

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2026年5月22日提出
【計算期間】	第20期(自 2025年2月22日至 2026年2月24日)
【ファンド名】	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
【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 小林 隆宏
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、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。

## &lt;信託金限度額&gt;

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。

## &lt;基本的性格&gt;

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会のホームページ (<https://www.imaj.or.jp/>) でもご覧いただけます。

一般社団法人資産運用業協会が定める「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。

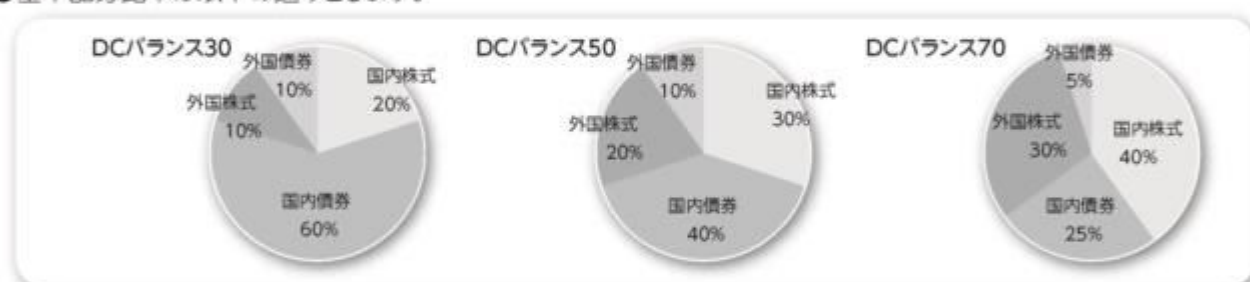
### <ファンドの特色>

## 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】

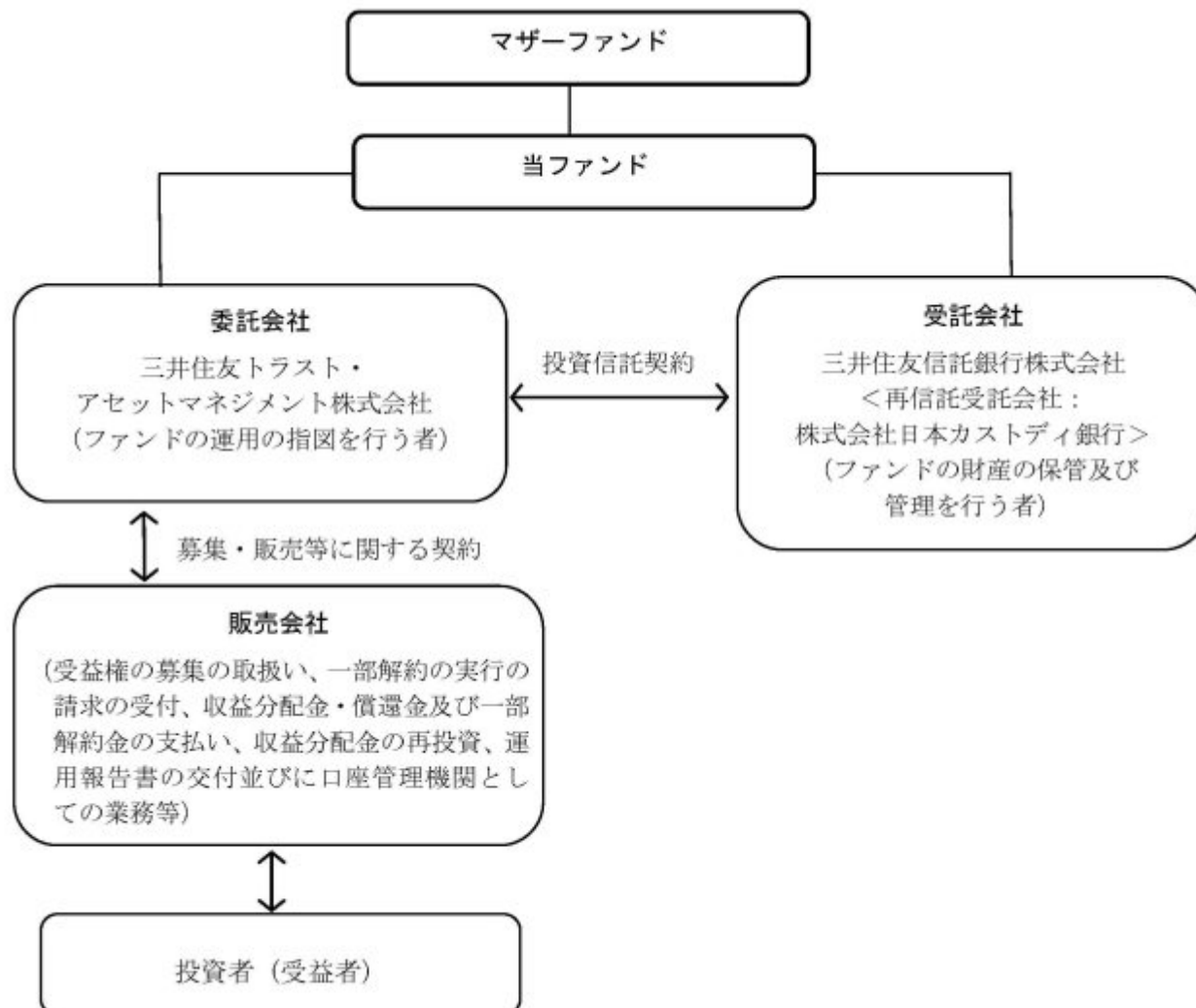
2006年9月29日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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（2026年 3月31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せん。）
3. 金銭債権（上記1.、2.及び下記4.に掲げるものに該当するものを除きます。）
4. 約束手形（上記1.に掲げるものに該当するものを除きます。）

B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

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

益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

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

（2）投資態度

株式への投資は、原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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り、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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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ます。）を行使したものに限り、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。

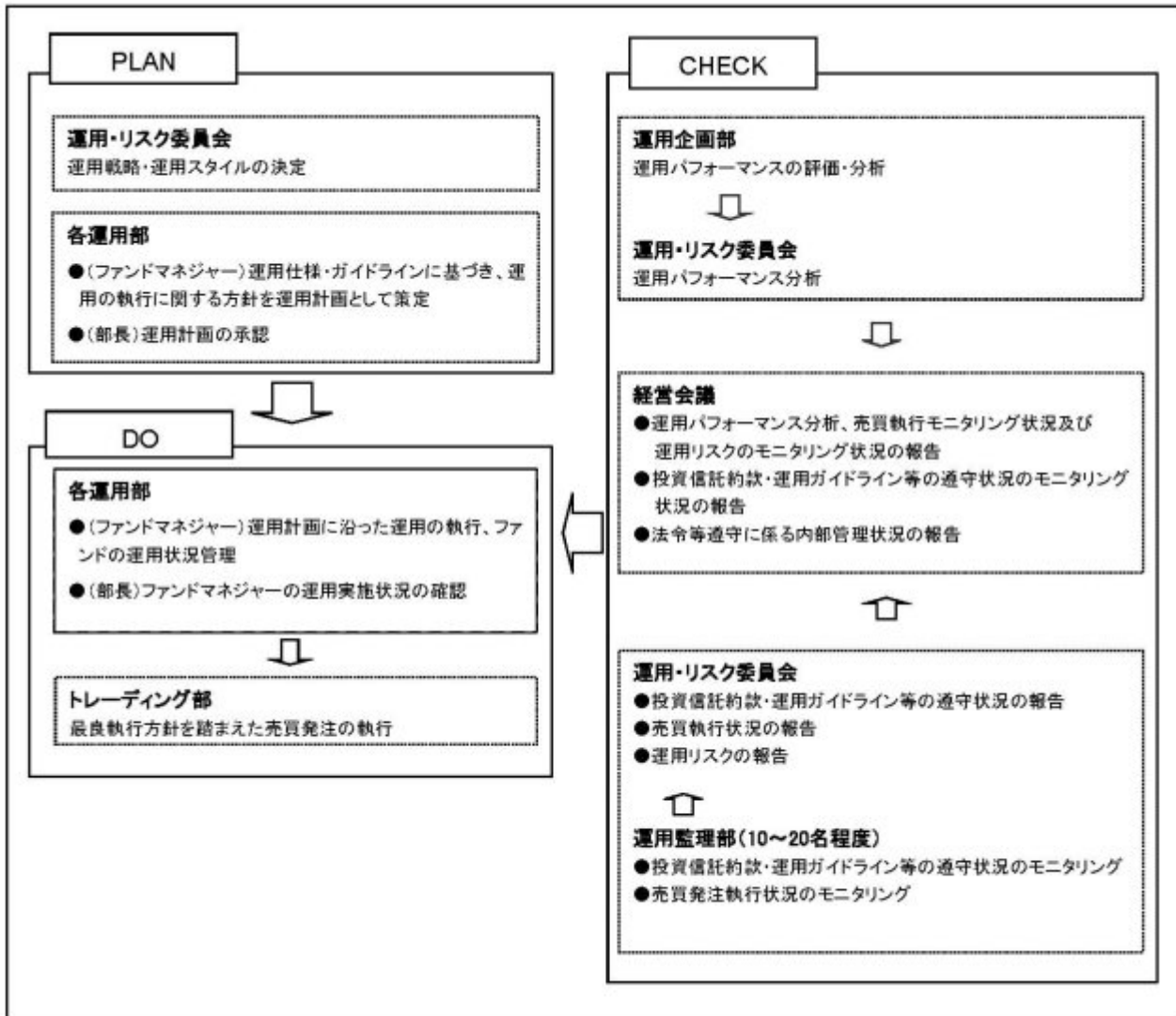
一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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、一般社団法人資産運用業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）【配分方針】

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．一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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が小さかった場合も同様です。

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

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要がある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。

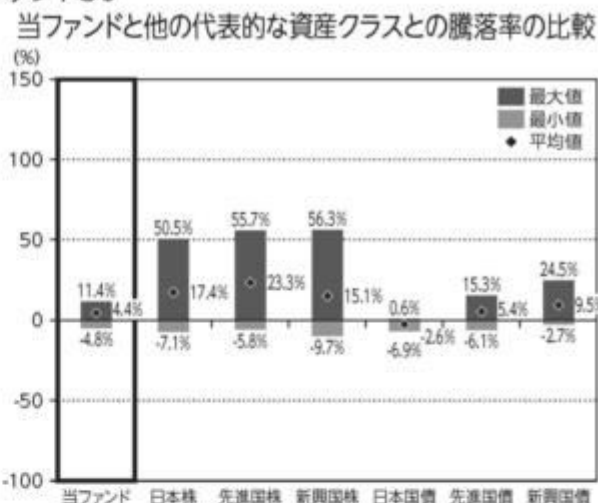
#### （２）リスクの管理体制

##### 委託会社におけるリスク管理体制

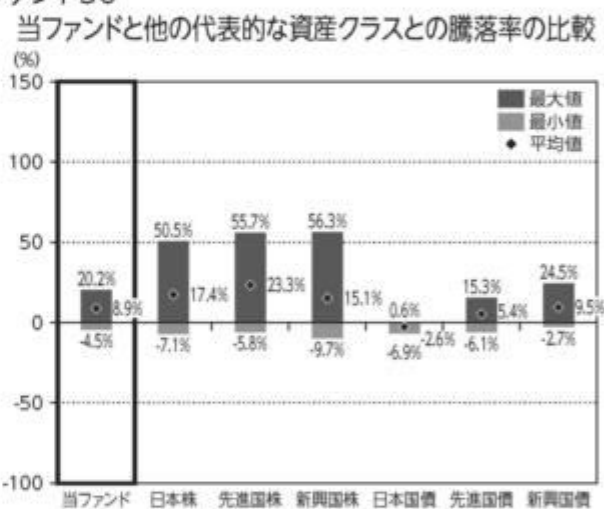
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 〔参考情報〕

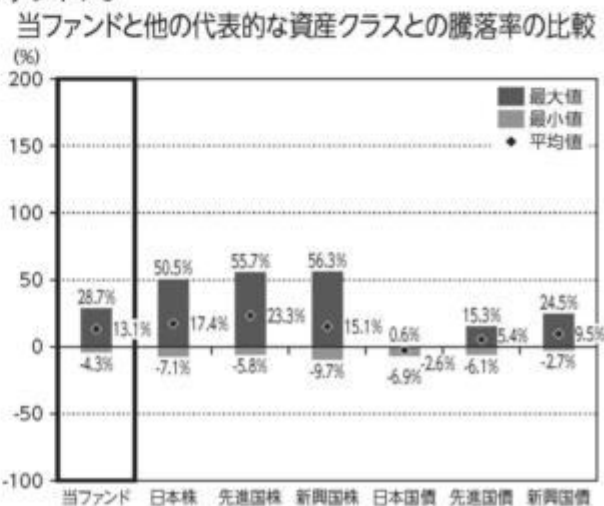
## DCバランスファンド30



## 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。

\*2021年4月～2026年3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に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は権限は、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エマージング・マーケット・ インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI指数	NOMURA-BPI指数とは、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定期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、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・エマージング・ マーケット・グローバル・ディバーシファイド円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

ありません。

### (2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図

るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をい、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

2026年 5月22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、2026年 3月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

#### （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 <sup>(1+2)</sup>	運用管理費用の比率 <sup>①</sup>	その他費用の比率 <sup>②</sup>
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2025年2月22日～2026年2月24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、2026年3月31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	32,011,858,021	99.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		114,070,398	0.36
合計(純資産総額)		32,125,928,419	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	16,472,542,680	1.1985	19,742,342,402	1.1760	19,371,710,191	60.30
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,437,077,322	4.7722	6,858,020,397	4.4187	6,350,013,562	19.77
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	928,684,635	3.5003	3,250,674,828	3.5093	3,259,032,989	10.14
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	339,661,054	9.3416	3,172,977,703	8.9239	3,031,101,279	9.44

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.64
合計	99.64

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

		純資産総額 (円)		1万口当たりの純資産額 (円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第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
第19期計算期間末	(2025年 2月21日)	30,522,203,833	30,522,203,833	17,451	17,451
第20期計算期間末	(2026年 2月24日)	32,994,568,929	32,994,568,929	18,907	18,907
	2025年 3月末日	30,189,475,818		17,204	
	4月末日	30,055,778,419		17,193	
	5月末日	30,456,310,410		17,371	
	6月末日	31,026,584,648		17,617	
	7月末日	31,271,108,893		17,753	
	8月末日	31,572,185,378		17,886	
	9月末日	31,867,202,599		18,083	
	10月末日	32,577,203,649		18,497	
	11月末日	32,499,185,406		18,492	
	12月末日	32,255,295,721		18,437	
	2026年 1月末日	32,420,820,523		18,459	
	2月末日	33,252,732,593		19,071	
	3月末日	32,125,928,419		18,321	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第19期計算期間	2024年 2月22日～2025年 2月21日	0
第20期計算期間	2025年 2月22日～2026年 2月24日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	2024年 2月22日～2025年 2月21日	1.2
第20期計算期間	2025年 2月22日～2026年 2月24日	8.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第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期計算期間	2024年 2月22日～2025年 2月21日	1,483,342,845	1,531,164,692	17,490,032,281
第20期計算期間	2025年 2月22日～2026年 2月24日	1,464,478,586	1,503,788,211	17,450,722,656

(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	41,007,007,518	99.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		170,702,090	0.41
合計(純資産総額)		41,177,709,608	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	14,221,688,401	1.1987	17,048,926,394	1.1760	16,724,705,559	40.62
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,673,019,654	4.7709	12,752,916,750	4.4187	11,811,271,945	28.68
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	911,529,987	9.3434	8,516,844,124	8.9239	8,134,402,450	19.75
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,235,752,875	3.5003	4,325,505,871	3.5093	4,336,627,564	10.53

(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	99.59
合計	99.59

(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
第19期計算期間末	(2025年 2月21日)	36,627,738,309	36,627,738,309	22,568	22,568
第20期計算期間末	(2026年 2月24日)	42,630,410,180	42,630,410,180	26,098	26,098
	2025年 3月末日	36,019,121,929		22,089	
	4月末日	35,759,453,604		21,990	
	5月末日	36,868,763,009		22,543	
	6月末日	37,633,710,516		22,989	
	7月末日	38,309,554,128		23,416	
	8月末日	38,859,518,399		23,730	
	9月末日	39,583,202,207		24,153	
	10月末日	41,022,172,738		24,995	
	11月末日	41,223,799,474		25,121	
	12月末日	41,114,899,066		25,188	
	2026年 1月末日	41,602,761,939		25,379	
	2月末日	43,188,512,190		26,449	
	3月末日	41,177,709,608		25,092	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第19期計算期間	2024年 2月22日～2025年 2月21日	0
第20期計算期間	2025年 2月22日～2026年 2月24日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	2024年 2月22日～2025年 2月21日	4.8
第20期計算期間	2025年 2月22日～2026年 2月24日	15.6

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第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期計算期間	2024年 2月22日～2025年 2月21日	1,437,846,067	1,340,586,381	16,229,739,111
第20期計算期間	2025年 2月22日～2026年 2月24日	1,219,975,168	1,115,220,189	16,334,494,090

(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	23,241,649,908	99.58
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		99,016,573	0.42
合計（純資産総額）		23,340,666,481	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	2,138,904,547	4.7564	10,173,485,588	4.4187	9,451,177,521	40.49
日本	親投資信託受 益証券	外国株式マザーファンド	773,308,334	9.3423	7,224,495,996	8.9239	6,900,926,241	29.57
日本	親投資信託受 益証券	日本債券マザーファンド	4,867,491,913	1.1987	5,834,704,447	1.1760	5,724,170,489	24.52
日本	親投資信託受 益証券	外国債券マザーファンド	332,082,084	3.5003	1,162,388,647	3.5093	1,165,375,657	4.99

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.58
合計	99.58

(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
第19期計算期間末	(2025年 2月21日)	19,852,180,855	19,852,180,855	27,698	27,698
第20期計算期間末	(2026年 2月24日)	24,391,294,781	24,391,294,781	33,827	33,827
	2025年 3月末日	19,334,797,225		26,874	
	4月末日	19,100,978,333		26,640	
	5月末日	19,969,651,150		27,682	

6月末日	20,439,265,118		28,359
7月末日	21,034,100,014		29,149
8月末日	21,467,214,234		29,721
9月末日	22,011,026,473		30,427
10月末日	23,058,131,198		31,788
11月末日	23,160,554,132		32,061
12月末日	23,235,527,565		32,295
2026年 1月末日	23,702,054,151		32,776
2月末日	24,852,728,576		34,439
3月末日	23,340,666,481		32,214

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第19期計算期間	2024年 2月22日～2025年 2月21日	0
第20期計算期間	2025年 2月22日～2026年 2月24日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	2024年 2月22日～2025年 2月21日	8.4
第20期計算期間	2025年 2月22日～2026年 2月24日	22.1

(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期計算期間	2024年 2月22日～2025年 2月21日	1,029,429,059	810,238,557	7,167,346,403
第20期計算期間	2025年 2月22日～2026年 2月24日	768,724,517	725,408,773	7,210,662,147

(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	494,804,385,105	96.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,523,152,161	3.04
合計(純資産総額)		510,327,537,266	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	13,560,480,000	2.66

(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	5,357,400	3,584.00	19,200,921,600	3,162.00	16,940,098,800	3.32
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,261,700	2,817.50	17,642,339,750	2,600.00	16,280,420,000	3.19
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,590,000	5,264.00	13,633,760,000	4,464.00	11,561,760,000	2.27
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,125,700	4,082.00	8,677,107,400	5,317.00	11,302,346,900	2.21
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	3,476,500	3,631.00	12,623,171,500	3,209.00	11,156,088,500	2.19
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,162,000	5,408.00	11,692,096,000	5,006.00	10,822,972,000	2.12
日本	株式	三井物産	卸売業	1,533,100	5,133.00	7,869,402,300	5,959.00	9,135,742,900	1.79
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,407,500	6,609.00	9,302,167,500	6,087.00	8,567,452,500	1.68

日本	株式	三菱重工業	機械	1,907,200	4,697.00	8,958,118,400	4,223.00	8,054,105,600	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	213,300	42,500.00	9,065,250,000	37,230.00	7,941,159,000	1.56
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,020,400	5,811.00	5,929,544,400	7,308.00	7,457,083,200	1.46
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	3,583,800	2,059.00	7,379,044,200	1,974.50	7,076,213,100	1.39
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,937,400	4,325.00	8,379,255,000	3,555.00	6,887,457,000	1.35
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	303,200	22,850.00	6,928,120,000	20,330.00	6,164,056,000	1.21
日本	株式	信越化学工業	化学	897,700	5,651.00	5,072,902,700	6,259.00	5,618,704,300	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	636,300	9,950.00	6,331,185,000	8,775.00	5,583,532,500	1.09
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,115,000	4,979.00	5,551,585,000	4,988.00	5,561,620,000	1.09
日本	株式	キーエンス	電気機器	100,800	59,310.00	5,978,448,000	54,860.00	5,529,888,000	1.08
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	899,500	5,027.00	4,521,786,500	5,664.00	5,094,768,000	1.00
日本	株式	HOYA	精密機器	191,300	25,100.00	4,801,630,000	26,550.00	5,079,015,000	1.00
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	766,200	8,499.00	6,511,933,800	6,526.00	5,000,221,200	0.98
日本	株式	丸紅	卸売業	813,700	5,129.00	4,173,467,300	5,618.00	4,571,366,600	0.90
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	72,000	60,850.00	4,381,200,000	61,630.00	4,437,360,000	0.87
日本	株式	NTT	情報・通信業	27,753,000	156.20	4,335,018,600	157.20	4,362,771,600	0.85
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,420,500	2,650.00	3,764,325,000	2,723.50	3,868,731,750	0.76
日本	株式	住友商事	卸売業	639,200	6,298.00	4,025,681,600	5,780.00	3,694,576,000	0.72
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	603,000	5,681.00	3,425,643,000	6,020.00	3,630,060,000	0.71
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	16,262,300	214.40	3,486,637,120	211.10	3,432,971,530	0.67
日本	株式	フジクラ	非鉄金属	802,800	3,027.50	2,430,477,000	4,090.00	3,283,452,000	0.64
日本	株式	村田製作所	電気機器	961,900	3,334.00	3,206,974,600	3,409.00	3,279,117,100	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	0.50
		建設業	2.44
		食料品	2.82
		繊維製品	0.32
		パルプ・紙	0.14
		化学	4.58
		医薬品	3.83
		石油・石炭製品	0.59
		ゴム製品	0.54
		ガラス・土石製品	0.70
		鉄鋼	0.71
		非鉄金属	2.27
		金属製品	0.41
		機械	6.15
電気機器	16.77		

輸送用機器	5.72
精密機器	1.91
その他製品	2.15
電気・ガス業	1.47
陸運業	2.07
海運業	0.62
空運業	0.27
倉庫・運輸関連業	0.15
情報・通信業	6.00
卸売業	8.81
小売業	4.14
銀行業	10.27
証券、商品先物取引業	0.91
保険業	3.46
その他金融業	1.15
不動産業	1.98
サービス業	3.03
小計	96.96
合計	96.96

(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	387	円	14,011,076,750	13,560,480,000	2.66

(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	352,906,330,290	84.75
地方債証券	日本	21,228,819,782	5.10
特殊債券	日本	20,190,637,305	4.85
	韓国	197,854,000	0.05
	小計	20,388,491,305	4.90
社債券	日本	19,768,471,000	4.75
	フランス	1,082,172,000	0.26

	小計	20,850,643,000	5.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,021,629,873	0.25
合計（純資産総額）		416,395,914,250	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183回利付国債(5年)	4,400,000,000	99.68	4,386,273,200	99.21	4,365,504,000	1.600	2030/12/20	1.05
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	4,570,000,000	91.24	4,169,987,900	90.92	4,155,089,700	0.100	2031/9/20	1.00
日本	国債証券	第376回利付国債(10年)	4,590,000,000	90.88	4,171,706,700	90.04	4,132,927,800	0.900	2034/9/20	0.99
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	4,305,000,000	93.17	4,011,183,750	92.96	4,002,143,250	0.100	2030/9/20	0.96
日本	国債証券	第377回利付国債(10年)	4,195,000,000	92.62	3,885,450,950	91.90	3,855,582,550	1.200	2034/12/20	0.93
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	4,223,000,000	90.72	3,831,118,950	90.40	3,817,760,920	0.200	2032/3/20	0.92
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	3,900,000,000	96.46	3,762,057,000	96.39	3,759,210,000	0.100	2028/12/20	0.90
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	4,195,000,000	89.71	3,763,382,500	89.30	3,746,218,900	0.200	2032/9/20	0.90
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	3,830,000,000	93.65	3,586,909,900	93.48	3,580,284,000	0.100	2030/6/20	0.86
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	3,980,000,000	89.88	3,577,582,200	89.32	3,555,015,600	0.600	2033/12/20	0.85
日本	国債証券	第179回利付国債(5年)	3,635,000,000	97.45	3,542,307,500	97.11	3,529,948,500	1.000	2030/6/20	0.85
日本	国債証券	第375回利付国債(10年)	3,835,000,000	92.69	3,554,661,500	92.02	3,529,082,050	1.100	2034/6/20	0.85
日本	国債証券	第178回利付国債(5年)	3,600,000,000	97.70	3,517,236,000	97.43	3,507,624,000	1.000	2030/3/20	0.84
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	3,805,000,000	91.76	3,491,506,050	91.45	3,479,786,650	0.100	2031/6/20	0.84
日本	国債証券	第374回利付国債(10年)	3,795,000,000	90.88	3,449,123,700	90.26	3,425,518,800	0.800	2034/3/20	0.82
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	3,770,000,000	90.70	3,419,578,500	90.38	3,407,552,200	0.100	2031/12/20	0.82
日本	国債証券	第381回利付国債(10年)	3,365,000,000	98.97	3,330,469,100	97.98	3,297,094,300	2.100	2035/12/20	0.79
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	3,560,000,000	92.69	3,299,764,000	92.46	3,291,647,200	0.100	2030/12/20	0.79
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	3,610,000,000	91.37	3,298,636,500	90.65	3,272,717,700	0.500	2032/12/20	0.79
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	3,550,000,000	92.24	3,274,551,500	91.97	3,265,148,000	0.100	2031/3/20	0.78
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	3,255,000,000	98.65	3,211,252,800	98.71	3,213,108,150	0.100	2027/6/20	0.77
日本	国債証券	第380回利付国債(10年)	3,325,000,000	95.67	3,181,153,500	94.85	3,153,895,500	1.700	2035/9/20	0.76
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	3,210,000,000	97.62	3,133,705,300	97.58	3,132,510,600	0.100	2028/3/20	0.75
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	3,260,000,000	94.58	3,083,568,800	94.50	3,080,700,000	0.100	2029/12/20	0.74

日本	国債証券	第163回利付国債(5年)	3,125,000,000	97.67	3,052,285,500	97.51	3,047,437,500	0.400	2028/9/20	0.73
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	3,390,000,000	89.53	3,035,125,000	89.03	3,018,320,400	0.400	2033/6/20	0.72
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	3,300,000,000	91.81	3,029,961,000	91.22	3,010,293,000	0.800	2033/9/20	0.72
日本	国債証券	第472回利付国債(2年)	3,000,000,000	99.58	2,987,400,000	99.54	2,986,200,000	0.700	2027/5/1	0.72
日本	国債証券	第378回利付国債(10年)	3,150,000,000	93.86	2,956,777,200	93.10	2,932,681,500	1.400	2035/3/20	0.70
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	3,245,000,000	90.24	2,928,354,400	89.84	2,915,470,250	0.200	2032/6/20	0.70

(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	84.75
地方債証券	5.10
特殊債券	4.90
社債券	5.01
合計	99.75

(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	477,036,036,334	69.94
	イギリス	26,962,387,053	3.95
	カナダ	25,755,212,505	3.78
	スイス	19,112,550,757	2.80
	フランス	16,704,271,313	2.45
	ドイツ	16,289,100,060	2.39
	オランダ	12,260,728,548	1.80
	オーストラリア	11,531,245,886	1.69
	アイルランド	11,285,997,545	1.65
	スペイン	6,793,606,488	1.00
	スウェーデン	5,789,967,461	0.85
	イタリア	5,217,965,429	0.77
	デンマーク	2,973,758,764	0.44
	シンガポール	2,830,237,568	0.41
	香港	2,797,113,958	0.41

	フィンランド	2,174,227,599	0.32
	イスラエル	1,929,276,644	0.28
	ベルギー	1,610,265,259	0.24
	ノルウェー	1,385,955,181	0.20
	ケイマン	1,260,743,484	0.18
	ルクセンブルク	1,109,705,258	0.16
	ジャージー	1,015,760,305	0.15
	バミューダ	764,814,361	0.11
	キュラソー	679,817,671	0.10
	リベリア	604,502,830	0.09
	オーストリア	589,226,582	0.09
	ニュージーランド	387,140,541	0.06
	ポルトガル	373,785,545	0.05
	パナマ	220,416,074	0.03
	マン島	39,000,406	0.01
	小計	657,484,817,409	96.39
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	96,194,013	0.01
	香港	45,665,400	0.01
	小計	141,859,413	0.02
投資証券	アメリカ	9,280,854,576	1.36
	オーストラリア	567,245,740	0.08
	フランス	237,817,532	0.03
	シンガポール	166,976,186	0.02
	イギリス	145,648,700	0.02
	香港	108,061,900	0.02
	小計	10,506,604,634	1.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,943,745,531	2.04
合計(純資産総額)		682,077,026,987	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	10,519,940,123	1.54
	買建	カナダ	385,435,195	0.06
	買建	ドイツ	1,853,171,905	0.27
	買建	イギリス	619,606,238	0.09
	買建	オーストラリア	372,429,408	0.05

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,226,418,513	0.18
	売建		141,268,820	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	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	1,386,099	29,639.43	41,083,196,959	26,407.37	36,603,242,456	5.37
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	839,260	44,465.82	37,318,388,793	39,431.20	33,093,032,605	4.85
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ ア・サービ ス	402,753	64,130.34	25,828,689,289	57,390.52	23,114,206,035	3.39
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	549,017	33,625.68	18,461,075,344	32,127.88	17,638,755,588	2.59
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・ 娯楽	331,239	51,616.18	17,097,294,912	43,727.17	14,484,147,376	2.12
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	277,841	51,657.22	14,352,495,885	43,669.62	12,133,211,780	1.78
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半 導体製造装 置	256,925	53,211.73	13,671,423,870	46,910.39	12,052,452,156	1.77
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・ 娯楽	124,250	105,740.16	13,138,215,179	85,756.43	10,655,236,974	1.56
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自 動車部品	160,666	65,728.26	10,560,297,714	56,802.16	9,126,176,867	1.34
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	155,130	51,545.31	7,996,224,250	45,369.14	7,038,115,867	1.03
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	240,244	23,830.11	5,725,041,908	27,414.62	6,586,198,832	0.97
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	45,718	169,181.81	7,734,654,373	141,754.40	6,480,727,860	0.95
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービ ス	78,322	81,233.42	6,362,364,642	75,888.64	5,943,750,125	0.87
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	137,429	38,376.08	5,273,986,385	38,769.30	5,328,026,295	0.78
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品 流通・小売 り	249,041	20,973.05	5,223,151,437	19,745.17	4,917,359,372	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービ ス	96,159	53,013.01	5,097,678,067	47,890.45	4,605,098,282	0.68
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	22,043	218,954.85	4,826,421,935	203,951.92	4,495,712,173	0.66

アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品 流通・小売 り	25,363	160,077.91	4,060,056,187	159,333.21	4,041,168,215	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サー ビス	48,406	87,732.55	4,246,781,873	78,980.71	3,823,140,732	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	109,374	28,915.89	3,162,647,297	33,688.31	3,684,625,743	0.54
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・ 娯楽	241,193	13,142.13	3,169,791,208	14,864.04	3,585,103,268	0.53
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	100,277	35,721.98	3,582,093,830	34,073.62	3,416,800,954	0.50
アメリカ	株式	MICRON TECHNOLOGY	半導体・半 導体製造装 置	64,200	63,124.42	4,052,587,888	51,449.38	3,303,050,453	0.48
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	132,812	25,448.09	3,379,813,004	23,137.83	3,072,981,956	0.45
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	389,949	9,038.01	3,524,365,457	7,551.13	2,944,556,528	0.43
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	56,498	61,577.78	3,479,021,528	51,721.18	2,922,143,228	0.43
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半 導体製造装 置	92,090	33,325.38	3,068,934,907	31,342.87	2,886,365,377	0.42
アメリカ	株式	PALANTIR TECHNOLOGIES INC- A	ソフトウェ ア・サービ ス	129,189	21,727.69	2,806,978,801	21,991.49	2,841,059,118	0.42
アメリカ	株式	CATERPILLAR	資本財	26,576	116,104.85	3,085,602,653	106,708.70	2,835,890,634	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料 ・タバコ	231,912	12,635.31	2,930,281,497	12,194.04	2,827,945,967	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.96
		素材	3.58
		資本財	8.18
		商業・専門サービス	1.07
		運輸	1.43
		自動車・自動車部品	1.81
		耐久消費財・アパレル	0.83
		消費者サービス	1.58
		メディア・娯楽	6.88
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.46
		生活必需品流通・小売り	1.94
		食品・飲料・タバコ	2.70
		家庭用品・パーソナル用品	1.12
		ヘルスケア機器・サービス	2.82
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.88
銀行	6.76		
金融サービス	6.35		

	保険	2.86
	エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.02
	ソフトウェア・サービス	7.36
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.97
	電気通信サービス	1.42
	公益事業	3.00
	半導体・半導体製造装置	11.16
	不動産管理・開発	0.25
	小計	96.39
新株予約権証券		
投資信託受益証券		0.02
投資証券		1.54
合計		97.96

(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	206	アメリカドル	69,232,139.03	11,068,834,388	65,798,975	10,519,940,123	1.54
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	9	カナダドル	3,398,916.5	390,331,571	3,356,280	385,435,195	0.06
	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	3,058,788	612,155,242	3,005,040	601,398,655	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	125	ユーロ	7,082,135	1,298,934,380	6,825,000	1,251,773,250	0.18
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	16	オーストラリアドル	3,459,112	379,395,404	3,395,600	372,429,408	0.05
	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	29	イギリスポンド	2,994,908.75	632,015,593	2,936,105	619,606,238	0.09

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,765,200.00	909,797,838	920,789,783	0.13
	ユーロ	買建	1,200,000.00	219,679,800	219,966,000	0.03
	イギリスポンド	買建	300,000.00	63,367,020	63,223,500	0.01
	香港ドル	買建	1,100,000.00	22,468,600	22,439,230	0.00
	アメリカドル	売建	300,000.00	47,955,000	47,955,810	0.01

イギリスポンド	売建	200,000.00	42,194,000	42,198,400	0.01
スウェーデンクローナ	売建	2,400,000.00	40,149,600	40,148,880	0.01
オーストラリアドル	売建	100,000.00	10,964,200	10,965,730	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	93,123,649,854	45.33
	中国	24,717,565,965	12.03
	フランス	14,271,476,156	6.95
	イタリア	13,090,197,068	6.37
	イギリス	11,477,993,545	5.59
	ドイツ	11,391,820,949	5.55
	スペイン	8,547,838,634	4.16
	カナダ	4,262,467,339	2.07
	ベルギー	3,061,773,694	1.49
	オーストラリア	2,649,397,625	1.29
	オランダ	2,431,304,523	1.18
	オーストリア	2,185,114,736	1.06
	メキシコ	1,829,724,006	0.89
	ポーランド	1,448,480,383	0.71
	ポルトガル	1,198,643,210	0.58
	フィンランド	1,065,051,364	0.52
	マレーシア	1,040,566,271	0.51
	アイルランド	887,611,216	0.43
	イスラエル	838,622,313	0.41
	シンガポール	777,400,088	0.38
ニュージーランド	615,133,585	0.30	
デンマーク	398,045,913	0.19	
スウェーデン	356,576,638	0.17	
ノルウェー	327,635,047	0.16	
	小計	201,994,090,122	98.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,432,377,500	1.67
合計(純資産総額)		205,426,467,622	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	317,501,691	0.15
	買建	ドイツ	303,529,794	0.15

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,244,541,158	0.61
	売建		460,619,655	0.22

(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 3.375% 09/15/27	11,660,000	15,972.93	1,862,443,745	15,878.08	1,851,384,420	3.375	2027/9/15	0.90
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,110,000	13,947.96	1,689,098,998	13,846.17	1,676,771,203	1.375	2031/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	T 3.75% 06/30/30	8,200,000	16,113.64	1,321,318,890	15,868.71	1,301,234,588	3.750	2030/6/30	0.63
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	13,947.96	1,273,449,534	13,869.59	1,266,293,567	0.625	2030/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 4.375% 05/15/34	7,140,000	16,309.00	1,164,463,241	16,136.01	1,152,111,390	4.375	2034/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.5% 05/31/27	7,330,000	15,380.95	1,127,424,046	15,386.57	1,127,836,046	0.500	2027/5/31	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	14,063.50	1,040,699,518	13,990.74	1,035,315,423	0.625	2030/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.5% 10/31/27	6,750,000	15,196.40	1,025,757,447	15,167.99	1,023,839,359	0.500	2027/10/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	6,250,000	16,474.50	1,029,656,868	16,295.26	1,018,454,335	4.500	2033/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 4% 02/15/34	6,400,000	15,916.17	1,018,635,447	15,750.05	1,008,003,432	4.000	2034/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	6,750,000	15,071.18	1,017,305,198	14,932.22	1,007,925,516	2.875	2032/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.875% 12/31/29	6,300,000	16,109.78	1,014,916,367	15,964.58	1,005,768,547	3.875	2029/12/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 4.5% 04/15/27	6,050,000	16,170.36	978,306,968	16,110.45	974,682,476	4.500	2027/4/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.875% 10/15/27	6,000,000	16,086.67	965,200,561	15,993.30	959,598,510	3.875	2027/10/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4% 06/30/32	6,000,000	16,062.94	963,776,625	15,894.94	953,696,693	4.000	2032/6/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.25% 11/15/34	5,900,000	16,126.64	951,472,115	15,958.95	941,578,595	4.250	2034/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 4% 11/15/35	6,040,000	15,850.49	957,369,806	15,572.06	940,552,559	4.000	2035/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/35	5,900,000	16,071.68	948,229,548	15,908.06	938,575,540	4.250	2035/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	5,900,000	15,835.92	934,319,671	15,671.05	924,591,972	3.875	2033/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	5,690,000	16,146.94	918,761,071	15,969.88	908,686,663	4.125	2032/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	15,190.16	911,409,683	15,133.64	908,018,475	1.250	2028/5/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	13,955.46	914,082,825	13,857.41	907,660,461	1.250	2031/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.75% 04/15/28	5,680,000	16,065.44	912,517,099	15,958.64	906,451,149	3.750	2028/4/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/28/29	5,950,000	15,204.83	904,687,844	15,122.08	899,764,197	1.875	2029/2/28	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	6,200,000	14,274.28	885,005,747	14,158.12	877,803,657	1.875	2032/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	5,590,000	15,736.93	879,694,862	15,642.63	874,423,254	2.875	2028/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.75% 04/30/27	5,500,000	15,844.35	871,439,675	15,814.06	869,773,738	2.750	2027/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.5% 12/31/31	5,260,000	16,521.03	869,006,564	16,346.79	859,841,325	4.500	2031/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.375% 10/31/28	5,700,000	15,091.48	860,214,666	15,024.34	856,387,850	1.375	2028/10/31	0.42

アメリカ	国債証券	T 3.875% 07/15/28	5,240,000	16,114.77	844,414,465	15,997.36	838,262,083	3.875	2028/7/15	0.41
------	------	-------------------	-----------	-----------	-------------	-----------	-------------	-------	-----------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.33
合計	98.33

(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	8	アメリカドル	866,803.68	138,584,572	864,312.48	138,186,279	0.07
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	5	アメリカドル	557,748.39	89,172,812	554,062.5	88,583,512	0.04
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	5	アメリカドル	573,670.25	91,718,400	567,500	90,731,900	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	3	ユーロ	318,576.3	58,430,080	317,265	58,189,574	0.03
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	4	ユーロ	465,558.4	85,388,066	461,400	84,625,374	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	7	ユーロ	883,954.7	162,126,131	876,260	160,714,846	0.08

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,660,000.00	578,777,562	584,360,358	0.28
	カナダドル	買建	440,000.00	50,978,438	50,494,400	0.02
	ユーロ	買建	2,030,000.00	372,661,151	372,094,940	0.18
	イギリスポンド	買建	360,000.00	76,281,366	75,861,360	0.04
	オフショア人民元	買建	7,000,000.00	160,894,529	161,730,100	0.08
	アメリカドル	売建	1,370,000.00	217,662,160	218,735,981	0.11
	カナダドル	売建	160,000.00	18,462,214	18,361,600	0.01
	ユーロ	売建	770,000.00	141,113,030	141,139,460	0.07
	イギリスポンド	売建	130,000.00	27,485,054	27,394,380	0.01
	オフショア人民元	売建	2,380,000.00	54,891,508	54,988,234	0.03

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

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

## 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：2026年3月31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 18,321円

純資産総額 321.26億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2022年2月	0円
2023年2月	0円
2024年2月	0円
2025年2月	0円
2026年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

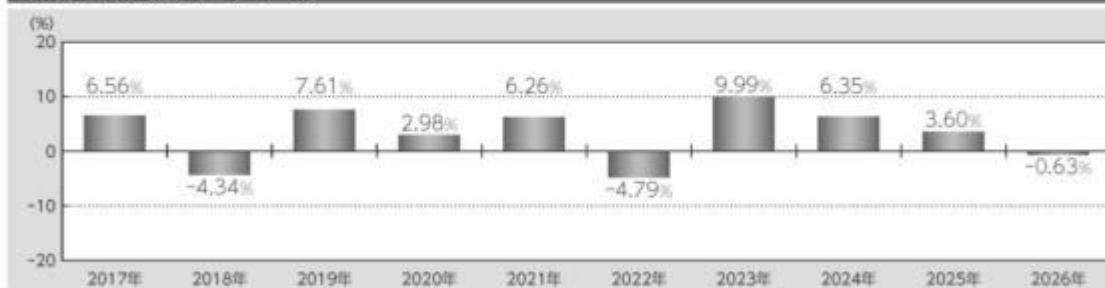
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	60.3%	第183回利付国債(5年)	日本	国債	-	1.600%	2030/12/20	0.6%
		第364回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/09/20	0.6%
		第376回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.900%	2034/09/20	0.6%
日本株式 マザーファンド	19.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.6%
		日立製作所	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
外国債券 マザーファンド	10.1%	T 3.375% 09/15/27	アメリカ	国債	-	3.375%	2027/09/15	0.1%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 3.75% 06/30/30	アメリカ	国債	-	3.750%	2030/06/30	0.1%
外国株式 マザーファンド	9.4%	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.5%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ソフトウェア	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.3%

※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)



※2026年は年初から作成基準日までの収益率です。

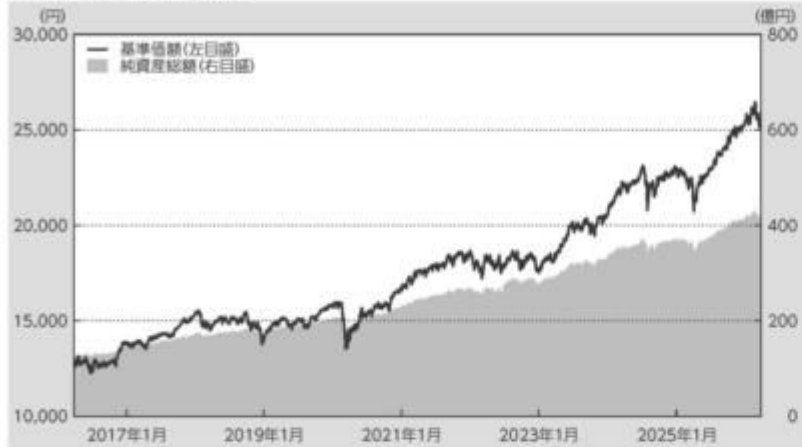
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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：2026年3月31日

**DCバランスファンド50**
**基準価額・純資産の推移**


※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

**基準価額** 25,092円

**純資産総額** 411.78億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

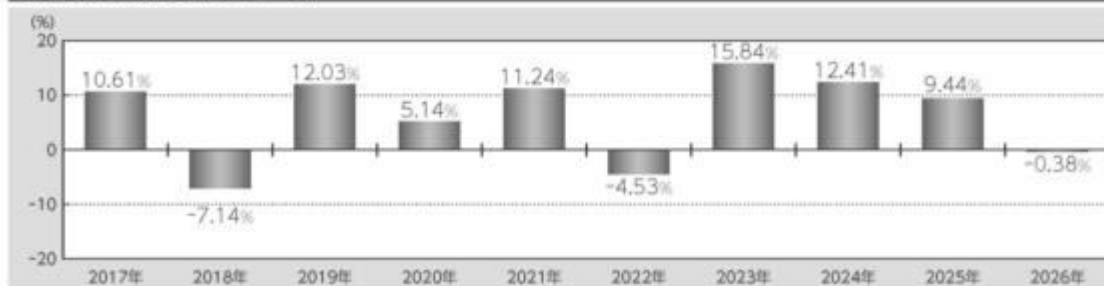
決算期	分配金
2022年2月	0円
2023年2月	0円
2024年2月	0円
2025年2月	0円
2026年2月	0円
<b>設定来 分配金合計額</b>	<b>0円</b>

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	40.6%	第183回利付国債(5年)	日本	国債	-	1.600%	2030/12/20	0.4%
		第364回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/09/20	0.4%
		第376回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.900%	2034/09/20	0.4%
日本株式 マザーファンド	28.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.0%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.9%
		日立製作所	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
外国株式 マザーファンド	19.8%	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.1%
		APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・ハードウェア及び機器	-	-	1.0%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.7%
外国債券 マザーファンド	10.5%	T 3.375% 09/15/27	アメリカ	国債	-	3.375%	2027/09/15	0.1%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 3.75% 06/30/30	アメリカ	国債	-	3.750%	2030/06/30	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)**

 ※2026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：2026年3月31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最近10年間を表示しております。

基準価額 32,214円

純資産総額 233.41億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2022年2月	0円
2023年2月	0円
2024年2月	0円
2025年2月	0円
2026年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

