

# DCターゲット・イヤールファンド

DCターゲット・イヤールファンド2025

DCターゲット・イヤールファンド2035

DCターゲット・イヤールファンド2045

DCターゲット・イヤールファンド2055

追加型投信／内外／資産複合

投資信託説明書

(請求目論見書)

2023年11月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

※本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

DCターゲット・イヤー ファンド2025、DCターゲット・イヤー ファンド2035、DCターゲット・イヤー ファンド2045及びDCターゲット・イヤー ファンド2055の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2023年11月28日に関東財務局長に提出しており、2023年11月29日にその届出の効力が生じております。

発行者名 : 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

代表者の役職・氏名 : 代表取締役社長 菱田 賀夫

本店の所在の場所 : 東京都港区芝公園一丁目1番1号

有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所 : 該当事項はありません。

## 目次

第一部【証券情報】	1
（1）【ファンドの名称】	1
（2）【内国投資信託受益証券の形態等】	1
（3）【発行（売出）価額の総額】	1
（4）【発行（売出）価格】	1
（5）【申込手数料】	1
（6）【申込単位】	2
（7）【申込期間】	2
（8）【申込取扱場所】	2
（9）【払込期日】	2
（10）【払込取扱場所】	2
（11）【振替機関に関する事項】	2
（12）【その他】	2
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
1【ファンドの性格】	4
2【投資方針】	15
3【投資リスク】	28
4【手数料等及び税金】	32
5【運用状況】	36
第2【管理及び運営】	65
1【申込（販売）手続等】	65
2【換金（解約）手続等】	66
3【資産管理等の概要】	67
4【受益者の権利等】	72
第3【ファンドの経理状況】	74
1【財務諸表】	74
2【ファンドの現況】	281
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	284
第三部【委託会社等の情報】	285
第1【委託会社等の概況】	285
1【委託会社等の概況】	285
2【事業の内容及び営業の概況】	286
3【委託会社等の経理状況】	287
4【利害関係人との取引制限】	309
5【その他】	309
約款	

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

DCターゲット・イヤー ファンド2025

DCターゲット・イヤー ファンド2035

DCターゲット・イヤー ファンド2045

DCターゲット・イヤー ファンド2055

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

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- ①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
- ②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
- ③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### (3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）とします。

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

### (5)【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

2023年11月29日から2024年5月28日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

<振替受益権について>

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

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

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

<申込みコース>

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

<受益権の取得申込みの受付の中止等>

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

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

###### <信託金限度額>

各ファンドにつき上限 4,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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



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

#### <商品分類表定義>

##### [単位型投信・追加型投信の区分]

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

##### [投資対象地域による区分]

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

##### [投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

##### [独立した区分]

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

##### [補足分類]

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

## <属性区分表定義>

### [投資対象資産による属性区分]

#### (1) 株式

- ①一般…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。
- ②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。
- ③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

- ①一般…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。
- ②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。
- ③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。
- ④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。
- ⑤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①から④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①から④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。

- ①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。
- ②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]

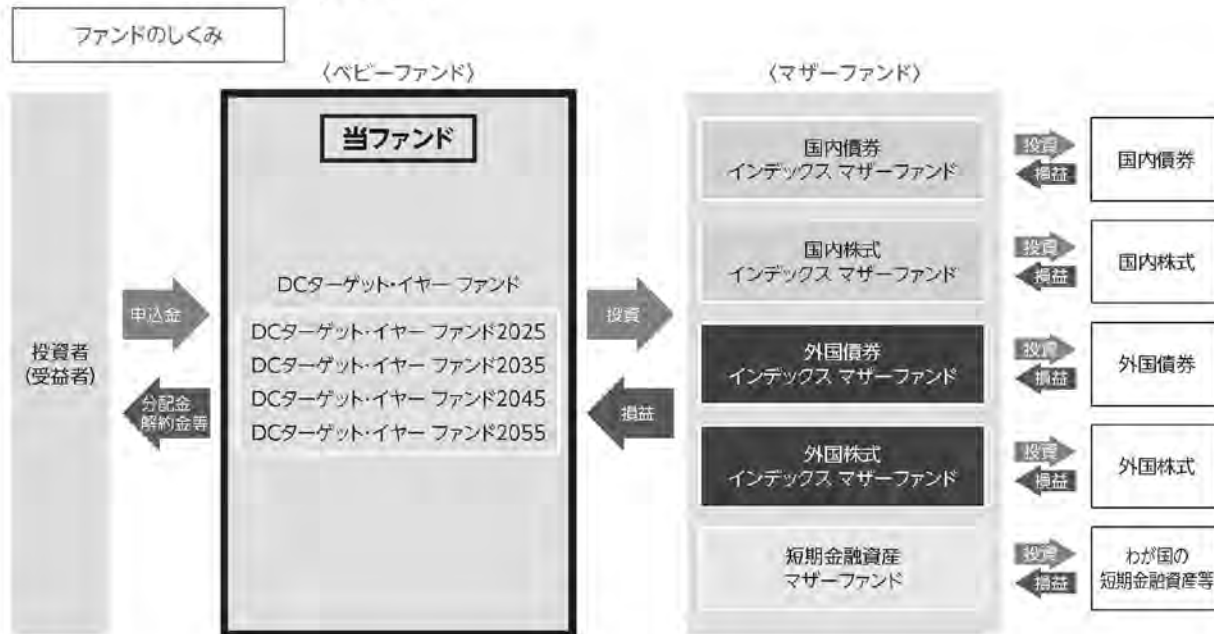
- (1) ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型/絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市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>

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



## ? ファミリーファンド方式とは

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

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

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

\*わが国の短期金融資産等への投資は、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果を目指します。「無担保コール翌日物金利」とは、金融機関の間で担保なしにお金を借りて翌営業日に返す翌日物の金利です。

※各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

※1「NOMURA-BPI総合」とは、野村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。

※2「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「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に係る商標又は商標は、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に係る商標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。

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

※4「MSCIコクサイ・インデックス」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。

## ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

- 基本組入比率に従って、各マザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

- 各マザーファンドの組入比率が基本組入比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

3.

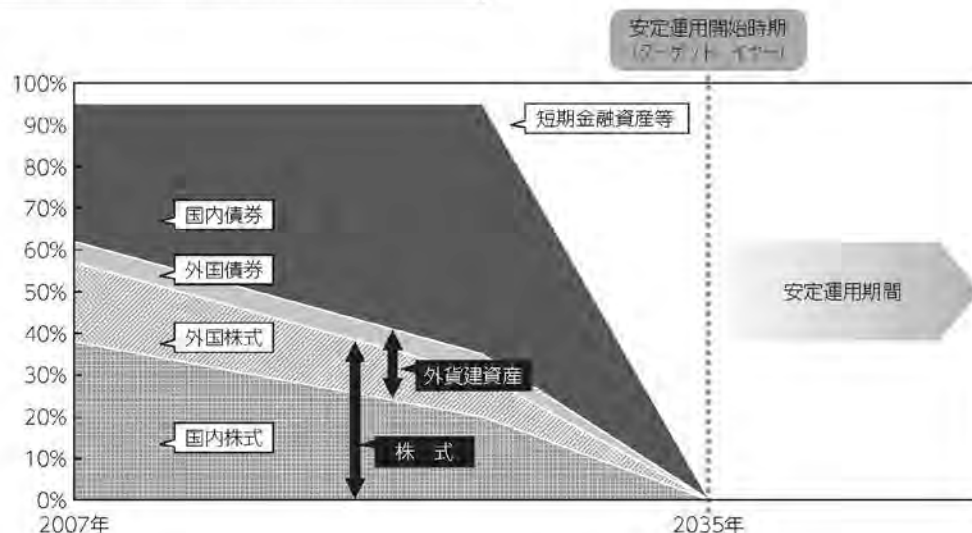
### 安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)に近づくにしたい、原則として1年に2回、各マザーファンドの基本組入比率を変更します。

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

各ファンドの安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)

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

基本組入比率イメージ  
(例:DCターゲット・イヤー ファンド2035)



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

基本組入比率の推移

■ 当初設定時

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

■ 2023年9月末現在

	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	短期金融資産等
DCターゲット・イヤー ファンド2025	12.00%	4.00%	1.00%	2.00%	81.00%
DCターゲット・イヤー ファンド2035	57.00%	22.00%	5.00%	11.00%	5.00%
DCターゲット・イヤー ファンド2045	42.00%	32.00%	5.00%	16.00%	5.00%
DCターゲット・イヤー ファンド2055	27.00%	42.00%	5.00%	21.00%	5.00%

■ 安定運用開始時期(ターゲット・イヤー)以降

	国内債券	国内株式	外国債券	外国株式	短期金融資産等
DCターゲット・イヤー ファンド2025					
DCターゲット・イヤー ファンド2035	0%	0%	0%	0%	100%
DCターゲット・イヤー ファンド2045					
DCターゲット・イヤー ファンド2055					

### 分配方針

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### 主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、以下の通りとします。

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

- 外貨建資産への実質投資割合は、以下の通りとします。

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

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

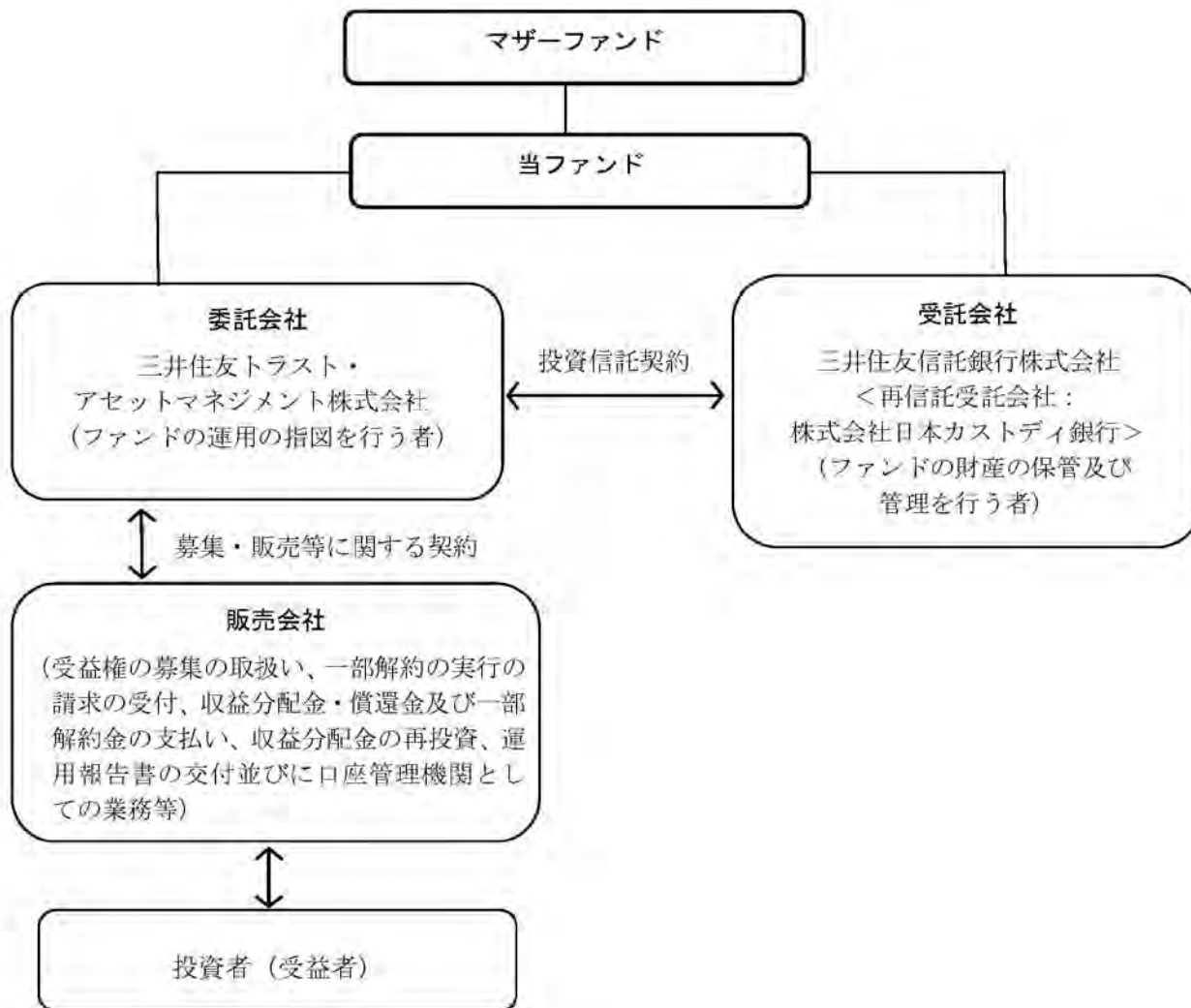
## (2) 【ファンドの沿革】

- 2007年9月26日 「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015」、「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025」、「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035」及び「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045」の投資信託契約締結、設定、運用開始
- 2012年4月1日 ファンドの名称を「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015」から「DCターゲット・イヤー ファンド2015」に、「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025」から「DCターゲット・イヤー ファンド2025」に、「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035」から「DCターゲット・イヤー ファンド2035」に、「すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045」から「DCターゲット・イヤー ファンド2045」にそれぞれ変更
- ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 短期金融資産 マザーファンド」の名称を「短期金融資産 マザーファンド」にそれぞれ変更
- 2017年3月29日 「DCターゲット・イヤー ファンド2015」の信託終了
- 2018年2月27日 「DC ターゲット・イヤー ファンド 2055」の投資信託契約締結、設定、運用開始



(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況 (2023年9月29日現在)

イ. 資本金の額: 20億円

ロ. 委託会社の沿革

- 1986年11月1日: 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 1987年2月20日: 投資顧問業の登録
- 1987年9月9日: 投資一任契約に係る業務の認可
- 1990年10月1日: 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 1999年2月15日: 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 1999年3月25日: 証券投資信託委託業の認可
- 2007年9月30日: 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録 (登録番号: 関東財務局長 (金商) 第347号)
- 2012年4月1日: 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年10月1日: 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ. 大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### (イ) 基本方針

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

#### (ロ) 運用方法

##### ①投資対象

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

##### ②投資態度

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## (2) 【投資対象】

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

《 2025 / 2035 / 2045 》

1. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 短期金融資産 マザーファンド
6. 株券または新株引受権証券
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人の発行する債券
10. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
11. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるも

のをいいます。)

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

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

《 2 0 5 5 》

1. ~17. 《 2 0 2 5 / 2 0 3 5 / 2 0 4 5 》と同じ。
18. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。)
19. ~27. 《 2 0 2 5 / 2 0 3 5 / 2 0 4 5 》と同じ。

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

(ハ) 委託会社は、信託金を、前記 (ロ) に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2

条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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

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

(参考)マザーファンド概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

- ①NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

#### 3. 運用制限

- ①同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ③外貨建資産への投資は、行いません。

- ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（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。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

- ①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）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- ③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

- ⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

- ①FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。
- ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

- ①同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポ

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

- ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

①原則としてMSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の



10%以下とします。

- ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### 「短期金融資産 マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の短期金融資産等を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

- ①わが国の短期金融資産等を中心に投資を行い、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果をめざします。
- ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- ③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。
- ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

#### 3. 運用制限

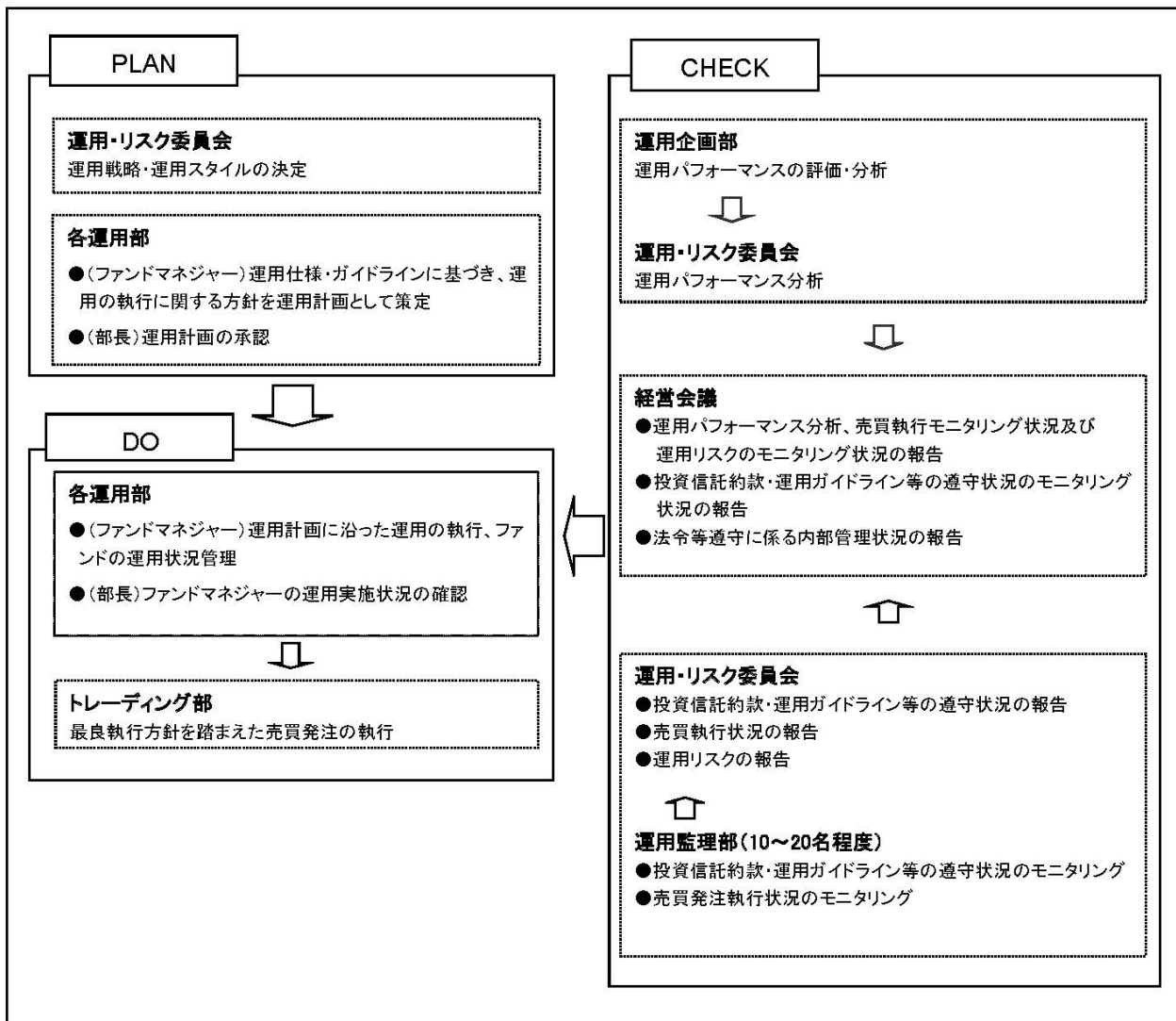
- ①株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得したものに限ることとし、投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④外貨建資産への投資は行いません。
- ⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委

託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

- ⑥デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### (3) 【運用体制】

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



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

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っ

ています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

#### (4) 【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### (5) 【投資制限】

<約款に定める投資制限>

##### (イ) 株式への投資割合（投資信託約款の「運用の基本方針」）

株式への実質投資割合は、以下の通りとします。

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

##### (ロ) 外貨建資産の投資割合（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合は、以下の通りとします。

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

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

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

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

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

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

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

##### (リ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図を

することができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。(投資信託約款第 22 条)

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

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

(以下同じ。) また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。(投資信託約款第 23 条)

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

(投資信託約款第 24 条)

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

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

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

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

(カ) 公社債の空売りの指図範囲

《 2025 / 2035 / 2045 》

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

《 2055 》

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

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

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

(レ) 資金の借入れ

《 2025 / 2035 / 2045 》

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の 10%を超えないこととします。また、収益分配金

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

#### 《 2055 》

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

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

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

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

#### ＜関連法令に基づく投資制限＞

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

(投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### ① 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。

##### ② 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。

##### ③ 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。

##### ④ 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。

##### ⑤ 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。

##### ⑥ 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>

① 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。

② 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。

- ③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。
- ④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。
- ⑤確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

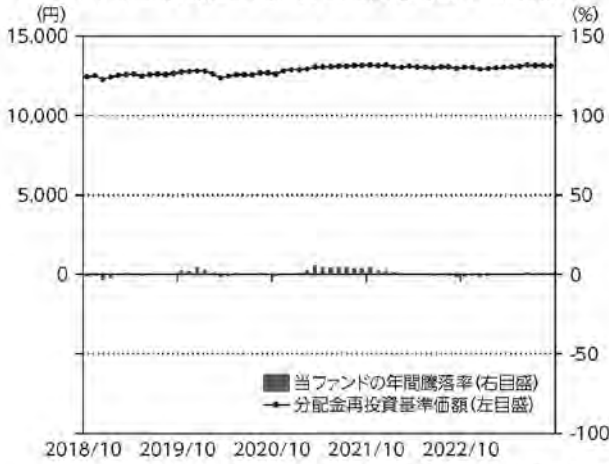
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。



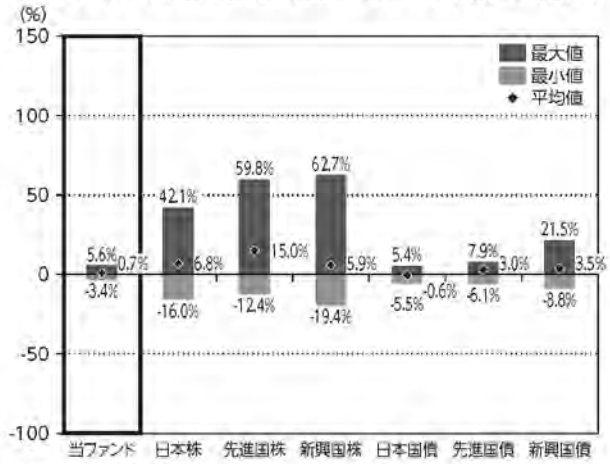
**[参考情報]**

**DCターゲット・イヤー ファンド2025**

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

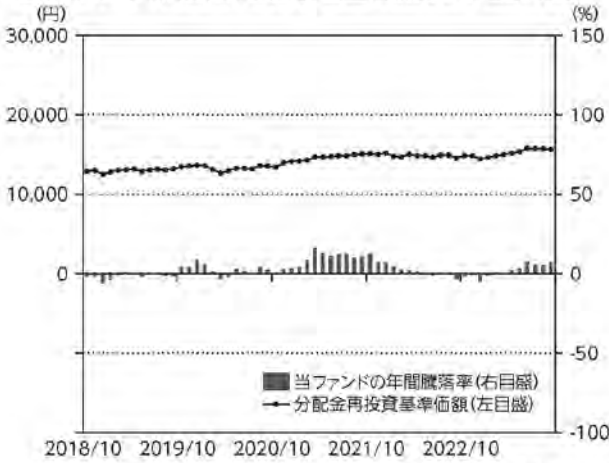


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

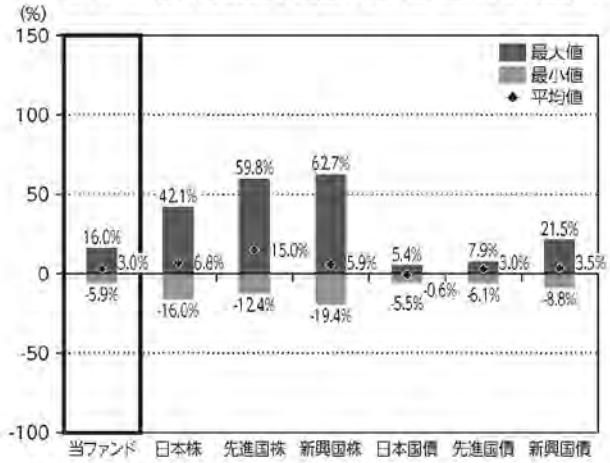


**DCターゲット・イヤー ファンド2035**

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

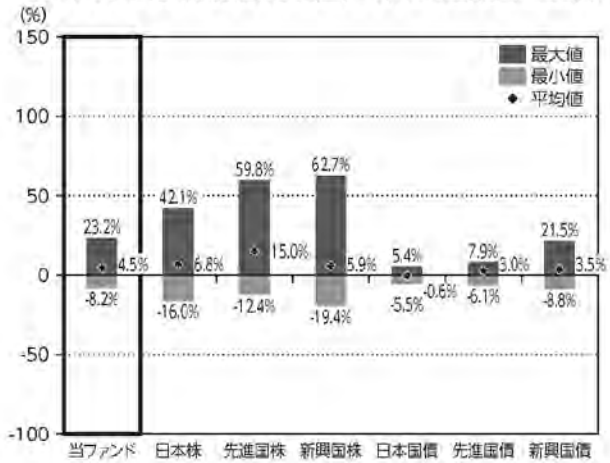


**DCターゲット・イヤー ファンド2045**

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



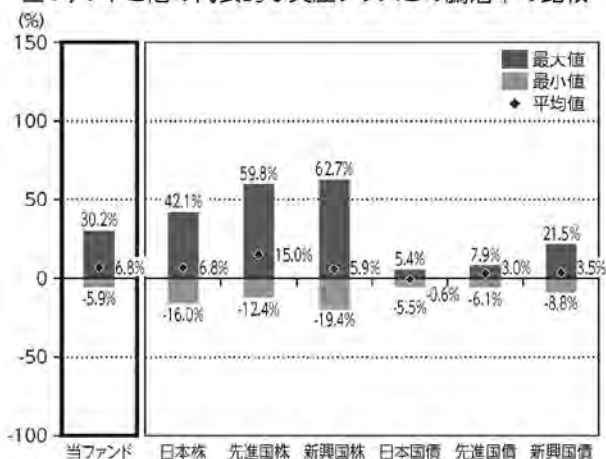
## 【参考情報】

### DCターゲット・イヤー ファンド2055

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*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。

\*DCターゲット・イヤー ファンド2025、DCターゲット・イヤー ファンド2035及びDCターゲット・イヤー ファンド2045については2018年10月～2023年9月の5年間のDCターゲット・イヤー ファンド2055については2019年2月～2023年9月の4年8ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2018年10月～2023年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

### 各資産クラスの指数について

<b>日本株</b> 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測る指数として、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、対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権利又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利、ノウハウ及び同指数に係る権利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。
<b>先進国株</b> 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。
<b>新興国株</b> 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。
<b>日本国債</b> NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
<b>先進国債</b> 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、本ファンドの権限、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、説明又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
<b>新興国債</b> JPMorgan Global Emerging Markets Bond Index (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、信託財産留保額（※）の控除はありません。

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

##### (3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

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

②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。

③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】

①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。）。

②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。

③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。）。

④《 2 0 2 5 / 2 0 3 5 / 2 0 4 5 》

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

《 2 0 5 5 》

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。

⑤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。

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

ロ. 一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

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

ニ. 少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。

NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となりますが、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

③個別元本について

イ. 追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等(申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)に当たります。

ロ. 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ. ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ. 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金(特別分配金)について」をご参照ください。

④普通分配金と元本払戻金(特別分配金)について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

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

⑤確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

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

※上記は、2023年9月29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 (①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
DCターゲット・イヤー ファンド2025	0.48%	0.47%	0.01%
DCターゲット・イヤー ファンド2035	0.48%	0.47%	0.01%
DCターゲット・イヤー ファンド2045	0.48%	0.47%	0.01%
DCターゲット・イヤー ファンド2055	0.48%	0.47%	0.01%

※対象期間は2022年8月30日～2023年8月28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、2023年9月29日現在の状況について記載してあります。

### 【DCターゲット・イヤー ファンド2025】

#### (1) 【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	5,192,538,549	97.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	158,016,482	2.95
合計(純資産総額)		5,350,555,031	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】

#### ① 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	4,129,076,492	1.0109	4,174,083,426	1.0110	4,174,496,333	78.02
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	479,356,070	1.3389	641,809,843	1.3302	637,639,444	11.92
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	92,145,033	2.3373	215,370,586	2.3825	219,535,541	4.10
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	20,858,531	5.1530	107,484,011	5.1507	107,436,035	2.01
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	16,309,889	3.3031	53,873,195	3.2760	53,431,196	1.00

(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) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

##### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.05
合計	97.05

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

#### ② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### ③ 【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】

① 【純資産の推移】

		純資産総額 (円)		1 万口当たりの純資産額 (円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 7 期計算期間末	(2014 年 8 月 28 日)	2,276,603,227	2,276,603,227	11,010	11,010
第 8 期計算期間末	(2015 年 8 月 28 日)	2,797,335,955	2,797,335,955	11,800	11,800
第 9 期計算期間末	(2016 年 8 月 29 日)	3,085,230,787	3,085,230,787	11,648	11,648
第 10 期計算期間末	(2017 年 8 月 28 日)	3,576,745,772	3,576,745,772	12,292	12,292
第 11 期計算期間末	(2018 年 8 月 28 日)	3,910,205,200	3,910,205,200	12,594	12,594
第 12 期計算期間末	(2019 年 8 月 28 日)	4,383,506,424	4,383,506,424	12,540	12,540
第 13 期計算期間末	(2020 年 8 月 28 日)	4,746,921,402	4,746,921,402	12,679	12,679
第 14 期計算期間末	(2021 年 8 月 30 日)	5,212,318,199	5,212,318,199	13,142	13,142
第 15 期計算期間末	(2022 年 8 月 29 日)	5,239,349,972	5,239,349,972	13,058	13,058
第 16 期計算期間末	(2023 年 8 月 28 日)	5,325,365,219	5,325,365,219	13,127	13,127
	2022 年 9 月末日	5,249,912,549	—	12,971	—
	10 月末日	5,296,710,181	—	13,041	—
	11 月末日	5,197,713,493	—	13,028	—
	12 月末日	5,150,367,732	—	12,922	—
	2023 年 1 月末日	5,175,956,526	—	12,961	—
	2 月末日	5,166,584,944	—	13,000	—
	3 月末日	5,214,752,881	—	13,033	—
	4 月末日	5,245,778,349	—	13,061	—
	5 月末日	5,274,372,063	—	13,097	—
	6 月末日	5,336,816,483	—	13,182	—
	7 月末日	5,368,186,248	—	13,159	—
	8 月末日	5,374,201,365	—	13,142	—
	9 月末日	5,350,555,031	—	13,120	—

② 【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 7 期計算期間	2013 年 8 月 29 日～2014 年 8 月 28 日	0
第 8 期計算期間	2014 年 8 月 29 日～2015 年 8 月 28 日	0
第 9 期計算期間	2015 年 8 月 29 日～2016 年 8 月 29 日	0
第 10 期計算期間	2016 年 8 月 30 日～2017 年 8 月 28 日	0
第 11 期計算期間	2017 年 8 月 29 日～2018 年 8 月 28 日	0
第 12 期計算期間	2018 年 8 月 29 日～2019 年 8 月 28 日	0
第 13 期計算期間	2019 年 8 月 29 日～2020 年 8 月 28 日	0
第 14 期計算期間	2020 年 8 月 29 日～2021 年 8 月 30 日	0



第15期計算期間	2021年8月31日～2022年8月29日	0
第16期計算期間	2022年8月30日～2023年8月28日	0

### ③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第7期計算期間	2013年8月29日～2014年8月28日	8.7
第8期計算期間	2014年8月29日～2015年8月28日	7.2
第9期計算期間	2015年8月29日～2016年8月29日	△1.3
第10期計算期間	2016年8月30日～2017年8月28日	5.5
第11期計算期間	2017年8月29日～2018年8月28日	2.5
第12期計算期間	2018年8月29日～2019年8月28日	△0.4
第13期計算期間	2019年8月29日～2020年8月28日	1.1
第14期計算期間	2020年8月29日～2021年8月30日	3.7
第15期計算期間	2021年8月31日～2022年8月29日	△0.6
第16期計算期間	2022年8月30日～2023年8月28日	0.5

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

(注2) 小数第2位を四捨五入しております。

### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第7期計算期間	2013年8月29日～2014年8月28日	510,257,180	68,896,868	2,067,801,560
第8期計算期間	2014年8月29日～2015年8月28日	385,997,089	83,215,635	2,370,583,014
第9期計算期間	2015年8月29日～2016年8月29日	351,565,066	73,529,672	2,648,618,408
第10期計算期間	2016年8月30日～2017年8月28日	345,039,082	83,920,170	2,909,737,320
第11期計算期間	2017年8月29日～2018年8月28日	350,641,543	155,550,641	3,104,828,222
第12期計算期間	2018年8月29日～2019年8月28日	511,821,385	120,990,227	3,495,659,380
第13期計算期間	2019年8月29日～2020年8月28日	419,462,284	171,242,620	3,743,879,044
第14期計算期間	2020年8月29日～2021年8月30日	475,701,731	253,364,979	3,966,215,796
第15期計算期間	2021年8月31日～2022年8月29日	351,520,007	305,408,490	4,012,327,313
第16期計算期間	2022年8月30日～2023年8月28日	408,854,663	364,509,007	4,056,672,969

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

### 【DCターゲット・イヤー ファンド2035】

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	6,342,881,006	97.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	192,780,424	2.95
合計(純資産総額)		6,535,661,430	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】

### ①【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	2,777,115,353	1.3387	3,717,724,324	1.3302	3,694,118,842	56.52
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	617,858,578	2.3374	1,444,182,641	2.3825	1,472,048,062	22.52
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	139,866,342	5.1530	720,731,261	5.1507	720,409,567	11.02
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	99,441,981	3.3030	328,460,683	3.2760	325,771,929	4.98
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	129,112,370	1.0109	130,532,605	1.0110	130,532,606	2.00

(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)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.05
合計	97.05

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

### ②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### ③【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】

### ①【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第7期計算期間末 (2014年8月28日)	1,633,177,356	1,633,177,356	10,868	10,868
第8期計算期間末 (2015年8月28日)	2,071,477,526	2,071,477,526	11,932	11,932
第9期計算期間末 (2016年8月29日)	2,267,735,876	2,267,735,876	11,461	11,461
第10期計算期間末 (2017年8月28日)	2,771,734,999	2,771,734,999	12,573	12,573
第11期計算期間末 (2018年8月28日)	3,240,277,607	3,240,277,607	13,175	13,175
第12期計算期間末 (2019年8月28日)	3,642,033,135	3,642,033,135	12,949	12,949

第13期計算期間末	(2020年8月28日)	4,220,411,377	4,220,411,377	13,567	13,567
第14期計算期間末	(2021年8月30日)	5,349,656,108	5,349,656,108	14,955	14,955
第15期計算期間末	(2022年8月29日)	5,735,939,018	5,735,939,018	14,909	14,909
第16期計算期間末	(2023年8月28日)	6,441,191,651	6,441,191,651	15,639	15,639
	2022年9月末日	5,669,824,290	—	14,564	—
	10月末日	5,833,717,454	—	14,890	—
	11月末日	5,794,983,023	—	14,870	—
	12月末日	5,675,938,854	—	14,456	—
	2023年1月末日	5,776,358,043	—	14,646	—
	2月末日	5,818,935,565	—	14,829	—
	3月末日	5,959,620,921	—	14,997	—
	4月末日	6,049,386,572	—	15,155	—
	5月末日	6,172,814,125	—	15,364	—
	6月末日	6,465,919,580	—	15,820	—
	7月末日	6,502,359,287	—	15,751	—
	8月末日	6,532,747,240	—	15,739	—
	9月末日	6,535,661,430	—	15,635	—

## ②【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金(円)
第7期計算期間	2013年8月29日～2014年8月28日	0
第8期計算期間	2014年8月29日～2015年8月28日	0
第9期計算期間	2015年8月29日～2016年8月29日	0
第10期計算期間	2016年8月30日～2017年8月28日	0
第11期計算期間	2017年8月29日～2018年8月28日	0
第12期計算期間	2018年8月29日～2019年8月28日	0
第13期計算期間	2019年8月29日～2020年8月28日	0
第14期計算期間	2020年8月29日～2021年8月30日	0
第15期計算期間	2021年8月31日～2022年8月29日	0
第16期計算期間	2022年8月30日～2023年8月28日	0

## ③【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第7期計算期間	2013年8月29日～2014年8月28日	11.5
第8期計算期間	2014年8月29日～2015年8月28日	9.8
第9期計算期間	2015年8月29日～2016年8月29日	△3.9
第10期計算期間	2016年8月30日～2017年8月28日	9.7
第11期計算期間	2017年8月29日～2018年8月28日	4.8

第12期計算期間	2018年8月29日～2019年8月28日	△1.7
第13期計算期間	2019年8月29日～2020年8月28日	4.8
第14期計算期間	2020年8月29日～2021年8月30日	10.2
第15期計算期間	2021年8月31日～2022年8月29日	△0.3
第16期計算期間	2022年8月30日～2023年8月28日	4.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第7期計算期間	2013年8月29日～2014年8月28日	365,544,435	42,147,384	1,502,787,319
第8期計算期間	2014年8月29日～2015年8月28日	295,447,605	62,141,449	1,736,093,475
第9期計算期間	2015年8月29日～2016年8月29日	280,298,222	37,748,019	1,978,643,678
第10期計算期間	2016年8月30日～2017年8月28日	284,666,336	58,716,974	2,204,593,040
第11期計算期間	2017年8月29日～2018年8月28日	333,480,026	78,692,832	2,459,380,234
第12期計算期間	2018年8月29日～2019年8月28日	417,662,600	64,376,146	2,812,666,688
第13期計算期間	2019年8月29日～2020年8月28日	398,934,497	100,702,007	3,110,899,178
第14期計算期間	2020年8月29日～2021年8月30日	568,152,385	101,939,288	3,577,112,275
第15期計算期間	2021年8月31日～2022年8月29日	395,490,801	125,411,706	3,847,191,370
第16期計算期間	2022年8月30日～2023年8月28日	480,122,344	208,769,999	4,118,543,715

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

#### 【DCターゲット・イヤー ファンド2045】

##### (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	3,430,860,238	97.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	103,790,391	2.94
合計(純資産総額)		3,534,650,629	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】

