,500	217.32	325,980.00
MONGODB INC	4,115	444.81	1,830,393.15
OKTA INC	9,345	83.66	781,802.70
ORACLE CORP	91,492	108.45	9,922,307.40
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	103,887	23.40	2,430,955.80
PALO ALTO NETWORKS INC	17,419	366.09	6,376,921.71
PTC INC	7,030	176.89	1,243,536.70
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,903	544.11	3,211,881.33
SALESFORCE INC	54,562	286.39	15,626,011.18
SERVICENOW INC	11,509	752.84	8,664,435.56
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,022	220.08	3,526,121.76
SPLUNK INC	8,652	155.40	1,344,520.80
SYNOPSYS INC	8,405	547.98	4,605,771.90
TWILIO INC - A	10,378	56.68	588,225.04
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,478	435.38	1,078,871.64
UIPATH INC - CLASS A	24,000	23.82	571,680.00
UNITY SOFTWARE INC	13,116	32.02	419,974.32
VERISIGN INC	5,329	192.23	1,024,393.67
WIX.COM LTD	3,273	125.32	410,172.36
WORKDAY INC-CLASS A	11,335	301.98	3,422,943.30
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,443	61.32	763,004.76
ZSCALER INC	5,230	249.04	1,302,479.20
AMPHENOL CORPORATION	33,054	104.61	3,457,778.94
APPLE INC	873,971	181.56	158,678,174.76
ARISTA NETWORKS INC	14,708	259.61	3,818,343.88
CDW CORP/DE	7,411	241.79	1,791,905.69
CISCO SYSTEMS	228,543	48.28	11,034,056.04
CORNING	43,885	32.29	1,417,046.65

DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	82.46	1,155,182.14
F5 INC	2,841	183.14	520,300.74
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	75,299	15.01	1,130,237.99
HP INC	49,496	28.63	1,417,070.48
JABIL INC	7,400	137.33	1,016,242.00
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	36.90	601,765.20
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,238	154.43	1,426,624.34
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,289	323.04	3,000,718.56
NETAPP INC	10,843	85.46	926,642.78
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	86.77	857,287.60
SUPER MICRO COMPUTER INC	2,800	787.57	2,205,196.00
TE CONNECTIVITY LTD	17,335	140.22	2,430,713.70
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,404	430.76	1,035,547.04
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,869	60.13	833,942.97
WESTERN DIGITAL CORP	17,228	54.13	932,551.64
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,892	271.93	786,421.56
AT&T INC	395,564	16.91	6,688,987.24
LIBERTY GLOBAL LTD-C	12,682	19.49	247,172.18
T-MOBILE US INC	29,432	162.05	4,769,455.60
VERIZON COMMUNICATIONS	235,548	40.50	9,539,694.00
AES CORP	34,338	16.42	563,829.96
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	48.25	610,989.75
AMEREN CORPORATION	14,991	69.87	1,047,421.17
AMERICAN ELECTRIC POWER	28,664	80.88	2,318,344.32
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,087	121.16	1,343,300.92
ATMOS ENERGY CORP	7,575	113.69	861,201.75
CENTERPOINT ENERGY INC	36,651	27.79	1,018,531.29
CMS ENERGY CORP	17,231	57.03	982,683.93
CONSOLIDATED EDISON INC	18,713	87.58	1,638,884.54
CONSTELLATION ENERGY	18,305	131.80	2,412,599.00
DOMINION ENERGY INC	48,379	45.35	2,193,987.65
DTE ENERGY COMPANY	10,982	107.64	1,182,102.48
DUKE ENERGY CORP	43,568	91.94	4,005,641.92
EDISON INTL	21,304	66.54	1,417,568.16
ENERGY CORP	12,274	100.01	1,227,522.74
ESSENTIAL UTILITIES INC	12,969	36.16	468,959.04
EVERGY INC	11,724	50.18	588,310.32
EVERSOURCE ENERGY	18,286	57.52	1,051,810.72
EXELON CORP	54,634	34.73	1,897,438.82
FIRSTENERGY CORP	30,792	37.15	1,143,922.80
NEXTERA ENERGY INC	113,922	56.61	6,449,124.42
NISOURCE INC	25,553	26.02	664,889.06

	NRG ENERGY INC	12,298	51.70	635,806.60
	PG&E CORP	115,431	16.63	1,919,617.53
	PPL CORPORATION	38,399	26.44	1,015,269.56
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	28,637	60.11	1,721,370.07
	SEMPRA	35,873	70.66	2,534,786.18
	SOUTHERN CO	61,651	67.04	4,133,083.04
	VISTRA CORP	19,603	46.15	904,678.45
	WEC ENERGY GROUP INC	18,373	78.00	1,433,094.00
	XCEL ENERGY INC	31,146	59.19	1,843,531.74
	ADVANCED MICRO DEVICES	90,389	165.69	14,976,553.41
	ANALOG DEVICES	27,639	189.40	5,234,826.60
	APPLIED MATERIALS	47,292	189.14	8,944,808.88
	BROADCOM INC	24,818	1,226.55	30,440,517.90
	ENPHASE ENERGY INC	7,104	127.55	906,115.20
	ENTEGRIS INC	8,008	135.52	1,085,244.16
	FIRST SOLAR INC	5,850	153.25	896,512.50
	INTEL CORP	233,872	44.52	10,411,981.44
	KLA CORP	7,545	651.77	4,917,604.65
	LAM RESEARCH CORP	7,358	900.44	6,625,437.52
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	8,500	72.17	613,445.00
	MARVELL TECHNOLOGY INC	47,247	65.04	3,072,944.88
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	29,374	82.40	2,420,417.60
	MICRON TECHNOLOGY	60,391	80.71	4,874,157.61
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,625	712.32	1,869,840.00
	NVIDIA CORP	138,165	694.52	95,958,355.80
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,362	231.35	3,322,648.70
	ON SEMICONDUCTOR CORP	24,703	77.47	1,913,741.41
	QORVO INC	5,297	111.86	592,522.42
	QUALCOMM	62,632	151.96	9,517,558.72
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,922	103.92	927,174.24
	TERADYNE INC	9,235	100.17	925,069.95
	TEXAS INSTRUMENTS	50,935	162.74	8,289,161.90
	CBRE GROUP INC-A	16,391	90.97	1,491,089.27
	COSTAR GROUP INC	22,748	81.24	1,848,047.52
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	3.26	209,618.00
	ZILLOW GROUP INC-C	7,537	53.52	403,380.24
	アメリカドル 小計	19,042,230		2,407,862,451.33 (361,564,625,691)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	36,244	21.99	797,005.56
	CAMECO CORP	22,453	56.05	1,258,490.65
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	61,177	85.43	5,226,351.11
	CENOVUS ENERGY INC	83,349	23.24	1,937,030.76

ENBRIDGE	120,448	46.56	5,608,058.88
IMPERIAL OIL	11,645	79.84	929,736.80
KEYERA CORP	10,963	33.23	364,300.49
MEG ENERGY CORP	18,392	25.80	474,513.60
PARKLAND CORP	8,544	46.65	398,577.60
PEMBINA PIPELINE CORP	32,665	45.50	1,486,257.50
SUNCOR ENERGY	73,948	44.12	3,262,585.76
TC ENERGY CORP	57,598	53.69	3,092,436.62
TOURMALINE OIL CORP	16,980	57.00	967,860.00
AGNICO EAGLE MINES	27,843	65.76	1,830,955.68
BARRICK GOLD CORP	101,706	19.93	2,027,000.58
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	58.63	428,116.26
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,312	11.61	351,922.32
FRANCO-NEVADA CORP	11,522	146.09	1,683,248.98
IVANHOE MINES LTD-CL A	35,897	14.48	519,788.56
KINROSS GOLD CORP	74,937	6.86	514,067.82
LUNDIN MINING CORP	30,173	11.36	342,765.28
NUTRIEN LTD	27,026	68.42	1,849,118.92
PAN AMERICAN SILVER CORP	24,343	17.49	425,759.07
TECK RESOURCES LTD-CL B	24,191	51.26	1,240,030.66
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,575	106.37	380,272.75
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,120	59.78	1,561,453.60
CAE INC	16,864	26.05	439,307.20
STANTEC INC	6,135	111.80	685,893.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	124.78	532,685.82
WSP GLOBAL INC	7,506	208.26	1,563,199.56
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	20,483	22.68	464,554.44
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,920	49.26	537,919.20
RB GLOBAL INC	9,865	91.59	903,535.35
THOMSON REUTERS CORP	8,466	213.34	1,806,136.44
AIR CANADA	6,737	17.89	120,524.93
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,884	173.12	5,519,758.08
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	52,627	114.79	6,041,053.33
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	195.42	904,794.60
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,682	73.43	1,078,099.26
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,366	90.34	123,404.44
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	45.78	457,800.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,311	103.22	1,786,841.42
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	139.56	360,902.16
DOLLARAMA INC	16,822	104.42	1,756,553.24
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	42,716	85.07	3,633,850.12
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	34.31	251,492.30

LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	139.02	1,260,633.36	
METRO INC	13,489	71.23	960,821.47	
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	175.99	652,042.95	
SAPUTO INC	17,963	28.05	503,862.15	
BANK MONTREAL	39,095	127.92	5,001,032.40	
BANK NOVA SCOTIA	67,781	64.13	4,346,795.53	
CANADIAN IMPERIAL BANK	50,581	62.82	3,177,498.42	
NATIONAL BANK OF CANADA	19,372	104.48	2,023,986.56	
ROYAL BANK OF CANADA	76,323	132.55	10,116,613.65	
TORONTO-DOMINION BANK	103,712	80.66	8,365,409.92	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	18,244	55.15	1,006,156.60	
BROOKFIELD CORP	80,503	54.65	4,399,488.95	
IGM FINANCIAL INC	3,890	35.30	137,317.00	
ONEX CORP	3,361	102.65	345,006.65	
TMX GROUP LTD	16,225	34.19	554,732.75	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	1,361.73	1,631,352.54	
GREAT-WEST LIFECO INC	15,674	42.30	663,010.20	
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	93.75	507,656.25	
INTACT FINANCIAL CORP	9,967	227.58	2,268,289.86	
MANULIFE FINANCIAL CORP	100,823	32.99	3,326,150.77	
POWER CORP OF CANADA	29,992	38.67	1,159,790.64	
SUN LIFE FINANCIAL INC	32,024	73.43	2,351,522.32	
CGI INC - CL A	11,043	152.88	1,688,253.84	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,145	3,722.93	4,262,754.85	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,402	116.85	514,373.70	
OPEN TEXT CORP	15,045	53.01	797,535.45	
SHOPIFY INC - CLASS A	65,609	106.30	6,974,236.70	
BCE INC	3,102	51.23	158,915.46	
QUEBECOR INC -CL B	9,679	31.93	309,050.47	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,199	61.54	1,119,966.46	
TELUS CORP	23,120	24.20	559,504.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	37,267	8.00	298,136.00	
ALTAGAS INCOME LTD	14,516	28.48	413,415.68	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	33.78	211,597.92	
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	30.53	182,508.34	
EMERA INC	13,595	48.09	653,783.55	
FORTIS INC	29,864	53.61	1,601,009.04	
HYDRO ONE LTD	20,457	40.71	832,804.47	
NORTHLAND POWER INC	13,044	23.60	307,838.40	
FIRSTSERVICE CORP	2,028	222.40	451,027.20	
カナダドル 小計	2,285,314		144,021,893.17 (15,989,310,579)	

ユーロ	ENI	135,037	14.13	1,908,342.88
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	30,121	14.22	428,471.22
	NESTE OIL OYJ	21,882	27.55	602,849.10
	OMV AG	7,462	40.80	304,449.60
	REPSOL SA	71,632	13.65	977,776.80
	TENARIS SA	27,420	14.77	404,993.40
	TOTALENERGIES SE	126,086	58.60	7,388,639.60
	AIR LIQUIDE	29,475	185.86	5,478,223.50
	AKZO NOBEL	9,224	68.04	627,600.96
	ARCELORMITTAL	29,386	24.42	717,606.12
	ARKEMA	4,377	96.44	422,117.88
	BASF SE	48,561	46.04	2,235,991.24
	COVESTRO AG	10,438	47.85	499,458.30
	DSM-FIRMENICH AG	10,830	102.92	1,114,623.60
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	17.35	166,612.05
	HEIDELBERG MATERIALS AG	8,131	87.68	712,926.08
	OCI NV	5,799	25.50	147,874.50
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	14,165	38.10	539,686.50
	STORA ENSO OYJ R	26,361	11.14	293,661.54
	SYENSQO SA	3,676	84.28	309,813.28
	SYMRISE AG	7,051	98.42	693,959.42
	UMICORE	12,057	19.93	240,296.01
	UPM KYMMENE OYJ	32,788	29.34	961,999.92
	VOESTALPINE AG	5,948	25.28	150,365.44
	WACKER CHEMIE AG	1,600	99.66	159,456.00
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	12,595	36.63	461,354.85
	AIRBUS SE	33,517	144.96	4,858,624.32
	ALSTOM	16,908	11.44	193,427.52
	BOUYGUES ORD	11,344	34.57	392,162.08
	BRENTAG SE	8,989	81.56	733,142.84
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,498	35.51	1,047,473.98
	DASSAULT AVIATION SA	1,210	182.60	220,946.00
	EIFFAGE	4,432	96.42	427,333.44
	FERROVIAL SE	29,779	35.50	1,057,154.50
GEA GROUP AG	7,649	37.51	286,913.99	
IMCD NV	3,050	141.05	430,202.50	
KINGSPAN GROUP PLC	9,798	85.14	834,201.72	
KNORR-BREMSE AG	3,221	58.16	187,333.36	
KONE OYJ-B	19,254	46.01	885,876.54	
LEGRAND SA	15,620	89.08	1,391,429.60	
LEONARDO SPA	26,079	19.15	499,412.85	
METSO CORPORATION	35,225	10.04	353,835.12	

MTU AERO ENGINES AG	2,774	223.50	619,989.00
PRYSMIAN SPA	15,275	43.63	666,448.25
RATIONAL AG	268	754.00	202,072.00
RHEINMETALL AG	2,442	401.90	981,439.80
SAFRAN SA	18,948	190.46	3,608,836.08
SAINT-GOBAIN	25,279	68.30	1,726,555.70
SCHNEIDER ELECTRIC SE	30,276	201.15	6,090,017.40
SIEMENS	42,875	168.72	7,233,870.00
SIEMENS ENERGY AG	24,753	13.43	332,432.79
THALES SA	5,540	135.15	748,731.00
VINCI S.A.	28,324	114.44	3,241,398.56
WARTSILA OYJ	30,397	14.59	443,644.21
BUREAU VERITAS SA	15,662	25.24	395,308.88
RANDSTAD NV	5,866	51.32	301,043.12
TELEPERFORMANCE	3,110	133.90	416,429.00
WOLTERS KLUWER	14,750	147.20	2,171,200.00
ADP	1,532	127.20	194,870.40
AENA SME SA	4,116	170.50	701,778.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	7.33	282,544.16
DHL GROUP	56,431	42.98	2,425,404.38
GETLINK	18,582	15.42	286,627.35
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,499	101.82	1,781,748.18
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,480	96.15	334,602.00
CONTINENTAL AG	6,262	72.94	456,750.28
DR ING HC F PORSCHE AG	5,800	79.08	458,664.00
FERRARI NV	6,834	362.50	2,477,325.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	43,736	66.78	2,920,690.08
MICHELIN	35,958	33.33	1,198,480.14
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,889	45.14	401,249.46
RENAULT SA	11,301	36.48	412,260.48
STELLANTIS NV	121,390	23.40	2,840,526.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,635	118.08	1,373,860.80
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	134.20	222,369.40
ADIDAS AG	9,192	181.12	1,664,855.04
HERMES INTERNATIONAL	1,765	2,219.50	3,917,417.50
KERING	4,318	428.20	1,848,967.60
LVMH	15,508	820.20	12,719,661.60
MONCLER SPA	12,416	62.68	778,234.88
PUMA SE	6,274	41.70	261,625.80
SEB SA	1,310	112.30	147,113.00
ACCOR	12,281	37.85	464,835.85
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	25,319	61.40	1,554,586.60