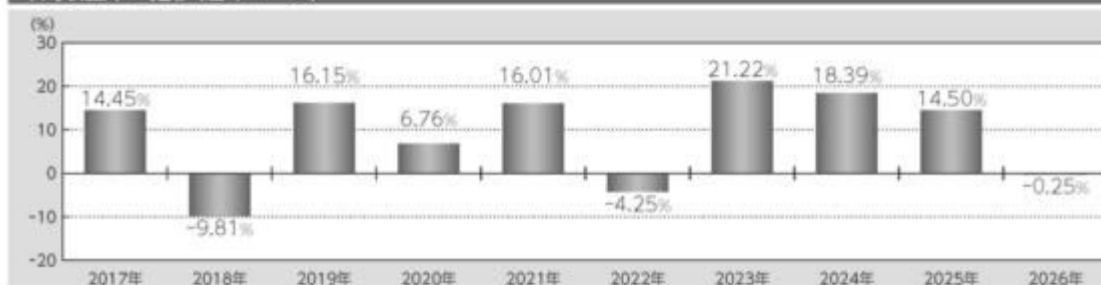
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 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	40.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.3%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	1.3%
		日立製作所	日本	株式	電気機器	-	-	0.9%
外国株式 マザーファンド	29.6%	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.6%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	1.4%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.0%
日本債券 マザーファンド	24.5%	第183回利付国債(5年)	日本	国債	-	1.600%	2030/12/20	0.3%
		第364回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2031/09/20	0.2%
		第376回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.900%	2034/09/20	0.2%
外国債券 マザーファンド	5.0%	T 3.375% 09/15/27	アメリカ	国債	-	3.375%	2027/09/15	0.0%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.0%
		T 3.75% 06/30/30	アメリカ	国債	-	3.750%	2030/06/30	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)

※2026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。当該時間を過ぎた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、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より拠ることとなります。

#### <受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

#### <一部解約受付の中止等>

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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

## （１）【資産の評価】

### < 基準価額の算出方法 >

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

### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

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

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （２）【保管】

該当事項はありません。

### （３）【信託期間】

無期限とします。（2006年 9月29日設定）

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

### （４）【計算期間】

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

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

### （５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

#### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ファンドの繰上償還において、上記 から までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記 の一定の期間が一月を下らずにその公

告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金(解約)請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金(解約)手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

## 【DCバランスファンド30】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間(2025年2月22日から2026年2月24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19期 (2025年 2月21日現在)	第20期 (2026年 2月24日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	140,540,915	142,136,634
親投資信託受益証券	30,383,831,945	32,859,337,523
未収入金	45,139,070	76,243,186
未収利息	1,789	2,792
流動資産合計	30,569,513,719	33,077,720,135
資産合計	30,569,513,719	33,077,720,135
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,823,435	44,054,328
未払受託者報酬	6,793,971	7,309,881
未払委託者報酬	28,861,180	30,935,543
その他未払費用	831,300	851,454
流動負債合計	47,309,886	83,151,206
負債合計	47,309,886	83,151,206
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,490,032,281	17,450,722,656
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	13,032,171,552	15,543,846,273
(分配準備積立金)	5,980,551,268	7,926,655,638
元本等合計	30,522,203,833	32,994,568,929
純資産合計	30,522,203,833	32,994,568,929
負債純資産合計	30,569,513,719	33,077,720,135

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期		第20期	
	自 至	2024年 2月21日	自 至	2025年 2月22日
営業収益				
受取利息		247,102		795,813
有価証券売買等損益		414,235,113		2,624,935,047
営業収益合計		414,482,215		2,625,730,860
営業費用				
支払利息		985		-
受託者報酬		13,445,718		14,018,309
委託者報酬		57,131,092		59,294,232
その他費用		1,652,417		1,669,673
営業費用合計		72,230,212		74,982,214
営業利益又は営業損失（ ）		342,252,003		2,550,748,646
経常利益又は経常損失（ ）		342,252,003		2,550,748,646
当期純利益又は当期純損失（ ）		342,252,003		2,550,748,646
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（ ）		34,677,365		73,586,677
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		12,714,566,258		13,032,171,552
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,118,497,563		1,153,544,378
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,118,497,563		1,153,544,378
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,108,466,907		1,119,031,626
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,108,466,907		1,119,031,626
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		13,032,171,552		15,543,846,273

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第20期計算期間は2025年2月22日から2026年2月24日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第19期 (2025年2月21日現在)	第20期 (2026年2月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,490,032,281口	17,450,722,656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) 1.7451円 (17,451円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8907円 (18,907円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2024年2月22日 至 2025年2月21日			第20期 自 2025年2月22日 至 2026年2月24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	353,953,872円	費用控除後の配当等収益額	A	466,290,470円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	-円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,968,302,242円
収益調整金額	C	7,819,060,049円	収益調整金額	C	8,281,860,842円
分配準備積立金額	D	5,626,597,396円	分配準備積立金額	D	5,492,062,926円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,799,611,317円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	16,208,516,480円
当ファンドの期末残存口数	F	17,490,032,281口	当ファンドの期末残存口数	F	17,450,722,656口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,889円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,288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20期 自 2025年2月22日 至 2026年2月24日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第20期 (2026年2月24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。

第20期 (2026年 2月24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。

## （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19期 自 2024年 2月22日 至 2025年 2月21日	第20期 自 2025年 2月22日 至 2026年 2月24日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	17,537,854,128円	17,490,032,281円
期中追加設定元本額	1,483,342,845円	1,464,478,586円
期中一部解約元本額	1,531,164,692円	1,503,788,211円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第19期 (2025年 2月21日現在)	第20期 (2026年 2月24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	338,972,689	2,315,611,196
合計	338,972,689	2,315,611,196

## （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	1,436,753,314	6,858,198,269	
	日本債券マザーファンド	16,334,494,724	19,585,059,174	
	外国株式マザーファンド	339,211,563	3,169,253,633	
	外国債券マザーファンド	927,585,192	3,246,826,447	
合計		19,038,044,793	32,859,337,523	

(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20期計算期間(2025年2月22日から2026年2月24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19期 (2025年 2月21日現在)	第20期 (2026年 2月24日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	216,137,150	253,032,499
親投資信託受益証券	36,467,879,351	42,432,419,892
未収入金	3,796,897	4,489,291
未収利息	2,752	4,971
流動資産合計	36,687,816,150	42,689,946,653
資産合計	36,687,816,150	42,689,946,653
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	14,902,963	7,974,812
未払受託者報酬	8,064,207	9,264,518
未払委託者報酬	36,263,514	41,421,771
その他未払費用	847,157	875,372
流動負債合計	60,077,841	59,536,473
負債合計	60,077,841	59,536,473
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	16,229,739,111	16,334,494,090
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	20,397,999,198	26,295,916,090
(分配準備積立金)	11,792,538,937	16,646,271,718
元本等合計	36,627,738,309	42,630,410,180
純資産合計	36,627,738,309	42,630,410,180
負債純資産合計	36,687,816,150	42,689,946,653

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期		第20期	
	自 至	2024年 2月21日	自 至	2025年 2月24日
<b>営業収益</b>				
受取利息		327,273		1,006,728
有価証券売買等損益		1,731,331,405		5,862,124,900
営業収益合計		1,731,658,678		5,863,131,628
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,144		-
受託者報酬		15,845,453		17,380,405
委託者報酬		71,279,074		77,645,357
その他費用		1,682,767		1,711,850
営業費用合計		88,808,438		96,737,612
営業利益又は営業損失（ ）		1,642,850,240		5,766,394,016
経常利益又は経常損失（ ）		1,642,850,240		5,766,394,016
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,642,850,240		5,766,394,016
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（ ）		90,381,899		137,787,768
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		18,613,959,701		20,397,999,198
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,777,941,085		1,669,999,037
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,777,941,085		1,669,999,037
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,546,369,929		1,400,688,393
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,546,369,929		1,400,688,393
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		20,397,999,198		26,295,916,090

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第20期計算期間は2025年2月22日から2026年2月24日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第19期 (2025年2月21日現在)	第20期 (2026年2月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	16,229,739,111口	16,334,494,090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) 2.2568円 (22,568円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6098円 (26,098円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2024年2月22日 至 2025年2月21日			第20期 自 2025年2月22日 至 2026年2月24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	552,470,469円	費用控除後の配当等収益額	A	657,658,108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	999,997,872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	4,970,948,140円
収益調整金額	C	10,894,395,889円	収益調整金額	C	11,822,173,882円
分配準備積立金額	D	10,240,070,596円	分配準備積立金額	D	11,017,665,470円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,686,934,826円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	28,468,445,600円
当ファンドの期末残存口数	F	16,229,739,111口	当ファンドの期末残存口数	F	16,334,494,090口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	13,978円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	17,428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20期 自 2025年2月22日 至 2026年2月24日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第20期 (2026年2月24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。

第20期 (2026年 2月24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。

## （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19期 自 2024年 2月22日 至 2025年 2月21日	第20期 自 2025年 2月22日 至 2026年 2月24日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	16,132,479,425円	16,229,739,111円
期中追加設定元本額	1,437,846,067円	1,219,975,168円
期中一部解約元本額	1,340,586,381円	1,115,220,189円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第19期 (2025年 2月21日現在)	第20期 (2026年 2月24日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,567,245,069	5,236,974,163
合計	1,567,245,069	5,236,974,163

## （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	2,630,899,342	12,558,334,919	
	日本債券マザーファンド	14,195,746,182	17,020,699,672	
	外国株式マザーファンド	912,794,490	8,528,238,920	
	外国債券マザーファンド	1,235,650,196	4,325,146,381	
合計		18,975,090,210	42,432,419,892	

(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20期計算期間(2025年2月22日から2026年2月24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19期 (2025年 2月21日現在)	第20期 (2026年 2月24日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	93,570,795	151,662,996
親投資信託受益証券	19,760,372,831	24,273,335,042
未収入金	40,136,484	13,291,345
未収利息	1,191	2,979
流動資産合計	19,894,081,301	24,438,292,362
資産合計	19,894,081,301	24,438,292,362
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	16,451,089	16,528,742
未払受託者報酬	4,335,314	5,224,479
未払委託者報酬	20,572,954	24,599,693
その他未払費用	541,089	644,667
流動負債合計	41,900,446	46,997,581
負債合計	41,900,446	46,997,581
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,167,346,403	7,210,662,147
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	12,684,834,452	17,180,632,634
(分配準備積立金)	6,995,344,824	10,600,535,898
元本等合計	19,852,180,855	24,391,294,781
純資産合計	19,852,180,855	24,391,294,781
負債純資産合計	19,894,081,301	24,438,292,362

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期		第20期	
	自 至	2024年 2月21日	自 至	2025年 2月24日
<b>営業収益</b>				
受取利息		163,596		565,137
有価証券売買等損益		1,547,553,783		4,469,618,504
営業収益合計		1,547,717,379		4,470,183,641
<b>営業費用</b>				
支払利息		623		-
受託者報酬		8,425,158		9,629,237
委託者報酬		39,999,655		45,290,173
その他費用		1,052,255		1,186,275
営業費用合計		49,477,691		56,105,685
営業利益又は営業損失（ ）		1,498,239,688		4,414,077,956
経常利益又は経常損失（ ）		1,498,239,688		4,414,077,956
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,498,239,688		4,414,077,956
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（ ）		103,881,638		141,488,931
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		10,803,677,186		12,684,834,452
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,750,355,127		1,507,174,107
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,750,355,127		1,507,174,107
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,263,555,911		1,283,964,950
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,263,555,911		1,283,964,950
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,684,834,452		17,180,632,634

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月22日から翌年2月21日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第20期計算期間は2025年2月22日から2026年2月24日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第19期 (2025年2月21日現在)	第20期 (2026年2月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,167,346,403口	7,210,662,147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) 2.7698円 (27,698円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.3827円 (33,827円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2024年2月22日 至 2025年2月21日			第20期 自 2025年2月22日 至 2026年2月24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	323,458,288円	費用控除後の配当等収益額	A	383,549,709円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,070,899,762円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,889,039,316円
収益調整金額	C	6,717,106,801円	収益調整金額	C	7,473,116,620円
分配準備積立金額	D	5,600,986,774円	分配準備積立金額	D	6,327,946,873円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,712,451,625円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,073,652,518円
当ファンドの期末残存口数	F	7,167,346,403口	当ファンドの期末残存口数	F	7,210,662,147口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	19,131円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	25,065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20期 自 2025年2月22日 至 2026年2月24日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第20期 (2026年2月24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。

第20期 (2026年 2月24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。

## （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19期 自 2024年 2月22日 至 2025年 2月21日	第20期 自 2025年 2月22日 至 2026年 2月24日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,948,155,901円	7,167,346,403円
期中追加設定元本額	1,029,429,059円	768,724,517円
期中一部解約元本額	810,238,557円	725,408,773円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第19期 (2025年 2月21日現在)	第20期 (2026年 2月24日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,454,846,331	4,086,529,265
合計	1,454,846,331	4,086,529,265

## （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	2,015,276,702	9,619,721,809	
	日本債券マザーファンド	5,056,853,105	6,063,166,872	
	外国株式マザーファンド	786,519,102	7,348,447,969	
	外国債券マザーファンド	354,826,270	1,241,998,392	
合計		8,213,475,179	24,273,335,042	

(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

	2026年 2月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	14,988,630,630
株式	549,752,531,350
派生商品評価勘定	167,590,450
未収入金	167,232,400
未収配当金	649,423,255
未収利息	294,471
その他未収収益	25,938,780
差入委託証拠金	222,822,684
流動資産合計	565,974,464,020
資産合計	565,974,464,020
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	781,050
前受金	166,860,000
未払解約金	182,170,584
未払利息	5,419,126
受入担保金	11,880,486,395
流動負債合計	12,235,717,155
負債合計	12,235,717,155
純資産の部	
元本等	
元本	116,004,824,003
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	437,733,922,862
元本等合計	553,738,746,865
純資産合計	553,738,746,865
負債純資産合計	565,974,464,020

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 2月24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

	2026年 2月24日現在
	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）

	2026年 2月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	116,004,824,003口
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	株式 11,216,885,540円 1口当たり純資産額 4.7734円 (1万口当たり純資産額) (47,734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

	2026年 2月24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

	2026年 2月24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	2026年 2月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2026年 2月24日現在
期首	2025年 2月22日
期首元本額	126,312,649,564円
期中追加設定元本額	9,492,023,905円
期中一部解約元本額	19,799,849,466円
期末元本額	116,004,824,003円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	534,707,740円
D C日本株式インデックスファンド	249,774,393円
D C日本株式インデックスファンドL	50,166,014,962円
D C日本株式インデックスファンドA	609,581,606円
D Cバランスファンド3 0	1,436,753,314円
D Cバランスファンド5 0	2,630,899,342円
D Cバランスファンド7 0	2,015,276,702円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	409,643,903円
日本株式インデックスe	1,169,374,736円
インデックスコレクション（国内株式）	23,899,458,611円
インデックスコレクション（バランス株式3 0）	7,590,186,335円
インデックスコレクション（バランス株式5 0）	3,175,634,132円
インデックスコレクション（バランス株式7 0）	3,699,507,667円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,628,150,419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）	2,521,420,185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）	446,252,789円
バランスVA3 0（適格機関投資家専用）	9,864,515円
バランスVA5 0（適格機関投資家専用）	169,257,745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）	20,363,396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）	63,529,582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）	16,847,891円
バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	153,841,033円
バランスVA3 7 . 5（適格機関投資家専用）	189,095,364円
バランスVA5 0 L（適格機関投資家専用）	3,394,128,248円
バランスVA7 5（適格機関投資家専用）	398,299,461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）	19,955,694円
VAポートフォリオ4 0（適格機関投資家専用）	510,087,513円
VAポートフォリオ2 0（適格機関投資家専用）	6,918,377円
バランスVA4 0（適格機関投資家専用）	65,470,656円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	877,955,594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）	19,000,982円
VAバランス5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	21,933,571円
VAファンド2 5（適格機関投資家専用）	3,200,872円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	189,762,072円
バランスVA2 5 L（適格機関投資家専用）	102,437,003円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	1,502,112,597円
世界バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	30,607,834円
国内バランスVA3 0（適格機関投資家専用）	8,889,116円
国内バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	3,257,618円
VAバランス2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	43,210,644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）	2,159,789円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2026年 2月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	28,791,312,677
合計	28,791,312,677

(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

（2026年 2月24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	3,348,000,000	-	3,514,860,000	166,860,000
合計		3,348,000,000	-	3,514,860,000	166,860,000

(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ではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,000	5,330.00	31,980,000	
ニッスイ	130,900	1,501.00	196,480,900	
マルハニチロ	69,300	1,525.50	105,717,150	
ユキグニファクトリー	12,300	1,100.00	13,530,000	貸付有価証券 3,800株
カネコ種苗	4,100	1,549.00	6,350,900	
サカタのタネ	17,300	4,330.00	74,909,000	
ホクト	12,800	2,003.00	25,638,400	
住石ホールディングス	12,800	895.00	11,456,000	貸付有価証券 9,600株
日鉄鉱業	28,900	3,780.00	109,242,000	貸付有価証券 20,400株
I N P E X	479,500	3,708.00	1,777,986,000	
石油資源開発	88,100	2,320.00	204,392,000	
K & O エナジーグループ	6,500	5,220.00	33,930,000	
ショーボンドホールディングス	83,300	1,430.00	119,119,000	
ミライト・ワン	48,700	3,952.00	192,462,400	
タマホーム	9,000	3,940.00	35,460,000	貸付有価証券 6,700株
第一カッター興業	3,700	1,612.00	5,964,400	貸付有価証券 1,600株
安藤・間	75,800	2,090.00	158,422,000	
東急建設	45,100	1,569.00	70,761,900	
コムシスホールディングス	51,100	5,665.00	289,481,500	
ピーアールホールディングス	21,100	528.00	11,140,800	
高松コンストラクショングループ	10,700	3,965.00	42,425,500	
東建コーポレーション	3,100	14,970.00	46,407,000	

ヤマウラ	7,300	1,649.00	12,037,700	貸付有価証券 5,200株
オリエンタル白石	53,300	420.00	22,386,000	
大成建設	74,600	19,055.00	1,421,503,000	
大林組	323,100	4,181.00	1,350,881,100	
清水建設	272,900	3,490.00	952,421,000	
長谷工コーポレーション	92,400	3,279.00	302,979,600	
松井建設	8,200	1,897.00	15,555,400	
鹿島建設	221,500	6,964.00	1,542,526,000	
不動テトラ	5,700	3,840.00	21,888,000	
鉄建建設	6,300	4,710.00	29,673,000	
西松建設	16,000	6,733.00	107,728,000	
大豊建設	13,900	868.00	12,065,200	
奥村組	16,200	7,140.00	115,668,000	
東鉄工業	11,100	5,220.00	57,942,000	
浅沼組	40,300	1,137.00	45,821,100	
戸田建設	123,900	1,573.00	194,894,700	
熊谷組	59,300	1,998.00	118,481,400	
矢作建設工業	18,700	2,470.00	46,189,000	
ピーエス・コンストラクション	7,300	3,420.00	24,966,000	
日本ハウスホールディングス	21,500	324.00	6,966,000	貸付有価証券 16,100株
新日本建設	14,100	2,071.00	29,201,100	
東亜道路工業	15,400	1,893.00	29,152,200	
東亜建設工業	36,900	4,115.00	151,843,500	
日本国土開発	30,800	692.00	21,313,600	
若築建設	3,000	4,885.00	14,655,000	
五洋建設	141,600	2,055.50	291,058,800	
世紀東急工業	14,400	1,687.00	24,292,800	
福田組	3,500	7,550.00	26,425,000	
住友林業	259,100	1,705.00	441,765,500	
大和ハウス工業	276,300	5,562.00	1,536,780,600	
ライト工業	19,200	4,155.00	79,776,000	
積水ハウス	303,000	3,769.00	1,142,007,000	
日特建設	9,600	1,418.00	13,612,800	
北陸電気工事	5,700	1,698.00	9,678,600	
ユアテック	21,100	3,085.00	65,093,500	
日本リーテック	7,900	3,050.00	24,095,000	
四電工	12,600	2,022.00	25,477,200	
中電工	13,300	5,000.00	66,500,000	
関電工	55,200	6,617.00	365,258,400	貸付有価証券 41,100株
きんでん	68,500	8,216.00	562,796,000	

東京エネシス	9,300	1,915.00	17,809,500	貸付有価証券 7,000株
トーエネック	16,700	2,260.00	37,742,000	
日本電設工業	18,900	4,940.00	93,366,000	
エクシオグループ	95,300	2,890.50	275,464,650	
新日本空調	13,100	4,015.00	52,596,500	
クラフティア	21,800	10,130.00	220,834,000	
三機工業	20,400	7,610.00	155,244,000	
日揮ホールディングス	108,800	2,362.50	257,040,000	
中外炉工業	2,700	5,020.00	13,554,000	
太平電業	20,000	2,750.00	55,000,000	
高砂熱学工業	53,500	5,020.00	268,570,000	
朝日工業社	9,400	4,655.00	43,757,000	
明星工業	16,900	1,967.00	33,242,300	
大気社	25,800	3,800.00	98,040,000	
ダイダン	57,900	3,395.00	196,570,500	
日比谷総合設備	7,200	6,270.00	45,144,000	
飛島ホールディングス	10,300	2,499.00	25,739,700	
フィル・カンパニー	1,800	1,104.00	1,987,200	
テスホールディングス	24,400	580.00	14,152,000	貸付有価証券 18,200株
インフロニア・ホールディングス	105,500	2,600.50	274,352,750	貸付有価証券 18,500株
東洋エンジニアリング	14,800	2,921.00	43,230,800	貸付有価証券 11,000株
レイズネクスト	14,600	2,579.00	37,653,400	貸付有価証券 5,300株
ニッポン	35,300	2,869.00	101,275,700	
日清製粉グループ本社	100,400	2,139.00	214,755,600	
日東富士製粉	1,800	7,180.00	12,924,000	
昭和産業	8,600	3,455.00	29,713,000	貸付有価証券 6,200株
中部飼料	12,700	1,949.00	24,752,300	
フィード・ワン	13,200	1,264.00	16,684,800	
日本甜菜製糖	5,300	4,360.00	23,108,000	
D M三井製糖	8,400	3,525.00	29,610,000	
ウェルネオシュガー	5,700	3,030.00	17,271,000	
森永製菓	39,700	2,860.00	113,542,000	
中村屋	2,500	3,275.00	8,187,500	貸付有価証券 1,700株
江崎グリコ	28,900	6,012.00	173,746,800	
mei to	4,500	2,647.00	11,911,500	貸付有価証券 3,200株
井村屋グループ	5,500	2,544.00	13,992,000	
不二家	6,900	2,511.00	17,325,900	貸付有価証券 5,100株

山崎製パン	67,700	3,514.00	237,897,800	
モロゾフ	9,800	1,518.00	14,876,400	貸付有価証券 7,300株
亀田製菓	6,400	4,395.00	28,128,000	
寿スピリッツ	53,400	1,986.50	106,079,100	貸付有価証券 40,200株
カルビー	46,300	3,061.00	141,724,300	
森永乳業	37,600	4,721.00	177,509,600	
六甲バター	7,600	1,213.00	9,218,800	貸付有価証券 5,700株
ヤクルト本社	139,100	2,606.50	362,564,150	貸付有価証券 2,000株
明治ホールディングス	139,700	3,904.00	545,388,800	
雪印メグミルク	27,200	3,520.00	95,744,000	
プリマハム	13,600	2,890.00	39,304,000	
日本ハム	37,700	7,057.00	266,048,900	
丸大食品	10,200	2,449.00	24,979,800	貸付有価証券 5,100株
S Foods	11,200	3,200.00	35,840,000	貸付有価証券 300株
柿安本店	4,300	2,876.00	12,366,800	貸付有価証券 3,200株
伊藤ハム米久ホールディングス	17,500	6,280.00	109,900,000	
サッポロホールディングス	150,000	1,732.50	259,875,000	
アサヒグループホールディングス	753,000	1,703.00	1,282,359,000	
キリンホールディングス	417,700	2,651.00	1,107,322,700	
シマダヤ	2,900	1,951.00	5,657,900	
宝ホールディングス	82,600	1,600.00	132,160,000	
オエノンホールディングス	30,200	467.00	14,103,400	
養命酒製造	3,300	4,595.00	15,163,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	65,200	4,097.00	267,124,400	
ライフドリンク カンパニー	17,900	1,244.00	22,267,600	
サントリー 食品インターナショナル	70,600	4,835.00	341,351,000	
ダイトーグループホールディングス	11,500	2,568.00	29,532,000	貸付有価証券 8,500株
伊藤園	32,700	3,015.00	98,590,500	
キーコーヒー	11,300	2,001.00	22,611,300	貸付有価証券 8,400株
日清オイリオグループ	14,200	5,970.00	84,774,000	
不二製油	20,200	3,922.00	79,224,400	
J - オイルミルズ	11,600	2,055.00	23,838,000	
キッコーマン	332,300	1,504.00	499,779,200	
味の素	497,900	4,697.00	2,338,636,300	
ブルドックソース	5,400	1,922.00	10,378,800	貸付有価証券 200株

キューピー	54,300	4,542.00	246,630,600	
ハウス食品グループ本社	37,500	3,041.00	114,037,500	
カゴメ	54,100	2,855.50	154,482,550	貸付有価証券 8,900株
アリアケジャパン	11,200	6,050.00	67,760,000	
エバラ食品工業	2,600	2,705.00	7,033,000	
ニチレイ	88,100	2,081.00	183,336,100	
東洋水産	46,400	12,025.00	557,960,000	
イトアンドホールディングス	5,200	2,082.00	10,826,400	貸付有価証券 3,900株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,500	1,000.00	5,500,000	貸付有価証券 4,200株
日清食品ホールディングス	113,300	3,248.00	367,998,400	貸付有価証券 22,100株
フジッコ	10,400	1,644.00	17,097,600	
ロック・フィールド	11,300	1,415.00	15,989,500	貸付有価証券 8,400株
日本たばこ産業	609,300	5,980.00	3,643,614,000	
ケンコーマヨネーズ	6,300	2,278.00	14,351,400	
わらべや日洋ホールディングス	6,800	3,505.00	23,834,000	
なとり	6,300	1,944.00	12,247,200	貸付有価証券 4,600株
ファーマフーズ	13,400	625.00	8,375,000	貸付有価証券 9,700株
ユーグレナ	64,700	385.00	24,909,500	貸付有価証券 49,800株
紀文食品	8,800	1,095.00	9,636,000	貸付有価証券 6,500株
ピククルスホールディングス	5,900	1,288.00	7,599,200	貸付有価証券 4,400株
オリオンビール	16,300	1,323.00	21,564,900	
理研ビタミン	8,000	3,035.00	24,280,000	
片倉工業	9,700	3,155.00	30,603,500	
ゲンゼ	14,600	4,620.00	67,452,000	
ユニチカ	33,300	1,377.00	45,854,100	貸付有価証券 25,600株
富士紡ホールディングス	4,800	10,970.00	52,656,000	
倉敷紡績	6,900	9,980.00	68,862,000	
シキボウ	7,400	1,137.00	8,413,800	
日本毛織	26,400	2,068.00	54,595,200	
帝国繊維	10,600	3,030.00	32,118,000	貸付有価証券 200株
帝人	90,500	1,699.50	153,804,750	
東レ	687,700	1,324.50	910,858,650	
セーレン	22,200	3,570.00	79,254,000	
小松マテーレ	14,900	910.00	13,559,000	
ワコールホールディングス	20,200	4,585.00	92,617,000	

ホギメディカル	11,200	6,710.00	75,152,000	
T S I ホールディングス	31,300	1,145.00	35,838,500	
ワールド	15,800	3,340.00	52,772,000	貸付有価証券 11,600株
三陽商会	4,800	4,455.00	21,384,000	
オンワードホールディングス	66,700	812.00	54,160,400	
ルックホールディングス	3,300	2,502.00	8,256,600	貸付有価証券 2,400株
ゴールドウイン	59,600	2,450.00	146,020,000	
特種東海製紙	15,000	1,684.00	25,260,000	
王子ホールディングス	386,300	981.50	379,153,450	
日本製紙	57,600	1,266.00	72,921,600	
北越コーポレーション	57,800	971.00	56,123,800	貸付有価証券 43,100株
大王製紙	51,900	1,127.00	58,491,300	
レンゴー	103,200	1,529.00	157,792,800	
トーモク	5,900	3,680.00	21,712,000	
ザ・バック	20,600	1,318.00	27,150,800	
北の達人コーポレーション	43,300	137.00	5,932,100	貸付有価証券 32,200株
東洋紡	44,400	1,628.00	72,283,200	
クラレ	129,000	1,819.50	234,715,500	
旭化成	676,100	1,833.00	1,239,291,300	
レゾナック・ホールディングス	98,600	11,900.00	1,173,340,000	貸付有価証券 50,000株
住友化学	820,800	575.70	472,534,560	
住友精化	4,300	7,170.00	30,831,000	
日産化学	52,100	6,921.00	360,584,100	
ラサ工業	3,300	10,290.00	33,957,000	貸付有価証券 2,400株
クレハ	15,200	4,875.00	74,100,000	貸付有価証券 3,000株
多木化学	4,000	3,900.00	15,600,000	
テイカ	7,300	1,728.00	12,614,400	
石原産業	17,100	3,905.00	66,775,500	
日本曹達	21,800	4,090.00	89,162,000	
東ソー	148,600	2,672.00	397,059,200	
トクヤマ	35,700	4,241.00	151,403,700	
セントラル硝子	13,000	4,350.00	56,550,000	
東亜合成	43,400	1,856.50	80,572,100	
大阪ソーダ	35,900	2,415.00	86,698,500	
関東電化工業	19,700	1,767.00	34,809,900	
デンカ	40,500	3,332.00	134,946,000	
信越化学工業	907,100	5,930.00	5,379,103,000	
日本カーバイド工業	5,400	3,085.00	16,659,000	

堺化学工業	7,200	4,030.00	29,016,000	
第一稀元素化学工業	11,200	2,424.00	27,148,800	貸付有価証券 8,200株
エア・ウォーター	98,600	2,066.50	203,756,900	
日本酸素ホールディングス	115,500	5,811.00	671,170,500	
日本化学工業	3,800	3,560.00	13,528,000	
日本パーカラライジング	50,500	1,600.00	80,800,000	
高圧ガス工業	14,900	1,138.00	16,956,200	貸付有価証券 200株
四国化成ホールディングス	11,600	5,530.00	64,148,000	
戸田工業	2,300	1,460.00	3,358,000	
ステラ ケミファ	5,500	5,480.00	30,140,000	
保土谷化学工業	6,500	2,386.00	15,509,000	
日本触媒	65,900	2,482.00	163,563,800	
大日精化工業	7,000	4,950.00	34,650,000	
カネカ	25,300	5,172.00	130,851,600	
三菱瓦斯化学	72,600	4,519.00	328,079,400	
三井化学	183,600	2,326.00	427,053,600	
東京応化工業	49,100	9,182.00	450,836,200	
大阪有機化学工業	8,600	4,750.00	40,850,000	
三菱ケミカルグループ	713,900	1,145.00	817,415,500	
KHネオケム	17,100	3,035.00	51,898,500	貸付有価証券 800株
ダイセル	112,700	1,645.00	185,391,500	
住友ベークライト	35,700	5,860.00	209,202,000	
積水化学工業	213,200	2,993.00	638,107,600	
日本ゼオン	74,400	2,087.00	155,272,800	
アイカ工業	26,000	3,910.00	101,660,000	貸付有価証券 19,400株
UBE	53,000	2,838.00	150,414,000	
積水樹脂	12,100	2,356.00	28,507,600	
旭有機材	6,800	5,120.00	34,816,000	
ニチバン	6,300	1,986.00	12,511,800	
リケンテクノス	17,700	1,771.00	31,346,700	貸付有価証券 13,200株
大倉工業	4,900	5,090.00	24,941,000	
積水化成成品工業	14,400	515.00	7,416,000	
群栄化学工業	2,400	5,300.00	12,720,000	
ダイキョーニシカワ	22,700	921.00	20,906,700	
森六	5,500	2,614.00	14,377,000	
恵和	6,700	1,337.00	8,957,900	
日本化薬	73,100	1,963.50	143,531,850	
カーリット	9,200	2,787.00	25,640,400	
日本精化	6,800	2,757.00	18,747,600	

扶桑化学工業	10,800	9,460.00	102,168,000	貸付有価証券 300株
トリケミカル研究所	11,200	3,525.00	39,480,000	貸付有価証券 8,600株
A D E K A	39,500	4,572.00	180,594,000	
日油	117,100	3,027.00	354,461,700	
ハリマ化成グループ	8,000	1,041.00	8,328,000	
花王	241,600	6,636.00	1,603,257,600	
第一工業製薬	3,700	11,700.00	43,290,000	
石原ケミカル	4,400	2,934.00	12,909,600	貸付有価証券 3,200株
三洋化成工業	6,300	6,050.00	38,115,000	
大日本塗料	11,400	1,479.00	16,860,600	
日本ペイントホールディングス	541,700	1,158.00	627,288,600	
関西ペイント	82,000	2,765.00	226,730,000	貸付有価証券 61,500株
中国塗料	20,900	4,590.00	95,931,000	
藤倉化成	13,000	1,116.00	14,508,000	
太陽ホールディングス	49,000	6,096.00	298,704,000	
D I C	36,500	4,396.00	160,454,000	
サカタインクス	22,900	2,678.00	61,326,200	
a r t i e n c e	18,900	4,285.00	80,986,500	
富士フイルムホールディングス	615,800	2,988.50	1,840,318,300	
資生堂	198,000	3,194.00	632,412,000	
ライオン	118,200	1,837.00	217,133,400	
高砂香料工業	38,400	1,406.00	53,990,400	
マンダム	20,400	3,080.00	62,832,000	
ミルボン	16,500	2,786.00	45,969,000	
コーセーホールディングス	23,300	6,223.00	144,995,900	
コタ	10,400	1,300.00	13,520,000	貸付有価証券 8,000株
ポーラ・オルビスホールディングス	52,800	1,379.50	72,837,600	貸付有価証券 38,400株
ノエビアホールディングス	9,200	4,685.00	43,102,000	
新日本製薬	5,900	2,113.00	12,466,700	貸付有価証券 4,300株
I - n e	2,700	1,120.00	3,024,000	貸付有価証券 2,000株
アクシージャ	6,500	375.00	2,437,500	貸付有価証券 4,800株
エステー	7,100	1,574.00	11,175,400	
コニシ	32,400	1,373.00	44,485,200	
長谷川香料	19,700	2,905.00	57,228,500	
小林製薬	27,000	5,723.00	154,521,000	
荒川化学工業	9,500	1,515.00	14,392,500	

メック	7,500	7,240.00	54,300,000	貸付有価証券 5,400株
日本高純度化学	2,600	5,280.00	13,728,000	
タカラバイオ	27,500	1,148.00	31,570,000	
J C U	11,200	6,850.00	76,720,000	
O A T アグリオ	3,800	2,363.00	8,979,400	
デクセリアルズ	88,100	2,375.00	209,237,500	
アース製薬	9,400	4,990.00	46,906,000	
北興化学工業	7,700	1,865.00	14,360,500	貸付有価証券 2,600株
大成ラミックグループ	3,000	2,750.00	8,250,000	
クミアイ化学工業	42,100	721.00	30,354,100	貸付有価証券 9,400株
日本農薬	15,700	1,029.00	16,155,300	
アキレス	5,600	1,742.00	9,755,200	
有沢製作所	15,500	2,640.00	40,920,000	
日東電工	310,300	3,596.00	1,115,838,800	
レック	10,200	1,201.00	12,250,200	
三光合成	13,000	1,044.00	13,572,000	
Z A C R O S	32,600	1,478.00	48,182,800	
前澤化成工業	7,200	2,385.00	17,172,000	貸付有価証券 4,800株
未来工業	4,200	3,495.00	14,679,000	貸付有価証券 1,000株
J S P	7,200	2,841.00	20,455,200	貸付有価証券 5,200株
エフピコ	19,300	2,824.00	54,503,200	
信越ポリマー	22,200	2,182.00	48,440,400	
ニフコ	38,500	5,174.00	199,199,000	
バルカー	7,900	5,170.00	40,843,000	
ユニ・チャーム	638,400	1,094.50	698,728,800	
協和キリン	120,100	2,824.00	339,162,400	
武田薬品工業	908,800	5,818.00	5,287,398,400	
アステラス製薬	895,900	2,508.50	2,247,365,150	
住友ファーマ	91,700	2,241.00	205,499,700	
塩野義製薬	372,700	3,630.00	1,352,901,000	
日本新薬	27,000	4,996.00	134,892,000	
中外製薬	319,700	10,100.00	3,228,970,000	
科研製薬	15,100	4,305.00	65,005,500	
エーザイ	133,300	5,077.00	676,764,100	
ロート製薬	108,800	2,358.00	256,550,400	
小野薬品工業	227,900	2,628.00	598,921,200	
持田製薬	12,600	3,855.00	48,573,000	
参天製薬	171,900	1,724.00	296,355,600	
扶桑薬品工業	4,000	2,428.00	9,712,000	

ツムラ	35,400	4,120.00	145,848,000	
キッセイ薬品工業	16,100	4,865.00	78,326,500	
生化学工業	17,300	732.00	12,663,600	
栄研化学	16,300	3,300.00	53,790,000	
JCRファーマ	44,400	686.00	30,458,400	
東和薬品	13,800	4,350.00	60,030,000	
富士製薬工業	7,600	2,379.00	18,080,400	
ゼリア新薬工業	13,900	2,208.00	30,691,200	貸付有価証券 200株
ネクセラファーマ	45,200	909.00	41,086,800	貸付有価証券 32,800株
第一三共	937,800	2,978.00	2,792,768,400	
杏林製薬	20,700	1,710.00	35,397,000	
大幸薬品	21,400	301.00	6,441,400	貸付有価証券 16,600株
ダイト	13,900	1,457.00	20,252,300	
大塚ホールディングス	227,500	10,425.00	2,371,687,500	
ペプチドリーム	49,900	1,341.00	66,915,900	
セルソース	6,100	407.00	2,482,700	貸付有価証券 4,400株
あすか製薬ホールディングス	8,800	2,462.00	21,665,600	
サワイグループホールディングス	53,200	2,335.00	124,222,000	
日本コークス工業	104,500	124.00	12,958,000	
ニチレキグループ	10,900	2,433.00	26,519,700	
ユシロ	5,300	3,150.00	16,695,000	
出光興産	441,700	1,407.00	621,471,900	
ENEOSホールディングス	1,443,100	1,455.00	2,099,710,500	
コスモエネルギーホールディングス	56,600	4,740.00	268,284,000	
横浜ゴム	57,000	7,759.00	442,263,000	
TOYO TIRE	64,600	4,713.00	304,459,800	
ブリヂストン	598,000	3,666.00	2,192,268,000	
住友ゴム工業	111,100	2,750.00	305,525,000	
藤倉コンポジット	9,900	2,618.00	25,918,200	
オカモト	5,400	5,720.00	30,888,000	
フコク	6,100	2,025.00	12,352,500	
ニッタ	10,100	4,515.00	45,601,500	
三ツ星ベルト	13,000	4,295.00	55,835,000	
バンドー化学	15,300	2,365.00	36,184,500	
日東紡績	12,900	26,200.00	337,980,000	貸付有価証券 1,200株
AGC	99,400	6,517.00	647,789,800	
日本板硝子	53,600	613.00	32,856,800	
日本電気硝子	34,400	6,429.00	221,157,600	
オハラ	3,900	1,174.00	4,578,600	貸付有価証券 2,900株

住友大阪セメント	17,900	4,600.00	82,340,000	
太平洋セメント	63,000	4,575.00	288,225,000	
日本ヒューム	18,000	1,525.00	27,450,000	貸付有価証券 13,400株
日本コンクリート工業	20,000	346.00	6,920,000	貸付有価証券 14,800株
三谷セキサン	3,600	7,250.00	26,100,000	貸付有価証券 200株
アジアパイルホールディングス	14,600	1,514.00	22,104,400	
東海カーボン	103,600	1,082.00	112,095,200	
日本カーボン	5,900	5,020.00	29,618,000	
東洋炭素	7,500	6,120.00	45,900,000	貸付有価証券 5,700株
ノリタケ	10,700	7,090.00	75,863,000	
TOTO	63,400	6,337.00	401,765,800	
日本碍子	113,500	4,471.00	507,458,500	
日本特殊陶業	83,500	7,847.00	655,224,500	
MARUWA	4,300	59,450.00	255,635,000	
品川リフラ	12,700	2,430.00	30,861,000	貸付有価証券 200株
黒崎播磨	8,300	4,205.00	34,901,500	
ヨータイ	5,300	1,986.00	10,525,800	
フジインコーポレーテッド	30,500	3,250.00	99,125,000	
ニチアス	28,400	8,803.00	250,005,200	
ニチハ	12,900	3,710.00	47,859,000	
日本製鉄	2,865,000	663.90	1,902,073,500	
神戸製鋼所	211,300	2,225.50	470,248,150	貸付有価証券 158,300株
中山製鋼所	21,800	623.00	13,581,400	
合同製鐵	5,900	3,990.00	23,541,000	貸付有価証券 4,000株
JFEホールディングス	340,900	2,228.00	759,525,200	
東京製鐵	29,600	1,584.00	46,886,400	
共英製鋼	10,300	2,602.00	26,800,600	
大和工業	20,000	12,845.00	256,900,000	
東京鐵鋼	4,300	6,270.00	26,961,000	
大阪製鐵	4,900	2,584.00	12,661,600	貸付有価証券 3,600株
ヨドコウ	60,600	1,418.00	85,930,800	
中部鋼鈹	8,600	2,542.00	21,861,200	
丸一鋼管	105,600	1,600.00	168,960,000	
モリ工業	11,800	1,022.00	12,059,600	
大同特殊鋼	74,500	2,220.00	165,390,000	
日本冶金工業	7,100	5,060.00	35,926,000	
愛知製鋼	19,700	3,340.00	65,798,000	

大平洋金属	8,900	3,230.00	28,747,000	
新日本電工	58,000	441.00	25,578,000	
栗本鐵工所	24,600	1,713.00	42,139,800	
三菱製鋼	7,800	2,044.00	15,943,200	
日本精線	8,400	1,326.00	11,138,400	
エンビプロ・ホールディングス	10,500	929.00	9,754,500	貸付有価証券 7,800株
J X 金属	291,900	3,692.00	1,077,694,800	
大紀アルミニウム工業所	15,400	1,469.00	22,622,600	
日本軽金属ホールディングス	31,100	3,030.00	94,233,000	
三井金属	26,300	33,040.00	868,952,000	
三菱マテリアル	70,200	5,437.00	381,677,400	
住友金属鉱山	144,000	10,810.00	1,556,640,000	
D O W A ホールディングス	28,600	10,590.00	302,874,000	
古河機械金属	12,700	5,730.00	72,771,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,500	2,805.00	51,892,500	貸付有価証券 14,000株
東邦チタニウム	19,200	1,886.00	36,211,200	貸付有価証券 14,600株
U A C J	63,700	2,605.00	165,938,500	
C K サンエツ	2,600	4,465.00	11,609,000	
古河電気工業	35,000	26,910.00	941,850,000	
住友電気工業	362,900	10,390.00	3,770,531,000	
フジクラ	135,200	25,190.00	3,405,688,000	
S W C C	15,300	15,390.00	235,467,000	貸付有価証券 9,900株
平河ヒューテック	6,200	4,595.00	28,489,000	
リョービ	11,800	2,994.00	35,329,200	
A R E ホールディングス	43,000	4,255.00	182,965,000	貸付有価証券 32,200株
稲葉製作所	5,900	1,693.00	9,988,700	貸付有価証券 4,300株
宮地エンジニアリンググループ	12,800	1,881.00	24,076,800	
トーカロ	30,500	3,075.00	93,787,500	
S U M C O	200,000	1,662.00	332,400,000	
川田テクノロジーズ	8,000	5,390.00	43,120,000	
R S Technologies	7,100	3,830.00	27,193,000	
東洋製罐グループホールディングス	52,500	4,054.00	212,835,000	
ホッカンホールディングス	5,700	2,448.00	13,953,600	貸付有価証券 200株
コロナ	5,900	1,049.00	6,189,100	貸付有価証券 200株
横河ブリッジホールディングス	18,200	3,215.00	58,513,000	
三和ホールディングス	101,000	4,022.00	406,222,000	
文化シャッター	33,000	2,089.00	68,937,000	

三協立山	13,300	699.00	9,296,700	
アルインコ	8,100	1,159.00	9,387,900	
L I X I L	164,200	1,815.00	298,023,000	
ノーリツ	15,400	2,416.00	37,206,400	
長府製作所	10,500	2,106.00	22,113,000	貸付有価証券 1,000株
リンナイ	55,200	4,060.00	224,112,000	
日東精工	13,800	787.00	10,860,600	貸付有価証券 10,000株
岡部	18,900	1,035.00	19,561,500	
ジーテクト	11,800	2,036.00	24,024,800	
東プレ	18,700	2,877.00	53,799,900	
高周波熱錬	14,600	1,483.00	21,651,800	
東京製綱	6,200	1,949.00	12,083,800	
サンコール	10,400	1,191.00	12,386,400	貸付有価証券 7,600株
パイオラックス	11,300	1,775.00	20,057,500	
エイチワン	10,900	1,452.00	15,826,800	
日本発條	79,200	3,014.00	238,708,800	
中央発條	6,900	3,380.00	23,322,000	貸付有価証券 5,100株
立川ブラインド工業	4,900	2,552.00	12,504,800	
日本製鋼所	31,200	9,563.00	298,365,600	
三浦工業	48,100	3,000.00	144,300,000	
タクマ	30,700	2,881.00	88,446,700	
ツガミ	22,100	4,005.00	88,510,500	
オークマ	18,100	4,580.00	82,898,000	
芝浦機械	12,300	4,560.00	56,088,000	
アマダ	150,000	2,506.00	375,900,000	
アイダエンジニアリング	19,500	1,165.00	22,717,500	
F U J I	41,000	5,793.00	237,513,000	
牧野フライス製作所	10,400	11,660.00	121,264,000	
オーエスジー	36,600	2,894.50	105,938,700	貸付有価証券 27,600株
旭ダイヤモンド工業	24,900	1,252.00	31,174,800	貸付有価証券 18,600株
D M G 森精機	71,000	2,987.00	212,077,000	
ソディック	25,200	1,447.00	36,464,400	
ディスコ	49,600	75,620.00	3,750,752,000	
日東工器	3,700	1,879.00	6,952,300	
日進工具	8,700	941.00	8,186,700	
富士ダイス	7,600	1,279.00	9,720,400	貸付有価証券 5,700株
リケンN P R	11,800	4,190.00	49,442,000	
島精機製作所	16,500	985.00	16,252,500	