##### ①【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	1,102,577,100	1.3388	1,476,130,222	1.3302	1,466,648,058	41.49
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	484,239,289	2.3375	1,131,909,339	2.3825	1,153,700,106	32.64

日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	109,621,577	5.1530	564,879,987	5.1507	564,627,856	15.97
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	53,581,265	3.3030	176,978,919	3.2760	175,532,224	4.97
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	69,586,543	1.0110	70,351,995	1.0110	70,351,994	1.99

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.06
合計	97.06

(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。

#### ②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### ③【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】

#### ①【純資産の推移】

	純資産総額 (円)		1 万口当たりの純資産額 (円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 7 期計算期間末 (2014 年 8 月 28 日)	601,017,817	601,017,817	10,456	10,456
第 8 期計算期間末 (2015 年 8 月 28 日)	818,329,438	818,329,438	11,753	11,753
第 9 期計算期間末 (2016 年 8 月 29 日)	897,737,674	897,737,674	10,969	10,969
第 10 期計算期間末 (2017 年 8 月 28 日)	1,184,545,763	1,184,545,763	12,460	12,460
第 11 期計算期間末 (2018 年 8 月 28 日)	1,515,638,255	1,515,638,255	13,298	13,298
第 12 期計算期間末 (2019 年 8 月 28 日)	1,721,901,931	1,721,901,931	12,782	12,782
第 13 期計算期間末 (2020 年 8 月 28 日)	2,070,589,304	2,070,589,304	13,738	13,738
第 14 期計算期間末 (2021 年 8 月 30 日)	2,699,465,334	2,699,465,334	15,702	15,702
第 15 期計算期間末 (2022 年 8 月 29 日)	2,970,332,492	2,970,332,492	15,836	15,836
第 16 期計算期間末 (2023 年 8 月 28 日)	3,475,380,298	3,475,380,298	17,142	17,142
2022 年 9 月末日	2,926,678,710	—	15,370	—
10 月末日	3,029,220,241	—	15,867	—
11 月末日	3,037,545,777	—	15,879	—
12 月末日	2,954,204,603	—	15,348	—
2023 年 1 月末日	3,035,292,280	—	15,653	—

2月末日	3,070,822,386	—	15,864	—
3月末日	3,146,263,838	—	16,034	—
4月末日	3,207,132,579	—	16,261	—
5月末日	3,291,300,431	—	16,585	—
6月末日	3,497,507,424	—	17,264	—
7月末日	3,522,835,713	—	17,268	—
8月末日	3,536,323,498	—	17,296	—
9月末日	3,534,650,629	—	17,187	—

## ②【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 7 期計算期間	2013 年 8 月 29 日～2014 年 8 月 28 日	0
第 8 期計算期間	2014 年 8 月 29 日～2015 年 8 月 28 日	0
第 9 期計算期間	2015 年 8 月 29 日～2016 年 8 月 29 日	0
第 10 期計算期間	2016 年 8 月 30 日～2017 年 8 月 28 日	0
第 11 期計算期間	2017 年 8 月 29 日～2018 年 8 月 28 日	0
第 12 期計算期間	2018 年 8 月 29 日～2019 年 8 月 28 日	0
第 13 期計算期間	2019 年 8 月 29 日～2020 年 8 月 28 日	0
第 14 期計算期間	2020 年 8 月 29 日～2021 年 8 月 30 日	0
第 15 期計算期間	2021 年 8 月 31 日～2022 年 8 月 29 日	0
第 16 期計算期間	2022 年 8 月 30 日～2023 年 8 月 28 日	0

## ③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第 7 期計算期間	2013 年 8 月 29 日～2014 年 8 月 28 日	14.3
第 8 期計算期間	2014 年 8 月 29 日～2015 年 8 月 28 日	12.4
第 9 期計算期間	2015 年 8 月 29 日～2016 年 8 月 29 日	△6.7
第 10 期計算期間	2016 年 8 月 30 日～2017 年 8 月 28 日	13.6
第 11 期計算期間	2017 年 8 月 29 日～2018 年 8 月 28 日	6.7
第 12 期計算期間	2018 年 8 月 29 日～2019 年 8 月 28 日	△3.9
第 13 期計算期間	2019 年 8 月 29 日～2020 年 8 月 28 日	7.5
第 14 期計算期間	2020 年 8 月 29 日～2021 年 8 月 30 日	14.3
第 15 期計算期間	2021 年 8 月 31 日～2022 年 8 月 29 日	0.9
第 16 期計算期間	2022 年 8 月 30 日～2023 年 8 月 28 日	8.2

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

(注 2) 小数第 2 位を四捨五入しております。

## (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第7期計算期間	2013年8月29日～2014年8月28日	178,178,605	39,676,309	574,812,354
第8期計算期間	2014年8月29日～2015年8月28日	174,356,779	52,914,082	696,255,051
第9期計算期間	2015年8月29日～2016年8月29日	161,155,035	39,011,124	818,398,962
第10期計算期間	2016年8月30日～2017年8月28日	187,698,313	55,419,992	950,677,283
第11期計算期間	2017年8月29日～2018年8月28日	239,625,450	50,566,222	1,139,736,511
第12期計算期間	2018年8月29日～2019年8月28日	277,919,743	70,487,031	1,347,169,223
第13期計算期間	2019年8月29日～2020年8月28日	260,422,137	100,415,451	1,507,175,909
第14期計算期間	2020年8月29日～2021年8月30日	333,011,049	120,997,969	1,719,188,989
第15期計算期間	2021年8月31日～2022年8月29日	250,322,311	93,878,012	1,875,633,288
第16期計算期間	2022年8月30日～2023年8月28日	268,609,781	116,880,430	2,027,362,639

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

## 【DCターゲット・イヤー ファンド2055】

### (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	148,083,691	97.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,443,835	2.91
合計(純資産総額)		152,527,526	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】

#### ①【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	27,327,978	2.3387	63,912,900	2.3825	65,108,907	42.69
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	30,472,040	1.3389	40,799,507	1.3302	40,533,907	26.57
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	6,187,680	5.1536	31,888,926	5.1507	31,870,883	20.90
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	2,303,500	3.3028	7,608,186	3.2760	7,546,266	4.95
日本	親投資信託受益証券	短期金融資産 マザーファンド	2,990,829	1.0110	3,023,729	1.0110	3,023,728	1.98

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
----	----------

親投資信託受益証券	97.09
合計	97.09

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

	純資産総額 (円)		1 万口当たりの純資産額 (円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 1 期計算期間末 (2018 年 8 月 28 日)	1,457,998	1,457,998	10,043	10,043
第 2 期計算期間末 (2019 年 8 月 28 日)	4,150,978	4,150,978	9,426	9,426
第 3 期計算期間末 (2020 年 8 月 28 日)	17,950,694	17,950,694	10,382	10,382
第 4 期計算期間末 (2021 年 8 月 30 日)	81,504,845	81,504,845	12,285	12,285
第 5 期計算期間末 (2022 年 8 月 29 日)	108,764,217	108,764,217	12,534	12,534
第 6 期計算期間末 (2023 年 8 月 28 日)	149,554,557	149,554,557	13,995	13,995
2022 年 9 月末日	108,494,432	—	12,086	—
10 月末日	114,639,543	—	12,599	—
11 月末日	115,885,830	—	12,636	—
12 月末日	114,261,847	—	12,143	—
2023 年 1 月末日	118,799,139	—	12,466	—
2 月末日	121,379,139	—	12,646	—
3 月末日	125,912,346	—	12,774	—
4 月末日	129,840,243	—	13,002	—
5 月末日	137,499,701	—	13,340	—
6 月末日	147,196,047	—	14,033	—
7 月末日	149,940,785	—	14,100	—
8 月末日	153,282,943	—	14,156	—
9 月末日	152,527,526	—	14,072	—

②【分配の推移】

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



第3期計算期間	2019年8月29日～2020年8月28日	0
第4期計算期間	2020年8月29日～2021年8月30日	0
第5期計算期間	2021年8月31日～2022年8月29日	0
第6期計算期間	2022年8月30日～2023年8月28日	0

### ③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第1期計算期間	2018年2月27日～2018年8月28日	0.4
第2期計算期間	2018年8月29日～2019年8月28日	△6.1
第3期計算期間	2019年8月29日～2020年8月28日	10.1
第4期計算期間	2020年8月29日～2021年8月30日	18.3
第5期計算期間	2021年8月31日～2022年8月29日	2.0
第6期計算期間	2022年8月30日～2023年8月28日	11.7

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

(注2) 小数第2位を四捨五入しております。

### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第1期計算期間	2018年2月27日～2018年8月28日	1,451,770	—	1,451,770
第2期計算期間	2018年8月29日～2019年8月28日	6,156,092	3,204,277	4,403,585
第3期計算期間	2019年8月29日～2020年8月28日	17,683,699	4,797,666	17,289,618
第4期計算期間	2020年8月29日～2021年8月30日	51,620,729	2,564,231	66,346,116
第5期計算期間	2021年8月31日～2022年8月29日	29,069,429	8,642,594	86,772,951
第6期計算期間	2022年8月30日～2023年8月28日	22,231,123	2,139,980	106,864,094

(注1) 第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	543,220,316,450	84.51
地方債証券	日本	32,867,650,860	5.11
特殊債券	日本	36,727,047,864	5.71
社債券	日本	27,259,970,000	4.24
	フランス	1,290,105,000	0.20
	スペイン	398,448,000	0.06
	韓国	99,371,000	0.02

	小計	29,047,894,000	4.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	899,227,405	0.14
合計(純資産総額)		642,762,136,579	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350回利付国債(10年)	6,670,000,000	100.04	6,673,134,900	99.22	6,618,507,600	0.100	2028/3/20	1.03
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,210,000,000	100.15	6,219,794,300	99.78	6,196,524,300	0.005	2026/6/20	0.96
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,267,000,000	97.88	6,134,139,600	95.63	5,993,445,450	0.100	2031/12/20	0.93
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	100.44	5,926,373,000	99.98	5,899,115,000	0.100	2026/9/20	0.92
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	5,910,000,000	100.08	5,914,728,000	99.59	5,886,300,900	0.005	2026/12/20	0.92
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,810,000,000	99.98	5,809,007,400	99.33	5,771,363,500	0.005	2027/6/20	0.90
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	100.39	5,772,942,500	99.81	5,739,075,000	0.100	2027/3/20	0.89
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	5,670,000,000	100.08	5,675,001,500	99.70	5,653,216,800	0.005	2026/9/20	0.88
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	5,440,000,000	100.10	5,445,920,600	99.85	5,431,948,800	0.005	2026/3/20	0.85
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	5,430,000,000	98.19	5,331,733,000	96.20	5,223,985,800	0.100	2031/6/20	0.81
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,180,000,000	100.30	5,195,603,800	99.54	5,156,534,600	0.100	2027/9/20	0.80
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	100.17	5,169,092,800	99.39	5,128,730,400	0.100	2027/12/20	0.80
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,120,000,000	100.37	5,138,944,000	100.14	5,127,526,400	0.100	2025/9/20	0.80
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	5,050,000,000	100.33	5,066,665,000	100.15	5,057,777,000	0.100	2025/6/20	0.79
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	100.90	5,065,631,800	100.56	5,048,312,800	0.300	2025/12/20	0.79
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	5,230,000,000	98.21	5,136,876,900	95.66	5,003,018,000	0.200	2032/9/20	0.78
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,160,000,000	98.53	5,084,268,600	96.19	4,963,765,200	0.200	2032/3/20	0.77
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,050,000,000	98.02	4,950,010,000	95.90	4,843,253,000	0.100	2031/9/20	0.75
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	4,970,000,000	98.81	4,911,312,400	97.14	4,828,007,100	0.100	2030/9/20	0.75
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	5,010,000,000	98.37	4,928,526,100	95.93	4,806,193,200	0.200	2032/6/20	0.75
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	4,800,000,000	100.39	4,818,720,000	100.12	4,805,808,000	0.100	2025/12/20	0.75
日本	国債証券	第351回利付国債	4,835,000,000	99.94	4,832,534,150	99.02	4,787,810,400	0.100	2028/6/20	0.74

		債(10年)								
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	100.42	4,780,039,600	100.08	4,764,093,600	0.100	2026/3/20	0.74
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	4,860,000,000	100.83	4,900,471,300	97.83	4,754,732,400	0.500	2033/3/20	0.74
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	4,850,000,000	98.43	4,774,063,500	96.49	4,680,104,500	0.100	2031/3/20	0.73
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	4,810,000,000	98.55	4,740,410,400	96.80	4,656,512,900	0.100	2030/12/20	0.72
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	4,720,000,000	99.71	4,706,406,400	98.60	4,654,250,400	0.100	2029/3/20	0.72
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	4,740,000,000	100.79	4,777,800,400	98.05	4,647,854,400	0.500	2032/12/20	0.72
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	4,790,000,000	97.61	4,675,901,000	96.69	4,631,882,100	0.400	2033/6/20	0.72
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	100.85	4,599,124,800	100.59	4,587,314,400	0.400	2025/3/20	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	84.51
地方債証券	5.11
特殊債券	5.71
社債券	4.52
合計	99.86

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	567,182,679,660	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	7,787,912,121	1.35
合計(純資産総額)		574,970,591,781	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	5,971,395,000	1.04

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 （％）
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,461,500	1,933.20	18,290,971,800	2,677.50	25,333,166,250	4.41
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,218,900	13,273.18	16,178,679,102	12,240.00	14,919,336,000	2.59
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,628,200	929.89	9,883,056,898	1,268.50	13,481,871,700	2.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	55,359,900	162.74	9,009,270,126	176.60	9,776,558,340	1.70
日本	株式	キーエンス	電気機器	172,400	68,599.15	11,826,493,460	55,500.00	9,568,200,000	1.66
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,206,100	5,657.14	6,823,076,554	7,347.00	8,861,216,700	1.54
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,111,500	5,920.19	6,580,291,185	7,128.00	7,922,772,000	1.38
日本	株式	日立製作所	電気機器	846,300	8,140.92	6,889,660,596	9,275.00	7,849,432,500	1.37
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	364,700	19,731.43	7,196,052,521	20,440.00	7,454,468,000	1.30
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,529,400	4,537.53	6,939,698,382	4,641.00	7,097,945,400	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,202,100	1,343.43	5,645,241,210	1,682.00	7,067,932,200	1.23
日本	株式	三井物産	卸売業	1,275,600	4,643.81	5,923,644,036	5,423.00	6,917,578,800	1.20
日本	株式	任天堂	その他製品	1,087,900	5,913.83	6,433,655,657	6,230.00	6,777,617,000	1.18
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,454,300	2,077.66	5,099,200,938	2,541.00	6,236,376,300	1.08
日本	株式	信越化学工業	化学	1,434,700	4,405.13	6,320,040,011	4,343.00	6,230,902,100	1.08
日本	株式	第一三共	医薬品	1,505,500	4,542.39	6,838,568,145	4,106.00	6,181,583,000	1.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,335,400	4,356.19	5,817,256,126	4,577.00	6,112,125,800	1.06
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,123,400	4,952.08	5,563,166,672	5,406.00	6,073,100,400	1.06
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,311,400	4,444.89	5,829,028,746	4,609.00	6,044,242,600	1.05
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,677,400	3,112.44	5,220,806,856	3,465.00	5,812,191,000	1.01
日本	株式	HOYA	精密機器	365,100	17,157.02	6,264,028,002	15,325.00	5,595,157,500	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	852,500	5,557.36	4,737,649,400	6,335.00	5,400,587,500	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	207,800	26,765.02	5,561,771,156	23,475.00	4,878,105,000	0.85
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,778,000	1,511.19	4,198,085,820	1,690.50	4,696,209,000	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	937,500	5,374.73	5,038,809,375	4,909.00	4,602,187,500	0.80

日本	株式	村田製作所	電気機器	1,567,800	2,752.68	4,315,656,930	2,734.00	4,286,365,200	0.75
日本	株式	SMC	機械	56,400	74,555.98	4,204,957,272	66,980.00	3,777,672,000	0.66
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	628,300	6,147.32	3,862,361,156	5,855.00	3,678,696,500	0.64
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,031,000	3,083.36	3,178,944,160	3,440.00	3,546,640,000	0.62
日本	株式	パナソニック ホールディングス	電気機器	2,055,600	1,455.41	2,991,740,796	1,682.00	3,457,519,200	0.60

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.40
		建設業	2.12
		食料品	3.36
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.18
		化学	5.71
		医薬品	5.04
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	1.00
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.50
		機械	5.27
		電気機器	16.40
		輸送用機器	8.73
		精密機器	2.25
		その他製品	2.22
		電気・ガス業	1.38
		陸運業	2.88
		海運業	0.67
		空運業	0.47
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	7.94
		卸売業	6.70
小売業	4.27		
銀行業	7.04		
証券、商品先物取引業	0.77		

	保険業	2.40
	その他金融業	1.20
	不動産業	1.91
	サービス業	4.65
	小計	98.65
合計		98.65

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	257円		6,069,288,100	5,971,395,000	1.04

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

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

#### 外国債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	136,295,760,998	47.24
	フランス	23,029,341,708	7.98
	イタリア	20,634,945,803	7.15
	中国	19,975,212,680	6.92
	ドイツ	18,085,458,700	6.27
	イギリス	13,764,787,117	4.77
	スペイン	13,642,998,617	4.73
	カナダ	5,722,573,043	1.98
	ベルギー	5,022,933,433	1.74
	オーストラリア	4,182,340,816	1.45
	オランダ	4,065,255,590	1.41
	オーストリア	3,329,965,323	1.15
	メキシコ	2,769,744,057	0.96
	アイルランド	1,615,756,221	0.56
	マレーシア	1,501,068,817	0.52
	フィンランド	1,471,495,150	0.51
	ポーランド	1,400,205,994	0.49

	シンガポール	1,275,634,660	0.44
	デンマーク	888,942,515	0.31
	イスラエル	873,457,768	0.30
	ニュージーランド	644,822,300	0.22
	スウェーデン	562,179,424	0.19
	ノルウェー	464,009,058	0.16
	小計	281,218,889,792	97.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	7,304,284,091	2.53
合計(純資産総額)		288,523,173,883	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,958,951,163	0.68
	買建	ドイツ	1,741,449,930	0.60

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	4,441,014,672	1.54

(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 4.125% 11/15/32	14,000,000	15,155.53	2,121,774,401	14,425.70	2,019,598,769	4.125	2032/11/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	13,800,000	13,736.23	1,895,600,456	12,951.52	1,787,310,395	2.750	2032/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,036.85	1,640,908,464	13,787.06	1,611,708,372	2.375	2027/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,363.57	1,555,337,132	11,718.65	1,474,207,190	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	14,455.55	1,474,466,483	14,428.62	1,471,719,964	3.125	2025/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	14,395.32	1,461,125,190	14,448.49	1,466,522,051	2.250	2024/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,840.21	1,504,873,313	12,148.11	1,423,759,237	1.875	2032/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	14,228.54	1,431,391,500	13,854.26	1,393,738,881	2.875	2028/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,969.02	1,430,299,003	11,474.42	1,371,193,441	0.625	2030/8/15	0.48

アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,901.59	1,404,060,716	13,128.56	1,325,985,211	2.875	2032/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	12,158.92	1,355,720,222	11,632.18	1,296,988,313	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	13,534.06	1,285,736,512	13,466.87	1,279,353,066	0.750	2026/4/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	14,230.55	1,252,288,438	14,309.43	1,259,229,874	1.500	2024/11/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/31/27	8,850,000	14,285.65	1,264,280,070	14,110.18	1,248,751,390	3.125	2027/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	12,798.43	1,264,485,748	12,616.72	1,246,532,171	0.375	2027/9/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/30/24	8,500,000	14,288.10	1,214,488,804	14,384.91	1,222,718,186	1.500	2024/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	12,853.65	1,233,950,866	12,637.17	1,213,168,590	0.625	2027/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	14,288.39	1,208,798,289	14,302.71	1,210,009,359	2.000	2025/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	13,023.10	1,237,194,583	12,703.49	1,206,831,593	1.250	2028/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/28/25	8,500,000	14,060.81	1,195,169,031	14,111.93	1,199,514,741	1.125	2025/2/28	0.42
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	14,351.20	1,205,501,440	13,919.70	1,169,255,176	3.125	2028/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	14,828.44	1,205,552,214	14,331.04	1,165,114,323	3.875	2029/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	13,056.35	1,175,071,527	12,800.48	1,152,043,542	1.250	2028/6/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 1% 12/15/24	8,000,000	14,102.58	1,128,207,150	14,203.08	1,136,247,075	1.000	2024/12/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	13,802.55	1,104,204,239	13,861.27	1,108,901,984	0.375	2025/4/30	0.38
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000	2,039.23	1,098,533,677	2,039.75	1,098,815,166	1.990	2025/4/9	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	8,480,000	13,167.13	1,116,572,632	12,900.69	1,093,978,575	1.250	2028/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	9,230,000	12,299.74	1,135,266,132	11,685.93	1,078,612,031	1.250	2031/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/31/28	8,500,000	12,905.07	1,096,931,203	12,672.23	1,077,139,603	0.750	2028/1/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.375% 01/31/26	8,000,000	13,487.90	1,079,032,725	13,458.10	1,076,648,791	0.375	2026/1/31	0.37

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.47
合計	97.47

(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	53	アメリカ ドル	5,603,757.88	838,210,103	5,575,765.89	834,023,061	0.29
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	35	アメリカ ドル	3,815,098.11	570,662,375	3,775,078.3	564,676,212	0.20
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	33	アメリカ ドル	3,865,467.4	578,196,614	3,745,500	560,251,890	0.19
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	21	ユーロ	2,206,364.1	348,605,528	2,200,485	347,676,630	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ	EURO-BOBL FU	買建	27	ユーロ	3,134,706.7	495,283,658	3,102,300	490,163,400	0.17



	金融先物取引所									
	ドイツ ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	45	ユーロ	5,838,044.5	922,411,031	5,719,050	903,609,900	0.31

(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	15,120,000.00	2,235,617,426	2,255,347,584	0.78
	カナダドル	買建	1,560,000.00	170,714,345	172,309,488	0.06
	ユーロ	買建	9,330,000.00	1,468,049,736	1,471,070,430	0.51
	イギリスポンド	買建	1,250,000.00	227,459,959	227,545,625	0.08
	オフショア人民元	買建	15,410,000.00	311,822,851	314,741,545	0.11

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

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	401,505,357,979	68.05
	イギリス	24,048,770,892	4.08
	カナダ	19,977,364,676	3.39
	フランス	18,086,055,796	3.07
	スイス	18,068,171,667	3.06
	ドイツ	13,551,974,450	2.30
	オーストラリア	11,001,412,050	1.86
	アイルランド	10,637,436,027	1.80
	オランダ	10,433,331,381	1.77
	デンマーク	5,449,818,244	0.92
	スウェーデン	4,702,722,134	0.80
	スペイン	4,217,731,360	0.71
	イタリア	3,092,605,394	0.52
	香港	2,806,932,492	0.48
	シンガポール	1,923,319,127	0.33
	フィンランド	1,799,404,712	0.30
	ジャージー	1,693,259,960	0.29
ベルギー	1,275,022,972	0.22	

	ノルウェー	1,198,262,968	0.20
	イスラエル	1,153,389,469	0.20
	キュラソー	962,258,635	0.16
	バミューダ	929,956,200	0.16
	ケイマン	836,634,552	0.14
	ニュージーランド	425,919,421	0.07
	ルクセンブルク	344,609,293	0.06
	オーストリア	328,501,688	0.06
	ポルトガル	317,459,559	0.05
	リベリア	240,992,688	0.04
	パナマ	155,104,947	0.03
	マン島	83,795,416	0.01
	小計	561,247,576,149	95.12
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	110,654,920	0.02
	香港	49,060,147	0.01
	小計	159,715,067	0.03
投資証券	アメリカ	9,370,596,574	1.59
	オーストラリア	684,045,509	0.12
	シンガポール	237,310,576	0.04
	フランス	215,548,708	0.04
	イギリス	159,430,686	0.03
	香港	117,850,510	0.02
	カナダ	55,301,186	0.01
	ベルギー	46,684,626	0.01
	小計	10,886,768,375	1.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	17,722,711,493	3.00
合計(純資産総額)		590,016,771,084	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	13,008,505,162	2.20
	買建	カナダ	627,071,894	0.11
	買建	ドイツ	2,595,246,554	0.44
	買建	イギリス	893,842,108	0.15
	買建	オーストラリア	592,738,230	0.10

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

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

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	730,540,746	0.12

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,177,684	26,243.40	30,906,438,684	25,531.81	30,068,404,364	5.10
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	528,983	49,785.90	26,335,897,323	46,914.27	24,816,851,922	4.21
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	690,901	17,984.16	12,425,277,477	18,844.08	13,019,399,520	2.21
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	184,802	58,347.30	10,782,697,976	64,452.52	11,910,955,747	2.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	444,829	18,647.40	8,294,907,661	19,790.92	8,803,579,512	1.49
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	395,244	18,761.81	7,415,496,547	19,913.58	7,870,725,148	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	213,419	29,057.98	6,201,526,534	36,853.52	7,865,241,470	1.33
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	165,576	39,224.35	6,494,611,642	45,466.33	7,528,134,182	1.28
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	301,729	15,701.41	4,737,571,523	17,870.32	5,391,994,568	0.91
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	69,912	72,038.12	5,036,329,315	76,300.75	5,334,338,593	0.90
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	97,275	48,003.94	4,669,583,360	53,409.03	5,195,363,860	0.88
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	60,535	63,847.83	3,865,028,661	81,438.83	4,929,899,635	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	217,897	20,481.98	4,462,964,044	22,076.51	4,810,405,779	0.82
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	179,427	23,087.67	4,142,551,904	23,466.11	4,210,453,791	0.71

			ンス						
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	120,784	33,651.01	4,064,503,906	34,651.70	4,185,371,271	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	177,374	21,763.67	3,860,310,044	21,889.53	3,882,634,771	0.66
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	30,991	121,568.15	3,767,518,642	124,450.56	3,856,847,305	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	63,267	55,998.26	3,542,842,206	59,748.23	3,780,091,596	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	135,745	23,060.49	3,130,346,567	25,516.85	3,463,785,102	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	75,273	43,801.51	3,297,071,167	45,396.03	3,417,095,682	0.58
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	246,100	12,052.87	2,966,211,799	13,805.28	3,397,480,638	0.58
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	199,766	18,310.78	3,657,873,115	16,820.03	3,360,070,912	0.57
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	133,056	20,599.57	2,740,896,436	22,773.55	3,030,158,134	0.51
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	191,177	16,610.69	3,175,582,369	15,601.19	2,982,589,465	0.51
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	32,965	75,875.95	2,501,250,719	85,055.67	2,803,860,340	0.48
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	110,203	21,901.50	2,413,611,401	24,312.73	2,679,336,137	0.45
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	29,993	107,752.83	3,231,830,930	87,026.39	2,610,182,815	0.44
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	102,377	27,456.90	2,810,955,542	25,353.80	2,595,647,006	0.44
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,096	62,134.03	2,118,522,098	75,488.53	2,573,857,212	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	305,497	9,013.69	2,753,655,499	8,348.05	2,550,307,225	0.43

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
----	-------	----	----------

株式	外国	エネルギー	5.43
		素材	3.92
		資本財	6.48
		商業・専門サービス	1.51
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	2.15
		耐久消費財・アパレル	1.46
		消費者サービス	2.05
		メディア・娯楽	6.01
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.28
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.69
		家庭用品・パーソナル用品	1.68
		ヘルスケア機器・サービス	4.39
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.37
		銀行	5.23
		金融サービス	6.40
		保険	3.07
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.04
		ソフトウェア・サービス	9.13
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.54
電気通信サービス	1.13		
公益事業	2.61		
半導体・半導体製造装置	5.79		
不動産管理・開発	0.32		
小計			95.12
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.03
投資証券	—	—	1.85
合計			97.00

(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	401	アメリカドル	90,274,284.55	13,503,227,482	86,966,875	13,008,505,162	2.20
	カナダ	モントリオ	S&P/TSE 60	買建	24	カナダドル	5,805,348	642,884,237	5,662,560	627,071,894	0.11

	ール取引所			ル						
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	46	スイスフラン	5,080,492	830,457,222	5,038,380	823,573,594	0.14
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	268	ユーロ	11,425,647.6	1,805,252,321	11,213,120	1,771,672,960	0.30
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	35	オーストラリアドル	6,375,395	612,420,444	6,170,500	592,738,230	0.10
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	64	イギリスポンド	4,879,485	890,652,396	4,896,960	893,842,108	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。

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	4,340,000.00	648,818,900	648,831,396	0.11
	スイスフラン	買建	500,000.00	81,690,000	81,709,350	0.01

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

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

## 短期金融資産 マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	9,738,949,434	100.00
合計(純資産総額)		9,738,949,434	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

#### ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

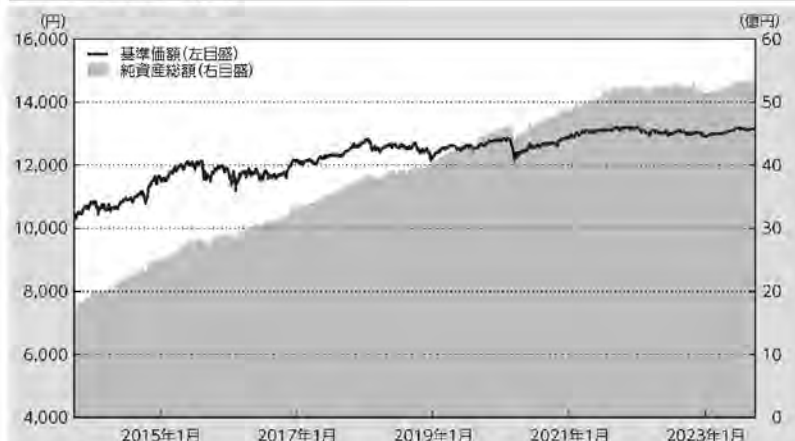
該当事項はありません。

## 運用実績

当初設定日：2007年9月26日  
作成基準日：2023年9月29日

### DCターゲット・イヤー ファンド2025

#### 基準価額・純資産の推移



基準価額 13,120円

純資産総額 53.51億円

#### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年8月	0円
2020年8月	0円
2021年8月	0円
2022年8月	0円
2023年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

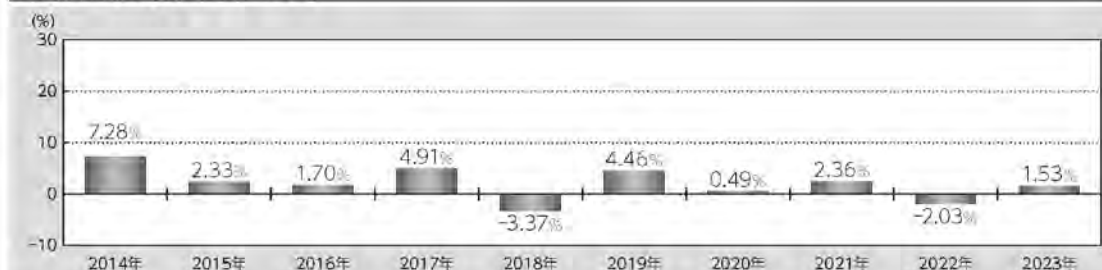
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

#### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
短期金融資産 マザーファンド	78.0%	-	-	-	-	-	-	-
国内債券 インデックス マザーファンド	11.9%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	11.9%	第148回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/06/20	0.1%
国内株式 インデックス マザーファンド	4.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
国内株式 インデックス マザーファンド	4.1%	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.1%
外国株式 インデックス マザーファンド	2.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/機器	-	-	0.1%
外国株式 インデックス マザーファンド	2.0%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.1%
外国債券 インデックス マザーファンド	1.0%	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.0%
外国債券 インデックス マザーファンド	1.0%	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

#### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2023年は年当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：2007年9月26日  
作成基準日：2023年9月29日

## DCターゲット・イヤー ファンド2035

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	15,635円
純資産総額	65.36億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年 8月	0円
2020年 8月	0円
2021年 8月	0円
2022年 8月	0円
2023年 8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

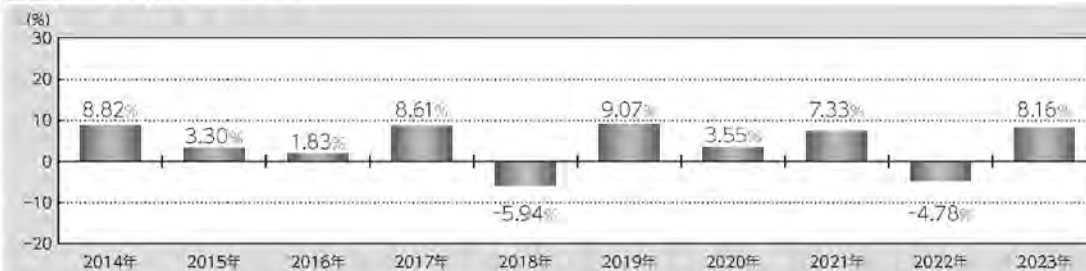
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内債券 インデックス マザーファンド	56.5%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.6%
		第148回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/06/20	0.5%
国内株式 インデックス マザーファンド	22.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.0%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
外国株式 インデックス マザーファンド	11.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.6%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.5%
外国債券 インデックス マザーファンド	5.0%	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.0%
		T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	2.0%	-	-	-	-	-	-	-

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2023年は年初から作成基準日までの収益率です。  
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

当初設定日：2007年9月26日  
作成基準日：2023年9月29日

## DCターゲット・イヤー ファンド2045

### 基準価額・純資産の推移



基準価額 17,187円

純資産総額 35.35億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年 8月	0円
2020年 8月	0円
2021年 8月	0円
2022年 8月	0円
2023年 8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

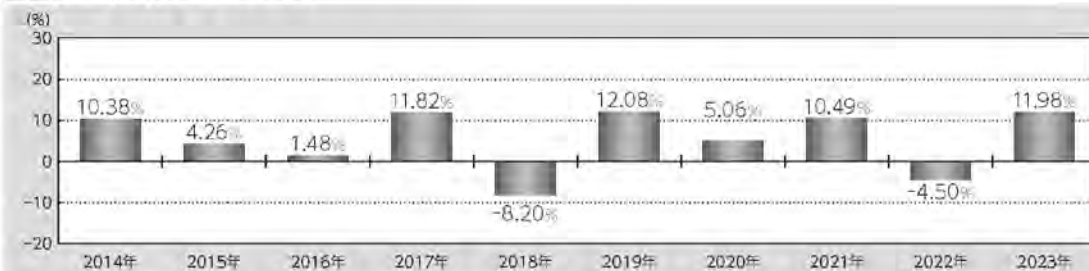
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内債券 インデックス マザーファンド	41.5%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.4%
		第148回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/06/20	0.4%
国内株式 インデックス マザーファンド	32.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.4%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
外国株式 インデックス マザーファンド	16.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/半導体	-	-	0.8%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.7%
外国債券 インデックス マザーファンド	5.0%	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.0%
		T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	2.0%	-	-	-	-	-	-	-

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2023年は年初から作成基準日までの収益率です。  
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

# 運用実績

当初設定日：2018年2月27日  
作成基準日：2023年9月29日

## DCターゲット・イヤー ファンド2055

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	14,072円
純資産総額	1.53億円

### 分配の推移

(1万円当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年 8月	0円
2020年 8月	0円
2021年 8月	0円
2022年 8月	0円
2023年 8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

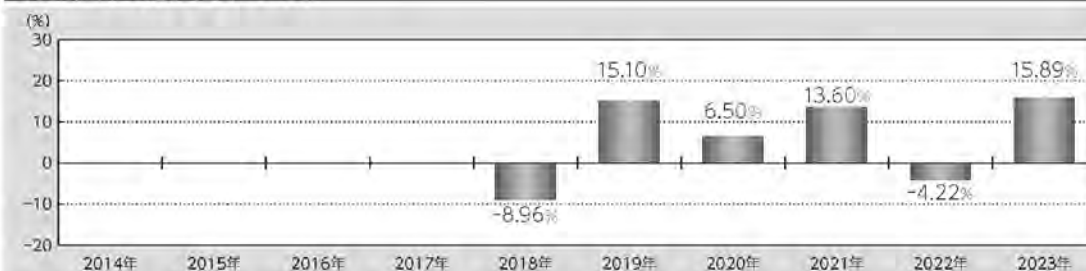
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式 インデックス マザーファンド	42.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.9%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	26.6%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.3%
		第148回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/06/20	0.3%
外国株式 インデックス マザーファンド	20.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	IT/ソフトウェア/ハードウェア	-	-	1.1%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.9%
外国債券 インデックス マザーファンド	4.9%	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.0%
		T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.0%
短期金融資産 マザーファンド	2.0%	-	-	-	-	-	-	-

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※2018年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2023年は年初から作成基準日までの収益率です。  
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### <申込手続>

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

#### <申込コース>

当ファンドは、「分配金再投資コース」(※)専用ファンドです。

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

#### <申込みの受付>

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

#### <申込単位>

1円以上1円単位とします。

#### <申込価額>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### <申込手数料>

ありません。

#### <申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### <受付不可日>

ありません。

#### <申込受付の中止等>

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

#### <その他>

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項

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

#### <問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

## 2 【換金（解約）手続等】

#### <一部解約手続>

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

#### <一部解約の受付>

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

#### <一部解約単位>

1口単位とします。

#### <解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### <一部解約代金の支払い>

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに基づきとります。

#### <受付不可日>

ありません。

#### <一部解約受付の中止等>

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

取り消すことができます。

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

#### 〈一部解約の制限〉

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

#### 〈その他〉

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

#### 〈問い合わせ先〉

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

##### 〈基準価額の算出方法〉

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

##### 〈基準価額の算出頻度〉

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### 〈主要な投資対象資産の評価方法〉

###### ①ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

###### ②マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

###### ・株式

原則として、ファンドの基準価額計算日（外国で取引されているものについては、原則として、

ファンドの基準価額計算日の前日)の当該取引所における最終相場で評価します。

・公社債

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

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

③外貨建資産等の円換算

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

<基準価額の照会方法>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

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

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

《2025、2035、2045》

<投資信託契約の終了(償還)と手続き>

(1)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)