DELIVERY HERO SE	8,935	22.33	199,518.55
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	38.72	206,455.04
SODEXO	4,698	75.66	355,450.68
BOLLORE SE	51,405	6.28	322,823.40
PUBLICIS GROUPE	13,443	98.12	1,319,027.16
SCOUT24 SE	4,128	65.34	269,723.52
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	47,953	26.98	1,293,771.94
VIVENDI SE	41,539	10.22	424,736.27
D' IETEREN GROUP	1,617	174.00	281,358.00
INDITEX	62,230	40.10	2,495,423.00
PROSUS	83,321	27.69	2,307,575.09
ZALANDO SE	11,285	19.65	221,750.25
CARREFOUR	30,831	15.70	484,200.85
HELLOFRESH SE	7,756	12.06	93,576.14
JERONIMO MARTINS	13,062	21.98	287,102.76
KESKO OYJ-B SHS	14,326	17.99	257,796.37
KONINKLIJKE AHOLD NV	52,445	27.73	1,454,299.85
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	50,369	58.26	2,934,497.94
DANONE (GROUPE)	35,678	61.68	2,200,619.04
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	9.81	261,630.06
HEINEKEN HOLDING NV	7,127	73.75	525,616.25
HEINEKEN NV	16,000	88.16	1,410,560.00
JDE PEET'S BV	9,274	23.16	214,785.84
KERRY GROUP PLC-A	8,173	79.00	645,667.00
LOTUS BAKERIES	24	9,000.00	216,000.00
PERNOD-RICARD	11,584	155.85	1,805,366.40
REMY COINTREAU	1,020	98.44	100,408.80
BEIERSDORF AG	5,845	139.05	812,747.25
HENKEL AG & CO KGAA	6,247	64.44	402,556.68
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,083	71.46	720,531.18
LOREAL	13,589	443.60	6,028,080.40
AMPLIFON SPA	6,606	31.47	207,890.82
BIOMERIEUX	2,374	103.70	246,183.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	110.95	231,996.45
DIASORIN ITALIA SPA	1,418	92.46	131,108.28
ESSILORLUXOTTICA	16,595	188.52	3,128,489.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	9,705	37.70	365,878.50
FRESENIUS SE&CO KGAA	23,936	26.04	623,293.44
KONINKLIJKE PHILIPS	43,352	18.68	810,162.17
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	54.92	800,568.84
ARGENX SE	3,157	366.30	1,156,409.10
BAYER	54,521	28.76	1,568,296.56

EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	57.58	373,694.20
GRIFOLS SA	14,240	10.93	155,643.20
IPSEN	1,866	105.60	197,049.60
MERCK KGAA	6,723	153.40	1,031,308.20
ORION OYJ-CLASS B	5,393	38.94	210,003.42
QIAGEN N.V.	12,712	39.45	501,488.40
RECORDATI SPA	5,195	52.12	270,763.40
SANOFI	63,904	87.13	5,567,955.52
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	334.90	407,238.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,435	249.30	357,745.50
UCB (GROUPE)	6,718	95.06	638,613.08
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	14.53	286,502.54
AIB GROUP PLC	86,175	4.15	357,798.60
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	9.09	2,988,847.66
BANCO BPM SPA	78,110	4.93	385,316.63
BANCO SANTANDER SA	904,812	3.80	3,438,285.60
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,138	8.43	439,940.44
BNP PARIBAS	59,550	55.50	3,305,025.00
CAIXABANK	240,435	4.10	985,783.50
COMMERZBANK AG	56,376	10.60	597,867.48
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	12.44	802,069.00
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	39.09	708,271.71
FINECOBANK SPA	42,306	13.20	558,439.20
ING GROEP NV-CVA	199,441	12.69	2,532,102.93
INTESA SANPAOLO	853,697	2.84	2,432,609.60
KBC GROEP NV	12,855	62.04	797,524.20
MEDIOBANCA	29,447	11.85	348,946.95
NORDEA BANK ABP	180,364	11.11	2,004,926.22
SOCIETE GENERALE	41,916	22.15	928,439.40
UNICREDIT SPA	89,900	29.95	2,692,505.00
ADYEN NV	1,178	1,482.80	1,746,738.40
AMUNDI SA	2,812	60.35	169,704.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	111,998	11.95	1,338,824.09
DEUTSCHE BOERSE	10,526	188.85	1,987,835.10
EDENRED	15,236	56.36	858,700.96
EURAZEO SA	2,340	77.55	181,467.00
EURONEXT NV	4,500	82.55	371,475.00
EXOR NV	6,325	97.52	616,814.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	70.72	394,759.04
NEXI SPA	36,598	7.09	259,479.82
SOFINA	752	214.00	160,928.00
WORLDLINE SA	13,712	11.50	157,688.00

AEGON LTD	95,201	5.39	513,514.19
AGEAS	8,621	39.36	339,322.56
ALLIANZ SE-REG	22,740	249.40	5,671,356.00
ASR NEDERLAND NV	9,000	42.95	386,550.00
ASSICURAZIONI GENERALI	58,531	20.93	1,225,053.83
AXA SA	100,654	31.16	3,136,881.91
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	231.60	689,241.60
MUENCHENER RUECKVERSICH.	7,773	412.80	3,208,694.40
NN GROUP NV	13,557	37.55	509,065.35
POSTE ITALIANE SPA	25,777	10.11	260,605.47
SAMPO OYJ-A SHS	25,899	41.47	1,074,161.02
TALANX AG	5,000	65.45	327,250.00
BECHTLE AG	4,296	46.24	198,647.04
CAPGEMINI SA	9,097	218.80	1,990,423.60
DASSAULT SYSTEMES SA	38,993	43.10	1,680,598.30
NEMETSCHKE SE	3,320	84.72	281,270.40
SAP SE	58,571	163.06	9,550,587.26
NOKIA OYJ	300,315	3.24	973,020.60
CELLNEX TELECOM SA	30,696	33.36	1,024,018.56
DEUTSCHE TELEKOM	183,125	22.26	4,077,278.12
ELISA A	7,825	42.79	334,831.75
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	10.77	160,225.29
KPN (KON.)	173,861	3.37	586,259.29
ORANGE	104,881	10.90	1,143,622.42
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.28	140,802.83
TELEFONICA	280,413	3.66	1,028,274.47
ACCIONA SA	1,278	108.50	138,663.00
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	3,416	20.84	71,189.44
E.ON SE	123,229	12.03	1,483,061.01
EDP RENOVAVEIS SA	15,623	13.82	215,909.86
ELIA GROUP SA/NV	1,604	103.50	166,014.00
ENAGAS	11,944	14.92	178,264.20
ENDESA	17,138	16.75	287,061.50
ENEL	451,639	5.90	2,666,025.01
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,324	3.75	710,343.64
ENGIE	100,082	14.44	1,445,784.57
FORTUM OYJ	26,655	11.08	295,470.67
IBERDROLA SA	349,911	10.90	3,814,029.90
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,726	23.02	223,892.52
REDEIA CORP SA	23,296	15.09	351,536.64
RWE STAMM	33,396	31.17	1,040,953.32
SNAM SPA	115,930	4.47	518,902.68

	TERNA SPA	80,424	7.53	606,236.11
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,814	29.75	1,095,216.50
	VERBUND AG	3,916	64.65	253,169.40
	ASM INTERNATIONAL NV	2,534	542.50	1,374,695.00
	ASML HOLDING NV	22,598	837.70	18,930,344.60
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,300	153.20	658,760.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	72,297	32.56	2,353,990.32
	STMICROELECTRONICS NV	37,319	40.94	1,528,026.45
	LEG IMMOBILIEN SE	3,774	70.82	267,274.68
	VONOVIA SE	43,373	26.58	1,152,854.34
	ユーロ 小計	10,093,190		279,765,360.80 (45,417,108,672)
イギリスポンド	BP PLC	965,605	4.66	4,505,030.12
	SHELL PLC-NEW	369,179	24.88	9,185,173.52
	ANGLO AMERICAN PLC	74,016	17.19	1,272,779.13
	ANTOFAGASTA PLC	22,358	17.76	397,078.08
	CRH PLC	41,918	61.40	2,573,765.20
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,013	49.99	400,569.87
	ENDEAVOUR MINING PLC	13,000	12.97	168,610.00
	GLENCORE PLC	587,098	3.90	2,292,030.59
	MONDI PLC	23,525	13.82	325,233.12
	RIO TINTO PLC REG	61,891	52.30	3,236,899.30
	ASHTREAD GROUP PLC	25,115	53.50	1,343,652.50
	BAE SYSTEMS PLC	170,458	12.53	2,135,838.74
	BUNZL PLC	19,312	32.53	628,219.36
	DCC PLC	4,499	58.26	262,111.74
	MELROSE INDUSTRIES PLC	75,000	6.13	460,200.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	458,658	3.30	1,515,864.69
	SMITHS GROUP PLC	20,046	16.39	328,654.17
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	103.95	381,704.40
	EXPERIAN PLC	52,941	33.90	1,794,699.90
	INTERTEK GROUP PLC	10,295	44.91	462,348.45
	RELX PLC	107,318	34.36	3,687,446.48
	RENTOKIL INITIAL PLC	130,328	4.25	554,284.98
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	4.80	245,102.22
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	47.91	289,759.68
	BURBERRY GROUP PLC	22,327	13.07	291,925.52
	PERSIMMON PLC	14,327	14.28	204,661.19
	TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.45	241,848.91
	COMPASS GROUP PLC	95,637	22.07	2,110,708.59
	ENTAIN PLC	33,614	9.23	310,257.22
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	10,117	165.90	1,678,410.30

INTERCONTINENTAL HOTELS	10,141	83.34	845,150.94
PEARSON	34,302	9.58	328,681.76
WHITBREAD PLC	10,170	35.50	361,035.00
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	7.22	317,236.92
INFORMA PLC	79,688	8.21	654,557.23
WPP PLC	56,693	7.88	446,854.22
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.12	128,278.26
KINGFISHER PLC	96,593	2.23	216,271.72
NEXT PLC	7,235	85.34	617,434.90
OCADO GROUP PLC	36,500	5.31	194,107.00
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.56	210,212.13
TESCO PLC	393,967	2.84	1,120,836.11
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,881	23.07	481,724.67
BRITISH AMERICAN TOBACCO	114,644	23.83	2,732,539.74
COCA-COLA HBC AG-CDI	14,115	24.81	350,193.15
DIAGEO	126,321	29.66	3,747,312.46
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	18.24	832,054.08
HALEON PLC	314,427	3.25	1,023,931.52
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	39,541	58.16	2,299,704.56
UNILEVER PLC	141,262	40.53	5,725,348.86
SMITH & NEPHEW PLC	54,631	11.29	617,057.14
ASTRAZENECA	87,036	102.04	8,881,153.44
GSK PLC	224,792	16.77	3,771,560.17
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	19.85	170,432.10
BARCLAYS	873,251	1.61	1,412,920.11
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,087,112	6.43	6,998,827.05
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,573,042	0.43	1,559,632.83
NATWEST GROUP PLC	329,785	2.28	754,548.08
STANDARD CHARTERED PLC	135,187	6.00	812,203.49
3I GROUP PLC	55,147	24.52	1,352,204.44
ABRDN PLC	100,722	1.59	160,399.78
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	8.05	146,953.28
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	24,087	88.44	2,130,254.28
M&G PLC	118,170	2.25	266,237.01
SCHRODERS PLC	42,161	4.02	169,740.18
ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	6.53	174,747.66
WISE PLC - A	45,000	8.38	377,190.00
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	25.83	254,993.76
AVIVA PLC	152,469	4.43	676,657.42
LEGAL & GENERAL GROUP	313,717	2.41	757,312.83
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,255	5.01	217,053.59
PRUDENTIAL	158,898	8.15	1,295,018.70

	SAGE GROUP PLC	56,360	11.73	661,102.80
	HALMA PLC	20,296	22.82	463,154.72
	BT GROUP PLC	373,976	1.06	399,593.35
	VODAFONE GROUP PLC	1,387,940	0.67	930,891.35
	CENTRICA PLC	370,000	1.33	493,580.00
	NATIONAL GRID PLC	203,012	10.39	2,109,294.68
	SEVERN TRENT PLC	14,219	25.89	368,129.91
	SSE PLC	65,158	16.09	1,048,718.01
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.54	365,906.64
	イギリスポンド 小計	15,433,247		105,715,802.00 (20,041,601,743)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	13,161	11.07	145,692.27
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	636.00	197,160.00
	GIVAUDAN-REG	533	3,744.00	1,995,552.00
	HOLCIM LTD	30,195	68.06	2,055,071.70
	SIG GROUP AG	16,000	18.14	290,240.00
	SIKA AG-BR	8,383	255.40	2,141,018.20
	ABB LTD	88,585	40.15	3,556,687.75
	GEBERIT AG-REG	1,930	511.80	987,774.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,332	223.40	297,568.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	231.70	468,265.70
	VAT GROUP AG	1,440	428.50	617,040.00
	ADECCO GROUP AG-REG	9,959	36.68	365,296.12
	SGS SA	8,675	84.68	734,599.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	284.80	777,504.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	29,711	135.80	4,034,753.80
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,572	212.60	334,207.20
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	41.00	123,164.00
	AVOLTA AG	5,500	35.24	193,820.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	189	1,319.00	249,291.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	111,000.00	666,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	11,230.00	617,650.00
	NESTLE SA - REGISTERED	149,344	99.60	14,874,662.40
	ALCON INC	27,668	68.88	1,905,771.84
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,788	285.10	794,858.80
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,767	145.70	840,251.90
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,950	64.50	125,775.00
	LONZA GROUP AG-REG	4,282	454.30	1,945,312.60
	NOVARTIS	114,781	90.77	10,418,671.37
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,944	247.00	480,168.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	39,348	232.20	9,136,605.60
	SANDOZ GROUP AG	22,464	28.06	630,339.84

	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,564	108.10	169,068.40
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,775	48.25	568,143.75
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,287	1,237.50	1,592,662.50
	UBS GROUP AG	182,563	24.40	4,454,537.20
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	144.20	336,562.80
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,500	123.60	309,000.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,612	648.80	1,045,865.60
	SWISS RE LTD	16,438	102.75	1,689,004.50
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,505	443.90	3,775,369.50
	TEMENOS AG - REG	3,520	62.24	219,084.80
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	76.92	638,282.16
	SWISSCOM	1,331	520.60	692,918.60
	BKW AG	807	133.00	107,331.00
	SWISS PRIME SITE-REG	5,135	86.30	443,150.50
	スイスフラン 小計	843,296		78,041,754.20 (13,289,730,322)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	13,081	269.95	3,531,215.95
	HOLMEN AB-B SHARES	5,106	403.30	2,059,249.80
	SCA SV CELLULOSA B	34,632	142.30	4,928,133.60
	ALFA LAVAL AB	14,260	379.40	5,410,244.00
	ASSA ABLOY AB-B	57,678	293.90	16,951,564.20
	ATLAS COPCO A	156,971	174.55	27,399,288.05
	ATLAS COPCO B	85,638	151.10	12,939,901.80
	BEIJER REF AB	23,000	145.80	3,353,400.00
	EPIROC AB-A	37,140	193.20	7,175,448.00
	EPIROC AB-B	22,442	172.60	3,873,489.20
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	79.20	1,729,807.20
	INDUTRADE AB	14,669	275.20	4,036,908.80
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	265.00	2,141,465.00
	LIFCO AB-B SHS	13,590	275.90	3,749,481.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	80,939	59.36	4,804,539.04
	SAAB AB-B	5,800	799.60	4,637,680.00
	SANDVIK AB	56,973	222.70	12,687,887.10
	SKANSKA B	19,869	184.35	3,662,850.15
	SKF AB-B	18,340	216.40	3,968,776.00
	VOLVO AB-A SHS	8,748	279.20	2,442,441.60
	VOLVO B	87,756	274.00	24,045,144.00
	SECURITAS B	25,545	107.60	2,748,642.00
	VOLVO CAR AB-B	35,544	36.36	1,292,379.84
	EVOLUTION AB	9,622	1,350.00	12,989,700.00
	HENNES & MAURITZ B	33,524	142.46	4,775,829.04
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	243.60	7,711,158.00