オプトラン	17,000	3,040.00	51,680,000	
イワキポンプ	6,900	2,822.00	19,471,800	
フリュー	9,800	1,199.00	11,750,200	
ヤマシンフィルタ	21,500	606.00	13,029,000	貸付有価証券 15,600株
日阪製作所	11,000	1,749.00	19,239,000	
やまびこ	16,900	3,855.00	65,149,500	
野村マイクロ・サイエンス	18,600	3,320.00	61,752,000	
平田機工	14,900	2,959.00	44,089,100	
P E G A S U S	11,400	818.00	9,325,200	
マルマエ	4,000	3,675.00	14,700,000	貸付有価証券 3,200株
タツモ	6,800	2,518.00	17,122,400	
ナブテスコ	60,400	4,868.00	294,027,200	
三井海洋開発	26,000	13,755.00	357,630,000	
レオン自動機	10,900	1,621.00	17,668,900	
S M C	29,200	76,000.00	2,219,200,000	
ホソカワミクロン	7,900	6,690.00	52,851,000	
ユニオンツール	4,600	14,500.00	66,700,000	貸付有価証券 3,300株
瑞光	8,800	971.00	8,544,800	貸付有価証券 6,600株
オイレス工業	12,700	2,648.00	33,629,600	
日精エー・エス・ビー機械	4,000	8,650.00	34,600,000	
サトー	12,900	2,460.00	31,734,000	
技研製作所	9,700	2,506.00	24,308,200	貸付有価証券 7,200株
日本エアーテック	4,900	1,297.00	6,355,300	
日精樹脂工業	6,800	908.00	6,174,400	貸付有価証券 5,000株
ワイエイシイホールディングス	10,500	1,152.00	12,096,000	
小松製作所	495,500	7,517.00	3,724,673,500	
住友重機械工業	60,800	5,815.00	353,552,000	
日立建機	41,300	6,554.00	270,680,200	
日工	15,400	864.00	13,305,600	
巴工業	12,100	2,174.00	26,305,400	
井関農機	9,700	1,988.00	19,283,600	貸付有価証券 7,000株
T O W A	37,200	2,830.00	105,276,000	
北川鉄工所	4,100	1,874.00	7,683,400	
ローツェ	60,500	3,398.00	205,579,000	
クボタ	519,800	3,132.00	1,628,013,600	
荏原実業	10,200	2,880.00	29,376,000	貸付有価証券 400株
三菱化工機	10,900	3,790.00	41,311,000	

月島ホールディングス	13,600	3,365.00	45,764,000	
帝国電機製作所	6,500	3,250.00	21,125,000	
新東工業	20,800	1,198.00	24,918,400	
澁谷工業	9,700	3,660.00	35,502,000	
アイチ コーポレーション	17,200	1,435.00	24,682,000	
小森コーポレーション	24,600	1,777.00	43,714,200	
鶴見製作所	14,600	2,188.00	31,944,800	
酒井重工業	4,100	2,263.00	9,278,300	
荏原製作所	211,200	5,680.00	1,199,616,000	
西島製作所	7,700	2,623.00	20,197,100	
A I R M A N	10,400	2,153.00	22,391,200	
ダイキン工業	134,000	20,465.00	2,742,310,000	
オルガノ	14,100	16,885.00	238,078,500	
トーヨーカネツ	7,400	3,095.00	22,903,000	
栗田工業	62,000	8,520.00	528,240,000	
椿本チエイン	44,900	2,656.00	119,254,400	
木村化工機	7,900	1,409.00	11,131,100	貸付有価証券 5,900株
アネスト岩田	17,600	1,769.00	31,134,400	
ダイフク	173,600	6,257.00	1,086,215,200	
サムコ	2,800	6,320.00	17,696,000	貸付有価証券 2,100株
タダノ	54,700	1,405.00	76,853,500	
C K D	31,000	5,500.00	170,500,000	
平和	30,400	2,003.00	60,891,200	
理想科学工業	16,600	1,285.00	21,331,000	
S A N K Y O	108,900	2,175.50	236,911,950	
日本金銭機械	12,500	1,216.00	15,200,000	
マースグループホールディングス	8,700	3,205.00	27,883,500	
ガリレイ	15,300	3,840.00	58,752,000	
ダイコク電機	4,500	2,666.00	11,997,000	貸付有価証券 1,400株
竹内製作所	18,800	7,570.00	142,316,000	
アマノ	27,300	4,041.00	110,319,300	
J U K I	16,100	718.00	11,559,800	
ジャノメ	8,300	1,435.00	11,910,500	
マックス	14,200	6,850.00	97,270,000	
グローリー	27,200	4,124.00	112,172,800	
新晃工業	29,700	1,440.00	42,768,000	
大和冷機工業	15,900	1,809.00	28,763,100	貸付有価証券 200株
セガサミーホールディングス	84,900	2,476.50	210,254,850	
T P R	23,500	1,390.00	32,665,000	
ツバキ・ナカシマ	24,000	356.00	8,544,000	

ホシザキ	66,200	5,637.00	373,169,400	
大豊工業	9,000	1,070.00	9,630,000	
日本精工	192,000	1,346.50	258,528,000	
NTN	245,300	413.30	101,382,490	
ジェイテクト	97,100	2,053.00	199,346,300	
不二越	7,700	5,280.00	40,656,000	貸付有価証券 5,500株
日本トムソン	28,200	1,079.00	30,427,800	
THK	54,900	5,178.00	284,272,200	
YUSHIN	9,600	764.00	7,334,400	
前澤給装工業	7,400	1,698.00	12,565,200	
イーグル工業	11,500	3,470.00	39,905,000	
PILLAR	9,600	8,170.00	78,432,000	
キッツ	34,600	2,202.00	76,189,200	貸付有価証券 200株
マキタ	128,000	6,042.00	773,376,000	
三井E&S	51,000	7,729.00	394,179,000	
カナデピア	85,000	1,065.00	90,525,000	
三菱重工業	1,927,200	4,811.00	9,271,759,200	
IHI	536,000	4,133.00	2,215,288,000	
キオクシアホールディングス	61,700	22,270.00	1,374,059,000	
日清紡ホールディングス	78,000	1,760.00	137,280,000	
イビデン	128,800	9,884.00	1,273,059,200	
コニカミノルタ	231,900	593.40	137,609,460	
ブラザー工業	127,700	3,144.00	401,488,800	
ミネベアミツミ	179,000	3,319.00	594,101,000	
日立製作所	2,617,200	4,813.00	12,596,583,600	
三菱電機	1,126,700	5,916.00	6,665,557,200	
富士電機	73,900	13,130.00	970,307,000	
安川電機	111,700	5,097.00	569,334,900	
シンフォニアテクノロジー	11,300	12,130.00	137,069,000	
明電舎	19,100	7,570.00	144,587,000	
山洋電気	11,900	5,050.00	60,095,000	
デンヨー	7,600	3,855.00	29,298,000	
PHCホールディングス	19,600	1,057.00	20,717,200	貸付有価証券 13,600株
KOKUSAI ELECTRIC	117,900	6,373.00	751,376,700	
ソシオネクスト	89,100	1,945.50	173,344,050	
東芝テック	13,200	3,205.00	42,306,000	
芝浦メカトロニクス	6,400	27,080.00	173,312,000	
マブチモーター	100,200	1,850.50	185,420,100	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,000	339.00	2,373,000	貸付有価証券 5,300株

トレックス・セミコンダクター	5,000	1,732.00	8,660,000	貸付有価証券 2,800株
東光高岳	5,700	5,660.00	32,262,000	
ダイヘン	9,700	14,860.00	144,142,000	
ヤーマン	20,400	705.00	14,382,000	貸付有価証券 14,800株
JVCケンウッド	82,000	1,271.00	104,222,000	貸付有価証券 8,400株
ミマキエンジニアリング	8,700	1,844.00	16,042,800	
大崎電気工業	19,700	1,685.00	33,194,500	
オムロン	86,400	5,290.00	457,056,000	
日東工業	12,300	4,705.00	57,871,500	
I D E C	13,100	3,305.00	43,295,500	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	42,100	5,402.00	227,424,200	
B U F F A L O	2,000	5,170.00	10,340,000	貸付有価証券 1,500株
テクノメディカ	2,100	2,544.00	5,342,400	貸付有価証券 1,000株
日本電気	675,400	3,673.00	2,480,744,200	
富士通	946,500	3,313.00	3,135,754,500	
沖電気工業	50,200	3,015.00	151,353,000	
電気興業	4,200	3,315.00	13,923,000	
サンケン電気	10,600	7,492.00	79,415,200	
アイホン	5,400	2,914.00	15,735,600	
ルネサスエレクトロニクス	997,400	2,839.00	2,831,618,600	
セイコーエプソン	129,100	2,099.00	270,980,900	
ワコム	61,900	847.00	52,429,300	
アルバック	26,300	10,595.00	278,648,500	
アクセル	5,300	1,239.00	6,566,700	
E I Z O	13,500	2,278.00	30,753,000	
日本信号	23,600	1,721.00	40,615,600	
京三製作所	24,100	786.00	18,942,600	
能美防災	14,100	4,335.00	61,123,500	
ホーチキ	8,100	6,050.00	49,005,000	
エレコム	24,900	1,765.00	43,948,500	
パナソニック ホールディングス	1,215,200	2,459.00	2,988,176,800	
シャープ	123,800	617.20	76,409,360	
アンリツ	67,300	2,884.00	194,093,200	
ソニーグループ	3,513,000	3,306.00	11,613,978,000	
T D K	888,400	2,370.00	2,105,508,000	
帝国通信工業	4,600	2,836.00	13,045,600	
タムラ製作所	41,300	724.00	29,901,200	
アルプスアルパイン	84,300	2,355.50	198,568,650	
日本電波工業	9,900	1,251.00	12,384,900	

鈴木	5,600	3,060.00	17,136,000	
メイコー	9,200	21,650.00	199,180,000	
日本トリム	2,400	5,030.00	12,072,000	
フォスター電機	9,500	3,110.00	29,545,000	
S M K	2,500	3,560.00	8,900,000	
ヨコオ	9,300	3,335.00	31,015,500	
ホシデン	20,700	2,891.00	59,843,700	貸付有価証券 15,200株
ヒロセ電機	15,000	22,405.00	336,075,000	
日本航空電子工業	24,100	2,644.00	63,720,400	
T O A	10,500	1,817.00	19,078,500	
マクセル	19,900	2,272.00	45,212,800	
古野電気	13,400	8,010.00	107,334,000	貸付有価証券 10,000株
スミダコーポレーション	14,600	1,229.00	17,943,400	
アイコム	4,000	3,200.00	12,800,000	貸付有価証券 700株
リオン	4,300	3,055.00	13,136,500	
横河電機	112,500	5,754.00	647,325,000	
新電元工業	4,000	3,985.00	15,940,000	
アズビル	247,400	1,368.00	338,443,200	
日本光電工業	84,700	1,668.00	141,279,600	
チノー	8,500	1,729.00	14,696,500	貸付有価証券 4,800株
日本電子材料	6,300	9,050.00	57,015,000	
堀場製作所	19,500	19,475.00	379,762,500	
アドバンテスト	320,900	26,620.00	8,542,358,000	
エスベック	9,200	3,910.00	35,972,000	
キーエンス	101,900	63,740.00	6,495,106,000	
日置電機	5,400	7,540.00	40,716,000	
シスメックス	263,800	1,362.50	359,427,500	
日本マイクロニクス	16,900	12,340.00	208,546,000	
メガチップス	7,100	9,150.00	64,965,000	
O B A R A G R O U P	5,600	5,420.00	30,352,000	貸付有価証券 4,200株
コーセル	12,800	1,312.00	16,793,600	
イリソ電子工業	8,400	3,735.00	31,374,000	
オブテックスグループ	17,500	3,020.00	52,850,000	
千代田インテグレ	3,200	3,345.00	10,704,000	
レーザーテック	43,000	31,920.00	1,372,560,000	
スタンレー電気	52,200	3,252.00	169,754,400	
ウシオ電機	42,300	3,136.00	132,652,800	
日本セラミック	8,400	3,825.00	32,130,000	
山一電機	10,000	8,880.00	88,800,000	

図研	8,500	4,480.00	38,080,000	
日本電子	23,800	6,611.00	157,341,800	
カシオ計算機	82,100	1,622.00	133,166,200	
ファナック	486,400	6,542.00	3,182,028,800	
日本シイエムケイ	30,500	627.00	19,123,500	
エンプラス	3,000	14,700.00	44,100,000	
大真空	11,400	685.00	7,809,000	貸付有価証券 7,200株
ローム	200,000	2,736.00	547,200,000	
浜松ホトニクス	170,300	1,939.00	330,211,700	
三井ハイテック	52,800	820.00	43,296,000	貸付有価証券 39,900株
京セラ	632,800	2,710.00	1,714,888,000	
太陽誘電	54,600	4,972.00	271,471,200	
村田製作所	971,900	4,045.00	3,931,335,500	
双葉電子工業	19,800	724.00	14,335,200	
ニチコン	24,300	2,189.00	53,192,700	
日本ケミコン	12,700	1,775.00	22,542,500	
K O A	15,900	1,994.00	31,704,600	
市光工業	19,500	570.00	11,115,000	
小糸製作所	106,400	2,759.00	293,557,600	
ミツバ	19,200	1,355.00	26,016,000	貸付有価証券 1,000株
S C R E E Nホールディングス	36,300	21,725.00	788,617,500	
キヤノン	457,100	4,657.00	2,128,714,700	
リコー	238,700	1,440.50	343,847,350	
象印マホービン	28,000	1,595.00	44,660,000	貸付有価証券 20,400株
東京エレクトロン	215,500	44,380.00	9,563,890,000	
イノテック	7,400	2,804.00	20,749,600	
トヨタ紡織	50,000	3,143.00	157,150,000	
ユニプレス	17,300	1,488.00	25,742,400	
豊田自動織機	86,900	20,200.00	1,755,380,000	
モリタホールディングス	16,200	2,929.00	47,449,800	
三櫻工業	14,200	871.00	12,368,200	
デンソー	997,700	2,223.00	2,217,887,100	
東海理化電機製作所	27,400	3,315.00	90,831,000	
川崎重工業	76,700	17,195.00	1,318,856,500	
名村造船所	31,700	5,510.00	174,667,000	
日本車輛製造	3,800	4,250.00	16,150,000	
日産自動車	1,555,800	436.20	678,639,960	
いすゞ自動車	271,700	2,827.00	768,095,900	
トヨタ自動車	5,413,600	3,656.00	19,792,121,600	
日野自動車	154,400	440.00	67,936,000	

三菱自動車工業	392,500	414.70	162,769,750	
武蔵精密工業	22,500	2,498.00	56,205,000	
日産車体	15,600	1,066.00	16,629,600	貸付有価証券 11,700株
新明和工業	29,600	2,620.00	77,552,000	
極東開発工業	16,800	3,540.00	59,472,000	
トピー工業	7,300	3,595.00	26,243,500	
ティラド	2,000	11,170.00	22,340,000	
曙ブレーキ工業	62,700	144.00	9,028,800	
タチエス	18,900	2,317.00	43,791,300	
NOK	39,900	3,307.00	131,949,300	貸付有価証券 29,000株
フタバ産業	27,300	1,134.00	30,958,200	
カヤバ	17,400	5,250.00	91,350,000	
大同メタル工業	20,100	1,159.00	23,295,900	
プレス工業	38,400	975.00	37,440,000	
アイシン	260,200	2,681.00	697,596,200	
マツダ	336,900	1,309.50	441,170,550	
本田技研工業	2,211,800	1,543.00	3,412,807,400	
スズキ	748,200	2,252.50	1,685,320,500	
S U B A R U	307,100	2,916.50	895,657,150	
ヤマハ発動機	504,000	1,220.00	614,880,000	
エクセディ	16,800	6,080.00	102,144,000	
豊田合成	34,000	5,018.00	170,612,000	
愛三工業	16,900	2,248.00	37,991,200	
ヨロズ	10,600	1,085.00	11,501,000	貸付有価証券 6,900株
エフ・シー・シー	19,800	3,815.00	75,537,000	
シマノ	43,400	16,715.00	725,431,000	
テイ・エス テック	38,100	1,999.00	76,161,900	
リガク・ホールディングス	61,700	1,797.00	110,874,900	貸付有価証券 45,000株
北里コーポレーション	8,100	1,497.00	12,125,700	
テルモ	676,600	1,969.50	1,332,563,700	
日機装	23,900	2,385.00	57,001,500	
日本エム・ディ・エム	8,100	566.00	4,584,600	
島津製作所	135,300	4,225.00	571,642,500	
J M S	9,500	444.00	4,218,000	
長野計器	6,700	3,090.00	20,703,000	
ブイ・テクノロジー	5,000	4,400.00	22,000,000	
東京計器	8,500	8,720.00	74,120,000	貸付有価証券 6,200株
愛知時計電機	4,900	3,225.00	15,802,500	
インターアクション	6,200	1,468.00	9,101,600	貸付有価証券 3,900株

東京精密	19,300	17,035.00	328,775,500	
マニー	41,100	1,653.00	67,938,300	
ニコン	127,000	1,974.50	250,761,500	
オリンパス	551,900	1,441.00	795,287,900	
理研計器	14,500	3,435.00	49,807,500	
タムロン	52,500	1,031.00	54,127,500	貸付有価証券 900株
H O Y A	196,000	29,100.00	5,703,600,000	
ノーリツ鋼機	28,900	2,201.00	63,608,900	
A & D ホロンホールディングス	12,800	2,751.00	35,212,800	
朝日インテック	124,100	3,142.00	389,922,200	
シチズン時計	84,300	1,763.00	148,620,900	
メニコン	38,300	1,893.00	72,501,900	
松風	9,200	1,825.00	16,790,000	
セイコーグループ	14,200	11,940.00	169,548,000	
ニプロ	85,600	1,561.50	133,664,400	
三井松島ホールディングス	17,400	1,492.00	25,960,800	
テクセンドフォトマスク	28,400	2,943.00	83,581,200	
トランザクション	11,000	1,348.00	14,828,000	貸付有価証券 8,200株
ニホンフラッシュ	8,700	862.00	7,499,400	貸付有価証券 6,100株
前田工織	20,900	2,102.00	43,931,800	
アートネイチャー	10,600	817.00	8,660,200	
フルヤ金属	8,800	7,910.00	69,608,000	
バンダイナムコホールディングス	272,300	4,015.00	1,093,284,500	
S H O E I	26,800	1,714.00	45,935,200	
フランスベッドホールディングス	13,300	1,366.00	18,167,800	貸付有価証券 10,200株
パイロットコーポレーション	15,700	4,971.00	78,044,700	
萩原工業	6,900	1,828.00	12,613,200	貸付有価証券 5,100株
フジシールインターナショナル	20,600	2,769.00	57,041,400	
タカラトミー	49,900	2,749.00	137,175,100	
広済堂ホールディングス	33,000	474.00	15,642,000	貸付有価証券 24,200株
プロネクサス	10,600	1,177.00	12,476,200	
T O P P A Nホールディングス	123,500	4,847.00	598,604,500	
大日本印刷	219,700	3,156.00	693,373,200	
共同印刷	11,600	1,701.00	19,731,600	
N I S S H A	18,100	1,341.00	24,272,100	
T A K A R A & C O M P A N Y	5,600	3,960.00	22,176,000	
アシックス	391,600	4,798.00	1,878,896,800	
ツツミ	2,200	2,959.00	6,509,800	
ローランド	7,800	4,035.00	31,473,000	

小松ウオール工業	6,800	2,956.00	20,100,800	
ヤマハ	173,800	1,187.50	206,387,500	
河合楽器製作所	3,100	3,010.00	9,331,000	
クリナップ	10,100	1,050.00	10,605,000	
ピジョン	60,700	1,705.00	103,493,500	
キングジム	9,100	822.00	7,480,200	貸付有価証券 6,700株
リンテック	22,100	5,340.00	118,014,000	
イトーキ	21,100	3,300.00	69,630,000	
任天堂	642,900	8,541.00	5,491,008,900	
三菱鉛筆	13,800	2,333.00	32,195,400	貸付有価証券 10,300株
タカラスタンダード	23,200	3,070.00	71,224,000	
コクヨ	213,300	899.80	191,927,340	
ナカバヤシ	11,100	628.00	6,970,800	
グローブライド	10,100	2,345.00	23,684,500	
オカムラ	30,900	2,589.00	80,000,100	
美津濃	27,300	4,055.00	110,701,500	
グリムス	3,600	2,670.00	9,612,000	
東京電力ホールディングス	918,000	686.10	629,839,800	貸付有価証券 672,900株
中部電力	375,300	2,600.00	975,780,000	
関西電力	552,000	2,751.00	1,518,552,000	
中国電力	178,400	1,071.00	191,066,400	
北陸電力	105,000	1,085.00	113,925,000	
東北電力	268,100	1,294.00	346,921,400	
四国電力	95,600	1,764.00	168,638,400	
九州電力	234,800	1,935.50	454,455,400	
北海道電力	114,800	1,186.50	136,210,200	貸付有価証券 86,600株
沖縄電力	26,200	1,193.00	31,256,600	
電源開発	77,300	3,652.00	282,299,600	
エフオン	7,500	343.00	2,572,500	
イーレックス	20,000	691.00	13,820,000	貸付有価証券 15,400株
レノバ	28,000	730.00	20,440,000	
東京瓦斯	183,700	7,625.00	1,400,712,500	
大阪瓦斯	181,800	6,467.00	1,175,700,600	
東邦瓦斯	37,700	5,608.00	211,421,600	
北海道瓦斯	30,600	893.00	27,325,800	
広島ガス	21,700	382.00	8,289,400	貸付有価証券 5,000株
西部ガスホールディングス	10,700	2,560.00	27,392,000	貸付有価証券 7,800株

静岡ガス	23,400	1,471.00	34,421,400	貸付有価証券 400株
メタウォーター	13,600	4,130.00	56,168,000	
SBSホールディングス	9,200	4,270.00	39,284,000	
東武鉄道	107,300	3,124.00	335,205,200	
相鉄ホールディングス	39,200	2,951.00	115,679,200	
東急	261,800	1,936.00	506,844,800	
京浜急行電鉄	115,500	1,558.00	179,949,000	
小田急電鉄	154,400	1,756.50	271,203,600	
京王電鉄	45,600	4,175.00	190,380,000	
京成電鉄	178,700	1,325.50	236,866,850	
富士急行	12,600	2,308.00	29,080,800	貸付有価証券 200株
東日本旅客鉄道	561,600	3,828.00	2,149,804,800	
西日本旅客鉄道	242,900	3,306.00	803,027,400	
東海旅客鉄道	431,500	4,630.00	1,997,845,000	貸付有価証券 108,800株
東京地下鉄	162,200	1,693.50	274,685,700	貸付有価証券 122,200株
西武ホールディングス	110,900	4,592.00	509,252,800	
鴻池運輸	17,500	3,555.00	62,212,500	
西日本鉄道	29,700	3,183.00	94,535,100	
ハマキョウレックス	31,900	1,955.00	62,364,500	
サカイ引越センター	13,000	2,933.00	38,129,000	
近鉄グループホールディングス	108,900	3,332.00	362,854,800	
阪急阪神ホールディングス	134,900	4,536.00	611,906,400	
南海電気鉄道	48,600	3,059.00	148,667,400	
京阪ホールディングス	53,300	3,435.00	183,085,500	
神戸電鉄	2,800	2,538.00	7,106,400	貸付有価証券 2,000株
名古屋鉄道	113,300	1,828.50	207,169,050	
山陽電気鉄道	7,700	2,047.00	15,761,900	貸付有価証券 5,700株
ヤマトホールディングス	123,600	1,851.50	228,845,400	
山九	23,400	9,820.00	229,788,000	
丸全昭和運輸	6,300	9,550.00	60,165,000	
センコーグループホールディングス	73,600	1,921.00	141,385,600	
ニッコンホールディングス	43,400	3,905.00	169,477,000	貸付有価証券 32,700株
福山通運	11,000	5,580.00	61,380,000	
セイノーホールディングス	50,400	2,624.50	132,274,800	
神奈川中央交通	2,900	3,665.00	10,628,500	貸付有価証券 2,100株
AZ-COM丸和ホールディングス	31,800	947.00	30,114,600	
九州旅客鉄道	76,600	3,940.00	301,804,000	

S Gホールディングス	172,100	1,553.00	267,271,300	貸付有価証券 128,800株
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	101,800	3,846.00	391,522,800	
日本郵船	214,900	5,253.00	1,128,869,700	
商船三井	193,500	5,505.00	1,065,217,500	
川崎汽船	219,100	2,425.00	531,317,500	貸付有価証券 1,800株
N Sユナイテッド海運	6,400	7,770.00	49,728,000	
飯野海運	37,600	1,646.00	61,889,600	
乾汽船	13,000	1,616.00	21,008,000	
日本航空	233,100	3,125.00	728,437,500	
A N Aホールディングス	276,600	3,331.00	921,354,600	貸付有価証券 208,700株
三菱倉庫	115,400	1,389.50	160,348,300	
三井倉庫ホールディングス	31,700	3,449.00	109,333,300	
住友倉庫	29,900	3,935.00	117,656,500	
澁澤倉庫	16,200	1,406.00	22,777,200	
日本トランスシティ	25,600	1,351.00	34,585,600	
中央倉庫	6,000	1,713.00	10,278,000	
安田倉庫	7,000	2,558.00	17,906,000	貸付有価証券 5,200株
上組	45,000	5,695.00	256,275,000	
キューソー流通システム	5,800	3,165.00	18,357,000	貸付有価証券 4,200株
エーアイティー	6,400	2,311.00	14,790,400	
M I X I	19,200	2,595.00	49,824,000	
クロスキャット	5,900	988.00	5,829,200	
システナ	147,200	410.00	60,352,000	
デジタルアーツ	5,400	5,340.00	28,836,000	
日鉄ソリューションズ	27,900	3,760.00	104,904,000	貸付有価証券 21,000株
キューブシステム	5,500	1,086.00	5,973,000	貸付有価証券 4,000株
コア	4,600	2,213.00	10,179,800	貸付有価証券 3,200株
ディー・エヌ・エー	42,200	2,585.50	109,108,100	
手間いらず	1,500	2,851.00	4,276,500	
ラクーンホールディングス	7,700	648.00	4,989,600	貸付有価証券 5,700株
ソリトンシステムズ	5,300	1,857.00	9,842,100	
ソフトクリエイイトホールディングス	7,400	2,020.00	14,948,000	
T I S	108,000	2,924.00	315,792,000	
グリーホールディングス	34,500	382.00	13,179,000	
G M Oペパボ	1,300	2,003.00	2,603,900	貸付有価証券 900株

コーエーテクモホールディングス	64,000	1,687.00	107,968,000	
三菱総合研究所	4,900	4,760.00	23,324,000	
ファインデックス	7,200	811.00	5,839,200	
K L a b	27,800	307.00	8,534,600	貸付有価証券 20,700株
ポールトゥウィンホールディングス	14,700	315.00	4,630,500	
ネクソン	251,500	3,117.00	783,925,500	
アイスタイル	35,800	462.00	16,539,600	貸付有価証券 26,200株
エムアップホールディングス	25,200	677.00	17,060,400	
エイチームホールディングス	7,100	1,008.00	7,156,800	貸付有価証券 5,400株
セルシス	13,900	1,296.00	18,014,400	
エニグモ	11,500	406.00	4,669,000	貸付有価証券 8,400株
コロブラ	35,000	425.00	14,875,000	
ブロードリーフ	37,600	658.00	24,740,800	
デジタルハーツホールディングス	7,300	850.00	6,205,000	貸付有価証券 4,800株
メディアドゥ	3,500	1,661.00	5,813,500	
じげん	25,400	424.00	10,769,600	貸付有価証券 19,500株
フィックスターズ	14,200	1,415.00	20,093,000	貸付有価証券 10,500株
オブティム	10,600	456.00	4,833,600	貸付有価証券 7,900株
セレス	4,700	1,522.00	7,153,400	貸付有価証券 3,400株
S H I F T	92,400	591.50	54,654,600	
セック	3,500	3,770.00	13,195,000	貸付有価証券 2,600株
テクマトリックス	20,300	1,815.00	36,844,500	
プロシップ	8,100	1,398.00	11,323,800	貸付有価証券 6,000株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	21,900	2,510.00	54,969,000	
GMOペイメントゲートウェイ	20,600	7,489.00	154,273,400	
システムリサーチ	7,100	1,771.00	12,574,100	
インターネットイニシアティブ	56,400	2,147.00	121,090,800	
さくらインターネット	14,400	2,919.00	42,033,600	貸付有価証券 10,800株
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,100	2,060.00	6,386,000	貸付有価証券 1,500株
S R Aホールディングス	5,900	4,935.00	29,116,500	
朝日ネット	11,100	686.00	7,614,600	貸付有価証券 200株
e B A S E	14,500	416.00	6,032,000	
アバントグループ	14,500	1,371.00	19,879,500	
アドソル日進	8,300	1,742.00	14,458,600	

フリービット	5,400	1,536.00	8,294,400	貸付有価証券 2,400株
コムチュア	13,600	1,424.00	19,366,400	
アステリア	8,100	1,145.00	9,274,500	貸付有価証券 6,000株
アイル	5,800	2,316.00	13,432,800	
マークライnz	6,100	1,623.00	9,900,300	
g u m i	19,000	321.00	6,099,000	貸付有価証券 14,100株
テラスカイ	4,000	1,848.00	7,392,000	貸付有価証券 2,800株
デジタル・インフォメーション・テクノロ ジー	12,000	1,008.00	12,096,000	
ネオジャパン	2,700	1,705.00	4,603,500	
P R T I M E S	2,100	2,340.00	4,914,000	
ラクス	96,900	727.70	70,514,130	貸付有価証券 20,000株
ダブルスタンダード	3,700	1,462.00	5,409,400	
オープンドア	7,200	353.00	2,541,600	貸付有価証券 4,400株
アカツキ	5,000	3,035.00	15,175,000	
U b i c o mホールディングス	3,300	948.00	3,128,400	
カナミックネットワーク	13,000	526.00	6,838,000	
チェンジホールディングス	19,700	919.00	18,104,300	貸付有価証券 14,800株
オークネット	9,500	2,249.00	21,365,500	
オロ	4,300	1,926.00	8,281,800	貸付有価証券 3,200株
ユーザーローカル	5,000	1,521.00	7,605,000	
P K S H A T e c h n o l o g y	12,300	2,735.00	33,640,500	貸付有価証券 9,100株
マネーフォワード	23,500	2,763.50	64,942,250	貸付有価証券 17,500株
G M Oフィナンシャルゲート	1,700	4,980.00	8,466,000	
S u n A s t e r i s k	7,600	402.00	3,055,200	貸付有価証券 5,800株
プラスアルファ・コンサルティング	13,100	2,028.00	26,566,800	
電算システムホールディングス	4,600	2,950.00	13,570,000	貸付有価証券 3,300株
A p p i e r G r o u p	39,400	664.00	26,161,600	貸付有価証券 29,400株
ビジョナル	12,300	6,347.00	78,068,100	
ハイマックス	3,200	1,270.00	4,064,000	
野村総合研究所	199,200	3,561.00	709,351,200	
日本システム技術	9,500	1,942.00	18,449,000	
インテージホールディングス	6,900	1,648.00	11,371,200	貸付有価証券 5,100株

東邦システムサイエンス	4,500	1,132.00	5,094,000	貸付有価証券 3,300株
ソースネクスト	53,500	127.00	6,794,500	貸付有価証券 40,000株
シンプレクス・ホールディングス	81,600	764.00	62,342,400	
HEROZ	4,100	761.00	3,120,100	貸付有価証券 3,000株
ラクスル	20,500	1,898.00	38,909,000	
メルカリ	43,900	3,400.00	149,260,000	
I P S	3,000	3,125.00	9,375,000	
システムサポートホールディングス	7,200	1,200.00	8,640,000	
ボードルア	5,500	1,718.00	9,449,000	貸付有価証券 4,000株
N E	5,200	680.00	3,536,000	貸付有価証券 3,700株
イーソル	6,900	546.00	3,767,400	貸付有価証券 5,000株
ウイングアーク1st	10,800	2,550.00	27,540,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	941.00	3,858,100	
サーバーワークス	1,800	1,795.00	3,231,000	貸付有価証券 1,300株
S a n s a n	29,200	1,023.00	29,871,600	貸付有価証券 400株
ギフトィ	8,000	951.00	7,608,000	
メドレー	11,700	1,958.00	22,908,600	貸付有価証券 9,000株
ベース	4,300	3,195.00	13,738,500	
J M D C	14,900	3,900.00	58,110,000	
フォーカスシステムズ	6,900	1,644.00	11,343,600	
クレスコ	16,100	1,509.00	24,294,900	
フジ・メディア・ホールディングス	80,300	3,415.00	274,224,500	貸付有価証券 60,500株
オービック	189,700	3,768.00	714,789,600	
ジャストシステム	14,800	3,825.00	56,610,000	
T D C ソフト	17,400	1,011.00	17,591,400	
L I N E ヤフー	1,572,600	365.60	574,942,560	
トレンドマイクロ	59,000	4,906.00	289,454,000	
I D ホールディングス	6,600	1,922.00	12,685,200	
日本オラクル	19,500	8,791.00	171,424,500	
アルファシステムズ	3,200	3,620.00	11,584,000	貸付有価証券 2,000株
フューチャー	22,000	1,743.00	38,346,000	
C A C H o l d i n g s	6,300	1,899.00	11,963,700	
オービックビジネスコンサルタント	17,400	5,626.00	97,892,400	
アイティフォー	10,600	1,687.00	17,882,200	

東計電算	2,900	4,295.00	12,455,500	貸付有価証券 2,100株
大塚商会	115,800	2,964.00	343,231,200	
サイボウズ	14,200	2,046.00	29,053,200	貸付有価証券 1,000株
電通総研	37,500	1,779.00	66,712,500	
デジタルガレージ	14,500	1,891.00	27,419,500	
E Mシステムズ	13,600	697.00	9,479,200	貸付有価証券 10,100株
ウェザーニューズ	7,800	4,210.00	32,838,000	貸付有価証券 5,800株
C I J	27,400	503.00	13,782,200	貸付有価証券 100株
ビジネスエンジニアリング	12,000	1,309.00	15,708,000	貸付有価証券 8,500株
WOWOW	7,800	1,327.00	10,350,600	貸付有価証券 5,500株
スカラ	9,600	363.00	3,484,800	貸付有価証券 7,200株
ANYCOLOR	16,300	3,815.00	62,184,500	貸付有価証券 5,600株
日本ビジネスシステムズ	5,500	1,489.00	8,189,500	
システムソフト	36,000	57.00	2,052,000	貸付有価証券 26,700株
アルゴグラフィックス	33,800	1,541.00	52,085,800	
マーベラス	19,100	505.00	9,645,500	
エイベックス	17,500	1,189.00	20,807,500	
B I P R O G Y	34,800	4,378.00	152,354,400	
都築電気	5,800	3,965.00	22,997,000	
T B S ホールディングス	50,500	5,703.00	288,001,500	
日本テレビホールディングス	90,400	3,249.00	293,709,600	
朝日放送グループホールディングス	10,800	842.00	9,093,600	
テレビ朝日ホールディングス	25,000	3,250.00	81,250,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	68,000	2,846.00	193,528,000	
テレビ東京ホールディングス	6,400	4,305.00	27,552,000	
ビジョン	16,100	1,290.00	20,769,000	貸付有価証券 600株
U - N E X T H O L D I N G S	34,600	1,834.00	63,456,400	貸付有価証券 25,800株
日本通信	82,900	136.00	11,274,400	
N T T	28,044,200	150.80	4,229,065,360	
K D D I	1,435,400	2,620.00	3,760,748,000	
ソフトバンク	16,420,300	209.00	3,431,842,700	
光通信	10,100	41,100.00	415,110,000	
エムティーアイ	7,000	671.00	4,697,000	
G M O インターネットグループ	33,300	2,816.00	93,772,800	
ファイバーゲート	4,000	674.00	2,696,000	

KADOKAWA	56,700	2,728.50	154,705,950	
学研ホールディングス	18,900	1,039.00	19,637,100	
ゼンリン	15,300	1,017.00	15,560,100	
松竹	5,900	11,650.00	68,735,000	貸付有価証券 4,200株
東宝	53,600	7,648.00	409,932,800	
東映	17,000	5,120.00	87,040,000	
ピー・シー・エー	6,800	1,951.00	13,266,800	
ビジネスブレイン太田昭和	3,700	3,010.00	11,137,000	
D T S	81,200	1,090.00	88,508,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	168,000	2,438.00	409,584,000	
シーイーシー	12,500	1,901.00	23,762,500	
カプコン	203,000	3,115.00	632,345,000	
アイ・エス・ビー	4,800	1,876.00	9,004,800	
N S W	4,600	2,385.00	10,971,000	
アイネス	8,000	2,000.00	16,000,000	
T K C	16,100	3,970.00	63,917,000	
N S D	36,000	2,750.00	99,000,000	
コナミグループ	43,700	18,435.00	805,609,500	
福井コンピュータホールディングス	5,500	3,345.00	18,397,500	
J B C Cホールディングス	27,300	1,263.00	34,479,900	
ミロク情報サービス	8,700	1,735.00	15,094,500	
ソフトバンクグループ	1,958,400	4,096.00	8,021,606,400	
リョーサン菱洋ホールディングス	20,600	3,310.00	68,186,000	
高千穂交易	8,600	2,119.00	18,223,400	貸付有価証券 6,300株
伊藤忠食品	2,400	12,080.00	28,992,000	
あらた	16,600	3,060.00	50,796,000	
トーメンデバイス	1,600	13,790.00	22,064,000	貸付有価証券 1,100株
東京エレクトロン デバイス	10,800	3,610.00	38,988,000	
円谷フィールズホールディングス	19,900	1,473.00	29,312,700	
双日	104,000	6,700.00	696,800,000	
アルフレッサ ホールディングス	102,000	2,594.00	264,588,000	
横浜冷凍	27,300	1,445.00	39,448,500	
ラサ商事	5,400	2,328.00	12,571,200	
アルコニックス	15,500	3,125.00	48,437,500	
神戸物産	93,800	3,758.00	352,500,400	
あい ホールディングス	19,600	2,851.00	55,879,600	
ダイワボウホールディングス	40,400	3,013.00	121,725,200	
マクニカホールディングス	75,000	2,617.00	196,275,000	
ラクト・ジャパン	4,600	3,730.00	17,158,000	貸付有価証券 3,400株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,900	1,433.00	21,351,700	

八洲電機	8,100	3,475.00	28,147,500	
メディアスホールディングス	7,000	816.00	5,712,000	貸付有価証券 5,200株
レスター	9,200	3,175.00	29,210,000	
T O K A Iホールディングス	59,000	1,210.00	71,390,000	
三洋貿易	12,700	1,862.00	23,647,400	
ビューティガレージ	2,900	1,449.00	4,202,100	
ウイン・パートナーズ	7,900	1,457.00	11,510,300	貸付有価証券 5,900株
シップヘルスケアホールディングス	39,800	2,668.00	106,186,400	
明治電機工業	4,700	2,482.00	11,665,400	
コメダホールディングス	26,400	2,917.00	77,008,800	
アセンテック	4,300	1,261.00	5,422,300	
ユニソルホールディングス	8,900	2,327.00	20,710,300	貸付有価証券 6,600株
ヤマエグループホールディングス	10,600	3,100.00	32,860,000	
小野建	11,600	1,487.00	17,249,200	
佐島電機	6,900	2,002.00	13,813,800	貸付有価証券 3,500株
伯東	5,700	4,440.00	25,308,000	
コンドーテック	8,300	1,535.00	12,740,500	
ナガイレーベン	13,700	1,779.00	24,372,300	
松田産業	8,300	7,460.00	61,918,000	
第一興商	35,600	1,712.50	60,965,000	
メディバルホールディングス	116,900	2,963.00	346,374,700	
S P K	4,400	2,732.00	12,020,800	
萩原電気ホールディングス	4,700	3,925.00	18,447,500	貸付有価証券 3,200株
アズワン	34,400	2,222.00	76,436,800	
スズデン	4,400	1,787.00	7,862,800	
シモジマ	7,300	1,476.00	10,774,800	貸付有価証券 5,600株
ドウシシャ	12,800	3,620.00	46,336,000	
高速	6,400	3,395.00	21,728,000	
たけびし	4,600	2,509.00	11,541,400	
リックス	2,500	3,870.00	9,675,000	
丸文	9,700	1,261.00	12,231,700	
ハピネット	14,600	2,923.00	42,675,800	貸付有価証券 4,000株
橋本総業ホールディングス	4,300	1,404.00	6,037,200	貸付有価証券 1,600株
日本ライフライン	27,400	1,485.00	40,689,000	
タカショー	8,800	399.00	3,511,200	貸付有価証券 6,300株
I D O M	32,600	1,480.00	48,248,000	貸付有価証券 24,500株

進和	6,400	3,340.00	21,376,000	
ダイترون	9,000	2,922.00	26,298,000	
シークス	15,900	1,419.00	22,562,100	貸付有価証券 11,900株
オーハシテクニカ	10,200	1,258.00	12,831,600	
白銅	3,000	2,639.00	7,917,000	貸付有価証券 2,200株
伊藤忠商事	3,621,500	2,192.50	7,940,138,750	
丸紅	822,200	5,798.00	4,767,115,600	
長瀬産業	46,400	4,795.00	222,488,000	
蝶理	5,800	4,525.00	26,245,000	
豊田通商	323,600	6,969.00	2,255,168,400	
三共生興	14,100	895.00	12,619,500	
兼松	90,800	2,332.00	211,745,600	
三井物産	1,549,200	5,555.00	8,605,806,000	
日本紙パルプ商事	51,900	1,116.00	57,920,400	
カメイ	10,100	3,360.00	33,936,000	
スターゼン	22,500	1,374.00	30,915,000	
山善	32,700	1,531.00	50,063,700	貸付有価証券 24,600株
椿本興業	6,000	3,080.00	18,480,000	貸付有価証券 4,400株
住友商事	645,900	6,327.00	4,086,609,300	
内田洋行	20,000	2,024.00	40,480,000	
三菱商事	2,148,100	5,132.00	11,024,049,200	
第一実業	10,100	3,550.00	35,855,000	
キヤノンマーケティングジャパン	25,600	6,869.00	175,846,400	
西華産業	15,600	2,821.00	44,007,600	
佐藤商事	7,500	2,462.00	18,465,000	
東京産業	11,000	1,003.00	11,033,000	
ユアサ商事	9,300	6,340.00	58,962,000	
神鋼商事	7,100	2,743.00	19,475,300	
阪和興業	17,900	8,830.00	158,057,000	
正栄食品工業	7,200	4,110.00	29,592,000	貸付有価証券 5,400株
カナデン	7,800	2,310.00	18,018,000	貸付有価証券 5,600株
RYODEN	8,300	3,580.00	29,714,000	
岩谷産業	107,900	1,942.50	209,595,750	
極東貿易	6,200	2,163.00	13,410,600	
アステナホールディングス	20,500	504.00	10,332,000	貸付有価証券 13,700株
三愛オブリ	25,300	2,462.00	62,288,600	
稲畑産業	24,500	4,310.00	105,595,000	
G S I クレオス	5,800	2,748.00	15,938,400	

明和産業	15,500	935.00	14,492,500	貸付有価証券 11,600株
ワキタ	16,000	2,133.00	34,128,000	貸付有価証券 2,100株
東邦ホールディングス	30,600	4,759.00	145,625,400	
サンゲツ	27,300	3,330.00	90,909,000	
ミツウロコグループホールディングス	13,100	2,332.00	30,549,200	
シナネンホールディングス	2,300	7,170.00	16,491,000	貸付有価証券 1,200株
伊藤忠エネクス	26,900	1,981.00	53,288,900	
サンリオ	107,000	5,240.00	560,680,000	貸付有価証券 80,600株
サンワテクノス	4,900	3,395.00	16,635,500	貸付有価証券 600株
新光商事	13,000	1,110.00	14,430,000	
トーヨー	12,600	1,332.00	16,783,200	貸付有価証券 9,000株
三信電気	6,200	3,170.00	19,654,000	
東陽テクニカ	10,000	1,850.00	18,500,000	
モスフードサービス	16,000	4,270.00	68,320,000	
加賀電子	20,000	4,270.00	85,400,000	
ソーダニッカ	8,800	1,213.00	10,674,400	
立花エレテック	6,500	3,435.00	22,327,500	
フォーバル	4,300	1,116.00	4,798,800	貸付有価証券 3,000株
PALTAC	16,700	4,993.00	83,383,100	
三谷産業	19,000	726.00	13,794,000	貸付有価証券 13,500株
コア商事ホールディングス	9,700	864.00	8,380,800	
KPPグループホールディングス	28,200	920.00	25,944,000	
ヤマタネ	8,700	2,300.00	20,010,000	
泉州電業	6,900	6,530.00	45,057,000	
トラスコ中山	22,800	2,460.00	56,088,000	
オートバックスセブン	37,800	1,755.00	66,339,000	
モリト	8,600	2,063.00	17,741,800	
加藤産業	13,400	6,870.00	92,058,000	
イエローハット	27,200	1,732.00	47,110,400	
JKホールディングス	7,100	1,565.00	11,111,500	
日伝	6,000	2,500.00	15,000,000	貸付有価証券 4,500株
杉本商事	8,700	1,438.00	12,510,600	
因幡電機産業	56,200	2,828.50	158,961,700	
東テク	10,900	4,435.00	48,341,500	
ミスミグループ本社	152,000	3,093.00	470,136,000	
スズケン	35,700	6,437.00	229,800,900	
ジェコス	6,500	1,888.00	12,272,000	