- ①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了(繰上償還)させることができます。

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

②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。

③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。

④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）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。

①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。

②上記①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。

③上記②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ときは、ファンドの繰上償還を行いません。

④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。

⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④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②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。

①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。

②上記①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。

③上記②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。

④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>

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背  
いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を  
申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託  
会社は、上記<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>に従い、新受託会社を選任  
します。

②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>

①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。

②上記①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。

- ③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。
- ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

《2055》

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

- ①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。
- ・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
  - ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
  - ・やむを得ない事情が発生した場合
- ②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。
- ③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。
- ④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記(1)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。

- ①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③上記①の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

#### (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

- ①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③上記①の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### <受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

- ①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- ②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

## 4 【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

- ①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。
- ②収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されて

いる受益権については原則として取得申込者とします。) に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2) 償還金に対する請求権

- ① 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。
- ② 償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③ 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。
- ④ 受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

##### 【DCターゲット・イヤー ファンド2025】

- (1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(2022年8月30日から2023年8月28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。

# 独立監査人の監査報告書

2023年11月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎雅則  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤー ファンド2025の2022年8月30日から2023年8月28日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤー ファンド2025の2023年8月28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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を

開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 15 期 (2022 年 8 月 29 日現在)	第 16 期 (2023 年 8 月 28 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	178,148,550	169,501,645
親投資信託受益証券	5,082,214,943	5,165,923,066
未収入金	3,530,000	14,000,000
流動資産合計	5,263,893,493	5,349,424,711
資産合計	5,263,893,493	5,349,424,711
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,908,076	11,413,721
未払受託者報酬	1,148,705	1,149,622
未払委託者報酬	11,199,792	11,208,666
未払利息	298	392
その他未払費用	286,650	287,091
流動負債合計	24,543,521	24,059,492
負債合計	24,543,521	24,059,492
純資産の部		
元本等		
元本	4,012,327,313	4,056,672,969
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1,227,022,659	1,268,692,250
(分配準備積立金)	720,178,435	657,627,156
元本等合計	5,239,349,972	5,325,365,219
純資産合計	5,239,349,972	5,325,365,219
負債純資産合計	5,263,893,493	5,349,424,711



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 15 期		第 16 期	
	自 2021 年 8 月 31 日	至 2022 年 8 月 29 日	自 2022 年 8 月 30 日	至 2023 年 8 月 28 日
<b>営業収益</b>				
受取利息		1,065		376
有価証券売買等損益		△8,074,196		52,818,123
営業収益合計		△8,073,131		52,818,499
<b>営業費用</b>				
支払利息		57,016		88,948
受託者報酬		2,294,168		2,297,718
委託者報酬		22,367,969		22,402,481
その他費用		286,650		287,091
営業費用合計		25,005,803		25,076,238
営業利益又は営業損失 (△)		△33,078,934		27,742,261
経常利益又は経常損失 (△)		△33,078,934		27,742,261
当期純利益又は当期純損失 (△)		△33,078,934		27,742,261
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 (△)		△1,323,604		△413,216
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		1,246,102,403		1,227,022,659
剰余金増加額又は欠損金減少額		108,593,515		124,929,197
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		108,593,515		124,929,197
剰余金減少額又は欠損金増加額		95,917,929		111,415,083
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		95,917,929		111,415,083
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		1,227,022,659		1,268,692,250

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は2022年8月30日から2023年8月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2022年8月29日現在)	第16期 (2023年8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,012,327,313口	4,056,672,969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) 1,3058円 (13,058円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,3127円 (13,127円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自2021年8月31日 至2022年8月29日			第16期 自2022年8月30日 至2023年8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後の配当等収益額	A	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	964,023,642円	収益調整金額	C	1,045,184,616円
分配準備積立金額	D	720,178,435円	分配準備積立金額	D	657,627,156円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,684,202,077円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,702,811,772円
当ファンドの期末残存口数	F	4,012,327,313口	当ファンドの期末残存口数	F	4,056,672,969口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,197円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,197円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第16期 自2022年8月30日 至2023年8月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監視部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

第 16 期 (2023 年 8 月 28 日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第 15 期	第 16 期
	自 2021 年 8 月 31 日 至 2022 年 8 月 29 日	自 2022 年 8 月 30 日 至 2023 年 8 月 28 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,966,215,796 円	4,012,327,313 円
期中追加設定元本額	351,520,007 円	408,854,663 円
期中一部解約元本額	305,408,490 円	364,509,007 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 15 期	第 16 期
	(2022 年 8 月 29 日現在)	(2023 年 8 月 28 日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	△2,690,846	40,704,163
合計	△2,690,846	40,704,163

(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	国内株式インデックス マザーファンド	91,652,195	214,182,014	
	外国株式インデックス マザーファンド	20,742,675	106,889,078	
	国内債券インデックス マザーファンド	476,818,706	638,460,247	
	外国債券インデックス マザーファンド	16,221,569	53,584,708	
	短期金融資産 マザーファンド	4,107,216,912	4,152,807,019	
合計		4,712,652,057	5,165,923,066	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

**【DCターゲット・イヤー ファンド2035】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(2022年8月30日から2023年8月28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。

# 独立監査人の監査報告書

2023年11月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎雅則  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤー ファンド2035の2022年8月30日から2023年8月28日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤー ファンド2035の2023年8月28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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかど

うかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 15 期 (2022 年 8 月 29 日現在)	第 16 期 (2023 年 8 月 28 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	186,566,089	201,088,133
親投資信託受益証券	5,563,236,124	6,248,602,092
未収入金	-	10,790,000
流動資産合計	5,749,802,213	6,460,480,225
資産合計	5,749,802,213	6,460,480,225
負債の部		
流動負債		
未払解約金	379,838	4,458,212
未払受託者報酬	1,226,049	1,349,126
未払委託者報酬	11,953,925	13,153,849
未払利息	312	465
その他未払費用	303,071	326,922
流動負債合計	13,863,195	19,288,574
負債合計	13,863,195	19,288,574
純資産の部		
元本等		
元本	3,847,191,370	4,118,543,715
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1,888,747,648	2,322,647,936
(分配準備積立金)	1,166,657,772	1,382,184,594
元本等合計	5,735,939,018	6,441,191,651
純資産合計	5,735,939,018	6,441,191,651
負債純資産合計	5,749,802,213	6,460,480,225



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 15 期		第 16 期	
	自 2021 年 8 月 31 日	至 2022 年 8 月 29 日	自 2022 年 8 月 30 日	至 2023 年 8 月 28 日
<b>営業収益</b>				
受取利息		1,169		422
有価証券売買等損益		11,047,215		320,885,968
営業収益合計		11,048,384		320,886,390
<b>営業費用</b>				
支払利息		61,421		99,286
受託者報酬		2,425,517		2,616,371
委託者報酬		23,648,729		25,509,343
その他費用		303,071		326,922
営業費用合計		26,438,738		28,551,922
営業利益又は営業損失 (△)		△15,390,354		292,334,468
経常利益又は経常損失 (△)		△15,390,354		292,334,468
当期純利益又は当期純損失 (△)		△15,390,354		292,334,468
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 (△)		△568,002		2,646,375
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		1,772,543,833		1,888,747,648
剰余金増加額又は欠損金減少額		193,174,325		246,673,108
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		193,174,325		246,673,108
剰余金減少額又は欠損金増加額		62,148,158		102,460,913
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		62,148,158		102,460,913
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		1,888,747,648		2,322,647,936

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は2022年8月30日から2023年8月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2022年8月29日現在)	第16期 (2023年8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,847,191,370口	4,118,543,715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) 1,4909円 (14,909円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,5639円 (15,639円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自2021年8月31日 至2022年8月29日			第16期 自2022年8月30日 至2023年8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後の配当等収益額	A	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－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	275,677,232円
収益調整金額	C	1,446,156,746円	収益調整金額	C	1,690,593,071円
分配準備積立金額	D	1,166,657,772円	分配準備積立金額	D	1,106,507,362円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,612,814,518円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,072,777,665円
当ファンドの期末残存口数	F	3,847,191,370口	当ファンドの期末残存口数	F	4,118,543,715口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,791円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,460円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第16期 自2022年8月30日 至2023年8月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監視部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 16 期 (2023 年 8 月 28 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第 15 期 自 2021 年 8 月 31 日 至 2022 年 8 月 29 日	第 16 期 自 2022 年 8 月 30 日 至 2023 年 8 月 28 日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	3,577,112,275 円	3,847,191,370 円
期中追加設定元本額	395,490,801 円	480,122,344 円
期中一部解約元本額	125,411,706 円	208,769,999 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 15 期 (2022 年 8 月 29 日現在)	第 16 期 (2023 年 8 月 28 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	13,747,484	286,900,507
合計	13,747,484	286,900,507

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	608,900,394	1,422,939,330	
	外国株式インデックス マザーファンド	137,799,181	710,092,959	
	国内債券インデックス マザーファンド	2,735,856,649	3,663,312,053	
	外国債券インデックス マザーファンド	97,975,454	323,642,317	
	短期金融資産 マザーファンド	127,203,475	128,615,433	
合計		3,707,735,153	6,248,602,092	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

**【DCターゲット・イヤー ファンド2045】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(2022年8月30日から2023年8月28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。

# 独立監査人の監査報告書

2023年11月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎雅則  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤー ファンド2045の2022年8月30日から2023年8月28日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤー ファンド2045の2023年8月28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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を

開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 15 期 (2022 年 8 月 29 日現在)	第 16 期 (2023 年 8 月 28 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	99,466,598	106,950,444
親投資信託受益証券	2,880,788,409	3,371,555,024
未収入金	1,650,000	7,910,000
流動資産合計	2,981,905,007	3,486,415,468
資産合計	2,981,905,007	3,486,415,468
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,631,856	3,122,840
未払受託者報酬	631,213	719,974
未払委託者報酬	6,154,247	7,019,640
未払利息	166	247
その他未払費用	155,033	172,469
流動負債合計	11,572,515	11,035,170
負債合計	11,572,515	11,035,170
純資産の部		
元本等		
元本	1,875,633,288	2,027,362,639
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1,094,699,204	1,448,017,659
(分配準備積立金)	606,679,398	825,705,765
元本等合計	2,970,332,492	3,475,380,298
純資産合計	2,970,332,492	3,475,380,298
負債純資産合計	2,981,905,007	3,486,415,468



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 15 期		第 16 期	
	自 2021 年 8 月 31 日	至 2022 年 8 月 29 日	自 2022 年 8 月 30 日	至 2023 年 8 月 28 日
<b>営業収益</b>				
受取利息		589		221
有価証券売買等損益		38,858,393		274,026,615
営業収益合計		38,858,982		274,026,836
<b>営業費用</b>				
支払利息		31,173		52,070
受託者報酬		1,241,278		1,380,724
委託者報酬		12,102,260		13,461,942
その他費用		155,033		172,469
営業費用合計		13,529,744		15,067,205
営業利益又は営業損失 (△)		25,329,238		258,959,631
経常利益又は経常損失 (△)		25,329,238		258,959,631
当期純利益又は当期純損失 (△)		25,329,238		258,959,631
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 (△)		752,485		4,634,402
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		980,276,345		1,094,699,204
剰余金増加額又は欠損金減少額		143,425,857		167,269,864
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		143,425,857		167,269,864
剰余金減少額又は欠損金増加額		53,579,751		68,276,638
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		53,579,751		68,276,638
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		1,094,699,204		1,448,017,659

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は2022年8月30日から2023年8月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2022年8月29日現在)	第16期 (2023年8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,875,633,288口	2,027,362,639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) 1,5836円 (15,836円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,7142円 (17,142円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自2021年8月31日 至2022年8月29日			第16期 自2022年8月30日 至2023年8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円	費用控除後の配当等収益額	A	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	24,581,567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	254,347,646円
収益調整金額	C	824,440,565円	収益調整金額	C	975,527,889円
分配準備積立金額	D	582,097,831円	分配準備積立金額	D	571,358,119円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,431,119,963円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,801,233,654円
当ファンドの期末残存口数	F	1,875,633,288口	当ファンドの期末残存口数	F	2,027,362,639口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,630円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,884円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第16期 自2022年8月30日 至2023年8月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監視部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 16 期 (2023 年 8 月 28 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第 15 期 自 2021 年 8 月 31 日 至 2022 年 8 月 29 日	第 16 期 自 2022 年 8 月 30 日 至 2023 年 8 月 28 日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,719,188,989 円	1,875,633,288 円
期中追加設定元本額	250,322,311 円	268,609,781 円
期中一部解約元本額	93,878,012 円	116,880,430 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 15 期 (2022 年 8 月 29 日現在)	第 16 期 (2023 年 8 月 28 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	38,466,309	250,985,410
合計	38,466,309	250,985,410

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	477,457,706	1,115,770,913	
	外国株式インデックス マザーファンド	108,051,144	556,798,350	
	国内債券インデックス マザーファンド	1,086,760,408	1,455,172,186	
	外国債券インデックス マザーファンド	52,818,293	174,474,667	
	短期金融資産 マザーファンド	68,577,696	69,338,908	
合計		1,793,665,247	3,371,555,024	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

**【DCターゲット・イヤー ファンド2055】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2022年8月30日から2023年8月28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。

# 独立監査人の監査報告書

2023年11月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎雅則  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤー ファンド2055の2022年8月30日から2023年8月28日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤー ファンド2055の2023年8月28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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を

開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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ズ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。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (2022年8月29日現在)	第6期 (2023年8月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,531,797	4,448,221
親投資信託受益証券	105,480,508	145,090,598
未収入金	-	339,599
流動資産合計	109,012,305	149,878,418
資産合計	109,012,305	149,878,418
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	22,819	29,790
未払委託者報酬	222,470	290,394
未払利息	5	10
その他未払費用	2,794	3,667
流動負債合計	248,088	323,861
負債合計	248,088	323,861
純資産の部		
元本等		
元本	86,772,951	106,864,094
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	21,991,266	42,690,463
(分配準備積立金)	6,219,690	20,867,541
元本等合計	108,764,217	149,554,557
純資産合計	108,764,217	149,554,557
負債純資産合計	109,012,305	149,878,418



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自 2021年8月31日	至 2022年8月29日	自 2022年8月30日	至 2023年8月28日
<b>営業収益</b>				
受取利息		16		7
有価証券売買等損益		2,199,702		15,477,252
営業収益合計		2,199,718		15,477,259
<b>営業費用</b>				
支払利息		875		1,902
受託者報酬		41,989		54,921
委託者報酬		409,326		535,311
その他費用		5,128		6,751
営業費用合計		457,318		598,885
営業利益又は営業損失(△)		1,742,400		14,878,374
経常利益又は経常損失(△)		1,742,400		14,878,374
当期純利益又は当期純損失(△)		1,742,400		14,878,374
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)		△140,139		94,664
期首剰余金又は期首欠損金(△)		15,158,729		21,991,266
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,951,018		6,459,613
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,951,018		6,459,613
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,001,020		544,126
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,001,020		544,126
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		21,991,266		42,690,463

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第6期計算期間は2022年8月30日から2023年8月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2022年8月29日現在)	第6期 (2023年8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	86,772,951口	106,864,094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) 1,2534円 (12,534円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,3995円 (13,995円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自2021年8月31日 至2022年8月29日	第6期 自2022年8月30日 至2023年8月28日																																																												
<p>分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,274,011円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>608,528円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>15,771,576円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>4,337,151円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>21,991,266円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>86,772,951口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,534円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>－円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,274,011円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	608,528円	収益調整金額	C	15,771,576円	分配準備積立金額	D	4,337,151円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,991,266円	当ファンドの期末残存口数	F	86,772,951口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,534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	<p>分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>2,168,125円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>12,615,585円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>21,822,922円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>6,083,831円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>42,690,463円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>106,864,094口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>3,994円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>－円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,168,125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	12,615,585円	収益調整金額	C	21,822,922円	分配準備積立金額	D	6,083,831円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	42,690,463円	当ファンドの期末残存口数	F	106,864,094口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,994円	1万口当たり分配金額	H	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,274,011円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	608,528円																																																											
収益調整金額	C	15,771,576円																																																											
分配準備積立金額	D	4,337,151円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,991,266円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	86,772,951口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,534円																																																											
1万口当たり分配金額	H	－円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,168,125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	12,615,585円																																																											
収益調整金額	C	21,822,922円																																																											
分配準備積立金額	D	6,083,831円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	42,690,463円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	106,864,094口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,994円																																																											
1万口当たり分配金額	H	－円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円																																																											

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第6期 自2022年8月30日 至2023年8月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監視部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第6期 (2023年8月28日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第5期 自 2021年8月31日 至 2022年8月29日	第6期 自 2022年8月30日 至 2023年8月28日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	66,346,116 円	86,772,951 円
期中追加設定元本額	29,069,429 円	22,231,123 円
期中一部解約元本額	8,642,594 円	2,139,980 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第5期 (2022年8月29日現在)	第6期 (2023年8月28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	2,198,079	14,499,306
合計	2,198,079	14,499,306

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	26,944,114	62,965,700	
	外国株式インデックス マザーファンド	6,097,568	31,421,377	
	国内債券インデックス マザーファンド	30,038,380	40,221,390	
	外国債券インデックス マザーファンド	2,270,742	7,500,942	
	短期金融資産 マザーファンド	2,948,462	2,981,189	
合計		68,299,266	145,090,598	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2023年8月28日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	854,868,321
国債証券	541,247,560,250
地方債証券	32,820,291,393
特殊債券	36,993,673,559
社債券	29,518,908,000
未収入金	398,195,000
未収利息	1,510,790,475
前払費用	47,975,948
流動資産合計	643,392,262,946
資産合計	643,392,262,946
負債の部	
流動負債	

未払金	753,773,700
未払解約金	186,125,240
未払利息	1,980
流動負債合計	939,900,920
負債合計	939,900,920
純資産の部	
元本等	
元本	479,811,102,684
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	162,641,259,342
元本等合計	642,452,362,026
純資産合計	642,452,362,026
負債純資産合計	643,392,262,946

## 注記表

### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

### (貸借対照表に関する注記)

	2023年8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	479,811,102,684 口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 99,548,000 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3390 円 (1万口当たり純資産額) (13,390 円)

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

### (金融商品に関する注記)

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年8月28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、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

### (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	2023年 8月 28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月 30日
期首元本額	455,969,657,054円
期中追加設定元本額	51,474,560,051円
期中一部解約元本額	27,633,114,421円
期末元本額	479,811,102,684円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	5,440,712,642円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,702,392円
SMT 国内債券インデックス・オープン	20,672,612,385円
世界経済インデックスファンド	5,894,314,978円
DCマイセレクション25	28,056,716,206円
DCマイセレクション50	33,561,754,386円

DCマイセレクション75	10,706,483,111円
DC日本債券インデックス・オープン	412,135,649円
DC日本債券インデックス・オープンS	90,533,721,501円
DC日本債券インデックス・オープンP	64,147,224,282円
DCマイセレクションS25	15,651,352,423円
DCマイセレクションS50	18,054,394,779円
DCマイセレクションS75	4,435,363,177円
DCターゲット・イヤーフンド2025	476,818,706円
DCターゲット・イヤーフンド2035	2,735,856,649円
DCターゲット・イヤーフンド2045	1,086,760,408円
DC世界経済インデックスファンド	4,433,596,497円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	2,105,261円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	17,793,161円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	7,961,710円
国内バランス60VA2 (適格機関投資家専用)	1,103,784円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	65,407,639円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	105,883,657円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	27,699,115円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	23,405,141円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	2,278,431,813円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	732,678,934円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	3,145,002,682円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	63,921,454円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	50,028,540円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	918,205,566円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	1,020,348,131円
バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)	1,351,018,350円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	102,320,595円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,489,158,858円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,841,602,417円
分散投資コア戦略ファンドA	19,359,832,385円
分散投資コア戦略ファンドS	26,054,049,871円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	274,698,013円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,771,943,190円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	98,117,575円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	42,567,886円
SMT インデックスバランス・オープン	73,586,059円
SMT 世界経済インデックス・オープン	44,771,069円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	98,080,328円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	157,014,664円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	15,518,602円
グローバル経済コア	233,061,754円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	41,384,067円
DCターゲット・イヤーフンド2055	30,038,380円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	124,041,741円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	68,675,304円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	19,710,059円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	12,259,946円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	480,983,119円
10資産分散投資ファンド	306,346,994円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	90,423,736,244円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	40,008,023円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	15,565,168円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	463,288,024円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	△12,914,252,750	
地方債証券	△366,489,369	
特殊債券	△417,399,053	
社債券	△205,243,000	
合計	△13,903,384,172	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第440回利付国債(2年)	420,000,000	420,378,000	
	第441回利付国債(2年)	440,000,000	440,404,800	
	第442回利付国債(2年)	2,400,000,000	2,402,256,000	
	第443回利付国債(2年)	3,300,000,000	3,302,904,000	
	第444回利付国債(2年)	2,925,000,000	2,927,340,000	
	第445回利付国債(2年)	1,160,000,000	1,160,823,600	
	第446回利付国債(2年)	3,060,000,000	3,061,836,000	
	第448回利付国債(2年)	50,000,000	50,016,500	
	第449回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,220,207,400	
	第450回利付国債(2年)	50,000,000	50,004,500	
	第451回利付国債(2年)	740,000,000	740,066,600	
	第141回利付国債(5年)	8,820,000,000	8,836,846,200	
	第142回利付国債(5年)	3,910,000,000	3,917,937,300	
	第143回利付国債(5年)	4,480,000,000	4,489,049,600	
	第144回利付国債(5年)	5,050,000,000	5,059,999,000	
	第145回利付国債(5年)	5,120,000,000	5,128,960,000	
	第146回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,807,728,000	



第1 4 7回利付国債（5年）	4,540,000,000	4,535,323,800	
第1 4 8回利付国債（5年）	6,210,000,000	6,200,374,500	
第1 4 9回利付国債（5年）	5,070,000,000	5,059,150,200	
第1 5 0回利付国債（5年）	6,410,000,000	6,391,987,900	
第1 5 1回利付国債（5年）	4,510,000,000	4,493,222,800	
第1 5 2回利付国債（5年）	210,000,000	209,924,400	
第1 5 3回利付国債（5年）	5,810,000,000	5,782,460,600	
第1 5 4回利付国債（5年）	5,180,000,000	5,169,536,400	
第1 5 5回利付国債（5年）	2,730,000,000	2,745,178,800	
第1 5 6回利付国債（5年）	3,650,000,000	3,654,672,000	
第1 5 7回利付国債（5年）	1,460,000,000	1,460,000,000	
第1 5 8回利付国債（5年）	3,730,000,000	3,713,140,400	
第1 5 9回利付国債（5年）	950,000,000	944,575,500	
第1 6 0回利付国債（5年）	300,000,000	299,571,000	
第1回利付国債（40年）	550,000,000	652,888,500	
第2回利付国債（40年）	1,130,000,000	1,291,635,200	
第3回利付国債（40年）	650,000,000	741,331,500	
第4回利付国債（40年）	950,000,000	1,082,819,500	
第5回利付国債（40年）	1,150,000,000	1,259,917,000	
第6回利付国債（40年）	1,260,000,000	1,352,131,200	
第7回利付国債（40年）	1,340,000,000	1,373,124,800	
第8回利付国債（40年）	1,490,000,000	1,414,159,000	
第9回利付国債（40年）	2,260,000,000	1,568,643,400	
第1 0回利付国債（40年）	2,040,000,000	1,661,110,800	
第1 1回利付国債（40年）	1,525,000,000	1,192,473,750	
第1 2回利付国債（40年）	1,290,000,000	896,292,000	
第1 3回利付国債（40年）	2,330,000,000	1,598,706,200	
第1 4回利付国債（40年）	2,170,000,000	1,590,566,600	
第1 5回利付国債（40年）	2,970,000,000	2,391,117,300	
第1 6回利付国債（40年）	1,030,000,000	907,852,300	
第3 3 5回利付国債（10年）	3,710,000,000	3,732,816,500	
第3 3 6回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,289,305,600	
第3 3 7回利付国債（10年）	2,800,000,000	2,813,020,000	
第3 3 8回利付国債（10年）	4,560,000,000	4,590,506,400	
第3 3 9回利付国債（10年）	3,970,000,000	3,999,417,700	
第3 4 0回利付国債（10年）	4,430,000,000	4,465,085,600	

第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	5,051,274,600	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,766,664,000	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,672,990,400	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,904,484,000	
第345回利付国債(10年)	4,280,000,000	4,281,369,600	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,747,930,000	
第347回利付国債(10年)	3,550,000,000	3,545,953,000	
第348回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,251,394,800	
第349回利付国債(10年)	5,120,000,000	5,104,640,000	
第350回利付国債(10年)	6,670,000,000	6,639,851,600	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,835,000,000	4,807,392,150	
第352回利付国債(10年)	4,230,000,000	4,199,332,500	
第353回利付国債(10年)	4,385,000,000	4,347,113,600	
第354回利付国債(10年)	4,720,000,000	4,672,233,600	
第355回利付国債(10年)	4,660,000,000	4,605,478,000	
第356回利付国債(10年)	4,630,000,000	4,568,050,600	
第357回利付国債(10年)	3,390,000,000	3,338,709,300	
第358回利付国債(10年)	3,900,000,000	3,833,817,000	
第359回利付国債(10年)	4,145,000,000	4,065,250,200	
第360回利付国債(10年)	5,070,000,000	4,960,437,300	
第361回利付国債(10年)	4,690,000,000	4,575,423,300	
第362回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,629,766,400	
第363回利付国債(10年)	5,430,000,000	5,266,774,200	
第364回利付国債(10年)	5,050,000,000	4,885,875,000	
第365回利付国債(10年)	6,367,000,000	6,144,155,000	
第366回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,010,360,000	
第367回利付国債(10年)	4,900,000,000	4,745,944,000	
第368回利付国債(10年)	4,930,000,000	4,762,577,200	
第369回利付国債(10年)	4,740,000,000	4,694,022,000	
第370回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,800,853,800	
第371回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,708,070,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	126,329,500	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	180,894,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	135,280,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	129,316,000	

第5回利付国債（30年）	50,000,000	56,488,500	
第6回利付国債（30年）	350,000,000	402,706,500	
第7回利付国債（30年）	380,000,000	436,076,600	
第8回利付国債（30年）	850,000,000	941,290,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	257,155,200	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	166,928,000	
第11回利付国債（30年）	260,000,000	285,828,400	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	216,320,700	
第13回利付国債（30年）	400,000,000	451,736,000	
第14回利付国債（30年）	750,000,000	878,347,500	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	402,301,600	
第16回利付国債（30年）	200,000,000	236,954,000	
第17回利付国債（30年）	1,130,000,000	1,328,529,700	
第18回利付国債（30年）	315,000,000	367,116,750	
第19回利付国債（30年）	530,000,000	618,441,100	
第20回利付国債（30年）	480,000,000	571,320,000	
第21回利付国債（30年）	500,000,000	584,045,000	
第22回利付国債（30年）	540,000,000	644,004,000	
第23回利付国債（30年）	430,000,000	513,136,200	
第24回利付国債（30年）	780,000,000	931,834,800	
第25回利付国債（30年）	600,000,000	702,342,000	
第26回利付国債（30年）	1,550,000,000	1,834,223,500	
第27回利付国債（30年）	1,850,000,000	2,213,895,000	
第28回利付国債（30年）	2,020,000,000	2,418,828,800	
第29回利付国債（30年）	1,670,000,000	1,977,313,400	
第30回利付国債（30年）	2,070,000,000	2,422,458,900	
第31回利付国債（30年）	1,220,000,000	1,407,965,400	
第32回利付国債（30年）	1,510,000,000	1,763,770,600	
第33回利付国債（30年）	2,120,000,000	2,376,986,400	
第34回利付国債（30年）	1,865,000,000	2,146,335,250	
第35回利付国債（30年）	2,480,000,000	2,772,416,800	
第36回利付国債（30年）	2,420,000,000	2,703,551,400	
第37回利付国債（30年）	2,295,000,000	2,520,736,200	
第38回利付国債（30年）	1,510,000,000	1,628,988,000	
第39回利付国債（30年）	1,470,000,000	1,608,929,700	
第40回利付国債（30年）	1,260,000,000	1,355,923,800	

第 4 1 回利付国債 (30年)	1,270,000,000	1,344,053,700	
第 4 2 回利付国債 (30年)	1,400,000,000	1,480,024,000	
第 4 3 回利付国債 (30年)	1,340,000,000	1,416,179,000	
第 4 4 回利付国債 (30年)	1,350,000,000	1,425,141,000	
第 4 5 回利付国債 (30年)	1,440,000,000	1,466,035,200	
第 4 6 回利付国債 (30年)	1,830,000,000	1,861,842,000	
第 4 7 回利付国債 (30年)	1,650,000,000	1,706,545,500	
第 4 8 回利付国債 (30年)	1,800,000,000	1,792,440,000	
第 4 9 回利付国債 (30年)	1,730,000,000	1,721,211,600	
第 5 0 回利付国債 (30年)	1,730,000,000	1,519,493,600	
第 5 1 回利付国債 (30年)	1,670,000,000	1,300,696,200	
第 5 2 回利付国債 (30年)	1,630,000,000	1,327,961,000	
第 5 3 回利付国債 (30年)	1,470,000,000	1,222,496,100	
第 5 4 回利付国債 (30年)	1,720,000,000	1,494,817,600	
第 5 5 回利付国債 (30年)	1,590,000,000	1,377,814,500	
第 5 6 回利付国債 (30年)	1,580,000,000	1,365,151,600	
第 5 7 回利付国債 (30年)	1,530,000,000	1,318,079,700	
第 5 8 回利付国債 (30年)	2,260,000,000	1,941,249,600	
第 5 9 回利付国債 (30年)	1,370,000,000	1,144,922,700	
第 6 0 回利付国債 (30年)	1,360,000,000	1,188,640,000	
第 6 1 回利付国債 (30年)	1,360,000,000	1,127,304,000	
第 6 2 回利付国債 (30年)	1,165,000,000	913,488,150	
第 6 3 回利付国債 (30年)	1,450,000,000	1,101,971,000	
第 6 4 回利付国債 (30年)	1,520,000,000	1,150,670,400	
第 6 5 回利付国債 (30年)	1,405,000,000	1,059,468,350	
第 6 6 回利付国債 (30年)	1,465,000,000	1,099,438,550	
第 6 7 回利付国債 (30年)	1,665,000,000	1,315,599,750	
第 6 8 回利付国債 (30年)	1,610,000,000	1,267,649,600	
第 6 9 回利付国債 (30年)	1,430,000,000	1,154,667,800	
第 7 0 回利付国債 (30年)	1,990,000,000	1,603,024,600	
第 7 1 回利付国債 (30年)	1,510,000,000	1,212,288,400	
第 7 2 回利付国債 (30年)	1,670,000,000	1,338,738,800	
第 7 3 回利付国債 (30年)	1,870,000,000	1,495,457,700	
第 7 4 回利付国債 (30年)	2,020,000,000	1,749,845,200	
第 7 5 回利付国債 (30年)	1,410,000,000	1,316,192,700	
第 7 6 回利付国債 (30年)	1,960,000,000	1,874,798,800	

第 7 7 回利付国債 ( 3 0 年)	1, 870, 000, 000	1, 873, 721, 300	
第 7 8 回利付国債 ( 3 0 年)	1, 250, 000, 000	1, 193, 837, 500	
第 7 9 回利付国債 ( 3 0 年)	500, 000, 000	453, 680, 000	
第 7 2 回利付国債 ( 2 0 年)	630, 000, 000	644, 571, 900	
第 7 3 回利付国債 ( 2 0 年)	360, 000, 000	369, 694, 800	
第 7 4 回利付国債 ( 2 0 年)	200, 000, 000	205, 648, 000	
第 7 5 回利付国債 ( 2 0 年)	130, 000, 000	134, 310, 800	
第 7 6 回利付国債 ( 2 0 年)	270, 000, 000	278, 110, 800	
第 7 7 回利付国債 ( 2 0 年)	290, 000, 000	299, 164, 000	
第 7 8 回利付国債 ( 2 0 年)	170, 000, 000	175, 871, 800	
第 7 9 回利付国債 ( 2 0 年)	270, 000, 000	279, 814, 500	
第 8 0 回利付国債 ( 2 0 年)	220, 000, 000	228, 395, 200	
第 8 1 回利付国債 ( 2 0 年)	390, 000, 000	405, 943, 200	
第 8 2 回利付国債 ( 2 0 年)	600, 000, 000	625, 764, 000	
第 8 3 回利付国債 ( 2 0 年)	290, 000, 000	303, 853, 300	
第 8 4 回利付国債 ( 2 0 年)	470, 000, 000	491, 366, 200	
第 8 5 回利付国債 ( 2 0 年)	290, 000, 000	305, 213, 400	
第 8 6 回利付国債 ( 2 0 年)	510, 000, 000	539, 360, 700	
第 8 7 回利付国債 ( 2 0 年)	1, 830, 000, 000	1, 930, 686, 600	
第 8 8 回利付国債 ( 2 0 年)	420, 000, 000	446, 371, 800	
第 8 9 回利付国債 ( 2 0 年)	350, 000, 000	370, 996, 500	
第 9 0 回利付国債 ( 2 0 年)	630, 000, 000	670, 874, 400	
第 9 1 回利付国債 ( 2 0 年)	450, 000, 000	480, 568, 500	
第 9 2 回利付国債 ( 2 0 年)	880, 000, 000	938, 361, 600	
第 9 3 回利付国債 ( 2 0 年)	410, 000, 000	437, 523, 300	
第 9 4 回利付国債 ( 2 0 年)	610, 000, 000	653, 114, 800	
第 9 5 回利付国債 ( 2 0 年)	830, 000, 000	898, 416, 900	
第 9 6 回利付国債 ( 2 0 年)	1, 590, 000, 000	1, 709, 011, 500	
第 9 7 回利付国債 ( 2 0 年)	900, 000, 000	974, 655, 000	
第 9 8 回利付国債 ( 2 0 年)	440, 000, 000	474, 720, 400	
第 9 9 回利付国債 ( 2 0 年)	1, 510, 000, 000	1, 635, 028, 000	
第 1 0 0 回利付国債 ( 2 0 年)	480, 000, 000	523, 579, 200	
第 1 0 1 回利付国債 ( 2 0 年)	715, 000, 000	786, 371, 300	
第 1 0 2 回利付国債 ( 2 0 年)	1, 180, 000, 000	1, 303, 003, 200	
第 1 0 3 回利付国債 ( 2 0 年)	400, 000, 000	439, 792, 000	
第 1 0 4 回利付国債 ( 2 0 年)	160, 000, 000	174, 393, 600	

第105回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,290,046,800	
第106回利付国債（20年）	680,000,000	746,816,800	
第107回利付国債（20年）	700,000,000	767,655,000	
第108回利付国債（20年）	840,000,000	912,382,800	
第109回利付国債（20年）	520,000,000	566,394,400	
第110回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,210,187,000	
第111回利付国債（20年）	970,000,000	1,075,817,300	
第112回利付国債（20年）	790,000,000	871,670,200	
第113回利付国債（20年）	2,020,000,000	2,235,069,400	
第114回利付国債（20年）	2,330,000,000	2,585,694,200	
第115回利付国債（20年）	700,000,000	781,144,000	
第116回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,857,407,200	
第117回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,646,514,800	
第118回利付国債（20年）	660,000,000	731,438,400	
第119回利付国債（20年）	530,000,000	580,328,800	
第120回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,373,276,400	
第121回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,621,953,900	
第122回利付国債（20年）	900,000,000	986,850,000	
第123回利付国債（20年）	1,820,000,000	2,036,834,800	
第124回利付国債（20年）	760,000,000	845,158,000	
第125回利付国債（20年）	1,280,000,000	1,444,211,200	
第126回利付国債（20年）	730,000,000	812,979,100	
第127回利付国債（20年）	1,020,000,000	1,128,079,200	
第128回利付国債（20年）	970,000,000	1,074,469,000	
第129回利付国債（20年）	740,000,000	814,125,800	
第130回利付国債（20年）	1,685,000,000	1,856,145,450	
第131回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,443,842,400	
第132回利付国債（20年）	660,000,000	722,607,600	
第133回利付国債（20年）	990,000,000	1,091,801,700	
第134回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,634,512,000	
第135回利付国債（20年）	630,000,000	690,612,300	
第136回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,141,948,500	
第137回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,317,036,000	
第138回利付国債（20年）	980,000,000	1,058,654,800	
第139回利付国債（20年）	830,000,000	903,596,100	
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,734,742,100	

第141回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,757,504,000	
第142回利付国債（20年）	1,175,000,000	1,301,606,250	
第143回利付国債（20年）	1,820,000,000	1,983,581,600	
第144回利付国債（20年）	710,000,000	767,055,600	
第145回利付国債（20年）	2,335,000,000	2,566,958,900	
第146回利付国債（20年）	2,760,000,000	3,035,061,600	
第147回利付国債（20年）	2,360,000,000	2,571,644,800	
第148回利付国債（20年）	2,130,000,000	2,299,739,700	
第149回利付国債（20年）	2,860,000,000	3,086,769,400	
第150回利付国債（20年）	2,830,000,000	3,022,496,600	
第151回利付国債（20年）	2,445,000,000	2,557,029,900	
第152回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,861,984,800	
第153回利付国債（20年）	2,510,000,000	2,646,820,100	
第154回利付国債（20年）	2,635,000,000	2,744,879,500	
第155回利付国債（20年）	2,650,000,000	2,694,281,500	
第156回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,585,436,600	
第157回利付国債（20年）	3,070,000,000	2,811,874,400	
第158回利付国債（20年）	2,750,000,000	2,609,227,500	
第159回利付国債（20年）	2,840,000,000	2,720,918,800	
第160回利付国債（20年）	2,080,000,000	2,012,712,000	
第161回利付国債（20年）	2,380,000,000	2,264,474,800	
第162回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,166,470,500	
第163回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,155,033,200	
第164回利付国債（20年）	1,860,000,000	1,726,470,600	
第165回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,876,085,400	
第166回利付国債（20年）	1,880,000,000	1,782,841,600	
第167回利付国債（20年）	2,290,000,000	2,100,319,300	
第168回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,061,115,000	
第169回利付国債（20年）	2,000,000,000	1,760,820,000	
第170回利付国債（20年）	2,420,000,000	2,121,009,000	
第171回利付国債（20年）	1,960,000,000	1,710,041,200	
第172回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,014,152,000	
第173回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,066,801,500	
第174回利付国債（20年）	2,640,000,000	2,311,452,000	
第175回利付国債（20年）	2,050,000,000	1,818,268,000	
第176回利付国債（20年）	2,660,000,000	2,349,099,200	