	GETINGE AB-B SHS	12,650	208.80	2,641,320.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,481	263.20	2,495,399.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	96,619	152.50	14,734,397.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	81,670	124.35	10,155,664.50	
	SWEDBANK AB-A	50,623	218.00	11,035,814.00	
	EQT AB	22,258	279.80	6,227,788.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	344.50	2,359,136.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	344.30	2,971,653.30	
	INVESTOR AB-B SHS	95,842	255.60	24,497,215.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	559.40	2,289,624.20	
	ERICSSON (LM) B	160,922	56.04	9,018,068.88	
	HEXAGON AB-B SHS	108,582	117.55	12,763,814.10	
	TELE2 AB-B SHS	34,520	84.92	2,931,438.40	
	TELIA CO AB	138,487	25.00	3,462,175.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	32,478	65.26	2,119,514.28	
	SAGAX AB-B	9,400	254.40	2,391,360.00	
	スウェーデンクローナ 小計	1,795,548		297,141,006.33 (4,311,516,001)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	17,052	259.30	4,421,583.60	
	EQUINOR ASA	50,840	264.25	13,434,470.00	
	NORSK HYDRO	72,015	56.62	4,077,489.30	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,449	351.20	3,318,488.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,500	662.00	2,979,000.00	
	ADEVINTA ASA	16,857	115.00	1,938,555.00	
	MOWI ASA	23,314	202.90	4,730,410.60	
	ORKLA	39,803	75.80	3,017,067.40	
	SALMAR ASA	6,500	637.20	4,141,800.00	
	DNB BANK ASA	46,261	208.60	9,650,044.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	171.70	1,914,970.10	
	TELENOR ASA	38,789	116.65	4,524,736.85	
	ノルウェークローネ 小計	336,533		58,148,616.25 (833,269,670)	
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S	18,930	384.70	7,282,371.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	428	2,220.00	950,160.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	55,152	183.34	10,111,567.68	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	10,330.00	1,570,160.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	251	10,485.00	2,631,735.00	
	DSV A/S	10,213	1,135.50	11,596,861.50	
	PANDORA A/S	5,465	1,141.50	6,238,297.50	
	CARLSBERG AS-B	5,476	948.80	5,195,628.80	
	COLOPLAST-B	8,147	885.60	7,214,983.20	
	DEMANT A/S	4,463	364.40	1,626,317.20	



	GENMAB A/S	3,603	1,985.00	7,151,955.00
	NOVO NORDISK A/S-B	182,764	843.30	154,124,881.20
	DANSKE BANK A/S	38,806	192.85	7,483,737.10
	TRYG A/S	25,030	144.45	3,615,583.50
	ORSTED A/S	11,432	389.50	4,452,764.00
	デンマーククローネ 小計	370,312		231,247,002.68 (5,036,559,718)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	12,821	37.80	484,633.80
	SANTOS	176,138	7.40	1,303,421.20
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	105,494	30.19	3,184,863.86
	BHP GROUP LTD	284,017	45.54	12,934,134.18
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	22.50	484,852.50
	FORTESCUE LTD	97,584	28.21	2,752,844.64
	IGO LTD	35,382	6.98	246,966.36
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	25,493	56.54	1,441,374.22
	MINERAL RESOURCES LTD	10,000	59.41	594,100.00
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	13.17	765,466.74
	ORICA LTD	26,961	16.85	454,292.85
	PILBARA MINERALS LTD	131,710	3.56	468,887.60
	RIO TINTO LTD	20,196	128.04	2,585,895.84
	SOUTH32 LTD	246,137	2.84	699,029.08
	REECE LTD	12,870	23.83	306,692.10
	BRAMBLES LTD	82,936	15.28	1,267,262.08
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,589	26.03	744,171.67
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.92	366,927.68
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	5.72	228,502.56
	TRANSURBAN GROUP	167,820	13.16	2,208,511.20
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,473	44.35	1,395,827.55
	IDP EDUCATION LTD	12,550	19.51	244,850.50
	LOTTERY CORP LTD/THE	123,601	5.05	624,185.05
	CAR GROUP LTD	23,075	35.45	818,008.75
	REA GROUP LTD	3,000	192.85	578,550.00
	SEEK LTD	17,113	26.21	448,531.73
	WESFARMERS LTD	63,823	63.01	4,021,487.23
	COLES GROUP LTD	82,651	16.03	1,324,895.53
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	74,362	5.40	401,554.80
	WOOLWORTHS GROUP LTD	69,391	35.87	2,489,055.17
TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.74	404,795.20	
COCHLEAR LIMITED	3,460	330.31	1,142,872.60	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	50.79	489,666.39	
SONIC HEALTHCARE LTD	25,969	29.24	759,333.56	
CSL LIMITED	26,778	282.28	7,558,893.84	

	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	166,585	27.88	4,644,389.80
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	94,297	116.95	11,028,034.15
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	177,800	33.49	5,954,522.00
	WESTPAC BANKING	194,057	25.90	5,026,076.30
	ASX LTD	11,055	64.28	710,615.40
	MACQUARIE GROUP LIMITED	20,561	191.02	3,927,562.22
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	34.23	354,109.35
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	137,266	6.19	849,676.54
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.89	502,790.28
	QBE INSURANCE GROUP	78,253	17.11	1,338,908.83
	SUNCORP GROUP LIMITED	66,731	15.29	1,020,316.99
	WISETECH GLOBAL LTD	8,342	79.85	666,108.70
	XERO LTD	7,073	113.68	804,058.64
	TELSTRA GROUP LTD	199,810	3.94	787,251.40
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	8.67	761,945.61
	オーストラリアドル 小計	3,668,048		94,601,704.27 (9,309,753,717)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	8.04	520,197.74
	EBOS GROUP LTD	10,256	35.80	367,164.80
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	36,015	23.74	854,996.10
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	5.10	533,692.01
	MERCURY NZ LTD	40,719	6.79	276,685.60
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	5.57	356,669.38
	ニュージーランドドル 小計	320,228		2,909,405.63 (269,498,243)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,448	42.15	5,877,733.20
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	84,500	83.10	7,021,950.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	7.08	722,160.00
	MTR CORP	82,500	25.90	2,136,750.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	12.62	1,022,220.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	117,000	45.15	5,282,550.00
	SANDS CHINA LTD	127,000	23.50	2,984,500.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	13.18	1,093,940.00
	WH GROUP LTD	446,619	4.75	2,121,440.25
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	191,500	19.40	3,715,100.00
	HANG SENG BANK	39,600	81.85	3,241,260.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	69,800	244.80	17,087,040.00
	AIA GROUP LTD	649,400	63.75	41,399,250.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	46.80	1,497,600.00
	CLP HOLDINGS	100,000	65.10	6,510,000.00
	HONG KONG & CHINA GAS	608,990	5.99	3,647,850.10
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	46.90	3,447,150.00	

	CK ASSET HOLDINGS LTD	98,448	35.45	3,489,981.60
	ESR GROUP LTD	92,400	9.35	863,940.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	8.27	951,050.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	21.30	1,698,909.30
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	9.36	713,700.00
	SINO LAND CO	198,600	8.01	1,590,786.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,000	72.45	5,796,000.00
	SWIRE PACIFIC A	31,000	63.15	1,957,650.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	15.56	1,073,640.00
	WHARF HOLDINGS	77,000	27.00	2,079,000.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	26.25	2,126,250.00
	香港ドル 小計	4,026,316		131,149,400.45 (2,518,068,488)
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,100	26.19	133,569.00
	KEPPEL LTD	80,200	7.39	592,678.00
	SEATRIM LTD	3,030,719	0.09	293,979.74
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.92	293,216.00
	SINGAPORE AIRLINES	73,350	7.37	540,589.50
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	1.06	338,882.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	106,600	3.24	345,384.00
	DBS GROUP	101,800	34.17	3,478,506.00
	OCBC BANK	199,350	13.45	2,681,257.50
	UNITED OVERSEAS BANK	72,300	29.51	2,133,573.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.42	400,350.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	420,880	2.39	1,005,903.20
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	49,000	5.81	284,690.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	153,900	2.92	449,388.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	6.07	133,540.00
	UOL GROUP LIMITED	24,800	6.21	154,008.00
	シンガポールドル 小計	4,776,999		13,259,513.94 (1,481,485,492)
イスラエルシェケル	ICL LTD	39,375	18.05	710,718.75
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	758.00	945,984.00
	BANK HAPUALIM BM	80,240	32.60	2,615,824.00
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,181	28.07	2,306,820.67
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	17.93	1,151,590.11
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,698	136.00	1,182,928.00
	NICE LTD	3,165	825.90	2,613,973.50
	AZRIELI GROUP	2,465	243.60	600,474.00
	イスラエルシェケル 小計	281,599		12,128,313.03 (494,359,741)
		63,272,860		480,556,888,077

合 計			(480,556,888,077)
-----	--	--	-------------------

## (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
新株予約権証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,063.00	-	
	カナダドル 小計		1,063.00	-	(-)
新株予約権証券合計				-	(-)
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	63,405	507,874.05	
	オーストラリアドル 小計		63,405	507,874.05	(49,979,885)
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,705,700.00	
	香港ドル 小計		185,000	1,705,700.00	(32,749,440)
投資信託受益証券合計			248,405	82,729,325	(82,729,325)
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,648	1,146,471.84	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	20,363	700,079.94	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	26,373	4,968,673.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	24,773	463,255.10	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,676	1,353,585.84	
		BOSTON PROPERTIES	7,893	521,174.79	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,427	607,287.23	
		CROWN CASTLE INC	24,878	2,709,711.76	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,085	2,172,440.10	
		EQUINIX INC	5,148	4,400,201.52	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	598,360.56	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,842	1,132,781.04	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,594	837,222.30	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,358	1,606,248.36	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	15,190	684,917.10	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	39,537	668,966.04	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,506	796,347.96	
		INVITATION HOMES INC	35,025	1,147,769.25	
		IRON MOUNTAIN INC	16,160	1,105,667.20	
		KIMCO REALTY CORP	31,093	610,666.52	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,844	866,587.28	
		PROLOGIS INC	52,154	6,954,735.90	
PUBLIC STORAGE	8,723	2,478,378.76			
REALTY INCOME CORP	46,547	2,442,321.09			
REGENCY CENTERS CORP	10,530	638,328.60			

	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,725	1,185,304.00
	SIMON PROPERTY GROUP	18,395	2,739,015.50
	SUN COMMUNITIES INC	6,650	870,152.50
	UDR INC	17,830	638,314.00
	VENTAS INC	23,610	1,016,174.40
	VICI PROPERTIES INC	56,023	1,656,039.88
	WELLTOWER INC	28,300	2,626,523.00
	WP CAREY INC	10,761	612,731.34
	アメリカドル 小計	661,640	52,956,433.90 (7,951,938,114)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	254,869.32
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	165,482.50
	カナダドル 小計	14,014	420,351.82 (46,667,459)
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,076	127,469.44
	GECINA SA	2,719	254,226.50
	KLEPIERRE	11,603	274,991.10
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	430,723.40
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,235	184,637.20
	ユーロ 小計	30,818	1,272,047.64 (206,504,213)
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	207,379.92
	SEGRE PLC	63,208	544,600.12
	イギリスポンド 小計	95,340	751,980.04 (142,560,375)
オーストラリアドル	DEXUS	74,283	566,779.29
	GOODMAN GROUP	100,493	2,885,154.03
	GPT GROUP	111,587	492,098.67
	MIRVAC GROUP	228,843	510,319.89
	SCENTRE GROUP	297,027	885,140.46
	STOCKLAND	121,481	560,027.41
	VICINITY CENTERS	221,263	439,207.05
	オーストラリアドル 小計	1,154,977	6,338,726.80 (623,794,104)
香港ドル	LINK REIT	147,800	5,616,400.00
	香港ドル 小計	147,800	5,616,400.00 (107,834,880)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	207,909	569,670.66
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	276,190	544,094.30
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	174,778	265,662.56
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	132,200	183,758.00
	シンガポールドル 小計	791,077	1,563,185.52

			(174,654,718)	
	投資証券合計	2,895,666	9,253,953,863 (9,253,953,863)	
	合計		9,336,683,188 (9,336,683,188)	

## 有価証券明細表注記

1. 券面総額欄の数値は、証券数又は口数を表示しております。
2. 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。
3. 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。
4. 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。
5. 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	組入新株予約権 証券 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 589銘柄	97.8%				73.8%
	投資証券 33銘柄				2.2%	1.6%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%				3.3%
	新株予約権 証券 1銘柄					
	投資証券 2銘柄				0.3%	0.0%
ユーロ	株式 220銘柄	99.5%				9.3%
	投資証券 5銘柄				0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 81銘柄	99.3%				4.1%
	投資証券 2銘柄				0.7%	0.0%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.0%				2.7%
スウェーデン クローナ	株式 42銘柄	100.0%				0.9%
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 15銘柄	100.0%				1.0%
オーストラ リアドル	株式 50銘柄	93.3%				1.9%
	投資信託受 益証券 1銘柄			0.5%		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	94.7%				0.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄			1.2%		0.0%
	投資証券 1銘柄				4.1%	0.0%
シンガポ ールドル	株式 16銘柄	89.5%				0.3%
	投資証券 4銘柄				10.5%	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

	2024年 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	561,234,902
コール・ローン	890,980,396
国債証券	174,730,906,035
派生商品評価勘定	1,109,436
未収入金	64,882
未収利息	1,236,641,581
前払金	6,158,198
前払費用	69,382,960
差入委託証拠金	86,635,538
流動資産合計	177,583,113,928
資産合計	177,583,113,928
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,252,082
未払金	1,014,022,158
未払解約金	212,091,182
未払利息	169
流動負債合計	1,232,365,591
負債合計	1,232,365,591
純資産の部	
元本等	
元本	58,566,398,371
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	117,784,349,966
元本等合計	176,350,748,337
純資産合計	176,350,748,337
負債純資産合計	177,583,113,928

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024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 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</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 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p>

2024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	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024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	58,566,398,371口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.0111円 (30,111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

2024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、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2024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。



2024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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2024年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月22日
期首元本額	57,796,068,029円
期中追加設定元本額	7,449,609,718円
期中一部解約元本額	6,679,279,376円
期末元本額	58,566,398,371円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,856,380,809円
DC外国債券インデックスファンド	1,819,495,078円
DC外国債券インデックスファンドL	14,373,706,162円
DCバランスファンド30	1,001,030,821円
DCバランスファンド50	1,142,238,081円
DCバランスファンド70	240,598,088円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	495,219,563円
外国債券インデックスe	957,595,571円
インデックスコレクション（外国債券）	9,884,745,359円
インデックスコレクション（バランス株式30）	5,389,328,016円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,144,589,464円
インデックスコレクション（バランス株式70）	371,381,524円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,863,516,266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）	3,039,146,582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）	289,366,867円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	52,263,881円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	312,464,023円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	208,256,874円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	167,375,574円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	71,385,963円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	890,961,479円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	478,759,255円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,246,958,721円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	295,184,972円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	137,466,804円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,252,568,776円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	58,825,752円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	155,526,501円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	67,405,339円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	38,375,441円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	45,902,233円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	179,531,836円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	57,152,256円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	964,784,157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）	16,910,283円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024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	1,018,231,994	
合計	1,018,231,994	

(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

(2024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	債券先物取引 買建	764,167,817	-		758,009,619	6,158,198
	合計	764,167,817	-		758,009,619	6,158,198