インターメスティック	4,800	1,923.00	9,230,400	
サンエー	18,500	3,135.00	57,997,500	
カワチ薬品	8,600	3,215.00	27,649,000	貸付有価証券 6,300株
エービーシー・マート	56,700	2,583.50	146,484,450	
ハードオフコーポレーション	4,400	2,098.00	9,231,200	
アスクル	25,600	1,273.00	32,588,800	
ゲオホールディングス	12,400	1,746.00	21,650,400	
アンドエスティHD	15,100	2,998.00	45,269,800	貸付有価証券 11,200株
くら寿司	12,800	3,645.00	46,656,000	貸付有価証券 9,500株
キャンドウ	3,900	3,560.00	13,884,000	貸付有価証券 2,900株
パルグループホールディングス	42,400	1,645.00	69,748,000	
エディオン	51,300	2,243.00	115,065,900	
サーラコーポレーション	23,000	1,214.00	27,922,000	
ハローズ	4,400	4,850.00	21,340,000	貸付有価証券 3,300株
あみやき亭	8,100	1,437.00	11,639,700	貸付有価証券 5,800株
大黒天物産	3,900	5,490.00	21,411,000	
ハニーズホールディングス	9,800	1,529.00	14,984,200	貸付有価証券 7,100株
アルペン	10,600	2,221.00	23,542,600	貸付有価証券 7,800株
クオールホールディングス	13,600	1,906.00	25,921,600	
ジinzホールディングス	7,400	5,220.00	38,628,000	
ビックカメラ	57,900	1,781.50	103,148,850	貸付有価証券 43,300株
DCMホールディングス	56,400	1,728.00	97,459,200	貸付有価証券 200株
Monotaro	152,900	2,006.00	306,717,400	
J.フロント リテイリング	123,700	2,622.50	324,403,250	
ドトール・日レスホールディングス	19,400	2,980.00	57,812,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	187,600	2,590.00	485,884,000	
ブロンコビリー	6,400	4,035.00	25,824,000	貸付有価証券 4,800株
ZOZO	170,000	1,095.00	186,150,000	
トレジャー・ファクトリー	7,600	1,797.00	13,657,200	貸付有価証券 5,600株
物語コーポレーション	21,100	4,985.00	105,183,500	貸付有価証券 15,300株
三越伊勢丹ホールディングス	168,100	2,994.50	503,375,450	
Hamee	5,200	509.00	2,646,800	
クリエイトSDホールディングス	15,500	3,350.00	51,925,000	
シュッピン	10,400	1,325.00	13,780,000	

オイシックス・ラ・大地	16,000	1,383.00	22,128,000	貸付有価証券 13,100株
ネクステージ	24,900	3,745.00	93,250,500	貸付有価証券 18,600株
ジョイフル本田	29,500	2,190.00	64,605,000	貸付有価証券 18,900株
エターナルホスピタリティグループ	4,500	3,710.00	16,695,000	貸付有価証券 3,300株
ホットランドホールディングス	8,400	1,932.00	16,228,800	貸付有価証券 6,200株
すかいらーくホールディングス	147,400	3,570.00	526,218,000	貸付有価証券 110,900株
SFPホールディングス	6,100	2,301.00	14,036,100	貸付有価証券 4,500株
綿半ホールディングス	8,600	1,506.00	12,951,600	貸付有価証券 1,200株
ヨシックスホールディングス	3,700	3,590.00	13,283,000	貸付有価証券 2,400株
ユニテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	53,300	984.00	52,447,200	貸付有価証券 40,100株
あさひ	9,200	1,315.00	12,098,000	
コスモス薬品	18,300	6,996.00	128,026,800	
セブン&アイ・ホールディングス	1,190,300	2,231.00	2,655,559,300	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	163,400	768.00	125,491,200	貸付有価証券 122,100株
ツルハホールディングス	169,000	2,696.00	455,624,000	
サンマルクホールディングス	9,700	3,055.00	29,633,500	
トリドールホールディングス	30,700	4,253.00	130,567,100	貸付有価証券 22,800株
TOKYO BASE	12,200	383.00	4,672,600	
JMホールディングス	15,800	1,720.00	27,176,000	
アレンザホールディングス	8,300	1,461.00	12,126,300	
串カツ田中ホールディングス	3,400	2,060.00	7,004,000	貸付有価証券 2,400株
パロックジャパンリミテッド	12,400	811.00	10,056,400	貸付有価証券 9,300株
クスリのアオキホールディングス	28,300	4,062.00	114,954,600	貸付有価証券 20,500株
力の源ホールディングス	8,100	1,531.00	12,401,100	貸付有価証券 5,900株
FOOD & LIFE COMPANIES	61,900	9,450.00	584,955,000	
ブルーゾーンホールディングス	13,100	9,668.00	126,650,800	
メディカルシステムネットワーク	11,100	523.00	5,805,300	
Japan Eyewear Holdings	3,600	1,930.00	6,948,000	貸付有価証券 2,600株
ノジマ	106,500	1,142.00	121,623,000	
カッパ・クリエイト	17,100	1,562.00	26,710,200	貸付有価証券 12,800株

良品計画	235,300	3,532.00	831,079,600	
アドヴァングループ	7,200	1,030.00	7,416,000	
アルビス	3,600	2,740.00	9,864,000	貸付有価証券 2,100株
G - 7ホールディングス	12,000	1,507.00	18,084,000	
イオン北海道	26,800	943.00	25,272,400	貸付有価証券 20,600株
コジマ	18,200	1,344.00	24,460,800	貸付有価証券 12,600株
コーナン商事	12,000	4,255.00	51,060,000	貸付有価証券 9,000株
エコス	4,100	3,240.00	13,284,000	貸付有価証券 3,000株
ワタミ	13,100	966.00	12,654,600	貸付有価証券 9,500株
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	1,089,000	1,023.50	1,114,591,500	
西松屋チェーン	24,200	2,168.00	52,465,600	貸付有価証券 18,000株
ゼンショーホールディングス	55,100	9,883.00	544,553,300	
幸楽苑	9,400	1,210.00	11,374,000	貸付有価証券 6,900株
サイゼリヤ	14,100	7,030.00	99,123,000	
V Tホールディングス	42,800	569.00	24,353,200	
魚力	3,900	2,335.00	9,106,500	
ユナイテッドアローズ	11,700	2,561.00	29,963,700	
ハイデイ日高	17,600	3,215.00	56,584,000	貸付有価証券 13,100株
コロワイド	61,300	1,841.00	112,853,300	貸付有価証券 45,800株
壱番屋	43,100	924.00	39,824,400	貸付有価証券 32,100株
スギホールディングス	58,400	3,517.00	205,392,800	
薬王堂ホールディングス	5,400	2,066.00	11,156,400	
ダブルエー	3,100	1,340.00	4,154,000	貸付有価証券 2,300株
スクロール	16,100	1,360.00	21,896,000	
ヨンドシーホールディングス	10,400	1,890.00	19,656,000	貸付有価証券 7,700株
木曽路	16,500	2,596.00	42,834,000	貸付有価証券 12,300株
S R Sホールディングス	18,100	1,265.00	22,896,500	貸付有価証券 13,400株
千趣会	22,000	133.00	2,926,000	貸付有価証券 16,000株
リテールパートナーズ	16,300	1,411.00	22,999,300	貸付有価証券 12,100株
上新電機	10,800	2,837.00	30,639,600	貸付有価証券 200株

日本瓦斯	52,100	3,064.00	159,634,400	
ロイヤルホールディングス	39,400	1,543.00	60,794,200	貸付有価証券 29,400株
チヨダ	9,800	1,110.00	10,878,000	貸付有価証券 2,000株
ライフコーポレーション	20,800	2,728.00	56,742,400	
リンガーハット	14,000	2,287.00	32,018,000	貸付有価証券 10,700株
MrMaxHD	9,300	817.00	7,598,100	
AOKIホールディングス	23,400	1,776.00	41,558,400	
オークワ	14,400	902.00	12,988,800	貸付有価証券 10,800株
コメリ	14,700	3,670.00	53,949,000	貸付有価証券 10,200株
青山商事	23,300	2,616.00	60,952,800	
しまむら	76,500	3,531.00	270,121,500	
高島屋	156,200	2,209.50	345,123,900	
松屋	18,400	2,765.00	50,876,000	貸付有価証券 14,100株
エイチ・ツー・オー リテイリング	52,900	2,476.00	130,980,400	
近鉄百貨店	6,300	1,820.00	11,466,000	貸付有価証券 4,600株
丸井グループ	63,500	3,100.00	196,850,000	
アクシアル リテイリング	29,800	1,295.00	38,591,000	
イオン	1,272,100	2,320.50	2,951,908,050	
イズミ	19,100	3,130.00	59,783,000	
平和堂	17,800	3,065.00	54,557,000	貸付有価証券 13,300株
フジ	16,500	2,186.00	36,069,000	貸付有価証券 12,100株
ゼビオホールディングス	13,000	1,114.00	14,482,000	
ケーズホールディングス	73,500	1,696.00	124,656,000	
シルバーライフ	3,200	831.00	2,659,200	貸付有価証券 2,300株
Genky DrugStores	9,600	4,450.00	42,720,000	
ブックオフグループホールディングス	8,000	1,957.00	15,656,000	貸付有価証券 5,800株
ギフトホールディングス	5,600	4,010.00	22,456,000	貸付有価証券 4,300株
アインホールディングス	10,900	6,143.00	66,958,700	
Genki Global Dining	6,200	2,908.00	18,029,600	
ヤマダホールディングス	334,600	571.90	191,357,740	
アークランズ	32,400	2,044.00	66,225,600	貸付有価証券 23,600株
ニトリホールディングス	174,400	3,183.00	555,115,200	
グルメ杵屋	9,000	1,002.00	9,018,000	貸付有価証券 6,700株
ケーユーホールディングス	6,300	1,330.00	8,379,000	

吉野家ホールディングス	39,800	3,145.00	125,171,000	貸付有価証券 31,600株
松屋フーズホールディングス	5,200	6,120.00	31,824,000	貸付有価証券 3,800株
サガミホールディングス	17,600	1,903.00	33,492,800	貸付有価証券 13,000株
王将フードサービス	22,300	3,225.00	71,917,500	
ミニストップ	7,800	2,020.00	15,756,000	貸付有価証券 5,900株
アークス	18,300	3,970.00	72,651,000	貸付有価証券 13,700株
パローホールディングス	20,800	3,745.00	77,896,000	
ベルク	4,800	7,830.00	37,584,000	
大庄	7,200	1,195.00	8,604,000	貸付有価証券 5,400株
ファーストリテイリング	72,700	66,850.00	4,859,995,000	
サンドラッグ	31,900	4,264.00	136,021,600	
サックスパー ホールディングス	10,600	834.00	8,840,400	貸付有価証券 7,000株
ペルーナ	26,400	978.00	25,819,200	
いよぎんホールディングス	131,300	3,265.00	428,694,500	
しずおかフィナンシャルグループ	220,900	3,079.00	680,151,100	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	85,100	3,214.00	273,511,400	
楽天銀行	53,200	8,367.00	445,124,400	
京都フィナンシャルグループ	137,700	3,562.00	490,487,400	
めぶきフィナンシャルグループ	468,900	1,280.00	600,192,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	12,900	11,050.00	142,545,000	
九州フィナンシャルグループ	194,100	1,288.50	250,097,850	
ゆうちょ銀行	1,089,400	3,046.00	3,318,312,400	
富山第一銀行	32,100	2,543.00	81,630,300	
横浜フィナンシャルグループ	523,100	1,665.00	870,961,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	61,800	4,294.00	265,369,200	
三十三フィナンシャルグループ	9,000	6,050.00	54,450,000	
第四北越フィナンシャルグループ	95,300	1,958.00	186,597,400	
ひろぎんホールディングス	140,700	1,885.50	265,289,850	
おきなわフィナンシャルグループ	8,000	5,930.00	47,440,000	
十六フィナンシャルグループ	14,200	9,600.00	136,320,000	
CCIグループ	104,700	998.00	104,490,600	
プロクレアホールディングス	11,600	2,978.00	34,544,800	貸付有価証券 4,300株
あいちフィナンシャルグループ	20,600	6,140.00	126,484,000	
SBI新生銀行	127,700	1,819.00	232,286,300	貸付有価証券 96,400株
あおぞら銀行	63,900	2,784.00	177,897,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,329,000	2,888.00	18,278,152,000	
りそなホールディングス	1,230,100	1,926.50	2,369,787,650	

三井住友トラストグループ	349,100	5,403.00	1,886,187,300
三井住友フィナンシャルグループ	2,203,500	5,808.00	12,797,928,000
千葉銀行	306,800	2,277.50	698,737,000
群馬銀行	180,900	2,121.00	383,688,900
武蔵野銀行	14,000	6,230.00	87,220,000
千葉興業銀行	19,000	2,330.00	44,270,000
筑波銀行	44,400	698.00	30,991,200
七十七銀行	32,400	9,475.00	306,990,000
秋田銀行	6,800	5,520.00	37,536,000
山形銀行	11,100	2,683.00	29,781,300
岩手銀行	6,400	6,760.00	43,264,000
東邦銀行	116,300	709.00	82,456,700
ふくおかフィナンシャルグループ	80,100	6,674.00	534,587,400
スルガ銀行	68,100	2,116.00	144,099,600
八十二長野銀行	206,800	1,948.50	402,949,800
山梨中央銀行	11,300	5,250.00	59,325,000
大垣共立銀行	20,700	6,300.00	130,410,000
福井銀行	9,000	3,420.00	30,780,000
清水銀行	4,000	2,867.00	11,468,000
滋賀銀行	15,300	8,570.00	131,121,000
南都銀行	15,200	7,380.00	112,176,000
百五銀行	95,100	1,537.00	146,168,700
紀陽銀行	33,300	4,205.00	140,026,500
ほくほくフィナンシャルグループ	61,100	5,950.00	363,545,000
山陰合同銀行	63,300	1,730.00	109,509,000
百十四銀行	9,900	9,320.00	92,268,000
四国銀行	14,700	2,361.00	34,706,700
阿波銀行	13,800	5,770.00	79,626,000
大分銀行	5,900	9,560.00	56,404,000
宮崎銀行	5,900	9,290.00	54,811,000
佐賀銀行	5,900	4,955.00	29,234,500
琉球銀行	21,300	2,408.00	51,290,400
セブン銀行	314,400	294.40	92,559,360
みずほフィナンシャルグループ	1,422,300	6,930.00	9,856,539,000
山口フィナンシャルグループ	99,200	2,700.00	267,840,000
名古屋銀行	19,000	5,320.00	101,080,000
北洋銀行	130,600	1,024.00	133,734,400
愛媛銀行	14,800	1,853.00	27,424,400
京葉銀行	45,400	2,136.00	96,974,400
栃木銀行	46,300	986.00	45,651,800
北日本銀行	3,500	5,170.00	18,095,000
東和銀行	18,600	1,202.00	22,357,200

トモニホールディングス	96,600	974.00	94,088,400	
フィデアホールディングス	10,400	2,155.00	22,412,000	
池田泉州ホールディングス	140,300	893.00	125,287,900	
F P G	32,200	2,027.00	65,269,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	16,400	1,966.00	32,242,400	
S B I ホールディングス	352,200	3,190.00	1,123,518,000	
ジャフコ グループ	27,800	2,430.00	67,554,000	
大和証券グループ本社	717,200	1,588.50	1,139,272,200	
野村ホールディングス	1,686,700	1,384.00	2,334,392,800	
岡三証券グループ	79,900	955.00	76,304,500	
丸三証券	33,600	1,083.00	36,388,800	
東洋証券	25,500	767.00	19,558,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	120,100	774.00	92,957,400	
水戸証券	27,700	628.00	17,395,600	
いちよし証券	20,400	1,390.00	28,356,000	
松井証券	69,700	925.00	64,472,500	
マネックスグループ	106,300	706.00	75,047,800	
極東証券	12,600	1,825.00	22,995,000	
岩井コスモホールディングス	10,500	3,745.00	39,322,500	
アイザワ証券グループ	10,500	1,492.00	15,666,000	
スパークス・グループ	11,200	2,064.00	23,116,800	
ライフネット生命保険	16,200	2,100.00	34,020,000	貸付有価証券 11,800株
かんぼ生命保険	113,300	5,035.00	570,465,500	
F P パートナー	4,500	2,301.00	10,354,500	貸付有価証券 3,300株
S O M P O ホールディングス	498,100	5,904.00	2,940,782,400	
アニコム ホールディングス	31,900	1,195.00	38,120,500	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	625,400	4,231.00	2,646,067,400	
ソニーフィナンシャルグループ	3,514,200	156.50	549,972,300	
第一生命ホールディングス	1,973,300	1,512.00	2,983,629,600	
東京海上ホールディングス	1,031,200	6,340.00	6,537,808,000	
T & D ホールディングス	248,700	3,987.00	991,566,900	
N S グループ	13,400	1,700.00	22,780,000	貸付有価証券 10,000株
全国保証	57,700	3,176.00	183,255,200	
ジェイリース	7,600	1,398.00	10,624,800	
S B I アルヒ	10,300	915.00	9,424,500	貸付有価証券 7,700株
プレミアグループ	17,200	1,801.00	30,977,200	
ネットプロテクションズホールディングス	30,300	500.00	15,150,000	貸付有価証券 22,200株
クレディセゾン	56,500	4,635.00	261,877,500	
芙蓉総合リース	27,900	4,541.00	126,693,900	

みずほリース	76,000	1,509.00	114,684,000	
東京センチュリー	75,600	2,224.00	168,134,400	
日本証券金融	37,200	2,300.00	85,560,000	
アイフル	167,500	501.00	83,917,500	
リコーリース	9,600	6,160.00	59,136,000	
イオンフィナンシャルサービス	58,100	1,772.00	102,953,200	
アコム	179,000	506.30	90,627,700	
ジャックス	12,100	4,305.00	52,090,500	
オリエントコーポレーション	39,300	1,131.00	44,448,300	
オリックス	620,000	5,402.00	3,349,240,000	
三菱HCキャピタル	502,800	1,495.50	751,937,400	
日本取引所グループ	550,200	1,952.50	1,074,265,500	
イー・ギャランティ	16,600	1,721.00	28,568,600	
NECキャピタルソリューション	5,000	4,290.00	21,450,000	貸付有価証券 3,500株
robot home	29,400	193.00	5,674,200	貸付有価証券 21,800株
大東建託	170,700	3,517.00	600,351,900	
いちご	86,200	426.00	36,721,200	
日本駐車場開発	121,300	280.00	33,964,000	貸付有価証券 18,600株
スター・マイカ・ホールディングス	10,900	1,557.00	16,971,300	
SREホールディングス	3,800	2,609.00	9,914,200	
ヒューリック	292,600	2,045.50	598,513,300	
野村不動産ホールディングス	279,900	1,119.50	313,348,050	
三重交通グループホールディングス	22,100	595.00	13,149,500	貸付有価証券 17,000株
ディア・ライフ	15,700	1,103.00	17,317,100	
地主	8,400	3,335.00	28,014,000	
JPMC	5,600	1,369.00	7,666,400	
フージャースホールディングス	15,800	1,294.00	20,445,200	
オープンハウスグループ	32,200	11,170.00	359,674,000	
東急不動産ホールディングス	274,300	1,524.00	418,033,200	
飯田グループホールディングス	85,500	2,718.00	232,389,000	
And Doホールディングス	6,100	1,113.00	6,789,300	貸付有価証券 4,400株
ケイアイスター不動産	4,300	7,790.00	33,497,000	
グッドコムアセット	8,700	1,462.00	12,719,400	貸付有価証券 6,500株
ジェイ・エス・ビー	4,300	3,380.00	14,534,000	
ロードスターキャピタル	5,800	3,475.00	20,155,000	
アズーム	1,800	4,335.00	7,803,000	
霞ヶ関キャピタル	10,000	7,350.00	73,500,000	貸付有価証券 7,500株
パーク24	72,400	2,164.00	156,673,600	

パラカ	2,900	2,003.00	5,808,700	
三井不動産	1,483,500	2,060.50	3,056,751,750	
三菱地所	602,800	5,059.00	3,049,565,200	
平和不動産	20,800	2,500.00	52,000,000	
東京建物	95,700	4,121.00	394,379,700	
京阪神ビルディング	15,000	2,077.00	31,155,000	
住友不動産	285,200	5,075.00	1,447,390,000	
テーオーシー	18,300	884.00	16,177,200	
レオパレス21	88,500	719.00	63,631,500	
スターツコーポレーション	18,600	5,190.00	96,534,000	
フジ住宅	13,000	893.00	11,609,000	
空港施設	14,500	1,026.00	14,877,000	
明和地所	8,300	1,150.00	9,545,000	
ゴールドクレスト	5,500	3,315.00	18,232,500	
エスリード	4,800	7,200.00	34,560,000	
日神グループホールディングス	16,600	807.00	13,396,200	
エスコン	22,500	1,127.00	25,357,500	
MIRARTHホールディングス	59,300	415.00	24,609,500	
カチタス	27,300	3,420.00	93,366,000	
トーセイ	30,000	1,605.00	48,150,000	
サンフロンティア不動産	15,000	2,570.00	38,550,000	
FJネクストホールディングス	9,400	1,878.00	17,653,200	
グランディハウス	9,900	655.00	6,484,500	
日本空港ビルデング	35,800	5,285.00	189,203,000	
LIFULL	31,400	204.00	6,405,600	
ジェイエイシーリクルートメント	38,200	849.00	32,431,800	
日本M&Aセンターホールディングス	166,900	696.10	116,179,090	
フィットイージー	2,400	2,549.00	6,117,600	貸付有価証券 200株
メンバーズ	4,200	1,154.00	4,846,800	
UTグループ	207,000	203.00	42,021,000	
アイティメディア	5,500	1,828.00	10,054,000	貸付有価証券 4,100株
E・Jホールディングス	7,000	1,869.00	13,083,000	
オープンアップグループ	35,300	1,846.00	65,163,800	
コシダカホールディングス	29,000	1,180.00	34,220,000	
パソナグループ	12,400	1,999.00	24,787,600	貸付有価証券 8,000株
リンクアンドモチベーション	25,100	529.00	13,277,900	
エス・エム・エス	40,400	1,674.00	67,629,600	
パーソルホールディングス	962,600	240.50	231,505,300	
クックパッド	21,100	143.00	3,017,300	貸付有価証券 15,800株

学情	4,800	1,855.00	8,904,000	貸付有価証券 3,800株
スタジオアリス	5,300	2,006.00	10,631,800	貸付有価証券 3,900株
N J S	2,300	4,550.00	10,465,000	貸付有価証券 1,900株
A L S O K	176,400	1,190.50	210,004,200	
カカクコム	68,000	1,572.50	106,930,000	
ルネサンス	8,300	1,117.00	9,271,100	貸付有価証券 5,800株
ディップ	18,500	2,030.00	37,555,000	貸付有価証券 13,700株
新日本科学	11,200	1,664.00	18,636,800	貸付有価証券 8,300株
エムスリー	206,900	1,495.00	309,315,500	
ワールドホールディングス	4,300	2,802.00	12,048,600	
情報堂 D Y ホールディングス	133,600	1,147.00	153,239,200	
ぐるなび	20,000	147.00	2,940,000	貸付有価証券 15,000株
タカミヤ	14,500	429.00	6,220,500	
ファンコミュニケーションズ	13,300	471.00	6,264,300	
ライク	5,500	1,579.00	8,684,500	貸付有価証券 4,000株
エスプール	27,500	251.00	6,902,500	
W D B ホールディングス	5,400	1,573.00	8,494,200	
アドウェイズ	11,600	279.00	3,236,400	貸付有価証券 3,300株
バリューコマース	9,400	437.00	4,107,800	貸付有価証券 7,000株
インフォマート	99,900	370.00	36,963,000	
J P ホールディングス	27,100	773.00	20,948,300	貸付有価証券 20,100株
C L ホールディングス	2,700	1,125.00	3,037,500	貸付有価証券 2,000株
プレステージ・インターナショナル	38,900	673.00	26,179,700	
アミューズ	5,700	2,056.00	11,719,200	
ドリームインキュベータ	2,600	2,845.00	7,397,000	貸付有価証券 1,900株
クイック	21,900	864.00	18,921,600	
電通グループ	101,300	2,765.50	280,145,150	貸付有価証券 76,300株
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,100	721.00	3,677,100	
イオンファンタジー	4,600	2,790.00	12,834,000	貸付有価証券 3,400株
シーティーエス	12,900	981.00	12,654,900	
H . U . グループホールディングス	32,900	3,180.00	104,622,000	
アルプス技研	8,800	2,611.00	22,976,800	
サニックスホールディングス	15,400	207.00	3,187,800	

日本空調サービス	11,400	1,615.00	18,411,000	
オリエンタルランド	617,100	2,709.50	1,672,032,450	
ダスキン	23,800	4,272.00	101,673,600	
明光ネットワークジャパン	14,000	720.00	10,080,000	貸付有価証券 10,400株
ファルコホールディングス	4,200	2,686.00	11,281,200	
ラウンドワン	99,800	984.30	98,233,140	
リゾートトラスト	99,200	1,886.00	187,091,200	
ビー・エム・エル	13,000	4,295.00	55,835,000	
リソー教育グループ	33,200	209.00	6,938,800	
早稲田アカデミー	5,100	2,020.00	10,302,000	貸付有価証券 2,900株
ユー・エス・エス	198,600	1,862.00	369,793,200	
サイバーエージェント	212,400	1,299.50	276,013,800	
楽天グループ	825,400	823.00	679,304,200	
クリーク・アンド・リバー社	5,400	1,466.00	7,916,400	
SBIグローバルアセットマネジメント	20,800	610.00	12,688,000	貸付有価証券 14,800株
テー・オー・ダブリュー	19,000	378.00	7,182,000	
GMOインターネット	2,600	675.00	1,755,000	貸付有価証券 1,900株
山田コンサルティンググループ	5,400	1,684.00	9,093,600	
セントラルスポーツ	4,000	2,465.00	9,860,000	貸付有価証券 2,900株
フルキャストホールディングス	8,200	1,631.00	13,374,200	貸付有価証券 5,600株
エン	17,200	1,150.00	19,780,000	貸付有価証券 1,500株
弁護士ドットコム	3,900	2,287.00	8,919,300	貸付有価証券 2,900株
アイ・アールジャパンホールディングス	5,600	801.00	4,485,600	
KeepPer 技研	6,500	3,430.00	22,295,000	貸付有価証券 4,900株
Gunosy	8,500	545.00	4,632,500	貸付有価証券 6,300株
イー・ガーディアン	3,200	1,626.00	5,203,200	貸付有価証券 2,400株
ジャパンマテリアル	32,300	2,072.00	66,925,600	
ベクトル	14,500	1,355.00	19,647,500	
チャーム・ケア・コーポレーション	8,900	1,408.00	12,531,200	
キャリアリンク	3,900	2,772.00	10,810,800	貸付有価証券 2,900株
I B J	8,200	739.00	6,059,800	
アサンテ	5,300	1,616.00	8,564,800	貸付有価証券 3,900株
バリューHR	9,500	1,404.00	13,338,000	貸付有価証券 6,900株
M&Aキャピタルパートナーズ	8,600	3,430.00	29,498,000	

ライドオンエクスプレスホールディングス	4,300	1,030.00	4,429,000	貸付有価証券 3,200株
シグマクシス・ホールディングス	30,800	663.00	20,420,400	
ウィルグループ	9,000	1,282.00	11,538,000	貸付有価証券 6,900株
リクルートホールディングス	774,300	6,163.00	4,772,010,900	
エラン	9,300	742.00	6,900,600	
日本郵政	942,800	2,039.00	1,922,369,200	
ベルシステム24ホールディングス	11,500	1,463.00	16,824,500	
鎌倉新書	9,100	554.00	5,041,400	貸付有価証券 7,000株
エアトリ	8,700	704.00	6,124,800	貸付有価証券 6,400株
アトラエ	8,300	715.00	5,934,500	貸付有価証券 5,100株
ストライク	5,200	4,300.00	22,360,000	貸付有価証券 3,800株
ソラスト	25,400	940.00	23,876,000	
セラク	3,200	1,570.00	5,024,000	貸付有価証券 2,200株
インソース	23,000	698.00	16,054,000	
ペイカレント	77,000	3,861.00	297,297,000	
Orchestra Holdings	2,400	1,115.00	2,676,000	貸付有価証券 1,800株
アイモバイル	15,800	522.00	8,247,600	
MS - Japan	5,800	1,056.00	6,124,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	88,200	1,641.50	144,780,300	
エル・ティー・エス	1,500	1,631.00	2,446,500	
ミダックホールディングス	5,300	2,074.00	10,992,200	
キュービーネットホールディングス	6,200	1,360.00	8,432,000	貸付有価証券 3,300株
オープングループ	17,000	239.00	4,063,000	
マネジメントソリューションズ	5,400	1,441.00	7,781,400	貸付有価証券 3,600株
プロレド・パートナーズ	2,700	481.00	1,298,700	貸付有価証券 2,000株
フロンティア・マネジメント	3,400	554.00	1,883,600	貸付有価証券 2,300株
アンビスホールディングス	22,700	478.00	10,850,600	貸付有価証券 17,000株
カーブスホールディングス	28,900	779.00	22,513,100	
Macbee Planet	4,000	1,426.00	5,704,000	貸付有価証券 3,000株
ダイレクトマーケティングミックス	11,200	341.00	3,819,200	
ポピンズ	1,600	1,422.00	2,275,200	
LITALICO	9,700	1,312.00	12,726,400	
リログループ	46,700	1,860.00	86,862,000	

東祥	8,900	941.00	8,374,900	
ビーウィズ	2,800	1,738.00	4,866,400	貸付有価証券 2,000株
サンウェルズ	5,500	253.00	1,391,500	貸付有価証券 4,200株
TREホールディングス	24,300	1,771.00	43,035,300	
人・夢・技術グループ	4,400	1,645.00	7,238,000	
NISSOホールディングス	9,300	666.00	6,193,800	貸付有価証券 6,700株
大栄環境	23,000	3,800.00	87,400,000	
GENOVA	4,900	601.00	2,944,900	
日本管財ホールディングス	11,100	2,875.00	31,912,500	
クオッツ総研ホールディングス	13,700	756.00	10,357,200	貸付有価証券 9,300株
エイチ・アイ・エス	30,700	1,252.00	38,436,400	貸付有価証券 22,800株
ラックランド	4,500	1,770.00	7,965,000	貸付有価証券 2,300株
共立メンテナンス	39,700	2,607.50	103,517,750	貸付有価証券 29,100株
イチネンホールディングス	10,100	2,198.00	22,199,800	
建設技術研究所	10,900	3,485.00	37,986,500	
スペース	7,700	1,649.00	12,697,300	
燦ホールディングス	8,900	1,507.00	13,412,300	
スバル興業	3,600	3,565.00	12,834,000	
タナベコンサルティンググループ	8,800	735.00	6,468,000	貸付有価証券 6,600株
ナガワ	2,800	6,090.00	17,052,000	
東京都競馬	7,700	5,830.00	44,891,000	貸付有価証券 5,700株
カナモト	14,900	4,210.00	62,729,000	
ニシオホールディングス	8,700	4,565.00	39,715,500	
トランス・コスモス	13,500	3,975.00	53,662,500	
乃村工藝社	46,100	1,428.00	65,830,800	
藤田観光	21,000	2,324.00	48,804,000	貸付有価証券 12,800株
KNT-CTホールディングス	5,200	1,612.00	8,382,400	貸付有価証券 3,900株
トーカイ	8,300	2,599.00	21,571,700	
セコム	195,500	5,946.00	1,162,443,000	
セントラル警備保障	5,100	2,998.00	15,289,800	
丹青社	22,400	1,536.00	34,406,400	
メイテックグループホールディングス	39,000	3,340.00	130,260,000	
応用地質	9,600	2,989.00	28,694,400	
船井総研ホールディングス	42,200	1,126.00	47,517,200	
学究社	4,200	2,450.00	10,290,000	貸付有価証券 2,000株

ナック	10,600	542.00	5,745,200
ダイセキ	21,400	3,770.00	80,678,000
ステップ	3,900	2,513.00	9,800,700
合 計	207,834,900		549,752,531,350

## (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

項目	2026年 2月24日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	229,318,335	
国債証券	357,815,985,130	
地方債証券	21,817,981,760	
特殊債券	20,787,361,787	
社債券	20,970,771,000	
未収入金	435,451,200	
未収利息	1,379,241,786	
前払費用	88,521,761	
流動資産合計	423,524,632,759	
資産合計	423,524,632,759	
負債の部		
流動負債		
未払金	298,852,000	
未払解約金	219,969,362	
流動負債合計	518,821,362	
負債合計	518,821,362	
純資産の部		
元本等		
元本	352,789,857,620	
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	70,215,953,777	
元本等合計	423,005,811,397	
純資産合計	423,005,811,397	
負債純資産合計	423,524,632,759	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2026年 2月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 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> <p>先物取引</p>

2026年 2月24日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
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)

2026年 2月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	352,789,857,620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 1.1990円 (1万口当たり純資産額) (11,990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

2026年 2月24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

2026年 2月24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	2026年 2月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 2月22日
期首元本額	322,731,311,402円

区分	2026年 2月24日現在
期中追加設定元本額	61,605,290,332円
期中一部解約元本額	31,546,744,114円
期末元本額	352,789,857,620円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	712,913,494円
D C日本債券インデックスファンド	1,536,213,442円
D C日本債券インデックスファンドL	43,251,082,354円
D Cバランスファンド30	16,334,494,724円
D Cバランスファンド50	14,195,746,182円
D Cバランスファンド70	5,056,853,105円
日本債券インデックスe	747,002,703円
インデックスコレクション(国内債券)	37,920,850,100円
インデックスコレクション(バランス株式30)	86,246,874,767円
インデックスコレクション(バランス株式50)	16,084,910,867円
インデックスコレクション(バランス株式70)	8,860,170,542円
私募日本債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	67,509,728,653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)	6,757,556,822円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	88,404,878円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	623,410,706円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	88,441,780円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	90,389,163円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	94,639,790円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,505,697,426円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,017,424,171円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	12,812,593,583円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	200,591,198円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	186,819,909円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	2,894,180,653円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	103,565,513円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	370,208,013円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,178,855,824円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	284,588,705円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	738,761,567円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	23,969,341円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	2,411,281,893円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,221,198,788円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	18,640,862,565円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	386,631,192円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	84,046,124円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	37,334,749円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	485,305,085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)	6,257,249円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2026年 2月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	6,045,135,260
地方債証券	164,679,488
特殊債券	90,116,997
社債券	145,669,000
合計	6,445,600,745

(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470回利付国債(2年)	1,720,000,000	1,716,112,800	
	第471回利付国債(2年)	1,785,000,000	1,782,090,450	
	第472回利付国債(2年)	3,120,000,000	3,106,552,800	
	第473回利付国債(2年)	1,705,000,000	1,698,521,000	
	第474回利付国債(2年)	980,000,000	974,414,000	
	第475回利付国債(2年)	1,160,000,000	1,155,998,000	
	第476回利付国債(2年)	1,320,000,000	1,314,786,000	
	第477回利付国債(2年)	180,000,000	179,490,600	
	第478回利付国債(2年)	1,885,000,000	1,878,930,300	
	第480回利付国債(2年)	1,250,000,000	1,247,162,500	
	第151回利付国債(5年)	1,810,000,000	1,790,198,600	
	第152回利付国債(5年)	1,285,000,000	1,272,227,100	
	第153回利付国債(5年)	2,265,000,000	2,232,542,550	
	第154回利付国債(5年)	2,780,000,000	2,733,991,000	
	第155回利付国債(5年)	1,780,000,000	1,751,199,600	
	第156回利付国債(5年)	1,870,000,000	1,836,414,800	
	第157回利付国債(5年)	2,695,000,000	2,638,863,150	
	第158回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,270,308,000	
	第159回利付国債(5年)	80,000,000	77,903,200	
	第160回利付国債(5年)	1,590,000,000	1,551,903,600	
	第161回利付国債(5年)	2,885,000,000	2,822,366,650	
	第162回利付国債(5年)	570,000,000	555,835,500	
	第163回利付国債(5年)	3,225,000,000	3,152,889,000	
	第164回利付国債(5年)	1,230,000,000	1,191,943,800	
	第165回利付国債(5年)	1,705,000,000	1,657,089,500	
	第166回利付国債(5年)	1,310,000,000	1,276,752,200	
	第167回利付国債(5年)	1,090,000,000	1,058,597,100	
	第168回利付国債(5年)	800,000,000	781,776,000	
	第169回利付国債(5年)	1,310,000,000	1,276,306,800	
	第170回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,899,670,500	
	第171回利付国債(5年)	1,100,000,000	1,064,470,000	
	第172回利付国債(5年)	960,000,000	932,035,200	
	第173回利付国債(5年)	310,000,000	301,010,000	
第174回利付国債(5年)	2,340,000,000	2,280,072,600		
第175回利付国債(5年)	1,000,000,000	979,040,000		
第176回利付国債(5年)	430,000,000	422,616,900		

第177回利付国債（5年）	1,460,000,000	1,440,217,000	
第178回利付国債（5年）	3,600,000,000	3,529,008,000	
第179回利付国債（5年）	3,685,000,000	3,603,008,750	
第180回利付国債（5年）	550,000,000	540,094,500	
第181回利付国債（5年）	2,470,000,000	2,441,570,300	
第182回利付国債（5年）	1,205,000,000	1,196,516,800	
第183回利付国債（5年）	1,140,000,000	1,140,250,800	
第1回利付国債（40年）	470,000,000	420,556,000	
第2回利付国債（40年）	560,000,000	475,899,200	
第3回利付国債（40年）	555,000,000	463,175,250	
第4回利付国債（40年）	915,000,000	752,166,600	
第5回利付国債（40年）	555,000,000	428,110,350	
第6回利付国債（40年）	920,000,000	687,690,800	
第7回利付国債（40年）	990,000,000	702,405,000	
第8回利付国債（40年）	960,000,000	620,793,600	
第9回利付国債（40年）	1,660,000,000	754,221,000	
第10回利付国債（40年）	1,380,000,000	747,049,200	
第11回利付国債（40年）	1,080,000,000	554,050,800	
第12回利付国債（40年）	1,055,000,000	466,858,600	
第13回利付国債（40年）	1,675,000,000	734,906,250	
第14回利付国債（40年）	1,745,000,000	816,939,200	
第15回利付国債（40年）	1,911,000,000	989,305,590	
第16回利付国債（40年）	1,725,000,000	973,676,250	
第17回利付国債（40年）	1,775,000,000	1,312,701,250	
第18回利付国債（40年）	780,000,000	726,710,400	
第346回利付国債（10年）	3,515,000,000	3,480,060,900	
第347回利付国債（10年）	3,255,000,000	3,212,359,500	
第348回利付国債（10年）	2,640,000,000	2,596,308,000	
第349回利付国債（10年）	2,220,000,000	2,176,199,400	
第350回利付国債（10年）	2,890,000,000	2,823,992,400	
第351回利付国債（10年）	1,010,000,000	983,527,900	
第352回利付国債（10年）	2,780,000,000	2,697,100,400	
第353回利付国債（10年）	3,900,000,000	3,768,726,000	
第354回利付国債（10年）	2,760,000,000	2,655,782,400	
第355回利付国債（10年）	2,830,000,000	2,711,281,500	
第356回利付国債（10年）	2,910,000,000	2,775,790,800	
第357回利付国債（10年）	3,260,000,000	3,095,239,600	
第358回利付国債（10年）	2,930,000,000	2,768,644,900	
第359回利付国債（10年）	3,830,000,000	3,601,732,000	
第360回利付国債（10年）	4,305,000,000	4,030,125,750	
第361回利付国債（10年）	3,640,000,000	3,389,750,000	
第362回利付国債（10年）	3,590,000,000	3,326,853,000	

第363回利付国債(10年)	3,805,000,000	3,508,210,000
第364回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,192,792,200
第365回利付国債(10年)	3,770,000,000	3,441,595,300
第366回利付国債(10年)	3,893,000,000	3,557,345,540
第367回利付国債(10年)	3,245,000,000	2,949,737,450
第368回利付国債(10年)	4,595,000,000	4,154,661,150
第369回利付国債(10年)	2,630,000,000	2,415,812,800
第370回利付国債(10年)	2,906,000,000	2,658,437,860
第371回利付国債(10年)	3,390,000,000	3,061,441,200
第372回利付国債(10年)	3,300,000,000	3,055,767,000
第373回利付国債(10年)	3,980,000,000	3,610,656,000
第374回利付国債(10年)	3,795,000,000	3,481,191,450
第375回利付国債(10年)	3,835,000,000	3,588,908,050
第376回利付国債(10年)	3,590,000,000	3,289,122,100
第377回利付国債(10年)	4,195,000,000	3,925,806,850
第378回利付国債(10年)	3,180,000,000	3,017,406,600
第379回利付国債(10年)	2,780,000,000	2,652,092,200
第380回利付国債(10年)	3,325,000,000	3,217,735,500
第381回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,150,000,000
第1回利付国債(30年)	50,000,000	52,360,000
第2回利付国債(30年)	100,000,000	103,521,000
第3回利付国債(30年)	140,000,000	144,425,400
第4回利付国債(30年)	190,000,000	201,401,900
第5回利付国債(30年)	140,000,000	143,984,400
第6回利付国債(30年)	365,000,000	379,439,400
第7回利付国債(30年)	170,000,000	175,844,600
第9回利付国債(30年)	115,000,000	112,274,500
第10回利付国債(30年)	345,000,000	329,247,300
第11回利付国債(30年)	435,000,000	431,489,550
第12回利付国債(30年)	400,000,000	407,040,000
第13回利付国債(30年)	360,000,000	363,067,200
第14回利付国債(30年)	620,000,000	642,568,000
第15回利付国債(30年)	575,000,000	599,771,000
第16回利付国債(30年)	335,000,000	349,036,500
第17回利付国債(30年)	335,000,000	345,820,500
第18回利付国債(30年)	640,000,000	654,726,400
第19回利付国債(30年)	345,000,000	352,434,750
第20回利付国債(30年)	250,000,000	259,205,000
第21回利付国債(30年)	405,000,000	412,091,550
第22回利付国債(30年)	635,000,000	656,640,800
第23回利付国債(30年)	500,000,000	516,080,000
第24回利付国債(30年)	120,000,000	123,615,600
第25回利付国債(30年)	185,000,000	186,615,050

第26回利付国債（30年）	1,130,000,000	1,148,057,400	
第27回利付国債（30年）	310,000,000	316,674,300	
第28回利付国債（30年）	885,000,000	900,009,600	
第29回利付国債（30年）	930,000,000	930,446,400	
第30回利付国債（30年）	1,100,000,000	1,083,126,000	
第31回利付国債（30年）	970,000,000	938,135,500	
第32回利付国債（30年）	1,605,000,000	1,562,644,050	
第33回利付国債（30年）	1,440,000,000	1,340,913,600	
第34回利付国債（30年）	1,350,000,000	1,280,461,500	
第35回利付国債（30年）	1,770,000,000	1,623,514,800	
第36回利付国債（30年）	1,605,000,000	1,461,111,750	
第37回利付国債（30年）	1,560,000,000	1,390,084,800	
第38回利付国債（30年）	1,195,000,000	1,040,785,250	
第39回利付国債（30年）	825,000,000	726,544,500	
第40回利付国債（30年）	705,000,000	608,718,150	
第41回利付国債（30年）	725,000,000	612,719,250	
第42回利付国債（30年）	898,000,000	755,047,380	
第43回利付国債（30年）	865,000,000	723,944,450	
第44回利付国債（30年）	900,000,000	750,186,000	
第45回利付国債（30年）	1,032,000,000	826,435,920	
第46回利付国債（30年）	1,250,000,000	996,025,000	
第47回利付国債（30年）	1,200,000,000	969,648,000	
第48回利付国債（30年）	1,100,000,000	852,511,000	
第49回利付国債（30年）	1,150,000,000	886,604,000	
第50回利付国債（30年）	1,200,000,000	812,364,000	
第51回利付国債（30年）	1,269,000,000	756,324,000	
第52回利付国債（30年）	1,470,000,000	913,134,600	
第53回利付国債（30年）	1,090,000,000	688,193,300	
第54回利付国債（30年）	945,000,000	621,318,600	
第55回利付国債（30年）	1,085,000,000	708,342,250	
第56回利付国債（30年）	860,000,000	557,495,000	
第57回利付国債（30年）	1,185,000,000	762,772,650	
第58回利付国債（30年）	1,450,000,000	926,274,500	
第59回利付国債（30年）	1,120,000,000	691,958,400	
第60回利付国債（30年）	1,075,000,000	694,149,000	
第61回利付国債（30年）	795,000,000	483,765,450	
第62回利付国債（30年）	880,000,000	502,374,400	
第63回利付国債（30年）	1,210,000,000	664,447,300	
第64回利付国債（30年）	1,035,000,000	562,843,350	
第65回利付国債（30年）	640,000,000	344,684,800	
第66回利付国債（30年）	690,000,000	368,266,800	
第67回利付国債（30年）	795,000,000	446,941,050	

第68回利付国債(30年)	945,000,000	526,648,500
第69回利付国債(30年)	1,270,000,000	723,277,700
第70回利付国債(30年)	1,155,000,000	651,847,350
第71回利付国債(30年)	1,000,000,000	558,900,000
第72回利付国債(30年)	1,165,000,000	645,200,300
第73回利付国債(30年)	1,195,000,000	655,816,000
第74回利付国債(30年)	1,455,000,000	869,711,700
第75回利付国債(30年)	1,348,000,000	872,991,760
第76回利付国債(30年)	1,286,000,000	852,592,280
第77回利付国債(30年)	1,100,000,000	765,853,000
第78回利付国債(30年)	1,379,000,000	908,333,510
第79回利付国債(30年)	960,000,000	596,284,800
第80回利付国債(30年)	1,110,000,000	807,303,000
第81回利付国債(30年)	1,225,000,000	844,564,000
第82回利付国債(30年)	1,130,000,000	818,074,800
第83回利付国債(30年)	1,130,000,000	899,344,400
第84回利付国債(30年)	1,220,000,000	946,927,400
第85回利付国債(30年)	1,030,000,000	837,060,400
第86回利付国債(30年)	1,020,000,000	847,354,800
第87回利付国債(30年)	1,010,000,000	914,312,600
第88回利付国債(30年)	1,015,000,000	995,339,450
第89回利付国債(30年)	60,000,000	61,131,000
第93回利付国債(20年)	200,000,000	202,018,000
第94回利付国債(20年)	330,000,000	333,676,200
第95回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,198,349,000
第96回利付国債(20年)	580,000,000	587,516,800
第97回利付国債(20年)	570,000,000	579,120,000
第98回利付国債(20年)	370,000,000	375,350,200
第99回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,615,567,200
第100回利付国債(20年)	600,000,000	611,892,000
第101回利付国債(20年)	410,000,000	419,774,400
第102回利付国債(20年)	965,000,000	990,186,500
第103回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,064,804,000
第104回利付国債(20年)	260,000,000	264,999,800
第105回利付国債(20年)	730,000,000	744,965,000
第106回利付国債(20年)	400,000,000	409,196,000
第108回利付国債(20年)	1,125,000,000	1,143,022,500
第109回利付国債(20年)	742,000,000	753,886,840
第110回利付国債(20年)	1,115,000,000	1,139,596,900
第111回利付国債(20年)	450,000,000	461,623,500
第112回利付国債(20年)	880,000,000	899,940,800
第113回利付国債(20年)	1,755,000,000	1,795,207,050
第114回利付国債(20年)	550,000,000	562,925,000