	第177回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,012,211,300	
	第178回利付国債(20年)	2,280,000,000	1,998,579,600	
	第179回利付国債(20年)	2,495,000,000	2,178,858,550	
	第180回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,161,412,500	
	第181回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,174,356,000	
	第182回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,312,544,000	
	第183回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,470,036,400	
	第184回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,648,362,000	
	第185回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,079,941,000	
	国債証券合計	545,612,000,000	541,247,560,250	
地方債証券	第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	100,000,000	99,589,000	
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	78,617,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,983,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	115,729,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	113,074,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	108,457,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	105,597,000	
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	216,704,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,768,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,606,000	
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	79,135,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	217,160,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	216,190,000	
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,332,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,494,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	99,876,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	99,694,000	
	第781回東京都公募公債	300,000,000	297,231,000	
	第800回東京都公募公債	200,000,000	194,740,000	
	第830回東京都公募公債	300,000,000	288,585,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,111,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,734,000	
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,982,000	
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	197,660,000	
	令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	195,974,000	



令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,877,000	
第31回1号宮城県公募公債(10年)	200,000,000	201,560,000	
第39回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	98,116,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	237,996,000	
第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,389,000	
第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	218,902,000	
第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,042,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,254,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	105,009,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	201,024,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	100,703,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,092,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,841,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,675,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	194,678,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	219,096,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	218,018,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	108,332,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,558,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	151,841,070	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,798,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,746,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	155,606,880	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	198,846,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	197,642,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	98,783,000	
第458回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	96,806,000	
第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	154,051,200	
第468回大阪府公募公債(10年)	182,000,000	174,811,000	
第469回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	191,862,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	110,107,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	108,726,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,817,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	91,126,000	

平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	93,462,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	135,696,305	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	108,314,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	100,749,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,694,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,651,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,544,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	442,408,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,561,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	91,738,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	292,920,000	
第1回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,190,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	99,991,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	83,987,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,312,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	105,775,000	
平成27年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,774,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,713,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,807,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,739,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	301,208,400	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	110,456,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,529,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,147,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,675,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,606,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	278,319,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,288,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	82,808,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	194,556,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,169,000	

令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	156,544,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,695,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	109,741,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	219,906,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,141,674	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,700,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	378,159,600	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	96,902,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	99,149,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	108,135,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	109,343,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	87,963,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	221,046,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	184,232,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	218,902,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	182,946,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,727,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,616,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,048,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,712,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	96,818,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	96,580,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	143,449,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,303,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,588,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,382,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	110,203,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	104,100,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	111,348,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,504,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,210,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,716,000	

平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	82,808,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	92,351,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	292,110,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,310,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	90,911,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債(グリーンボンド・10年)	100,000,000	98,876,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	98,600,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	218,686,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	110,113,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	108,312,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,528,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,786,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,617,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,796,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	291,612,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	97,044,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	127,498,800	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,730,000	
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	290,067,000	
令和4年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	289,593,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	98,822,000	
第1回群馬県公募公債(20年)	200,000,000	217,444,000	
第28回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	98,598,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	99,649,000	
第139回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,579,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,126,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,044,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,584,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,452,106	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,757,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,773,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,820,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,748,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,352,000	

第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,190,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	398,392,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,452,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,830,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,017,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,386,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,204,148	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,691,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,798,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,132,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	191,586,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,670,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,824,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,935,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,702,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債(10年)	100,000,000	96,931,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	98,198,260	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,728,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,685,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,574,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	220,258,000	
第15回大阪市公募公債(30年)	100,000,000	77,947,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	275,025,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	94,223,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	192,716,000	
第1回名古屋市公募公債(12年)	100,000,000	101,686,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	117,140,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	117,462,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	108,692,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	104,544,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	99,928,000	
第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	292,023,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	199,660,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	127,912,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	218,990,000	

平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	110,782,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	108,405,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	78,305,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	78,181,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	103,741,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	328,995,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,798,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,814,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,881,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,338,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,467,000	
第30回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	209,534,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	292,050,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	96,356,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	104,317,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,485,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,080,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債(10年)	200,000,000	196,268,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	108,715,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,786,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,776,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,503,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,744,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,738,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	109,803,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	106,305,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	201,156,000	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,524,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,791,050	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	169,282,600	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	535,832,000	
令和2年度第3回広島市公募公債(5年)	300,000,000	299,193,000	

	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	194,408,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	287,622,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	96,329,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	98,078,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債(10年)	100,000,000	100,757,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債(10年)	200,000,000	200,740,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	98,473,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	108,360,000	
地方債証券合計		32,680,430,000	32,820,291,393	
特殊債券	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,656,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,916,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,765,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	64,093,000	
	第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	500,000,000	499,350,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,174,000	
	第21回道路債券	100,000,000	117,101,000	
	第28回道路債券	200,000,000	236,652,000	
	第33回道路債券	200,000,000	239,138,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,015,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,772,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,560,000	
	第42回道路債券	200,000,000	206,514,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,788,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,560,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	219,804,000	
	第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	221,300,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,352,000	
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	113,486,000		

第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,852,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,800,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,492,000	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,129,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,561,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,588,000	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,333,000	
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,042,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,217,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	556,998,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,297,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	84,246,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,450,000	
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	105,608,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,422,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,594,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	259,000,000	260,432,270	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,110,000	
第238回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	402,096,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,556,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,214,000	
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,519,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	112,797,440	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,868,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,000,000	



第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	78,374,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,358,000	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,069,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	204,407,550	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,260,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,179,000	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,750,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,412,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	295,875,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,622,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	119,466,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,360,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	277,623,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	212,416,400	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,608,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,243,000	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	116,220,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	342,831,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	103,867,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	353,895,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	235,658,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	116,026,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	219,374,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	215,622,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	154,368,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,646,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	217,772,000	

第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	107,913,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	534,725,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,596,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,539,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,552,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	419,000,000	422,075,460	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,948,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,408,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,016,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,568,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,012,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,683,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,416,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,509,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,656,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	250,272,100	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,774,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,689,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,645,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,538,000	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,977,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	155,001,600	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,265,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,392,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,042,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,570,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	712,348,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,805,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,184,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	196,570,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,198,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,040,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,089,000	

F 2 0 8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,631,000	
F 2 1 4回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,411,000	
F 2 2 6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,443,000	
F 4 4 1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,556,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,443,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	103,170,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,841,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,153,000	
第19回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,740,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,906,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	110,882,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,600,580	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,688,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,601,400	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	185,644,250	
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,916,400	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,861,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	202,274,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	128,186,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	70,860,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	149,782,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,757,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	97,283,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	104,109,000	103,331,305	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,971,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	71,402,000	71,084,975	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,978,000	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	9,972,000	9,990,049	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	123,840,000	122,644,944	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	141,411,000	139,616,494	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	50,324,000	49,799,120	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,324,000	10,404,011	

第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	177,867,000	176,072,321	
第 9 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	122,068,000	120,741,120	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,431,000	10,529,572	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,241,000	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,932,000	14,485,797	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,718,000	14,241,204	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,499,000	16,208,699	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,733,000	18,547,476	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,899,000	19,816,357	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,367,000	20,272,407	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,076,000	41,895,049	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,175,000	18,938,531	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,534,000	19,271,282	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,143,000	18,881,782	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,175,000	17,859,595	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,216,000	10,314,482	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,394,000	37,690,354	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,089,000	19,773,149	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,605,000	26,435,882	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,295,000	25,083,129	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,487,000	25,300,703	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,784,000	54,355,907	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,324,000	66,626,560	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,945,000	34,556,688	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,801,000	35,711,394	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,479,000	36,438,706	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,773,000	31,583,253	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,722,000	30,282,259	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,081,000	36,067,828	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	165,384,000	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,878,000	93,606,225	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,396,000	126,625,176	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,278,000	36,769,929	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,674,000	38,183,352	

第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,435,000	38,815,122	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,917,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,347,000	122,399,078	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,394,000	41,583,170	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,858,000	87,503,932	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,190,000	49,087,684	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,855,000	52,517,785	
第 9 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	313,818,000	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,946,000	51,877,431	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,937,000	162,196,099	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,420,000	109,377,326	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,230,000	53,184,222	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,474,000	57,353,304	
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,661,000	61,431,591	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,338,000	67,111,556	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,804,000	66,397,924	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,202,000	67,020,060	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,852,000	67,931,768	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,007,000	67,931,292	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,162,000	69,795,808	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,347,000	70,031,172	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,051,000	69,532,817	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,057,000	69,537,887	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,896,000	70,346,826	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,342,000	142,758,407	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,858,000	70,271,541	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,930,000	143,848,508	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,607,000	71,886,082	

第1 3 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,762,000	143,080,779	
第1 3 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,078,000	72,314,378	
第1 3 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,472,000	145,457,046	
第1 3 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	152,316,000	146,218,790	
第1 3 5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,993,000	
第1 3 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,021,000	74,330,656	
第1 3 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,302,000	73,805,398	
第1 4 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,771,000	73,578,094	
第1 4 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,776,000	151,316,703	
第1 4 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,536,000	75,684,071	
第1 4 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,643,000	74,957,789	
第1 4 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,588,000	151,734,674	
第1 4 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,480,000	76,854,380	
第1 4 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	245,649,000	230,342,610	
第1 4 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,420,000	155,036,586	
第1 5 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,222,000	79,985,633	
第1 5 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,074,000	80,519,138	
第1 6 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,550,000	165,812,027	
第1 6 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,412,000	83,835,794	
第1 6 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,890,000	167,613,888	
第1 6 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,094,000	169,329,795	
第1 6 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,981,000	84,367,335	
第1 6 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,966,000	170,354,156	
第1 6 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,968,000	170,096,556	
第1 6 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,549,000	85,927,379	

第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,068,000	86,842,220	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	274,656,000	258,981,382	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,236,000	87,047,725	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,440,000	89,302,476	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,048,000	90,933,372	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,851,000	91,798,419	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,394,000	183,774,748	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,292,000	95,126,280	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,262,000	195,178,037	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,594,000	98,608,789	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,159,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,125,000	99,189,431	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,901,000	99,782,117	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,348,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	79,175,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	288,858,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,005,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,432,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,792,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,868,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,508,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,595,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,924,000	
い第876号商工債	300,000,000	298,749,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,746,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,538,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,396,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	396,768,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	100,401,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,662,000	

	第21回国際協力機構債券	100,000,000	107,844,000	
	第64回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	97,402,000	
	第67回東日本高速道路株式会社債	200,000,000	195,538,000	
	第73回東日本高速道路株式会社債	500,000,000	486,300,000	
	第86回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,164,000	
	第102回東日本高速道路株式会社債	500,000,000	499,675,000	
	第106回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,638,000	
	第85回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	199,378,000	
	第98回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	201,048,000	
	第100回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,861,000	
	第101回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,897,000	
	第27回西日本高速道路株式会社債	200,000,000	201,528,000	
	第54回西日本高速道路株式会社債	600,000,000	598,860,000	
	第70回西日本高速道路株式会社債	300,000,000	299,934,000	
	第71回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,859,000	
	第74回西日本高速道路株式会社債	200,000,000	201,094,000	
	第77回西日本高速道路株式会社債	200,000,000	199,580,000	
	第78回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,586,000	
	第80回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,019,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,497,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	186,696,000	
	特殊債券合計	36,917,807,000	36,993,673,559	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,897,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	299,244,000	
	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,676,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,930,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,272,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,001,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	398,236,000	
	第1回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,552,000	
	第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債（2023）	100,000,000	99,595,000	



第52回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,186,000	
第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,202,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,261,000	
第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,877,000	
第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,550,000	
第8回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,208,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,864,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,435,000	
第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,967,000	
第2回DM三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第19回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,912,000	
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,619,000	
第16回キリンホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,814,000	
第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,632,000	
第8回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,760,000	
第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,794,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,929,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,712,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,792,000	
第10回J. フロント リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	98,656,000	
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	97,877,000	
第27回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,950,000	
第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,245,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,380,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,721,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,039,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,378,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,614,000	

第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,387,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,789,000	
第13回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	95,863,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	98,721,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	197,932,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,554,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,099,000	
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	82,402,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,764,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,888,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	195,468,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	285,510,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,887,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	200,000,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,738,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,621,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	400,000,000	399,100,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,816,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,052,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,404,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,674,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,374,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	96,745,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,598,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,745,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,482,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,283,000	
第14回株式会社L I X I L無担保社債	100,000,000	99,466,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,715,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	98,695,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,561,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,933,000	

第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,982,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,326,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,766,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,806,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,000,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,551,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	94,966,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,818,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,198,000	
第29回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,477,000	
第35回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,254,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,796,000	
第25回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,492,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	192,682,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,869,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,298,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	85,823,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,538,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	109,450,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	195,984,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,494,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,294,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	96,736,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,857,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	96,581,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	99,286,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	110,433,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,793,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,153,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,406,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,942,000	

第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,380,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	194,522,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,312,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,198,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,514,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,712,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,919,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,732,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,861,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,439,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,674,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,282,000	
第82回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,648,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,369,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,015,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,419,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,558,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,716,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,216,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,446,000	
第36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	199,502,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,188,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,645,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,129,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	98,750,000	
第39回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,917,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,817,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保	300,000,000	300,027,000	

社債			
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,668,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	198,416,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,572,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,380,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	85,862,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,159,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,617,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,585,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,803,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,314,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,304,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	86,933,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,445,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,094,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	77,783,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,644,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,004,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,495,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	218,840,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,248,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	87,163,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,464,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,205,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	77,387,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	85,186,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	72,032,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,682,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,743,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	76,289,000	

第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	85,287,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,265,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	84,925,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,878,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,375,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,416,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	79,985,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	67,836,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	60,595,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	72,916,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	81,412,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	156,404,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,564,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,816,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,284,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	175,424,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,501,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,383,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,454,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	92,897,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	84,053,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,801,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,688,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,464,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,199,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,685,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,261,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,520,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,074,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,748,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,341,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	196,030,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,091,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	295,632,000	

第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,857,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,602,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,864,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,321,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,613,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	195,026,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,727,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,069,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,380,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,416,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,494,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,880,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,080,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	195,066,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,387,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,354,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	196,482,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,926,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	89,570,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,163,000	
第31回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	99,899,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	91,083,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,631,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,794,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,647,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,834,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,466,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,034,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,400,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,451,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,939,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,659,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	271,629,000	

第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,253,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	96,105,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	76,934,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	193,046,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,170,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	84,652,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	198,526,000	
社債券合計	30,300,000,000	29,518,908,000	
合計		640,580,433,202	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,047,038,086
株式	563,150,268,210
派生商品評価勘定	37,266,750
未収配当金	725,914,205
差入委託証拠金	176,285,000
流動資産合計	567,136,772,251
資産合計	567,136,772,251
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,656,000
前受金	35,648,700
未払解約金	227,452,798
未払利息	7,059
流動負債合計	264,764,557
負債合計	264,764,557



純資産の部	
元本等	
元本	242,575,517,919
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	324,296,489,775
元本等合計	566,872,007,694
純資産合計	566,872,007,694
負債純資産合計	567,136,772,251

## 注記表

### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

### (貸借対照表に関する注記)

	2023年8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,575,517,919口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.3369円 (1万口当たり純資産額) (23,369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

	2023年8月28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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p> <p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>
-------------------	---

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

### (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

### (その他の注記)

#### 元本の移動

区分	2023年 8月 28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月 30日
期首元本額	263,768,603,358円
期中追加設定元本額	20,721,755,794円
期中一部解約元本額	41,914,841,233円
期末元本額	242,575,517,919円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス (毎月決算型)	332,593,078円
SBI資産設計オープン (資産成長型)	3,486,085,001円
SBI資産設計オープン (分配型)	11,990,817円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,116,107,298円
世界経済インデックスファンド	4,900,989,949円

日本株式インデックス・オープン	3,021,354,539円
DCマイセレクション25	5,497,274,833円
DCマイセレクション50	17,705,457,671円
DCマイセレクション75	18,515,157,521円
DC日本株式インデックス・オープン	6,028,994,993円
DCマイセレクションS25	3,222,398,306円
DCマイセレクションS50	9,500,956,859円
DCマイセレクションS75	8,108,901,990円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,051,054,577円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	91,652,195円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	608,900,394円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	477,457,706円
DC世界経済インデックスファンド	3,711,755,483円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	917,307,072円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	3,668,401円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	9,059,381円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	15,125,814円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	158,838,737円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,072,124円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	17,934,767円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	74,059,921円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	16,846,659円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	48,815,045円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	589,565,943円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	331,236,638円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,233,427,557円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	31,095,300円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	13,271,382円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	347,672,809円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	197,609,005円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	259,729,075円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	21,497,122円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	445,671,710円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,619,327,787円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,799,211,605円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,241,824,743円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,805,562,216円
分散投資コア戦略ファンドA	1,573,611,795円
分散投資コア戦略ファンドS	5,972,815,479円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	571,977,177円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	400,775,302円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,322,566,262円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	206,015,004円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,636,618円
SMTインデックスバランス・オープン	50,699,263円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	19,121,035,850円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	285,794,619円
SMT世界経済インデックス・オープン	49,807,474円
SMT世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	204,018,030円
SMT世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	35,285,667円
SMT8資産インデックスバランス・オープン	11,690,962円
グローバル経済コア	212,980,116円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	33,481,974円
MySMTTOPIXインデックス(ノーロード)	961,457,378円
DCターゲット・イヤーフアンド2055	26,944,114円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	980,337,953円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	232,177,734円

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	49,952,698 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	47,346,435 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	19,807,783 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	20,901,128 円
10資産分散投資ファンド	93,091,386 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,498,863,771 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	523,395,403 円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	295,613,559 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,756,390 円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	614,567,203 円
SMTAM日本株式インデックスファンドVLP（適格機関投資家専用）	46,315,612,423 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,369,143 円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	204,617,803 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		33,791,217,923
合計		33,791,217,923

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年8月28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	3,527,026,300	—	3,562,675,000	35,648,700
合計		3,527,026,300	—	3,562,675,000	35,648,700

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,100	3,790.00	34,489,000	
ニッセイ	241,400	770.90	186,095,260	
マルハニチロ	35,800	2,544.50	91,093,100	

雪国まいたけ	20,600	897.00	18,478,200	
カネコ種苗	7,400	1,403.00	10,382,200	
サカタのタネ	27,500	4,035.00	110,962,500	
ホクト	21,500	1,840.00	39,560,000	
ホクリヨウ	2,300	1,026.00	2,359,800	
住石ホールディングス	25,000	372.00	9,300,000	
日鉄鉱業	9,700	5,000.00	48,500,000	
三井松島ホールディングス	10,900	2,769.00	30,182,100	
I N P E X	892,800	2,038.50	1,819,972,800	
石油資源開発	28,000	4,705.00	131,740,000	
K&Oエナジーグループ	10,900	2,431.00	26,497,900	
ショーボンドホールディングス	32,900	5,864.00	192,925,600	
ミライト・ワン	79,800	1,902.50	151,819,500	
タマホーム	15,200	3,475.00	52,820,000	
サンヨーホームズ	1,900	722.00	1,371,800	
日本アクア	6,700	1,050.00	7,035,000	
ファーストコーポレーション	4,100	752.00	3,083,200	
ベステラ	3,500	1,103.00	3,860,500	
R o b o t H o m e	46,900	197.00	9,239,300	
キャンディル	2,900	617.00	1,789,300	
ダイセキ環境ソリューション	3,300	1,276.00	4,210,800	
第一カッター興業	6,200	1,280.00	7,936,000	
安藤・間	139,900	1,174.00	164,242,600	
東急建設	68,700	758.00	52,074,600	
コムシスホールディングス	77,100	3,075.00	237,082,500	
ビーアールホールディングス	38,300	385.00	14,745,500	
高松コンストラクショングループ	15,700	2,581.00	40,521,700	
東建コーポレーション	6,900	7,700.00	53,130,000	
ソネック	1,700	987.00	1,677,900	
ヤマウラ	12,200	1,228.00	14,981,600	
オリエンタル白石	86,800	328.00	28,470,400	
大成建設	158,000	4,854.00	766,932,000	
大林組	603,900	1,311.50	792,014,850	
清水建設	478,800	979.80	469,128,240	
飛島建設	18,600	1,301.00	24,198,600	
長谷工コーポレーション	174,300	1,794.00	312,694,200	

松井建設	15,800	756.00	11,944,800	
銭高組	1,400	3,970.00	5,558,000	
鹿島建設	374,400	2,411.00	902,678,400	
不動テトラ	11,700	1,842.00	21,551,400	
大末建設	4,100	1,460.00	5,986,000	
鉄建建設	12,100	2,015.00	24,381,500	
西松建設	28,600	3,688.00	105,476,800	
三井住友建設	136,200	399.00	54,343,800	
大豊建設	7,000	3,975.00	27,825,000	
佐田建設	7,200	472.00	3,398,400	
ナカノフドー建設	8,000	388.00	3,104,000	
奥村組	27,400	4,480.00	122,752,000	
東鉄工業	23,200	2,706.00	62,779,200	
イチケン	2,500	2,063.00	5,157,500	
富士ピー・エス	5,000	461.00	2,305,000	
浅沼組	13,500	3,505.00	47,317,500	
戸田建設	207,700	812.60	168,777,020	
熊谷組	28,300	3,255.00	92,116,500	
北野建設	2,100	3,050.00	6,405,000	
植木組	3,200	1,520.00	4,864,000	
矢作建設工業	23,000	1,269.00	29,187,000	
ピーエス三菱	21,400	788.00	16,863,200	
日本ハウスホールディングス	36,100	370.00	13,357,000	
新日本建設	23,700	1,194.00	28,297,800	
東亜道路工業	6,700	4,960.00	33,232,000	
日本道路	3,400	9,400.00	31,960,000	
東亜建設工業	14,500	3,565.00	51,692,500	
日本国土開発	48,000	611.00	29,328,000	
若築建設	7,500	3,045.00	22,837,500	
東洋建設	56,200	1,086.00	61,033,200	
五洋建設	239,400	868.70	207,966,780	
世紀東急工業	21,700	1,603.00	34,785,100	
福田組	6,300	4,625.00	29,137,500	
住友林業	145,800	3,977.00	579,846,600	
日本基礎技術	6,800	487.00	3,311,600	
巴コーポレーション	12,600	534.00	6,728,400	

大和ハウス工業	466,900	4,040.00	1,886,276,000	
ライト工業	31,300	2,034.00	63,664,200	
積水ハウス	511,900	2,934.00	1,501,914,600	
日特建設	16,100	1,078.00	17,355,800	
北陸電気工事	11,600	936.00	10,857,600	
ユアテック	37,200	941.00	35,005,200	
日本リーテック	14,800	1,269.00	18,781,200	
四電工	7,100	2,368.00	16,812,800	
中電工	26,200	2,371.00	62,120,200	
関電工	92,500	1,324.00	122,470,000	
きんでん	118,900	1,985.50	236,075,950	
東京エネシス	16,800	991.00	16,648,800	
トーエネック	5,600	4,025.00	22,540,000	
住友電設	16,100	2,927.00	47,124,700	
日本電設工業	27,700	2,117.00	58,640,900	
エクシオグループ	77,800	3,085.00	240,013,000	
新日本空調	9,400	2,424.00	22,785,600	
九電工	41,100	4,496.00	184,785,600	
三機工業	37,400	1,638.00	61,261,200	
日揮ホールディングス	167,000	1,954.00	326,318,000	
中外炉工業	5,500	2,035.00	11,192,500	
ヤマト	9,400	906.00	8,516,400	
太平電業	10,500	3,770.00	39,585,000	
高砂熱学工業	40,700	2,922.00	118,925,400	
三晃金属工業	1,400	4,095.00	5,733,000	
朝日工業社	7,000	2,363.00	16,541,000	
明星工業	29,000	950.00	27,550,000	
大気社	19,500	4,560.00	88,920,000	
ダイダン	11,100	2,990.00	33,189,000	
日比谷総合設備	14,400	2,202.00	31,708,800	
フィル・カンパニー	3,000	777.00	2,331,000	
テスホールディングス	37,400	547.00	20,457,800	
インフロニア・ホールディングス	176,900	1,501.50	265,615,350	
東洋エンジニアリング	22,300	624.00	13,915,200	
レイズネクスト	24,400	1,411.00	34,428,400	
ニッポン	45,700	2,046.00	93,502,200	

日清製粉グループ本社	156,800	1,885.50	295,646,400	
日東富士製粉	3,000	4,880.00	14,640,000	
昭和産業	14,800	2,947.00	43,615,600	
鳥越製粉	10,100	653.00	6,595,300	
中部飼料	23,500	1,144.00	26,884,000	
フィード・ワン	24,800	820.00	20,336,000	
東洋精糖	2,100	2,175.00	4,567,500	
日本甜菜製糖	9,900	1,913.00	18,938,700	
DM三井製糖ホールディングス	16,800	2,971.00	49,912,800	
塩水港精糖	13,500	268.00	3,618,000	
ウェルネオシュガー	8,800	2,152.00	18,937,600	
森永製菓	30,900	5,297.00	163,677,300	
中村屋	4,200	3,120.00	13,104,000	
江崎グリコ	48,500	3,805.00	184,542,500	
名糖産業	6,700	1,652.00	11,068,400	
井村屋グループ	9,300	2,322.00	21,594,600	
不二家	11,600	2,456.00	28,489,600	
山崎製パン	113,500	2,741.50	311,160,250	
第一屋製パン	2,100	398.00	835,800	
モロゾフ	5,500	3,680.00	20,240,000	
亀田製菓	10,800	4,380.00	47,304,000	
寿スピリッツ	18,000	10,960.00	197,280,000	
カルビー	77,600	2,815.00	218,444,000	
森永乳業	30,800	5,963.00	183,660,400	
六甲バター	12,400	1,391.00	17,248,400	
ヤクルト本社	121,100	7,619.00	922,660,900	
明治ホールディングス	207,800	3,750.00	779,250,000	
雪印メグミルク	41,000	2,397.00	98,277,000	
プリマハム	22,800	2,552.00	58,185,600	
日本ハム	66,300	4,528.00	300,206,400	
林兼産業	3,400	538.00	1,829,200	
丸大食品	17,100	1,676.00	28,659,600	
S Foods	18,700	3,415.00	63,860,500	
柿安本店	6,600	2,489.00	16,427,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	129,500	827.00	107,096,500	
サッポロホールディングス	55,800	4,395.00	245,241,000	



アサヒグループホールディングス	391,700	5,543.00	2,171,193,100	
キリンホールディングス	706,100	2,019.50	1,425,968,950	
宝ホールディングス	115,700	1,270.00	146,939,000	
オエノンホールディングス	50,700	369.00	18,708,300	
養命酒製造	5,600	1,913.00	10,712,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	132,800	1,870.00	248,336,000	
ライフドリンク カンパニー	3,100	4,000.00	12,400,000	
サントリー食品インターナショナル	119,400	4,711.00	562,493,400	
ダイドーグループホールディングス	9,600	5,570.00	53,472,000	
伊藤園	57,400	4,307.00	247,221,800	
キーコーヒー	19,000	2,097.00	39,843,000	
ユニカフェ	3,800	929.00	3,530,200	
ジャパンフーズ	1,800	1,086.00	1,954,800	
日清オイリオグループ	23,900	4,220.00	100,858,000	
不二製油グループ本社	39,500	2,292.50	90,553,750	
かどや製油	1,400	3,480.00	4,872,000	
J-オイルミルズ	17,300	1,787.00	30,915,100	
キッコーマン	112,300	8,418.00	945,341,400	
味の素	409,300	6,054.00	2,477,902,200	
ブルドックソース	9,000	2,065.00	18,585,000	
キューピー	91,100	2,394.00	218,093,400	
ハウス食品グループ本社	51,900	3,118.00	161,824,200	
カゴメ	72,900	3,384.00	246,693,600	
焼津水産化学工業	4,400	1,139.00	5,011,600	
アリアケジャパン	14,800	5,377.00	79,579,600	
ピエトロ	1,600	1,848.00	2,956,800	
エバラ食品工業	4,500	2,980.00	13,410,000	
やまみ	1,100	1,712.00	1,883,200	
ニチレイ	77,700	3,409.00	264,879,300	
東洋水産	85,700	6,085.00	521,484,500	
イトアンドホールディングス	7,400	2,120.00	15,688,000	
大冷	1,400	1,983.00	2,776,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	985.00	10,638,000	
日清食品ホールディングス	59,600	12,575.00	749,470,000	
永谷園ホールディングス	8,300	2,382.00	19,770,600	

一正蒲鉾	4,800	753.00	3,614,400	
フジッコ	17,400	1,941.00	33,773,400	
ロック・フィールド	19,000	1,542.00	29,298,000	
日本たばこ産業	1,030,100	3,170.00	3,265,417,000	
ケンコーマヨネーズ	11,700	1,441.00	16,859,700	
わらべや日洋ホールディングス	12,500	2,716.00	33,950,000	
なとり	10,600	1,980.00	20,988,000	
イフジ産業	1,900	1,690.00	3,211,000	
ファーマフーズ	24,300	1,681.00	40,848,300	
ユーグレナ	109,200	795.00	86,814,000	
紀文食品	13,200	1,118.00	14,757,600	
ピクルスホールディングス	9,900	1,231.00	12,186,900	
ミヨシ油脂	4,400	1,136.00	4,998,400	
理研ビタミン	14,600	2,307.00	33,682,200	
片倉工業	16,200	1,638.00	26,535,600	
グンゼ	12,400	4,520.00	56,048,000	
東洋紡	75,000	1,037.00	77,775,000	
ユニチカ	54,300	209.00	11,348,700	
富士紡ホールディングス	6,900	3,405.00	23,494,500	
倉敷紡績	13,100	2,324.00	30,444,400	
シキボウ	6,400	1,033.00	6,611,200	
日本毛織	45,900	1,240.00	56,916,000	
トーア紡コーポレーション	4,500	431.00	1,939,500	
帝国繊維	19,700	1,907.00	37,567,900	
帝人	166,000	1,472.00	244,352,000	
東レ	1,156,000	780.90	902,720,400	
住江織物	2,500	2,212.00	5,530,000	
日本フェルト	7,500	420.00	3,150,000	
イチカワ	1,800	1,399.00	2,518,200	
日東製網	1,200	1,439.00	1,726,800	
アツギ	7,200	435.00	3,132,000	
ダイニック	3,000	789.00	2,367,000	
セーレン	33,500	2,388.00	79,998,000	
ソトー	3,900	790.00	3,081,000	
東海染工	1,300	1,020.00	1,326,000	
小松マテーレ	25,300	739.00	18,696,700	

ワコールホールディングス	31,500	3,125.00	98,437,500	
ホギメディカル	23,200	3,185.00	73,892,000	
T S I ホールディングス	58,300	713.00	41,567,900	
マツオカコーポレーション	3,300	1,405.00	4,636,500	
ワールド	22,300	1,583.00	35,300,900	
三陽商会	4,400	1,933.00	8,505,200	
ナイガイ	4,600	287.00	1,320,200	
オンワードホールディングス	112,200	517.00	58,007,400	
ルックホールディングス	3,700	1,983.00	7,337,100	
ゴールドウイン	30,600	10,125.00	309,825,000	
デサント	29,800	3,600.00	107,280,000	
キング	5,400	648.00	3,499,200	
ヤマトインターナショナル	9,800	297.00	2,910,600	
特種東海製紙	7,700	3,255.00	25,063,500	
王子ホールディングス	718,400	597.80	429,459,520	
日本製紙	89,800	1,270.00	114,046,000	
三菱製紙	13,800	524.00	7,231,200	
北越コーポレーション	109,000	901.00	98,209,000	
中越パルプ工業	4,600	1,296.00	5,961,600	
巴川製紙所	3,600	689.00	2,480,400	
大王製紙	76,200	1,234.50	94,068,900	
阿波製紙	2,800	534.00	1,495,200	
レンゴー	157,100	1,004.00	157,728,400	
トーモク	10,000	2,279.00	22,790,000	
ザ・パック	12,800	3,065.00	39,232,000	
北の達人コーポレーション	72,700	248.00	18,029,600	
クラレ	251,300	1,647.00	413,891,100	
旭化成	1,076,900	931.10	1,002,701,590	
共和レザー	6,600	604.00	3,986,400	
レブナック・ホールディングス	166,700	2,322.00	387,077,400	
住友化学	1,279,300	393.30	503,148,690	
住友精化	7,200	4,445.00	32,004,000	
日産化学	81,500	6,237.00	508,315,500	
ラサ工業	6,600	2,038.00	13,450,800	
クレハ	14,700	8,440.00	124,068,000	
多木化学	6,700	3,755.00	25,158,500	

テイカ	11,600	1,328.00	15,404,800
石原産業	31,200	1,447.00	45,146,400
片倉コープアグリ	2,400	1,181.00	2,834,400
日本曹達	18,500	5,350.00	98,975,000
東ソー	230,200	1,868.50	430,128,700
トクヤマ	55,700	2,328.50	129,697,450
セントラル硝子	27,700	2,907.00	80,523,900
東亜合成	86,500	1,379.50	119,326,750
大阪ソーダ	10,300	7,570.00	77,971,000
関東電化工業	33,300	829.00	27,605,700
デンカ	62,700	2,674.00	167,659,800
信越化学工業	1,433,500	4,534.00	6,499,489,000
日本カーバイド工業	4,400	1,589.00	6,991,600
堺化学工業	13,100	1,929.00	25,269,900
第一稀元素化学工業	15,700	957.00	15,024,900
エア・ウォーター	162,700	1,784.50	290,338,150
日本酸素ホールディングス	167,300	3,335.00	557,945,500
日本化学工業	5,700	1,859.00	10,596,300
東邦アセチレン	2,400	1,518.00	3,643,200
日本パーカライジング	85,400	1,113.00	95,050,200
高圧ガス工業	25,000	757.00	18,925,000
チタン工業	1,400	1,383.00	1,936,200
四国化成ホールディングス	22,100	1,458.00	32,221,800
戸田工業	3,900	1,956.00	7,628,400
ステラ ケミファ	10,200	3,120.00	31,824,000
保土谷化学工業	4,900	3,280.00	16,072,000
日本触媒	26,300	5,437.00	142,993,100
大日精化工業	12,000	2,311.00	27,732,000
カネカ	39,400	4,012.00	158,072,800
三菱瓦斯化学	128,800	1,952.50	251,482,000
三井化学	142,200	3,980.00	565,956,000
J S R	161,000	4,056.00	653,016,000
東京応化工業	27,400	9,800.00	268,520,000
大阪有機化学工業	14,400	2,640.00	38,016,000
三菱ケミカルグループ	1,163,700	856.30	996,476,310
KHネオケム	28,600	2,221.00	63,520,600

ダイセル	240,200	1,174.50	282,114,900	
住友ベークライト	25,500	6,716.00	171,258,000	
積水化学工業	349,600	2,240.00	783,104,000	
日本ゼオン	103,400	1,563.00	161,614,200	
アイカ工業	43,500	3,362.00	146,247,000	
UBE	88,900	2,462.00	218,871,800	
積水樹脂	23,900	2,512.00	60,036,800	
タキロンシーアイ	37,700	621.00	23,411,700	
旭有機材	11,500	4,245.00	48,817,500	
ニチバン	10,700	1,886.00	20,180,200	
リケンテクノス	37,100	698.00	25,895,800	
大倉工業	8,000	2,473.00	19,784,000	
積水化成成品工業	24,200	451.00	10,914,200	
群栄化学工業	4,100	3,425.00	14,042,500	
タイガースポリマー	5,200	775.00	4,030,000	
ミライアル	3,500	1,511.00	5,288,500	
ダイキアクシス	4,800	726.00	3,484,800	
ダイキョーニシカワ	38,100	796.00	30,327,600	
竹本容器	4,400	797.00	3,506,800	
森六ホールディングス	8,700	2,212.00	19,244,400	
恵和	12,400	1,184.00	14,681,600	
日本化薬	131,700	1,287.00	169,497,900	
カーリットホールディングス	15,500	889.00	13,779,500	
日本精化	9,800	2,561.00	25,097,800	
扶桑化学工業	16,000	4,235.00	67,760,000	
トリケミカル研究所	23,000	2,730.00	62,790,000	
ADEKA	60,100	2,766.50	166,266,650	
日油	53,300	6,415.00	341,919,500	
新日本理化	15,800	232.00	3,665,600	
ハリマ化成グループ	8,100	827.00	6,698,700	
花王	389,900	5,561.00	2,168,233,900	
第一工業製薬	6,200	1,647.00	10,211,400	
石原ケミカル	7,900	1,599.00	12,632,100	
日華化学	4,600	858.00	3,946,800	
ニイタカ	2,100	1,970.00	4,137,000	
三洋化成工業	10,600	4,105.00	43,513,000	