(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

(2024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)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,859,210,553	-		1,860,226,105	1,015,552
	アメリカドル	1,001,078,456	-		1,001,141,058	62,602
	カナダドル	52,362,854	-		52,283,685	79,169
	ユーロ	610,879,068	-		611,705,416	826,348
	イギリスポンド	101,478,751	-		101,596,214	117,463
	オーストラリアドル	13,276,710	-		13,276,966	256
	オフショア人民元	80,134,714	-		80,222,766	88,052
	合計	1,859,210,553	-		1,860,226,105	1,015,552

(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 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,113,901.56	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	4,055,524.79	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	2,062,972.64	
		T 0.25% 09/30/25	3,290,000.00	3,065,033.38	
		T 0.375% 01/31/26	1,700,000.00	1,567,818.35	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,590,312.48	
		T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,496,953.12	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,477,578.12	
		T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,498,074.00	
		T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,226,972.66	
		T 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	3,812,656.24	
		T 0.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,772,500.00	
		T 0.5% 05/31/27	300,000.00	264,972.65	
		T 0.5% 06/30/27	2,500,000.00	2,202,197.27	
		T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	963,423.82	
		T 0.5% 10/31/27	1,580,000.00	1,375,896.08	
		T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,034,765.60	
		T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	5,934,597.68	
		T 0.625% 07/31/26	4,000,000.00	3,648,437.52	
		T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	7,258,350.00	
		T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,229,044.90	
		T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,610,234.36	
		T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,052,382.83	
		T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,543,642.58	
		T 0.75% 04/30/26	3,500,000.00	3,227,792.96	
		T 0.75% 08/31/26	3,000,000.00	2,738,027.34	
		T 0.875% 09/30/26	5,000,000.00	4,570,117.20	
		T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	4,954,348.41	
		T 1.125% 02/15/31	5,600,000.00	4,563,343.73	
		T 1.125% 02/29/28	3,880,000.00	3,428,267.97	
		T 1.125% 05/15/40	1,550,000.00	946,710.93	
		T 1.125% 08/15/40	3,600,000.00	2,177,859.38	
		T 1.125% 08/31/28	4,000,000.00	3,485,234.36	
		T 1.125% 10/31/26	6,850,000.00	6,283,001.93	
		T 1.25% 03/31/28	5,300,000.00	4,696,089.85	
		T 1.25% 04/30/28	5,300,000.00	4,685,427.74	
		T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	2,557,400.01	
		T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,293,359.36	
		T 1.25% 06/30/28	1,000,000.00	880,175.78	
		T 1.25% 08/15/31	6,550,000.00	5,293,730.43	

T 1.25% 09/30/28	3,800,000.00	3,322,847.64	
T 1.25% 11/30/26	3,000,000.00	2,755,546.86	
T 1.25% 12/31/26	5,500,000.00	5,042,919.91	
T 1.375% 08/15/50	2,300,000.00	1,187,285.16	
T 1.375% 10/31/28	1,700,000.00	1,492,181.64	
T 1.375% 11/15/31	12,110,000.00	9,810,992.18	
T 1.375% 11/15/40	4,650,000.00	2,925,413.06	
T 1.5% 01/31/27	5,800,000.00	5,343,816.42	
T 1.5% 02/15/25	3,000,000.00	2,899,357.32	
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,555,744.53	
T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	4,934,589.85	
T 1.5% 11/30/28	5,550,000.00	4,891,371.06	
T 1.625% 02/15/26	4,450,000.00	4,202,816.38	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,072,414.07	
T 1.625% 05/15/31	4,290,000.00	3,591,450.59	
T 1.625% 08/15/29	1,760,000.00	1,539,106.25	
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,003,783.20	
T 1.625% 11/15/50	3,100,000.00	1,712,871.08	
T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	2,812,928.92	
T 1.75% 01/31/29	2,500,000.00	2,222,412.10	
T 1.75% 03/15/25	5,500,000.00	5,319,316.42	
T 1.75% 08/15/41	4,800,000.00	3,173,437.48	
T 1.75% 11/15/29	2,220,000.00	1,945,621.87	
T 1.75% 12/31/26	4,300,000.00	3,998,748.06	
T 1.875% 02/15/32	6,200,000.00	5,195,890.65	
T 1.875% 02/15/41	4,750,000.00	3,245,957.05	
T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	2,651,660.14	
T 1.875% 02/28/27	3,000,000.00	2,789,414.07	
T 1.875% 02/28/29	1,900,000.00	1,696,566.41	
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	3,752,393.75	
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,693,476.55	
T 1.875% 11/15/51	3,400,000.00	1,992,054.69	
T 1% 07/31/28	2,500,000.00	2,170,800.77	
T 2.125% 05/15/25	3,850,000.00	3,726,378.88	
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,669,884.75	
T 2.25% 02/15/52	2,410,000.00	1,551,719.92	
T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,432,089.84	
T 2.25% 05/15/41	1,600,000.00	1,158,906.25	
T 2.25% 08/15/27	1,820,000.00	1,697,825.38	
T 2.25% 08/15/46	2,180,000.00	1,465,539.05	
T 2.25% 08/15/49	2,110,000.00	1,379,082.81	
T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,281,503.92	

T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	4,887,382.44
T 2.375% 02/15/42	1,350,000.00	985,842.77
T 2.375% 03/31/29	1,400,000.00	1,279,468.75
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,739,237.50
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,386,039.07
T 2.375% 05/15/29	1,390,000.00	1,268,049.21
T 2.375% 05/15/51	1,980,000.00	1,316,545.32
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	1,349,919.13
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	3,908,928.76
T 2.5% 02/15/45	1,750,000.00	1,258,120.11
T 2.5% 02/15/46	1,250,000.00	888,452.15
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	624,317.38
T 2.5% 05/15/46	1,810,000.00	1,282,943.54
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,301,378.91
T 2.625% 02/15/29	6,900,000.00	6,397,054.72
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,439,648.45
T 2.625% 05/31/27	2,900,000.00	2,747,070.29
T 2.625% 12/31/25	4,500,000.00	4,342,412.11
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,406,126.74
T 2.75% 05/31/29	6,000,000.00	5,572,734.36
T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	1,947,578.12
T 2.75% 07/31/27	5,000,000.00	4,745,605.45
T 2.75% 08/15/32	3,180,000.00	2,832,932.82
T 2.75% 08/15/42	2,330,000.00	1,800,107.01
T 2.75% 08/15/47	1,150,000.00	845,744.14
T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	4,855,371.10
T 2.75% 11/15/42	1,650,000.00	1,270,306.63
T 2.75% 11/15/47	1,400,000.00	1,028,015.63
T 2.875% 04/30/25	8,370,000.00	8,180,530.65
T 2.875% 04/30/29	4,170,000.00	3,901,556.25
T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,216,442.16
T 2.875% 05/15/32	6,750,000.00	6,091,479.51
T 2.875% 05/15/43	1,350,000.00	1,055,531.25
T 2.875% 05/15/49	4,100,000.00	3,061,867.20
T 2.875% 05/15/52	4,300,000.00	3,190,314.43
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	487,099.61
T 2.875% 08/15/28	10,200,000.00	9,617,882.83
T 2.875% 08/15/45	1,880,000.00	1,439,411.71
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	5,876,579.41
T 2% 02/15/50	3,370,000.00	2,068,469.13
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,604,174.80
T 2% 08/15/51	6,090,000.00	3,692,181.43
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,533,570.32

T 2% 11/15/41	4,140,000.00	2,847,786.31	
T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	823,710.94	
T 3.125% 02/15/43	3,600,000.00	2,934,562.50	
T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,100,449.22	
T 3.125% 08/15/25	2,500,000.00	2,442,822.27	
T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,249,203.12	
T 3.125% 08/31/29	4,300,000.00	4,059,132.83	
T 3.125% 11/15/28	7,460,000.00	7,097,199.23	
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	719,075.39	
T 3.25% 05/15/42	1,500,000.00	1,254,228.51	
T 3.25% 06/30/27	4,850,000.00	4,684,986.31	
T 3.375% 05/15/33	2,310,000.00	2,149,653.52	
T 3.375% 05/15/44	400,000.00	336,054.68	
T 3.375% 08/15/42	1,200,000.00	1,020,117.19	
T 3.375% 11/15/48	1,400,000.00	1,150,105.46	
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,647,734.36	
T 3.5% 02/15/39	900,000.00	812,935.54	
T 3.625% 02/15/44	1,600,000.00	1,398,187.50	
T 3.625% 02/15/53	3,270,000.00	2,820,375.00	
T 3.625% 05/15/53	1,650,000.00	1,424,349.61	
T 3.625% 08/15/43	2,700,000.00	2,365,611.31	
T 3.75% 04/15/26	5,800,000.00	5,707,562.50	
T 3.75% 06/30/30	2,500,000.00	2,425,878.90	
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	996,552.73	
T 3.75% 11/15/43	1,800,000.00	1,603,792.96	
T 3.875% 02/15/43	830,000.00	755,753.91	
T 3.875% 08/15/33	4,000,000.00	3,871,250.00	
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	631,523.43	
T 3.875% 09/30/29	1,050,000.00	1,029,000.00	
T 3.875% 11/30/29	3,880,000.00	3,800,429.69	
T 3% 02/15/47	2,100,000.00	1,624,792.97	
T 3% 02/15/48	2,950,000.00	2,268,676.75	
T 3% 02/15/49	1,940,000.00	1,485,691.40	
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	885,951.17	
T 3% 05/15/45	600,000.00	470,484.37	
T 3% 05/15/47	1,300,000.00	1,004,046.87	
T 3% 07/15/25	6,100,000.00	5,955,601.53	
T 3% 08/15/48	2,360,000.00	1,810,424.22	
T 3% 08/15/52	2,570,000.00	1,957,717.57	
T 3% 09/30/25	3,660,000.00	3,563,639.08	
T 3% 10/31/25	1,000,000.00	972,832.03	
T 3% 11/15/44	1,550,000.00	1,220,655.27	

T	4.125%	08/15/53	1,200,000.00	1,134,656.25	
T	4.125%	08/31/30	3,400,000.00	3,368,324.20	
T	4.125%	11/15/32	5,690,000.00	5,620,541.99	
T	4.25%	05/15/39	850,000.00	835,125.00	
T	4.25%	10/15/25	680,000.00	675,258.59	
T	4.25%	11/15/40	650,000.00	630,982.42	
T	4.375%	02/15/38	500,000.00	502,861.33	
T	4.375%	05/15/40	750,000.00	742,089.84	
T	4.375%	05/15/41	550,000.00	540,536.13	
T	4.375%	11/15/39	650,000.00	645,353.51	
T	4.375%	11/30/30	3,970,000.00	3,989,229.68	
T	4.5%	02/15/36	600,000.00	618,117.18	
T	4.5%	05/15/38	250,000.00	254,052.73	
T	4.5%	08/15/39	750,000.00	756,562.50	
T	4.5%	11/15/25	4,350,000.00	4,337,595.71	
T	4.5%	11/15/33	2,300,000.00	2,338,093.75	
T	4.625%	02/15/40	700,000.00	714,000.00	
T	4.625%	03/15/26	2,170,000.00	2,172,670.11	
T	4.625%	09/30/28	2,950,000.00	2,992,406.25	
T	4.625%	11/15/26	3,600,000.00	3,618,421.88	
T	4.75%	02/15/41	750,000.00	772,573.24	
T	4.75%	11/15/53	2,500,000.00	2,627,343.75	
T	4%	02/28/30	2,400,000.00	2,364,281.25	
T	4%	06/30/28	2,000,000.00	1,977,265.62	
T	4%	07/31/30	800,000.00	787,093.75	
T	4%	11/15/52	3,500,000.00	3,235,312.50	
T	4%	12/15/25	5,000,000.00	4,943,945.30	
T	5.0%	05/15/37	300,000.00	322,101.56	
T	5.25%	11/15/28	1,900,000.00	1,979,191.41	
T	5.375%	02/15/31	750,000.00	803,437.50	
T	5%	08/31/25	1,230,000.00	1,234,420.31	
T	6.0%	02/15/26	600,000.00	616,148.43	
T	6.125%	11/15/27	1,850,000.00	1,963,384.75	
T	6.25%	05/15/30	2,920,000.00	3,231,162.50	
アメリカドル 小計			625,020,000.00	550,396,749.31 (82,647,575,876)	
カナダドル	CAN	0.25%	03/01/26	1,130,000.00	1,047,158.36
	CAN	0.5%	09/01/25	1,590,000.00	1,500,944.64
	CAN	0.5%	12/01/30	1,570,000.00	1,287,915.25
	CAN	1.25%	03/01/25	500,000.00	483,491.07
	CAN	1.25%	03/01/27	640,000.00	594,019.44
	CAN	1.25%	06/01/30	1,940,000.00	1,693,792.83
	CAN	1.5%	04/01/25	1,210,000.00	1,169,983.29

	CAN 1.5% 06/01/26	740,000.00	700,245.69
	CAN 1.5% 06/01/31	2,010,000.00	1,750,716.37
	CAN 1.5% 12/01/31	1,230,000.00	1,061,927.47
	CAN 1.75% 12/01/53	1,520,000.00	1,056,649.43
	CAN 1% 06/01/27	640,000.00	587,119.60
	CAN 1% 09/01/26	1,060,000.00	986,322.39
	CAN 2.25% 06/01/25	670,000.00	651,674.66
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	366,610.90
	CAN 2.25% 12/01/29	240,000.00	224,644.54
	CAN 2.5% 12/01/32	940,000.00	868,158.46
	CAN 2.75% 06/01/33	330,000.00	310,397.84
	CAN 2.75% 09/01/27	710,000.00	686,884.45
	CAN 2.75% 12/01/48	520,000.00	462,749.87
	CAN 2.75% 12/01/55	280,000.00	246,053.84
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	304,804.19
	CAN 2% 06/01/28	500,000.00	468,693.38
	CAN 2% 06/01/32	1,190,000.00	1,060,926.81
	CAN 2% 12/01/51	2,400,000.00	1,797,007.77
	CAN 3.25% 09/01/28	1,010,000.00	994,272.71
	CAN 3.5% 03/01/28	780,000.00	774,954.65
	CAN 3.5% 08/01/25	1,940,000.00	1,914,968.70
	CAN 3.5% 12/01/45	490,000.00	494,259.73
	CAN 3% 10/01/25	1,880,000.00	1,840,866.14
	CAN 4.0% 06/01/41	420,000.00	448,505.44
	CAN 5.75% 06/01/29	680,000.00	752,071.27
	CAN 5.75% 06/01/33	2,170,000.00	2,550,445.21
	CAN 5% 06/01/37	420,000.00	485,763.58
	カナダドル 小計	34,090,000.00	31,624,999.97 (3,511,007,496)
メキシコベ ソ	MBONO 10% 11/20/36	5,250,000.00	5,554,710.00
	MBONO 5.5% 03/04/27	14,220,000.00	12,718,510.20
	MBONO 5.75% 03/05/26	28,180,000.00	25,970,215.13
	MBONO 5% 03/06/25	6,400,000.00	6,079,872.00
	MBONO 7.5% 05/26/33	11,360,000.00	10,130,507.20
	MBONO 7.5% 06/03/27	21,620,000.00	20,423,549.20
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,210,000.00	20,466,070.80
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	11,968,417.80
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,970,000.00	4,467,433.60
	MBONO 7% 09/03/26	3,040,000.00	2,850,881.60
	MBONO 8.5% 05/31/29	17,740,000.00	17,209,041.80
	MBONO 8.5% 11/18/38	13,720,000.00	12,833,550.80
	MBONO 8% 07/31/53	9,730,000.00	8,344,253.40