第115回利付国債(20年)	780,000,000	801,153,600	
第116回利付国債(20年)	330,000,000	339,038,700	
第117回利付国債(20年)	975,000,000	997,971,000	
第118回利付国債(20年)	450,000,000	458,743,500	
第119回利付国債(20年)	320,000,000	323,561,600	
第120回利付国債(20年)	445,000,000	446,259,350	
第121回利付国債(20年)	970,000,000	984,472,400	
第122回利付国債(20年)	100,000,000	101,044,000	
第123回利付国債(20年)	500,000,000	511,635,000	
第124回利付国債(20年)	1,435,000,000	1,461,647,950	
第125回利付国債(20年)	670,000,000	688,987,800	
第126回利付国債(20年)	590,000,000	601,050,700	
第127回利付国債(20年)	670,000,000	679,252,700	
第128回利付国債(20年)	865,000,000	876,418,000	
第129回利付国債(20年)	560,000,000	564,513,600	
第130回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,047,945,600	
第131回利付国債(20年)	195,000,000	195,446,550	
第132回利付国債(20年)	710,000,000	710,937,200	
第133回利付国債(20年)	940,000,000	946,476,600	
第134回利付国債(20年)	535,000,000	538,086,950	
第135回利付国債(20年)	1,010,000,000	1,010,000,000	
第136回利付国債(20年)	530,000,000	526,941,900	
第137回利付国債(20年)	780,000,000	778,884,600	
第138回利付国債(20年)	710,000,000	700,699,000	
第139回利付国債(20年)	545,000,000	541,119,600	
第140回利付国債(20年)	945,000,000	941,938,200	
第141回利付国債(20年)	1,145,000,000	1,139,767,350	
第142回利付国債(20年)	740,000,000	741,346,800	
第143回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,254,074,200	
第144回利付国債(20年)	1,225,000,000	1,201,590,250	
第145回利付国債(20年)	1,820,000,000	1,805,312,600	
第146回利付国債(20年)	1,520,000,000	1,503,857,600	
第147回利付国債(20年)	1,605,000,000	1,572,225,900	
第148回利付国債(20年)	1,935,000,000	1,875,634,200	
第149回利付国債(20年)	1,900,000,000	1,836,179,000	
第150回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,235,659,400	
第151回利付国債(20年)	1,765,000,000	1,651,739,950	
第152回利付国債(20年)	1,785,000,000	1,663,941,300	
第153回利付国債(20年)	1,595,000,000	1,494,419,300	
第154回利付国債(20年)	2,175,000,000	2,011,026,750	
第155回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,462,455,000	
第156回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,013,268,000	

	第157回利付国債(20年)	1,210,000,000	992,357,300
	第158回利付国債(20年)	2,265,000,000	1,907,062,050
	第159回利付国債(20年)	2,030,000,000	1,716,953,700
	第160回利付国債(20年)	1,485,000,000	1,262,101,500
	第161回利付国債(20年)	1,670,000,000	1,393,815,400
	第162回利付国債(20年)	2,270,000,000	1,882,170,500
	第163回利付国債(20年)	1,540,000,000	1,268,467,200
	第164回利付国債(20年)	1,945,000,000	1,570,626,400
	第165回利付国債(20年)	1,525,000,000	1,222,272,250
	第166回利付国債(20年)	1,220,000,000	996,654,600
	第167回利付国債(20年)	1,575,000,000	1,243,289,250
	第168回利付国債(20年)	1,585,000,000	1,224,079,650
	第169回利付国債(20年)	1,595,000,000	1,204,735,400
	第170回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,244,004,000
	第171回利付国債(20年)	1,420,000,000	1,055,812,600
	第172回利付国債(20年)	1,210,000,000	906,459,400
	第173回利付国債(20年)	1,020,000,000	758,206,800
	第174回利付国債(20年)	1,320,000,000	973,566,000
	第175回利付国債(20年)	1,770,000,000	1,316,791,500
	第176回利付国債(20年)	1,810,000,000	1,335,689,500
	第177回利付国債(20年)	1,520,000,000	1,093,229,600
	第178回利付国債(20年)	1,695,000,000	1,230,959,850
	第179回利付国債(20年)	1,655,000,000	1,192,626,100
	第180回利付国債(20年)	1,800,000,000	1,358,226,000
	第181回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,266,347,600
	第182回利付国債(20年)	1,865,000,000	1,463,931,750
	第183回利付国債(20年)	1,583,000,000	1,299,168,100
	第184回利付国債(20年)	1,535,000,000	1,191,052,550
	第185回利付国債(20年)	1,880,000,000	1,449,818,400
	第186回利付国債(20年)	2,000,000,000	1,643,520,000
	第187回利付国債(20年)	1,405,000,000	1,109,008,650
	第188回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,397,275,100
	第189回利付国債(20年)	1,335,000,000	1,155,268,950
	第190回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,144,530,000
	第191回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,074,306,600
	第192回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,271,853,200
	第193回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,053,449,600
	第194回利付国債(20年)	1,310,000,000	1,267,791,800
	第195回利付国債(20年)	110,000,000	114,440,700
	国債証券合計	404,372,000,000	357,815,985,130
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	64,387,000
	第7回東京都公募公債(30年)	200,000,000	198,880,000

第11回東京都公募公債（20年）	200,000,000	202,204,000	
第16回東京都公募公債（20年）	150,000,000	152,332,500	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	101,772,000	
第18回東京都公募公債（20年）	200,000,000	204,366,000	
第20回東京都公募公債（20年）	100,000,000	101,809,000	
第21回東京都公募公債（20年）	100,000,000	102,179,000	
第786回東京都公募公債	200,000,000	193,678,000	
第800回東京都公募公債	300,000,000	283,182,000	
第830回東京都公募公債	100,000,000	90,480,000	
第866回東京都公募公債	100,000,000	95,875,000	
平成30年度第3回北海道公募公債	100,000,000	97,284,000	
令和2年度第21回北海道公募公債	100,000,000	92,580,000	
令和4年度第1回北海道公募公債	100,000,000	90,876,000	
第3回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	102,090,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	101,750,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	300,000,000	303,000,000	
第16回神奈川県公募公債（20年）	600,000,000	609,714,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	300,000,000	296,874,000	
第21回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	98,928,000	
第45回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	72,408,000	
第243回神奈川県公募公債	100,000,000	94,376,000	
第2回大阪府公募公債（20年）	300,000,000	306,915,000	
第19回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	145,232,000	
第205回大阪府公募公債（5年）	300,000,000	291,612,000	
第423回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	295,080,000	
第486回大阪府公募公債（10年）	172,000,000	156,540,640	
第490回大阪府公募公債（10年）	121,000,000	110,032,560	
平成19年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	101,589,000	
平成25年度第2回京都府公募公債（15年）	100,000,000	99,324,000	
平成25年度第10回京都府公募公債（15年）	200,000,000	198,520,000	
令和2年度第1回京都府公募公債（10年）	100,000,000	93,992,000	
令和5年度第5回京都府公募公債	100,000,000	97,320,000	
令和5年度第6回京都府公募公債	100,000,000	91,296,000	
第3回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	101,564,000	
第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	99,955,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	98,711,000	
第11回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	192,420,000	
平成28年度第30回兵庫県公募公債	100,000,000	98,986,000	
第40回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	145,110,000	
令和3年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	91,296,000	
令和5年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	91,413,000	
	100,000,000	91,013,000	

令和5年度第4回兵庫県公募公債（グリーンボンド・10年）			
令和5年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	91,634,000	
第4回静岡県公募公債（15年）	100,000,000	99,879,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	61,039,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	98,707,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	98,331,000	
第29回静岡県公募公債（20年）	200,000,000	146,026,000	
令和2年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	94,087,000	
令和4年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	90,565,000	
令和6年度第4回静岡県公募公債（5年）	100,000,000	97,163,000	
令和7年度第5回静岡県公募公債	200,000,000	191,676,000	
令和7年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	94,695,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	101,646,000	
平成25年度第8回愛知県公募公債（30年）	110,000,000	96,239,000	
平成25年度第17回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	96,886,000	
平成29年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	197,214,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,533,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	97,892,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	194,962,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	94,126,000	
令和2年度第4回愛知県公募公債（20年）	200,000,000	145,462,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	93,467,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	106,154,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	102,321,000	
平成29年度第7回広島県公募公債	131,440,000	128,351,160	
令和2年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	143,832,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	100,000,000	92,556,000	
第2回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	91,501,000	
第5回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	102,022,000	
第7回埼玉県公募公債（15年）	400,000,000	335,996,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	100,000,000	82,610,000	
第9回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	61,405,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	164,000,000	
平成29年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	98,539,000	
令和4年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	91,298,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	101,640,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	102,073,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	193,968,000	
平成29年度第8回福岡県公募公債	200,000,000	195,588,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	91,894,000	

令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	200,000,000	162,784,000
令和6年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	92,271,000
令和7年度第6回福岡県公募公債	200,000,000	191,596,000
令和7年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	95,766,000
第6回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	204,572,000
第8回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	102,128,000
第9回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	100,597,000
第28回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	143,932,000
平成29年度第5回千葉県公募公債	120,000,000	117,588,000
令和元年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	94,033,000
令和元年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	93,756,000
令和2年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	93,570,000
令和4年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	92,130,000
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	200,000,000	184,590,000
令和5年度第3回長野県公募公債(グリーンボンド(10年))	100,000,000	91,881,000
令和6年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	91,908,000
第2回群馬県公募公債(20年)	100,000,000	101,172,000
第3回群馬県公募公債(20年)	100,000,000	98,847,000
第28回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	90,981,000
第30回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	92,225,000
第32回群馬県公募公債(10年)	200,000,000	191,596,000
第171回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,605,000
第175回共同発行市場公募地方債	150,000,000	147,297,000
第178回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,910,000
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,477,000
第194回共同発行市場公募地方債	160,000,000	152,854,400
第204回共同発行市場公募地方債	100,000,000	93,756,000
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	93,262,000
第218回共同発行市場公募地方債	200,000,000	183,794,000
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	181,116,000
第231回共同発行市場公募地方債	200,000,000	181,292,000
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	180,716,000
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	91,158,000
第252回共同発行市場公募地方債	100,000,000	90,760,000
第268回共同発行市場公募地方債	100,000,000	94,796,000
第269回共同発行市場公募地方債	200,000,000	190,234,000
令和7年度第1回新潟市公募公債(10年)	200,000,000	196,414,000
令和7年度第1回浜松市公募公債	250,000,000	249,485,000
第7回大阪市公募公債(30年)	100,000,000	64,247,000
第10回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	102,284,000
第22回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	82,123,000
令和3年度第2回大阪市公募公債	100,000,000	91,975,000

第3回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	100,423,000
第13回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	64,330,000
第21回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	158,962,000
第522回名古屋市公募公債(10年)	200,000,000	182,596,000
第525回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	91,526,000
第6回京都市公募公債(20年)	100,000,000	101,660,000
令和4年度第3回京都市公募公債	200,000,000	182,596,000
令和4年度第4回京都市公募公債	100,000,000	92,710,000
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	102,213,000
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	98,653,000
平成26年度第3回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	95,185,000
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	54,404,000
令和6年度第1回神戸市公募公債(5年)	300,000,000	290,460,000
第5回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	102,265,000
第7回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	100,289,000
第25回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	98,998,000
第26回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	98,997,000
平成29年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	97,929,000
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	91,945,000
平成25年度第5回札幌市公募公債(15年)	200,000,000	199,520,000
令和7年度第8回札幌市公募公債(10年)	200,000,000	199,556,000
第8回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	102,181,000
第11回川崎市公募公債(20年)	150,000,000	150,867,000
第13回川崎市公募公債(30年)	200,000,000	134,530,000
第66回川崎市公募公債(5年)	200,000,000	196,432,000
第96回川崎市公募公債	100,000,000	91,839,000
第98回川崎市公募公債	100,000,000	94,695,000
第99回川崎市公募公債	200,000,000	197,074,000
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	400,000,000	383,744,000
平成29年度第12回福岡市公募公債	130,000,000	126,912,500
平成30年度第9回福岡市公募公債(10年)	100,000,000	97,008,000
2019年度第11回福岡市公募公債(30年)	100,000,000	51,016,000
2020年度第8回福岡市公募公債(30年)	100,000,000	54,513,000
2021年度第4回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	69,867,000
令和7年度第4回広島市公募公債	100,000,000	98,207,000
令和3年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	92,335,000
令和7年度第3回千葉市公募公債	100,000,000	95,838,000
第25回さいたま市公募公債	100,000,000	98,207,000
令和3年度第2回三重県公募公債	100,000,000	91,089,000
令和5年度第2回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	96,990,000
令和5年度第5回福井県公募公債	100,000,000	91,271,000

	令和元年度第3回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	93,748,000
	地方債証券合計	23,544,440,000	21,817,981,760
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	36,772,000
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,477,000
	第21回道路債券	100,000,000	105,151,000
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	179,970,000
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	609,648,000
	第28回道路債券	300,000,000	316,602,000
	第33回道路債券	100,000,000	105,804,000
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,241,000
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,266,000
	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	101,649,000
	第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,534,000
	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	101,572,000
	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	101,906,000
	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	102,276,000
	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	95,855,000
	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	94,339,000
	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	101,439,000
	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	92,501,000
	第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,307,000
	第155回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,083,000
	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	98,458,000
	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	98,622,000
	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	98,781,000
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,873,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,396,000	
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	92,635,000	
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	91,609,000	
第250回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	52,803,000	

第256回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	52,884,000	
第293回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	81,897,000	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,370,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	82,706,000	
第307回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	80,036,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	165,760,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	170,002,000	
第317回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	105,522,000	
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	98,129,000	
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	237,498,480	
第340回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	80,706,000	
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	96,850,000	
第372回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,097,000	
第383回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,340,000	
第399回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	108,000,000	101,732,760	
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	257,325,000	
第416回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	51,891,000	
第467回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	289,281,000	
第474回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	256,605,000	
第477回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	179,456,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	102,220,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	101,734,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	204,200,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（30年）	100,000,000	63,358,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	102,003,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	101,430,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	106,390,000	
第15回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	302,976,000	
第17回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	300,000,000	295,350,000	
第17回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	100,071,000	

第22回公営企業債券（20年）	200,000,000	202,696,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	400,000,000	393,928,000	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	101,858,000	
第30回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	98,528,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	400,000,000	386,652,000	
第52回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	81,071,000	
第88回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	142,602,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	395,276,000	
第96回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,678,000	
第103回政府保証地方公共団体金融機構債券	133,000,000	130,236,260	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	110,494,790	
第107回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,417,000	
第110回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	145,585,500	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,903,000	
第116回政府保証地方公共団体金融機構債券	120,000,000	115,371,600	
第118回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	95,912,000	
第122回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	94,449,000	
第146回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	364,040,000	
F169回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,179,000	
第33回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	97,302,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,003,000	
第159回都市再生債券	100,000,000	38,328,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	43,230,000	
第169回都市再生債券	100,000,000	46,227,000	
第191回都市再生債券	100,000,000	62,905,000	
第5回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	77,976,000	75,812,166	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,516,000	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	28,014,000	27,243,054	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	34,602,000	33,355,635	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,823,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,464,000	10,518,098	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,815,000	11,918,499	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,226,000	22,354,244	
第28回政府保証住宅金融支援機構債券（グリーンボンド）	100,000,000	88,126,000	
第29回政府保証住宅金融支援機構債券	200,000,000	165,902,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,664,000	15,686,399	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,911,000	15,000,913	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,916,000	13,980,431	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,012,000	30,834,921	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,741,000	18,440,394	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,431,000	18,260,328	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,332,000	

第 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,476,000	52,403,583
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,508,000	58,709,852
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,855,000	13,904,600
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,248,000	14,262,390
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,038,000	15,022,811
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,128,000	16,941,989
第 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,989,000	17,758,201
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,147,000	19,753,730
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,463,000	19,128,236
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,520,000	26,046,854
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,053,000	27,709,879
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,734,000	23,802,270
第 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,398,000	22,291,274
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,583,000	22,470,354
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,279,000	26,956,391
第 8 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,847,000
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,933,000
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,996,000	39,639,246
第 1 0 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,570,000	89,003,321
第 1 1 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,405,000	45,601,383
第 1 1 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,183,000	47,426,888
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,896,000	47,346,494
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,894,000	46,231,832
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,842,000	47,043,002
第 1 1 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,130,000
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,072,000	47,388,739
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,535,000	47,485,116
第 1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,015,000	47,193,115
第 1 2 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,257,000	47,682,569
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,263,000	48,913,190
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,622,000	49,769,581
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,710,000	48,436,796
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,817,000	49,720,462
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,014,000	49,527,631
第 1 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,268,000	50,668,201
第 1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,226,000	50,612,766
第 1 4 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,011,000	50,036,366
第 1 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,338,000	50,658,350
第 1 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,098,000	51,784,443
第 1 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,125,000	52,013,797
第 1 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	219,507,000	165,080,239
第 1 5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	217,743,000	165,033,951

第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,451,000	54,785,997
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,714,000	110,466,839
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,409,000	56,174,426
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,786,000	55,656,489
第162回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	92,076,000
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,799,000	57,044,761
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,571,000	57,405,642
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,398,000	57,827,141
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,570,000	57,007,130
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,202,000	116,738,205
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,293,000	58,356,476
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,998,000	59,860,761
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,334,000	120,724,618
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,379,000	61,278,442
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,199,000	62,355,253
第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,480,000	125,751,787
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,681,000	65,789,515
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,396,000	66,796,751
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,480,000	65,081,702
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,977,000	66,085,361
第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,490,000	67,057,585
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,440,000	67,768,623
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,188,000	68,875,709
第205回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,185,000	71,561,797
第211回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,310,000	149,878,620
第220回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,986,000	166,746,848
第223回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,222,000	88,005,945
第225回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	94,409,000
第263回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	55,427,000
第344回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	81,443,000
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	165,366,000
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	500,000,000	422,765,000
い第874号商工債	100,000,000	97,799,000
い第876号商工債	400,000,000	390,176,000
い第878号商工債	100,000,000	97,260,000
い第889号商工債	200,000,000	194,456,000
い第902号商工債	100,000,000	97,731,000
第394回信金中金債（5年）	100,000,000	98,117,000
第417回信金中金債（5年）	200,000,000	192,742,000
第41号商工債（10年）	100,000,000	90,132,000
第19回韓国輸出入銀行円貨債券	200,000,000	198,018,000
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	188,944,000
第87回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	96,133,000

	第103回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,880,000	
	第114回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,186,000	
	第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,711,000	
	第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,513,000	
	第103回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,573,000	
	第107回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	194,314,000	
	第109回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	194,594,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	293,076,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,568,000	
	第87回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	291,774,000	
	第90回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,953,000	
	第66回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	98,408,000	
	特殊債券合計	23,459,536,000	20,787,361,787	
社債券	第44回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	200,000,000	197,646,000	
	第47回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,294,000	
	第38回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,250,000	
	第41回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	197,996,000	
	第44回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,964,000	
	第25回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,173,000	
	第30回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	97,485,000	
	第8回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債(2023)	200,000,000	195,384,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,971,000	
	第37回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	96,766,000	
	第52回鹿島建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,354,000	
	第12回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	96,292,000	
	第9回日揮ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,816,000	
	第22回森永乳業株式会社無担保社債	100,000,000	95,794,000	
	第37回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,180,000	
	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	97,576,000	
	第25回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,227,000	
	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	90,755,000	
	第28回味の素株式会社無担保社債	300,000,000	292,176,000	
	第18回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	97,785,000	
	第11回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	97,877,000	

第15回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	97,710,000	
第11回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	98,041,000	
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	94,552,000	
第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	98,583,000	
第26回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	98,896,000	
第31回レンゴー株式会社無担保社債	100,000,000	97,413,000	
第4回株式会社レゾナック・ホールディングス無担保社債	100,000,000	97,127,000	
第23回デンカ株式会社無担保社債	100,000,000	98,827,000	
第15回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	96,817,000	
第62回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	95,005,000	
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	68,492,000	
第22回UBE株式会社無担保社債	100,000,000	98,967,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	92,448,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	94,121,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	200,000,000	179,960,000	
第3回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	96,163,000	
第10回第一三共株式会社無担保社債	100,000,000	96,778,000	
第7回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,105,000	
第10回関西ペイント株式会社無担保社債	100,000,000	99,023,000	
第11回関西ペイント株式会社無担保社債	100,000,000	97,398,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	94,297,000	
第13回住友三井オートサービス株式会社無担保社債	100,000,000	97,797,000	
第14回住友三井オートサービス株式会社無担保社債	100,000,000	97,915,000	
第3回サワイグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,303,000	
第20回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	197,906,000	
第24回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,004,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	91,495,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	95,938,000	
第9回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	98,309,000	
第9回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	97,022,000	
第72回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	98,925,000	
第42回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,552,000	
第41回三菱マテリアル株式会社無担保社債	100,000,000	100,005,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,067,000	
第17回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	98,947,000	

第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	91,613,000	
第13回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	91,632,000	
第33回ダイキン工業株式会社無担保社債	100,000,000	92,742,000	
第53回日本精工株式会社無担保社債	100,000,000	98,375,000	
第22回THK株式会社無担保社債	100,000,000	97,805,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	93,970,000	
第1回オムロン株式会社無担保社債	100,000,000	99,080,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	92,014,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	92,717,000	
第27回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,945,000	
第29回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,286,000	
第15回株式会社デンソー無担保社債	200,000,000	197,124,000	
第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	98,490,000	
第30回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	95,430,000	
第32回マツダ株式会社無担保社債	100,000,000	96,716,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	94,753,000	
第6回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	97,553,000	
第12回TOPPANホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,313,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	72,018,000	
第119回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	96,334,000	
第10回長瀬産業株式会社無担保社債	100,000,000	92,956,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	100,772,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	91,319,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	193,622,000	
第87回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	97,264,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	96,897,000	
第115回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	97,224,000	
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	94,541,000	
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	98,370,000	
第41回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	97,167,000	
第26回みずほリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,714,000	
第33回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,049,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	279,117,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	283,869,000	
第28回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	97,456,000	
第34回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	92,961,000	
第38回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	91,524,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	96,715,000	

第88回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	98,796,000	
第97回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	98,620,000	
第36回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	94,796,000	
第24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	99,484,000	
第87回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	97,483,000	
第33回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	97,060,000	
第42回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,187,000	
第217回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	97,438,000	
第54回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,752,000	
第3回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	90,354,000	
第25回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,088,000	
第45回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,013,000	
第10回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	97,153,000	
第1回損害保険ジャパン株式会社無担保社債	100,000,000	98,180,000	
第14回NECキャピタルソリューション株式会社無担保社債	100,000,000	97,404,000	
第29回NECキャピタルソリューション株式会社無担保社債	100,000,000	98,450,000	
第5回株式会社T&Dホールディングス無担保社債	100,000,000	97,424,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	98,501,000	
第78回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	74,318,000	
第89回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	96,066,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,433,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	73,706,000	
第143回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	91,469,000	
第111回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,740,000	
第3回東急株式会社無担保社債	100,000,000	93,846,000	
第16回東急株式会社無担保社債	100,000,000	95,198,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	73,202,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	74,582,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	56,397,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	73,994,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,089,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,892,000	
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	55,191,000	
第132回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	60,935,000	

第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	53,365,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	71,418,000	
第166回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	53,538,000	
第176回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	46,125,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	50,537,000	
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	62,613,000	
第53回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	53,353,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,683,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	82,392,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	101,533,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	101,817,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,124,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	53,662,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	55,873,000	
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	187,856,000	
第52回名古屋鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	82,832,000	
第75回名古屋鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,864,000	
第11回センコーグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	96,641,000	
第13回センコーグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	96,759,000	
第8回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	91,217,000	
第13回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	90,450,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	200,000,000	193,512,000	
第38回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	94,914,000	
第42回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,820,000	
第17回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	95,768,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	79,238,000	
第37回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	76,660,000	
第535回中部電力株式会社社債	200,000,000	188,972,000	
第574回中部電力株式会社社債	100,000,000	94,930,000	
第509回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,860,000	
第510回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,675,000	
第536回関西電力株式会社社債	200,000,000	185,630,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	90,853,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	93,467,000	
第426回中国電力株式会社社債	100,000,000	93,139,000	
第443回中国電力株式会社社債	200,000,000	194,976,000	
第448回中国電力株式会社社債	100,000,000	90,497,000	
第463回中国電力株式会社社債	100,000,000	94,284,000	
第321回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,847,000	

第364回北陸電力株式会社社債	100,000,000	90,430,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	96,133,000	
第521回東北電力株式会社社債	100,000,000	94,034,000	
第535回東北電力株式会社社債	200,000,000	193,396,000	
第536回東北電力株式会社社債	100,000,000	90,386,000	
第569回東北電力株式会社社債	100,000,000	93,159,000	
第296回四国電力株式会社社債	100,000,000	98,081,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,116,000	
第507回九州電力株式会社社債	200,000,000	181,906,000	
第516回九州電力株式会社社債	300,000,000	271,659,000	
第323回北海道電力株式会社社債	100,000,000	97,846,000	
第357回北海道電力株式会社社債	100,000,000	95,995,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	91,145,000	
第396回北海道電力株式会社社債	100,000,000	91,490,000	
第56回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	88,064,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,087,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,448,000	
第93回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	95,198,000	
第8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,595,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,553,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	95,572,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	91,690,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	240,951,000	
第66回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	90,779,000	
第77回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	94,684,000	
第83回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,322,000	
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	95,248,000	
第6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	95,129,000	
第38回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	84,512,000	
第51回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	55,098,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	54,251,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	91,488,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	70,734,000	
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	97,541,000	
社債券合計	22,700,000,000	20,970,771,000	
合計		421,392,099,677	

## 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

	2026年 2月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,170,009,663
コール・ローン	1,151,772,990
株式	688,113,185,920
投資信託受益証券	133,625,492
投資証券	11,358,871,788
派生商品評価勘定	169,851,309
未収入金	21,467,461
未収配当金	587,668,708
未収利息	22,628
前払金	397,976
差入委託証拠金	5,914,797,616
流動資産合計	718,621,671,551
資産合計	718,621,671,551
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	180,551,742
未払解約金	100,343,266
流動負債合計	280,895,008
負債合計	280,895,008
純資産の部	
元本等	
元本	76,885,379,888
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	641,455,396,655
元本等合計	718,340,776,543
純資産合計	718,340,776,543
負債純資産合計	718,621,671,551

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 2月24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</p>

2026年 2月24日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2026年 2月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	76,885,379,888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 9.3430円 (1万口当たり純資産額) (93,430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

2026年 2月24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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、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。</p>
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

	2026年 2月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(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、当該帳簿価額によつております。
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つた場合、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ぬ。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありませぬ。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	2026年 2月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 2月22日
期首元本額	79,947,662,610円
期中追加設定元本額	5,887,853,569円
期中一部解約元本額	8,950,136,291円
期末元本額	76,885,379,888円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,286,805,782円
D C 外国株式インデックスファンド	5,061,842,566円
D C 外国株式インデックスファンド L	30,687,187,920円
D C バランスファンド 3 0	339,211,563円
D C バランスファンド 5 0	912,794,490円
D C バランスファンド 7 0	786,519,102円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	207,061,364円
外国株式インデックス e	3,681,095,291円
インデックスコレクション ( 外国株式 )	20,404,840,547円
インデックスコレクション ( バランス株式 3 0 )	1,793,061,460円
インデックスコレクション ( バランス株式 5 0 )	1,005,332,367円
インデックスコレクション ( バランス株式 7 0 )	1,373,002,863円
私募外国株式パッシブファンド ( 適格機関投資家専用 )	4,943,650,146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 )	1,540,280,373円
外国株式インデックスファンド V A ( 適格機関投資家専用 )	210,801,947円
バランス V A 3 0 ( 適格機関投資家専用 )	4,860,525円
バランス V A 5 0 ( 適格機関投資家専用 )	84,007,689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 )	9,656,135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 )	30,124,809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 )	39,933,375円
バランス V A 2 5 ( 適格機関投資家専用 )	51,725,805円
バランス V A 3 7 . 5 ( 適格機関投資家専用 )	79,192,719円
バランス V A 5 0 L ( 適格機関投資家専用 )	1,615,659,438円
バランス V A 7 5 ( 適格機関投資家専用 )	221,296,818円

区分	2026年 2月24日現在
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）	28,367,398円
V Aポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	244,341,986円
V Aポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	3,278,345円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	31,039,808円
V Aバランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	27,031,328円
V Aバランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	93,532,858円
V Aファンド 2 5（適格機関投資家専用）	1,517,737円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	20,247,711円
V Aバランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	61,429,314円
私募外国株式インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	4,648,309円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2026年 2月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,867,356,061
投資信託受益証券	4,941,885
投資証券	527,039,776
合計	3,335,374,400

(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

（2026年 2月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	18,652,661,044	-	18,652,263,068	397,976
合計		18,652,661,044	-	18,652,263,068	397,976

## (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はありません。

## 通貨関連

（2026年 2月24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	1,078,670,563	-	1,068,377,696	10,292,867
	アメリカドル	786,039,033	-	780,858,021	5,181,012
	ユーロ	222,741,600	-	218,922,840	3,818,760
	イギリスポンド	63,904,230	-	62,615,580	1,288,650
	スウェーデンクローナ	5,985,700	-	5,981,255	4,445
	売建	57,239,800	-	57,249,390	9,590

デンマーククローネ	24,433,000	-	24,438,600	5,600
オーストラリアドル	32,806,800	-	32,810,790	3,990
合計	1,135,910,363	-	1,125,627,086	10,302,457

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	56,594	63.67	3,603,339.98	
	CHENIERE ENERGY INC	12,816	223.35	2,862,453.60	
	CHEVRON CORP	109,374	184.91	20,224,346.34	
	CONOCOPHILLIPS	70,565	109.88	7,753,682.20	
	COTERRA ENERGY INC	41,058	30.75	1,262,533.50	
	DEVON ENERGY CORPORATION	36,666	43.67	1,601,204.22	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	10,676	173.82	1,855,702.32	
	EOG RESOURCES INC	31,475	122.31	3,849,707.25	
	EQT CORPORATION	35,989	59.03	2,124,430.67	
	EXPAND ENERGY CORP	11,833	103.18	1,220,928.94	
	EXXON MOBIL	242,131	150.76	36,503,669.56	
	HALLIBURTON CO	51,295	35.24	1,807,635.80	
	KINDER MORGAN INC	115,314	32.70	3,770,767.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	17,533	192.82	3,380,713.06	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	42,607	52.43	2,233,885.01	
	ONEOK INC	35,918	87.33	3,136,718.94	
	PHILLIPS 66	23,509	154.85	3,640,368.65	
	SLB LTD	82,516	51.24	4,228,119.84	
	TARGA RESOURCES CORP	12,379	231.87	2,870,318.73	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	3,564	502.85	1,792,157.40	
	VALERO ENERGY CORP	17,417	197.39	3,437,941.63	
	WILLIAMS COS	69,054	72.98	5,039,560.92	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,937	283.25	3,664,405.25	
	AMCOR PLC	26,687	50.58	1,349,828.46	
	AMRIZE LTD	27,526	63.63	1,751,479.38	
	AVERY DENNISON CORP	4,953	196.62	973,858.86	
	BALL CORP	13,886	67.14	932,306.04	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	95.45	990,675.55
CORTEVA INC	37,964	76.46	2,902,727.44
CRH PLC	38,049	121.49	4,622,573.01
DOW INC	42,336	30.30	1,282,780.80
DUPONT DE NEMOURS INC	23,669	50.08	1,185,343.52
ECOLAB INC	14,774	305.67	4,515,968.58
FREEMPORT-MCMORAN INC	80,748	65.55	5,293,031.40
INT'L PAPER CO	28,836	44.41	1,280,606.76
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,928	82.24	1,145,438.72
LINDE PLC	26,570	498.19	13,236,908.30
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,698	56.66	832,788.68
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,496	683.60	2,389,865.60
NEWMONT CORPORATION	62,078	124.25	7,713,191.50
NUCOR CORP	12,567	178.85	2,247,607.95
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,174	225.55	1,166,995.70
PPG INDUSTRIES INC	12,417	125.35	1,556,470.95
RELIANCE INC	3,200	322.70	1,032,640.00
RPM INTERNATIONAL INC	6,894	116.01	799,772.94
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,647	364.27	4,971,192.69
SMURFIT WESTROCK PLC	28,640	46.29	1,325,745.60
STEEL DYNAMICS INC	8,151	196.01	1,597,677.51
VULCAN MATERIALS CO	7,535	310.79	2,341,802.65
3 M COMPANY	30,691	166.34	5,105,140.94
AECOM	7,200	93.28	671,616.00
AERCAP HOLDINGS NV	9,720	147.74	1,436,032.80
ALLEGION PLC	4,638	158.67	735,911.46
AMETEK INC	13,319	231.45	3,082,682.55
AXON ENTERPRISE INC	4,059	423.44	1,718,742.96
BLOOM ENERGY CORP- A	12,847	160.28	2,059,117.16
BOEING CO	44,127	230.44	10,168,625.88
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,900	107.28	740,232.00
CARLISLE COS INC	2,452	400.67	982,442.84
CARRIER GLOBAL CORP	43,538	63.46	2,762,921.48
CATERPILLAR	26,576	756.47	20,103,946.72
CNH INDUSTRIAL NV	57,411	12.73	730,842.03
COMFORT SYSTEMS USA INC	2,035	1,413.57	2,876,614.95
CUMMINS INC	7,929	587.36	4,657,177.44
DEERE&CO	14,704	646.84	9,511,135.36
DOVER CORP	7,577	230.73	1,748,241.21
EATON CORP	22,006	362.05	7,967,272.30
EMCOR GROUP INC	2,546	806.66	2,053,756.36
EMERSON ELECTRIC CO	31,834	145.51	4,632,165.34

FASTENAL CO	66,183	45.05	2,981,544.15
FERGUSON ENTERPRISES INC	10,959	251.31	2,754,106.29
FORTIVE CORP	20,480	57.18	1,171,046.40
GE AEROSPACE	60,179	338.99	20,400,079.21
GE VERNOVA INC	15,612	831.70	12,984,500.40
GENERAL DYNAMICS CORP	13,173	348.98	4,597,113.54
GRACO INC	8,952	92.87	831,372.24
GRAINGER (WW) INC	2,543	1,116.75	2,839,895.25
HEICO CORP	2,252	346.27	779,800.04
HEICO CORP-CLASS A	4,228	258.86	1,094,460.08
HONEYWELL INTL INC	35,896	243.06	8,724,881.76
HOWMET AEROSPACE INC	22,086	257.04	5,676,985.44
HUBBELL INC	2,927	516.99	1,513,229.73
IDEX CORP	3,983	206.65	823,086.95
ILLINOIS TOOL WORKS	15,702	293.22	4,604,140.44
INGERSOLL-RAND INC	22,994	93.94	2,160,056.36
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	80.16	769,536.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	37,145	142.83	5,305,420.35
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,790	355.14	3,831,960.60
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,906	554.84	1,057,525.04
LOCKHEED MARTIN CORP	11,870	660.62	7,841,559.40
MASCO CORP	12,110	73.82	893,960.20
NORDSON CORP	3,191	288.82	921,624.62
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,707	725.39	5,590,580.73
OTIS WORLDWIDE CORP	23,094	90.55	2,091,161.70
PACCAR INC	29,938	126.06	3,773,984.28
PARKER HANNIFIN CORP	7,149	1,008.97	7,213,126.53
PENTAIR PLC	9,772	101.66	993,421.52
QUANTA SERVICES INC	8,368	549.11	4,594,952.48
ROCKET LAB CORP	24,963	70.21	1,752,652.23
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,432	387.63	2,493,236.16
RTX CORP	76,501	201.92	15,447,081.92
SNAP-ON INC	2,841	385.37	1,094,836.17
TEXTRON	10,911	98.80	1,078,006.80
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,822	459.94	5,897,350.68
TRANSDIGM GROUP INC	3,231	1,296.15	4,187,860.65
UNITED RENTALS INC	3,711	882.70	3,275,699.70
VERTIV HOLDINGS CO-A	21,018	245.42	5,158,237.56
WABTEC CORP	9,524	262.93	2,504,145.32
WATSCO INC	2,000	411.71	823,420.00
XYLEM INC	14,075	127.26	1,791,184.50
AUTOMATIC DATA PROCESS	23,362	205.73	4,806,264.26

BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,038	74.26	522,641.88
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	6,756	175.73	1,187,231.88
CINTAS CORP	20,337	198.33	4,033,437.21
COPART INC	51,154	35.36	1,808,805.44
EQUIFAX INC	6,976	188.43	1,314,487.68
JACOBS SOLUTIONS INC	6,865	131.80	904,807.00
LEIDOS HOLDINGS	6,940	172.00	1,193,680.00
PAYCHEX INC	18,498	87.39	1,616,540.22
PAYCOM SOFTWARE INC	2,625	114.43	300,378.75
REPUBLIC SERVICES INC	12,216	221.19	2,702,057.04
ROLLINS INC	15,210	60.38	918,379.80
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	12,962	69.55	901,507.10
TRANSUNION	10,758	71.23	766,292.34
VERALTO CORP	14,528	92.60	1,345,292.80
VERISK ANALYTICS INC	8,140	181.60	1,478,224.00
WASTE CONNECTIONS INC	14,985	163.00	2,442,555.00
WASTE MANAGEMENT INC	22,788	230.56	5,254,001.28
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	177.20	1,111,752.80
CSX CORP	107,512	41.97	4,512,278.64
DELTA AIR LINES INC	8,645	66.88	578,177.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,795	149.63	1,166,365.85
FEDEX CORP	12,928	383.71	4,960,602.88
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	134,628	4.18	562,745.04
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,321	222.07	959,564.47
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,941	315.03	4,076,803.23
OLD DOMINION FREIGHT LINE	10,497	193.88	2,035,158.36
UBER TECHNOLOGIES INC	112,153	70.72	7,931,460.16
UNION PACIFIC CORP	33,540	263.76	8,846,510.40
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	4,803	107.17	514,737.51
UNITED PARCEL SERVICE B	42,301	115.02	4,865,461.02
APTIV PLC	13,353	76.87	1,026,445.11
FORD MOTOR COMPANY	225,431	13.64	3,074,878.84
GENERAL MOTORS CO	53,821	79.66	4,287,380.86
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	40,190	14.96	601,242.40
TESLA INC	160,666	399.83	64,239,086.78
DECKERS OUTDOOR CORP	8,400	118.17	992,628.00
DR HORTON INC	14,977	164.25	2,459,972.25
GARMIN LTD	9,152	247.10	2,261,459.20
LENNAR CORP-CL A	12,262	116.20	1,424,844.40
LULULEMON ATHLETICA INC	6,410	178.11	1,141,685.10
NIKE B	66,957	63.09	4,224,317.13
NVR INC	161	7,456.83	1,200,549.63

PULTE GROUP INC	11,379	140.21	1,595,449.59
TAPESTRY INC	11,934	152.97	1,825,543.98
AIRBNB INC-CLASS A	25,073	122.96	3,082,976.08
BOOKING HOLDINGS INC	1,836	3,870.83	7,106,843.88
CARNIVAL CORPORATION	57,539	30.42	1,750,336.38
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	75,143	36.61	2,750,985.23
DARDEN RESTAURANTS INC	6,950	214.26	1,489,107.00
DOMINO'S PIZZA INC	1,717	400.36	687,418.12
DOORDASH INC - A	22,044	164.66	3,629,765.04
DRAFTKINGS INC	24,000	21.81	523,440.00
EXPEDIA GROUP INC	6,567	188.51	1,237,945.17
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	9,285	115.42	1,071,674.70
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	13,564	311.80	4,229,255.20
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,446	159.65	390,503.90
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	8,641	141.00	1,218,381.00
LAS VEGAS SANDS CORP	18,196	55.72	1,013,881.12
MARRIOTT INTL A	12,984	342.62	4,448,578.08
MCDONALD'S CORP	40,443	334.56	13,530,610.08
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,466	302.64	4,377,990.24
STARBUCKS CORP	64,151	94.78	6,080,231.78
YUM BRANDS INC	16,259	166.45	2,706,310.55
ALPHABET INC-CL A	330,739	311.49	103,021,891.11
ALPHABET INC-CL C	277,841	311.69	86,600,261.29
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,239	227.52	1,191,977.28
EHOSTAR CORP-A	8,155	107.42	876,010.10
ELECTRONIC ARTS INC	13,708	200.48	2,748,179.84
FOX CORP - CLASS A	12,108	55.34	670,056.72
FOX CORP- CLASS B	6,975	50.85	354,678.75
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	12,328	87.81	1,082,521.68
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,914	158.28	1,410,907.92
META PLATFORMS INC-CLASS A	123,421	637.25	78,650,032.25
NETFLIX INC	241,193	76.02	18,335,491.86
NEWS CORP-CLASS A	19,675	23.00	452,525.00
OMNICOM GROUP	18,421	80.75	1,487,495.75
PINTEREST INC- CLASS A	35,629	16.69	594,648.01
REDDIT INC-CL A	5,058	142.46	720,562.68
ROBLOX CORP -CLASS A	31,128	62.43	1,943,321.04
SNAP INC - A	62,654	4.93	308,884.22
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	9,024	467.83	4,221,697.92
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,120	195.59	1,979,370.80
THE WALT DISNEY CO	101,865	104.41	10,635,724.65
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	26,248	24.17	634,414.16

WARNER BROS DISCOVERY INC	135,638	28.92	3,922,650.96
AMAZON.COM	545,782	205.27	112,032,671.14
AUTOZONE INC	975	3,829.27	3,733,538.25
BEST BUY COMPANY INC	11,511	62.71	721,854.81
BURLINGTON STORES INC	3,549	311.38	1,105,087.62
CARVANA CO	6,671	325.10	2,168,742.10
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,209	211.34	678,190.06
EBAY	26,830	84.31	2,262,037.30
GENUINE PARTS CO	7,768	116.16	902,330.88
HOME DEPOT	56,498	376.99	21,299,181.02
LOWES COMPANIES	31,733	274.36	8,706,265.88
MERCADOLIBRE INC	2,594	1,864.46	4,836,409.24
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	48,888	95.35	4,661,470.80
ROSS STORES INC	18,756	201.89	3,786,648.84
SEA LTD-ADR	21,414	111.24	2,382,093.36
TJX COMPANIES INC	63,743	157.69	10,051,633.67
TRACTOR SUPPLY COMPANY	29,247	53.89	1,576,120.83
ULTA BEAUTY INC	2,482	669.87	1,662,617.34
WILLIAMS-SONOMA INC	7,000	201.88	1,413,160.00
COSTCO WHOLESALE CORP	25,161	986.02	24,809,249.22
DOLLAR GENERAL CORP	12,157	152.90	1,858,805.30
DOLLAR TREE INC	11,506	130.41	1,500,497.46
KROGER CO	34,783	68.26	2,374,287.58
SYSCO CORP	28,275	89.43	2,528,633.25
TARGET (DAYTON HUDSON)	26,160	113.34	2,964,974.40
WALMART INC	249,041	125.81	31,331,848.21
ALTRIA GROUP INC	95,653	68.98	6,598,143.94
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	27,207	67.69	1,841,641.83
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,307	30.20	311,271.40
BUNGE GLOBAL SA	7,516	121.32	911,841.12
COCA-COLA CO	231,912	80.56	18,682,830.72
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,651	107.49	1,359,855.99
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,545	159.42	1,362,243.90
GENERAL MILLS INC	31,192	45.38	1,415,492.96
HERSHEY FOODS CORPORATION	8,190	226.07	1,851,513.30
HORMEL FOODS CORP	15,714	25.16	395,364.24
JM SMUCKER CO	6,809	111.00	755,799.00
KEURIG DR PEPPER INC	71,245	29.77	2,120,963.65
KRAFT HEINZ CO/THE	51,016	24.54	1,251,932.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,652	69.53	949,223.56
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	74,544	60.38	4,500,966.72
MONSTER BEVERAGE CORP	42,171	84.69	3,571,461.99

PEPSICO INC	77,454	168.32	13,037,057.28
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	88,265	187.22	16,524,973.30
TYSON FOODS INC	17,680	62.96	1,113,132.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,150	105.26	1,489,429.00
CLOROX COMPANY	7,594	126.76	962,615.44
COLGATE-PALMOLIVE CO	43,119	97.10	4,186,854.90
ESTEE LAUDER CO-CL A	13,683	113.02	1,546,452.66
KENVUE INC	107,793	18.95	2,042,677.35
KIMBERLY-CLARK CORP	19,092	110.51	2,109,856.92
PROCTER & GAMBLE CO	132,812	165.17	21,936,558.04
ABBOTT LABORATORIES	99,520	115.29	11,473,660.80
BAXTER INTERNATIONAL	31,501	21.26	669,711.26
BECTON DICKINSON & CO	16,080	184.34	2,964,187.20
BOSTON SCIENTIFIC CORP	83,808	74.37	6,232,800.96
CARDINAL HEALTH	13,680	224.82	3,075,537.60
CENCORA INC	10,539	366.03	3,857,590.17
CENTENE CORP	29,946	43.34	1,297,859.64
COOPER COS INC/THE	12,215	82.94	1,013,112.10
CVS HEALTH CORP	71,578	77.00	5,511,506.00
DEXCOM INC	22,165	73.26	1,623,807.90
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	34,369	82.44	2,833,380.36
ELEVANCE HEALTH INC	12,687	335.87	4,261,182.69
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	25,756	83.86	2,159,898.16
HCA HEALTHCARE INC	9,437	535.97	5,057,948.89
HOLOGIC INC	12,961	75.44	977,777.84
HUMANA INC	6,841	181.16	1,239,315.56
IDEXX LABORATORIES INC	4,634	623.13	2,887,584.42
INSULET CORP	4,284	249.38	1,068,343.92
INTUITIVE SURGICAL INC	20,516	492.10	10,095,923.60
LABCORP HOLDINGS INC	4,776	285.30	1,362,592.80
MCKESSON CORP	7,095	949.25	6,734,928.75
MEDTRONIC PLC	72,977	98.61	7,196,261.97
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	207.43	1,295,607.78
RESMED INC	8,586	260.79	2,239,142.94
SOLVENTUM CORP	8,012	72.65	582,071.80
STERIS PLC	5,851	247.11	1,445,840.61
STRYKER CORP	19,593	384.73	7,538,014.89
THE CIGNA GROUP	15,320	283.18	4,338,317.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	51,382	282.34	14,507,193.88
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,100	232.60	721,060.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,662	172.17	1,491,336.54
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,864	99.46	1,179,993.44