有機合成薬品工業	8,500	292.00	2,482,000	
大日本塗料	21,000	966.00	20,286,000	
日本ペイントホールディングス	915,700	1,099.50	1,006,812,150	
関西ペイント	138,300	2,332.00	322,515,600	
神東塗料	9,600	130.00	1,248,000	
中国塗料	28,300	1,379.00	39,025,700	
日本特殊塗料	7,300	1,239.00	9,044,700	
藤倉化成	23,200	455.00	10,556,000	
太陽ホールディングス	26,200	2,629.00	68,879,800	
D I C	67,400	2,498.00	168,365,200	
サカタインクス	38,400	1,333.00	51,187,200	
東洋インキS Cホールディングス	37,500	2,200.00	82,500,000	
T & K TOKA	15,400	1,406.00	21,652,400	
富士フイルムホールディングス	331,300	8,561.00	2,836,259,300	
資生堂	360,500	5,814.00	2,095,947,000	
ライオン	226,000	1,568.50	354,481,000	
高砂香料工業	11,700	2,832.00	33,134,400	
マンダム	37,300	1,404.00	52,369,200	
ミルボン	23,500	4,359.00	102,436,500	
ファンケル	75,500	2,511.50	189,618,250	
コーセー	35,100	11,480.00	402,948,000	
コタ	15,900	1,617.00	25,710,300	
シーボン	1,500	1,543.00	2,314,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	88,500	1,826.00	161,601,000	
ノエビアホールディングス	15,400	5,570.00	85,778,000	
アジュバンホールディングス	2,800	933.00	2,612,400	
新日本製薬	9,800	1,552.00	15,209,600	
アクシージア	8,700	1,091.00	9,491,700	
エステー	13,300	1,522.00	20,242,600	
アグロ カネショウ	6,900	1,397.00	9,639,300	
コニシ	28,800	2,450.00	70,560,000	
長谷川香料	33,000	3,395.00	112,035,000	
星光PMC	7,000	562.00	3,934,000	
小林製薬	50,200	7,217.00	362,293,400	
荒川化学工業	14,600	1,012.00	14,775,200	
メック	14,200	3,710.00	52,682,000	

日本高純度化学	4,300	2,515.00	10,814,500	
タカラバイオ	46,500	1,431.00	66,541,500	
JCU	19,300	3,270.00	63,111,000	
新田ゼラチン	7,100	718.00	5,097,800	
OATアグリオ	4,300	1,733.00	7,451,900	
デクセリアルズ	47,200	3,616.00	170,675,200	
アース製薬	15,700	4,920.00	77,244,000	
北興化学工業	17,400	894.00	15,555,600	
大成ラミック	5,400	3,085.00	16,659,000	
クミアイ化学工業	68,600	1,103.00	75,665,800	
日本農薬	31,700	671.00	21,270,700	
アキレス	10,900	1,465.00	15,968,500	
有沢製作所	28,100	1,023.00	28,746,300	
日東電工	125,300	9,856.00	1,234,956,800	
レック	24,600	936.00	23,025,600	
三光合成	21,700	646.00	14,018,200	
きもと	16,900	184.00	3,109,600	
藤森工業	13,600	3,640.00	49,504,000	
前澤化成工業	11,100	1,517.00	16,838,700	
未来工業	6,200	2,948.00	18,277,600	
ウェーブロックホールディングス	3,400	639.00	2,172,600	
JSP	12,100	1,955.00	23,655,500	
エフピコ	32,700	2,740.50	89,614,350	
天馬	14,100	2,544.00	35,870,400	
信越ポリマー	31,900	1,336.00	42,618,400	
東リ	25,800	366.00	9,442,800	
ニフコ	62,300	4,240.00	264,152,000	
バルカー	14,400	4,160.00	59,904,000	
ユニ・チャーム	359,700	5,700.00	2,050,290,000	
ショーエイコーポレーション	3,300	596.00	1,966,800	
協和キリン	208,600	2,634.50	549,556,700	
武田薬品工業	1,528,100	4,472.00	6,833,663,200	
アステラス製薬	1,631,100	2,204.00	3,594,944,400	
住友ファーマ	128,100	527.50	67,572,750	
塩野義製薬	217,700	6,424.00	1,398,504,800	
わかもと製薬	10,800	231.00	2,494,800	

日本新薬	40,700	6,254.00	254,537,800
中外製薬	540,500	4,413.00	2,385,226,500
科研製薬	29,600	3,554.00	105,198,400
エーザイ	210,000	9,077.00	1,906,170,000
ロート製薬	167,300	3,824.00	639,755,200
小野薬品工業	333,100	2,790.50	929,515,550
久光製薬	38,400	4,925.00	189,120,000
持田製薬	19,800	3,345.00	66,231,000
参天製薬	314,600	1,342.50	422,350,500
扶桑薬品工業	5,500	2,103.00	11,566,500
日本ケミファ	1,200	1,922.00	2,306,400
ツムラ	54,400	2,746.00	149,382,400
キッセイ薬品工業	26,600	3,425.00	91,105,000
生化学工業	32,900	812.00	26,714,800
栄研化学	28,000	1,398.00	39,144,000
鳥居薬品	9,300	3,785.00	35,200,500
JCRファーマ	58,400	1,237.00	72,240,800
東和薬品	26,500	2,747.00	72,795,500
富士製薬工業	12,700	1,181.00	14,998,700
ゼリア新薬工業	23,900	2,406.00	57,503,400
そーせいグループ	59,100	1,647.00	97,337,700
第一三共	1,504,200	4,271.00	6,424,438,200
杏林製薬	37,400	1,749.00	65,412,600
大幸薬品	34,200	347.00	11,867,400
ダイト	12,100	2,511.00	30,383,100
大塚ホールディングス	359,100	5,490.00	1,971,459,000
大正製薬ホールディングス	38,400	6,058.00	232,627,200
ペプチドリーム	83,700	1,834.00	153,505,800
あすか製薬ホールディングス	17,700	1,671.00	29,576,700
サワイグループホールディングス	39,500	4,438.00	175,301,000
日本コークス工業	155,700	111.00	17,282,700
ニチレキ	20,400	2,172.00	44,308,800
ユシロ化学工業	8,900	1,434.00	12,762,600
ビーピー・カストロール	4,400	879.00	3,867,600
富士石油	35,200	297.00	10,454,400
MORESCO	3,700	1,203.00	4,451,100



出光興産	191,800	3,061.00	587,099,800	
E N E O Sホールディングス	2,928,900	537.10	1,573,112,190	
コスモエネルギーホールディングス	68,300	5,299.00	361,921,700	
横浜ゴム	87,300	2,964.50	258,800,850	
TOYO TIRE	99,200	2,177.50	216,008,000	
ブリヂストン	505,400	5,624.00	2,842,369,600	
住友ゴム工業	169,400	1,486.50	251,813,100	
藤倉コンポジット	8,200	1,135.00	9,307,000	
オカモト	9,300	4,700.00	43,710,000	
フコク	9,100	1,430.00	13,013,000	
ニッタ	17,500	3,320.00	58,100,000	
住友理工	33,500	1,069.00	35,811,500	
三ツ星ベルト	25,200	4,660.00	117,432,000	
バンドー化学	27,300	1,514.00	41,332,200	
日東紡績	19,500	4,145.00	80,827,500	
A G C	161,100	5,034.00	810,977,400	
日本板硝子	88,000	735.00	64,680,000	
石塚硝子	1,900	2,366.00	4,495,400	
日本山村硝子	4,500	2,100.00	9,450,000	
日本電気硝子	70,600	2,541.00	179,394,600	
オハラ	8,300	1,348.00	11,188,400	
住友大阪セメント	24,400	4,060.00	99,064,000	
太平洋セメント	110,000	2,814.00	309,540,000	
日本ヒューム	15,400	855.00	13,167,000	
日本コンクリート工業	34,000	328.00	11,152,000	
三谷セキサン	7,300	5,010.00	36,573,000	
アジアパイルホールディングス	27,300	646.00	17,635,800	
東海カーボン	159,500	1,137.50	181,431,250	
日本カーボン	9,900	4,390.00	43,461,000	
東洋炭素	12,200	5,800.00	70,760,000	
ノリタケカンパニーリミテド	8,600	5,990.00	51,514,000	
TOTO	114,000	3,936.00	448,704,000	
日本碍子	200,900	1,930.50	387,837,450	
日本特殊陶業	131,500	3,358.00	441,577,000	
MARUWA	6,400	26,330.00	168,512,000	
品川リフラクトリーズ	4,900	7,140.00	34,986,000	

黒崎播磨	3,500	9,990.00	34,965,000
ヨータイ	9,400	1,495.00	14,053,000
東京窯業	11,100	344.00	3,818,400
ニッカトー	5,400	612.00	3,304,800
フジミインコーポレーテッド	41,300	3,325.00	137,322,500
クニミネ工業	3,500	1,017.00	3,559,500
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,169.00	2,688,700
ニチアス	43,700	2,978.00	130,138,600
ニチハ	21,700	3,140.00	68,138,000
日本製鉄	795,400	3,408.00	2,710,723,200
神戸製鋼所	357,300	1,805.50	645,105,150
中山製鋼所	36,600	888.00	32,500,800
合同製鐵	8,800	4,200.00	36,960,000
J F Eホールディングス	474,700	2,284.50	1,084,452,150
東京製鐵	49,900	1,613.00	80,488,700
共英製鋼	20,300	1,948.00	39,544,400
大和工業	29,300	6,993.00	204,894,900
東京鐵鋼	8,500	3,295.00	28,007,500
大阪製鐵	8,200	1,675.00	13,735,000
淀川製鋼所	20,200	3,410.00	68,882,000
中部鋼板	14,600	2,101.00	30,674,600
丸一鋼管	54,100	3,725.00	201,522,500
モリ工業	2,700	3,440.00	9,288,000
大同特殊鋼	22,400	5,948.00	133,235,200
日本高周波鋼業	4,100	490.00	2,009,000
日本冶金工業	13,000	4,430.00	57,590,000
山陽特殊製鋼	17,600	2,765.00	48,664,000
愛知製鋼	10,300	3,590.00	36,977,000
日本金属	2,600	905.00	2,353,000
大平洋金属	12,600	1,620.00	20,412,000
新日本電工	105,800	278.00	29,412,400
栗本鐵工所	8,500	3,020.00	25,670,000
虹技	1,500	1,481.00	2,221,500
三菱製鋼	11,200	1,419.00	15,892,800
日亜鋼業	12,100	313.00	3,787,300
日本精線	2,400	4,695.00	11,268,000

エンビプロ・ホールディングス	8,200	593.00	4,862,600	
シンニッタン	12,900	245.00	3,160,500	
新家工業	2,600	2,811.00	7,308,600	
大紀アルミニウム工業所	25,300	1,418.00	35,875,400	
日本軽金属ホールディングス	47,900	1,558.00	74,628,200	
三井金属鉱業	51,700	3,692.00	190,876,400	
東邦亜鉛	10,500	1,709.00	17,944,500	
三菱マテリアル	118,500	2,412.00	285,822,000	
住友金属鉱山	206,000	4,521.00	931,326,000	
DOWAホールディングス	39,900	4,586.00	182,981,400	
古河機械金属	26,100	1,748.00	45,622,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,100	3,210.00	83,781,000	
東邦チタニウム	32,200	2,004.00	64,528,800	
UACJ	24,900	3,135.00	78,061,500	
CKサンエツ	4,300	3,680.00	15,824,000	
古河電気工業	59,200	2,475.00	146,520,000	
住友電気工業	613,400	1,761.00	1,080,197,400	
フジクラ	190,500	1,184.50	225,647,250	
SWCC	19,900	1,933.00	38,466,700	
タツタ電線	36,100	708.00	25,558,800	
カナレ電気	2,100	1,407.00	2,954,700	
平河ヒューテック	10,300	1,499.00	15,439,700	
リョービ	18,900	2,810.00	53,109,000	
アーレスティ	13,200	747.00	9,860,400	
AREホールディングス	71,900	1,878.00	135,028,200	
稲葉製作所	9,200	1,539.00	14,158,800	
宮地エンジニアリンググループ	4,900	5,860.00	28,714,000	
トーカロ	47,300	1,407.00	66,551,100	
アルファC o	4,300	1,475.00	6,342,500	
SUMCO	315,600	1,961.00	618,891,600	
川田テクノロジーズ	4,200	6,040.00	25,368,000	
RS Technologies	11,900	2,806.00	33,391,400	
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,416.00	3,865,600	
信和	6,500	765.00	4,972,500	
東洋製罐グループホールディングス	106,000	2,513.00	266,378,000	
ホッカンホールディングス	9,500	1,562.00	14,839,000	

コロナ	9,900	903.00	8,939,700	
横河ブリッジホールディングス	22,200	2,734.00	60,694,800	
駒井ハルテック	1,900	1,850.00	3,515,000	
高田機工	1,000	2,984.00	2,984,000	
三和ホールディングス	163,600	2,151.00	351,903,600	
文化シャッター	51,100	1,085.00	55,443,500	
三協立山	20,300	860.00	17,458,000	
アルインコ	13,500	1,065.00	14,377,500	
東洋シャッター	2,700	639.00	1,725,300	
L I X I L	258,800	1,795.00	464,546,000	
日本ファイルコン	7,700	474.00	3,649,800	
ノーリツ	29,400	1,600.00	47,040,000	
長府製作所	17,800	2,155.00	38,359,000	
リンナイ	96,600	2,854.00	275,696,400	
ダイニチ工業	5,900	732.00	4,318,800	
日東精工	25,700	556.00	14,289,200	
三洋工業	1,400	2,078.00	2,909,200	
岡部	31,700	736.00	23,331,200	
ジーテクト	19,800	1,827.00	36,174,600	
東プレ	31,300	1,710.00	53,523,000	
高周波熱錬	27,400	1,004.00	27,509,600	
東京製綱	10,500	1,167.00	12,253,500	
サンコール	10,500	496.00	5,208,000	
モリテック スチール	8,700	319.00	2,775,300	
パイオラックス	24,500	2,252.00	55,174,000	
エイチワン	18,300	759.00	13,889,700	
日本発條	157,100	1,121.50	176,187,650	
中央発條	13,200	722.00	9,530,400	
アドバネクス	1,400	1,019.00	1,426,600	
立川ブラインド工業	8,000	1,385.00	11,080,000	
三益半導体工業	13,700	2,849.00	39,031,300	
日本ドライケミカル	2,800	2,079.00	5,821,200	
日本製鋼所	47,900	2,924.00	140,059,600	
三浦工業	72,600	3,355.00	243,573,000	
タクマ	53,500	1,560.00	83,460,000	
ツガミ	38,700	1,174.00	45,433,800	

オークマ	17,400	6,791.00	118,163,400
芝浦機械	17,400	4,170.00	72,558,000
アマダ	277,500	1,525.00	423,187,500
アイダエンジニアリング	35,900	995.00	35,720,500
TAKISAWA	3,100	2,552.00	7,911,200
FUJI	75,600	2,420.50	182,989,800
牧野フライス製作所	19,300	6,450.00	124,485,000
オーエスジー	76,700	1,829.50	140,322,650
ダイジェット工業	1,300	922.00	1,198,600
旭ダイヤモンド工業	48,700	893.00	43,489,100
DMG森精機	105,500	2,646.00	279,153,000
ソディック	45,800	683.00	31,281,400
ディスコ	83,700	27,465.00	2,298,820,500
日東工器	8,500	2,000.00	17,000,000
日進工具	14,600	1,162.00	16,965,200
パンチ工業	10,600	441.00	4,674,600
富士ダイス	5,500	660.00	3,630,000
豊和工業	6,400	811.00	5,190,400
東洋機械金属	8,100	673.00	5,451,300
エンシュウ	2,600	759.00	1,973,400
島精機製作所	27,700	1,837.00	50,884,900
オプトラン	28,600	1,870.00	53,482,000
NCホールディングス	2,400	1,929.00	4,629,600
イワキポンプ	11,600	1,872.00	21,715,200
フリュー	18,300	1,708.00	31,256,400
ヤマシンフィルタ	41,700	318.00	13,260,600
日阪製作所	16,900	936.00	15,818,400
やまびこ	28,400	1,417.00	40,242,800
野村マイクロ・サイエンス	5,900	5,760.00	33,984,000
平田機工	8,300	7,550.00	62,665,000
PEGASUS	19,300	573.00	11,058,900
マルマエ	7,600	1,803.00	13,702,800
タツモ	10,500	2,786.00	29,253,000
ナブテスコ	109,200	2,718.50	296,860,200
三井海洋開発	22,000	1,600.00	35,200,000
レオン自動機	18,300	1,352.00	24,741,600

SMC	56,400	69,800.00	3,936,720,000	
ホソカワミクロン	11,200	3,895.00	43,624,000	
ユニオンツール	7,700	3,660.00	28,182,000	
瑞光	12,600	1,393.00	17,551,800	
オイレス工業	24,300	2,016.00	48,988,800	
日精エー・エス・ビー機械	6,900	4,065.00	28,048,500	
サトーホールディングス	24,800	2,040.00	50,592,000	
技研製作所	16,400	1,977.00	32,422,800	
日本エアータック	8,800	1,235.00	10,868,000	
カワタ	3,400	1,031.00	3,505,400	
日精樹脂工業	13,000	1,057.00	13,741,000	
オカダアイヨン	3,600	2,167.00	7,801,200	
ワイエイシイホールディングス	4,900	2,651.00	12,989,900	
小松製作所	814,800	4,066.00	3,312,976,800	
住友重機械工業	102,900	3,513.00	361,487,700	
日立建機	69,300	4,328.00	299,930,400	
日工	25,900	661.00	17,119,900	
巴工業	7,500	2,918.00	21,885,000	
井関農機	16,400	1,197.00	19,630,800	
TOWA	17,800	3,415.00	60,787,000	
丸山製作所	2,000	2,179.00	4,358,000	
北川鉄工所	6,900	1,364.00	9,411,600	
ローツェ	9,100	11,500.00	104,650,000	
タカキタ	3,400	486.00	1,652,400	
クボタ	920,200	2,215.00	2,038,243,000	
荏原実業	9,200	2,822.00	25,962,400	
三菱化工機	5,600	2,772.00	15,523,200	
月島ホールディングス	23,600	1,347.00	31,789,200	
帝国電機製作所	12,300	2,478.00	30,479,400	
新東工業	35,300	1,063.00	37,523,900	
澁谷工業	16,400	2,484.00	40,737,600	
アイチ コーポレーション	24,300	952.00	23,133,600	
小森コーポレーション	40,400	1,129.00	45,611,600	
鶴見製作所	13,300	2,929.00	38,955,700	
日本ギア工業	4,000	429.00	1,716,000	
酒井重工業	1,900	5,010.00	9,519,000	

荏原製作所	71,400	7,258.00	518,221,200
石井鐵工所	1,400	2,891.00	4,047,400
西島製作所	15,000	1,850.00	27,750,000
北越工業	17,500	1,882.00	32,935,000
ダイキン工業	207,600	24,840.00	5,156,784,000
オルガノ	23,900	4,160.00	99,424,000
トーヨーカネツ	6,600	3,300.00	21,780,000
栗田工業	97,300	5,621.00	546,923,300
椿本チエイン	24,700	3,795.00	93,736,500
大同工業	4,800	735.00	3,528,000
木村化工機	13,400	737.00	9,875,800
アネスト岩田	29,600	1,198.00	35,460,800
ダイフク	269,000	2,681.50	721,323,500
サムコ	4,700	5,030.00	23,641,000
加藤製作所	5,500	1,296.00	7,128,000
油研工業	1,800	2,178.00	3,920,400
タダノ	100,200	1,145.50	114,779,100
フジテック	61,000	3,748.00	228,628,000
C K D	48,100	1,986.00	95,526,600
平和	57,900	2,222.00	128,653,800
理想科学工業	13,900	2,282.00	31,719,800
SANKYO	34,200	6,412.00	219,290,400
日本金銭機械	19,200	1,018.00	19,545,600
マースグループホールディングス	10,300	2,787.00	28,706,100
フクシマガリレイ	12,800	5,200.00	66,560,000
オーイズミ	4,500	422.00	1,899,000
ダイコク電機	9,500	4,715.00	44,792,500
竹内製作所	31,600	4,425.00	139,830,000
アマノ	49,400	3,149.00	155,560,600
JUKI	27,000	618.00	16,686,000
ジャノメ	17,700	640.00	11,328,000
マックス	21,400	2,664.00	57,009,600
グローリー	41,800	3,043.00	127,197,400
新晃工業	17,600	1,987.00	34,971,200
大和冷機工業	26,700	1,408.00	37,593,600
セガサミーホールディングス	139,800	2,928.00	409,334,400

日本ピストンリング	3,900	1,611.00	6,282,900	
リケン	6,900	3,135.00	21,631,500	
T P R	19,900	1,803.00	35,879,700	
ツバキ・ナカシマ	42,800	785.00	33,598,000	
ホシザキ	102,600	5,465.00	560,709,000	
大豊工業	15,100	834.00	12,593,400	
日本精工	319,500	821.20	262,373,400	
N T N	342,800	283.00	97,012,400	
ジェイテクト	154,800	1,271.00	196,750,800	
不二越	12,900	3,880.00	50,052,000	
日本トムソン	42,700	561.00	23,954,700	
T H K	100,300	2,687.00	269,506,100	
ユーシン精機	13,900	699.00	9,716,100	
前澤給装工業	12,300	1,209.00	14,870,700	
イーグル工業	19,300	1,704.00	32,887,200	
前澤工業	6,700	958.00	6,418,600	
日本ピラー工業	16,100	4,170.00	67,137,000	
キッツ	63,900	1,047.00	66,903,300	
マキタ	216,400	3,945.00	853,698,000	
三井E & S	83,200	485.00	40,352,000	
日立造船	142,600	848.00	120,924,800	
三菱重工業	304,100	7,964.00	2,421,852,400	
I H I	109,600	3,528.00	386,668,800	
スター精密	32,800	1,860.00	61,008,000	
日清紡ホールディングス	130,700	1,080.00	141,156,000	
イビデン	99,800	8,625.00	860,775,000	
コニカミノルタ	389,000	453.90	176,567,100	
ブラザー工業	232,500	2,475.50	575,553,750	
ミネベアミツミ	302,600	2,465.00	745,909,000	
日立製作所	845,600	9,513.00	8,044,192,800	
東芝	334,600	4,599.00	1,538,825,400	
三菱電機	1,797,100	1,867.00	3,355,185,700	
富士電機	105,700	6,699.00	708,084,300	
東洋電機製造	3,800	1,035.00	3,933,000	
安川電機	206,000	5,631.00	1,159,986,000	
シンフォニアテクノロジー	19,200	1,562.00	29,990,400	



明電舎	26,400	2,201.00	58,106,400	
オリジン	2,600	1,274.00	3,312,400	
山洋電気	7,600	7,050.00	53,580,000	
デンヨー	13,200	2,034.00	26,848,800	
P H C ホールディングス	24,500	1,415.00	34,667,500	
ソシオネクスト	24,700	17,000.00	419,900,000	
東芝テック	26,000	3,540.00	92,040,000	
芝浦メカトロニクス	3,000	23,500.00	70,500,000	
マブチモーター	43,300	4,336.00	187,748,800	
ニデック	423,100	7,446.00	3,150,402,600	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,400	489.00	6,552,600	
トレックス・セミコンダクター	8,300	2,310.00	19,173,000	
東光高岳	10,600	2,229.00	23,627,400	
ダブル・スコープ	56,700	1,140.00	64,638,000	
ダイヘン	15,700	5,190.00	81,483,000	
ヤーマン	30,400	1,026.00	31,190,400	
J V C ケンウッド	159,100	580.00	92,278,000	
ミマキエンジニアリング	16,900	730.00	12,337,000	
I - P E X	12,300	1,655.00	20,356,500	
大崎電気工業	41,200	628.00	25,873,600	
オムロン	159,300	6,862.00	1,093,116,600	
日東工業	23,400	3,765.00	88,101,000	
I D E C	25,700	3,025.00	77,742,500	
正興電機製作所	4,200	1,097.00	4,607,400	
不二電機工業	2,600	1,154.00	3,000,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,200	2,687.50	153,725,000	
サクサホールディングス	2,400	2,321.00	5,570,400	
メルコホールディングス	4,500	3,140.00	14,130,000	
テクノメディカ	4,400	2,172.00	9,556,800	
日本電気	245,900	7,512.00	1,847,200,800	
富士通	173,300	18,235.00	3,160,125,500	
沖電気工業	78,600	888.00	69,796,800	
岩崎通信機	5,100	825.00	4,207,500	
電気興業	7,000	2,488.00	17,416,000	
サンケン電気	16,200	10,900.00	176,580,000	
ナカヨ	1,900	1,270.00	2,413,000	

アイホン	10,600	3,010.00	31,906,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,134,900	2,488.50	2,824,198,650	
セイコーエプソン	223,100	2,293.50	511,679,850	
ワコム	132,800	594.00	78,883,200	
アルバック	41,300	5,615.00	231,899,500	
アクセル	4,600	1,723.00	7,925,800	
E I Z O	12,700	4,890.00	62,103,000	
日本信号	39,600	966.00	38,253,600	
京三製作所	36,400	462.00	16,816,800	
能美防災	23,700	1,759.00	41,688,300	
ホーチキ	13,200	1,678.00	22,149,600	
星和電機	5,800	482.00	2,795,600	
エレコム	41,800	1,703.00	71,185,400	
パナソニック ホールディングス	2,053,800	1,672.50	3,434,980,500	
シャープ	209,400	903.20	189,130,080	
アンリツ	122,500	1,050.00	128,625,000	
富士通ゼネラル	49,300	2,794.50	137,768,850	
ソニーグループ	1,217,900	12,000.00	14,614,800,000	
TDK	275,400	5,203.00	1,432,906,200	
帝国通信工業	8,100	1,795.00	14,539,500	
タムラ製作所	74,600	578.00	43,118,800	
アルプスアルパイン	155,600	1,203.00	187,186,800	
池上通信機	3,700	734.00	2,715,800	
日本電波工業	21,100	1,529.00	32,261,900	
鈴木	9,700	1,120.00	10,864,000	
メイコー	19,100	3,385.00	64,653,500	
日本トリム	4,000	2,954.00	11,816,000	
ローランド ディー. ジー.	9,600	3,415.00	32,784,000	
フォスター電機	16,100	905.00	14,570,500	
SMK	4,200	2,481.00	10,420,200	
ヨコオ	14,000	1,688.00	23,632,000	
ホシデン	40,800	1,785.00	72,828,000	
ヒロセ電機	28,000	17,665.00	494,620,000	
日本航空電子工業	35,700	3,030.00	108,171,000	
TOA	19,800	1,057.00	20,928,600	
マクセル	35,400	1,544.00	54,657,600	

古野電気	22,900	1,282.00	29,357,800	
スミダコーポレーション	23,500	1,685.00	39,597,500	
アイコム	6,700	3,140.00	21,038,000	
リオン	7,300	2,084.00	15,213,200	
横河電機	190,200	2,747.00	522,479,400	
新電元工業	6,700	3,105.00	20,803,500	
アズビル	120,300	4,763.00	572,988,900	
東亜ディーケーケー	5,800	877.00	5,086,600	
日本光電工業	79,600	3,844.00	305,982,400	
チノー	7,200	2,021.00	14,551,200	
共和電業	10,700	354.00	3,787,800	
日本電子材料	11,400	1,563.00	17,818,200	
堀場製作所	32,900	7,460.00	245,434,000	
アドバンテスト	135,600	18,060.00	2,448,936,000	
小野測器	5,500	452.00	2,486,000	
エスペック	13,900	2,260.00	31,414,000	
キーエンス	172,200	61,630.00	10,612,686,000	
日置電機	9,000	7,650.00	68,850,000	
シスメックス	148,600	7,642.00	1,135,601,200	
日本マイクロニクス	31,100	2,099.00	65,278,900	
メガチップス	14,200	4,210.00	59,782,000	
OBARA GROUP	9,500	3,940.00	37,430,000	
澤藤電機	1,600	1,286.00	2,057,600	
原田工業	5,500	816.00	4,488,000	
コーセル	21,000	1,282.00	26,922,000	
イリソ電子工業	15,900	4,145.00	65,905,500	
オブテックスグループ	31,800	1,703.00	54,155,400	
千代田インテグレ	6,800	2,746.00	18,672,800	
レーザーテック	78,900	22,210.00	1,752,369,000	
スタンレー電気	122,200	2,565.00	313,443,000	
ウシオ電機	87,600	1,816.50	159,125,400	
岡谷電機産業	10,200	311.00	3,172,200	
ヘリオス テクノ ホールディング	11,300	446.00	5,039,800	
エノモト	3,100	1,737.00	5,384,700	
日本セラミック	17,600	2,563.00	45,108,800	
遠藤照明	5,400	1,227.00	6,625,800	

古河電池	13,000	950.00	12,350,000	
双信電機	5,700	342.00	1,949,400	
山一電機	14,200	1,750.00	24,850,000	
図研	15,100	4,070.00	61,457,000	
日本電子	43,200	4,630.00	200,016,000	
カシオ計算機	128,300	1,288.00	165,250,400	
ファナック	839,500	4,138.00	3,473,851,000	
日本シイエムケイ	37,300	598.00	22,305,400	
エンプラス	5,100	10,840.00	55,284,000	
大真空	21,500	782.00	16,813,000	
ローム	79,600	12,165.00	968,334,000	
浜松ホトニクス	138,200	6,756.00	933,679,200	
三井ハイテック	17,800	9,530.00	169,634,000	
新光電気工業	61,000	5,975.00	364,475,000	
京セラ	267,500	7,339.00	1,963,182,500	
太陽誘電	83,900	4,038.00	338,788,200	
村田製作所	522,200	8,087.00	4,223,031,400	
双葉電子工業	33,500	538.00	18,023,000	
北陸電気工業	4,600	1,418.00	6,522,800	
ニチコン	35,400	1,406.00	49,772,400	
日本ケミコン	17,300	1,421.00	24,583,300	
KOA	26,300	1,835.00	48,260,500	
市光工業	31,700	522.00	16,547,400	
小糸製作所	207,200	2,420.00	501,424,000	
ミツバ	32,300	753.00	24,321,900	
SCREENホールディングス	29,400	14,840.00	436,296,000	
キャノン電子	19,200	1,838.00	35,289,600	
キャノン	858,700	3,602.00	3,093,037,400	
リコー	431,700	1,190.50	513,938,850	
象印マホービン	51,400	1,745.00	89,693,000	
MUTOHホールディングス	1,800	2,000.00	3,600,000	
東京エレクトロン	364,400	20,955.00	7,636,002,000	
イノテック	11,700	1,545.00	18,076,500	
トヨタ紡織	72,500	2,678.00	194,155,000	
芦森工業	2,100	2,158.00	4,531,800	
ユニプレス	31,000	1,218.00	37,758,000	

豊田自動織機	125,900	10,135.00	1,275,996,500	
モリタホールディングス	30,300	1,635.00	49,540,500	
三櫻工業	26,400	899.00	23,733,600	
デンソー	355,100	9,746.00	3,460,804,600	
東海理化電機製作所	48,600	2,257.00	109,690,200	
川崎重工業	129,700	3,626.00	470,292,200	
名村造船所	29,500	879.00	25,930,500	
日本車輛製造	6,600	2,038.00	13,450,800	
三菱ロジスネクスト	27,500	1,337.00	36,767,500	
近畿車輛	1,600	1,848.00	2,956,800	
日産自動車	2,445,600	606.90	1,484,234,640	
いすゞ自動車	500,500	1,825.50	913,662,750	
トヨタ自動車	9,453,500	2,436.50	23,033,452,750	
日野自動車	222,000	560.90	124,519,800	
三菱自動車工業	671,600	561.70	377,237,720	
エフテック	8,000	757.00	6,056,000	
レシップホールディングス	4,500	539.00	2,425,500	
GMB	2,300	1,803.00	4,146,900	
ファルテック	1,900	591.00	1,122,900	
武蔵精密工業	42,100	1,726.00	72,664,600	
日産車体	30,400	901.00	27,390,400	
新明和工業	54,100	1,366.00	73,900,600	
極東開発工業	28,400	1,818.00	51,631,200	
トピー工業	14,000	2,190.00	30,660,000	
ティラド	4,400	2,046.00	9,002,400	
曙ブレーキ工業	105,100	132.00	13,873,200	
タチエス	27,300	1,691.00	46,164,300	
NOK	66,900	2,025.00	135,472,500	
フタバ産業	46,300	631.00	29,215,300	
KYB	16,600	4,705.00	78,103,000	
大同メタル工業	33,800	523.00	17,677,400	
プレス工業	77,000	660.00	50,820,000	
ミクニ	13,300	451.00	5,998,300	
太平洋工業	39,500	1,392.00	54,984,000	
アイシン	132,800	4,696.00	623,628,800	
マツダ	569,500	1,519.50	865,355,250	

今仙電機製作所	7,400	650.00	4,810,000	
本田技研工業	1,399,500	4,643.00	6,497,878,500	
スズキ	316,200	5,492.00	1,736,570,400	
S U B A R U	544,700	2,759.50	1,503,099,650	
安永	5,100	796.00	4,059,600	
ヤマハ発動機	248,000	3,863.00	958,024,000	
T B K	11,500	399.00	4,588,500	
エクセディ	28,200	2,591.00	73,066,200	
豊田合成	50,300	3,044.00	153,113,200	
愛三工業	28,500	1,274.00	36,309,000	
盟和産業	1,700	1,029.00	1,749,300	
日本プラスト	9,200	463.00	4,259,600	
ヨロズ	16,200	894.00	14,482,800	
エフ・シー・シー	30,500	1,885.00	57,492,500	
シマノ	69,900	21,345.00	1,492,015,500	
テイ・エス テック	78,800	1,730.00	136,324,000	
ジャムコ	6,300	1,463.00	9,216,900	
テルモ	529,500	4,295.00	2,274,202,500	
クリエートメディック	3,800	923.00	3,507,400	
日機装	40,100	1,010.00	40,501,000	
日本エム・ディ・エム	10,300	765.00	7,879,500	
島津製作所	209,700	4,269.00	895,209,300	
J M S	16,000	532.00	8,512,000	
長野計器	12,500	2,382.00	29,775,000	
ブイ・テクノロジー	8,400	2,375.00	19,950,000	
東京計器	13,200	1,444.00	19,060,800	
愛知時計電機	6,700	1,598.00	10,706,600	
インターアクション	8,200	1,070.00	8,774,000	
オーバル	10,200	424.00	4,324,800	
東京精密	37,900	7,970.00	302,063,000	
マニー	68,900	1,860.00	128,154,000	
ニコン	248,900	1,559.50	388,159,550	
トプコン	90,600	1,688.50	152,978,100	
オリンパス	1,059,800	1,888.50	2,001,432,300	
理研計器	10,700	5,100.00	54,570,000	
タムロン	12,800	4,440.00	56,832,000	

HOYA	364,700	15,940.00	5,813,318,000	
シード	5,800	814.00	4,721,200	
ノーリツ鋼機	16,300	2,836.00	46,226,800	
A&Dホールディングス	25,100	1,667.00	41,841,700	
朝日インテック	192,400	2,955.50	568,638,200	
シチズン時計	158,400	869.00	137,649,600	
リズム	3,600	1,641.00	5,907,600	
大研医器	8,700	540.00	4,698,000	
メニコン	59,200	2,067.00	122,366,400	
シンシア	1,300	586.00	761,800	
松風	7,800	2,086.00	16,270,800	
セイコーグループ	26,700	2,680.00	71,556,000	
ニプロ	143,500	1,150.00	165,025,000	
KYORITSU	17,100	174.00	2,975,400	
中本パックス	3,500	1,641.00	5,743,500	
スノーピーク	29,400	1,618.00	47,569,200	
パラマウントベッドホールディングス	39,800	2,371.00	94,365,800	
トランザクション	11,300	1,950.00	22,035,000	
粧美堂	3,100	500.00	1,550,000	
ニホンフラッシュ	16,100	914.00	14,715,400	
前田工織	14,500	3,095.00	44,877,500	
永大産業	12,200	219.00	2,671,800	
アートネイチャー	17,700	785.00	13,894,500	
バンダイナムコホールディングス	471,700	3,417.00	1,611,798,900	
アイフィスジャパン	3,200	592.00	1,894,400	
SHOEI	38,900	2,407.00	93,632,300	
フランスベッドホールディングス	19,800	1,201.00	23,779,800	
パイロットコーポレーション	24,200	4,595.00	111,199,000	
萩原工業	11,500	1,645.00	18,917,500	
フジシールインターナショナル	34,900	1,733.00	60,481,700	
タカラトミー	78,900	2,306.00	181,943,400	
広済堂ホールディングス	7,700	2,849.00	21,937,300	
エステールホールディングス	2,700	630.00	1,701,000	
タカノ	4,300	826.00	3,551,800	
プロネクサス	14,300	1,076.00	15,386,800	
ホクシン	8,800	131.00	1,152,800	

ウッドワン	3,800	1,057.00	4,016,600	
大建工業	10,500	3,040.00	31,920,000	
凸版印刷	211,600	3,373.00	713,726,800	
大日本印刷	188,100	3,893.00	732,273,300	
共同印刷	4,800	3,240.00	15,552,000	
N I S S H A	32,600	1,726.00	56,267,600	
光村印刷	1,000	1,257.00	1,257,000	
TAKARA & COMPANY	11,000	2,333.00	25,663,000	
アシックス	146,700	5,062.00	742,595,400	
ツツミ	3,000	2,399.00	7,197,000	
ローランド	12,700	3,865.00	49,085,500	
小松ウオール工業	6,300	2,879.00	18,137,700	
ヤマハ	108,500	4,529.00	491,396,500	
河合楽器製作所	4,600	3,380.00	15,548,000	
クリナップ	19,300	700.00	13,510,000	
ビジョン	109,700	1,674.00	183,637,800	
キングジム	15,200	872.00	13,254,400	
リンテック	34,600	2,337.00	80,860,200	
イトーキ	35,300	1,333.00	47,054,900	
任天堂	1,087,000	6,175.00	6,712,225,000	
三菱鉛筆	24,400	1,903.00	46,433,200	
タカラスタンダード	31,700	1,924.00	60,990,800	
コクヨ	74,600	2,231.50	166,469,900	
ナカバヤシ	18,500	525.00	9,712,500	
グローブライト	13,900	1,899.00	26,396,100	
オカムラ	51,800	2,181.00	112,975,800	
美津濃	17,100	4,635.00	79,258,500	
東京電力ホールディングス	1,551,900	617.90	958,919,010	
中部電力	634,400	1,920.50	1,218,365,200	
関西電力	664,800	2,008.00	1,334,918,400	
中国電力	274,200	955.50	261,998,100	
北陸電力	162,500	831.20	135,070,000	
東北電力	420,900	1,006.00	423,425,400	
四国電力	147,000	1,042.50	153,247,500	
九州電力	396,900	947.50	376,062,750	
北海道電力	166,300	649.70	108,045,110	