	MBONO 8% 11/07/47	14,310,000.00	12,437,679.60	
	メキシコペソ 小計	186,730,000.00	171,454,693.13 (1,509,469,972)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	660,000.00	562,617.00	
	BGB 0.35% 06/22/32	860,000.00	705,663.11	
	BGB 0.4% 06/22/40	400,000.00	258,371.60	
	BGB 0.65% 06/22/71	340,000.00	143,323.60	
	BGB 0.8% 06/22/25	940,000.00	911,256.99	
	BGB 0.8% 06/22/27	920,000.00	865,466.08	
	BGB 0.8% 06/22/28	810,000.00	750,943.71	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,100,000.00	1,006,959.80	
	BGB 0% 10/22/27	530,000.00	481,394.65	
	BGB 0% 10/22/31	730,000.00	593,716.30	
	BGB 1.25% 04/22/33	410,000.00	359,570.41	
	BGB 1.4% 06/22/53	520,000.00	332,649.20	
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	328,828.80	
	BGB 1.6% 06/22/47	640,000.00	462,456.96	
	BGB 1.7% 06/22/50	610,000.00	436,053.60	
	BGB 1.9% 06/22/38	480,000.00	411,598.08	
	BGB 1% 06/22/26	1,000,000.00	959,640.00	
	BGB 1% 06/22/31	910,000.00	807,724.19	
	BGB 2.15% 06/22/66	450,000.00	339,588.00	
	BGB 2.25% 06/22/57	270,000.00	210,514.41	
	BGB 2.75% 04/22/39	140,000.00	133,135.38	
	BGB 2.85% 10/22/34	200,000.00	198,261.20	
	BGB 3.3% 06/22/54	580,000.00	569,067.00	
	BGB 3.45% 06/22/43	280,000.00	286,238.45	
	BGB 3.75% 06/22/45	450,000.00	480,566.25	
	BGB 3% 06/22/33	860,000.00	869,853.02	
	BGB 3% 06/22/34	350,000.00	352,754.85	
	BGB 4.25% 03/28/41	980,000.00	1,110,622.24	
	BGB 4.5% 03/28/26	510,000.00	526,778.59	
	BGB 4% 03/28/32	620,000.00	675,347.40	
	BGB 5.5% 03/28/28	1,170,000.00	1,299,032.28	
	BGB 5% 03/28/35	1,110,000.00	1,320,678.00	
	BKO 2.5% 03/13/25	1,900,000.00	1,884,805.44	
	BKO 3.1% 09/18/25	1,000,000.00	1,001,566.00	
BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,110,986.25		
BTPS 0.35% 02/01/25	590,000.00	573,223.82		
BTPS 0.45% 02/15/29	1,710,000.00	1,488,578.94		
BTPS 0.5% 02/01/26	1,500,000.00	1,424,388.88		
BTPS 0.5% 07/15/28	730,000.00	649,667.15		
BTPS 0.6% 08/01/31	1,300,000.00	1,052,555.40		

BTPS 0.85% 01/15/27	1,000,000.00	937,584.00	
BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,088,610.90	
BTPS 0.95% 03/01/37	600,000.00	415,740.00	
BTPS 0.95% 06/01/32	1,290,000.00	1,046,828.55	
BTPS 0.95% 08/01/30	420,000.00	359,820.71	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	926,508.80	
BTPS 0.95% 12/01/31	1,120,000.00	922,906.88	
BTPS 0% 04/01/26	2,700,000.00	2,526,865.20	
BTPS 0% 08/01/26	1,330,000.00	1,232,868.77	
BTPS 1.1% 04/01/27	1,400,000.00	1,316,309.91	
BTPS 1.2% 08/15/25	940,000.00	911,693.64	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,112,562.36	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,510,000.00	1,339,871.32	
BTPS 1.45% 03/01/36	830,000.00	631,998.52	
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,046,021.07	
BTPS 1.5% 04/30/45	650,000.00	406,907.15	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,465,567.50	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,304,668.35	
BTPS 1.65% 03/01/32	1,300,000.00	1,126,076.90	
BTPS 1.65% 12/01/30	820,000.00	729,595.00	
BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	453,885.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	890,000.00	633,516.24	
BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	803,981.61	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	1,003,289.04	
BTPS 2.15% 03/01/72	260,000.00	156,182.00	
BTPS 2.15% 09/01/52	510,000.00	335,804.91	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,110,000.00	1,077,997.59	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,190,000.00	986,951.49	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,360,000.00	1,222,275.52	
BTPS 2.45% 09/01/50	970,000.00	698,584.30	
BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	652,202.47	
BTPS 2.5% 12/01/32	960,000.00	877,365.12	
BTPS 2.65% 12/01/27	770,000.00	755,926.71	
BTPS 2.7% 03/01/47	940,000.00	732,630.36	
BTPS 2.8% 03/01/67	500,000.00	361,909.61	
BTPS 2.8% 06/15/29	700,000.00	681,740.50	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,235,775.24	
BTPS 2.95% 09/01/38	850,000.00	743,539.20	
BTPS 2% 02/01/28	930,000.00	889,944.34	
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,028,380.50	
BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	586,195.06	
BTPS 3.25% 03/01/38	270,000.00	245,565.00	

BTPS 3.25% 09/01/46	880,000.00	755,788.00
BTPS 3.35% 03/01/35	1,390,000.00	1,320,947.60
BTPS 3.4% 03/28/25	140,000.00	139,919.64
BTPS 3.4% 04/01/28	1,050,000.00	1,057,610.50
BTPS 3.45% 03/01/48	1,040,000.00	917,868.64
BTPS 3.5% 01/15/26	1,490,000.00	1,497,469.37
BTPS 3.5% 03/01/30	1,870,000.00	1,881,824.01
BTPS 3.6% 09/29/25	920,000.00	924,199.80
BTPS 3.85% 09/01/49	840,000.00	785,607.41
BTPS 3.85% 12/15/29	1,250,000.00	1,279,260.00
BTPS 3% 08/01/29	670,000.00	659,001.95
BTPS 4.35% 11/01/33	1,540,000.00	1,611,246.56
BTPS 4.4% 05/01/33	240,000.00	252,783.36
BTPS 4.45% 09/01/43	440,000.00	449,216.46
BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	953,455.53
BTPS 4.5% 10/01/53	570,000.00	582,303.45
BTPS 4.75% 09/01/28	1,260,000.00	1,338,777.72
BTPS 4.75% 09/01/44	1,030,000.00	1,094,859.10
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	1,803,470.94
BTPS 4% 04/30/35	620,000.00	626,378.56
BTPS 4% 10/30/31	440,000.00	453,121.68
BTPS 4% 11/15/30	1,490,000.00	1,533,880.50
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	1,572,618.24
BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	1,945,178.67
BTPS 5.75% 02/01/33	1,410,000.00	1,627,714.85
BTPS 5% 03/01/25	1,290,000.00	1,309,695.07
BTPS 5% 08/01/34	1,620,000.00	1,778,743.80
BTPS 5% 09/01/40	1,220,000.00	1,332,618.20
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,309,672.88
BTPS 6% 05/01/31	1,320,000.00	1,530,672.00
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	386,939.70
DBR 0.25% 02/15/27	230,000.00	215,200.65
DBR 0.25% 02/15/29	1,750,000.00	1,581,902.00
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,185,756.00
DBR 0.5% 02/15/25	1,290,000.00	1,255,464.12
DBR 0.5% 02/15/26	1,990,000.00	1,903,625.94
DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,403,520.84
DBR 0.5% 08/15/27	580,000.00	542,990.78
DBR 0% 02/15/30	1,660,000.00	1,449,566.78
DBR 0% 02/15/31	1,380,000.00	1,179,192.06
DBR 0% 02/15/32	2,080,000.00	1,735,993.68
DBR 0% 05/15/35	1,280,000.00	977,716.41
DBR 0% 05/15/36	1,320,000.00	979,397.22

DBR 0% 08/15/26	1,950,000.00	1,829,119.50
DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,145,383.82
DBR 0% 08/15/30	1,880,000.00	1,624,398.96
DBR 0% 08/15/30	400,000.00	346,017.10
DBR 0% 08/15/31	2,310,000.00	1,952,298.81
DBR 0% 08/15/50	2,530,000.00	1,315,106.65
DBR 0% 08/15/52	1,630,000.00	807,534.60
DBR 0% 11/15/27	1,230,000.00	1,125,081.00
DBR 0% 11/15/28	1,250,000.00	1,120,887.50
DBR 1.25% 08/15/48	1,880,000.00	1,443,225.24
DBR 1.7% 08/15/32	1,310,000.00	1,249,542.19
DBR 1.8% 08/15/53	1,580,000.00	1,342,066.22
DBR 1% 05/15/38	970,000.00	793,507.53
DBR 1% 08/15/25	1,130,000.00	1,097,439.05
DBR 2.1% 11/15/29	450,000.00	444,350.25
DBR 2.3% 02/15/33	2,120,000.00	2,116,124.64
DBR 2.4% 11/15/30	300,000.00	301,441.80
DBR 2.5% 07/04/44	1,520,000.00	1,499,860.00
DBR 2.5% 08/15/46	1,600,000.00	1,582,492.80
DBR 2.6% 08/15/33	1,160,000.00	1,184,583.88
DBR 3.25% 07/04/42	930,000.00	1,018,668.06
DBR 4.0% 01/04/37	1,570,000.00	1,829,262.73
DBR 4.25% 07/04/39	990,000.00	1,200,202.74
DBR 4.75% 07/04/28	1,180,000.00	1,294,080.04
DBR 4.75% 07/04/34	1,440,000.00	1,748,900.16
DBR 4.75% 07/04/40	1,100,000.00	1,417,226.80
DBR 5.5% 01/04/31	1,090,000.00	1,307,863.75
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	1,674,873.00
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	739,575.34
DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,431,740.85
FRTR 0.25% 11/25/26	1,800,000.00	1,682,265.60
FRTR 0.5% 05/25/25	2,500,000.00	2,418,130.00
FRTR 0.5% 05/25/26	2,710,000.00	2,575,009.48
FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	2,536,973.31
FRTR 0.5% 05/25/40	1,460,000.00	971,981.49
FRTR 0.5% 05/25/72	640,000.00	248,508.16
FRTR 0.5% 06/25/44	700,000.00	419,673.80
FRTR 0.75% 02/25/28	1,970,000.00	1,828,892.84
FRTR 0.75% 05/25/28	3,250,000.00	3,005,613.00
FRTR 0.75% 05/25/52	1,930,000.00	1,045,037.10
FRTR 0.75% 05/25/53	1,750,000.00	926,985.50
FRTR 0.75% 11/25/28	2,990,000.00	2,740,400.78

FRTR 0% 02/25/25	880,000.00	851,194.08
FRTR 0% 02/25/26	2,790,000.00	2,636,522.10
FRTR 0% 02/25/27	2,140,000.00	1,974,057.98
FRTR 0% 03/25/25	1,890,000.00	1,824,068.25
FRTR 0% 05/25/32	1,850,000.00	1,480,588.30
FRTR 0% 11/25/29	2,460,000.00	2,118,041.78
FRTR 0% 11/25/30	2,880,000.00	2,410,643.52
FRTR 0% 11/25/31	3,590,000.00	2,918,372.03
FRTR 1.25% 05/25/34	2,200,000.00	1,885,817.35
FRTR 1.25% 05/25/36	2,570,000.00	2,113,997.19
FRTR 1.25% 05/25/38	600,000.00	472,819.20
FRTR 1.5% 05/25/31	2,410,000.00	2,225,784.42
FRTR 1.5% 05/25/50	2,030,000.00	1,401,670.34
FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	575,496.75
FRTR 1.75% 06/25/39	1,660,000.00	1,392,613.84
FRTR 1% 05/25/27	2,850,000.00	2,701,418.10
FRTR 1% 11/25/25	1,520,000.00	1,469,851.29
FRTR 2.5% 05/25/30	3,520,000.00	3,490,842.88
FRTR 2.5% 05/25/43	510,000.00	456,224.58
FRTR 2.5% 09/24/26	1,670,000.00	1,658,214.81
FRTR 2.75% 02/25/29	1,010,000.00	1,014,197.56
FRTR 2.75% 10/25/27	3,080,000.00	3,086,723.64
FRTR 2% 05/25/48	1,580,000.00	1,247,312.04
FRTR 2% 11/25/32	1,960,000.00	1,844,005.24
FRTR 3.25% 05/25/45	1,800,000.00	1,801,335.60
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,163,427.28
FRTR 3.5% 11/25/33	700,000.00	738,448.90
FRTR 3% 05/25/33	2,110,000.00	2,142,700.78
FRTR 3% 05/25/54	970,000.00	909,585.19
FRTR 4.5% 04/25/41	1,940,000.00	2,281,889.11
FRTR 4.75% 04/25/35	1,590,000.00	1,862,495.79
FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	1,209,042.64
FRTR 4% 04/25/60	1,020,000.00	1,169,368.80
FRTR 4% 10/25/38	1,420,000.00	1,572,166.20
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	2,837,770.00
FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	2,632,984.60
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,519,936.40
IRISH 0.2% 05/15/27	410,000.00	380,058.43
IRISH 0.2% 10/18/30	380,000.00	326,032.76
IRISH 0.35% 10/18/32	170,000.00	140,299.30
IRISH 0.4% 05/15/35	310,000.00	240,358.50
IRISH 0.55% 04/22/41	250,000.00	169,602.00
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	411,699.64

IRISH 0% 10/18/31	530,000.00	435,591.83
IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	511,357.88
IRISH 1.3% 05/15/33	310,000.00	275,648.90
IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	221,431.68
IRISH 1.5% 05/15/50	460,000.00	334,418.16
IRISH 1.7% 05/15/37	420,000.00	365,456.70
IRISH 1% 05/15/26	670,000.00	645,478.00
IRISH 2.4% 05/15/30	440,000.00	435,952.88
IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	523,005.96
IRISH 3% 10/18/43	170,000.00	170,864.62
IRISH 5.4% 03/13/25	590,000.00	602,740.34
NETHER 0.25% 07/15/25	720,000.00	692,640.00
NETHER 0.25% 07/15/29	540,000.00	479,000.65
NETHER 0.5% 01/15/40	780,000.00	553,695.24
NETHER 0.5% 07/15/26	1,050,000.00	996,776.55
NETHER 0.5% 07/15/32	650,000.00	549,030.70
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	847,244.70
NETHER 0.75% 07/15/28	1,010,000.00	935,713.99
NETHER 0% 01/15/26	870,000.00	824,454.84
NETHER 0% 01/15/27	750,000.00	695,862.29
NETHER 0% 01/15/29	1,040,000.00	920,188.88
NETHER 0% 01/15/38	530,000.00	361,519.25
NETHER 0% 01/15/52	970,000.00	467,261.93
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	724,406.29
NETHER 0% 07/15/31	800,000.00	664,301.97
NETHER 2.5% 01/15/33	820,000.00	814,410.88
NETHER 2.5% 07/15/33	590,000.00	583,358.37
NETHER 2.75% 01/15/47	1,050,000.00	1,049,267.10
NETHER 2% 01/15/54	400,000.00	341,470.05
NETHER 3.25% 01/15/44	170,000.00	181,496.59
NETHER 3.75% 01/15/42	1,010,000.00	1,144,174.15
NETHER 4% 01/15/37	950,000.00	1,075,582.78
NETHER 5.5% 01/15/28	780,000.00	863,010.72
OBL 0% 04/10/26	1,500,000.00	1,417,033.50
OBL 0% 04/11/25	1,050,000.00	1,013,376.00
OBL 0% 04/16/27	1,210,000.00	1,119,673.50
OBL 0% 10/09/26	1,360,000.00	1,271,612.24
OBL 0% 10/10/25	1,970,000.00	1,880,217.25
OBL 1.3% 10/15/27	2,620,000.00	2,518,315.18
OBL 2.2% 04/13/28	900,000.00	892,714.50
OBL 2.4% 10/19/28	1,460,000.00	1,461,576.80
RAGB 0.25% 10/20/36	360,000.00	256,764.24