ABBVIE INC	100,277	229.48	23,011,565.96
AGILENT TECHNOLOGIES	16,350	124.20	2,030,670.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,550	329.35	2,486,592.50
AMGEN	30,736	379.42	11,661,853.12
BIOGEN INC	8,034	196.34	1,577,395.56
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	114,962	61.25	7,041,422.50
DANAHER CORP	36,467	210.92	7,691,619.64
ELI LILLY & CO	45,718	1,058.56	48,395,246.08
GILEAD SCIENCES INC	70,208	149.83	10,519,264.64
ILLUMINA INC	8,558	120.54	1,031,581.32
INCYTE CORP	9,014	100.84	909,016.83
INSMED INC	12,190	159.03	1,938,575.70
IQVIA HOLDINGS INC	9,804	162.31	1,591,287.24
JOHNSON & JOHNSON	136,772	245.84	33,624,028.48
MERCK & CO	141,660	123.82	17,540,341.20
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,185	1,393.24	1,650,989.40
NATERA INC	6,797	209.35	1,422,951.95
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,281	128.38	806,354.78
PFIZER	323,847	27.06	8,763,299.82
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,008	787.04	4,728,536.32
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	23,158	45.47	1,052,994.26
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	63,846	33.91	2,165,017.86
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,589	516.44	11,149,423.16
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,421	474.52	1,148,812.92
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,485	481.01	6,967,429.85
WATERS CORP	5,482	327.78	1,796,889.96
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,106	244.22	1,002,767.32
ZOETIS INC	24,846	125.79	3,125,378.34
BANK OF AMERICA CORP	399,424	51.07	20,398,583.68
CITIGROUP	104,326	110.75	11,554,104.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,193	62.49	1,574,310.57
FIFTH THIRD BANCORP	51,211	50.71	2,596,909.81
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	488	1,965.72	959,271.36
HUNTINGTON BANCSHARES INC	115,080	17.08	1,965,566.40
JPMORGAN CHASE & CO	156,269	297.67	46,516,593.23
KEY CORP	47,783	21.01	1,003,920.83
M & T BANK CORP	8,674	222.12	1,926,668.88
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	8,700	94.67	823,629.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,190	220.77	4,898,886.30
REGIONS FINL CORP	51,282	28.71	1,472,306.22
TRUIST FINANCIAL CORP	72,407	50.09	3,626,866.63
US BANCORP	90,086	55.81	5,027,699.66

WELLS FARGO & CO	181,736	85.15	15,474,820.40
AFFIRM HOLDINGS INC	15,663	47.13	738,197.19
AMERICAN EXPRESS	31,540	321.24	10,131,909.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,526	453.78	2,507,588.28
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	25,298	113.73	2,877,141.54
ARES MANAGEMENT CORP - A	11,165	114.57	1,279,174.05
BANK NEW YORK CO	40,631	115.54	4,694,505.74
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	78,322	494.09	38,698,116.98
BLACKROCK INC	8,422	1,071.01	9,020,046.22
BLACKSTONE INC	42,529	113.71	4,835,972.59
BLOCK INC	31,222	50.75	1,584,516.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,493	190.00	6,933,670.00
CARLYLE GROUP INC/THE	12,682	49.52	628,012.64
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,992	290.11	1,738,339.12
CME GROUP INC	20,449	314.00	6,420,986.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	11,265	160.24	1,805,103.60
COREBRIDGE FINANCIAL INC	13,006	27.26	354,543.56
CORPAY INC	3,879	332.57	1,290,039.03
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	40.21	742,316.81
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	31,029	47.46	1,472,636.34
FISERV INC	31,649	58.40	1,848,301.60
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,543	146.75	519,935.25
GLOBAL PAYMENTS INC	13,229	79.49	1,051,573.21
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,172	892.31	15,322,747.32
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	25,440	71.54	1,819,977.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	32,287	154.10	4,975,426.70
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,616	155.68	718,618.88
KKR & CO INC	36,018	92.19	3,320,499.42
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,627	303.88	1,406,052.76
MASTERCARD INC-CLASS A	48,406	496.03	24,010,828.18
MOODY'S CORP	9,312	437.11	4,070,368.32
MORGAN STANLEY	67,857	166.80	11,318,547.60
MSCI INC	4,462	538.39	2,402,296.18
NASDAQ INC	24,462	79.92	1,955,003.04
NORTHERN TRUST CORP	10,567	140.38	1,483,395.46
PAYPAL HOLDINGS INC	50,832	44.05	2,239,149.60
PRICE T ROWE GROUP INC	13,208	93.06	1,229,136.48
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,558	153.13	1,616,746.54
ROBINHOOD MARKETS INC - A	41,178	71.78	2,955,756.84
ROCKET COS INC-CLASS A	52,700	17.09	900,643.00
S&P GLOBAL INC	17,950	404.78	7,265,801.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	98,583	92.75	9,143,573.25

SOFI TECHNOLOGIES INC	67,383	18.22	1,227,718.26
STATE STREET CORP	15,678	125.13	1,961,788.14
SYNCHRONY FINANCIAL	21,397	68.88	1,473,825.36
TOAST INC-CLASS A	28,589	25.07	716,726.23
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,542	118.00	771,956.00
VISA INC-CLASS A SHARES	96,490	306.52	29,576,114.80
AFLAC	29,302	112.35	3,292,079.70
ALLSTATE CORP	15,236	206.16	3,141,053.76
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	129.61	492,906.83
AMERICAN INT'L GROUP	31,950	79.98	2,555,361.00
AON PLC	11,563	315.31	3,645,929.53
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,742	98.70	2,047,235.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,440	214.33	3,094,925.20
BROWN & BROWN INC	17,365	69.16	1,200,963.40
CHUBB LTD	21,843	333.39	7,282,237.77
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,155	160.91	1,473,131.05
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	263.77	380,883.88
EVEREST GROUP LTD	2,474	337.77	835,642.98
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	15,987	51.03	815,816.61
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	16,673	140.54	2,343,223.42
LOEWS CORP	10,482	108.71	1,139,498.22
MARKEL GROUP INC	702	2,066.61	1,450,760.22
MARSH & MCLENNAN COS	27,741	176.99	4,909,879.59
METLIFE INC	31,573	75.24	2,375,552.52
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	92.69	1,179,480.25
PROGRESSIVE CORP	33,469	203.69	6,817,300.61
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,636	100.88	1,980,879.68
TRAVELERS COS INC/THE	12,644	305.39	3,861,351.16
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,626	291.52	1,640,091.52
WR BERKLEY CORP	17,499	71.00	1,242,429.00
WEYERHAEUSER CO	40,664	25.13	1,021,886.32
ACCENTURE PLC-CL A	35,108	201.18	7,063,027.44
ADOBE INC	23,672	246.68	5,839,408.96
APPLOVIN CORP-CLASS A	13,055	380.62	4,968,994.10
ATLASSIAN CORP-CL A	9,723	68.81	669,039.63
AUTODESK INC	12,284	218.64	2,685,773.76
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,160	32.20	262,752.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	15,715	279.80	4,397,057.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,694	154.73	726,302.62
CLOUDFLARE INC - CLASS A	18,306	160.19	2,932,438.14
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	28,407	61.13	1,736,519.91
COREWEAVE INC-CL A	9,428	90.84	856,439.52

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,388	350.33	5,040,548.04
DATADOG INC - CLASS A	17,711	102.61	1,817,414.26
DOCUSIGN INC	10,873	41.75	453,947.75
DYNATRACE INC	18,651	33.64	627,419.64
FAIR ISAAC CORP	1,338	1,281.64	1,714,834.32
FORTINET INC	36,470	75.60	2,757,132.00
GARTNER INC	4,549	144.97	659,468.53
GEN DIGITAL INC	29,838	21.65	645,992.70
GODADDY INC - CLASS A	7,951	87.76	697,779.76
HUBSPOT INC	2,971	217.36	645,776.56
INTL BUSINESS MACHINES CORP	53,268	223.35	11,897,407.80
INTUIT INC	15,788	359.55	5,676,575.40
MICROSOFT CORP	401,570	384.47	154,391,617.90
MONDAY.COM LTD	2,400	70.12	168,300.00
MONGODB INC	4,115	305.37	1,256,597.55
NEBIUS GROUP NV	12,233	100.61	1,230,762.13
NUTANIX INC - A	14,588	37.38	545,299.44
OKTA INC	9,345	69.51	649,570.95
ORACLE CORP	97,486	141.31	13,775,746.66
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	129,189	130.60	16,872,083.40
PALO ALTO NETWORKS INC	45,944	144.14	6,622,368.16
PTC INC	7,030	150.88	1,060,686.40
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,122	335.70	2,055,155.40
SALESFORCE INC	53,976	178.16	9,616,364.16
SAMSARA INC-CL A	16,923	24.72	418,336.56
SERVICENOW INC	59,305	100.80	5,977,944.00
SNOWFLAKE INC	18,562	157.60	2,925,371.20
STRATEGY INC	15,143	123.71	1,873,340.53
SYNOPSYS INC	10,403	420.82	4,377,790.46
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,869	65.42	907,309.98
TWILIO INC - A	9,334	108.50	1,012,739.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,478	317.43	786,591.54
VERISIGN INC	5,080	211.49	1,074,369.20
WIX.COM LTD	3,273	62.80	205,544.40
WORKDAY INC-CLASS A	12,333	129.21	1,593,546.93
ZOOM COMMUNICATIONS INC	15,053	86.06	1,295,461.18
ZSCALER INC	6,238	143.28	893,780.64
AMPHENOL CORPORATION	68,993	147.82	10,198,545.26
APPLE INC	843,960	266.18	224,645,272.80
ARISTA NETWORKS INC	61,004	127.43	7,773,739.72
CDW CORP/DE	7,411	123.13	912,516.43
CIENA CORP	8,135	344.84	2,805,273.40

CISCO SYSTEMS	224,247	77.74	17,432,961.78
CORNING	45,772	145.25	6,648,383.00
DELL TECHNOLOGIES -C	18,365	119.14	2,188,006.10
F5 INC	3,114	269.52	839,285.28
FLEX LTD	21,566	63.30	1,365,127.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	75,299	20.00	1,505,980.00
HP INC	53,353	18.35	979,027.55
IONQ INC	17,031	30.78	524,214.18
JABIL INC	5,732	261.28	1,497,656.96
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,911	245.00	2,428,195.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,722	465.03	4,521,021.66
NETAPP INC	11,393	100.53	1,145,338.29
PURE STORAGE INC - CLASS A	17,131	68.44	1,172,445.64
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,282	407.40	5,003,686.80
SUPER MICRO COMPUTER INC	30,990	30.71	951,702.90
TE CONNECTIVITY PLC	16,614	231.28	3,842,485.92
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,845	672.42	1,913,034.90
WESTERN DIGITAL CORP	20,197	280.42	5,663,642.74
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,892	231.32	668,977.44
AT&T INC	404,804	28.52	11,545,010.08
COMCAST CORP-CL A	209,479	31.63	6,625,820.77
T-MOBILE US INC	29,246	219.95	6,432,657.70
VERIZON COMMUNICATIONS	239,075	49.68	11,877,246.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	13,919	71.91	1,000,915.29
AMEREN CORPORATION	14,991	111.16	1,666,399.56
AMERICAN ELECTRIC POWER	30,895	132.03	4,079,066.85
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,087	132.92	1,473,684.04
ATMOS ENERGY CORP	9,420	181.72	1,711,802.40
CENTERPOINT ENERGY INC	36,651	42.89	1,571,961.39
CMS ENERGY CORP	17,231	76.30	1,314,725.30
CONSOLIDATED EDISON INC	20,558	112.14	2,305,374.12
CONSTELLATION ENERGY	17,635	293.80	5,181,163.00
DOMINION ENERGY INC	47,741	64.23	3,066,404.43
DTE ENERGY COMPANY	12,475	145.85	1,819,478.75
DUKE ENERGY CORP	43,843	127.79	5,602,696.97
EDISON INTL	21,304	74.65	1,590,343.60
ENERGY CORP	24,548	104.87	2,574,348.76
ESSENTIAL UTILITIES INC	18,012	39.28	707,511.36
EVERGY INC	12,472	82.11	1,024,075.92
EVERSOURCE ENERGY	21,065	74.87	1,577,136.55
EXELON CORP	59,536	48.20	2,869,635.20
FIRSTENERGY CORP	30,792	50.44	1,553,148.48

	NEXTERA ENERGY INC	117,628	94.06	11,064,089.68
	NISOURCE INC	25,553	46.20	1,180,548.60
	NRG ENERGY INC	10,697	176.52	1,888,234.44
	OKLO INC	6,155	63.09	388,318.95
	PG&E CORP	128,135	18.48	2,367,934.80
	PPL CORPORATION	45,254	37.26	1,686,164.04
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	28,637	86.31	2,471,659.47
	SEMPRA	38,151	93.60	3,570,933.60
	SOUTHERN CO	63,803	95.18	6,072,769.54
	VISTRA CORP	19,603	167.80	3,289,383.40
	WEC ENERGY GROUP INC	18,373	115.80	2,127,593.40
	XCEL ENERGY INC	33,943	83.35	2,829,149.05
	ADVANCED MICRO DEVICES	92,090	196.60	18,104,894.00
	ANALOG DEVICES	27,829	355.15	9,883,469.35
	APPLIED MATERIALS	45,166	373.55	16,871,759.30
	ASTERA LABS INC	7,669	128.24	983,472.56
	BROADCOM INC	255,053	330.34	84,254,208.02
	CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDI	8,979	124.05	1,113,844.95
	ENTEGRIS INC	8,797	136.42	1,200,086.74
	FIRST SOLAR INC	5,850	242.15	1,416,577.50
	INTEL CORP	256,033	43.63	11,170,719.79
	KLA CORP	7,475	1,487.66	11,120,258.50
	LAM RESEARCH CORP	71,523	242.27	17,327,877.21
	MARVELL TECHNOLOGY INC	48,489	77.79	3,771,959.31
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	31,692	76.60	2,427,607.20
	MICRON TECHNOLOGY	63,716	420.97	26,822,524.52
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,829	1,190.06	3,366,679.74
	NVIDIA CORP	1,381,960	191.55	264,714,438.00
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,150	231.16	3,270,914.00
	ON SEMICONDUCTOR CORP	24,703	69.47	1,716,117.41
	QNITY ELECTRONICS INC	11,834	111.58	1,320,437.72
	QUALCOMM	60,785	140.41	8,534,821.85
	TERADYNE INC	9,235	318.50	2,941,347.50
	TEXAS INSTRUMENTS	51,472	219.86	11,316,633.92
	CBRE GROUP INC-A	16,797	144.18	2,421,791.46
	COSTAR GROUP INC	25,311	47.87	1,211,637.57
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	8.71	560,053.00
	ZILLOW GROUP INC-C	8,148	42.83	348,978.84
	アメリカドル 小計	21,044,725		3,332,835,540.35 (516,122,911,778)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	36,244	24.70	895,226.80
	CAMECO CORP	23,649	162.61	3,845,563.89

CANADIAN NATURAL RESOURCES	122,354	58.02	7,098,979.08
CENOVUS ENERGY INC	77,972	30.88	2,407,775.36
ENBRIDGE	123,593	71.75	8,867,797.75
IMPERIAL OIL	9,983	162.50	1,622,237.50
KEYERA CORP	10,963	51.83	568,212.29
PEMBINA PIPELINE CORP	32,665	60.49	1,975,905.85
SUNCOR ENERGY	69,724	77.07	5,373,628.68
TC ENERGY CORP	58,491	86.50	5,059,471.50
TOURMALINE OIL CORP	20,945	62.74	1,314,089.30
WHITECAP RESOURCES INC	72,100	13.76	992,096.00
AGNICO EAGLE MINES	28,971	329.66	9,550,579.86
ALAMOS GOLD INC-CLASS A	24,420	68.08	1,662,513.60
BARRICK MINING CORP	95,931	67.59	6,483,976.29
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	90.82	663,167.64
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	44,533	38.31	1,706,059.23
FRANCO-NEVADA CORP	11,522	371.16	4,276,505.52
IVANHOE MINES LTD-CL A	35,897	15.05	540,249.85
KINROSS GOLD CORP	67,582	48.68	3,289,891.76
LUNDIN GOLD INC	6,808	116.00	789,728.00
LUNDIN MINING CORP	39,506	41.63	1,644,634.78
NUTRIEN LTD	26,434	98.48	2,603,220.32
PAN AMERICAN SILVER CORP	24,452	89.36	2,185,030.72
TECK RESOURCES LTD-CL B	27,966	81.02	2,265,805.32
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,120	213.54	5,577,664.80
ATKINSREALIS GROUP INC	10,000	91.56	915,600.00
BOMBARDIER INC-B	5,192	263.66	1,368,922.72
CAE INC	16,864	39.72	669,838.08
STANTEC INC	6,135	120.75	740,801.25
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	202.35	863,832.15
WSP GLOBAL INC	7,506	216.20	1,622,797.20
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	20,483	34.30	702,566.90
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	11,755	57.86	680,144.30
RB GLOBAL INC	9,676	134.70	1,303,357.20
THOMSON REUTERS CORP	9,577	110.84	1,061,514.68
CANADIAN NATL RAILWAY CO	30,330	150.78	4,573,157.40
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	52,301	116.15	6,074,761.15
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	157.60	729,688.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,682	87.59	1,285,996.38
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	96.90	969,000.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,311	92.54	1,601,959.94
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	186.98	483,530.28
DOLLARAMA INC	15,355	195.69	3,004,819.95

	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	41,739	85.26	3,558,667.14	
	EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	49.91	365,840.30	
	LOBLAW COMPANIES LTD	32,938	69.26	2,281,285.88	
	METRO INC	11,718	99.56	1,166,644.08	
	WESTON (GEORGE) LTD	9,277	103.00	955,531.00	
	SAPUTO INC	14,064	42.72	600,814.08	
	BANK MONTREAL	40,663	194.97	7,928,065.11	
	BANK NOVA SCOTIA	71,603	104.01	7,447,428.03	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	53,925	135.96	7,331,643.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	22,772	178.45	4,063,663.40	
	ROYAL BANK OF CANADA	79,664	234.00	18,641,376.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	96,262	131.30	12,639,200.60	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	24,728	65.65	1,623,393.20	
	BROOKFIELD CORP	118,729	60.28	7,156,984.12	
	IGM FINANCIAL INC	3,890	67.32	261,874.80	
	TMX GROUP LTD	16,225	46.32	751,542.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,082	2,336.59	2,528,190.38	
	GREAT-WEST LIFECO INC	15,674	64.89	1,017,085.86	
	IA FINANCIAL CORP INC	5,415	153.76	832,610.40	
	INTACT FINANCIAL CORP	9,825	258.83	2,543,004.75	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	95,160	49.23	4,684,726.80	
	POWER CORP OF CANADA	29,442	66.89	1,969,375.38	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	32,024	88.47	2,833,163.28	
	CGI INC - CL A	11,043	97.66	1,078,459.38	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,203	2,406.97	2,895,584.91	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,402	86.02	378,660.04	
	OPEN TEXT CORP	15,045	32.51	489,112.95	
	SHOPIFY INC - CLASS A	69,528	160.67	11,171,063.76	
	CELESTICA INC	6,797	406.47	2,762,776.59	
	BCE INC	3,102	35.72	110,803.44	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	22,766	52.85	1,203,183.10	
	TELUS CORP	23,120	18.60	430,032.00	
	ALTAGAS INCOME LTD	14,516	45.40	659,026.40	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	6,264	59.02	369,701.28	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	48.25	288,438.50	
	EMERA INC	19,067	70.13	1,337,168.71	
	FORTIS INC	29,864	78.24	2,336,559.36	
	HYDRO ONE LTD	20,457	57.64	1,179,141.48	
	FIRSTSERVICE CORP	2,028	207.65	421,114.20	
	カナダドル 小計	2,464,108		232,205,234.96 (26,250,801,812)	
ユーロ	BOLLORE SE	51,405	4.85	249,622.68	

ENI	113,922	18.68	2,128,518.64
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	22,193	18.57	412,234.97
NESTE OIL OYJ	21,882	21.07	461,053.74
OMV AG	8,243	55.50	457,486.50
REPSOL SA	71,632	18.52	1,326,982.80
TENARIS SA	19,465	22.60	439,909.00
TOTALENERGIES SE	112,814	66.14	7,461,517.96
AIR LIQUIDE	32,930	174.76	5,754,846.80
AKZO NOBEL	9,224	59.74	551,041.76
ARCELORMITTAL	26,680	56.48	1,506,886.40
BASF SE	52,265	48.87	2,554,190.55
BUZZI SPA	4,029	49.02	197,501.58
DSM-FIRMENICH AG	9,907	60.46	598,977.22
EVONIK INDUSTRIES AG	19,273	15.23	293,527.79
HEIDELBERG MATERIALS AG	7,446	203.50	1,515,261.00
STORA ENSO OYJ R	36,068	11.20	403,961.60
SYENSQO SA	3,676	77.64	285,404.64
SYMRISE AG	7,051	75.80	534,465.80
UPM KYMMENE OYJ	32,788	26.81	879,046.28
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,089	106.20	965,251.80
AIRBUS SE	33,620	183.14	6,157,166.80
ALSTOM	16,908	29.12	492,360.96
BOUYGUES ORD	11,344	51.36	582,627.84
BRENTAG SE	6,434	53.30	342,932.20
CSG NV	11,400	29.75	339,150.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	26,054	42.06	1,095,831.24
DASSAULT AVIATION SA	1,210	346.00	418,660.00
EIFFAGE	4,432	142.80	632,889.60
FERROVIAL SE	29,779	61.64	1,835,577.56
GEA GROUP AG	7,649	65.25	499,097.25
HENSOLDT AG	3,676	80.90	297,388.40
HOCHTIEF AG	896	402.60	360,729.60
IMCD NV	3,050	81.84	249,612.00
KINGSPAN GROUP PLC	9,798	83.80	821,072.40
KNORR-BREMSE AG	4,139	112.10	463,981.90
KONE OYJ-B	19,254	63.44	1,221,473.76
LEGRAND SA	14,610	154.15	2,252,131.50
LEONARDO SPA	23,610	57.98	1,368,907.80
METSO CORPORATION	35,225	17.07	601,290.75
MTU AERO ENGINES AG	2,865	397.50	1,138,837.50
PRYSMIAN SPA	15,275	96.02	1,466,705.50
RATIONAL AG	268	730.00	195,640.00

REXEL SA	15,000	36.67	550,050.00
RHEINMETALL AG	2,641	1,701.50	4,493,661.50
SAFRAN SA	20,502	346.00	7,093,692.00
SAINT-GOBAIN	25,039	88.50	2,215,951.50
SCHNEIDER ELECTRIC SE	31,022	259.75	8,057,964.50
SIEMENS	43,079	240.65	10,366,961.35
SIEMENS ENERGY AG	44,460	165.70	7,367,022.00
THALES SA	5,128	253.50	1,299,948.00
VINCI S.A.	28,324	140.90	3,990,851.60
WARTSILA OYJ	27,778	36.75	1,020,841.50
BUREAU VERITAS SA	21,724	27.42	595,672.08
RANDSTAD NV	5,866	27.04	158,616.64
WOLTERS KLUWER	13,568	59.68	809,738.24
ADP	1,532	120.80	185,065.60
AENA SME SA	41,160	27.41	1,128,195.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	9.18	353,420.82
DHL GROUP	55,718	49.50	2,758,041.00
GETLINK	18,582	17.77	330,202.14
INPOST SA	17,408	15.18	264,253.44
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	81,288	4.92	400,180.82
RYANAIR HOLDINGS PLC	50,805	26.58	1,350,396.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,786	87.70	1,472,132.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,480	87.45	304,326.00
CONTINENTAL AG	6,262	72.16	451,865.92
DR ING HC F PORSCHE AG	5,800	41.17	238,786.00
FERRARI NV	7,221	303.90	2,194,461.90
MERCEDES-BENZ GROUP AG	41,584	58.30	2,424,347.20
MICHELIN	37,018	33.76	1,249,727.68
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,889	35.96	319,648.44
RENAULT SA	11,301	32.01	361,745.01
STELLANTIS NV	123,544	6.47	799,576.76
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,635	99.90	1,162,336.50
ADIDAS AG	9,989	158.60	1,584,255.40
HERMES INTERNATIONAL	1,841	2,106.00	3,877,146.00
KERING	4,318	286.50	1,237,107.00
LVMH	14,165	558.00	7,904,070.00
MONCLER SPA	12,416	58.06	720,872.96
ACCOR	12,281	48.00	589,488.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	25,319	47.54	1,203,665.26
DELIVERY HERO SE	8,935	19.53	174,500.55
FDJ UNITED	5,332	24.60	131,167.20
SODEXO	4,698	47.38	222,591.24

CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,054	65.70	266,347.80
PUBLICIS GROUPE	13,443	71.92	966,820.56
SCOUT24 SE	4,128	69.65	287,515.20
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	63,039	19.03	1,199,947.36
D' IETEREN GROUP	1,617	181.10	292,838.70
INDITEX	62,116	57.44	3,567,943.04
PROSUS	75,028	44.13	3,310,985.64
ZALANDO SE	11,285	20.17	227,618.45
CARREFOUR	30,831	15.86	489,133.81
JERONIMO MARTINS	16,160	22.10	357,136.00
KESKO OYJ-B SHS	14,326	21.16	303,138.16
KONINKLIJKE AHOLD NV	52,445	41.25	2,163,356.25
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	55,933	67.76	3,790,020.08
DANONE (GROUPE)	36,339	72.04	2,617,861.56
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	47,108	6.64	313,079.76
HEINEKEN HOLDING NV	7,127	72.50	516,707.50
HEINEKEN NV	16,000	77.96	1,247,360.00
JDE PEET'S BV	9,274	31.72	294,171.28
KERRY GROUP PLC-A	9,303	72.55	674,932.65
LOTUS BAKERIES	24	10,260.00	246,240.00
MAGNUM ICE CREAM CO NV/THE	28,288	13.43	380,134.14
PERNOD-RICARD	11,584	83.80	970,739.20
BEIERSDORF AG	5,845	107.80	630,091.00
HENKEL AG & CO KGAA	6,247	76.60	478,520.20
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,083	83.58	842,737.14
LOREAL	13,563	397.10	5,385,867.30
BIOMERIEUX	2,374	94.70	224,817.80
ESSILORLUXOTTICA	17,350	236.00	4,094,600.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	13,908	41.39	575,652.12
FRESENIUS SE&CO KGAA	23,936	51.72	1,237,969.92
KONINKLIJKE PHILIPS	46,729	26.32	1,229,907.28
SIEMENS HEALTHINEERS AG	17,834	41.55	741,002.70
ARGENX SE	3,612	703.60	2,541,403.20
BAYER	54,521	42.80	2,333,498.80
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	66.32	430,416.80
FINANCIERE DE TUBIZE	902	235.50	212,421.00
GRIFOLS SA	14,240	11.00	156,640.00
IPSEN	1,866	157.00	292,962.00
MERCK KGAA	7,010	125.90	882,559.00
ORION OYJ-CLASS B	6,364	68.25	434,343.00
QIAGEN N.V.	11,740	40.40	474,296.00
RECORDATI SPA	5,195	47.60	247,282.00

SANOFI	63,096	80.76	5,095,632.96
SARTORIUS AG-VORZUG	1,716	228.30	391,762.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,435	176.70	253,564.50
UCB (GROUPE)	6,756	270.20	1,825,471.20
ABN AMRO BANK NV-CVA	30,543	29.30	894,909.90
AIB GROUP PLC	116,846	8.86	1,035,839.79
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	114,500	8.66	992,257.00
BANCO BILBAO VIZCAYA	326,872	20.06	6,557,052.32
BANCO BPM SPA	61,107	13.00	794,391.00
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	480,466	0.92	442,701.37
BANCO DE SABADELL SA	279,050	3.34	932,864.15
BANCO SANTANDER SA	842,923	10.92	9,211,462.54
BANK OF IRELAND GROUP PLC	45,947	16.81	772,598.80
BANKINTER SA	39,818	14.50	577,361.00
BNP PARIBAS	57,910	95.85	5,550,673.50
BPER BANCA SPA	84,618	12.40	1,049,686.29
CAIXABANK	221,044	10.96	2,423,747.46
COMMERZBANK AG	40,587	34.41	1,396,598.67
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	18.71	1,206,649.62
ERSTE GROUP BANK AG	17,241	107.20	1,848,235.20
FINECOBANK SPA	31,097	19.75	614,165.75
ING GROEP NV-CVA	170,286	25.03	4,263,110.01
INTESA SANPAOLO	811,089	5.86	4,755,414.80
KBC GROEP NV	12,855	117.90	1,515,604.50
NORDEA BANK ABP	180,364	16.75	3,021,097.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,333	42.36	310,625.88
SOCIETE GENERALE	40,196	74.42	2,991,386.32
UNICREDIT SPA	80,005	73.70	5,896,368.50
ADYEN NV	1,479	947.30	1,401,056.70
AMUNDI SA	2,812	79.10	222,429.20
BANCA MEDIOLANUM SPA	12,697	17.81	226,133.57
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	12,309	11.83	145,615.47
DEUTSCHE BANK NAMEN	103,335	30.67	3,169,801.12
DEUTSCHE BOERSE	10,860	219.70	2,385,942.00
EDENRED	15,236	18.20	277,371.38
EURONEXT NV	4,500	128.40	577,800.00
EXOR NV	5,347	72.95	390,063.65
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	83.75	467,492.50
NEXI SPA	36,598	3.22	117,955.35
POSTE ITALIANE SPA	25,777	23.31	600,861.87
SOFINA	752	244.00	183,488.00
AEGON LTD	75,698	6.33	479,319.73

AGEAS	8,621	63.25	545,278.25
ALLIANZ SE-REG	21,864	378.80	8,282,083.20
ASR NEDERLAND NV	9,000	62.38	561,420.00
AXA SA	100,240	39.82	3,991,556.80
GENERALI	49,435	35.94	1,776,693.90
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,628	249.20	904,097.60
MAPFRE SA	53,279	4.00	213,542.23
MUENCHENER RUECKVERSICH.	7,528	542.80	4,086,198.40
NN GROUP NV	13,896	70.20	975,499.20
SAMPO OYJ-A SHS	133,807	9.27	1,240,658.50
TALANX AG	2,850	107.60	306,660.00
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	22,848	21.35	487,804.80
CAPGEMINI SA	9,097	101.90	926,984.30
DASSAULT SYSTEMES SA	38,993	17.29	674,188.97
NEMETSCHKE SE	3,320	66.00	219,120.00
SAP SE	59,214	167.86	9,939,662.04
NOKIA OYJ	300,315	6.41	1,926,821.04
CELLNEX TELECOM SA	30,696	30.87	947,585.52
DEUTSCHE TELEKOM	212,299	33.25	7,058,941.75
ELISA A	7,825	42.78	334,753.50
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	8.79	130,843.21
KPN (KON.)	227,886	4.70	1,072,887.28
ORANGE	104,881	17.72	1,859,015.72
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.64	317,063.50
TELEFONICA	229,139	3.64	836,128.21
ACCIONA SA	1,278	196.30	250,871.40
E.ON SE	125,722	18.47	2,322,713.95
EDP RENOVAVEIS SA	15,623	13.20	206,223.60
EDP SA	189,324	4.33	820,151.56
ELIA GROUP SA/NV	2,940	135.50	398,370.00
ENDESA	17,138	32.01	548,587.38
ENEL	476,463	9.70	4,621,691.10
ENGIE	100,827	26.52	2,673,932.04
FORTUM OYJ	26,655	19.58	521,904.90
IBERDROLA SA	372,321	19.85	7,390,571.85
NATURGY ENERGY GROUP SA	11,183	25.80	288,521.40
REDEIA CORP SA	23,296	16.14	375,997.44
RWE STAMM	35,639	51.68	1,841,823.52
SNAM SPA	115,930	6.39	741,720.14
TERNA SPA	80,424	9.99	803,918.30
VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,524	34.56	1,193,149.44
VERBUND AG	3,916	59.40	232,610.40

	ASM INTERNATIONAL NV	2,604	711.40	1,852,485.60
	ASML HOLDING NV	22,043	1,249.20	27,536,115.60
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,300	187.65	806,895.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	73,348	45.89	3,365,939.72
	STMICROELECTRONICS NV	37,319	28.50	1,063,778.09
	LEG IMMOBILIEN SE	3,774	68.90	260,028.60
	VONOVIA SE	43,373	27.55	1,194,926.15
	ユーロ 小計	11,273,084		371,352,291.39 (67,790,360,793)
イギリスポンド	BP PLC	906,300	4.74	4,296,768.30
	SHELL PLC-NEW	328,206	29.65	9,731,307.90
	ANGLO AMERICAN PLC	65,188	36.50	2,379,362.00
	ANTOFAGASTA PLC	22,358	40.81	912,429.98
	ENDEAVOUR MINING PLC	5,569	50.10	279,006.90
	FRESNILLO PLC	4,000	39.76	159,040.00
	GLENCORE PLC	587,098	5.13	3,011,812.74
	RIO TINTO PLC REG	65,081	71.62	4,661,101.22
	ASHTED GROUP PLC	25,115	51.44	1,291,915.60
	BAE SYSTEMS PLC	169,963	21.37	3,632,109.31
	BUNZL PLC	19,312	21.16	408,641.92
	DCC PLC	3,974	51.00	202,674.00
	MELROSE INDUSTRIES PLC	75,000	6.69	502,350.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	476,108	13.33	6,346,519.64
	SMITHS GROUP PLC	20,046	26.96	540,440.16
	SPIRAX GROUP PLC	3,672	78.15	286,966.80
	EXPERIAN PLC	52,941	25.24	1,336,230.84
	INTERTEK GROUP PLC	10,295	45.00	463,275.00
	RELX PLC	102,746	22.51	2,312,812.46
	RENTOKIL INITIAL PLC	159,478	4.59	732,482.45
	BARRATT REDROW PLC	79,405	3.75	298,006.96
	COMPASS GROUP PLC	100,770	21.55	2,171,593.50
	ENTAIN PLC	33,614	5.63	189,314.04
	PEARSON	34,302	9.28	318,459.76
	WHITBREAD PLC	10,170	26.21	266,555.70
	AUTOTRADER GROUP PLC	60,593	4.71	285,938.36
	INFORMA PLC	79,688	8.17	651,369.71
	JD SPORTS FASHION PLC	114,330	0.80	92,401.50
	KINGFISHER PLC	96,593	3.58	346,672.27
	NEXT PLC	7,235	131.30	949,955.50
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	118,754	4.06	483,210.02
	SAINSBURY (J) PLC	82,018	3.57	292,968.29
	TESCO PLC	361,640	4.99	1,804,583.60

	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,881	19.50	407,283.90
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	121,644	45.97	5,591,974.68
	COCA-COLA HBC AG-CDI	14,115	48.50	684,577.50
	DIAGEO	127,224	18.58	2,363,821.92
	IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	33.00	1,505,361.00
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,959	63.98	2,428,616.82
	UNILEVER PLC	125,728	54.62	6,867,263.36
	SMITH & NEPHEW PLC	43,163	13.35	576,226.05
	ASTRAZENECA	87,967	153.44	13,497,656.48
	GSK PLC	229,406	22.06	5,060,696.36
	HALEON PLC	503,805	4.09	2,063,585.28
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	16.19	139,007.34
	BARCLAYS	787,083	4.63	3,644,194.29
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	976,377	12.92	12,622,601.85
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,433,541	1.03	3,564,015.55
	NATWEST GROUP PLC	450,344	6.10	2,748,899.77
	STANDARD CHARTERED PLC	115,810	18.15	2,102,530.55
	3I GROUP PLC	54,349	33.54	1,822,865.46
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,203	77.06	2,019,203.18
	M&G PLC	118,170	3.18	375,780.60
	SCHRODERS PLC	42,161	5.86	247,063.46
	WISE PLC - A	45,000	8.31	374,175.00
	ADMIRAL GROUP PLC	15,031	28.28	425,076.68
	AVIVA PLC	180,469	6.47	1,168,356.30
	LEGAL & GENERAL GROUP	328,066	2.69	882,825.60
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,255	7.55	326,791.52
	PRUDENTIAL	142,860	11.17	1,596,460.50
	THE SAGE GROUP PLC	56,360	7.83	441,636.96
	HALMA PLC	20,296	39.72	806,157.12
	BT GROUP PLC	373,976	2.06	772,260.44
	VODAFONE GROUP PLC	1,157,830	1.16	1,348,871.95
	CENTRICA PLC	270,000	1.92	520,020.00
	NATIONAL GRID PLC	275,331	13.59	3,743,124.94
	SEVERN TRENT PLC	14,219	31.52	448,182.88
	SSE PLC	65,158	25.80	1,681,076.40
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	13.48	467,971.68
	イギリスボンド 小計	14,674,262		136,974,489.80 (28,629,038,113)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	268	626.00	167,768.00
	GIVAUDAN-REG	533	3,054.00	1,627,782.00
	HOLCIM LTD	30,195	73.48	2,218,728.60
	SIKA AG-BR	8,973	155.95	1,399,339.35

ABB LTD	90,324	69.80	6,304,615.20	
BELIMO HOLDING AG-REG	571	824.50	470,789.50	
GEBERIT AG-REG	1,930	645.40	1,245,622.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,332	281.50	374,958.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,198	293.80	645,772.40	
VAT GROUP AG	1,440	522.20	751,968.00	
SGS SA	8,675	94.20	817,185.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,789	174.70	487,238.30	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	30,511	163.70	4,994,650.70	
SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,572	198.30	311,727.60	
AVOLTA AG	5,500	51.40	282,700.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	189	1,440.00	272,160.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	126,800.00	760,800.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	12,600.00	693,000.00	
NESTLE SA - REGISTERED	146,163	81.40	11,897,668.20	
ALCON INC	28,424	63.78	1,812,882.72	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,788	193.75	540,175.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,820	91.70	625,394.00	
GALDERMA GROUP AG	8,946	148.60	1,329,375.60	
LONZA GROUP AG-REG	4,051	520.60	2,108,950.60	
NOVARTIS	108,141	127.98	13,839,885.18	
ROCHE HOLDING AG-BR	1,944	377.80	734,443.20	
ROCHE HOLDING GENUSS	39,857	370.40	14,763,032.80	
SANDOZ GROUP AG	24,188	66.36	1,605,115.68	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,564	114.80	179,547.20	
JULIUS BAER GROUP LTD	11,775	64.54	759,958.50	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,287	850.00	1,093,950.00	
UBS GROUP AG	180,100	32.18	5,795,618.00	
HELVETIA BALOISE HOLDING AG	4,861	198.10	962,964.10	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,612	869.20	1,401,150.40	
SWISS RE LTD	16,708	129.00	2,155,332.00	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,262	575.40	4,753,954.80	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	69.08	573,225.84	
SWISSCOM	1,342	716.00	960,872.00	
BKW AG	1,065	144.20	153,573.00	
SWISS PRIME SITE-REG	5,135	138.50	711,197.50	
スイスフラン 小計	800,392		92,585,070.97 (18,512,384,940)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	15,440	672.80	10,388,032.00
	HOLMEN AB-B SHARES	5,106	356.40	1,819,778.40
	SCA SV CELLULOSA B	34,632	120.95	4,188,740.40
	ADDTECH AB-B SHARES	15,005	318.40	4,777,592.00

ALFA LAVAL AB	15,614	528.60	8,253,560.40	
ASSA ABLOY AB-B	57,678	381.50	22,004,157.00	
ATLAS COPCO A	156,971	194.85	30,585,799.35	
ATLAS COPCO B	85,638	168.30	14,412,875.40	
BEIJER REF AB	23,000	135.25	3,110,750.00	
EPIROC AB-A	37,140	264.40	9,819,816.00	
EPIROC AB-B	22,442	227.20	5,098,822.40	
INDUTRADE AB	14,669	229.80	3,370,936.20	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	224.90	1,817,416.90	
LIFCO AB-B SHS	13,590	314.20	4,269,978.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	80,939	39.35	3,184,949.65	
SAAB AB-B	16,524	649.40	10,730,685.60	
SANDVIK AB	61,489	383.10	23,556,435.90	
SKANSKA B	19,869	274.20	5,448,079.80	
SKF AB-B	18,340	259.30	4,755,562.00	
TRELLEBORG AB-B SHS	10,024	396.90	3,978,525.60	
VOLVO B	89,605	350.10	31,370,710.50	
SECURITAS B	25,545	155.90	3,982,465.50	
EVOLUTION AB	7,560	515.80	3,899,448.00	
HENNES & MAURITZ B	33,524	181.40	6,081,253.60	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	34,609	287.50	9,950,087.50	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,481	410.00	3,887,210.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	87,690	194.60	17,064,474.00	
SVENSKA HANDELSBK A	81,670	143.65	11,731,895.50	
SWEDBANK AB-A	50,623	349.00	17,667,427.00	
EQT AB	28,088	269.70	7,575,333.60	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	490.00	3,355,520.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	489.80	4,227,463.80	
INVESTOR AB-B SHS	102,079	368.05	37,570,175.95	
LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	564.50	2,310,498.50	
ERICSSON (LM) B	160,922	100.85	16,228,983.70	
HEXAGON AB-B SHS	127,535	98.44	12,554,545.40	
TELE2 AB-B SHS	29,014	191.30	5,550,378.20	
TELIA CO AB	138,487	45.63	6,319,161.81	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	32,478	65.24	2,118,864.72	
SAGAX AB-B	16,138	176.30	2,845,129.40	
スウェーデンクローナ 小計	1,786,811		381,863,519.68 (6,526,047,551)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	17,052	283.80	4,839,357.60
	EQUINOR ASA	45,759	277.50	12,698,122.50
	NORSK HYDRO	80,379	87.40	7,025,124.60
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,449	465.50	4,398,509.50

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	23,633	391.70	9,257,046.10	
	MOWI ASA	25,213	223.40	5,632,584.20	
	ORKLA	39,803	130.20	5,182,350.60	
	SALMAR ASA	3,135	571.00	1,790,085.00	
	DNB BANK ASA	51,293	304.00	15,593,072.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	269.40	3,004,618.20	
	TELENOR ASA	38,789	173.60	6,733,770.40	
	ノルウェークローネ 小計	345,658		76,154,640.70 (1,232,943,632)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	20,283	380.70	7,721,738.10	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	4,280	224.05	958,934.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	55,755	157.60	8,786,988.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	15,270.00	2,321,040.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	251	15,405.00	3,866,655.00	
	DSV A/S	11,813	1,642.50	19,402,852.50	
	PANDORA A/S	4,480	519.60	2,327,808.00	
	CARLSBERG AS-B	5,476	1,000.00	5,476,000.00	
	COLOPLAST-B	6,800	481.40	3,273,520.00	
	DEMANT A/S	4,463	179.60	801,554.80	
	GENMAB A/S	3,603	1,832.50	6,602,497.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	183,414	251.40	46,110,279.60	
	DANSKE BANK A/S	38,806	341.60	13,256,129.60	
	TRYG A/S	16,595	156.70	2,600,436.50	
ORSTED A/S	30,632	152.30	4,665,253.60		
	デンマーククローネ 小計	386,803		128,171,687.20 (3,132,516,035)	
オーストラリアドル	SANTOS	176,138	6.78	1,194,215.64	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	105,494	27.10	2,858,887.40	
	BHP GROUP LTD	287,712	54.02	15,542,202.24	
	EVOLUTION MINING LTD	106,856	15.58	1,664,816.48	
	FORTESCUE LTD	97,584	19.98	1,949,728.32	
	LYNAS RARE EARTHS LTD	52,235	15.86	828,447.10	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	76,240	29.30	2,233,832.00	
	RIO TINTO LTD	22,145	161.10	3,567,559.50	
	SOUTH32 LTD	246,137	4.44	1,092,848.28	
	SGH LTD	13,000	47.47	617,110.00	
	BRAMBLES LTD	74,584	24.52	1,828,799.68	
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,589	31.02	886,830.78	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	10.51	419,853.48	
	TRANSURBAN GROUP	172,292	14.35	2,472,390.20	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,473	46.97	1,478,286.81		
LOTTERY CORP LTD/THE	123,601	5.51	681,041.51		

	CAR GROUP LTD	23,075	24.86	573,644.50	
	REA GROUP LTD	3,000	159.02	477,060.00	
	WESFARMERS LTD	65,742	82.58	5,428,974.36	
	COLES GROUP LTD	73,213	21.70	1,588,722.10	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	69,391	31.31	2,172,632.21	
	COCHLEAR LIMITED	3,465	195.40	677,061.00	
	PRO MEDICUS LTD	3,869	115.30	446,095.70	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	325,143	2.97	965,674.71	
	SONIC HEALTHCARE LTD	25,969	23.02	597,806.38	
	CSL LIMITED	27,315	147.38	4,025,684.70	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	167,819	39.77	6,674,161.63	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	95,896	178.53	17,120,312.88	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	177,800	47.87	8,511,286.00	
	WESTPAC BANKING	197,078	42.04	8,285,159.12	
	ASX LTD	11,055	52.58	581,271.90	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	20,897	214.13	4,474,674.61	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON	19,845	37.23	738,829.35	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	137,266	6.96	955,371.36	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	4.45	575,171.40	
	QBE INSURANCE GROUP	87,093	22.23	1,936,077.39	
	SUNCORP GROUP LTD	56,794	14.80	840,551.20	
	WISETECH GLOBAL LTD	10,651	44.63	475,354.13	
	XERO LTD	8,985	75.28	676,390.80	
	TELSTRA GROUP LTD	192,953	5.14	991,778.42	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	106,215	12.07	1,282,015.05	
	オーストラリアドル 小計	3,693,809		110,388,610.32 (12,075,410,082)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	108,149	8.95	967,933.55	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	36,015	38.75	1,395,581.25	
	INFRATIL LTD	53,502	11.01	589,057.02	
	CONTACT ENERGY LTD	38,610	9.22	355,984.20	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	5.61	359,230.74	
	ニュージーランドドル 小計	300,310		3,667,786.76 (338,646,751)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	146,948	64.25	9,441,409.00	
	SWIRE PACIFIC A	31,000	81.65	2,531,150.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	84,500	123.90	10,469,550.00	
	MTR CORP	82,500	36.88	3,042,600.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	32.48	2,630,880.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	117,000	43.80	5,124,600.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	18.75	2,381,250.00	
	WH GROUP LTD	446,619	9.95	4,443,859.05	