沖縄電力	40,300	1,131.00	45,579,300	
電源開発	129,600	2,272.00	294,451,200	
エフオン	11,100	526.00	5,838,600	
イーレックス	30,600	927.00	28,366,200	
レノバ	45,900	1,392.00	63,892,800	
東京瓦斯	364,000	3,372.00	1,227,408,000	
大阪瓦斯	348,700	2,309.50	805,322,650	
東邦瓦斯	67,800	2,585.00	175,263,000	
北海道瓦斯	10,300	2,320.00	23,896,000	
広島ガス	36,300	379.00	13,757,700	
西部ガスホールディングス	16,200	1,994.00	32,302,800	
静岡ガス	39,100	1,033.00	40,390,300	
メタウォーター	20,600	1,893.00	38,995,800	
SBSホールディングス	15,300	3,020.00	46,206,000	
東武鉄道	189,100	3,889.00	735,409,900	
相鉄ホールディングス	56,900	2,779.00	158,125,100	
東急	482,800	1,777.50	858,177,000	
京浜急行電鉄	195,300	1,310.50	255,940,650	
小田急電鉄	261,000	2,097.00	547,317,000	
京王電鉄	91,000	4,900.00	445,900,000	
京成電鉄	111,000	5,405.00	599,955,000	
富士急行	21,200	5,290.00	112,148,000	
東日本旅客鉄道	292,000	8,055.00	2,352,060,000	
西日本旅客鉄道	219,900	6,022.00	1,324,237,800	
東海旅客鉄道	132,600	18,210.00	2,414,646,000	
西武ホールディングス	208,300	1,529.00	318,490,700	
鴻池運輸	29,300	2,032.00	59,537,600	
西日本鉄道	46,000	2,697.00	124,062,000	
ハマキョウレックス	13,500	4,170.00	56,295,000	
サカイ引越センター	8,200	4,760.00	39,032,000	
近鉄グループホールディングス	171,900	4,501.00	773,721,900	
阪急阪神ホールディングス	229,200	5,114.00	1,172,128,800	
南海電気鉄道	82,100	2,993.00	245,725,300	
京阪ホールディングス	94,700	4,048.00	383,345,600	
神戸電鉄	4,700	3,055.00	14,358,500	
名古屋鉄道	190,000	2,298.00	436,620,000	

山陽電気鉄道	12,900	2,228.00	28,741,200	
アルプス物流	13,700	1,580.00	21,646,000	
ヤマトホールディングス	220,100	2,664.50	586,456,450	
山九	43,700	5,026.00	219,636,200	
丸運	5,600	249.00	1,394,400	
丸全昭和運輸	10,600	3,925.00	41,605,000	
センコーグループホールディングス	91,000	1,020.00	92,820,000	
トナミホールディングス	3,800	4,710.00	17,898,000	
ニッコンホールディングス	55,000	3,307.00	181,885,000	
日本石油輸送	1,200	2,544.00	3,052,800	
福山通運	13,100	3,620.00	47,422,000	
セイノーホールディングス	96,700	2,102.50	203,311,750	
エスライングループ本社	3,200	864.00	2,764,800	
神奈川中央交通	4,900	3,285.00	16,096,500	
AZ-COM丸和ホールディングス	41,500	2,271.00	94,246,500	
C&Fロジホールディングス	16,500	1,346.00	22,209,000	
九州旅客鉄道	121,500	3,142.00	381,753,000	
SGホールディングス	329,800	2,095.50	691,095,900	
NIPPON EXPRESSホールディングス	58,300	7,458.00	434,801,400	
日本郵船	460,100	3,887.00	1,788,408,700	
商船三井	303,300	4,035.00	1,223,815,500	
川崎汽船	129,400	4,912.00	635,612,800	
NSユニテッド海運	9,500	4,050.00	38,475,000	
飯野海運	64,200	1,024.00	65,740,800	
共栄タンカー	3,300	841.00	2,775,300	
乾汽船	22,600	1,289.00	29,131,400	
日本航空	422,200	2,948.00	1,244,645,600	
ANAホールディングス	467,700	3,250.00	1,520,025,000	
パスコ	2,200	1,661.00	3,654,200	
トランコム	5,000	7,670.00	38,350,000	
日新	13,100	2,589.00	33,915,900	
三菱倉庫	36,900	3,860.00	142,434,000	
三井倉庫ホールディングス	16,000	4,205.00	67,280,000	
住友倉庫	46,400	2,437.00	113,076,800	
澁澤倉庫	6,900	3,320.00	22,908,000	

東陽倉庫	15,200	277.00	4,210,400	
日本トランスシティ	34,600	633.00	21,901,800	
ケイヒン	2,000	1,741.00	3,482,000	
中央倉庫	8,300	1,109.00	9,204,700	
川西倉庫	1,900	1,049.00	1,993,100	
安田倉庫	11,700	1,009.00	11,805,300	
ファイズホールディングス	2,100	1,089.00	2,286,900	
東洋埠頭	3,300	1,400.00	4,620,000	
上組	82,400	3,280.00	270,272,000	
サンリツ	2,600	727.00	1,890,200	
キムラユニティー	5,500	1,422.00	7,821,000	
キューソー流通システム	5,900	942.00	5,557,800	
東海運	6,700	285.00	1,909,500	
エーアイテイナー	10,800	1,956.00	21,124,800	
内外トランスライン	6,900	2,684.00	18,519,600	
日本コンセプト	6,100	1,731.00	10,559,100	
NEC ネットエスアイ	57,700	1,933.00	111,534,100	
クロスキャット	9,900	1,053.00	10,424,700	
システナ	290,400	265.00	76,956,000	
デジタルアーツ	10,900	4,850.00	52,865,000	
日鉄ソリューションズ	29,500	3,970.00	117,115,000	
キューブシステム	10,300	1,160.00	11,948,000	
コア	7,700	1,726.00	13,290,200	
手間いらず	2,900	3,405.00	9,874,500	
ラクーンホールディングス	14,400	734.00	10,569,600	
ソリトンシステムズ	8,900	1,127.00	10,030,300	
ソフトクリエイトホールディングス	14,200	1,777.00	25,233,400	
T I S	188,900	3,412.00	644,526,800	
J N S ホールディングス	5,400	455.00	2,457,000	
グリー	46,400	621.00	28,814,400	
GMOペパボ	2,500	1,359.00	3,397,500	
コーエーテクモホールディングス	108,200	2,277.00	246,371,400	
三菱総合研究所	8,500	4,960.00	42,160,000	
電算	1,400	1,556.00	2,178,400	
A G S	4,900	723.00	3,542,700	
ファインデックス	13,800	641.00	8,845,800	

ブレインパッド	13,000	942.00	12,246,000	
K L a b	34,300	272.00	9,329,600	
ポールトゥウィンホールディングス	29,500	702.00	20,709,000	
ネクソン	385,000	2,824.50	1,087,432,500	
アイスタイル	51,300	486.00	24,931,800	
エムアップホールディングス	21,200	1,465.00	31,058,000	
エイチーム	10,300	673.00	6,931,900	
エニグモ	22,100	373.00	8,243,300	
テクノスジャパン	9,500	675.00	6,412,500	
コロプラ	67,000	632.00	42,344,000	
ブロードリーフ	100,600	529.00	53,217,400	
クロス・マーケティンググループ	7,000	718.00	5,026,000	
デジタルハーツホールディングス	10,800	1,250.00	13,500,000	
システム情報	13,800	746.00	10,294,800	
メディアドゥ	6,800	1,148.00	7,806,400	
じげん	50,400	593.00	29,887,200	
ブイキューブ	20,800	420.00	8,736,000	
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	497.00	1,391,600	
サイバーリンクス	4,500	710.00	3,195,000	
フィックスターズ	19,500	1,230.00	23,985,000	
CARTA HOLDINGS	8,100	1,213.00	9,825,300	
オブティム	14,200	897.00	12,737,400	
セレス	7,000	985.00	6,895,000	
SHIFT	11,500	29,965.00	344,597,500	
ティーガイア	18,100	1,725.00	31,222,500	
セック	1,600	3,390.00	5,424,000	
テクマトリックス	31,600	1,572.00	49,675,200	
プロシップ	7,600	1,279.00	9,720,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,000	2,382.00	107,190,000	
GMOペイメントゲートウェイ	34,500	9,471.00	326,749,500	
ザッパラス	3,300	504.00	1,663,200	
システムリサーチ	5,400	2,564.00	13,845,600	
インターネットイニシアティブ	94,300	2,574.50	242,775,350	
さくらインターネット	19,400	1,221.00	23,687,400	
ヴィンクス	2,800	1,336.00	3,740,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	3,040.00	16,112,000	

S R Aホールディングス	8,800	3,395.00	29,876,000	
システムインテグレータ	3,500	425.00	1,487,500	
朝日ネット	18,600	622.00	11,569,200	
e B A S E	24,300	695.00	16,888,500	
アバントグループ	21,800	1,446.00	31,522,800	
アドソル日進	7,300	1,745.00	12,738,500	
ODKソリューションズ	2,600	575.00	1,495,000	
フリービット	9,100	1,172.00	10,665,200	
コムチュア	22,900	2,381.00	54,524,900	
サイバーコム	1,900	1,341.00	2,547,900	
アステリア	13,600	756.00	10,281,600	
アイル	8,100	2,640.00	21,384,000	
マークライنز	9,400	3,020.00	28,388,000	
メディカル・データ・ビジョン	25,700	727.00	18,683,900	
g u m i	25,500	636.00	16,218,000	
ショーケース	2,800	406.00	1,136,800	
モバイルファクトリー	2,500	809.00	2,022,500	
テラスカイ	7,500	1,958.00	14,685,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,000	1,824.00	18,240,000	
P C Iホールディングス	4,400	1,074.00	4,725,600	
アイビーシー	1,800	562.00	1,011,600	
ネオジャパン	5,800	1,111.00	6,443,800	
P R T I M E S	4,400	1,664.00	7,321,600	
ラクス	81,700	2,273.50	185,744,950	
ランドコンピュータ	2,800	1,225.00	3,430,000	
ダブルスタンダード	7,000	1,391.00	9,737,000	
オープンドア	12,100	1,135.00	13,733,500	
アカツキ	8,200	1,951.00	15,998,200	
ベネフィットジャパン	700	1,204.00	842,800	
U b i c o mホールディングス	5,400	1,267.00	6,841,800	
カナミックネットワーク	18,700	498.00	9,312,600	
ノムラシステムコーポレーション	12,900	117.00	1,509,300	
チェンジホールディングス	42,300	1,935.00	81,850,500	
シンクロ・フード	7,300	573.00	4,182,900	
オークネット	8,500	1,735.00	14,747,500	
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	814.00	1,872,200	

セグエグループ	3,700	914.00	3,381,800
エイトレッド	1,800	1,440.00	2,592,000
マクロミル	33,900	729.00	24,713,100
ビーグリー	2,400	1,100.00	2,640,000
オロ	6,300	2,127.00	13,400,100
ユーザーローカル	6,200	2,097.00	13,001,400
テモナ	2,800	286.00	800,800
ニーズウェル	6,300	688.00	4,334,400
マネーフォワード	38,400	5,251.00	201,638,400
サインポスト	4,400	438.00	1,927,200
Sun Asterisk	12,300	1,311.00	16,125,300
電算システムホールディングス	8,300	2,863.00	23,762,900
Appier Group	58,900	1,743.00	102,662,700
ソルクシーズ	9,400	408.00	3,835,200
フェイス	3,300	486.00	1,603,800
プロトコーポレーション	21,600	1,177.00	25,423,200
ハイマックス	5,400	1,405.00	7,587,000
野村総合研究所	344,000	4,158.00	1,430,352,000
サイバネットシステム	14,500	746.00	10,817,000
CEホールディングス	6,000	566.00	3,396,000
日本システム技術	4,800	2,141.00	10,276,800
インテージホールディングス	19,500	1,729.00	33,715,500
東邦システムサイエンス	3,200	1,918.00	6,137,600
ソースネクスト	88,000	189.00	16,632,000
インフォコム	22,300	2,927.00	65,272,100
シンプレクス・ホールディングス	29,600	2,721.00	80,541,600
HEROZ	5,800	1,715.00	9,947,000
ラクスル	41,400	1,362.00	56,386,800
メルカリ	104,400	3,199.00	333,975,600
I P S	5,600	2,191.00	12,269,600
F I G	13,500	294.00	3,969,000
システムサポート	6,700	1,760.00	11,792,000
イーソル	12,300	759.00	9,335,700
東海ソフト	1,700	1,058.00	1,798,600
ウイングアーク1st	17,800	2,528.00	44,998,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	4,600	1,405.00	6,463,000

ス				
サーバーワークス	3,500	3,325.00	11,637,500	
東名	900	2,220.00	1,998,000	
ヴィッツ	1,200	1,094.00	1,312,800	
トビラシステムズ	3,300	936.00	3,088,800	
S a n s a n	56,500	1,347.50	76,133,750	
L i n k-U	2,800	880.00	2,464,000	
ギフトィ	18,800	1,625.00	30,550,000	
メドレー	23,200	5,410.00	125,512,000	
ベース	5,900	4,380.00	25,842,000	
J M D C	28,400	4,275.00	121,410,000	
フォーカスシステムズ	12,600	975.00	12,285,000	
クレスコ	13,300	1,877.00	24,964,100	
フジ・メディア・ホールディングス	165,900	1,505.00	249,679,500	
オービック	57,700	25,155.00	1,451,443,500	
ジャストシステム	24,800	3,005.00	74,524,000	
T D C ソフト	14,600	1,648.00	24,060,800	
Z ホールディングス	2,457,400	413.00	1,014,906,200	
トレンドマイクロ	81,600	6,142.00	501,187,200	
I D ホールディングス	11,700	1,376.00	16,099,200	
日本オラクル	33,000	10,250.00	338,250,000	
アルファシステムズ	5,400	2,975.00	16,065,000	
フューチャー	36,900	1,507.00	55,608,300	
C A C H o l d i n g s	10,600	1,690.00	17,914,000	
S B テクノロジー	7,300	2,403.00	17,541,900	
トーセ	3,400	751.00	2,553,400	
オービックビジネスコンサルタント	34,000	5,970.00	202,980,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	92,700	4,318.00	400,278,600	
アイティフォー	22,800	1,049.00	23,917,200	
東計電算	2,400	6,430.00	15,432,000	
エクスネット	1,600	1,043.00	1,668,800	
大塚商会	85,600	6,336.00	542,361,600	
サイボウズ	23,800	2,061.00	49,051,800	
電通国際情報サービス	21,000	5,730.00	120,330,000	
A C C E S S	20,500	937.00	19,208,500	
デジタルガレージ	30,700	3,775.00	115,892,500	

EMシステムズ	28,800	717.00	20,649,600	
ウェザーニューズ	5,300	6,400.00	33,920,000	
C I J	28,700	547.00	15,698,900	
ビジネスエンジニアリング	2,400	3,210.00	7,704,000	
日本エンタープライズ	12,200	133.00	1,622,600	
WOWOW	13,000	1,128.00	14,664,000	
スカラ	16,000	731.00	11,696,000	
インテリジェント ウェイブ	6,200	896.00	5,555,200	
ANYCOLOR	6,000	3,260.00	19,560,000	
I M A G I C A G R O U P	14,500	614.00	8,903,000	
ネットワンシステムズ	64,300	2,780.50	178,786,150	
システムソフト	60,600	82.00	4,969,200	
アルゴグラフィックス	15,800	3,320.00	52,456,000	
マーベラス	28,100	683.00	19,192,300	
エイベックス	29,400	1,405.00	41,307,000	
B I P R O G Y	63,600	3,737.00	237,673,200	
都築電気	9,100	2,325.00	21,157,500	
T B S ホールディングス	88,400	2,524.00	223,121,600	
日本テレビホールディングス	152,900	1,339.00	204,733,100	
朝日放送グループホールディングス	16,200	675.00	10,935,000	
テレビ朝日ホールディングス	41,900	1,657.00	69,428,300	
スカパー J S A T ホールディングス	153,300	647.00	99,185,100	
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,981.00	36,964,400	
日本BS放送	4,200	921.00	3,868,200	
ビジョン	26,000	1,684.00	43,784,000	
スマートバリュー	2,900	381.00	1,104,900	
USEN-NEXT HOLDINGS	19,400	3,460.00	67,124,000	
ワイヤレスゲート	5,200	206.00	1,071,200	
日本通信	159,500	224.00	35,728,000	
クロップス	1,900	1,010.00	1,919,000	
日本電信電話	55,312,800	166.50	9,209,581,200	
K D D I	1,334,300	4,279.00	5,709,469,700	
ソフトバンク	2,775,200	1,644.00	4,562,428,800	
光通信	20,300	23,600.00	479,080,000	
エムティーアイ	11,900	577.00	6,866,300	
GMOインターネットグループ	63,800	2,331.50	148,749,700	



ファイバーゲート	9,300	1,441.00	13,401,300	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,800	261.00	730,800	
KADOKAWA	91,300	3,432.00	313,341,600	
学研ホールディングス	28,800	835.00	24,048,000	
ゼンリン	29,600	897.00	26,551,200	
昭文社ホールディングス	5,000	305.00	1,525,000	
インプレスホールディングス	10,300	183.00	1,884,900	
アイネット	10,500	1,724.00	18,102,000	
松竹	9,900	10,840.00	107,316,000	
東宝	108,100	5,512.00	595,847,200	
東映	4,800	17,290.00	82,992,000	
NTTデータグループ	541,800	1,912.50	1,036,192,500	
ピー・シー・エー	9,900	1,214.00	12,018,600	
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,088.00	15,451,200	
DTS	36,800	3,220.00	118,496,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	86,800	5,399.00	468,633,200	
シーイーシー	24,200	1,663.00	40,244,600	
カプコン	171,600	5,999.00	1,029,428,400	
アイ・エス・ビー	8,800	1,358.00	11,950,400	
ジャステック	10,600	1,435.00	15,211,000	
SCSK	140,900	2,512.50	354,011,250	
NSW	6,700	2,706.00	18,130,200	
アイネス	12,100	1,634.00	19,771,400	
TKC	27,500	3,615.00	99,412,500	
富士ソフト	34,700	4,500.00	156,150,000	
NSD	61,600	2,535.00	156,156,000	
コナミグループ	73,900	8,398.00	620,612,200	
福井コンピュータホールディングス	12,000	2,694.00	32,328,000	
JBCホールディングス	12,600	2,590.00	32,634,000	
ミロク情報サービス	15,700	1,531.00	24,036,700	
ソフトバンクグループ	851,800	6,572.00	5,598,029,600	
高千穂交易	4,300	3,190.00	13,717,000	
オルパヘルスケアホールディングス	1,800	1,738.00	3,128,400	
伊藤忠食品	4,100	5,990.00	24,559,000	
エレマテック	16,400	1,840.00	30,176,000	
あらた	13,900	5,260.00	73,114,000	

トーメンデバイス	2,600	4,935.00	12,831,000	
東京エレクトロン デバイス	6,700	9,770.00	65,459,000	
円谷フィールズホールディングス	31,300	2,556.00	80,002,800	
双日	181,600	3,105.00	563,868,000	
アルフレッサ ホールディングス	182,800	2,466.50	450,876,200	
横浜冷凍	49,600	1,303.00	64,628,800	
ラサ商事	5,600	1,540.00	8,624,000	
アルコニックス	24,000	1,390.00	33,360,000	
神戸物産	140,900	3,604.00	507,803,600	
ハイパー	2,700	355.00	958,500	
あい ホールディングス	29,200	2,345.00	68,474,000	
ディーブイエックス	3,400	857.00	2,913,800	
ダイワボウホールディングス	74,400	2,878.50	214,160,400	
マクニカホールディングス	43,100	6,330.00	272,823,000	
ラクト・ジャパン	7,100	2,018.00	14,327,800	
グリムス	7,600	2,391.00	18,171,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,500	978.00	25,917,000	
八洲電機	14,700	1,284.00	18,874,800	
メディアスホールディングス	11,700	771.00	9,020,700	
レスターホールディングス	17,400	2,369.00	41,220,600	
ジューテックホールディングス	2,800	1,214.00	3,399,200	
大光	5,100	614.00	3,131,400	
OCHIホールディングス	2,800	1,378.00	3,858,400	
TOKAIホールディングス	90,000	932.00	83,880,000	
黒谷	3,400	628.00	2,135,200	
Cominix	2,400	849.00	2,037,600	
三洋貿易	20,600	1,338.00	27,562,800	
ビューティガレージ	2,900	4,565.00	13,238,500	
ウイン・パートナーズ	13,300	1,065.00	14,164,500	
ミタチ産業	3,100	1,140.00	3,534,000	
シップヘルスケアホールディングス	65,500	2,459.00	161,064,500	
明治電機工業	6,800	1,484.00	10,091,200	
デリカフーズホールディングス	4,800	624.00	2,995,200	
スターティアホールディングス	2,400	1,807.00	4,336,800	
コメダホールディングス	44,700	2,807.00	125,472,900	
ピーバンドットコム	1,800	456.00	820,800	

アセンテック	6,200	633.00	3,924,600	
富士興産	2,700	1,811.00	4,889,700	
協栄産業	1,100	2,172.00	2,389,200	
フルサト・マルカホールディングス	18,100	2,767.00	50,082,700	
ヤマエグループホールディングス	10,300	4,480.00	46,144,000	
小野建	17,900	1,667.00	29,839,300	
南陽	2,300	2,116.00	4,866,800	
佐鳥電機	7,600	1,557.00	11,833,200	
エコトレーディング	2,400	1,314.00	3,153,600	
伯東	10,400	5,030.00	52,312,000	
コンドーテック	14,000	1,168.00	16,352,000	
中山福	6,500	345.00	2,242,500	
ナガイレーベン	23,000	2,277.00	52,371,000	
三菱食品	16,800	3,960.00	66,528,000	
松田産業	13,900	2,198.00	30,552,200	
第一興商	70,500	2,790.50	196,730,250	
メディパルホールディングス	174,200	2,461.00	428,706,200	
S P K	8,100	1,955.00	15,835,500	
萩原電気ホールディングス	7,400	3,780.00	27,972,000	
アズワン	25,900	5,760.00	149,184,000	
スズデン	6,400	2,196.00	14,054,400	
尾家産業	2,900	1,943.00	5,634,700	
シモジマ	12,500	1,143.00	14,287,500	
ドウシシャ	19,300	2,323.00	44,833,900	
小津産業	2,700	1,569.00	4,236,300	
高速	9,500	2,076.00	19,722,000	
たけびし	7,000	1,870.00	13,090,000	
リックス	2,500	3,035.00	7,587,500	
丸文	16,300	1,164.00	18,973,200	
ハビネット	15,500	2,507.00	38,858,500	
橋本総業ホールディングス	7,200	1,131.00	8,143,200	
日本ライフライン	53,400	1,128.00	60,235,200	
タカショー	15,900	634.00	10,080,600	
I D O M	55,100	797.00	43,914,700	
進和	11,200	2,248.00	25,177,600	
エスケイジャパン	3,000	693.00	2,079,000	

ダイトロン	7,200	3,070.00	22,104,000	
シークス	26,000	1,508.00	39,208,000	
田中商事	3,500	676.00	2,366,000	
オーハシテクニカ	8,800	1,603.00	14,106,400	
白銅	6,600	2,304.00	15,206,400	
ダイコー通産	1,300	1,152.00	1,497,600	
伊藤忠商事	1,122,400	5,514.00	6,188,913,600	
丸紅	1,421,400	2,349.50	3,339,579,300	
高島	1,900	3,630.00	6,897,000	
長瀬産業	83,500	2,501.50	208,875,250	
蝶理	9,800	2,833.00	27,763,400	
豊田通商	159,600	8,610.00	1,374,156,000	
三共生興	26,100	705.00	18,400,500	
兼松	70,700	2,043.00	144,440,100	
ツカモトコーポレーション	1,700	1,289.00	2,191,300	
三井物産	1,292,700	5,399.00	6,979,287,300	
日本紙パルプ商事	9,700	4,675.00	45,347,500	
カメイ	19,400	1,448.00	28,091,200	
東都水産	600	6,280.00	3,768,000	
OUGホールディングス	1,800	2,481.00	4,465,800	
スターゼン	13,800	2,579.00	35,590,200	
山善	49,100	1,129.00	55,433,900	
椿本興業	2,900	5,020.00	14,558,000	
住友商事	1,108,900	2,944.00	3,264,601,600	
内田洋行	7,400	6,480.00	47,952,000	
三菱商事	1,110,600	6,999.00	7,773,089,400	
第一実業	6,400	5,290.00	33,856,000	
キヤノンマーケティングジャパン	42,200	3,764.00	158,840,800	
西華産業	7,200	2,089.00	15,040,800	
佐藤商事	12,700	1,454.00	18,465,800	
菱洋エレクトロ	15,500	3,355.00	52,002,500	
東京産業	16,700	828.00	13,827,600	
ユアサ商事	15,700	4,245.00	66,646,500	
神鋼商事	4,600	5,630.00	25,898,000	
トルク	6,600	246.00	1,623,600	
阪和興業	32,700	4,625.00	151,237,500	

正栄食品工業	12,100	4,510.00	54,571,000	
カナデン	12,200	1,295.00	15,799,000	
R Y O D E N	14,700	2,312.00	33,986,400	
岩谷産業	41,500	7,474.00	310,171,000	
ナイス	3,300	1,527.00	5,039,100	
ニチモウ	1,600	3,925.00	6,280,000	
極東貿易	10,900	1,840.00	20,056,000	
アステナホールディングス	34,200	454.00	15,526,800	
三愛オブリ	48,200	1,660.00	80,012,000	
稲畑産業	36,800	3,185.00	117,208,000	
G S I クレオス	10,600	2,148.00	22,768,800	
明和産業	24,300	662.00	16,086,600	
クワザワホールディングス	3,900	510.00	1,989,000	
ワキタ	33,500	1,331.00	44,588,500	
東邦ホールディングス	45,400	2,877.50	130,638,500	
サンゲツ	45,700	2,919.00	133,398,300	
ミツウロコグループホールディングス	23,300	1,288.00	30,010,400	
シナネンホールディングス	5,900	4,020.00	23,718,000	
伊藤忠エネクス	45,200	1,466.00	66,263,200	
サンリオ	51,600	7,410.00	382,356,000	
サンワテクノス	9,300	2,193.00	20,394,900	
リョーサン	19,300	4,030.00	77,779,000	
新光商事	24,500	1,143.00	28,003,500	
トーヨー	7,800	3,070.00	23,946,000	
三信電気	7,400	2,162.00	15,998,800	
東陽テクニカ	18,500	1,334.00	24,679,000	
モスフードサービス	26,800	3,340.00	89,512,000	
加賀電子	14,800	6,560.00	97,088,000	
ソーダニッカ	8,900	898.00	7,992,200	
立花エレテック	13,300	2,617.00	34,806,100	
フォーバル	7,200	1,224.00	8,812,800	
P A L T A C	28,600	4,719.00	134,963,400	
三谷産業	31,900	321.00	10,239,900	
西本W i s m e t t a cホールディングス	4,600	4,500.00	20,700,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,978.00	1,978,000	
コア商事ホールディングス	10,300	692.00	7,127,600	

K P P グループホールディングス	42,500	634.00	26,945,000	
ヤマタネ	8,100	1,894.00	15,341,400	
丸紅建材リース	1,100	2,577.00	2,834,700	
泉州電業	9,100	3,840.00	34,944,000	
トラスコ中山	38,300	2,503.00	95,864,900	
オートバックスセブン	63,400	1,610.00	102,074,000	
モリト	13,100	1,220.00	15,982,000	
加藤産業	22,500	4,105.00	92,362,500	
北恵	3,100	820.00	2,542,000	
イエローハット	32,200	1,874.00	60,342,800	
J Kホールディングス	14,000	975.00	13,650,000	
日伝	10,800	2,518.00	27,194,400	
北沢産業	6,500	318.00	2,067,000	
杉本商事	8,100	2,236.00	18,111,600	
因幡電機産業	47,200	3,145.00	148,444,000	
東テク	6,100	5,230.00	31,903,000	
ミスミグループ本社	274,900	2,491.50	684,913,350	
アルテック	6,600	252.00	1,663,200	
タキヒヨー	3,000	1,113.00	3,339,000	
蔵王産業	2,000	2,594.00	5,188,000	
スズケン	53,300	4,190.00	223,327,000	
ジェコス	10,900	943.00	10,278,700	
グローセル	14,700	423.00	6,218,100	
ローソン	45,200	7,002.00	316,490,400	
サンエー	14,000	4,830.00	67,620,000	
カワチ薬品	14,500	2,283.00	33,103,500	
エービーシー・マート	26,600	7,729.00	205,591,400	
ハードオフコーポレーション	5,200	1,475.00	7,670,000	
アスクル	37,900	1,929.00	73,109,100	
ゲオホールディングス	18,000	2,536.00	45,648,000	
アダストリア	22,200	2,943.00	65,334,600	
くら寿司	21,500	3,080.00	66,220,000	
キャンドウ	6,700	2,943.00	19,718,100	
I Kホールディングス	5,100	380.00	1,938,000	
パルグループホールディングス	18,000	4,020.00	72,360,000	
エディオン	72,400	1,460.00	105,704,000	

サーラコーポレーション	38,900	743.00	28,902,700	
ワッツ	6,600	626.00	4,131,600	
ハローズ	8,400	4,000.00	33,600,000	
あみやき亭	4,500	3,440.00	15,480,000	
大黒天物産	5,700	6,280.00	35,796,000	
ハニーズホールディングス	14,700	1,651.00	24,269,700	
ファーマライズホールディングス	3,300	633.00	2,088,900	
アルペン	15,300	1,889.00	28,901,700	
ハブ	4,500	930.00	4,185,000	
クオールホールディングス	25,300	1,844.00	46,653,200	
ジinzホールディングス	10,900	3,475.00	37,877,500	
ビックカメラ	97,300	1,107.00	107,711,100	
DCMホールディングス	106,300	1,230.00	130,749,000	
Monotaro	258,500	1,714.00	443,069,000	
東京一番フーズ	3,700	529.00	1,957,300	
きちりホールディングス	2,900	852.00	2,470,800	
アークランドサービスホールディングス	15,100	3,045.00	45,979,500	
J. フロント リテイリング	226,800	1,491.00	338,158,800	
ドトール・日レスホールディングス	32,500	2,289.00	74,392,500	
マツキヨココカラ&カンパニー	110,500	8,315.00	918,807,500	
ブロンコビリー	10,800	2,958.00	31,946,400	
ZOZO	120,600	2,887.50	348,232,500	
トレジャー・ファクトリー	7,900	1,410.00	11,139,000	
物語コーポレーション	30,600	4,575.00	139,995,000	
三越伊勢丹ホールディングス	307,000	1,647.00	505,629,000	
Hamee	6,800	1,122.00	7,629,600	
マーケットエンタープライズ	1,500	1,220.00	1,830,000	
ウエルシアホールディングス	94,700	2,631.50	249,203,050	
クリエイトSDホールディングス	30,200	3,685.00	111,287,000	
丸善CHIホールディングス	15,700	339.00	5,322,300	
ミサワ	3,000	615.00	1,845,000	
ティーライフ	2,000	1,406.00	2,812,000	
チムニー	3,700	1,458.00	5,394,600	
シュッピン	14,000	1,145.00	16,030,000	
オイシックス・ラ・大地	24,700	1,645.00	40,631,500	
ネクステージ	41,700	3,210.00	133,857,000	

ジョイフル本田	53,300	1,691.00	90,130,300
鳥貴族ホールディングス	6,900	3,055.00	21,079,500
ホットランド	14,200	1,637.00	23,245,400
すかいらーくホールディングス	249,300	1,992.00	496,605,600
SFPホールディングス	10,000	2,333.00	23,330,000
綿半ホールディングス	14,400	1,361.00	19,598,400
ヨシックスホールディングス	2,600	2,776.00	7,217,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	59,800	1,130.00	67,574,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,900	720.00	6,408,000
B E E N O S	8,000	1,669.00	13,352,000
あさひ	15,600	1,284.00	20,030,400
日本調剤	12,800	1,338.00	17,126,400
コスモス薬品	18,100	16,865.00	305,256,500
トーエル	6,000	764.00	4,584,000
セブン&アイ・ホールディングス	627,800	6,027.00	3,783,750,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	137,000	1,134.00	155,358,000
ツルハホールディングス	38,300	10,545.00	403,873,500
サンマルクホールディングス	14,900	1,868.00	27,833,200
フェリシモ	3,200	1,014.00	3,244,800
トリドールホールディングス	45,400	3,915.00	177,741,000
TOKYO BASE	20,200	310.00	6,262,000
ウイルプラスホールディングス	2,300	1,138.00	2,617,400
JMホールディングス	14,000	1,863.00	26,082,000
サツドラホールディングス	6,100	780.00	4,758,000
アレンザホールディングス	14,100	1,012.00	14,269,200
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,551.00	8,065,200
バロックジャパンリミテッド	12,300	851.00	10,467,300
クスリのアオキホールディングス	16,300	9,169.00	149,454,700
力の源ホールディングス	7,000	2,245.00	15,715,000
FOOD & LIFE COMPANIES	97,300	2,547.00	247,823,100
メディカルシステムネットワーク	17,100	391.00	6,686,100
はるやまホールディングス	6,000	510.00	3,060,000
ノジマ	59,800	1,267.00	75,766,600
カップ・クリエイト	28,600	1,602.00	45,817,200
ライトオン	9,200	554.00	5,096,800



良品計画	199,100	1,866.00	371,520,600	
パリミキホールディングス	16,600	365.00	6,059,000	
アドヴァングループ	17,800	985.00	17,533,000	
アルビス	6,100	2,452.00	14,957,200	
コナカ	13,200	431.00	5,689,200	
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,605.00	2,889,000	
G-7ホールディングス	23,100	1,236.00	28,551,600	
イオン北海道	27,100	851.00	23,062,100	
コジマ	30,800	660.00	20,328,000	
ヒマラヤ	4,300	963.00	4,140,900	
コーナン商事	24,700	3,555.00	87,808,500	
エコス	7,000	2,069.00	14,483,000	
ワタミ	22,000	1,033.00	22,726,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	367,800	2,793.00	1,027,265,400	
西松屋チェーン	40,600	1,709.00	69,385,400	
ゼンショーホールディングス	99,800	6,981.00	696,703,800	
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,020.00	12,138,000	
ハークスレイ	5,000	707.00	3,535,000	
サイゼリヤ	27,000	4,390.00	118,530,000	
VTホールディングス	70,100	502.00	35,190,200	
魚力	5,900	2,168.00	12,791,200	
フジ・コーポレーション	10,600	1,860.00	19,716,000	
ユナイテッドアローズ	19,600	2,094.00	41,042,400	
ハイデイ日高	27,200	2,798.00	76,105,600	
YU-WA Creation Holdings	9,700	183.00	1,775,100	
コロワイド	83,900	2,361.00	198,087,900	
壺番屋	14,500	5,580.00	80,910,000	
PLANT	3,400	788.00	2,679,200	
スギホールディングス	36,800	6,502.00	239,273,600	
薬王堂ホールディングス	10,400	2,560.00	26,624,000	
スクロール	27,500	985.00	27,087,500	
ヨンドシーホールディングス	15,900	1,914.00	30,432,600	
木曾路	27,800	2,624.00	72,947,200	
SRSホールディングス	30,500	1,050.00	32,025,000	
千趣会	34,700	402.00	13,949,400	

リテールパートナーズ	27,300	1,440.00	39,312,000	
ケーヨー	29,500	861.00	25,399,500	
上新電機	16,500	2,228.00	36,762,000	
日本瓦斯	96,700	2,264.50	218,977,150	
ロイヤルホールディングス	35,200	2,632.00	92,646,400	
いなげや	17,800	1,497.00	26,646,600	
チヨダ	17,900	993.00	17,774,700	
ライフコーポレーション	16,000	3,640.00	58,240,000	
リンガーハット	23,500	2,370.00	55,695,000	
MrMaxHD	26,300	602.00	15,832,600	
AOKIホールディングス	34,000	1,010.00	34,340,000	
オークワ	29,300	873.00	25,578,900	
コメリ	28,200	3,025.00	85,305,000	
青山商事	39,300	1,508.00	59,264,400	
しまむら	21,400	15,670.00	335,338,000	
はせがわ	7,000	344.00	2,408,000	
高島屋	137,400	2,167.00	297,745,800	
松屋	31,000	1,068.00	33,108,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	88,800	1,679.00	149,095,200	
近鉄百貨店	8,000	2,666.00	21,328,000	
丸井グループ	134,400	2,499.50	335,932,800	
アクシアル リテイリング	12,500	3,680.00	46,000,000	
イオン	617,500	3,078.00	1,900,665,000	
イズミ	27,700	3,600.00	99,720,000	
平和堂	30,500	2,414.00	73,627,000	
フジ	28,000	1,818.00	50,904,000	
ヤオコー	20,600	7,619.00	156,951,400	
ゼビオホールディングス	25,100	1,007.00	25,275,700	
ケーズホールディングス	129,100	1,350.00	174,285,000	
Olympicグループ	5,400	524.00	2,829,600	
日産東京販売ホールディングス	16,600	440.00	7,304,000	
シルバーライフ	3,900	1,169.00	4,559,100	
Genky DrugStores	8,100	5,230.00	42,363,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,135.00	2,724,000	
ブックオフグループホールディングス	8,300	1,209.00	10,034,700	
ギフトホールディングス	8,000	2,531.00	20,248,000	