RAGB 0.5% 02/20/29	810,000.00	728,415.99
RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	607,064.25
RAGB 0.7% 04/20/71	200,000.00	90,373.38
RAGB 0.75% 02/20/28	720,000.00	668,362.32
RAGB 0.75% 03/20/51	460,000.00	268,433.46
RAGB 0.75% 10/20/26	900,000.00	854,821.80
RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	90,846.12
RAGB 0.9% 02/20/32	800,000.00	692,907.00
RAGB 0% 02/20/30	930,000.00	793,202.79
RAGB 0% 02/20/31	850,000.00	702,871.80
RAGB 0% 04/20/25	370,000.00	356,634.86
RAGB 0% 10/20/28	420,000.00	371,196.84
RAGB 0% 10/20/40	330,000.00	199,574.38
RAGB 1.2% 10/20/25	680,000.00	660,764.16
RAGB 1.5% 02/20/47	530,000.00	393,443.12
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	120,394.00
RAGB 1.85% 05/23/49	390,000.00	306,828.60
RAGB 2.1% 09/20/17	280,000.00	212,272.76
RAGB 2.4% 05/23/34	460,000.00	440,289.46
RAGB 2.9% 02/20/33	600,000.00	602,818.80
RAGB 2.9% 02/20/34	150,000.00	150,239.70
RAGB 2% 07/15/26	260,000.00	255,242.00
RAGB 3.15% 06/20/44	420,000.00	422,283.54
RAGB 3.15% 10/20/53	190,000.00	191,717.60
RAGB 3.45% 10/20/30	150,000.00	156,248.40
RAGB 3.8% 01/26/62	210,000.00	242,283.93
RAGB 4.15% 03/15/37	840,000.00	940,867.20
RAGB 4.85% 03/15/26	470,000.00	488,259.03
RAGB 6.25% 07/15/27	540,000.00	600,634.44
RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	192,141.18
RFGB 0.125% 04/15/52	240,000.00	112,082.68
RFGB 0.125% 09/15/31	290,000.00	238,982.50
RFGB 0.25% 09/15/40	210,000.00	133,980.00
RFGB 0.5% 04/15/26	500,000.00	476,342.40
RFGB 0.5% 04/15/43	180,000.00	113,448.31
RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	352,207.08
RFGB 0.5% 09/15/28	290,000.00	263,607.68
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	257,870.90
RFGB 0.75% 04/15/31	320,000.00	279,784.00
RFGB 0.875% 09/15/25	380,000.00	367,981.74
RFGB 0% 09/15/30	330,000.00	277,347.18
RFGB 1.125% 04/15/34	310,000.00	263,250.76
RFGB 1.375% 04/15/27	140,000.00	134,426.74

RFGB 1.375% 04/15/47	330,000.00	240,387.07
RFGB 1.5% 09/15/32	260,000.00	234,972.40
RFGB 2.625% 07/04/42	350,000.00	328,275.50
RFGB 2.75% 04/15/38	170,000.00	163,959.39
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	381,700.08
RFGB 2.875% 04/15/29	130,000.00	131,260.35
RFGB 2.95% 04/15/55	110,000.00	108,148.11
RFGB 3% 09/15/33	290,000.00	294,204.71
RFGB 4% 07/04/25	240,000.00	242,825.76
SPGB 0.1% 04/30/31	1,370,000.00	1,114,862.16
SPGB 0.5% 04/30/30	1,420,000.00	1,225,176.00
SPGB 0.5% 10/31/31	1,180,000.00	975,857.64
SPGB 0.6% 10/31/29	970,000.00	852,697.90
SPGB 0.7% 04/30/32	930,000.00	770,877.00
SPGB 0.8% 07/30/27	1,190,000.00	1,110,002.25
SPGB 0.8% 07/30/29	880,000.00	786,706.80
SPGB 0.85% 07/30/37	640,000.00	459,968.00
SPGB 0% 01/31/25	480,000.00	464,926.47
SPGB 0% 01/31/26	1,070,000.00	1,010,602.16
SPGB 0% 01/31/27	1,080,000.00	992,586.96
SPGB 0% 01/31/28	1,280,000.00	1,144,348.16
SPGB 0% 05/31/25	1,520,000.00	1,459,176.81
SPGB 1.2% 10/31/40	950,000.00	662,145.25
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,074,312.00
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,400,017.36
SPGB 1.4% 04/30/28	1,240,000.00	1,168,382.56
SPGB 1.4% 07/30/28	1,630,000.00	1,531,135.61
SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	698,398.50
SPGB 1.45% 10/31/27	1,330,000.00	1,264,220.96
SPGB 1.45% 10/31/71	260,000.00	126,515.20
SPGB 1.5% 04/30/27	1,290,000.00	1,236,067.68
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,225,843.75
SPGB 1.85% 07/30/35	1,190,000.00	1,023,076.32
SPGB 1.9% 10/31/52	1,050,000.00	699,765.98
SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,311,801.37
SPGB 1.95% 07/30/30	1,520,000.00	1,430,134.56
SPGB 1% 07/30/42	480,000.00	310,415.52
SPGB 1% 10/31/50	1,130,000.00	608,146.79
SPGB 2.15% 10/31/25	1,650,000.00	1,626,917.63
SPGB 2.35% 07/30/33	1,160,000.00	1,081,512.08
SPGB 2.55% 10/31/32	1,630,000.00	1,558,304.45
SPGB 2.7% 10/31/48	970,000.00	803,595.98



	SPGB 2.8% 05/31/26	330,000.00	328,747.65	
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,020,000.00	889,865.34	
	SPGB 3.15% 04/30/33	980,000.00	977,030.01	
	SPGB 3.25% 04/30/34	540,000.00	538,774.25	
	SPGB 3.45% 07/30/43	580,000.00	556,932.82	
	SPGB 3.45% 07/30/66	900,000.00	813,866.40	
	SPGB 3.5% 05/31/29	310,000.00	318,548.87	
	SPGB 3.55% 10/31/33	1,330,000.00	1,365,138.60	
	SPGB 3.9% 07/30/39	540,000.00	557,520.35	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,210,000.00	1,306,318.42	
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,438,803.19	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,240,000.00	1,408,460.20	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,080,000.00	1,247,250.96	
	SPGB 5.15% 10/31/28	1,100,000.00	1,207,985.90	
	SPGB 5.15% 10/31/44	790,000.00	951,798.32	
	SPGB 5.75% 07/30/32	950,000.00	1,136,523.95	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,452,440.56	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	2,684,106.55	
	ユーロ 小計	371,440,000.00	345,919,452.83 (56,156,563,972)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	780,000.00	720,787.70	
	UKT 0.125% 01/31/28	880,000.00	756,844.00	
	UKT 0.25% 01/31/25	1,270,000.00	1,218,133.70	
	UKT 0.25% 07/31/31	1,730,000.00	1,319,104.24	
	UKT 0.375% 10/22/26	1,170,000.00	1,059,190.23	
	UKT 0.375% 10/22/30	1,450,000.00	1,151,097.58	
	UKT 0.5% 01/31/29	1,180,000.00	998,247.78	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,050,000.00	309,365.70	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,160,000.00	1,103,585.48	
	UKT 0.625% 07/31/35	1,140,000.00	773,376.00	
	UKT 0.625% 10/22/50	640,000.00	255,143.68	
	UKT 0.875% 01/31/46	510,000.00	250,885.32	
	UKT 0.875% 07/31/33	1,500,000.00	1,126,739.10	
	UKT 0.875% 10/22/29	820,000.00	694,458.65	
	UKT 1.125% 01/31/39	1,320,000.00	847,293.51	
	UKT 1.125% 10/22/73	480,000.00	173,572.80	
	UKT 1.25% 07/22/27	740,000.00	674,384.20	
	UKT 1.25% 07/31/51	1,170,000.00	567,552.96	
	UKT 1.25% 10/22/41	1,190,000.00	722,586.44	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,180,000.00	1,108,680.32	
UKT 1.5% 07/22/47	860,000.00	481,590.19		
UKT 1.5% 07/31/53	680,000.00	344,351.45		
UKT 1.625% 10/22/28	480,000.00	433,216.80		

UKT 1.625% 10/22/54	720,000.00	373,665.60	
UKT 1.625% 10/22/71	710,000.00	325,409.18	
UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	349,536.00	
UKT 1.75% 07/22/57	980,000.00	516,840.24	
UKT 1.75% 09/07/37	1,110,000.00	818,968.65	
UKT 1% 01/31/32	1,880,000.00	1,499,592.15	
UKT 2.5% 07/22/65	860,000.00	543,674.80	
UKT 2% 09/07/25	1,300,000.00	1,252,095.00	
UKT 3.25% 01/22/44	1,240,000.00	1,025,919.61	
UKT 3.25% 01/31/33	1,610,000.00	1,514,062.03	
UKT 3.5% 01/22/45	1,130,000.00	965,561.72	
UKT 3.5% 07/22/68	800,000.00	653,577.60	
UKT 3.5% 10/22/25	490,000.00	481,939.50	
UKT 3.75% 01/29/38	1,060,000.00	991,757.20	
UKT 3.75% 07/22/52	900,000.00	781,174.80	
UKT 3.75% 10/22/53	1,370,000.00	1,182,460.70	
UKT 4.125% 01/29/27	1,870,000.00	1,865,894.60	
UKT 4.25% 03/07/36	850,000.00	851,868.30	
UKT 4.25% 06/07/32	770,000.00	784,800.94	
UKT 4.25% 09/07/39	670,000.00	656,073.38	
UKT 4.25% 12/07/27	1,100,000.00	1,107,278.92	
UKT 4.25% 12/07/40	800,000.00	778,320.00	
UKT 4.25% 12/07/46	1,120,000.00	1,065,052.80	
UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	767,246.09	
UKT 4.25% 12/07/55	1,100,000.00	1,040,138.00	
UKT 4.375% 07/31/54	150,000.00	144,104.51	
UKT 4.5% 06/07/28	900,000.00	915,017.57	
UKT 4.5% 09/07/34	840,000.00	865,116.00	
UKT 4.5% 12/07/42	930,000.00	926,505.99	
UKT 4.625% 01/31/34	570,000.00	593,289.80	
UKT 4.75% 10/22/43	420,000.00	429,905.82	
UKT 4.75% 12/07/30	760,000.00	796,571.96	
UKT 4.75% 12/07/38	810,000.00	841,347.00	
UKT 4% 01/22/60	710,000.00	644,254.00	
UKT 4% 10/22/63	560,000.00	506,545.28	
UKT 5% 03/07/25	1,080,000.00	1,082,754.64	
UKT 6.0% 12/07/28	1,070,000.00	1,164,566.60	
イギリスポンド 小計	58,030,000.00	48,193,074.81	(9,136,443,122)
スウェーデン ンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,010,000.00	2,564,038.40
	SGB 0.75% 05/12/28	3,240,000.00	3,020,001.76
	SGB 0.75% 11/12/29	4,430,000.00	4,052,670.49

	SGB 1.75% 11/11/33	1,780,000.00	1,680,161.76
	SGB 1% 11/12/26	4,120,000.00	3,940,791.49
	SGB 2.25% 06/01/32	2,560,000.00	2,531,271.52
	SGB 2.5% 05/12/25	4,200,000.00	4,164,585.39
	SGB 3.5% 03/30/39	2,340,000.00	2,606,245.20
スウェーデンクローナ 小計		25,680,000.00	24,559,766.01 (356,362,204)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	2,370,000.00	1,976,475.72
	NGB 1.375% 08/19/30	3,280,000.00	2,830,417.61
	NGB 1.5% 02/19/26	2,620,000.00	2,493,506.40
	NGB 1.75% 02/17/27	2,420,000.00	2,274,303.90
	NGB 1.75% 03/13/25	2,960,000.00	2,880,820.00
	NGB 1.75% 09/06/29	2,310,000.00	2,078,653.50
	NGB 2.125% 05/18/32	1,630,000.00	1,436,134.32
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,334,271.88
	NGB 3.5% 10/06/42	1,200,000.00	1,181,874.00
	NGB 3% 08/15/33	1,950,000.00	1,826,077.10
ノルウェークローネ 小計		23,250,000.00	21,312,534.43 (305,408,618)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	2,880,000.00	1,543,233.60
	DGB 0.5% 11/15/27	3,770,000.00	3,510,682.05
	DGB 0.5% 11/15/29	3,400,000.00	3,060,992.80
	DGB 0% 11/15/31	3,330,000.00	2,776,792.75
	DGB 1.75% 11/15/25	2,610,000.00	2,564,902.85
	DGB 2.25% 11/15/33	1,670,000.00	1,638,559.91
	DGB 4.5% 11/15/39	5,390,000.00	6,700,140.83
デンマーククローネ 小計		23,050,000.00	21,795,304.79 (474,701,738)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,220,000.00	1,077,911.48
	POLGB 0.75% 04/25/25	1,830,000.00	1,743,649.62
	POLGB 1.25% 10/25/30	2,040,000.00	1,592,309.76
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,940,000.00	2,258,137.56
	POLGB 2.5% 07/25/26	3,600,000.00	3,397,068.00
	POLGB 2.5% 07/25/27	2,010,000.00	1,852,482.33
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,870,000.00	3,537,690.84
	POLGB 2.75% 10/25/29	4,370,000.00	3,862,136.08
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,940,000.00	2,868,243.42
	POLGB 3.75% 05/25/27	300,000.00	288,629.40
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	921,243.96
	POLGB 6% 10/25/33	920,000.00	958,435.39
	POLGB 7.5% 07/25/28	320,000.00	349,166.40
	ポーランドズロチ 小計		27,260,000.00

オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	1,190,000.00	1,118,661.59	
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,030,000.00	948,582.68	
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	913,418.93	
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,000,003.41	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,060,000.00	597,517.56	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,380,000.00	1,139,255.92	
	ACGB 1% 11/21/31	1,990,000.00	1,586,606.44	
	ACGB 1% 12/21/30	1,480,000.00	1,217,852.35	
	ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	592,622.96	
	ACGB 2.5% 05/21/30	620,000.00	571,265.87	
	ACGB 2.75% 05/21/41	750,000.00	596,044.94	
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	546,451.83	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,160,000.00	1,119,559.92	
	ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	735,282.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,080,000.00	1,017,648.87	
	ACGB 3.25% 04/21/25	970,000.00	962,020.79	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,030,000.00	1,002,048.99	
	ACGB 3.25% 06/21/39	480,000.00	419,128.04	
	ACGB 3.5% 12/21/34	820,000.00	769,441.73	
	ACGB 3.75% 04/21/37	780,000.00	736,739.48	
	ACGB 3.75% 05/21/34	970,000.00	934,713.64	
	ACGB 3% 03/21/47	780,000.00	607,825.01	
	ACGB 3% 11/21/33	1,120,000.00	1,015,093.83	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,211,453.04	
ACGB 4.5% 04/21/33	1,340,000.00	1,374,612.33		
ACGB 4.75% 04/21/27	1,080,000.00	1,111,988.62		
ACGB 4.75% 06/21/54	330,000.00	341,471.09		
オーストラリアドル 小計		27,000,000.00	24,187,312.06 (2,380,273,379)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	490,000.00	407,519.14	
	NZGB 0.5% 05/15/26	360,000.00	326,774.32	
	NZGB 1.5% 05/15/31	460,000.00	369,828.90	
	NZGB 1.75% 05/15/41	260,000.00	160,919.97	
	NZGB 2.75% 04/15/25	490,000.00	475,577.96	
	NZGB 2.75% 04/15/37	350,000.00	274,766.20	
	NZGB 2.75% 05/15/51	350,000.00	230,153.56	
	NZGB 2% 05/15/32	350,000.00	284,504.05	
	NZGB 3.5% 04/14/33	640,000.00	578,259.18	
	NZGB 3% 04/20/29	450,000.00	415,887.08	
	NZGB 4.25% 05/15/34	270,000.00	256,879.31	
	NZGB 4.5% 04/15/27	460,000.00	456,433.88	
	NZGB 4.5% 05/15/30	260,000.00	257,249.53	