	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	213,000	44.34	9,444,420.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	69,800	417.80	29,162,440.00	
	AIA GROUP LTD	602,000	85.65	51,561,300.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	64.60	2,067,200.00	
	CLP HOLDINGS	100,000	77.40	7,740,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	608,990	7.69	4,683,133.10	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	62.00	4,557,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	86,448	47.44	4,101,093.12	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	34.60	2,759,730.60	
	SINO LAND CO	198,600	12.92	2,565,912.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,000	140.00	11,200,000.00	
	WHARF HOLDINGS	77,000	26.30	2,025,100.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	28.70	2,324,700.00	
	香港ドル 小計	3,418,666		174,257,326.87 (3,450,295,072)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	80,200	13.03	1,045,006.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	90,700	10.44	946,908.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	154,500	3.86	596,370.00	
	SINGAPORE AIRLINES	73,350	6.96	510,516.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	106,600	3.53	376,298.00	
	DBS GROUP	121,680	58.15	7,075,692.00	
	OCBC BANK	195,050	21.69	4,230,634.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	72,300	38.80	2,805,240.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	48,800	17.97	876,936.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	420,880	5.02	2,112,817.60	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	49,000	6.35	311,150.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	153,900	3.12	480,168.00	
	シンガポールドル 小計	1,566,960		21,367,736.10 (2,613,060,447)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	39,375	16.46	648,112.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,609	2,293.50	3,690,241.50	
	BANK HAPOLIM BM	72,120	82.04	5,916,724.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	85,752	77.57	6,651,782.64	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	70,961	40.33	2,861,857.13	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,698	251.60	2,188,416.80	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	13,075	170.40	2,227,980.00	
	NICE LTD	4,274	366.30	1,565,566.20	
	NOVA LTD	1,538	1,388.20	2,135,051.60	
	AZRIELI GROUP	2,465	456.50	1,125,272.50	
	イスラエルシェケル 小計	299,867		29,011,005.67 (1,438,768,914)	
		62,055,455		688,113,185,920	

合 計			(688,113,185,920)
-----	--	--	-------------------

## (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	89,221	813,695.52	
	オーストラリアドル 小計		89,221	813,695.52	(89,010,152)
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	2,253,300.00	
	香港ドル 小計		185,000	2,253,300.00	(44,615,340)
投資信託受益証券合計			274,221	133,625,492	(133,625,492)
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,648	518,580.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	20,363	599,079.46	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	26,370	5,011,618.50	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	34,530	787,974.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,522	1,502,939.92	
		BXP INC	8,739	521,019.18	
		CROWN CASTLE INC	24,878	2,181,800.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	19,438	3,422,837.42	
		EQUINIX INC	5,509	5,209,530.76	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,689	794,384.44	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,842	1,193,075.44	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,594	917,656.02	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,405	1,865,836.05	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	15,190	726,993.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40,061	693,055.30	
		INVITATION HOMES INC	35,025	898,741.50	
		IRON MOUNTAIN INC	17,826	1,982,072.94	
		KIMCO REALTY CORP	35,658	834,753.78	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,844	912,510.52	
		PROLOGIS INC	52,619	7,405,598.06	
		PUBLIC STORAGE	9,274	2,830,981.24	
		REALTY INCOME CORP	50,639	3,376,608.52	
		REGENCY CENTERS CORP	10,530	819,023.40	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	6,543	1,306,244.52	
SIMON PROPERTY GROUP	18,325	3,666,282.75			
SUN COMMUNITIES INC	6,753	885,723.48			

	UDR INC	17,830	666,307.10
	VENTAS INC	26,209	2,270,223.58
	VICI PROPERTIES INC	61,643	1,862,851.46
	WELLTOWER INC	38,356	8,037,116.24
	WP CAREY INC	11,776	860,354.56
	アメリカドル 小計	665,628	64,561,774.74 (9,998,036,436)
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,076	187,020.80
	GECINA SA	2,719	208,819.20
	KLEPIERRE	11,603	399,607.32
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	647,569.50
	ユーロ 小計	23,583	1,443,016.82 (263,422,720)
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	213,517.14
	SEGRO PLC	79,162	645,961.92
	イギリスポンド 小計	111,294	859,479.06 (179,639,718)
オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	112,492	3,289,266.08
	SCENTRE GROUP	297,027	1,125,732.33
	STOCKLAND	158,290	800,947.40
	VICINITY CENTERS	221,263	546,519.61
	オーストラリアドル 小計	789,072	5,762,465.42 (630,356,092)
香港ドル	LINK REIT	147,800	5,572,060.00
	香港ドル 小計	147,800	5,572,060.00 (110,326,788)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	207,909	561,354.30
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	360,472	886,761.12
	シンガポールドル 小計	568,381	1,448,115.42 (177,090,034)
	投資証券合計	2,305,758	11,358,871,788 (11,358,871,788)
	合計		11,492,497,280 (11,492,497,280)

## 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	527銘柄	98.1%				73.8%
	投資証券	31銘柄				1.9%	1.4%
カナダドル	株式	83銘柄	100.0%				3.8%
	新株予約権証券	1銘柄					
ユーロ	株式	218銘柄	99.6%				9.7%
	投資証券	4銘柄				0.4%	0.0%
イギリスポンド	株式	69銘柄	99.4%				4.1%
	投資証券	2銘柄				0.6%	0.0%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%				2.6%
スウェーデンクローナ	株式	40銘柄	100.0%				0.9%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%				0.2%
デンマーククローネ	株式	15銘柄	100.0%				0.4%
オーストラリアドル	株式	41銘柄	94.4%				1.7%
	投資信託受益証券	1銘柄				0.7%	0.0%
	投資証券	4銘柄				4.9%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%				0.0%
香港ドル	株式	21銘柄	95.7%				0.5%
	投資信託受益証券	1銘柄				1.2%	0.0%
	投資証券	1銘柄				3.1%	0.0%
シンガポールドル	株式	12銘柄	93.7%				0.4%
	投資証券	2銘柄				6.3%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	100.0%				0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

	2026年 2月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	724,037,216
コール・ローン	1,188,021,343
国債証券	202,083,764,792
派生商品評価勘定	9,095,621

	2026年 2月24日現在
項目	金額（円）
未収利息	1,710,355,353
前払費用	78,651,569
差入委託証拠金	95,232,392
流動資産合計	205,889,158,286
資産合計	205,889,158,286
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,037,819
前受金	6,912,314
未払解約金	93,495,663
流動負債合計	108,445,796
負債合計	108,445,796
純資産の部	
元本等	
元本	58,789,615,153
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	146,991,097,337
元本等合計	205,780,712,490
純資産合計	205,780,712,490
負債純資産合計	205,889,158,286

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 2月24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 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取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取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。</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）

	2026年 2月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	58,789,615,153口
2. 1口当たり純資産額	3.5003円

	2026年 2月24日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(35,003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

	2026年 2月24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

	2026年 2月24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	2026年 2月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 2月22日
期首元本額	60,325,723,982円
期中追加設定元本額	6,576,090,213円
期中一部解約元本額	8,112,199,042円
期末元本額	58,789,615,153円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,687,770,769円

区分	2026年 2月24日現在
DC外国債券インデックスファンド	1,617,365,371円
DC外国債券インデックスファンドL	14,695,710,546円
DCバランスファンド30	927,585,192円
DCバランスファンド50	1,235,650,196円
DCバランスファンド70	354,826,270円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	563,214,371円
外国債券インデックスe	839,615,190円
インデックスコレクション（外国債券）	10,375,795,267円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,902,905,631円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,367,352,126円
インデックスコレクション（バランス株式70）	609,967,031円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,715,122,958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）	3,308,947,165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）	221,036,882円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	30,546,398円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	219,512,439円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	126,017,038円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	131,047,055円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	54,282,763円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	446,633,393円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	387,180,478円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	4,417,846,095円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	300,692,484円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	90,029,106円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	996,511,541円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	35,658,192円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	127,318,613円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	48,995,722円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	28,262,260円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	16,506,418円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	127,763,456円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	40,506,756円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	723,882,642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）	17,557,339円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2026年 2月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,710,997,866
合計	1,710,997,866

(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

（2026年 2月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	債券先物取引			
	買建	732,872,322	-	739,784,636
合計		732,872,322	-	739,784,636

## (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

（2026年 2月24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	939,367,455	-	933,512,943	5,854,512
	アメリカドル	434,103,264	-	433,016,080	1,087,184
	カナダドル	37,747,437	-	37,280,100	467,337
	ユーロ	284,347,385	-	280,950,978	3,396,407
	イギリスポンド	59,331,306	-	58,441,208	890,098
	オフショア人民元	123,838,063	-	123,824,577	13,486
	合計	939,367,455	-	933,512,943	5,854,512

(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 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,828,437.52	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,810,234.36	
		T 0.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,931,406.24	
		T 0.5% 05/31/27	7,330,000.00	7,061,137.87	
		T 0.5% 06/30/27	2,500,000.00	2,402,539.05	
		T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	1,052,304.68	
		T 0.5% 10/31/27	6,750,000.00	6,427,792.93	
		T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,295,343.75	
		T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	6,561,140.58	
		T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	8,032,973.43	
		T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,523,166.01	
		T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,850,234.36	
		T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	3,326,093.75	
		T 0.875% 11/15/30	4,140,000.00	3,659,210.16	
		T 1.125% 02/15/31	3,890,000.00	3,460,808.40	
		T 1.125% 02/29/28	3,880,000.00	3,707,142.97	

T 1.125% 05/15/40	1,550,000.00	1,008,801.75	
T 1.125% 08/15/40	1,300,000.00	837,865.23	
T 1.125% 08/31/28	4,000,000.00	3,779,687.52	
T 1.25% 03/31/28	4,100,000.00	3,920,544.92	
T 1.25% 04/30/28	5,300,000.00	5,059,015.62	
T 1.25% 05/15/50	2,220,000.00	1,098,379.67	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,717,578.14	
T 1.25% 06/30/28	4,300,000.00	4,090,626.93	
T 1.25% 08/15/31	6,550,000.00	5,777,432.60	
T 1.25% 09/30/28	3,800,000.00	3,595,230.46	
T 1.375% 08/15/50	3,800,000.00	1,932,656.25	
T 1.375% 10/31/28	5,700,000.00	5,401,640.62	
T 1.375% 11/15/31	12,110,000.00	10,681,398.43	
T 1.375% 11/15/40	2,600,000.00	1,731,539.05	
T 1.5% 01/31/27	4,850,000.00	4,758,679.25	
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,685,775.00	
T 1.5% 11/30/28	4,050,000.00	3,844,652.36	
T 1.625% 05/15/31	4,290,000.00	3,886,136.74	
T 1.625% 08/15/29	1,760,000.00	1,654,881.25	
T 1.625% 11/15/50	2,400,000.00	1,301,531.25	
T 1.75% 01/31/29	2,500,000.00	2,382,568.35	
T 1.75% 08/15/41	1,800,000.00	1,245,585.94	
T 1.75% 11/15/29	2,220,000.00	2,086,800.00	
T 1.875% 02/15/32	6,200,000.00	5,596,710.92	
T 1.875% 02/15/41	3,750,000.00	2,685,351.56	
T 1.875% 02/15/51	4,200,000.00	2,422,546.89	
T 1.875% 02/28/27	3,000,000.00	2,950,440.12	
T 1.875% 02/28/29	5,950,000.00	5,683,295.89	
T 1.875% 11/15/51	3,400,000.00	1,939,195.30	
T 1% 07/31/28	2,500,000.00	2,359,375.00	
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,852,003.09	
T 2.25% 02/15/52	2,410,000.00	1,506,814.85	
T 2.25% 05/15/41	1,600,000.00	1,205,750.00	
T 2.25% 08/15/27	1,820,000.00	1,788,363.28	
T 2.25% 08/15/46	1,180,000.00	798,804.68	
T 2.25% 08/15/49	2,110,000.00	1,361,691.79	
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	5,155,108.18	
T 2.375% 02/15/42	1,350,000.00	1,018,195.31	
T 2.375% 03/31/29	5,400,000.00	5,229,667.96	
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,551,765.61	
T 2.375% 05/15/29	3,390,000.00	3,278,699.41	
T 2.375% 05/15/51	1,980,000.00	1,284,834.37	

T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	1,328,170.31
T 2.5% 02/15/45	1,750,000.00	1,273,125.00
T 2.5% 02/15/46	1,250,000.00	894,677.73
T 2.5% 05/15/46	1,810,000.00	1,291,109.76
T 2.625% 02/15/29	4,900,000.00	4,786,974.59
T 2.625% 05/31/27	2,900,000.00	2,868,847.64
T 2.625% 07/31/29	4,000,000.00	3,890,859.36
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,609,253.52
T 2.75% 04/30/27	5,500,000.00	5,452,519.54
T 2.75% 05/31/29	5,000,000.00	4,889,941.40
T 2.75% 07/31/27	5,000,000.00	4,949,804.70
T 2.75% 08/15/32	3,180,000.00	2,998,143.75
T 2.75% 08/15/42	2,330,000.00	1,843,976.56
T 2.75% 08/15/47	300,000.00	220,277.34
T 2.75% 11/15/42	1,650,000.00	1,298,988.27
T 2.75% 11/15/47	1,400,000.00	1,024,679.68
T 2.875% 04/30/29	4,170,000.00	4,097,025.00
T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,407,560.16
T 2.875% 05/15/32	6,750,000.00	6,432,143.58
T 2.875% 05/15/43	1,350,000.00	1,073,935.54
T 2.875% 05/15/49	1,410,000.00	1,039,324.22
T 2.875% 05/15/52	2,700,000.00	1,939,992.17
T 2.875% 08/15/28	5,590,000.00	5,517,286.34
T 2.875% 08/15/45	4,750,000.00	3,658,242.18
T 2% 02/15/50	2,070,000.00	1,251,541.41
T 2% 08/15/51	4,890,000.00	2,890,066.38
T 2% 11/15/41	2,110,000.00	1,510,051.16
T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	842,187.50
T 3.125% 02/15/43	3,600,000.00	2,983,500.00
T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,091,781.25
T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,259,072.26
T 3.125% 08/31/29	4,300,000.00	4,248,937.50
T 3.125% 11/15/28	5,260,000.00	5,217,057.04
T 3.125% 11/15/41	2,070,000.00	1,751,009.77
T 3.25% 05/15/42	1,500,000.00	1,279,160.16
T 3.25% 06/30/27	1,850,000.00	1,844,291.01
T 3.375% 05/15/33	2,310,000.00	2,246,068.94
T 3.375% 05/15/44	1,800,000.00	1,523,601.55
T 3.375% 08/15/42	1,200,000.00	1,037,859.37
T 3.375% 09/15/27	1,660,000.00	1,657,665.62
T 3.375% 11/15/48	2,100,000.00	1,704,445.30
T 3.5% 01/31/30	5,040,000.00	5,037,342.20
T 3.5% 02/15/33	4,010,000.00	3,938,571.87

T 3.5% 02/15/39	200,000.00	185,703.12
T 3.5% 04/30/30	4,000,000.00	3,994,062.48
T 3.5% 10/15/28	3,000,000.00	3,004,453.14
T 3.625% 02/15/44	2,300,000.00	2,023,101.57
T 3.625% 02/15/53	3,270,000.00	2,716,654.68
T 3.625% 05/15/53	1,650,000.00	1,369,564.44
T 3.625% 05/31/28	4,200,000.00	4,217,636.72
T 3.625% 08/15/43	2,700,000.00	2,386,441.41
T 3.625% 08/31/29	3,200,000.00	3,214,062.49
T 3.75% 04/15/28	5,680,000.00	5,716,387.50
T 3.75% 06/30/30	2,500,000.00	2,520,214.85
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,013,117.18
T 3.75% 10/31/32	3,000,000.00	2,996,835.93
T 3.75% 11/15/43	1,800,000.00	1,614,726.55
T 3.875% 02/15/43	830,000.00	763,308.20
T 3.875% 07/15/28	5,240,000.00	5,292,911.73
T 3.875% 08/15/33	5,900,000.00	5,916,363.29
T 3.875% 08/15/34	2,000,000.00	1,993,085.94
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	642,865.62
T 3.875% 09/30/29	1,550,000.00	1,569,768.56
T 3.875% 10/15/27	6,000,000.00	6,039,375.00
T 3.875% 11/30/29	3,880,000.00	3,930,015.60
T 3.875% 12/31/29	6,300,000.00	6,381,703.12
T 3% 02/15/47	1,500,000.00	1,159,804.68
T 3% 02/15/48	1,550,000.00	1,184,841.79
T 3% 02/15/49	1,940,000.00	1,468,034.37
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	906,597.65
T 3% 05/15/45	1,350,000.00	1,065,392.58
T 3% 05/15/47	1,300,000.00	1,002,269.52
T 3% 08/15/48	1,710,000.00	1,300,201.16
T 3% 08/15/52	2,570,000.00	1,892,564.06
T 3% 11/15/44	2,050,000.00	1,627,267.57
T 3% 11/15/45	1,400,000.00	1,097,796.86
T 4.125% 02/15/27	9,800,000.00	9,852,614.82
T 4.125% 03/31/29	3,700,000.00	3,772,410.14
T 4.125% 03/31/31	3,560,000.00	3,645,592.97
T 4.125% 03/31/32	2,000,000.00	2,045,312.50
T 4.125% 07/31/31	2,150,000.00	2,201,356.44
T 4.125% 08/15/44	3,100,000.00	2,912,304.67
T 4.125% 08/15/53	3,300,000.00	2,995,781.25
T 4.125% 08/31/30	3,400,000.00	3,479,089.84
T 4.125% 10/31/31	2,200,000.00	2,251,218.75

T 4.125% 11/15/32	5,690,000.00	5,809,245.50
T 4.25% 01/15/28	4,500,000.00	4,565,742.21
T 4.25% 02/15/54	4,300,000.00	3,985,226.58
T 4.25% 02/28/31	2,000,000.00	2,059,726.56
T 4.25% 05/15/35	3,210,000.00	3,275,704.68
T 4.25% 05/15/39	450,000.00	449,208.98
T 4.25% 06/30/29	4,600,000.00	4,712,304.67
T 4.25% 06/30/31	3,000,000.00	3,090,117.18
T 4.25% 08/15/35	5,900,000.00	6,015,234.37
T 4.25% 08/15/54	3,430,000.00	3,178,310.33
T 4.25% 11/15/34	5,900,000.00	6,031,251.93
T 4.25% 11/15/40	650,000.00	639,589.84
T 4.375% 02/15/38	500,000.00	512,529.29
T 4.375% 05/15/34	7,140,000.00	7,377,070.27
T 4.375% 05/15/40	750,000.00	751,142.58
T 4.375% 05/15/41	550,000.00	546,648.43
T 4.375% 07/15/27	4,000,000.00	4,048,437.52
T 4.375% 11/15/39	650,000.00	653,300.77
T 4.375% 11/30/30	3,970,000.00	4,107,476.77
T 4.5% 02/15/36	210,000.00	219,310.54
T 4.5% 04/15/27	6,050,000.00	6,116,171.87
T 4.5% 05/15/38	250,000.00	258,662.11
T 4.5% 08/15/39	750,000.00	765,146.48
T 4.5% 11/15/33	6,250,000.00	6,519,043.00
T 4.5% 11/15/54	2,800,000.00	2,705,500.00
T 4.5% 12/31/31	5,260,000.00	5,484,988.29
T 4.625% 02/15/35	4,480,000.00	4,703,212.50
T 4.625% 02/15/40	700,000.00	720,480.46
T 4.625% 02/15/55	3,400,000.00	3,354,046.89
T 4.625% 04/30/31	2,000,000.00	2,095,273.44
T 4.625% 05/15/44	390,000.00	391,340.62
T 4.625% 05/15/54	1,150,000.00	1,134,052.73
T 4.625% 06/15/27	3,000,000.00	3,042,890.64
T 4.625% 09/30/28	2,950,000.00	3,036,656.25
T 4.625% 09/30/30	4,020,000.00	4,199,251.15
T 4.625% 11/15/55	1,300,000.00	1,283,445.30
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	778,242.18
T 4.75% 05/15/55	1,300,000.00	1,308,683.59
T 4.75% 08/15/55	2,890,000.00	2,910,997.64
T 4.75% 11/15/43	1,100,000.00	1,123,998.05
T 4.75% 11/15/53	2,500,000.00	2,515,039.05
T 4.875% 10/31/30	4,400,000.00	4,645,781.27
T 4% 02/15/34	6,400,000.00	6,453,249.98

	T 4% 02/28/30	2,400,000.00	2,442,421.87	
	T 4% 02/29/28	2,200,000.00	2,223,718.75	
	T 4% 03/31/30	2,000,000.00	2,035,585.94	
	T 4% 06/30/28	2,000,000.00	2,026,054.68	
	T 4% 06/30/32	6,000,000.00	6,090,703.14	
	T 4% 07/31/30	5,200,000.00	5,295,265.61	
	T 4% 10/31/29	3,000,000.00	3,050,976.57	
	T 4% 11/15/35	3,740,000.00	3,733,571.87	
	T 4% 11/15/52	3,000,000.00	2,668,359.36	
	T 5.0% 05/15/37	300,000.00	325,546.87	
	T 5.25% 11/15/28	1,900,000.00	1,988,839.83	
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	810,585.93	
	T 6.125% 11/15/27	1,850,000.00	1,932,238.27	
	T 6.25% 05/15/30	2,920,000.00	3,227,854.69	
	<b>アメリカドル 小計</b>	<b>633,700,000.00</b>	<b>591,966,922.84</b>	<b>(91,671,997,671)</b>
<b>カナダドル</b>	CAN 0.5% 12/01/30	1,220,000.00	1,098,572.07	
	CAN 1.25% 03/01/27	1,440,000.00	1,425,050.09	
	CAN 1.25% 06/01/30	1,770,000.00	1,667,794.78	
	CAN 1.5% 06/01/31	2,280,000.00	2,135,240.42	
	CAN 1.5% 12/01/31	1,570,000.00	1,457,315.80	
	CAN 1.75% 12/01/53	1,520,000.00	1,011,530.95	
	CAN 1% 06/01/27	640,000.00	629,554.53	
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	385,972.26	
	CAN 2.25% 12/01/29	240,000.00	236,825.82	
	CAN 2.5% 08/01/27	1,490,000.00	1,493,141.53	
	CAN 2.5% 11/01/27	200,000.00	200,331.78	
	CAN 2.5% 12/01/32	920,000.00	894,698.57	
	CAN 2.75% 03/01/30	1,540,000.00	1,544,853.35	
	CAN 2.75% 05/01/27	1,220,000.00	1,226,135.69	
	CAN 2.75% 06/01/33	330,000.00	324,944.59	
	CAN 2.75% 09/01/27	1,350,000.00	1,357,599.07	
	CAN 2.75% 09/01/30	1,290,000.00	1,291,620.90	
	CAN 2.75% 12/01/48	520,000.00	449,564.80	
	CAN 2.75% 12/01/55	920,000.00	765,804.29	
	CAN 2.75% 12/01/64	290,000.00	234,760.35	
	CAN 2% 06/01/28	20,000.00	19,794.32	
	CAN 2% 06/01/32	1,060,000.00	1,005,132.96	
	CAN 2% 12/01/51	2,330,000.00	1,681,936.03	
	CAN 3.25% 06/01/35	1,160,000.00	1,170,108.84	
	CAN 3.25% 09/01/28	1,340,000.00	1,364,354.23	
	CAN 3.25% 12/01/33	600,000.00	609,396.96	

	CAN 3.25% 12/01/34	1,350,000.00	1,365,368.81
	CAN 3.25% 12/01/35	1,230,000.00	1,236,788.83
	CAN 3.5% 03/01/28	970,000.00	989,948.33
	CAN 3.5% 09/01/29	770,000.00	792,663.41
	CAN 3.5% 12/01/45	420,000.00	416,777.66
	CAN 3.5% 12/01/57	730,000.00	705,410.76
	CAN 3% 02/01/27	420,000.00	422,757.87
	CAN 3% 06/01/34	1,700,000.00	1,692,358.09
	CAN 4.0% 06/01/41	320,000.00	341,152.35
	CAN 4% 03/01/29	1,000,000.00	1,041,179.78
	CAN 5.75% 06/01/29	680,000.00	746,730.92
	CAN 5.75% 06/01/33	1,920,000.00	2,263,848.61
	CAN 5% 06/01/37	230,000.00	267,168.83
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>39,390,000.00</b>	<b>37,964,189.23</b> <b>(4,291,851,592)</b>
<b>メキシコペソ</b>	MBONO 10% 11/20/36	4,750,000.00	5,142,965.12
	MBONO 5.5% 03/04/27	15,140,000.00	14,929,726.14
	MBONO 7.5% 05/26/33	14,930,000.00	14,126,022.48
	MBONO 7.5% 06/03/27	21,000,000.00	21,134,072.61
	MBONO 7.75% 05/29/31	20,780,000.00	20,374,363.80
	MBONO 7.75% 11/13/42	21,540,000.00	18,697,813.58
	MBONO 7.75% 11/23/34	19,510,000.00	18,448,423.44
	MBONO 8.5% 02/28/30	16,580,000.00	16,856,053.18
	MBONO 8.5% 03/01/29	18,250,000.00	18,660,238.46
	MBONO 8.5% 05/31/29	18,050,000.00	18,425,646.31
	MBONO 8.5% 11/18/38	13,280,000.00	12,676,056.54
	MBONO 8% 02/21/36	2,500,000.00	2,361,450.00
	MBONO 8% 07/31/53	21,360,000.00	18,629,586.22
	MBONO 8% 11/07/47	10,810,000.00	9,491,444.95
	<b>メキシコペソ 小計</b>	<b>218,480,000.00</b>	<b>209,953,862.83</b> <b>(1,884,461,891)</b>
<b>ユーロ</b>	BGB 0.1% 06/22/30	660,000.00	598,315.44
	BGB 0.35% 06/22/32	680,000.00	588,702.25
	BGB 0.4% 06/22/40	400,000.00	257,295.00
	BGB 0.65% 06/22/71	340,000.00	106,223.31
	BGB 0.8% 06/22/27	640,000.00	630,130.71
	BGB 0.8% 06/22/28	750,000.00	727,900.68
	BGB 0.9% 06/22/29	1,160,000.00	1,110,155.31
	BGB 0% 10/22/27	530,000.00	512,693.57
	BGB 0% 10/22/31	520,000.00	449,940.20
	BGB 1.25% 04/22/33	180,000.00	162,508.72
	BGB 1.4% 06/22/53	520,000.00	291,058.30
	BGB 1.45% 06/22/37	460,000.00	379,406.43

BGB 1.6% 06/22/47	440,000.00	292,722.87
BGB 1.7% 06/22/50	520,000.00	333,585.72
BGB 1.9% 06/22/38	480,000.00	407,239.20
BGB 1% 06/22/31	810,000.00	748,212.83
BGB 2.15% 06/22/66	420,000.00	255,504.06
BGB 2.25% 06/22/57	330,000.00	219,501.89
BGB 2.6% 10/22/30	340,000.00	341,988.04
BGB 2.7% 10/22/29	210,000.00	212,736.67
BGB 2.75% 04/22/39	280,000.00	258,772.14
BGB 2.85% 10/22/34	620,000.00	612,612.70
BGB 3.1% 06/22/35	410,000.00	410,133.00
BGB 3.3% 06/22/54	580,000.00	501,362.73
BGB 3.4% 06/22/36	180,000.00	182,886.73
BGB 3.45% 06/22/42	160,000.00	154,859.36
BGB 3.45% 06/22/43	280,000.00	269,199.00
BGB 3.5% 06/22/55	300,000.00	267,458.10
BGB 3.75% 06/22/45	450,000.00	444,610.12
BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,132,797.68
BGB 3% 06/22/34	410,000.00	411,621.14
BGB 4.25% 03/28/41	790,000.00	847,283.69
BGB 4% 03/28/32	430,000.00	462,804.57
BGB 5.5% 03/28/28	990,000.00	1,058,064.08
BGB 5% 03/28/35	1,110,000.00	1,280,121.37
BKO 1.7% 06/10/27	1,400,000.00	1,394,552.72
BKO 1.9% 09/16/27	1,170,000.00	1,168,037.91
BKO 2.2% 03/11/27	90,000.00	90,172.20
BKO 2% 12/16/27	1,000,000.00	999,578.85
BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,203,164.37
BTPS 0.45% 02/15/29	1,210,000.00	1,146,734.54
BTPS 0.5% 07/15/28	730,000.00	701,662.13
BTPS 0.6% 08/01/31	1,300,000.00	1,164,592.00
BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,193,857.15
BTPS 0.95% 03/01/37	850,000.00	659,980.80
BTPS 0.95% 06/01/32	1,190,000.00	1,064,547.82
BTPS 0.95% 08/01/30	420,000.00	392,664.09
BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	982,996.62
BTPS 0.95% 12/01/31	1,120,000.00	1,014,683.04
BTPS 1.1% 04/01/27	900,000.00	890,848.80
BTPS 1.35% 04/01/30	1,510,000.00	1,445,697.90
BTPS 1.45% 03/01/36	830,000.00	700,643.39
BTPS 1.5% 04/30/45	650,000.00	439,599.06
BTPS 1.65% 03/01/32	1,300,000.00	1,220,458.85
BTPS 1.65% 12/01/30	820,000.00	786,435.76

BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	465,214.31	
BTPS 1.8% 03/01/41	590,000.00	459,798.21	
BTPS 2.05% 08/01/27	620,000.00	619,969.62	
BTPS 2.15% 03/01/72	360,000.00	220,523.04	
BTPS 2.15% 09/01/52	480,000.00	327,535.20	
BTPS 2.2% 06/01/27	660,000.00	661,479.19	
BTPS 2.25% 09/01/36	910,000.00	824,081.89	
BTPS 2.45% 09/01/33	980,000.00	946,492.82	
BTPS 2.45% 09/01/50	770,000.00	576,191.57	
BTPS 2.5% 12/01/32	850,000.00	831,157.20	
BTPS 2.55% 02/25/27	1,100,000.00	1,105,122.70	
BTPS 2.65% 06/15/28	200,000.00	202,004.74	
BTPS 2.65% 12/01/27	770,000.00	777,231.07	
BTPS 2.7% 03/01/47	740,000.00	605,339.98	
BTPS 2.7% 10/01/30	510,000.00	512,979.52	
BTPS 2.7% 10/15/27	720,000.00	726,680.16	
BTPS 2.8% 03/01/67	460,000.00	338,247.24	
BTPS 2.8% 06/15/29	700,000.00	710,090.99	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,279,697.32	
BTPS 2.95% 02/15/27	950,000.00	957,946.75	
BTPS 2.95% 07/01/30	750,000.00	763,137.75	
BTPS 2.95% 09/01/38	850,000.00	801,831.35	
BTPS 2% 02/01/28	750,000.00	748,518.75	
BTPS 3.1% 03/01/40	590,000.00	555,447.24	
BTPS 3.15% 03/15/33	400,000.00	405,294.40	
BTPS 3.15% 11/15/31	550,000.00	561,989.17	
BTPS 3.25% 03/01/38	570,000.00	557,020.53	
BTPS 3.25% 07/15/32	300,000.00	307,114.35	
BTPS 3.25% 09/01/46	880,000.00	791,443.40	
BTPS 3.25% 11/15/32	780,000.00	796,887.00	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,150,000.00	1,168,031.42	
BTPS 3.35% 07/01/29	1,120,000.00	1,155,291.20	
BTPS 3.4% 04/01/28	1,050,000.00	1,076,495.91	
BTPS 3.45% 03/01/48	820,000.00	753,265.53	
BTPS 3.45% 07/15/27	900,000.00	916,593.66	
BTPS 3.45% 07/15/31	1,130,000.00	1,173,194.25	
BTPS 3.5% 02/15/31	790,000.00	822,109.55	
BTPS 3.5% 03/01/30	1,140,000.00	1,186,308.73	
BTPS 3.6% 10/01/35	570,000.00	586,207.95	
BTPS 3.65% 08/01/35	880,000.00	909,794.16	
BTPS 3.7% 06/15/30	1,030,000.00	1,079,676.90	
BTPS 3.8% 08/01/28	690,000.00	715,802.55	

BTPS 3.85% 02/01/35	1,010,000.00	1,062,906.83
BTPS 3.85% 07/01/34	980,000.00	1,033,494.28
BTPS 3.85% 09/01/49	740,000.00	719,303.49
BTPS 3.85% 10/01/40	740,000.00	752,579.26
BTPS 3.85% 12/15/29	1,250,000.00	1,314,230.00
BTPS 3% 08/01/29	670,000.00	684,565.80
BTPS 3% 10/01/29	840,000.00	857,096.94
BTPS 4.05% 10/30/37	600,000.00	635,043.60
BTPS 4.1% 02/01/29	370,000.00	388,842.47
BTPS 4.1% 04/30/46	340,000.00	347,030.86
BTPS 4.15% 10/01/39	760,000.00	803,022.61
BTPS 4.2% 03/01/34	900,000.00	972,612.00
BTPS 4.3% 10/01/54	540,000.00	550,152.91
BTPS 4.35% 11/01/33	1,140,000.00	1,243,900.74
BTPS 4.4% 05/01/33	630,000.00	689,505.07
BTPS 4.45% 09/01/43	640,000.00	688,026.56
BTPS 4.5% 10/01/53	570,000.00	600,396.67
BTPS 4.65% 10/01/55	330,000.00	354,080.39
BTPS 4.75% 09/01/28	1,060,000.00	1,125,161.59
BTPS 4.75% 09/01/44	930,000.00	1,038,068.32
BTPS 4% 02/01/37	1,200,000.00	1,271,779.80
BTPS 4% 04/30/35	620,000.00	660,885.28
BTPS 4% 10/30/31	440,000.00	470,164.20
BTPS 4% 11/15/30	1,120,000.00	1,190,256.59
BTPS 5.0% 08/01/39	1,180,000.00	1,358,853.19
BTPS 5.25% 11/01/29	1,000,000.00	1,100,887.50
BTPS 5.75% 02/01/33	1,160,000.00	1,366,650.52
BTPS 5% 08/01/34	1,020,000.00	1,163,438.52
BTPS 5% 09/01/40	1,070,000.00	1,231,572.14
BTPS 6.5% 11/01/27	1,430,000.00	1,533,190.23
BTPS 6% 05/01/31	1,320,000.00	1,535,347.44
DBR 0.25% 02/15/27	950,000.00	934,183.29
DBR 0.25% 02/15/29	1,360,000.00	1,289,136.52
DBR 0.25% 08/15/28	150,000.00	143,653.38
DBR 0.5% 02/15/28	110,000.00	106,853.06
DBR 0.5% 08/15/27	580,000.00	567,620.62
DBR 0% 02/15/30	1,150,000.00	1,055,636.45
DBR 0% 02/15/31	780,000.00	697,986.90
DBR 0% 02/15/32	1,680,000.00	1,460,834.53
DBR 0% 05/15/35	2,020,000.00	1,582,791.20
DBR 0% 05/15/36	1,140,000.00	862,098.78
DBR 0% 08/15/29	1,030,000.00	957,584.54
DBR 0% 08/15/30	1,380,000.00	1,251,593.08

DBR 0% 08/15/30	400,000.00	362,844.50
DBR 0% 08/15/31	2,190,000.00	1,932,713.32
DBR 0% 08/15/50	2,530,000.00	1,121,494.58
DBR 0% 08/15/52	1,560,000.00	645,269.04
DBR 0% 11/15/27	1,210,000.00	1,170,061.53
DBR 0% 11/15/28	790,000.00	747,820.32
DBR 1.25% 08/15/48	1,760,000.00	1,187,012.20
DBR 1.7% 08/15/32	1,310,000.00	1,255,097.90
DBR 1.8% 08/15/53	1,530,000.00	1,102,407.07
DBR 1.8% 08/15/53	440,000.00	317,839.06
DBR 1% 05/15/38	1,110,000.00	892,561.26
DBR 2.1% 11/15/29	1,000,000.00	997,335.00
DBR 2.2% 02/15/34	1,590,000.00	1,548,702.72
DBR 2.3% 02/15/33	2,120,000.00	2,096,865.50
DBR 2.4% 11/15/30	1,370,000.00	1,377,614.73
DBR 2.5% 02/15/35	2,270,000.00	2,245,665.60
DBR 2.5% 07/04/44	1,470,000.00	1,328,090.97
DBR 2.5% 08/15/46	1,500,000.00	1,331,859.37
DBR 2.5% 08/15/54	1,040,000.00	874,827.46
DBR 2.6% 05/15/41	790,000.00	743,304.68
DBR 2.6% 08/15/33	1,370,000.00	1,377,480.20
DBR 2.6% 08/15/34	1,430,000.00	1,429,955.31
DBR 2.9% 08/15/56	760,000.00	690,511.68
DBR 3.25% 07/04/42	930,000.00	944,326.37
DBR 4.0% 01/04/37	1,150,000.00	1,279,901.12
DBR 4.25% 07/04/39	990,000.00	1,129,573.66
DBR 4.75% 07/04/28	1,180,000.00	1,253,232.45
DBR 4.75% 07/04/34	990,000.00	1,151,445.73
DBR 4.75% 07/04/40	1,050,000.00	1,260,300.30
DBR 5.5% 01/04/31	1,090,000.00	1,249,646.52
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	1,597,947.75
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	701,088.25
DBR 6.5% 07/04/27	1,260,000.00	1,335,420.45
FRTR 0.5% 05/25/29	2,700,000.00	2,547,081.09
FRTR 0.5% 05/25/40	1,430,000.00	927,000.36
FRTR 0.5% 05/25/72	640,000.00	172,316.80
FRTR 0.5% 06/25/44	1,100,000.00	614,818.60
FRTR 0.75% 02/25/28	3,110,000.00	3,025,238.10
FRTR 0.75% 05/25/28	2,910,000.00	2,819,222.55
FRTR 0.75% 05/25/52	1,830,000.00	839,276.88
FRTR 0.75% 05/25/53	1,750,000.00	778,780.62
FRTR 0.75% 11/25/28	3,050,000.00	2,928,613.38

FRTR 0% 02/25/27	2,140,000.00	2,096,384.07
FRTR 0% 05/25/32	2,250,000.00	1,894,291.87
FRTR 0% 11/25/29	2,460,000.00	2,250,438.75
FRTR 0% 11/25/30	2,810,000.00	2,493,175.31
FRTR 0% 11/25/31	1,690,000.00	1,449,335.55
FRTR 1.25% 05/25/34	2,790,000.00	2,419,184.58
FRTR 1.25% 05/25/36	2,320,000.00	1,902,554.28
FRTR 1.25% 05/25/38	1,490,000.00	1,152,782.45
FRTR 1.5% 05/25/31	2,940,000.00	2,779,518.15
FRTR 1.5% 05/25/50	1,730,000.00	1,040,456.60
FRTR 1.75% 05/25/66	740,000.00	387,170.59
FRTR 1.75% 06/25/39	1,660,000.00	1,336,515.80
FRTR 1% 05/25/27	2,530,000.00	2,496,571.11
FRTR 2.4% 09/24/28	1,160,000.00	1,164,582.58
FRTR 2.5% 05/25/30	2,720,000.00	2,723,295.82
FRTR 2.5% 05/25/43	990,000.00	821,890.08
FRTR 2.5% 09/24/27	1,450,000.00	1,458,505.98
FRTR 2.7% 02/25/31	1,630,000.00	1,637,560.75
FRTR 2.75% 02/25/29	2,210,000.00	2,238,712.98
FRTR 2.75% 02/25/30	2,340,000.00	2,366,393.32
FRTR 2.75% 10/25/27	1,730,000.00	1,747,715.20
FRTR 2% 05/25/48	1,360,000.00	953,122.68
FRTR 2% 11/25/32	2,090,000.00	1,979,994.94
FRTR 3.2% 05/25/35	1,660,000.00	1,658,257.00
FRTR 3.25% 05/25/45	1,430,000.00	1,301,070.48
FRTR 3.25% 05/25/55	990,000.00	827,673.66
FRTR 3.5% 11/25/33	2,130,000.00	2,200,045.47
FRTR 3.5% 11/25/35	810,000.00	824,846.08
FRTR 3.6% 05/25/42	650,000.00	633,709.37
FRTR 3.75% 05/25/56	450,000.00	411,370.20
FRTR 3% 05/25/33	2,110,000.00	2,117,794.34
FRTR 3% 05/25/54	1,070,000.00	856,325.81
FRTR 3% 06/25/49	330,000.00	277,151.16
FRTR 3% 11/25/34	2,110,000.00	2,085,846.83
FRTR 4.1% 05/25/46	520,000.00	529,260.42
FRTR 4.5% 04/25/41	1,840,000.00	2,007,080.64
FRTR 4.75% 04/25/35	2,040,000.00	2,290,313.10
FRTR 4% 04/25/55	980,000.00	945,502.53
FRTR 4% 04/25/60	1,020,000.00	970,542.24
FRTR 4% 10/25/38	1,150,000.00	1,203,530.43
FRTR 5.5% 04/25/29	1,500,000.00	1,644,159.75
FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	2,527,549.67
IRISH 0.2% 05/15/27	390,000.00	381,663.36

IRISH 0.2% 10/18/30	400,000.00	362,677.60	
IRISH 0.35% 10/18/32	170,000.00	147,041.67	
IRISH 0.4% 05/15/35	130,000.00	104,231.98	
IRISH 0.55% 04/22/41	250,000.00	169,854.96	
IRISH 0.9% 05/15/28	380,000.00	370,648.96	
IRISH 0% 10/18/31	290,000.00	252,802.42	
IRISH 1.1% 05/15/29	510,000.00	492,971.10	
IRISH 1.3% 05/15/33	340,000.00	310,695.82	
IRISH 1.35% 03/18/31	290,000.00	276,446.99	
IRISH 1.5% 05/15/50	460,000.00	311,072.24	
IRISH 1.7% 05/15/37	420,000.00	367,565.31	
IRISH 2.4% 05/15/30	400,000.00	401,419.00	
IRISH 2.6% 10/18/34	120,000.00	118,236.30	
IRISH 2% 02/18/45	530,000.00	429,298.94	
IRISH 3.1% 06/18/36	170,000.00	172,026.40	
IRISH 3.15% 10/18/55	130,000.00	118,970.28	
IRISH 3% 10/18/43	170,000.00	162,771.60	
NETHER 0.25% 07/15/29	540,000.00	506,063.70	
NETHER 0.5% 01/15/40	690,000.00	488,606.76	
NETHER 0.5% 07/15/32	560,000.00	494,069.80	
NETHER 0.75% 07/15/27	790,000.00	776,865.85	
NETHER 0.75% 07/15/28	510,000.00	494,454.24	
NETHER 0% 01/15/29	840,000.00	790,219.08	
NETHER 0% 01/15/38	530,000.00	371,694.56	
NETHER 0% 01/15/52	940,000.00	394,999.52	
NETHER 0% 07/15/30	910,000.00	823,614.37	
NETHER 0% 07/15/31	650,000.00	571,431.25	
NETHER 2.5% 01/15/30	570,000.00	575,144.25	
NETHER 2.5% 01/15/33	800,000.00	797,798.00	
NETHER 2.5% 07/15/33	590,000.00	585,749.05	
NETHER 2.5% 07/15/34	520,000.00	512,468.58	
NETHER 2.5% 07/15/35	410,000.00	400,616.74	
NETHER 2.75% 01/15/47	960,000.00	878,499.84	
NETHER 2% 01/15/54	800,000.00	598,019.00	
NETHER 3.25% 01/15/44	360,000.00	360,305.10	
NETHER 3.5% 01/15/56	210,000.00	212,767.69	
NETHER 3.75% 01/15/42	880,000.00	941,874.12	
NETHER 4% 01/15/37	950,000.00	1,047,555.50	
NETHER 5.5% 01/15/28	780,000.00	829,838.88	
OBL 0% 04/16/27	440,000.00	430,293.16	
OBL 1.3% 10/15/27	1,820,000.00	1,800,232.39	
OBL 2.1% 04/12/29	1,330,000.00	1,329,320.37	

OBL 2.1% 04/12/29	690,000.00	689,744.50
OBL 2.2% 04/13/28	1,400,000.00	1,404,929.68
OBL 2.2% 10/10/30	930,000.00	927,475.05
OBL 2.4% 04/18/30	850,000.00	855,996.75
OBL 2.4% 10/19/28	1,460,000.00	1,472,239.18
OBL 2.5% 10/11/29	960,000.00	971,035.20
PGB 0.3% 10/17/31	450,000.00	399,093.86
PGB 0.475% 10/18/30	480,000.00	441,157.61
PGB 0.7% 10/15/27	290,000.00	284,091.39
PGB 0.9% 10/12/35	330,000.00	273,532.54
PGB 1.15% 04/11/42	240,000.00	171,384.19
PGB 1.65% 07/16/32	330,000.00	312,012.52
PGB 1.95% 06/15/29	510,000.00	506,835.96
PGB 1% 04/12/52	340,000.00	186,107.50
PGB 2.125% 10/17/28	680,000.00	681,063.86
PGB 2.25% 04/18/34	410,000.00	393,625.21
PGB 2.875% 10/14/33	130,000.00	131,046.76
PGB 2.875% 10/20/34	320,000.00	320,449.76
PGB 3.25% 06/13/36	110,000.00	111,839.47
PGB 3.375% 06/15/40	140,000.00	139,797.66
PGB 3.5% 06/18/38	240,000.00	246,425.40
PGB 3.625% 06/12/54	220,000.00	212,574.89
PGB 3.875% 02/15/30	340,000.00	360,865.18
PGB 3% 06/15/35	190,000.00	190,961.40
PGB 4.1% 02/15/45	320,000.00	342,126.40
PGB 4.1% 04/15/37	490,000.00	535,305.05
PGB 4.125% 04/14/27	350,000.00	358,317.29
RAGB 0.25% 10/20/36	360,000.00	268,802.64
RAGB 0.5% 02/20/29	810,000.00	770,286.91
RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	638,889.06
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	101,489.15
RAGB 0.75% 02/20/28	590,000.00	575,056.77
RAGB 0.75% 03/20/51	450,000.00	237,884.21
RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	62,457.90
RAGB 0.9% 02/20/32	720,000.00	653,112.36
RAGB 0% 02/20/30	740,000.00	674,630.04
RAGB 0% 02/20/31	780,000.00	690,610.04
RAGB 0% 10/20/28	420,000.00	396,929.61
RAGB 0% 10/20/40	330,000.00	203,244.69
RAGB 1.5% 02/20/47	520,000.00	362,406.93
RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	96,978.86
RAGB 1.85% 05/23/49	310,000.00	225,455.40
RAGB 2.1% 09/20/17	230,000.00	137,569.61