ニュージーランドドル 小計		5,190,000.00	4,494,753.08 (416,348,977)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	320,000.00	305,254.40
	SIGB 1.25% 11/01/26	90,000.00	85,734.00
	SIGB 1.625% 07/01/31	390,000.00	352,989.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	360,000.00	288,000.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	270,000.00	216,662.85
	SIGB 2.125% 06/01/26	670,000.00	654,590.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	330,000.00	302,854.98
	SIGB 2.375% 06/01/25	430,000.00	424,324.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	211,135.40
	SIGB 2.625% 05/01/28	280,000.00	275,660.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	180,000.00	174,186.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	410,000.00	393,600.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	289,269.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	530,000.00	526,025.00
	SIGB 2.875% 08/01/28	80,000.00	79,577.60
	SIGB 2.875% 09/01/27	80,000.00	79,560.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	454,940.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	410,006.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	580,000.00	587,250.00
	SIGB 3% 08/01/72	270,000.00	274,995.00
シンガポールドル 小計		6,660,000.00	6,386,613.23 (713,576,296)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	790,000.00	732,627.35
	MGS 3.502% 05/31/27	920,000.00	920,518.69
	MGS 3.582% 07/15/32	320,000.00	313,608.23
	MGS 3.733% 06/15/28	1,180,000.00	1,184,764.01
	MGS 3.757% 05/22/40	1,110,000.00	1,070,897.66
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	248,812.57
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	857,787.98
	MGS 3.882% 03/14/25	1,240,000.00	1,247,572.80
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,911,474.74
	MGS 3.892% 03/15/27	300,000.00	303,527.16
	MGS 3.899% 11/16/27	1,820,000.00	1,843,156.77
	MGS 3.9% 11/30/26	1,140,000.00	1,153,556.08
	MGS 3.906% 07/15/26	750,000.00	758,737.42
	MGS 3.955% 09/15/25	1,100,000.00	1,108,325.79
	MGS 4.065% 06/15/50	1,340,000.00	1,312,080.25
	MGS 4.232% 06/30/31	1,330,000.00	1,364,311.87
	MGS 4.254% 05/31/35	1,480,000.00	1,519,835.08
	MGS 4.392% 04/15/26	380,000.00	387,362.84
	MGS 4.457% 03/31/53	490,000.00	508,918.45

	MGS 4.498% 04/15/30	1,040,000.00	1,084,052.42	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,232,328.43	
	MGS 4.696% 10/15/42	780,000.00	841,745.19	
	MGS 4.736% 03/15/46	640,000.00	692,533.63	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,252,468.47	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,490,000.00	1,632,015.02	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,170,000.00	1,295,737.56	
	MGS 4.935% 09/30/43	820,000.00	905,687.70	
	マレーシアリングット 小計	26,950,000.00	27,684,444.16 (866,105,067)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	350,000.00	328,040.86	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	1,240,000.00	1,193,787.06	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,310,000.00	1,051,107.16	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,230,000.00	862,744.75	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,290,000.00	1,252,277.17	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,160,000.00	1,814,596.76	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,320,000.00	1,230,387.31	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	440,000.00	303,636.47	
	ILGOV 2% 03/31/27	1,290,000.00	1,222,961.53	
	ILGOV 3.75% 02/28/29	570,000.00	565,480.97	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,440,000.00	1,242,581.90	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,060,000.00	1,172,927.73	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,550,000.00	1,645,248.58	
	イスラエルシェケル 小計	15,250,000.00	13,885,778.25 (565,995,430)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	53,260,000.00	53,253,530.50	
	CGB 2.18% 08/15/26	23,000,000.00	22,999,848.89	
	CGB 2.22% 09/25/25	12,250,000.00	12,273,749.07	
	CGB 2.24% 05/25/25	23,400,000.00	23,428,742.22	
	CGB 2.28% 11/25/25	23,020,000.00	23,076,484.17	
	CGB 2.3% 05/15/26	12,000,000.00	12,033,238.80	
	CGB 2.37% 01/20/27	19,900,000.00	20,020,476.59	
	CGB 2.39% 11/15/26	14,500,000.00	14,586,852.10	
	CGB 2.4% 07/15/28	17,600,000.00	17,672,240.96	
	CGB 2.44% 10/15/27	7,000,000.00	7,044,809.80	
	CGB 2.48% 04/15/27	18,380,000.00	18,541,258.76	
	CGB 2.48% 09/25/28	10,800,000.00	10,896,869.52	
	CGB 2.5% 07/25/27	26,400,000.00	26,604,201.36	
	CGB 2.52% 08/25/33	13,400,000.00	13,484,791.18	
	CGB 2.54% 12/25/30	10,000,000.00	10,072,930.00	
	CGB 2.55% 10/15/28	13,800,000.00	13,972,226.76	
	CGB 2.6% 09/01/32	14,750,000.00	14,863,923.10	

CGB 2.6% 09/15/30	12,500,000.00	12,643,575.00	
CGB 2.62% 06/25/30	13,000,000.00	13,155,901.20	
CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,286,316.00	
CGB 2.67% 05/25/33	6,400,000.00	6,506,417.28	
CGB 2.67% 11/25/33	12,000,000.00	12,240,463.20	
CGB 2.68% 05/21/30	21,550,000.00	21,897,166.19	
CGB 2.69% 08/12/26	28,920,000.00	29,293,308.03	
CGB 2.69% 08/15/32	12,700,000.00	12,929,759.51	
CGB 2.75% 06/15/29	12,000,000.00	12,243,908.40	
CGB 2.79% 12/15/29	9,740,000.00	9,963,342.09	
CGB 2.8% 03/24/29	15,770,000.00	16,132,711.57	
CGB 2.8% 03/25/30	5,000,000.00	5,115,502.00	
CGB 2.8% 11/15/32	6,000,000.00	6,143,772.60	
CGB 2.85% 06/04/27	11,760,000.00	11,998,927.92	
CGB 2.88% 02/25/33	5,100,000.00	5,277,400.44	
CGB 2.89% 11/18/31	22,500,000.00	23,197,531.50	
CGB 2.91% 10/14/28	20,300,000.00	20,882,199.94	
CGB 3.01% 05/13/28	15,960,000.00	16,445,019.61	
CGB 3.02% 05/27/31	14,720,000.00	15,327,166.14	
CGB 3.03% 03/11/26	22,150,000.00	22,581,054.50	
CGB 3.12% 10/25/52	8,200,000.00	8,932,291.16	
CGB 3.19% 04/15/53	4,600,000.00	5,154,665.24	
CGB 3.27% 11/19/30	5,930,000.00	6,258,673.21	
CGB 3.28% 12/03/27	11,140,000.00	11,613,983.60	
CGB 3.32% 04/15/52	4,390,000.00	4,961,803.64	
CGB 3.39% 03/16/50	11,760,000.00	13,314,897.79	
CGB 3.53% 10/18/51	6,510,000.00	7,600,897.62	
CGB 3.72% 04/12/51	6,850,000.00	8,238,070.98	
CGB 3.81% 09/14/50	8,230,000.00	10,002,217.74	
CGB 3.86% 07/22/49	5,810,000.00	7,071,343.44	
CGB 3% 10/15/53	5,500,000.00	5,974,137.95	
CGB 4.08% 10/22/48	8,080,000.00	10,074,207.83	
オフショア人民元 小計	688,530,000.00	708,284,807.10 (14,761,859,464)	
合計		174,730,906,035 (174,730,906,035)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
----	-----	--------------	----------------

アメリカドル	国債証券	201銘柄	100.0%	47.3%
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	14銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券	355銘柄	100.0%	32.1%
イギリスポンド	国債証券	60銘柄	100.0%	5.2%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券	10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
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	27銘柄	100.0%	1.4%
ニュージーランドドル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	20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	13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券	49銘柄	100.0%	8.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。



【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19期中間計算期間(2024年2月22日から2024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18期 (2024年 2月21日現在)	第19期中間計算期間 (2024年 8月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	178,854,163	185,374,664
親投資信託受益証券	30,108,969,029	30,134,423,522
未収入金	18,925,880	33,690,320
未収利息	-	1,105
流動資産合計	30,306,749,072	30,353,489,611
資産合計	30,306,749,072	30,353,489,611
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	19,471,862	35,383,315
未払受託者報酬	6,485,073	6,651,747
未払委託者報酬	27,561,519	28,269,912
未払利息	34	-
その他未払費用	810,198	821,117
流動負債合計	54,328,686	71,126,091
負債合計	54,328,686	71,126,091
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,537,854,128	17,396,460,077
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	12,714,566,258	12,885,903,443
(分配準備積立金)	6,139,729,162	5,809,465,184
元本等合計	30,252,420,386	30,282,363,520
純資産合計	30,252,420,386	30,282,363,520
負債純資産合計	30,306,749,072	30,353,489,611

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第18期中間計算期間 自 2023年 2月22日 至 2023年 8月21日	第19期中間計算期間 自 2024年 2月22日 至 2024年 8月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	88	59,365
有価証券売買等損益	1,409,670,118	306,134,463
<b>営業収益合計</b>	<b>1,409,670,206</b>	<b>306,193,828</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	36,615	985
受託者報酬	6,166,191	6,651,747
委託者報酬	26,206,249	28,269,912
その他費用	770,714	821,117
<b>営業費用合計</b>	<b>33,179,769</b>	<b>35,743,761</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>1,376,490,437</b>	<b>270,450,067</b>
経常利益又は経常損失（ ）	1,376,490,437	270,450,067
<b>中間純利益又は中間純損失（ ）</b>	<b>1,376,490,437</b>	<b>270,450,067</b>
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（ ）	42,504,783	17,872,305
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>9,678,549,598</b>	<b>12,714,566,258</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	460,822,140	619,764,273
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	460,822,140	619,764,273
剰余金減少額又は欠損金増加額	394,032,156	701,004,850
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	394,032,156	701,004,850
分配金	-	-
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>11,079,325,236</b>	<b>12,885,903,443</b>

## (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18期 (2024年 2月21日現在)	第19期中間計算期間 (2024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	17,537,854,128口	17,396,460,077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) 1.7250円 (17,250円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7407円 (17,407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19期中間計算期間 (2024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18期 自 2023年 2月22日 至 2024年 2月21日	第19期中間計算期間 自 2024年 2月22日 至 2024年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	17,471,609,523円	17,537,854,128円
期中追加設定元本額	1,488,749,899円	827,623,511円
期中一部解約元本額	1,422,505,294円	969,017,562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19期中間計算期間(2024年2月22日から2024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18期 (2024年 2月21日現在)	第19期中間計算期間 (2024年 8月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	220,607,995	213,613,235
親投資信託受益証券	34,583,411,111	35,323,545,301
未収入金	7,161,223	29,900,151
未収利息	-	1,274
流動資産合計	34,811,180,329	35,567,059,961
資産合計	34,811,180,329	35,567,059,961
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	23,906,201	32,791,827
未払受託者報酬	7,271,938	7,781,246
未払委託者報酬	32,723,648	35,015,560
未払利息	41	-
その他未払費用	839,375	835,610
流動負債合計	64,741,203	76,424,243
負債合計	64,741,203	76,424,243
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	16,132,479,425	16,097,800,672
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	18,613,959,701	19,392,835,046
(分配準備積立金)	11,125,593,934	10,555,859,283
元本等合計	34,746,439,126	35,490,635,718
純資産合計	34,746,439,126	35,490,635,718
負債純資産合計	34,811,180,329	35,567,059,961

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 自 2023年 2月22日 至 2023年 8月21日	第19期中間計算期間 自 2024年 2月22日 至 2024年 8月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	95	75,558
有価証券売買等損益	2,285,549,870	851,392,951
営業収益合計	2,285,549,965	851,468,509
<b>営業費用</b>		
支払利息	40,865	1,144
受託者報酬	6,662,026	7,781,246
委託者報酬	29,979,086	35,015,560
その他費用	811,873	835,610
営業費用合計	37,493,850	43,633,560
営業利益又は営業損失（ ）	2,248,056,115	807,834,949
経常利益又は経常損失（ ）	2,248,056,115	807,834,949
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,248,056,115	807,834,949
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（ ）	52,932,858	45,064,051
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	13,065,483,857	18,613,959,701
剰余金増加額又は欠損金減少額	721,506,742	992,339,516
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	721,506,742	992,339,516
剰余金減少額又は欠損金増加額	444,992,440	976,235,069
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	444,992,440	976,235,069
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	15,537,121,416	19,392,835,046

## (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18期 (2024年 2月21日現在)	第19期中間計算期間 (2024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	16,132,479,425口	16,097,800,672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) 2.1538円 (21,538円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2047円 (22,047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19期中間計算期間 (2024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18期 自 2023年 2月22日 至 2024年 2月21日	第19期中間計算期間 自 2024年 2月22日 至 2024年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	15,757,788,195円	16,132,479,425円
期中追加設定元本額	1,497,503,947円	812,731,529円
期中一部解約元本額	1,122,812,717円	847,410,282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19期中間計算期間(2024年2月22日から2024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18期 (2024年 2月21日現在)	第19期中間計算期間 (2024年 8月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	77,957,927	140,160,949
親投資信託受益証券	17,671,612,041	18,751,621,205
未収入金	35,000,000	-
未収利息	-	836
流動資産合計	17,784,569,968	18,891,782,990
資産合計	17,784,569,968	18,891,782,990
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	11,504,837	22,274,750
未払受託者報酬	3,613,982	4,089,844
未払委託者報酬	17,166,358	19,426,701
未払利息	14	-
その他未払費用	451,690	511,166
流動負債合計	32,736,881	46,302,461
負債合計	32,736,881	46,302,461
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,948,155,901	7,097,561,389
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	10,803,677,186	11,747,919,140
(分配準備積立金)	6,278,837,422	5,871,372,132
元本等合計	17,751,833,087	18,845,480,529
純資産合計	17,751,833,087	18,845,480,529
負債純資産合計	17,784,569,968	18,891,782,990



## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 自 2023年 2月22日 至 2023年 8月21日	第19期中間計算期間 自 2024年 2月22日 至 2024年 8月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	46	43,380
有価証券売買等損益	1,404,462,434	710,434,987
営業収益合計	1,404,462,480	710,478,367
<b>営業費用</b>		
支払利息	15,635	623
受託者報酬	3,182,496	4,089,844
委託者報酬	15,116,779	19,426,701
その他費用	397,749	511,166
営業費用合計	18,712,659	24,028,334
営業利益又は営業損失（ ）	1,385,749,821	686,450,033
経常利益又は経常損失（ ）	1,385,749,821	686,450,033
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,385,749,821	686,450,033
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（ ）	30,510,159	45,303,096
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,967,162,478	10,803,677,186
剰余金増加額又は欠損金減少額	555,636,952	1,037,119,068
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	555,636,952	1,037,119,068
剰余金減少額又は欠損金増加額	278,976,375	734,024,051
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	278,976,375	734,024,051
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,599,062,717	11,747,919,140

## (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18期 (2024年 2月21日現在)	第19期中間計算期間 (2024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	6,948,155,901口	7,097,561,389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) 2.5549円 (25,549円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6552円 (26,552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19期中間計算期間 (2024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18期 自 2023年 2月22日 至 2024年 2月21日	第19期中間計算期間 自 2024年 2月22日 至 2024年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,583,572,514円	6,948,155,901円
期中追加設定元本額	995,747,661円	621,444,869円
期中一部解約元本額	631,164,274円	472,039,381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

	2024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	2,639,539,705
株式	415,079,563,050
派生商品評価勘定	50,583,100
未収入金	15,678,000
未収配当金	512,554,662
未収利息	15,745
差入委託証拠金	335,185,831
流動資産合計	418,633,120,093
資産合計	418,633,120,093
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,991,300
前受金	44,660,000
未払解約金	227,264,438
流動負債合計	277,915,738
負債合計	277,915,738
純資産の部	
元本等	
元本	130,179,659,794
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	288,175,544,561
元本等合計	418,355,204,355
純資産合計	418,355,204,355
負債純資産合計	418,633,120,093

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8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）

	2024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	130,179,659,794口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.2137円 (1万口当たり純資産額) (32,137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