RAGB 2.4% 05/23/34	640,000.00	621,056.16
RAGB 2.5% 10/20/29	460,000.00	463,032.55
RAGB 2.9% 02/20/33	720,000.00	729,238.68
RAGB 2.9% 02/20/34	570,000.00	574,392.99
RAGB 2.9% 05/23/29	230,000.00	234,841.38
RAGB 2.95% 02/20/35	430,000.00	431,625.01
RAGB 3.15% 06/20/44	450,000.00	430,010.65
RAGB 3.15% 10/20/53	460,000.00	417,829.50
RAGB 3.2% 02/20/36	200,000.00	203,368.28
RAGB 3.2% 07/15/39	200,000.00	198,899.34
RAGB 3.45% 10/20/30	150,000.00	156,771.00
RAGB 3.8% 01/26/62	210,000.00	214,139.45
RAGB 4.15% 03/15/37	770,000.00	848,292.13
RAGB 6.25% 07/15/27	450,000.00	475,690.59
RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	201,544.06
RFGB 0.125% 04/15/52	240,000.00	97,539.60
RFGB 0.125% 09/15/31	290,000.00	254,083.31
RFGB 0.25% 09/15/40	210,000.00	134,989.83
RFGB 0.5% 04/15/43	180,000.00	110,734.09
RFGB 0.5% 09/15/27	490,000.00	478,474.52
RFGB 0.5% 09/15/28	290,000.00	278,198.56
RFGB 0.5% 09/15/29	390,000.00	366,485.57
RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	247,653.51
RFGB 0% 09/15/30	330,000.00	295,982.77
RFGB 1.125% 04/15/34	230,000.00	201,805.68
RFGB 1.375% 04/15/27	140,000.00	139,063.11
RFGB 1.375% 04/15/47	330,000.00	221,259.39
RFGB 1.5% 09/15/32	400,000.00	372,539.40
RFGB 2.5% 04/15/30	190,000.00	191,146.49
RFGB 2.625% 04/15/32	70,000.00	70,083.02
RFGB 2.625% 07/04/42	350,000.00	314,821.50
RFGB 2.75% 04/15/38	170,000.00	162,388.25
RFGB 2.75% 07/04/28	130,000.00	132,054.71
RFGB 2.875% 04/15/29	250,000.00	254,813.00
RFGB 2.95% 04/15/55	220,000.00	188,989.35
RFGB 3.2% 04/15/45	130,000.00	123,850.35
RFGB 3.55% 04/15/41	80,000.00	81,354.37
RFGB 3% 09/15/33	530,000.00	538,950.64
RFGB 3% 09/15/34	190,000.00	191,791.70
RFGB 3% 09/15/35	180,000.00	180,515.79
SPGB 0.1% 04/30/31	1,170,000.00	1,034,938.71
SPGB 0.5% 04/30/30	1,600,000.00	1,482,433.60

SPGB 0.5% 10/31/31	1,030,000.00	918,633.31
SPGB 0.6% 10/31/29	970,000.00	912,236.50
SPGB 0.7% 04/30/32	1,250,000.00	1,113,217.81
SPGB 0.8% 07/30/27	1,110,000.00	1,090,759.26
SPGB 0.8% 07/30/29	880,000.00	836,963.60
SPGB 0.85% 07/30/37	870,000.00	670,759.12
SPGB 0% 01/31/27	1,000,000.00	981,338.00
SPGB 0% 01/31/28	1,280,000.00	1,230,135.68
SPGB 1.2% 10/31/40	950,000.00	701,673.56
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,137,361.80
SPGB 1.4% 04/30/28	1,050,000.00	1,034,448.18
SPGB 1.4% 07/30/28	1,270,000.00	1,247,851.20
SPGB 1.45% 04/30/29	1,410,000.00	1,376,666.19
SPGB 1.45% 10/31/27	1,280,000.00	1,267,259.25
SPGB 1.45% 10/31/71	260,000.00	124,499.86
SPGB 1.5% 04/30/27	1,290,000.00	1,282,039.41
SPGB 1.85% 07/30/35	1,020,000.00	922,312.81
SPGB 1.9% 10/31/52	1,050,000.00	706,138.65
SPGB 1.95% 07/30/30	1,350,000.00	1,325,122.87
SPGB 1% 07/30/42	690,000.00	470,489.61
SPGB 1% 10/31/50	1,020,000.00	561,543.97
SPGB 2.35% 07/30/33	1,020,000.00	989,480.07
SPGB 2.4% 05/31/28	620,000.00	623,386.56
SPGB 2.5% 05/31/27	1,270,000.00	1,277,103.23
SPGB 2.55% 10/31/32	990,000.00	980,538.07
SPGB 2.7% 01/31/30	320,000.00	323,988.22
SPGB 2.7% 10/31/48	940,000.00	785,953.97
SPGB 2.9% 10/31/46	900,000.00	792,662.17
SPGB 3.1% 07/30/31	940,000.00	965,493.27
SPGB 3.15% 04/30/33	1,110,000.00	1,136,358.28
SPGB 3.15% 04/30/35	1,100,000.00	1,111,251.56
SPGB 3.2% 10/31/35	1,360,000.00	1,374,219.07
SPGB 3.25% 04/30/34	1,130,000.00	1,157,101.92
SPGB 3.3% 04/30/36	660,000.00	670,073.51
SPGB 3.45% 07/30/43	850,000.00	828,813.75
SPGB 3.45% 07/30/66	770,000.00	685,331.55
SPGB 3.45% 10/31/34	980,000.00	1,015,825.07
SPGB 3.5% 01/31/41	450,000.00	448,206.75
SPGB 3.5% 05/31/29	1,010,000.00	1,048,932.97
SPGB 3.55% 10/31/33	1,160,000.00	1,215,412.85
SPGB 3.9% 07/30/39	730,000.00	767,389.87
SPGB 4.2% 01/31/37	1,050,000.00	1,145,936.40
SPGB 4.7% 07/30/41	920,000.00	1,047,429.84

	SPGB 4.9% 07/30/40	860,000.00	998,173.19
	SPGB 4% 10/31/54	530,000.00	535,291.52
	SPGB 5.15% 10/31/28	550,000.00	592,095.62
	SPGB 5.15% 10/31/44	790,000.00	948,361.82
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,170,000.00	1,382,174.82
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,290,000.00	1,428,477.88
	ユーロ 小計	348,200,000.00	327,161,642.83 (59,723,357,898)
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/31/28	880,000.00	827,629.95
	UKT 0.25% 07/31/31	1,280,000.00	1,060,593.04
	UKT 0.375% 10/22/30	790,000.00	679,120.78
	UKT 0.5% 01/31/29	1,630,000.00	1,493,717.98
	UKT 0.5% 10/22/61	1,050,000.00	277,441.19
	UKT 0.625% 07/31/35	1,030,000.00	737,908.36
	UKT 0.625% 10/22/50	940,000.00	355,843.13
	UKT 0.875% 01/31/46	510,000.00	245,695.29
	UKT 0.875% 07/31/33	1,500,000.00	1,191,698.85
	UKT 0.875% 10/22/29	820,000.00	744,528.06
	UKT 1.125% 01/31/39	820,000.00	542,325.17
	UKT 1.125% 10/22/73	480,000.00	156,432.00
	UKT 1.25% 07/22/27	1,150,000.00	1,115,320.81
	UKT 1.25% 07/31/51	1,170,000.00	529,862.24
	UKT 1.25% 10/22/41	930,000.00	568,788.00
	UKT 1.5% 07/22/47	380,000.00	204,367.18
	UKT 1.5% 07/31/53	730,000.00	342,867.89
	UKT 1.625% 10/22/28	480,000.00	457,485.94
	UKT 1.625% 10/22/54	940,000.00	450,210.76
	UKT 1.625% 10/22/71	880,000.00	361,679.26
	UKT 1.75% 01/22/49	810,000.00	448,394.94
	UKT 1.75% 07/22/57	980,000.00	469,050.87
	UKT 1.75% 09/07/37	1,110,000.00	835,275.00
	UKT 1% 01/31/32	1,880,000.00	1,592,274.15
	UKT 2.5% 07/22/65	640,000.00	362,496.00
	UKT 3.25% 01/22/44	1,240,000.00	988,682.97
	UKT 3.25% 01/31/33	1,410,000.00	1,340,539.88
	UKT 3.5% 01/22/45	950,000.00	777,801.96
	UKT 3.5% 07/22/68	680,000.00	498,464.88
	UKT 3.75% 01/29/38	1,250,000.00	1,153,762.75
	UKT 3.75% 03/07/27	1,210,000.00	1,212,565.20
	UKT 3.75% 07/22/52	660,000.00	532,364.53
	UKT 3.75% 10/22/53	1,680,000.00	1,341,480.00
	UKT 4.125% 03/07/31	930,000.00	941,106.99

	UKT 4.125% 07/22/29	1,640,000.00	1,663,562.70
	UKT 4.25% 03/07/36	970,000.00	957,593.34
	UKT 4.25% 06/07/32	1,010,000.00	1,028,957.80
	UKT 4.25% 07/31/34	1,660,000.00	1,661,215.12
	UKT 4.25% 09/07/39	670,000.00	641,034.91
	UKT 4.25% 12/07/27	900,000.00	911,736.00
	UKT 4.25% 12/07/40	800,000.00	756,138.94
	UKT 4.25% 12/07/46	900,000.00	810,974.14
	UKT 4.25% 12/07/49	660,000.00	586,598.72
	UKT 4.25% 12/07/55	970,000.00	845,416.23
	UKT 4.375% 01/31/40	1,360,000.00	1,311,409.67
	UKT 4.375% 03/07/28	1,680,000.00	1,706,375.49
	UKT 4.375% 03/07/30	1,910,000.00	1,954,774.02
	UKT 4.375% 07/31/54	1,050,000.00	934,218.02
	UKT 4.5% 03/07/35	1,750,000.00	1,775,100.25
	UKT 4.5% 06/07/28	1,600,000.00	1,631,836.80
	UKT 4.5% 09/07/34	840,000.00	856,096.83
	UKT 4.5% 12/07/42	930,000.00	889,137.44
	UKT 4.625% 01/31/34	1,460,000.00	1,502,778.00
	UKT 4.75% 10/22/35	1,380,000.00	1,420,173.71
	UKT 4.75% 10/22/43	1,300,000.00	1,269,510.09
	UKT 4.75% 12/07/30	1,420,000.00	1,483,346.20
	UKT 4.75% 12/07/38	810,000.00	820,291.94
	UKT 4% 01/22/60	640,000.00	529,121.10
	UKT 4% 10/22/31	1,150,000.00	1,155,116.92
	UKT 4% 10/22/63	830,000.00	679,687.00
	UKT 5.25% 01/31/41	560,000.00	587,114.75
	UKT 6.0% 12/07/28	920,000.00	980,370.40
	イギリスポンド 小計	65,590,000.00	56,187,462.53 (11,743,741,543)
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	2,880,000.00	2,585,769.12
	SGB 0.75% 05/12/28	3,310,000.00	3,229,289.78
	SGB 0.75% 11/12/29	3,850,000.00	3,670,424.45
	SGB 1.75% 11/11/33	2,420,000.00	2,300,238.28
	SGB 2.25% 05/11/35	2,800,000.00	2,721,688.19
	SGB 2.25% 06/01/32	2,560,000.00	2,547,558.40
	SGB 2.5% 10/15/36	1,430,000.00	1,403,716.60
	SGB 3.5% 03/30/39	2,240,000.00	2,409,299.20
	スウェーデンクローナ 小計	21,490,000.00	20,867,984.02 (356,633,846)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	2,370,000.00	2,046,945.30
	NGB 1.375% 08/19/30	2,680,000.00	2,395,448.32
	NGB 1.75% 02/17/27	2,560,000.00	2,505,956.48

	NGB 1.75% 09/06/29	2,310,000.00	2,142,115.11
	NGB 2.125% 05/18/32	2,000,000.00	1,790,758.96
	NGB 2% 04/26/28	2,210,000.00	2,122,614.50
	NGB 3.5% 10/06/42	1,140,000.00	1,043,362.77
	NGB 3.625% 04/13/34	2,580,000.00	2,491,458.27
	NGB 3.625% 05/31/39	1,090,000.00	1,023,835.09
	NGB 3.75% 06/12/35	1,790,000.00	1,732,997.70
	NGB 3% 08/15/33	2,590,000.00	2,408,330.92
ノルウェークローネ 小計		23,320,000.00	21,703,823.42 (351,384,901)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	3,420,000.00	1,679,117.40
	DGB 0.5% 11/15/27	2,580,000.00	2,526,614.76
	DGB 0.5% 11/15/29	2,270,000.00	2,147,442.17
	DGB 0% 11/15/31	2,730,000.00	2,410,222.81
	DGB 2.25% 11/15/33	1,920,000.00	1,900,250.88
	DGB 2.25% 11/15/35	1,700,000.00	1,653,403.00
	DGB 4.5% 11/15/39	3,750,000.00	4,482,759.37
デンマーククローネ 小計		18,370,000.00	16,799,810.39 (410,587,365)
ポーランドズロチ	POLGB 1.25% 10/25/30	2,970,000.00	2,610,244.90
	POLGB 1.75% 04/25/32	3,100,000.00	2,656,764.01
	POLGB 2.5% 07/25/27	2,260,000.00	2,237,273.82
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,430,000.00	2,396,222.68
	POLGB 2.75% 10/25/29	3,840,000.00	3,693,365.03
	POLGB 3.75% 05/25/27	1,680,000.00	1,691,748.74
	POLGB 4.5% 07/25/30	1,580,000.00	1,603,873.31
	POLGB 4.75% 07/25/29	2,560,000.00	2,631,939.07
	POLGB 5.75% 04/25/29	2,450,000.00	2,592,229.59
	POLGB 5% 01/25/30	2,090,000.00	2,164,366.17
	POLGB 5% 10/25/34	2,460,000.00	2,488,703.77
	POLGB 5% 10/25/35	2,240,000.00	2,250,394.25
	POLGB 6% 10/25/33	2,400,000.00	2,601,892.80
	POLGB 7.5% 07/25/28	2,150,000.00	2,344,579.51
ポーランドズロチ 小計		34,210,000.00	33,963,597.65 (1,469,482,601)
オーストラリアドル	ACGB 1.25% 05/21/32	1,480,000.00	1,224,848.00
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,070,000.00	925,785.40
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,060,000.00	544,670.40
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,260,000.00	1,060,617.60
	ACGB 1% 11/21/31	1,560,000.00	1,293,271.20
	ACGB 1% 12/21/30	990,000.00	847,737.00
	ACGB 2.25% 05/21/28	890,000.00	852,967.10
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,140,000.00	1,061,305.80

	ACGB 2.75% 05/21/41	670,000.00	513,173.10
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,130,000.00	965,698.00
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,080,000.00	1,054,144.80
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,020,000.00	981,311.40
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,150,000.00	1,089,797.50
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,110,000.00	1,077,255.00
	ACGB 3.25% 06/21/39	480,000.00	403,958.40
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,250,000.00	1,146,562.50
	ACGB 3.75% 04/21/37	930,000.00	848,429.70
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,440,000.00	1,355,558.40
	ACGB 3% 03/21/47	620,000.00	449,816.20
	ACGB 3% 11/21/33	1,120,000.00	1,006,084.80
	ACGB 4.25% 03/21/36	870,000.00	837,644.70
	ACGB 4.25% 10/21/36	770,000.00	738,299.10
	ACGB 4.25% 12/21/35	960,000.00	925,776.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,340,000.00	1,338,392.00
	ACGB 4.75% 04/21/27	960,000.00	966,307.20
	ACGB 4.75% 06/21/54	330,000.00	307,602.90
	ACGB 4.75% 10/21/37	560,000.00	557,888.80
	オーストラリアドル 小計	27,240,000.00	24,374,903.00 (2,666,370,639)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	610,567.56
	NZGB 1.5% 05/15/31	540,000.00	481,561.04
	NZGB 1.75% 05/15/41	260,000.00	175,963.80
	NZGB 2.75% 04/15/37	350,000.00	297,500.14
	NZGB 2.75% 05/15/51	350,000.00	238,288.34
	NZGB 2% 05/15/32	540,000.00	481,907.91
	NZGB 3.5% 04/14/33	840,000.00	810,499.98
	NZGB 3% 04/20/29	530,000.00	524,288.99
	NZGB 4.25% 05/15/34	570,000.00	573,004.86
	NZGB 4.25% 05/15/36	640,000.00	634,267.47
	NZGB 4.5% 04/15/27	630,000.00	642,935.66
	NZGB 4.5% 05/15/30	690,000.00	714,181.80
	NZGB 4.5% 05/15/35	510,000.00	518,640.77
	NZGB 5% 05/15/54	190,000.00	190,162.27
	ニュージーランドドル 小計	7,290,000.00	6,893,770.59 (636,501,838)
シンガポールドル	SIGB 1.625% 07/01/31	300,000.00	300,030.48
	SIGB 1.875% 03/01/50	270,000.00	259,200.07
	SIGB 1.875% 10/01/51	400,000.00	381,200.14
	SIGB 2.25% 08/01/36	390,000.00	401,185.20
	SIGB 2.375% 07/01/39	290,000.00	301,165.02

	SIGB 2.5% 04/01/30	220,000.00	228,335.99
	SIGB 2.625% 05/01/28	280,000.00	287,347.45
	SIGB 2.625% 08/01/32	180,000.00	189,990.07
	SIGB 2.75% 03/01/35	50,000.00	53,549.99
	SIGB 2.75% 03/01/46	370,000.00	410,126.50
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	327,600.03
	SIGB 2.875% 07/01/29	550,000.00	574,998.87
	SIGB 2.875% 08/01/28	220,000.00	227,752.53
	SIGB 2.875% 09/01/27	140,000.00	143,233.30
	SIGB 2.875% 09/01/30	360,000.00	380,646.00
	SIGB 3.25% 06/01/54	70,000.00	86,161.60
	SIGB 3.375% 05/01/34	120,000.00	133,860.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	443,800.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	580,000.00	592,701.07
	SIGB 3% 04/01/29	180,000.00	188,251.57
	SIGB 3% 08/01/72	340,000.00	412,930.40
	シンガポールドル 小計	6,010,000.00	6,324,066.28 (773,370,065)
マレーシアリングット	MGS 2.632% 04/15/31	1,060,000.00	1,022,791.58
	MGS 3.502% 05/31/27	600,000.00	604,140.06
	MGS 3.519% 04/20/28	400,000.00	404,034.24
	MGS 3.582% 07/15/32	950,000.00	957,925.94
	MGS 3.733% 06/15/28	1,180,000.00	1,197,274.72
	MGS 3.757% 05/22/40	1,110,000.00	1,104,151.57
	MGS 3.828% 07/05/34	670,000.00	684,419.00
	MGS 3.844% 04/15/33	1,120,000.00	1,145,595.92
	MGS 3.885% 08/15/29	1,740,000.00	1,780,532.08
	MGS 3.892% 03/15/27	580,000.00	585,768.56
	MGS 3.899% 11/16/27	1,630,000.00	1,654,631.90
	MGS 3.917% 07/15/55	250,000.00	244,939.59
	MGS 4.054% 04/18/39	380,000.00	390,591.24
	MGS 4.065% 06/15/50	1,340,000.00	1,352,983.52
	MGS 4.18% 05/16/44	210,000.00	216,360.27
	MGS 4.232% 06/30/31	950,000.00	990,850.38
	MGS 4.254% 05/31/35	1,080,000.00	1,140,015.49
	MGS 4.457% 03/31/53	1,290,000.00	1,383,819.12
	MGS 4.498% 04/15/30	1,300,000.00	1,360,455.20
	MGS 4.504% 04/30/29	200,000.00	207,974.98
	MGS 4.642% 11/07/33	1,260,000.00	1,355,758.36
	MGS 4.696% 10/15/42	1,060,000.00	1,172,860.10
	MGS 4.736% 03/15/46	580,000.00	640,897.33
	MGS 4.762% 04/07/37	1,310,000.00	1,439,648.86
	MGS 4.893% 06/08/38	1,490,000.00	1,657,693.09

	MGS 4.921% 07/06/48	780,000.00	887,048.99
	MGS 4.935% 09/30/43	820,000.00	934,974.74
マレーシアリンギット 小計		25,340,000.00	26,518,136.83 (1,056,177,612)
イスラエルシェケル	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,810,000.00	1,588,284.12
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,600,000.00	1,262,163.48
	ILGOV 1% 03/31/30	2,530,000.00	2,298,258.77
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,500,000.00	1,457,547.40
	ILGOV 2.8% 11/29/52	1,270,000.00	965,616.02
	ILGOV 2% 03/31/27	1,710,000.00	1,684,513.98
	ILGOV 3.75% 02/28/29	1,630,000.00	1,645,008.22
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,360,000.00	1,284,232.76
	ILGOV 3.75% 09/30/27	880,000.00	884,513.16
	ILGOV 4.1% 07/31/28	500,000.00	507,708.50
	ILGOV 4% 03/30/35	1,670,000.00	1,708,326.81
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,260,000.00	1,482,313.39
	イスラエルシェケル 小計		17,720,000.00
オフショア人民元	CGB 1.38% 06/15/27	32,000,000.00	32,029,929.60
	CGB 1.42% 08/15/28	16,000,000.00	16,023,222.40
	CGB 1.42% 11/15/27	14,000,000.00	14,025,292.40
	CGB 1.43% 01/25/30	31,500,000.00	31,453,599.55
	CGB 1.45% 02/25/28	18,230,000.00	18,276,132.83
	CGB 1.46% 05/25/28	19,520,000.00	19,580,105.98
	CGB 1.55% 07/25/30	17,000,000.00	17,044,599.50
	CGB 1.61% 02/15/35	9,000,000.00	8,895,946.32
	CGB 1.62% 08/15/27	10,700,000.00	10,745,712.54
	CGB 1.63% 10/25/30	4,700,000.00	4,716,025.59
	CGB 1.65% 05/15/35	23,500,000.00	23,289,733.98
	CGB 1.66% 12/25/32	8,490,000.00	8,491,832.14
	CGB 1.67% 05/25/35	7,000,000.00	6,958,304.50
	CGB 1.74% 10/15/29	9,570,000.00	9,677,993.62
	CGB 1.78% 09/15/32	12,000,000.00	12,100,129.20
	CGB 1.78% 11/15/35	8,970,000.00	8,962,857.81
	CGB 1.79% 03/25/32	10,220,000.00	10,329,289.61
	CGB 1.83% 08/25/35	29,200,000.00	29,337,885.32
	CGB 1.85% 05/15/27	25,000,000.00	25,168,930.00
	CGB 1.92% 01/15/55	1,300,000.00	1,204,543.76
	CGB 2.04% 11/25/34	7,600,000.00	7,781,586.80
	CGB 2.11% 08/25/34	10,710,000.00	11,038,853.76
	CGB 2.12% 06/25/31	23,880,000.00	24,570,903.32
CGB 2.27% 05/25/34	20,360,000.00	21,221,734.96	

CGB 2.28% 03/25/31	10,000,000.00	10,363,590.00
CGB 2.35% 02/25/34	15,800,000.00	16,567,857.88
CGB 2.37% 01/15/29	26,300,000.00	27,073,006.97
CGB 2.4% 07/15/28	17,600,000.00	18,052,226.72
CGB 2.44% 10/15/27	7,000,000.00	7,117,796.70
CGB 2.48% 04/15/27	16,380,000.00	16,619,349.47
CGB 2.48% 09/25/28	10,800,000.00	11,121,468.48
CGB 2.5% 07/25/27	22,400,000.00	22,730,901.76
CGB 2.52% 08/25/33	20,700,000.00	21,938,087.70
CGB 2.54% 12/25/30	28,400,000.00	29,780,382.00
CGB 2.55% 10/15/28	18,000,000.00	18,573,892.20
CGB 2.6% 09/01/32	14,750,000.00	15,649,139.35
CGB 2.6% 09/15/30	12,500,000.00	13,122,462.50
CGB 2.62% 04/15/28	18,340,000.00	18,867,104.43
CGB 2.62% 06/25/30	13,000,000.00	13,638,222.00
CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,856,436.00
CGB 2.64% 01/15/28	22,840,000.00	23,445,607.16
CGB 2.67% 05/25/33	16,100,000.00	17,222,458.19
CGB 2.67% 11/25/33	12,000,000.00	12,868,317.60
CGB 2.68% 05/21/30	9,260,000.00	9,706,968.16
CGB 2.69% 08/15/32	12,700,000.00	13,503,706.80
CGB 2.75% 02/17/32	24,800,000.00	26,460,332.72
CGB 2.75% 06/15/29	14,730,000.00	15,397,548.87
CGB 2.76% 05/15/32	6,000,000.00	6,416,152.80
CGB 2.79% 12/15/29	25,840,000.00	27,187,801.48
CGB 2.8% 03/24/29	23,530,000.00	24,588,144.10
CGB 2.8% 03/25/30	19,000,000.00	20,058,628.70
CGB 2.8% 11/15/32	9,020,000.00	9,702,713.87
CGB 2.85% 06/04/27	29,360,000.00	30,002,634.61
CGB 2.88% 02/25/33	5,100,000.00	5,531,920.53
CGB 2.89% 11/18/31	15,100,000.00	16,244,658.52
CGB 2.91% 10/14/28	10,020,000.00	10,453,294.86
CGB 3.01% 05/13/28	14,360,000.00	14,937,188.71
CGB 3.02% 05/27/31	13,850,000.00	14,957,401.68
CGB 3.12% 10/25/52	6,950,000.00	8,091,125.36
CGB 3.19% 04/15/53	5,400,000.00	6,368,197.32
CGB 3.27% 11/19/30	5,930,000.00	6,462,225.20
CGB 3.28% 12/03/27	11,140,000.00	11,581,369.02
CGB 3.32% 04/15/52	7,020,000.00	8,414,464.73
CGB 3.39% 03/16/50	11,760,000.00	14,118,974.85
CGB 3.53% 10/18/51	6,510,000.00	8,066,205.73
CGB 3.72% 04/12/51	6,850,000.00	8,704,777.24
CGB 3.81% 09/14/50	11,780,000.00	15,082,975.35

	CGB 3.86% 07/22/49	8,310,000.00	10,642,705.08
	CGB 3% 10/15/53	13,220,000.00	15,150,609.14
	CGB 4.08% 10/22/48	8,280,000.00	10,882,659.02
	オフショア人民元 小計	1,029,180,000.00	1,077,248,837.05 (24,216,230,682)
	合計		202,083,764,792 (202,083,764,792)

## 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 200銘柄	100.0%	45.4%
カナダドル	国債証券 39銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 401銘柄	100.0%	29.6%
イギリスポンド	国債証券 62銘柄	100.0%	5.8%
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 11銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券 21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 12銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 70銘柄	100.0%	12.0%

(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。

## 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】

(2026年 3月31日現在)

資産総額	32,149,654,860円
負債総額	23,726,441円
純資産総額( - )	32,125,928,419円
発行済口数	17,535,217,687口
1口当たり純資産額( / )	1.8321円
(1万口当たり純資産額)	(18,321円)

## 【DCバランスファンド50】

## 【純資産額計算書】

(2026年 3月31日現在)

資産総額	41,204,769,854円
負債総額	27,060,246円
純資産総額( - )	41,177,709,608円
発行済口数	16,410,729,588口
1口当たり純資産額( / )	2.5092円
(1万口当たり純資産額)	(25,092円)

## 【DCバランスファンド70】

## 【純資産額計算書】

(2026年 3月31日現在)

資産総額	23,357,322,664円
負債総額	16,656,183円
純資産総額( - )	23,340,666,481円
発行済口数	7,245,520,058口
1口当たり純資産額( / )	3.2214円
(1万口当たり純資産額)	(32,214円)

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2026年 3月31日現在)

資産総額	526,193,853,095円
負債総額	15,866,315,829円
純資産総額( - )	510,327,537,266円
発行済口数	115,493,454,604口

1口当たり純資産額（ / ）	4.4187円
（1万口当たり純資産額）	（44,187円）

## 日本債券マザーファンド

## 純資産額計算書

（2026年 3月31日現在）

資産総額	422,021,277,312円
負債総額	5,625,363,062円
純資産総額（ - ）	416,395,914,250円
発行済口数	354,088,492,024口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1760円
（1万口当たり純資産額）	（11,760円）

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

（2026年 3月31日現在）

資産総額	682,745,758,050円
負債総額	668,731,063円
純資産総額（ - ）	682,077,026,987円
発行済口数	76,432,383,978口
1口当たり純資産額（ / ）	8.9239円
（1万口当たり純資産額）	（89,239円）

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

（2026年 3月31日現在）

資産総額	205,465,160,605円
負債総額	38,692,983円
純資産総額（ - ）	205,426,467,622円
発行済口数	58,537,256,287口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5093円
（1万口当たり純資産額）	（35,093円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

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

## 受益権の譲渡の対抗要件

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

## 受益権の再分割

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

## 償還金

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

## 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2026年 3月31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、監査等委員以外の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。

各運用部の部長は、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・リスク委員会に報告されます。なお、運用・リスク委員会での報告のうち重要なものについては、経営会議（議長は社長）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2026年 5月22日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2026年3月31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	516	16,364,783
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	33	92,825
単体型公社債投資信託	49	147,354
合計	598	16,604,962

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は財務諸表等規則並びに同規則第2条、第282条及び第306条の規定に

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、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第39期事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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。

また、第40期事業年度の中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	14,909	18,950
金銭の信託	18,596	18,214
前払費用	429	238
未収委託者報酬	10,943	12,164
未収運用受託報酬	5,967	6,523
未収収益	185	198
短期差入証拠金	3,660	2,476
その他	4,074	3,072
流動資産合計	58,767	61,839
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 219	1 189
器具備品	1 436	1 338
その他	1 -	1 4
有形固定資産合計	655	532
無形固定資産		
ソフトウェア	7,463	7,143
その他	61	78
無形固定資産合計	7,524	7,221
投資その他の資産		
投資有価証券	5,753	7,241
関係会社株式	6,077	6,077
繰延税金資産	1,196	1,184
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,058	14,534
固定資産合計	21,238	22,289
資産合計	80,005	84,128

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	86	66
未払金	8,475	8,472
未払収益分配金	0	0
未払手数料	5,524	6,159
その他未払金	2,951	2,313
未払費用	797	993
未払法人税等	694	1,743
賞与引当金	719	769
その他	957	705
流動負債合計	11,730	12,751
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	975	1,104
資産除去債務	154	154
その他	42	60
固定負債合計	1,171	1,319
負債合計	12,902	14,071
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	45,974	48,819
利益剰余金合計	48,574	51,419
株主資本合計	67,813	70,658
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	360	454
繰延ヘッジ損益	1,071	1,056
評価・換算差額等合計	710	601
純資産合計	67,103	70,057
負債・純資産合計	80,005	84,128

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	44,551	50,052
運用受託報酬	11,077	12,144
その他営業収益	356	369
営業収益合計	55,985	62,566
営業費用		
支払手数料	22,341	25,372
広告宣伝費	342	258
公告費	0	1
調査費	5,796	6,470
調査費	1,172	1,511
委託調査費	4,610	4,945
図書費	14	13
営業雑経費	5,887	6,296
通信費	78	126
印刷費	439	406
協会費	56	57
諸会費	29	45
情報機器関連費	5,193	5,570
その他営業雑経費	89	89
営業費用合計	34,369	38,399
一般管理費		
給料	6,981	7,585
役員報酬	385	476
給料・手当	5,432	5,753
賞与	1,163	1,355
退職給付費用	278	305
福利費	747	812
交際費	13	13
旅費交通費	191	175
租税公課	276	300
不動産賃借料	328	324
寄付金	0	-
減価償却費	2,239	2,501
業務委託費	1,544	1,399
諸経費	1,637	1,394
一般管理費合計	14,239	14,813
営業利益	7,376	9,353

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
営業外収益		
受取利息	138	64
収益分配金	0	1
金銭の信託運用益	4,007	-
投資有価証券売却益	1	150
投資有価証券償還益	1	0
その他	12	27
営業外収益合計	4,162	243
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	207
投資有価証券売却損	33	17
投資有価証券償還損	1	257
為替差損	1,273	660
デリバティブ費用	3,613	47
その他	3	107
営業外費用合計	4,925	1,296
経常利益	6,613	8,300
特別損失		
システム移行関連費用	-	147
特別損失合計	-	147
税引前当期純利益	6,613	8,153
法人税、住民税及び事業税	1,931	2,519
法人税等還付税額	-	129
法人税等調整額	95	25
法人税等合計	2,027	2,364
当期純利益	4,585	5,788

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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				
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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025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	45,974	48,574	67,813
当期変動額					
剰余金の配当			2,943	2,943	2,943
当期純利益			5,788	5,788	5,788
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	-	-	2,845	2,845	2,845
当期末残高	500	2,100	48,819	51,419	70,658

	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	360	1,071	710	67,103
当期変動額				
剰余金の配当				2,943
当期純利益				5,788
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	94	14	108	108
当期変動額合計	94	14	108	2,954
当期末残高	454	1,056	601	70,057

## 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直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确实であり、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。

(未適用の会計基準等)

リースに関する会計基準等

・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日）

・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日）

ほか、関連する企業会計基準、企業会計基準適用指針、実務対応報告及び移管指針の改正

(1) 概要

国際的な会計基準と同様に、借手のすべてのリースについて資産・負債を計上する等の取扱いを定めるもの。

(2) 適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

(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 (2024年3月31日)		当事業年度 (2025年3月31日)	
建 物	220	百万円	253	百万円
器具備品	823	"	942	"
その他	-	"	1	"
計	1,044	"	1,197	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

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

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	981,032	2024年3月31日	2024年6月21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

2025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
2025年6月20日 定時株主総会	普通株式	999	利益剰余金	333,333	2025年3月31日	2025年6月23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、自社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、市場価格のない株式等、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定適用指針」という。）第24-3項を適用した投資信託及び第24-16項を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）、（注4）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（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。

当事業年度（2025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	2,551	15,662	-	18,214
投資有価証券（*3）				
其他有価証券	-	3,785	-	3,785
資産計	2,551	19,448	-	21,999
デリバティブ取引（*4）				
株式関連取引	(128)	235	-	106
通貨関連取引	-	78	-	78
デリバティブ取引計	(128)	314	-	185

（\*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。

（\*3）投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額887百万円）、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（貸借対照表計上額1,976百万円）及び第24-16項を適用した組合出資金等（貸借対

照表計上額592百万円）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。時価算定適用指針第24-3項の取り扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付していません。

#### 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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
投資有価証券	876	887
関係会社株式	6,077	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(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	-

当事業年度(2025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	18,950	-	-	-
未収委託者報酬	12,164	-	-	-
未収運用受託報酬	6,523	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	2,053	2,400	-

(注4) 時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報

前事業年度(2024年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2025年3月31日)

第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

(単位:百万円)

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券 (その他有価証券)	-	-	23	2,000	1,976	-	1,976	-

(注) 決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,976百万円であります。

## （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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
子会社株式	6,077	6,077

## 2. その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（2025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	3,110	2,402	708
小計	3,110	2,402	708
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	2,651	2,712	61
小計	2,651	2,712	61
合計	5,762	5,115	647

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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
非上場株式	876	887
組合出資金等	359	592

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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	528	150	17

## （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（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。

当事業年度（2025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	5,575	-	37	37	
	英ポンド	141	-	0	0	
	カナダドル	118	-	0	0	
	スイスフラン	52	-	0	0	
	香港ドル	166	-	1	1	
	ユーロ	425	-	1	1	
	買建					
	米ドル	139	-	0	0	
	英ポンド	5	-	0	0	
	カナダドル	6	-	0	0	
	スイスフラン	5	-	0	0	
	香港ドル	1	-	0	0	
	ユーロ	16	-	0	0	
	合計		6,654	-	41	41

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

前事業年度（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。

当事業年度（2025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	9,848	-	128	128
店頭	トータルリターンス ワップ取引 売建	6,179	-	235	235

合計	16,027	-	106	106
----	--------	---	-----	-----

（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（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

### 当事業年度（2025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		1,947	-	13
	英ポンド		4,700	-	19
	スイスフラン		47	-	0
	香港ドル		122	-	0
	ユーロ		40	-	0
	シンガポールドル	449	-	3	
	買建				
	米ドル	16	-	0	
	香港ドル	94	-	0	
合計			7,419	-	36

## （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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
退職給付債務の期首残高	911	993
勤務費用	149	165
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	11	150
退職給付の支払額	85	42
簡便法で計算した退職給付費用	1	0
退職給付債務の期末残高	993	970

#### （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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	993	970
未認識数理計算上の差異	17	134
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	975	1,104
退職給付引当金	975	1,104
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	975	1,104

(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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
勤務費用	149	165
利息費用	3	3
数理差異償却	0	1
簡便法で計算した退職給付費用	1	0
確定給付制度に係る退職給付費用	155	171

(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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
割引率	0.4%	2.0%

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122百万円、当事業年度134百万円であります。

(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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	63 百万円	104 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	220 "	235 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	298 "	348 "
税務上の費用認識差額	256 "	94 "
繰延ヘッジ損益	472 "	486 "
その他	78 "	169 "
繰延税金資産 合計	1,390 "	1,437 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	159 "	209 "
その他	35 "	43 "
繰延税金負債 合計	194 "	252 "
繰延税金資産の純額	1,196 "	1,184 "

(注) 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律（令和7年法律第13号）」が2025年3月31日に成立したことに伴い、2026年4月1日以後に開始する事業年度から「防衛特別法人税」の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の30.62%から、2026年4月1日以後開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については31.52%となります。この税率変更により、当事業年度の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が18百万円増加、繰延ヘッジ損益が13百万円増加、その他有価証券評価差額金が5百万円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が10百万円減少しております。

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主な項目別の内訳

	前事業年度 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
法定実効税率 (調整)	-	30.62%
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.14%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	0.06%
法人税等還付税額	-	1.59%
その他	-	0.10%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	29.01%

(注)前事業年度は、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 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

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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	11,023百万円

##### [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 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	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。

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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	運用受託報酬	10,721	未収運用受託報酬	5,856
							投信販売代行手数料等	11,500	未払手数料	2,813

(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（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）

当事業年度（2025年3月31日）

三井住友トラストグループ株式会社（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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
1株当たり純資産額	22,367,677円92銭	23,352,414円83銭
1株当たり当期純利益金額	1,528,527円02銭	1,929,475円95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 2023年4月1日	当事業年度 (自 2024年4月1日

	至 2024年3月31日)	至 2025年3月31日)
当期純利益	4,585百万円	5,788百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,585百万円	5,788百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第40期中間会計期間末

(2025年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金		17,328
金銭の信託		21,058
未収委託者報酬		12,730
未収運用受託報酬		6,346
短期差入証拠金		2,629
その他		3,480
流動資産合計		63,574

## 固定資産

有形固定資産	1	480
無形固定資産		
ソフトウェア		7,654
その他		84
無形固定資産合計		7,738

## 投資その他の資産

投資有価証券		6,744
関係会社株式		6,416
繰延税金資産		1,262
その他		31
投資その他の資産合計		14,455

## 固定資産合計

22,674

## 資産合計

86,248

## 負債の部

## 流動負債

未払金		8,801
未払法人税等		1,519
賞与引当金		526
その他	2	1,602
流動負債合計		12,450

## 固定負債

退職給付引当金		1,141
資産除去債務		154
その他		65
固定負債合計		1,361

## 負債合計

13,812

(単位：百万円)

## 第40期中間会計期間末

（2025年9月30日）

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	51,174
利益剰余金合計	53,774
株主資本合計	73,013
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	503
繰延ヘッジ損益	1,081
評価・換算差額等合計	577
純資産合計	72,436
負債・純資産合計	86,248

## 中間損益計算書

（単位：百万円）

## 第40期中間会計期間

（自 2025年4月1日

至 2025年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		25,098
運用受託報酬		5,803
その他営業収益		198
営業収益合計		31,100
営業費用		19,072
一般管理費	1	7,553
営業利益		4,473
営業外収益	2	3,157
営業外費用	3	2,992
経常利益		4,638
税引前中間純利益		4,638
法人税、住民税及び事業税		1,524
過年度法人税等		150
法人税等調整額		89
法人税等合計		1,284
中間純利益		3,354

## 中間株主資本等変動計算書

第40期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本
	資本剰余金

	資本金	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
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	48,819	51,419	70,658
当中間期変動額					
剰余金の配当			999	999	999
中間純利益			3,354	3,354	3,354
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	2,354	2,354	2,354
当中間期末残高	500	2,100	51,174	53,774	73,013

	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	454	1,056	601	70,057
当中間期変動額				
剰余金の配当				999
中間純利益				3,354
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	48	24	23	23
当中間期変動額合計	48	24	23	2,378
当中間期末残高	503	1,081	577	72,436

## 注記事項

(重要な会計方針)

第40期中間会計期間 (自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
(1) 有価証券	
子会社株式及び関連会社株式	移動平均法による原価法によっております。
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。
市場価格のない株式等	(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あります。)
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直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	時価法によっております。
(3) 金銭の信託	時価法によっております。
2. 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。

### 3. 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中間会計期間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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間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るものであります。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、退職給付に係る当中間会計期間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。

### 4. 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。

### 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、中間会計期間末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. ヘッジ会計の方法

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によるものであります。

#### (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。

### 7. 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。

### (中間貸借対照表関係)

第40期中間会計期間末  
(2025年9月30日)

1	有形固定資産の減価償却累計額	1,259百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

### (中間損益計算書関係)

第40期中間会計期間  
(自 2025年4月1日  
至 2025年9月30日)

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	62百万円
	無形固定資産	1,102百万円
2	営業外収益の主要項目	
	金銭の信託運用益	2,976百万円
3	営業外費用の主要項目	
	デリバティブ費用	2,762百万円
	為替差損	215百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第40期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30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	当中間会計期間末
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
2025年6月20日 定時株主総会	普通株式	999	333,333	2025年3月31日	2025年6月23日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

## (リース取引関係)

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)

第40期中間会計期間末（2025年9月30日）

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

中間貸借対照表計上額、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、市場価格のない株式等、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定適用指針」という。）第24-3項を適用した投資信託及び第24-16項を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2及び（注2）、（注3）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) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	2,966	18,092	-	21,058
投資有価証券(*2)				
その他有価証券	-	3,217	-	3,217
資産計	2,966	21,309	-	24,276
デリバティブ取引(*3)				
株式関連取引	(114)	(134)	-	(249)
通貨関連取引	-	(4)	-	(4)
デリバティブ取引計	(114)	(138)	-	(253)

(\*1) 負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

(\*2) 投資有価証券のうち、非上場株式（中間貸借対照表計上額912百万円）、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（中間貸借対照表計上額1,987百万円）及び第24-16項を適用した組合出資金等（中間貸借対照表計上額627百万円）は上記に含めておりません。

(\*3) 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) 時価をもって中間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

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。時価算定適用指針第24-3項の取り扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付しておりません。

#### 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中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	912
関係会社株式	6,416

（注3）時価算定適用指針第24-3項の取り扱いを適用した投資信託に関する情報  
第24-3項の取り扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

（単位：百万円）

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券(その他有価証券)	1,976	-	10	-	1,987	-	1,987	-

（注）決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,987百万円であります。

#### （有価証券関係）

第40期中間会計期間末（2025年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

市場価格のある子会社株式及び関連会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式及び関連会社株式の中間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）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	6,077
関連会社株式	338
合計	6,416

#### 2. その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	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	2,833	2,106	727
小計	2,833	2,106	727
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,371	2,406	35
小計	2,371	2,406	35
合計	5,204	4,512	692

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額912百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額627百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

#### （デリバティブ取引関係）

第40期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)

店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,208	-	6	6
	英ポンド	127	-	0	0
	カナダドル	83	-	0	0
	スイスフラン	46	-	0	0
	香港ドル	152	-	0	0
	ユーロ	342	-	0	0
合計		6,960	-	5	5

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## (2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	11,572	-	114	114
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	5,235	-	134	134
合計		16,807	-	249	249

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

### (1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	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 米ドル 英ポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ	投資有価証券	739	-	0
			830	-	1
			31	-	0
			27	-	0
			52	-	0
			合計	1,681	-

（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）  
第40期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

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4. 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中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後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〕

第40期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

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〕

第40期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

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中間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中間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中間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

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,312百万円

## 〔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〕

第40期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）  
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〕

第40期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）  
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〕

第40期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）  
該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

第40期中間会計期間 (自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)	
1株当たり純資産額	24,145,344円27銭
1株当たり中間純利益	1,118,322円76銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

## (注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第40期中間会計期間 (自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)	
中間純利益	3,354百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	3,354百万円
普通株式の期中平均株式数	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

2026年5月22日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2025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） （2025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（2025年3月末日現在）  
事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。  
再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

**第3【参考情報】**

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2025年 5月21日	有価証券届出書
2025年 5月21日	有価証券報告書
2025年11月21日	有価証券届出書
2025年11月21日	半期報告書

**独立監査人の監査報告書**

2025年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 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2024年4月1日から2025年3月31日までの第39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2025年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2026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30の2025年2月22日から2026年2月24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2026年2月24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

2026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50の2025年2月22日から2026年2月24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2026年2月24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

2026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2025年2月22日から2026年2月24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2026年2月24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**

2025年12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 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

成 田 慎 一 郎

**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、「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2025年4月1日から2026年3月31日までの第40期事業年度の中間会計期間（2025年4月1日から2025年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2025年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（2025年4月1日から2025年9月30日まで）の経営成績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、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、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。

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。

**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に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、企業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、監査等委員会に対して、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

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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。