2024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	2024年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月22日
期首元本額	130,853,031,789円
期中追加設定元本額	10,374,493,527円
期中一部解約元本額	11,047,865,522円
期末元本額	130,179,659,794円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	572,241,864円
D C 日本株式インデックスファンド	271,633,828円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,632,675,057円
D C 日本株式インデックスファンド A	636,503,564円
D C バランスファンド 3 0	1,943,771,204円
D C バランスファンド 5 0	3,420,374,965円
D C バランスファンド 7 0	2,348,248,668円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	509,813,371円
日本株式インデックス e	1,313,568,672円
インデックスコレクション (国内株式)	24,350,154,918円
インデックスコレクション (バランス株式 3 0)	10,651,833,050円
インデックスコレクション (バランス株式 5 0)	3,672,303,468円
インデックスコレクション (バランス株式 7 0)	3,743,261,578円
私募日本株式パッシブファンド (適格機関投資家専用)	8,162,863,561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)	2,613,768,341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)	557,024,887円
バランス V A 3 0 (適格機関投資家専用)	19,646,983円
バランス V A 5 0 (適格機関投資家専用)	283,419,168円
V A バランスファンド (株 2 5 / 1 0 0) (適格機関投資家専用)	37,321,215円
V A バランスファンド (株 5 0 / 1 0 0) (適格機関投資家専用)	101,649,540円
V A バランスファンド (株 6 0 / 1 0 0) (適格機関投資家専用)	26,569,980円
バランス V A 2 5 (適格機関投資家専用)	315,962,876円
バランス V A 3 7 . 5 (適格機関投資家専用)	272,771,475円
バランス V A 5 0 L (適格機関投資家専用)	4,908,143,312円
バランス V A 7 5 (適格機関投資家専用)	524,058,049円
V A バランスファンド (株 4 0 / 1 0 0) (適格機関投資家専用)	31,341,315円
V A ポートフォリオ 4 0 (適格機関投資家専用)	777,867,092円
V A ポートフォリオ 2 0 (適格機関投資家専用)	12,402,738円
バランス V A 4 0 (適格機関投資家専用)	92,850,336円

区分	2024年 8月21日現在
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,244,815,526円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	32,077,528円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	33,580,813円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	10,567,788円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	334,529,230円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	165,512,782円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	2,414,672,114円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	50,878,227円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	15,637,251円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	5,159,860円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	65,824,064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）	2,359,536円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024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	3,266,140,000	-	3,310,800,000	44,660,000
合計		3,266,140,000	-	3,310,800,000	44,660,000

## （注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 日本債券マザーファンド

## 貸借対照表

	2024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	376,621,751
国債証券	344,794,101,100
地方債証券	21,035,102,239
特殊債券	22,289,278,195
社債券	18,785,726,000
未収利息	989,013,727
前払費用	55,880,854
流動資産合計	408,325,723,866
資産合計	408,325,723,866
負債の部	
流動負債	
未払解約金	200,655,978
流動負債合計	200,655,978
負債合計	200,655,978
純資産の部	
元本等	
元本	317,117,639,864
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	91,007,428,024
元本等合計	408,125,067,888

	2024年 8月21日現在
項目	金額（円）
純資産合計	408,125,067,888
負債純資産合計	408,325,723,866

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2024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	317,117,639,864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 98,977,000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 1.2870円 (1万口当たり純資産額) (12,870円)

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

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2024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	2024年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月22日
期首元本額	314,899,994,159円
期中追加設定元本額	25,987,211,841円
期中一部解約元本額	23,769,566,136円
期末元本額	317,117,639,864円

区分	2024年 8月21日現在
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	765,901,659円
DC日本債券インデックスファンド	1,692,207,412円
DC日本債券インデックスファンドL	43,388,516,050円
DCバランスファンド30	13,830,582,666円
DCバランスファンド50	10,576,086,501円
DCバランスファンド70	3,610,106,362円
日本債券インデックスe	870,956,846円
インデックスコレクション（国内債券）	37,953,270,547円
インデックスコレクション（バランス株式30）	75,750,202,916円
インデックスコレクション（バランス株式50）	11,319,994,270円
インデックスコレクション（バランス株式70）	5,754,803,854円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	55,887,403,875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）	6,773,655,540円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	113,618,958円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	652,766,734円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	113,217,819円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	92,139,167円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	90,915,380円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	2,091,102,336円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	968,366,760円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,492,882,460円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	153,517,478円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	203,343,635円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,807,843,018円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	128,730,964円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	344,171,114円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,073,519,067円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	293,184,452円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	785,130,069円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	44,156,154円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	2,703,697,340円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,293,860,489円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	20,429,798,442円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	426,391,744円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	89,945,877円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	37,420,576円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	509,740,794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）	4,490,539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

	2024年 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,011,079,941
コール・ローン	1,516,389,724
株式	518,717,021,034
投資信託受益証券	109,884,969
投資証券	10,113,000,393
派生商品評価勘定	318,787,331
未収入金	1,043,807
未収配当金	575,537,251
未収利息	9,045

	2024年 8月21日現在
項目	金額（円）
差入委託証拠金	4,156,495,801
流動資産合計	546,519,249,296
資産合計	546,519,249,296
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,232,040
前受金	294,449,307
未払解約金	105,091,037
流動負債合計	431,772,384
負債合計	431,772,384
純資産の部	
元本等	
元本	78,992,521,505
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	467,094,955,407
元本等合計	546,087,476,912
純資産合計	546,087,476,912
負債純資産合計	546,519,249,296

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024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 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)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、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)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>



2024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	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024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	78,992,521,505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) 6.9132円 (69,132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

2024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	2024年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月22日
期首元本額	78,589,889,137円
期中追加設定元本額	4,705,595,616円
期中一部解約元本額	4,302,963,248円
期末元本額	78,992,521,505円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,381,616,578円

区分	2024年 8月21日現在
DC外国株式インデックスファンド	5,177,572,391円
DC外国株式インデックスファンドL	30,396,430,413円
DCバランスファンド30	447,741,454円
DCバランスファンド50	1,052,648,153円
DCバランスファンド70	813,295,986円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	233,715,935円
外国株式インデックスe	4,137,948,427円
インデックスコレクション（外国株式）	19,726,933,473円
インデックスコレクション（バランス株式30）	2,453,764,405円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,127,476,520円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,296,455,421円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,134,268,557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）	1,576,811,806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）	259,475,842円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	9,088,784円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	130,507,918円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	17,481,827円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	46,822,196円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	60,993,729円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	97,395,611円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	109,658,413円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	2,260,997,046円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	274,573,551円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	43,837,581円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	357,387,593円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	5,779,146円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	42,931,632円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	44,237,790円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	140,995,377円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	4,366,955円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	32,680,262円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	91,768,396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）	4,862,337円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024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	17,267,087,690	-	17,561,536,997	294,449,307
合計		17,267,087,690	-	17,561,536,997	294,449,307

## （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

（2024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	1,879,687,646	-	1,871,793,630	7,894,016

	アメリカドル	1,439,981,806	-	1,430,208,390	9,773,416
	カナダドル	32,065,200	-	32,068,410	3,210
	ユーロ	251,002,640	-	252,244,700	1,242,060
	イギリスポンド	122,670,600	-	123,171,130	500,530
	スイスフラン	33,967,400	-	34,101,000	133,600
	合計	1,879,687,646	-	1,871,793,630	7,894,016

## (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

	2024年 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	594,800,814
コール・ローン	1,930,981,242
国債証券	178,922,200,377
派生商品評価勘定	5,052,011
未収利息	1,184,866,157
前払金	1,309,049
前払費用	102,360,671
差入委託証拠金	101,591,141
流動資産合計	182,843,161,462
資産合計	182,843,161,462
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,126,690
未払解約金	222,591,068
流動負債合計	234,717,758
負債合計	234,717,758
純資産の部	
元本等	
元本	59,500,782,079
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	123,107,661,625
元本等合計	182,608,443,704
純資産合計	182,608,443,704
負債純資産合計	182,843,161,462

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024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 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

2024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>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)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）

2024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	59,500,782,079口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0690円 (1万口当たり純資産額) (30,690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

2024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 「(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	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	2024年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2024年 8月21日現在
期首	2024年 2月22日
期首元本額	58,566,398,371円
期中追加設定元本額	4,597,229,897円
期中一部解約元本額	3,662,846,189円
期末元本額	59,500,782,079円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,826,560,594円
DC外国債券インデックスファンド	1,777,663,436円
DC外国債券インデックスファンドL	14,225,200,153円
DCバランスファンド30	975,053,729円
DCバランスファンド50	1,121,829,827円
DCバランスファンド70	305,105,821円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	492,379,573円
外国債券インデックスe	935,250,610円
インデックスコレクション（外国債券）	10,204,950,516円
インデックスコレクション（バランス株式30）	5,343,536,372円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,201,598,156円
インデックスコレクション（バランス株式70）	486,361,734円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,111,900,226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）	3,289,959,242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）	274,070,550円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	47,729,780円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	278,102,234円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	189,847,441円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	163,186,256円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	64,203,397円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	767,206,222円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	447,440,719円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	4,924,398,093円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	289,052,695円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	115,561,403円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,177,952,387円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	52,228,862円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	144,929,604円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	62,128,828円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	35,404,499円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	37,807,819円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	166,023,129円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	53,402,935円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	897,675,847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）	15,079,390円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2024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	1,398,066,483	-	1,396,757,434	1,309,049
	合計	1,398,066,483	-	1,396,757,434	1,309,049

## （注）1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

（2024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	1,660,235,276	-	1,654,469,646	5,765,630
	アメリカドル	809,104,198	-	800,986,224	8,117,974
	カナダドル	60,900,000	-	60,778,587	121,413
	ユーロ	517,820,474	-	520,355,864	2,535,390
	イギリスポンド	90,116,334	-	90,805,392	689,058
	オフショア人民元	182,294,270	-	181,543,579	750,691
	合計	1,660,235,276	-	1,654,469,646	5,765,630

## (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】

(2024年 9月30日現在)

資産総額	30,500,475,478円
負債総額	15,373,648円
純資産総額( - )	30,485,101,830円
発行済口数	17,477,409,880口
1口当たり純資産額( / )	1.7443円
(1万口当たり純資産額)	(17,443円)

## 【DCバランスファンド50】

## 【純資産額計算書】

(2024年 9月30日現在)

資産総額	35,809,371,950円
負債総額	31,989,254円
純資産総額( - )	35,777,382,696円
発行済口数	16,179,823,076口
1口当たり純資産額( / )	2.2112円
(1万口当たり純資産額)	(22,112円)

## 【DCバランスファンド70】

## 【純資産額計算書】

(2024年 9月30日現在)

資産総額	19,060,356,117円
負債総額	12,896,407円
純資産総額( - )	19,047,459,710円
発行済口数	7,144,469,638口
1口当たり純資産額( / )	2.6660円
(1万口当たり純資産額)	(26,660円)

(参考)

日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2024年 9月30日現在)

資産総額	419,324,261,859円
負債総額	530,469,382円
純資産総額( - )	418,793,792,477円
発行済口数	129,985,826,945口

1口当たり純資産額（ / ）	3.2218円
（1万口当たり純資産額）	（32,218円）

## 日本債券マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

資産総額	419,314,976,775円
負債総額	6,309,353,591円
純資産総額（ - ）	413,005,623,184円
発行済口数	320,258,376,956口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2896円
（1万口当たり純資産額）	（12,896円）

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

資産総額	556,676,155,532円
負債総額	444,723,966円
純資産総額（ - ）	556,231,431,566円
発行済口数	79,624,877,055口
1口当たり純資産額（ / ）	6.9856円
（1万口当たり純資産額）	（69,856円）

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

資産総額	185,065,382,091円
負債総額	726,127,217円
純資産総額（ - ）	184,339,254,874円
発行済口数	60,401,715,881口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0519円
（1万口当たり純資産額）	（30,519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、
- 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、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、
- 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、

## 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、）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（2024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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (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、各取締役に對して会日の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。

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

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

委託会社の機構は2024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。

2024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	532	15,497,778
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	60	209,691
単体型公社債投資信託	52	175,369
合計	644	15,882,839

## 3【委託会社等の経理状況】

- 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。
- 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 2023年4月1日 至 2024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 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,067	14,909
金銭の信託	14,693	18,596
前払費用	198	429
未収委託者報酬	9,147	10,943
未収運用受託報酬	5,815	5,967
未収収益	176	185
短期差入証拠金	3,541	3,660
その他	1,566	4,074
流動資産合計	58,207	58,767
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 255	1 219
器具備品	1 560	1 436
有形固定資産合計	816	655
無形固定資産		
ソフトウェア	7,203	7,463
その他	40	61
無形固定資産合計	7,244	7,524
投資その他の資産		
投資有価証券	4,063	5,753
関係会社株式	5,636	6,077
繰延税金資産	1,181	1,196
その他	31	31
投資その他の資産合計	10,911	13,058
固定資産合計	18,972	21,238
資産合計	77,179	80,005

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
負債の部		
流動負債		

預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
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	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077

その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	-	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	-	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	-

その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	-
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	-	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	-	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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
	利益準備金	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	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	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	941	509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
	利益準備金	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	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	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	49	510	460	66,134
当期変動額				
剰余金の配当				3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	560	250	250
当期変動額合計	310	560	250	968
当期末残高	360	1,071	710	67,103

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

## (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

## 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

## 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

## 4．固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

## 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

## 6．引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

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

## 7．収益及び費用の計上基準

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



## (1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

## (2) 投資一任業務

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

## (3) 投資助言業務

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

## (4) 成功報酬

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

## 8. ヘッジ会計の会計処理

## (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

## (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

## (3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

## (4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

## 9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

## (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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建 物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	"	823	"
計	866	"	1,044	"

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

## 1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

## (2) 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
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

## 1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(2) 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  
2024年6月20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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21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（支払期日に支払い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。

## (4) 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。

## 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 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、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順位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（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(10)	-	-	(10)
通貨関連取引	-	(136)	-	(136)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(\*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) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。

(\*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。

当事業年度（2024年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(\*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) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額1,017百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は18,596百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）は上記に含めておりません。

(\*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、短期差入証拠金、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、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。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。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、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。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(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(2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

当事業年度(2024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	14,909	-	-	-
未収委託者報酬	10,943	-	-	-
未収運用受託報酬	5,967	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,829	807	-

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

## 2. その他有価証券

前事業年度(2023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	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

当事業年度(2024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	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	3,429	738	16

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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	185	1	33

(デリバティブ取引関係)

## 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

前事業年度(2023年3月31日)

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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建				
	米ドル	152	-	3	3
合計		7,458	-	48	48

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度(2024年3月31日)

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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3
	合計	8,231	-	10	10

(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

前事業年度(2023年3月31日)

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	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
	合計	12,378	-	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2024年3月31日）

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	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

(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

前事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
合計			5,082	-	88

当事業年度（2024年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	1
合計			7,337	-	10

### (退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

#### 2. 確定給付制度

##### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	57	85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	6	17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	-	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
割引率	0.4%	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109百万円、当事業年度122百万円であります。

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	58 百万円	63 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187 "	220 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	277 "	298 "
税務上の費用認識差額	412 "	256 "
繰延ヘッジ損益	225 "	472 "
その他	75 "	78 "
繰延税金資産 合計	1,236 "	1,390 "
繰延税金負債		

			有価証券届出書（内国投資信託受益証券）	
有価証券評価差額	21	"	159	"
その他	32	"	35	"
繰延税金負債 合計	54	"	194	"
繰延税金資産の純額	1,181	"	1,196	"

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。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「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12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（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 2022年4月1日 至 2023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	9,887百万円

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	10,223百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（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 2022年4月1日 至 2023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	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

- (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 2023年4月1日 至 2024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	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

- (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（2023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（2024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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02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いません。  
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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

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

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

2024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（2024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） （2024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（2024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やSNSのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）、名称や利用上の注意事項等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**

2024年6月3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 田 中 洋 一**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2023年4月1日から2024年3月31日までの第38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2024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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2024年4月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド30の2023年2月22日から2024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2024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。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の監査報告書

2024年4月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 中島紀子

## 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2023年2月22日から2024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2024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。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2024年4月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 中島紀子

## 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2023年2月22日から2024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2024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。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024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 中島紀子

## 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2024年2月22日から2024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2024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（2024年2月22日から2024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

2024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 中島紀子

## 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2024年2月22日から2024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2024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（2024年2月22日から2024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

2024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 中島紀子

## 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2024年2月22日から2024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2024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（2024年2月22日から2024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。