アインホールディングス	25,200	5,077.00	127,940,400	
元気寿司	5,300	4,360.00	23,108,000	
ヤマダホールディングス	748,000	466.30	348,792,400	
アークランズ	26,900	1,648.00	44,331,200	
ニトリホールディングス	73,700	16,505.00	1,216,418,500	
グルメ杵屋	15,200	1,150.00	17,480,000	
愛眼	9,000	181.00	1,629,000	
ケーユーホールディングス	11,000	1,200.00	13,200,000	
吉野家ホールディングス	71,500	2,771.00	198,126,500	
松屋フーズホールディングス	8,700	4,170.00	36,279,000	
サガミホールディングス	29,600	1,354.00	40,078,400	
関西フードマーケット	16,800	1,432.00	24,057,600	
王将フードサービス	12,100	6,890.00	83,369,000	
ミニストップ	13,300	1,467.00	19,511,100	
アークス	33,600	2,572.00	86,419,200	
バローホールディングス	35,000	2,094.00	73,290,000	
ベルク	9,100	6,690.00	60,879,000	
大庄	7,000	1,119.00	7,833,000	
ファーストリテイリング	82,000	33,090.00	2,713,380,000	
サンドラッグ	69,300	4,252.00	294,663,600	
サックスパー ホールディングス	17,800	929.00	16,536,200	
ヤマザワ	2,600	1,289.00	3,351,400	
やまや	2,700	2,965.00	8,005,500	
ベルーナ	44,500	720.00	32,040,000	
いよぎんホールディングス	201,800	994.00	200,589,200	
しずおかフィナンシャルグループ	376,700	1,179.00	444,129,300	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	142,800	958.30	136,845,240	
楽天銀行	59,000	1,879.00	110,861,000	
島根銀行	3,900	505.00	1,969,500	
じもとホールディングス	10,000	406.00	4,060,000	
めぶきフィナンシャルグループ	841,400	404.00	339,925,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,700	3,755.00	81,483,500	
九州フィナンシャルグループ	298,300	689.90	205,797,170	
ゆうちょ銀行	465,800	1,170.50	545,218,900	
富山第一銀行	53,800	834.00	44,869,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	909,800	637.20	579,724,560	

西日本フィナンシャルホールディングス	105,200	1,475.00	155,170,000	
三十三フィナンシャルグループ	15,200	1,714.00	26,052,800	
第四北越フィナンシャルグループ	26,600	3,595.00	95,627,000	
ひろぎんホールディングス	221,200	875.70	193,704,840	
おきなわフィナンシャルグループ	15,600	2,170.00	33,852,000	
十六フィナンシャルグループ	22,000	3,590.00	78,980,000	
北國フィナンシャルホールディングス	17,900	4,900.00	87,710,000	
プロクレアホールディングス	20,800	1,982.00	41,225,600	
あいちフィナンシャルグループ	23,700	2,429.00	57,567,300	
あおぞら銀行	106,600	2,838.00	302,530,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,619,100	1,155.50	12,270,370,050	
りそなホールディングス	2,143,100	761.70	1,632,399,270	
三井住友トラスト・ホールディングス	304,700	5,433.00	1,655,435,100	
三井住友フィナンシャルグループ	1,205,100	6,580.00	7,929,558,000	
千葉銀行	472,500	1,026.50	485,021,250	
群馬銀行	329,000	655.70	215,725,300	
武蔵野銀行	21,800	2,582.00	56,287,600	
千葉興業銀行	26,400	748.00	19,747,200	
筑波銀行	74,400	230.00	17,112,000	
七十七銀行	54,300	3,075.00	166,972,500	
秋田銀行	11,400	1,819.00	20,736,600	
山形銀行	18,800	1,082.00	20,341,600	
岩手銀行	11,600	2,404.00	27,886,400	
東邦銀行	134,100	269.00	36,072,900	
東北銀行	5,500	1,073.00	5,901,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	135,400	3,392.00	459,276,800	
スルガ銀行	149,500	594.00	88,803,000	
八十二銀行	358,100	780.10	279,353,810	
山梨中央銀行	17,400	1,470.00	25,578,000	
大垣共立銀行	32,300	1,982.00	64,018,600	
福井銀行	15,200	1,531.00	23,271,200	
清水銀行	6,700	1,542.00	10,331,400	
富山銀行	1,700	1,752.00	2,978,400	
滋賀銀行	28,200	3,175.00	89,535,000	
南都銀行	25,500	2,606.00	66,453,000	
百五銀行	159,500	494.00	78,793,000	

京都銀行	53,700	8,538.00	458,490,600	
紀陽銀行	60,700	1,484.00	90,078,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	107,800	1,292.00	139,277,600	
山陰合同銀行	106,100	901.00	95,596,100	
鳥取銀行	3,600	1,263.00	4,546,800	
百十四銀行	15,500	2,195.00	34,022,500	
四国銀行	26,900	919.00	24,721,100	
阿波銀行	23,800	2,219.00	52,812,200	
大分銀行	10,200	2,392.00	24,398,400	
宮崎銀行	11,100	2,593.00	28,782,300	
佐賀銀行	9,900	1,796.00	17,780,400	
琉球銀行	38,900	1,035.00	40,261,500	
セブン銀行	607,400	306.10	185,925,140	
みずほフィナンシャルグループ	2,452,200	2,385.50	5,849,723,100	
高知銀行	3,900	966.00	3,767,400	
山口フィナンシャルグループ	166,300	1,137.00	189,083,100	
名古屋銀行	11,200	4,235.00	47,432,000	
北洋銀行	256,900	297.00	76,299,300	
大光銀行	3,400	1,213.00	4,124,200	
愛媛銀行	22,800	867.00	19,767,600	
トマト銀行	3,700	1,108.00	4,099,600	
京葉銀行	77,600	583.00	45,240,800	
栃木銀行	77,600	284.00	22,038,400	
北日本銀行	5,900	2,141.00	12,631,900	
東和銀行	31,100	561.00	17,447,100	
福島銀行	11,900	224.00	2,665,600	
大東銀行	4,400	670.00	2,948,000	
トモニホールディングス	137,000	403.00	55,211,000	
フィデアホールディングス	17,500	1,492.00	26,110,000	
池田泉州ホールディングス	217,100	257.00	55,794,700	
F P G	57,500	1,471.00	84,582,500	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,000	1,624.00	22,736,000	
マーキュリアホールディングス	6,000	771.00	4,626,000	
S B I ホールディングス	245,600	2,943.00	722,800,800	
ジャフコ グループ	56,700	1,808.50	102,541,950	
大和証券グループ本社	1,212,700	806.50	978,042,550	

野村ホールディングス	3,055,400	558.80	1,707,357,520	
岡三証券グループ	149,100	576.00	85,881,600	
丸三証券	56,700	522.00	29,597,400	
東洋証券	56,700	324.00	18,370,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	184,900	448.00	82,835,200	
光世証券	2,800	586.00	1,640,800	
水戸証券	45,900	420.00	19,278,000	
いちよし証券	31,500	690.00	21,735,000	
松井証券	100,300	818.00	82,045,400	
マネックスグループ	183,000	522.00	95,526,000	
極東証券	21,300	784.00	16,699,200	
岩井コスモホールディングス	19,400	1,731.00	33,581,400	
アイザワ証券グループ	24,700	847.00	20,920,900	
マネーパートナーズグループ	12,300	286.00	3,517,800	
スパークス・グループ	19,000	1,497.00	28,443,000	
かんぽ生命保険	197,400	2,321.50	458,264,100	
SOMPOホールディングス	291,000	6,298.00	1,832,718,000	
アニコムホールディングス	57,600	659.00	37,958,400	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	345,100	5,221.00	1,801,767,100	
第一生命ホールディングス	828,400	2,657.50	2,201,473,000	
東京海上ホールディングス	1,676,000	3,218.00	5,393,368,000	
T&Dホールディングス	455,000	2,330.50	1,060,377,500	
アドバンスクリエイト	9,800	1,117.00	10,946,600	
全国保証	44,400	4,998.00	221,911,200	
あんしん保証	6,600	280.00	1,848,000	
イントラスト	4,700	909.00	4,272,300	
日本モーゲージサービス	6,900	564.00	3,891,600	
C a s a	4,800	854.00	4,099,200	
アルヒ	21,300	926.00	19,723,800	
プレミアグループ	28,800	1,671.00	48,124,800	
ネットプロテクションズホールディングス	57,200	351.00	20,077,200	
クレディセゾン	107,600	2,206.50	237,419,400	
芙蓉総合リース	15,600	11,750.00	183,300,000	
みずほリース	25,300	4,680.00	118,404,000	
東京センチュリー	31,700	5,480.00	173,716,000	

日本証券金融	62,600	1,224.00	76,622,400
アイフル	281,800	343.00	96,657,400
リコーリース	16,200	4,230.00	68,526,000
イオンフィナンシャルサービス	97,600	1,276.50	124,586,400
アコム	303,600	342.50	103,983,000
ジャックス	18,100	5,050.00	91,405,000
オリエントコーポレーション	44,600	1,098.00	48,970,800
オリックス	1,113,100	2,657.00	2,957,506,700
三菱HCキャピタル	661,500	926.20	612,681,300
九州リースサービス	5,700	832.00	4,742,400
日本取引所グループ	476,600	2,558.00	1,219,142,800
イー・ギャランティ	27,700	1,955.00	54,153,500
アサックス	5,600	658.00	3,684,800
NECキャピタルソリューション	8,400	3,125.00	26,250,000
大東建託	62,200	15,970.00	993,334,000
いちご	197,700	287.00	56,739,900
日本駐車場開発	182,600	221.00	40,354,600
スター・マイカ・ホールディングス	20,300	611.00	12,403,300
SREホールディングス	8,500	3,305.00	28,092,500
ADワークスグループ	28,500	210.00	5,985,000
ヒューリック	396,100	1,269.50	502,848,950
三栄建築設計	8,700	2,024.00	17,608,800
野村不動産ホールディングス	106,200	3,595.00	381,789,000
三重交通グループホールディングス	37,400	592.00	22,140,800
サムティ	27,300	2,298.00	62,735,400
ディア・ライフ	29,700	849.00	25,215,300
地主	13,300	1,868.00	24,844,400
プレサンスコーポレーション	27,100	1,871.00	50,704,100
ハウスコム	2,500	894.00	2,235,000
JPMC	10,400	1,115.00	11,596,000
サンセイランディック	4,000	965.00	3,860,000
フージャースホールディングス	26,100	1,053.00	27,483,300
オープンハウスグループ	62,200	4,831.00	300,488,200
東急不動産ホールディングス	510,600	896.50	457,752,900
飯田グループホールディングス	148,800	2,330.00	346,704,000
イーランド	2,200	1,493.00	3,284,600

ムゲンエステート	8,300	988.00	8,200,400	
And Doホールディングス	10,100	1,020.00	10,302,000	
シーアールイー	9,900	1,470.00	14,553,000	
ケイアイスター不動産	8,300	4,645.00	38,553,500	
グッドコムアセット	16,500	943.00	15,559,500	
ジェイ・エス・ビー	4,300	5,690.00	24,467,000	
ロードスターキャピタル	11,400	1,682.00	19,174,800	
テンポイノベーション	4,000	1,224.00	4,896,000	
フェイスネットワーク	3,500	1,353.00	4,735,500	
パーク24	110,500	2,033.50	224,701,750	
パラカ	6,300	2,060.00	12,978,000	
三井不動産	723,800	3,130.00	2,265,494,000	
三菱地所	1,023,500	1,810.50	1,853,046,750	
平和不動産	27,700	3,850.00	106,645,000	
東京建物	148,500	1,885.00	279,922,500	
京阪神ビルディング	29,000	1,285.00	37,265,000	
住友不動産	306,700	3,662.00	1,123,135,400	
テーオーシー	31,800	623.00	19,811,400	
東京楽天地	3,000	4,170.00	12,510,000	
レオパレス21	190,900	368.00	70,251,200	
スターツコーポレーション	24,600	3,035.00	74,661,000	
フジ住宅	24,700	721.00	17,808,700	
空港施設	21,700	585.00	12,694,500	
明和地所	6,000	1,039.00	6,234,000	
ゴールドクレスト	16,500	1,919.00	31,663,500	
エスリード	8,200	2,948.00	24,173,600	
日神グループホールディングス	28,500	515.00	14,677,500	
日本エスコン	37,900	820.00	31,078,000	
MIRARTHホールディングス	85,700	467.00	40,021,900	
AVANTIA	7,100	891.00	6,326,100	
イオンモール	88,300	1,760.00	155,408,000	
毎日コムネット	5,100	747.00	3,809,700	
ファースト住建	5,200	1,148.00	5,969,600	
カチタス	45,800	2,254.00	103,233,200	
トーセイ	28,600	1,768.00	50,564,800	
穴吹興産	2,500	2,009.00	5,022,500	



サンフロンティア不動産	28,700	1,434.00	41,155,800
FJネクストホールディングス	18,500	1,048.00	19,388,000
インテリックス	2,800	505.00	1,414,000
ランドビジネス	4,100	275.00	1,127,500
サンネクスタグループ	4,000	960.00	3,840,000
グランディハウス	10,600	601.00	6,370,600
日本空港ビルデング	60,100	6,759.00	406,215,900
明豊ファシリティワークス	6,300	741.00	4,668,300
L I F U L L	61,500	229.00	14,083,500
M I X I	40,400	2,420.00	97,768,000
ジェイエイシーリクルートメント	16,100	2,625.00	42,262,500
日本M&Aセンターホールディングス	304,100	795.50	241,911,550
メンバーズ	5,400	1,181.00	6,377,400
中広	2,400	419.00	1,005,600
UTグループ	26,100	2,449.00	63,918,900
アイティメディア	6,900	1,122.00	7,741,800
E・Jホールディングス	10,500	1,662.00	17,451,000
オープンアップグループ	53,200	2,046.00	108,847,200
コシダカホールディングス	53,200	1,250.00	66,500,000
アルトナー	3,000	1,694.00	5,082,000
パソナグループ	21,700	1,625.00	35,262,500
CDS	3,100	1,711.00	5,304,100
リンクアンドモチベーション	51,000	442.00	22,542,000
エス・エム・エス	67,400	2,739.50	184,642,300
サニーサイドアップグループ	4,000	796.00	3,184,000
パーソルホールディングス	195,300	2,535.00	495,085,500
リニカル	7,100	711.00	5,048,100
クックパッド	50,400	163.00	8,215,200
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	669.00	4,214,700
学情	9,200	1,837.00	16,900,400
スタジオアリス	9,000	2,175.00	19,575,000
シミックホールディングス	8,700	1,752.00	15,242,400
エプロ	3,600	745.00	2,682,000
NJS	4,000	2,985.00	11,940,000
総合警備保障	328,800	920.00	302,496,000
カカコム	130,000	1,720.00	223,600,000

アイロムグループ	6,500	1,825.00	11,862,500	
セントケア・ホールディング	11,700	785.00	9,184,500	
サイネックス	2,500	648.00	1,620,000	
ルネサンス	12,700	927.00	11,772,900	
ディップ	31,100	3,520.00	109,472,000	
デジタルホールディングス	14,100	1,037.00	14,621,700	
新日本科学	18,900	2,132.00	40,294,800	
キャリアデザインセンター	2,600	2,127.00	5,530,200	
ベネフィット・ワン	82,200	1,232.50	101,311,500	
エムスリー	349,800	2,854.00	998,329,200	
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	503.00	3,822,800	
アウトソーシング	113,800	1,122.00	127,683,600	
ウエルネット	9,500	589.00	5,595,500	
ワールドホールディングス	8,100	2,366.00	19,164,600	
ディー・エヌ・エー	71,000	1,497.50	106,322,500	
博報堂DYホールディングス	225,900	1,318.00	297,736,200	
ぐるなび	33,300	338.00	11,255,400	
タカミヤ	24,600	506.00	12,447,600	
ジャパンベストレスクューシステム	8,800	731.00	6,432,800	
ファンコミュニケーションズ	35,400	392.00	13,876,800	
ライク	6,800	1,504.00	10,227,200	
ビジネス・ブレークスルー	5,100	409.00	2,085,900	
エスプール	51,400	482.00	24,774,800	
WDBホールディングス	9,200	2,041.00	18,777,200	
ティア	7,600	457.00	3,473,200	
CDG	1,500	1,320.00	1,980,000	
アドウェイズ	24,800	591.00	14,656,800	
バリューコマース	15,800	1,261.00	19,923,800	
インフォマート	184,500	440.00	81,180,000	
J Pホールディングス	51,800	326.00	16,886,800	
エコナックホールディングス	23,800	85.00	2,023,000	
CLホールディングス	5,300	826.00	4,377,800	
プレステージ・インターナショナル	75,000	571.00	42,825,000	
アミューズ	9,800	1,584.00	15,523,200	
ドリームインキュベータ	5,500	2,891.00	15,900,500	
クイック	13,700	2,098.00	28,742,600	

T A C	7,200	200.00	1,440,000	
電通グループ	174,000	4,336.00	754,464,000	
イオンファンタジー	7,700	3,200.00	24,640,000	
シーティーエス	20,000	701.00	14,020,000	
ネクシィーズグループ	4,100	728.00	2,984,800	
H. U. グループホールディングス	51,900	2,623.50	136,159,650	
アルプス技研	16,900	2,554.00	43,162,600	
日本空調サービス	19,400	779.00	15,112,600	
オリエンタルランド	936,700	5,114.00	4,790,283,800	
ダスキン	39,500	3,234.00	127,743,000	
明光ネットワークジャパン	21,900	668.00	14,629,200	
ファルコホールディングス	8,200	2,042.00	16,744,400	
ラウンドワン	148,500	580.00	86,130,000	
リゾートトラスト	70,000	2,296.00	160,720,000	
ビー・エム・エル	21,900	2,828.00	61,933,200	
リソー教育	81,600	251.00	20,481,600	
早稲田アカデミー	10,000	1,377.00	13,770,000	
ユー・エス・エス	182,100	2,547.50	463,899,750	
東京個別指導学院	21,600	486.00	10,497,600	
サイバーエージェント	391,300	901.00	352,561,300	
楽天グループ	1,515,000	551.20	835,068,000	
クリーク・アンド・リバー社	10,500	2,149.00	22,564,500	
S B I グローバルアセットマネジメント	29,400	540.00	15,876,000	
テー・オー・ダブリュー	35,700	305.00	10,888,500	
山田コンサルティンググループ	9,200	1,551.00	14,269,200	
セントラルスポーツ	6,800	2,421.00	16,462,800	
フルキャストホールディングス	17,000	2,038.00	34,646,000	
エン・ジャパン	32,100	2,583.00	82,914,300	
リソルホールディングス	1,100	4,790.00	5,269,000	
テクノプロ・ホールディングス	104,800	3,529.00	369,839,200	
アトラグループ	3,400	270.00	918,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,400	2,287.00	21,497,800	
K e e P e r 技研	11,000	6,750.00	74,250,000	
ファーストロジック	3,800	567.00	2,154,600	
三機サービス	2,100	1,069.00	2,244,900	
G u n o s y	14,600	605.00	8,833,000	

デザインワン・ジャパン	4,700	165.00	775,500	
イー・ガーディアン	6,800	2,624.00	17,843,200	
リブセンス	6,600	324.00	2,138,400	
ジャパンマテリアル	54,300	2,568.00	139,442,400	
ベクトル	28,000	1,284.00	35,952,000	
ウチヤマホールディングス	5,900	352.00	2,076,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,000	1,169.00	17,535,000	
キャリアリンク	6,600	2,377.00	15,688,200	
I B J	14,000	620.00	8,680,000	
アサンテ	8,900	1,622.00	14,435,800	
バリューHR	15,700	1,245.00	19,546,500	
M&Aキャピタルパートナーズ	14,400	2,732.00	39,340,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,013.00	6,685,800	
ERIホールディングス	3,200	2,162.00	6,918,400	
アビスト	1,900	3,460.00	6,574,000	
シグマクシス・ホールディングス	27,100	1,572.00	42,601,200	
ウィルグループ	15,000	1,094.00	16,410,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,600	140.00	2,044,000	
メドピア	15,900	1,015.00	16,138,500	
レアジョブ	2,600	1,082.00	2,813,200	
リクルートホールディングス	1,310,300	4,984.00	6,530,535,200	
エラン	23,800	819.00	19,492,200	
土木管理総合試験所	6,400	336.00	2,150,400	
日本郵政	2,129,800	1,112.50	2,369,402,500	
ベルシステム24ホールディングス	24,000	1,540.00	36,960,000	
鎌倉新書	20,500	650.00	13,325,000	
SMN	3,500	391.00	1,368,500	
グローバルキッズCOMPANY	2,600	641.00	1,666,600	
エアトリ	13,100	2,345.00	30,719,500	
アトラエ	10,800	1,046.00	11,296,800	
ストライク	7,600	3,040.00	23,104,000	
ソラスト	49,200	657.00	32,324,400	
セラク	5,600	1,299.00	7,274,400	
インソース	38,700	1,105.00	42,763,500	
ベイカレント・コンサルティング	140,100	4,914.00	688,451,400	
Orchestra Holdings	4,100	1,070.00	4,387,000	

アイモバイル	8,100	1,232.00	9,979,200
キャリアインデックス	5,100	263.00	1,341,300
MS-Japan	4,100	1,155.00	4,735,500
船場	2,800	819.00	2,293,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	63,300	2,337.00	147,932,100
フルテック	1,900	1,126.00	2,139,400
GameWith	4,500	335.00	1,507,500
MS&Consulting	1,800	663.00	1,193,400
ウェルビー	13,600	558.00	7,588,800
エル・ティー・エス	2,400	3,475.00	8,340,000
ミダックホールディングス	10,900	1,688.00	18,399,200
日総工産	13,600	834.00	11,342,400
キュービーネットホールディングス	8,600	1,574.00	13,536,400
RPAホールディングス	24,800	363.00	9,002,400
スプリックス	3,800	804.00	3,055,200
マネジメントソリューションズ	9,800	3,740.00	36,652,000
プロレド・パートナーズ	4,900	502.00	2,459,800
テノ.ホールディングス	1,900	613.00	1,164,700
フロンティア・マネジメント	6,100	1,290.00	7,869,000
ピアラ	2,900	432.00	1,252,800
コプロ・ホールディングス	2,100	2,486.00	5,220,600
ギークス	2,000	727.00	1,454,000
アンビスホールディングス	19,000	2,912.00	55,328,000
カーブスホールディングス	48,700	714.00	34,771,800
フォーラムエンジニアリング	10,600	1,251.00	13,260,600
Fast Fitness Japan	6,200	1,471.00	9,120,200
ダイレクトマーケティングミックス	21,500	534.00	11,481,000
ポピンズ	2,800	1,257.00	3,519,600
LITALICO	13,900	2,151.00	29,898,900
コンフィデンス・インターワークス	900	1,631.00	1,467,900
アドバンテッジリスクマネジメント	5,900	460.00	2,714,000
リログループ	98,700	1,690.00	166,803,000
東祥	12,500	1,205.00	15,062,500
ID&Eホールディングス	10,800	3,410.00	36,828,000
ビーウィズ	4,600	2,464.00	11,334,400

TREホールディングス	37,500	1,146.00	42,975,000	
人・夢・技術グループ	6,800	1,709.00	11,621,200	
大栄環境	45,100	2,234.00	100,753,400	
日本管財ホールディングス	18,700	2,660.00	49,742,000	
エイチ・アイ・エス	51,600	1,969.00	101,600,400	
ラックランド	8,100	2,979.00	24,129,900	
共立メンテナンス	30,400	6,103.00	185,531,200	
イチネンホールディングス	19,000	1,339.00	25,441,000	
建設技術研究所	9,200	4,400.00	40,480,000	
スペース	13,100	908.00	11,894,800	
燦ホールディングス	7,700	2,168.00	16,693,600	
スバル興業	800	10,800.00	8,640,000	
東京テアトル	4,300	1,129.00	4,854,700	
タナベコンサルティンググループ	4,900	1,155.00	5,659,500	
ナガワ	4,800	7,000.00	33,600,000	
東京都競馬	14,900	3,915.00	58,333,500	
カナモト	27,600	2,475.00	68,310,000	
ニシオホールディングス	16,500	3,560.00	58,740,000	
トランス・コスモス	22,100	3,195.00	70,609,500	
乃村工藝社	77,500	848.00	65,720,000	
藤田観光	7,800	4,750.00	37,050,000	
KNT-CTホールディングス	10,600	1,503.00	15,931,800	
トーカイ	15,800	1,886.00	29,798,800	
セコム	180,300	10,240.00	1,846,272,000	
セントラル警備保障	9,600	2,933.00	28,156,800	
丹青社	34,700	770.00	26,719,000	
メイテック	69,200	2,544.00	176,044,800	
応用地質	16,600	2,765.00	45,899,000	
船井総研ホールディングス	36,900	2,660.00	98,154,000	
進学会ホールディングス	4,900	291.00	1,425,900	
オオバ	7,700	885.00	6,814,500	
いであ	3,300	1,660.00	5,478,000	
学究社	7,200	1,969.00	14,176,800	
ベネッセホールディングス	66,200	1,852.50	122,635,500	
イオンディライト	19,700	3,200.00	63,040,000	
ナック	8,100	975.00	7,897,500	

ダイセキ	36,200	4,360.00	157,832,000	
ステップ	6,600	1,780.00	11,748,000	
合 計	254,326,100		563,150,268,210	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	800,925,411
コール・ローン	1,359,861,791
国債証券	282,874,711,571
派生商品評価勘定	13,009,991
未収入金	8,261,142
未収利息	1,815,281,222
前払金	6,204,083
前払費用	104,179,874
差入委託証拠金	119,353,795
流動資産合計	287,101,788,880
資産合計	287,101,788,880
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,762,907
未払金	116,066
未払解約金	102,661,123
未払利息	3,150
流動負債合計	110,543,246
負債合計	110,543,246
純資産の部	
元本等	
元本	86,879,656,566
剰余金	

剰余金又は欠損金（△）	200,111,589,068
元本等合計	286,991,245,634
純資産合計	286,991,245,634
負債純資産合計	287,101,788,880

## 注記表

### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年8月28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相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

### （貸借対照表に関する注記）

	2023年8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	86,879,656,566 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.3033 円 (1万口当たり純資産額) (33,033 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

	2023年8月28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



<p>2. 金融商品の内容及びそのリスク</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p> <p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>
---	--

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

### (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

### (その他の注記)

#### 元本の移動

区分	2023年 8月 28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月 30日
期首元本額	101,070,365,995円
期中追加設定元本額	15,582,009,240円
期中一部解約元本額	29,772,718,669円
期末元本額	86,879,656,566円

期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,178,080,539 円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	535,563,095 円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	368,681,116 円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,476,263,229 円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,301,974 円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,824,575,997 円
世界経済インデックスファンド	17,915,123,341 円
DCマイセレクション25	2,006,619,815 円
DCマイセレクション50	1,782,261,047 円
DCマイセレクション75	1,350,654,438 円
DC外国債券インデックス・オープン	2,265,502,586 円
DCマイセレクションS25	1,057,596,457 円
DCマイセレクションS50	956,833,359 円
DCマイセレクションS75	515,955,716 円
DCターゲット・イヤーフンド2025	16,221,569 円
DCターゲット・イヤーフンド2035	97,975,454 円
DCターゲット・イヤーフンド2045	52,818,293 円
DC世界経済インデックスファンド	13,522,070,493 円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	397,683,437 円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	918,807 円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,033,203 円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	18,962,955 円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	30,441,408 円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	54,159,658 円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	58,893,873 円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	56,884,660 円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	935,794,701 円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	393,286,244 円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,609,226,149 円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	56,615,690 円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	33,833,114 円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	378,442,202 円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	142,301,660 円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	189,717,521 円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	664,839,829 円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,946,272,757 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	635,702,212 円
外国債券ファンド・シリーズ1	736,801,779 円
分散投資コア戦略ファンドA	276,386,697 円
分散投資コア戦略ファンドS	604,847,674 円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	668,506,885 円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,322,495,054 円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	239,808,874 円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,081,780 円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,324,301,258 円
SMT インデックスバランス・オープン	179,904,328 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	350,442,392 円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	459,699,643 円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	735,654,813 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,351,787 円
グローバル経済コア	775,346,595 円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	20,784,359 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,270,742 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	50,638,400 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	67,652,859 円

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	32,414,941 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	37,210,233 円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	273,940,083 円
10資産分散投資ファンド	26,157,930 円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	12,163,354,620 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	189,009,292 円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	514,216,666 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	121,934,451 円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	58,333,833 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		△2,639,383,347
合計		△2,639,383,347

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	1,179,504,862	—		1,173,300,779	△6,204,083
合計		1,179,504,862	—		1,173,300,779	△6,204,083

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年8月28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	1,266,538,122	—		1,277,989,289	11,451,167
	アメリカドル	649,879,212	—		659,054,869	9,175,657
	カナダドル	51,353,032	—		51,595,824	242,792
	ユーロ	411,358,072	—		412,296,741	938,669
	イギリスポンド	67,721,046	—		68,095,022	373,976
	オフショア人民	86,226,760	—		86,946,833	720,073

	元			
合計		1,266,538,122	-	1,277,989,289
				11,451,167

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	3,900,000.00	3,582,210.91	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,479,968.75	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,745,406.22	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,722,382.82	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,254,343.76	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,186,250.00	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,390,312.48	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,680,585.91	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,764,481.35	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,264,647.66	
		T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,358,248.41	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,711,132.82	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,607,343.76	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,042,792.98	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,705,575.00	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,536,668.75	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,010,683.58	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	5,971,734.35	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,973,742.21	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,359,472.67			

T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,521,484.37	
T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,141,011.69	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,113,124.96	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,313,531.25	
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,817,070.32	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,125,390.62	
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,140,874.97	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,229,648.48	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,417,578.14	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,546,289.11	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,587,968.76	
T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,628,771.47	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,274,153.93	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,192,812.48	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,352,421.86	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,825,050.83	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,424,671.89	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,279,140.63	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	7,997,304.73	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,908,437.52	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,043,701.16	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,145,593.77	
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,313,262.12	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,351,100.00	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,919,375.04	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,853,697.27	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,178,750.00	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,751,953.08	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,371,380.83	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,127,509.73	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,283,867.17	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,391,098.06	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,786,718.76	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	3,032,912.08	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,025,206.23	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,083,164.87	

T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,775,078.14	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,195,912.09	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,408,906.28	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,434,673.64	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,834,960.90	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,153,359.37	
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,389,562.54	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,477,685.57	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,181,312.52	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,088,932.04	
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,938,418.74	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,789,179.68	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,549,421.86	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,930,304.72	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,345,132.04	
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,230,312.50	
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,992,128.90	
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,101,871.09	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,583,515.64	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,741,792.21	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,408,414.10	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,011,304.70	
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,646,406.24	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,788,180.44	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,792,861.04	
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,997,595.69	
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,937,968.75	
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,567,500.00	
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,020,648.03	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,356,367.19	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,658,271.12	
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,828,906.25	
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,128,980.44	
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,860,003.91	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,039,160.17	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,696,369.54	

T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	6,904,951.19	
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,112,605.47	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,685,859.37	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,076,546.87	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,777,701.14	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,151,640.63	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	6,983,015.62	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,186,320.32	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,036,591.79	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,404,832.01	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,444,253.91	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,805,943.75	
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,395,383.62	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,583,705.09	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,856,672.10	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,824,675.77	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,809,570.30	
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,032,694.73	
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,755,003.89	
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,611,320.34	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,037,203.12	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,450,461.90	
T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	3,049,315.62	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,964,814.43	
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,238,093.74	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,529,795.71	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,090,476.56	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,218,505.83	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,273,339.83	
T 2.75% 08/15/32	13,800,000.00	12,250,195.27	
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	6,744,199.19	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,023,261.73	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,598,664.02	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,655,858.60	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,275,109.37	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,852,968.76	

T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,045,281.25	
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,381,342.93	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,078,558.61	
T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	2,160,791.02	
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,649,181.25	
T 2.875% 05/15/52	7,600,000.00	5,819,195.28	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,674,660.91	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,241,173.46	
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,646,212.50	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,773,695.32	
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	1,916,601.55	
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,074,012.50	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,733,950.18	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,254,589.86	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,911,462.87	
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	2,964,035.14	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,281,875.00	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	869,900.38	
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,638,515.62	
T 3.125% 05/15/48	5,580,000.00	4,466,833.57	
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,834,632.83	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,492,556.25	
T 3.125% 08/31/27	1,850,000.00	1,753,236.32	
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,667,933.55	
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,891,078.10	
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,496,618.14	
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,820,351.57	
T 3.375% 05/15/33	7,800,000.00	7,264,968.75	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,545,331.25	
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,969,644.53	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,440,406.25	
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,648,437.50	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	699,256.25	
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,111,625.00	
T 3.625% 02/15/53	8,350,000.00	7,422,367.18	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,764,843.76	



T 3.75% 04/15/26	2,800,000.00	2,726,882.81	
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,692,382.82	
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,350,957.01	
T 3.875% 02/15/43	1,900,000.00	1,745,625.00	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,358,950.19	
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,438,639.85	
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	7,894,515.85	
T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,253,624.99	
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	781,953.12	
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	782,773.44	
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,982,203.12	
T 3% 05/15/45	700,000.00	552,835.93	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,513,705.86	
T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,643,406.25	
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,540,839.86	
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,088,296.88	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,033,886.72	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,797,363.30	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,219,109.36	
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,050,351.57	
T 4.125% 11/15/32	7,550,000.00	7,465,062.50	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	891,808.59	
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,796,769.51	
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	727,382.42	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,011,953.12	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,899,480.46	
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	646,419.92	
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	961,874.99	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,126,106.25	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	562,847.65	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,730,746.09	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,423,771.87	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	782,475.58	
T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,371,015.62	
T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,063,406.25	
T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,404,416.03	

	T 4% 11/15/52	7,800,000.00	7,426,757.83	
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	432,437.50	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,346,972.65	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,082,234.37	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,742,832.02	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,538,416.01	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,163,408.20	
	アメリカドル 小計	1,076,150,000.00	938,869,018.03 (137,591,254,592)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,050,244.74	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,767,711.91	
	CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,513,951.22	
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	668,426.54	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,364,168.34	
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,696,134.54	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,980,000.00	3,376,401.35	
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,383,506.14	
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	842,212.07	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,366,795.65	
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,157,741.61	
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,045,189.39	
	CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	1,951,650.26	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	723,111.25	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,385,676.89	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,225,798.05	
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	220,517.14	
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,081,573.96	
	CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	295,322.24	
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	821,688.37	
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,516,329.48	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	911,415.66	
	CAN 2.75% 12/01/55	460,000.00	392,312.05	
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	517,628.31	
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	375,520.13	
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,323,565.62	
	CAN 2% 12/01/51	3,450,000.00	2,514,766.44	

		CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,131,366.80	
		CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,034,796.01	
		CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	1,994,410.30	
		CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,290,212.94	
		CAN 3% 10/01/25	510,000.00	492,664.13	
		CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,108,009.01	
		CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	774,250.36	
		CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,633,143.89	
		CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,885,800.22	
		CAN 5% 06/01/37	630,000.00	717,174.78	
		カナダドル 小計	58,410,000.00	52,551,187.79 (5,663,441,508)	
メキシコペソ		MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,031,023.00	
		MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,244,119.61	
		MBONO 5.5% 03/04/27	20,900,000.00	18,300,040.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	41,080,571.33	
		MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,183,071.40	
		MBONO 7.5% 05/26/33	18,500,000.00	16,457,322.50	
		MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,453,342.30	
		MBONO 7.75% 05/29/31	40,630,000.00	37,233,332.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	24,624,197.85	
		MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,951,990.50	
		MBONO 8.5% 05/31/29	32,400,000.00	31,266,324.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	14,670,000.00	13,707,061.20	
		MBONO 8% 07/31/53	14,950,000.00	13,000,893.75	
		MBONO 8% 09/05/24	22,160,000.00	21,495,997.53	
		MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	21,549,846.00	
		メキシコペソ 小計	359,700,000.00	331,579,132.97 (2,907,252,679)	
ユーロ		BGB 0.1% 06/22/30	1,040,000.00	857,396.80	
		BGB 0.35% 06/22/32	1,570,000.00	1,237,459.87	
		BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	310,982.70	
		BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,375,262.90	
		BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	169,781.48	
		BGB 0.8% 06/22/25	1,900,000.00	1,820,580.00	
		BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,393,449.14	

BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,449,948.80	
BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,455,793.75	
BGB 0% 10/22/27	780,000.00	691,218.84	
BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,304,433.24	
BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	738,039.27	
BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	638,042.47	
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	629,760.00	
BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	745,833.96	
BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	750,053.12	
BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	534,105.65	
BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,381,412.87	
BGB 1% 06/22/31	1,270,000.00	1,091,413.87	
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	624,796.48	
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	501,861.49	
BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	365,665.20	
BGB 3.3% 06/22/54	690,000.00	647,316.60	
BGB 3.45% 06/22/43	360,000.00	353,916.00	
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	961,020.98	
BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,101,256.60	
BGB 3% 06/22/34	950,000.00	927,494.50	
BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,034,852.00	
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,179,091.74	
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,152,709.92	
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,262,237.60	
BGB 5% 03/28/35	1,730,000.00	2,007,981.59	
BKO 0.4% 09/13/24	1,820,000.00	1,765,970.75	
BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,371,699.67	
BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,613,801.06	
BKO 2.8% 06/12/25	800,000.00	795,803.20	
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,440,631.92	
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	553,699.83	
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,733,782.32	
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,772,999.52	
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,115,337.60	
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,443,722.80	
BTPS 0.85% 01/15/27	1,270,000.00	1,159,281.40	

	BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,342,023.96	
	BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	672,129.00	
	BTPS 0.95% 06/01/32	1,550,000.00	1,201,902.55	
	BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,834,765.95	
	BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,340,648.36	
	BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,687,306.54	
	BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,040,951.36	
	BTPS 0% 08/01/26	1,280,000.00	1,152,480.00	
	BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,448,698.50	
	BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	715,598.25	
	BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,335,353.75	
	BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,809,588.30	
	BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,582,490.00	
	BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	856,473.50	
	BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,218,301.70	
	BTPS 1.45% 11/15/24	1,970,000.00	1,918,431.31	
	BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	746,047.50	
	BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,322,514.59	
	BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,023,345.36	
	BTPS 1.65% 03/01/32	1,910,000.00	1,590,659.46	
	BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,176,523.46	
	BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	963,317.04	
	BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	449,535.24	
	BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,614,680.00	
	BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,582,773.32	
	BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,380,928.32	
	BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	332,419.57	
	BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	639,400.26	
	BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,167,295.04	
	BTPS 2.25% 09/01/36	2,050,000.00	1,630,057.50	
	BTPS 2.45% 09/01/33	2,200,000.00	1,899,046.60	
	BTPS 2.45% 09/01/50	1,010,000.00	692,851.92	
	BTPS 2.5% 11/15/25	2,200,000.00	2,150,062.20	
	BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,909,579.10	
	BTPS 2.5% 12/01/32	3,050,000.00	2,683,737.70	
	BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,689,578.88	

BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	829,053.45	
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	565,921.78	
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,474,619.30	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,358,153.32	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	992,793.00	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,107,111.00	
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,109,054.90	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,195,603.08	
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	838,850.88	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,870,711.54	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	1,024,363.20	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,540,655.48	
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	907,568.15	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,316,840.32	
BTPS 3.7% 06/15/30	300,000.00	296,226.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,150,838.50	
BTPS 3.8% 04/15/26	1,350,000.00	1,355,123.25	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,320,199.65	
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,857,712.00	
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,079,508.83	
BTPS 4.35% 11/01/33	470,000.00	476,248.65	
BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	408,689.60	
BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	838,727.54	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,123,513.60	
BTPS 4.5% 10/01/53	650,000.00	636,329.85	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,753,954.53	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,540,554.00	
BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,752,652.55	
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	858,156.12	
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,252,158.75	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,842,716.20	
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,930,482.89	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,571,292.80	
BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,190,302.58	
BTPS 5% 08/01/34	3,080,000.00	3,278,992.64	
BTPS 5% 09/01/40	2,450,000.00	2,601,380.60	

	BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,998,118.61	
	BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,299,098.40	
	BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,550,346.00	
	DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,785,987.28	
	DBR 0.25% 02/15/29	3,030,000.00	2,683,046.82	
	DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,351,798.60	
	DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,964,463.04	
	DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,832,330.99	
	DBR 0.5% 02/15/28	2,860,000.00	2,612,898.86	
	DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	322,447.65	
	DBR 0% 02/15/30	1,470,000.00	1,253,239.68	
	DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	941,110.33	
	DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,972,582.46	
	DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,759,191.28	
	DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,599,855.52	
	DBR 0% 08/15/26	1,050,000.00	968,828.70	
	DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,544,198.00	
	DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,980,659.90	
	DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,249,048.96	
	DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,739,857.40	
	DBR 0% 08/15/50	4,380,000.00	2,197,297.08	
	DBR 0% 08/15/52	2,200,000.00	1,048,742.20	
	DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,171,824.16	
	DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,745,896.65	
	DBR 1.25% 08/15/48	3,230,000.00	2,429,857.94	
	DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,958,414.12	
	DBR 1.8% 08/15/53	2,380,000.00	1,963,557.12	
	DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,520,889.07	
	DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,957,028.00	
	DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,337,003.90	
	DBR 2.1% 11/15/29	3,160,000.00	3,079,688.60	
	DBR 2.3% 02/15/33	3,130,000.00	3,069,434.50	
	DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,701,854.20	
	DBR 2.5% 08/15/46	3,040,000.00	2,962,540.80	
	DBR 2.6% 08/15/33	150,000.00	150,526.20	
	DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,975,104.36	

	DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,800,941.14	
	DBR 4.25% 07/04/39	1,900,000.00	2,275,031.50	
	DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,571,809.81	
	DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,561,853.24	
	DBR 4.75% 07/04/40	1,770,000.00	2,256,397.77	
	DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,716,404.00	
	DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,652,241.16	
	DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,521,876.25	
	DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,138,780.12	
	FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,287,961.08	
	FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,427,850.47	
	FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,203,261.00	
	FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,451,359.90	
	FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,706,025.76	
	FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	353,618.10	
	FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	849,721.93	
	FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,272,342.30	
	FRTR 0.75% 05/25/28	5,490,000.00	4,965,622.65	
	FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,514,667.42	
	FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,587,258.52	
	FRTR 0.75% 11/25/28	5,440,000.00	4,873,418.56	
	FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,134,699.45	
	FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,727,999.26	
	FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,115,244.96	
	FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,555,769.00	
	FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,530,995.60	
	FRTR 0% 11/25/29	3,580,000.00	2,991,231.39	
	FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,266,374.73	
	FRTR 0% 11/25/31	5,500,000.00	4,316,180.00	
	FRTR 1.25% 05/25/34	4,330,000.00	3,584,993.19	
	FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,523,007.15	
	FRTR 1.25% 05/25/38	1,100,000.00	832,677.42	
	FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,662,207.77	
	FRTR 1.5% 05/25/50	2,870,000.00	1,902,281.92	
	FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	944,547.84	
	FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,364,843.76	



FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,079,249.20	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,329,791.70	
FRTR 1% 11/25/25	4,280,000.00	4,086,013.28	
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,429,848.87	
FRTR 2.5% 05/25/43	520,000.00	449,553.00	
FRTR 2.5% 09/24/26	900,000.00	885,479.40	
FRTR 2.75% 02/25/29	500,000.00	494,935.50	
FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,304,518.84	
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,172,761.76	
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,658,536.56	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	2,985,298.50	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,781,273.20	
FRTR 3% 05/25/33	1,880,000.00	1,866,225.24	
FRTR 3% 05/25/54	1,210,000.00	1,092,229.36	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,938,961.68	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,799,338.80	
FRTR 4% 04/25/55	1,940,000.00	2,118,654.60	
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,959,641.69	
FRTR 4% 10/25/38	2,750,000.00	2,964,238.75	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,695,144.67	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,357,918.95	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,011,516.70	
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	605,460.24	
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	643,698.12	
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	373,517.77	
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	450,405.70	
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	227,005.56	
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	703,762.44	
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	673,242.50	
IRISH 1.1% 05/15/29	1,060,000.00	960,505.22	
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	369,179.79	
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	421,416.10	
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	538,228.80	
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	478,838.14	
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	950,047.00	
IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	766,954.12	

IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	772,496.76	
IRISH 3% 10/18/43	470,000.00	449,114.14	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,198,975.65	
NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,812,682.06	
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	820,102.70	
NETHER 0.5% 01/15/40	1,380,000.00	941,988.55	
NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,326,268.64	
NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	835,609.31	
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	831,756.60	
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,541,745.30	
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,109,160.44	
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,671,754.08	
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,386,139.16	
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	627,018.24	
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	788,585.40	
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,116,680.85	
NETHER 0% 07/15/31	1,570,000.00	1,263,763.08	
NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	392,116.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,507,758.77	
NETHER 2.5% 07/15/33	740,000.00	718,593.28	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,788,434.92	
NETHER 2% 01/15/54	720,000.00	589,917.60	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,881,576.49	
NETHER 4% 01/15/37	1,760,000.00	1,956,356.16	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,693,277.01	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,852,383.05	
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,189,416.25	
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,317,236.00	
OBL 0% 10/09/26	3,650,000.00	3,352,550.55	
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,758,276.00	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,322,396.17	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,368,364.25	
OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,358,763.20	
OBL 2.4% 10/19/28	670,000.00	663,937.84	
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	490,186.80	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,234,008.03	

	RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	997,257.35	
	RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	117,274.99	
	RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	798,531.36	
	RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	407,862.84	
	RAGB 0.75% 10/20/26	1,410,000.00	1,317,399.66	
	RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	90,028.21	
	RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,029,626.85	
	RAGB 0% 02/20/30	1,280,000.00	1,053,616.64	
	RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,331,491.00	
	RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	977,766.64	
	RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	626,061.87	
	RAGB 0% 10/20/40	470,000.00	269,138.45	
	RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,144,089.80	
	RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	765,744.84	
	RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	150,929.71	
	RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	970,134.66	
	RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	347,131.64	
	RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	450,138.65	
	RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	679,409.54	
	RAGB 2.9% 02/20/33	640,000.00	626,434.33	
	RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	218,964.68	
	RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	684,610.50	
	RAGB 3.15% 10/20/53	270,000.00	261,975.60	
	RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	465,066.42	
	RAGB 4.15% 03/15/37	1,570,000.00	1,710,551.11	
	RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,115,701.84	
	RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,318,594.54	
	RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	298,696.42	
	RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	201,753.24	
	RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	293,803.86	
	RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	181,408.20	
	RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	581,589.76	
	RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	293,865.22	
	RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	490,060.26	
	RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	646,623.78	
	RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	457,896.15	

	RFGB 0.75% 04/15/31	570,000.00	482,901.15	
	RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	420,662.44	
	RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	405,370.98	
	RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	274,024.32	
	RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	518,759.04	
	RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	302,860.17	
	RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	331,041.20	
	RFGB 1.375% 04/15/47	510,000.00	356,979.30	
	RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	499,864.92	
	RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	473,607.94	
	RFGB 2.75% 04/15/38	290,000.00	271,337.51	
	RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	545,012.05	
	RFGB 3% 09/15/33	460,000.00	455,186.56	
	RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	587,983.70	
	SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,718,781.04	
	SPGB 0.5% 04/30/30	2,750,000.00	2,292,166.25	
	SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,042,183.68	
	SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,038,973.96	
	SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,753,488.00	
	SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,223,752.56	
	SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,383,515.75	
	SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	997,553.76	
	SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,172,163.98	
	SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,457,645.54	
	SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,606,169.81	
	SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,109,483.00	
	SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,885,548.78	
	SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,394,947.38	
	SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,726,097.06	
	SPGB 1.3% 10/31/26	2,650,000.00	2,495,772.65	
	SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	1,999,257.89	
	SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,880,251.80	
	SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,439,133.29	
	SPGB 1.45% 10/31/27	2,210,000.00	2,057,293.42	
	SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	301,193.64	
	SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,410,627.00	

		SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,408,406.75	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,180,000.00	1,801,181.40	
		SPGB 1.9% 10/31/52	1,380,000.00	872,614.02	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,222,142.70	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,848,791.30	
		SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	542,736.24	
		SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	956,199.96	
		SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,533,565.01	
		SPGB 2.35% 07/30/33	1,440,000.00	1,300,052.16	
		SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,836,566.82	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,353,818.03	
		SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,338,072.07	
		SPGB 2.8% 05/31/26	1,000,000.00	985,959.40	
		SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,635,169.20	
		SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,647,150.40	
		SPGB 3.45% 07/30/43	730,000.00	672,013.91	
		SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,195,149.00	
		SPGB 3.55% 10/31/33	1,240,000.00	1,236,399.83	
		SPGB 3.9% 07/30/39	1,030,000.00	1,025,894.88	
		SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,036,550.55	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,907,492.60	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,062,078.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,932,627.98	
		SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,417,293.40	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,651,613.36	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,361,426.64	
		SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,206,239.60	
		SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,032,340.40	
		ユーロ 小計	649,440,000.00	590,885,868.44 (93,519,506,397)	
	イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,128,039.19	
		UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,242,334.38	
		UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,768,044.00	
		UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	1,965,292.00	
		UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,249,631.00	
		UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,624,575.26	

UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,756,665.80	
UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	509,465.73	
UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,297,423.12	
UKT 0.625% 07/31/35	1,700,000.00	1,094,460.00	
UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	415,546.91	
UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	773,495.98	
UKT 0.875% 07/31/33	1,630,000.00	1,166,679.02	
UKT 0.875% 10/22/29	1,810,000.00	1,466,889.88	
UKT 1.125% 01/31/39	1,950,000.00	1,200,421.28	
UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	378,480.27	
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	836,210.90	
UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,151,482.46	
UKT 1.25% 10/22/41	1,960,000.00	1,150,778.72	
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,461,008.00	
UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	930,418.50	
UKT 1.5% 07/31/53	970,000.00	484,806.00	
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	929,230.37	
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	688,247.22	
UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	545,347.38	
UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	342,987.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	818,314.84	
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,335,266.10	
UKT 1% 01/31/32	3,940,000.00	3,001,638.56	
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	899,428.00	
UKT 2.75% 09/07/24	1,440,000.00	1,405,251.64	
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,240,270.20	
UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,550,348.52	
UKT 3.25% 01/31/33	2,030,000.00	1,844,563.56	
UKT 3.5% 01/22/45	1,970,000.00	1,651,364.32	
UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,253,972.08	
UKT 3.5% 10/22/25	690,000.00	665,288.34	
UKT 3.75% 01/29/38	1,410,000.00	1,275,739.80	
UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,134,833.56	
UKT 3.75% 10/22/53	1,620,000.00	1,385,262.00	
UKT 4.125% 01/29/27	2,800,000.00	2,728,270.71	
UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,837,458.00	

	UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,488,225.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,211,459.09	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,180,000.00	2,143,485.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,378,003.44	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,590,000.00	1,489,178.10	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,508,425.10	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,780,000.00	1,679,647.87	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,391,221.53	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,759,122.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,492,288.19	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,417,555.44	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,133,856.25	
	UKT 4% 10/22/63	560,000.00	507,471.13	
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,178,013.35	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,437,770.25	
	イギリスポンド 小計	94,680,000.00	75,800,952.34 (13,988,307,744)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,643,117.05	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,823,475.20	
	SGB 0.75% 11/12/29	5,260,000.00	4,643,597.37	
	SGB 1.75% 11/11/33	2,700,000.00	2,454,360.15	
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,461,059.87	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,277,517.83	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,605,091.47	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,200,000.00	4,504,542.00	
	スウェーデンクローナ 小計	44,280,000.00	41,412,760.94 (549,961,465)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	3,016,514.40	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,408,324.44	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,832,837.16	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,911,925.15	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,025,145.45	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,762,355.00	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	2,927,426.88	
	NGB 2% 04/26/28	2,630,000.00	2,410,695.86	
	NGB 3% 08/15/33	3,310,000.00	3,079,955.00	

	ノルウェークローネ 小計	37,010,000.00	33,375,179.34 (457,907,460)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,574,046.11	
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,236,588.66	
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,330,250.76	
	DGB 0% 11/15/24	3,950,000.00	3,799,633.78	
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,239,231.92	
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,375,056.53	
	DGB 2.25% 11/15/33	930,000.00	885,794.49	
	DGB 4.5% 11/15/39	10,510,000.00	12,690,730.41	
	デンマーククローネ 小計	46,610,000.00	43,131,332.66 (916,109,505)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,933,796.12	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,306,528.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,128,373.75	
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,790,000.00	2,060,833.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,789,125.22	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,533,676.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,760,000.00	4,287,570.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,874,630.10	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,172,630.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,880,319.35	
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,327,538.84	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	608,610.00	
	POLGB 6% 10/25/33	2,100,000.00	2,163,525.00	
	POLGB 7.5% 07/25/28	910,000.00	987,531.90	
	ポーランドズロチ 小計	44,550,000.00	40,054,687.78 (1,418,881,238)	
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,674,009.94	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,938,721.44	
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,093,895.05	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,929,922.97	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	1,989,066.69	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,710,000.00	962,908.65	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,488,519.28	
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,182,330.13	



	ACGB 1% 12/21/30	2,020,000.00	1,633,325.90	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,376,396.13	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,133,677.62	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,180,000.00	932,649.82	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,036,714.21	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,846,659.33	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,569,907.41	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,362,415.35	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,047,254.59	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,622,165.41	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	972,932.67	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,359,721.30	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,092,710.14	
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,490,000.00	1,435,929.91	
	ACGB 3% 03/21/47	1,450,000.00	1,132,345.70	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,663,678.37	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,500,000.00	1,514,658.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,690,000.00	2,765,994.38	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,389,829.91	
	オーストラリアドル 小計	49,300,000.00	44,148,340.30 (4,154,800,305)	
ニュージー ランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	521,739.02	
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	591,253.26	
	NZGB 1.5% 05/15/31	790,000.00	614,507.88	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	277,441.93	
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	813,395.54	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	483,077.10	
	NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	334,043.32	
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	418,067.43	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,160,000.00	1,026,655.58	
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	586,971.19	
	NZGB 4.25% 05/15/34	320,000.00	298,872.37	
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	823,518.32	
	NZGB 4.5% 05/15/30	370,000.00	359,433.29	
	ニュージーランドドル 小計	8,440,000.00	7,148,976.23 (619,673,259)	

シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	590,000.00	552,535.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	757,269.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	496,440.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	605,220.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	249,908.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	607,446.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	580,775.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	880,816.50	
	SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	421,554.75	
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	701,640.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	230,000.00	218,385.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	604,160.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	594,735.75	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	636,675.00	
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	413,910.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	614,565.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	836,328.75	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	743,626.00	
	SIGB 3% 08/01/72	220,000.00	218,790.00	
	SIGB 3% 09/01/24	900,000.00	893,795.44	
シンガポールドル 小計		12,310,000.00	11,628,575.99 (1,257,281,636)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,514,500.28	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,502,613.12	
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	694,351.40	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,934,504.28	
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,249,825.90	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,741,496.25	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,872,459.18	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,381,268.66	
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,172,828.02	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,141,017.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,993,101.79	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,497,494.55	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	607,094.16	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,705,379.00	

	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,288,623.10	
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,928,063.02	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,550,964.91	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,781,739.92	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,910,000.00	1,951,693.39	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,100,000.00	1,146,558.37	
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	362,452.65	
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	926,835.18	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,450,000.00	1,547,807.72	
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,040,406.80	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,439,145.14	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,011,113.00	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,820,948.97	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,120,359.11	
	マレーシアリングット 小計	46,280,000.00	46,924,645.37 (1,481,584,675)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,946,782.82	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,037,589.16	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,271,185.00	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,210,000.00	981,885.96	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,296,600.22	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,180,596.31	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,220,000.00	1,854,899.67	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,512,442.34	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	500,000.00	378,080.50	
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,497,489.28	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,488,484.78	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,198,296.78	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,428,518.92	
	イスラエルシェケル 小計	23,780,000.00	22,072,851.74 (851,343,269)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000.00	53,782,977.32	
	CGB 2.18% 08/25/25	19,000,000.00	19,017,065.80	
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,263,111.85	
	CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,421,002.89	
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,182,005.81	

	CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,968,357.28	
	CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,328,880.22	
	CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,635,535.05	
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,627,121.40	
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,107,208.00	
	CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,191,527.32	
	CGB 2.6% 09/01/32	21,800,000.00	21,770,227.95	
	CGB 2.62% 04/15/28	15,050,000.00	15,215,712.54	
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,100,996.00	
	CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,625,583.98	
	CGB 2.68% 05/21/30	25,830,000.00	26,045,848.39	
	CGB 2.69% 08/12/26	63,900,000.00	64,796,408.37	
	CGB 2.69% 08/15/32	20,220,000.00	20,366,963.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,655,529.90	
	CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	25,871,715.29	
	CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	10,826,330.62	
	CGB 2.79% 12/15/29	13,000,000.00	13,191,049.30	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,473,091.63	
	CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,328,596.00	
	CGB 2.8% 11/15/32	4,000,000.00	4,058,954.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	30,066,019.70	
	CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,586,126.17	
	CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,737,879.67	
	CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,896,478.40	
	CGB 2% 06/15/25	3,600,000.00	3,592,812.09	
	CGB 3.01% 05/13/28	14,000,000.00	14,407,524.60	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,431,218.87	
	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,230,057.52	
	CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,745,960.72	
	CGB 3.19% 04/15/53	2,600,000.00	2,765,246.90	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,223,037.98	
	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,683,086.11	
	CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,733,499.10	
	CGB 3.39% 03/16/50	16,830,000.00	18,348,124.90	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	8,349,458.61	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,940,000.00	9,171,910.05	

	CGB 3.81% 09/14/50	18,550,000.00	21,698,606.50	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	14,077,060.66	
	CGB 4.08% 10/22/48	9,060,000.00	10,922,497.72	
	オフショア人民元 小計	848,970,000.00	869,518,406.18 (17,497,405,839)	
	合計		282,874,711,571 (282,874,711,571)	

#### 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 207 銘柄	100.0%	48.6%
カナダドル	国債証券 37 銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15 銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 359 銘柄	100.0%	33.1%
イギリスポンド	国債証券 57 銘柄	100.0%	4.9%
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 9 銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8 銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14 銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27 銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20 銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 28 銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 44 銘柄	100.0%	6.2%

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,925,249,442
コール・ローン	215,028,436
株式	559,308,883,315
投資信託受益証券	163,326,854
投資証券	11,411,318,638
派生商品評価勘定	8,696,190
未収入金	2,434,553
未収配当金	822,999,489
前払金	174,119,657
差入委託証拠金	4,670,766,562
流動資産合計	584,702,823,136
資産合計	584,702,823,136
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	182,806,917
未払金	47
未払解約金	178,371,099
未払利息	498
流動負債合計	361,178,561
負債合計	361,178,561
純資産の部	
元本等	
元本	113,397,092,534
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	470,944,552,041
元本等合計	584,341,644,575
純資産合計	584,341,644,575
負債純資産合計	584,702,823,136

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等</p>

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

	2023年8月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		113,397,092,534 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)	5.1531 円 (51,531 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

	2023年8月28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、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

### (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

### (その他の注記)

#### 元本の移動

区分	2023年 8月 28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月 30日
期首元本額	127,813,585,667円
期中追加設定元本額	14,537,707,732円
期中一部解約元本額	28,954,200,865円
期末元本額	113,397,092,534円
期末元本額の内訳	



SBI 資産設計オープン (資産成長型)	1,583,777,049 円
SBI 資産設計オープン (分配型)	5,444,304 円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,040,198,819 円
世界経済インデックスファンド	12,359,279,873 円
外国株式インデックス・オープン	882,859,318 円
DCマイセクション25	651,152,398 円
DCマイセクション50	3,522,393,245 円
DCマイセクション75	4,352,289,363 円
DC外国株式インデックス・オープン	12,561,511,126 円
DCマイセクションS25	412,332,308 円
DCマイセクションS50	1,892,734,322 円
DCマイセクションS75	1,866,741,539 円
DCターゲット・イヤーフンド2025	20,742,675 円
DCターゲット・イヤーフンド2035	137,799,181 円
DCターゲット・イヤーフンド2045	108,051,144 円
DC世界経済インデックスファンド	9,355,979,272 円
外国株式インデックス・オープン (SMA専用)	984,145,822 円
マイセクション50VA1 (適格機関投資家専用)	1,777,533 円
マイセクション75VA1 (適格機関投資家専用)	3,528,471 円
外国株式インデックス・オープンVA1 (適格機関投資家専用)	23,414,892 円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	8,128,323 円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	35,143,695 円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	7,702,248 円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	22,324,805 円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	178,617,411 円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	137,379,058 円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	1,042,091,497 円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	69,652,340 円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	17,797,112 円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	122,081,438 円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	39,823,046 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	824,893,776 円
FOFs用外国株式インデックス・オープン (適格機関投資家専用)	895,513,424 円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,124,963,332 円
コア投資戦略ファンド (安定型)	113,740,322 円
コア投資戦略ファンド (成長型)	283,481,970 円
分散投資コア戦略ファンドA	1,510,074,324 円
分散投資コア戦略ファンドS	7,640,398,474 円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,439,697,159 円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	998,642,227 円
コア投資戦略ファンド (切替型)	133,649,708 円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	512,466,486 円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	24,303,172 円
SMT インデックスバランス・オープン	128,545,358 円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	76,157,099 円
外国株式SMTBセクション (SMA専用)	4,291,568,581 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	243,584,446 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	986,357,925 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	170,723,221 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,283,169 円
My SMT グローバル株式インデックス (ノーロード)	996,402,967 円
グローバル経済コア	524,785,713 円
SBI 資産設計オープン (つみたてNISA対応型)	15,292,579 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,097,568 円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	116,500,119 円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	27,008,065 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2030	135,658,380 円

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	127,801,690円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	54,086,868円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	56,761,933円
10資産分散投資ファンド	53,269,375円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	53,293,331円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	23,713,018円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	449,439,295円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,430,098,484円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,202,635円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	68,475,569円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	84,679,257円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	70,265,140円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	194,200,383円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	186,765,260円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	185,818,200円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	189,041,134円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	187,171,165円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	85,911,878円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	120,414,728円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	16,387,901,962	
投資信託受益証券	△21,756,599	
投資証券	111,869,188	
合計	16,478,014,551	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年8月28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	14,071,745,913	—	13,897,626,256	△174,119,657
	買建				
合計		14,071,745,913	—	13,897,626,256	△174,119,657

（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

(2023年8月28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	532,915,000	—	532,923,930	8,930
	アメリカドル	498,100,000	—	498,111,900	11,900
	ユーロ	34,815,000	—	34,812,030	△2,970
合計		532,915,000	—	532,923,930	8,930

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	23,392	42.73	999,540.16	
	BAKER HUGHES CO	77,332	35.39	2,736,779.48	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	161.20	2,917,558.80	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	85.13	722,072.66	
	CHEVRON CORP	133,788	159.12	21,288,346.56	
	CONOCOPHILLIPS	90,080	116.52	10,496,121.60	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	27.74	1,513,106.04	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	50.43	2,534,410.08	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	149.55	1,984,079.85	
	EOG RESOURCES INC	43,691	127.08	5,552,252.28	
	EQT CORPORATION	27,026	42.04	1,136,173.04	
	EXXON MOBIL	301,729	108.25	32,662,164.25	
	HALLIBURTON CO	70,302	38.15	2,682,021.30	
	HESS CORP	19,804	150.60	2,982,482.40	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	57.10	766,795.90	
	KINDER MORGAN INC	144,061	17.34	2,498,017.74	
MARATHON OIL CORP	50,360	25.62	1,290,223.20		

MARATHON PETROLEUM CORP	32,827	143.98	4,726,431.46
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	53,406	61.84	3,302,627.04
ONEOK INC	31,321	64.95	2,034,298.95
OVINTIV INC	14,661	46.66	684,082.26
PHILLIPS 66	34,260	113.89	3,901,871.40
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	233.78	4,061,693.72
SCHLUMBERGER	105,564	56.46	5,960,143.44
TARGA RESOURCES CORP	17,298	84.48	1,461,335.04
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,902.16	1,013,851.28
VALERO ENERGY CORP	26,571	133.12	3,537,131.52
WILLIAMS COS	90,577	34.67	3,140,304.59
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,508	288.30	4,759,256.40
ALBEMARLE CORP	8,403	189.74	1,594,385.22
ALCOA CORP	15,500	28.23	437,565.00
AMCOR PLC	110,292	9.42	1,038,950.64
AVERY DENNISON CORP	6,638	184.36	1,223,781.68
BALL CORP	21,539	52.62	1,133,382.18
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	118.21	1,014,478.22
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,149	73.58	967,503.42
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	14.66	630,380.00
CORTEVA INC	51,304	49.94	2,562,121.76
CROWN HOLDINGS INC	9,940	88.53	879,988.20
DOW INC	51,372	53.98	2,773,060.56
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	74.64	2,546,642.16
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	81.93	723,605.76
ECOLAB INC	18,665	180.48	3,368,659.20
FMC CORP	8,264	87.95	726,818.80
FREEPORT-MCMORAN INC	105,762	38.33	4,053,857.46
INT'L PAPER CO	25,191	33.93	854,730.63
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	66.04	1,275,034.28
LINDE PLC	36,447	381.59	13,907,810.73
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	96.51	1,905,589.95
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,371	437.24	1,911,176.04
MOSAIC CO/THE	27,732	38.99	1,081,270.68
NEWMONT CORPORATION	61,808	38.31	2,367,864.48
NUCOR CORP	18,727	165.40	3,097,445.80

PACKAGING CORP OF AMERICA	5,893	146.04	860,613.72
PPG INDUSTRIES INC	17,495	138.37	2,420,783.15
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	275.74	1,137,703.24
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	99.75	1,042,986.00
SEALED AIR CORP	11,690	35.23	411,838.70
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,250	264.63	4,829,497.50
STEEL DYNAMICS INC	11,618	101.76	1,182,247.68
VULCAN MATERIALS CO	10,153	214.83	2,181,168.99
WESTLAKE CORP	2,222	131.22	291,570.84
WESTROCK CO	21,356	31.77	678,480.12
3 M COMPANY	40,676	98.95	4,024,890.20
AECOM	10,456	86.87	908,312.72
AERCAP HOLDINGS NV	11,968	60.59	725,141.12
ALLEGION PLC	5,598	109.84	614,884.32
AMETEK INC	17,753	157.59	2,797,695.27
AXON ENTERPRISE INC	5,367	198.43	1,064,973.81
BOEING CO	42,311	223.41	9,452,700.51
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	129.19	1,422,381.90
CARLISLE COS INC	3,456	259.28	896,071.68
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	55.02	3,414,706.26
CATERPILLAR	38,381	272.56	10,461,125.36
CUMMINS INC	10,414	232.05	2,416,568.70
DEERE&CO	20,925	390.21	8,165,144.25
DOVER CORP	10,657	142.67	1,520,434.19
EATON CORP	29,584	224.25	6,634,212.00
EMERSON ELECTRIC CO	42,473	97.64	4,147,063.72
FASTENAL CO	44,011	57.16	2,515,668.76
FERGUSON PLC	14,498	156.30	2,266,037.40
FORTIVE CORP	25,894	77.02	1,994,355.88
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	65.94	679,841.40
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	114.94	598,952.34
GENERAL DYNAMICS CORP	17,004	223.59	3,801,924.36
GENERAL ELECTRIC CO	81,042	111.97	9,074,272.74
GRACO INC	13,378	77.32	1,034,386.96
GRAINGER (WW) INC	3,363	714.56	2,403,065.28
HEICO CORP	3,640	166.39	605,659.60

HEICO CORP-CLASS A	4,690	133.67	626,912.30
HONEYWELL INTL INC	49,482	186.30	9,218,496.60
HOWMET AEROSPACE INC	26,751	48.18	1,288,863.18
HUBBELL INC	3,709	323.46	1,199,713.14
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	218.55	542,441.10
IDEX CORP	5,916	226.14	1,337,844.24
ILLINOIS TOOL WORKS	22,658	240.57	5,450,835.06
INGERSOLL-RAND INC	31,562	68.90	2,174,621.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	46.45	589,915.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	58.53	2,942,068.98
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	178.46	2,620,149.72
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	360.72	911,178.72
LOCKHEED MARTIN CORP	16,942	451.09	7,642,366.78
MASCO CORP	15,277	56.66	865,594.82
NORDSON CORP	4,121	238.60	983,270.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,740	429.56	4,613,474.40
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	83.87	2,576,234.79
OWENS CORNING	6,460	135.52	875,459.20
PACCAR INC	38,842	84.78	3,293,024.76
PARKER HANNIFIN CORP	9,535	403.21	3,844,607.35
PENTAIR PLC	10,813	67.05	725,011.65
QUANTA SERVICES INC	10,250	205.27	2,104,017.50
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	303.31	2,567,822.46
RTX CORP	108,761	84.69	9,210,969.09
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	37.10	513,018.80
SMITH (A. O. ) CORP	9,016	69.75	628,866.00
SNAP-ON INC	4,000	264.65	1,058,600.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	89.22	1,123,993.56
TEXTRON	13,437	75.22	1,010,731.14
TORO CO	8,812	99.42	876,089.04
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	202.58	3,449,532.24
TRANSDIGM GROUP INC	4,084	864.77	3,531,720.68
UNITED RENTALS INC	5,364	449.12	2,409,079.68
WABTEC CORP	13,304	111.72	1,486,322.88
WATSCO INC	2,656	349.65	928,670.40
XYLEM INC	16,864	101.17	1,706,130.88

AUTOMATIC DATA PROCESS	30,799	253.05	7,793,686.95
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	114.54	1,058,349.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,290	183.69	1,522,790.10
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	71.38	761,481.84
CINTAS CORP	6,804	496.01	3,374,852.04
CLARIVATE PLC	27,357	7.14	195,328.98
COPART INC	63,766	43.80	2,792,950.80
EQUIFAX INC	9,160	197.98	1,813,496.80
JACOBS SOLUTIONS INC	8,667	134.60	1,166,578.20
LEIDOS HOLDINGS	8,529	95.79	816,992.91
PAYCHEX INC	24,118	121.87	2,939,260.66
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	286.39	1,212,861.65
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	198.05	677,925.15
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	146.05	2,403,252.75
ROBERT HALF INC	7,185	74.96	538,587.60
ROLLINS INC	17,468	39.37	687,715.16
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	55.89	860,817.78
TRANSUNION	15,741	78.99	1,243,381.59
VERISK ANALYTICS INC	10,738	237.19	2,546,946.22
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	137.86	2,726,181.50
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	158.33	4,787,265.88
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	93.76	784,489.92
CSX CORP	152,261	30.91	4,706,387.51
DELTA AIR LINES INC	9,648	41.70	402,321.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	114.32	1,403,849.60
FEDEX CORP	17,749	258.73	4,592,198.77
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.70	418,140.70
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	187.66	1,078,669.68
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	54.56	743,270.88
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	210.65	3,564,198.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	409.04	3,008,898.24
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	31.22	422,500.26
U-HAUL HOLDING CO	6,606	52.63	347,673.78
UBER TECHNOLOGIES INC	134,723	43.96	5,922,423.08
UNION PACIFIC CORP	45,361	224.18	10,169,028.98
UNITED PARCEL SERVICE B	53,764	168.87	9,079,126.68

APTIV PLC	19,053	97.61	1,859,763.33
BORGWARNER INC	19,781	39.90	789,261.90
FORD MOTOR COMPANY	290,797	11.91	3,463,392.27
GENERAL MOTORS CO	103,664	32.95	3,415,728.80
LEAR CORP	3,648	140.53	512,653.44
LUCID GROUP INC	61,234	6.02	368,628.68
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	20.07	1,030,313.52
TESLA INC	212,019	238.59	50,585,613.21
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	521.52	1,096,756.56
DR HORTON INC	22,973	114.94	2,640,516.62
GARMIN LTD	10,561	103.35	1,091,479.35
HASBRO INC	10,572	69.68	736,656.96
LENNAR CORP-CL A	18,864	114.04	2,151,250.56
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	365.59	3,151,020.21
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	96.07	399,939.41
NIKE B	91,582	98.84	9,051,964.88
NVR INC	247	6,081.14	1,502,041.58
PULTE GROUP INC	16,747	77.17	1,292,365.99
VF CORP	25,718	18.87	485,298.66
WHIRLPOOL CORP	3,785	134.00	507,190.00
AIRBNB INC-CLASS A	30,729	125.79	3,865,400.91
ARAMARK	16,686	37.26	621,720.36
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	3,042.51	8,515,985.49
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	51.85	910,486.00
CARNIVAL CORPORATION	71,810	15.90	1,141,779.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,047	1,876.78	3,841,768.66
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	155.99	1,436,199.93
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	380.72	1,084,290.56
DOORDASH INC - A	19,212	78.02	1,498,920.24
EXPEDIA GROUP INC	11,638	106.94	1,244,567.72
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,175	147.02	2,819,108.50
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	110.71	419,258.77
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	52.62	1,344,967.20
MARRIOTT INTL A	19,516	199.79	3,899,101.64
MCDONALD'S CORP	54,264	284.58	15,442,449.12
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	42.17	959,536.18



ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	99.77	1,707,663.32
STARBUCKS CORP	85,428	95.48	8,156,665.44
VAIL RESORTS INC	3,014	220.82	665,551.48
WYNN RESORTS LTD	6,702	95.48	639,906.96
YUM BRANDS INC	19,972	129.74	2,591,167.28
ACTIVISION BLIZZARD INC	55,381	91.66	5,076,222.46
ALPHABET INC-CL A	442,712	129.88	57,499,434.56
ALPHABET INC-CL C	399,244	130.69	52,177,198.36
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	416.78	2,997,481.76
COMCAST CORP-CL A	312,679	45.47	14,217,514.13
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	119.69	2,361,842.77
FOX CORP - CLASS A	21,544	32.43	698,671.92
FOX CORP- CLASS B	10,345	30.15	311,901.75
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	32.33	921,760.63
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	88.82	812,969.46
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	64.45	991,176.55
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	23.28	316,235.52
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	84.79	984,666.27
MATCH GROUP INC	22,730	43.79	995,346.70
META PLATFORMS INC-CLASS A	164,626	285.50	47,000,723.00
NETFLIX INC	33,103	416.03	13,771,841.09
NEWS CORP-CLASS A	33,479	20.74	694,354.46
OMNICOM GROUP	14,048	79.86	1,121,873.28
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	14.44	469,415.52
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	26.91	1,231,589.97
ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	26.81	764,165.43
ROKU INC	9,122	76.95	701,937.90
SEA LTD-ADR	28,338	36.17	1,024,985.46
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.04	244,290.72
SNAP INC - A	63,578	9.25	588,096.50
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	141.42	1,819,651.14
THE WALT DISNEY CO	135,788	83.36	11,319,287.68
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	75.91	2,549,285.53
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	12.27	2,176,857.51
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	17.91	392,855.85
ADVANCE AUTO PARTS	4,616	64.08	295,793.28

AMAZON.COM	686,233	133.26	91,447,409.58
AUTOZONE INC	1,368	2,453.40	3,356,251.20
BATH & BODY WORKS INC	13,528	34.84	471,315.52
BEST BUY COMPANY INC	15,285	72.67	1,110,760.95
BURLINGTON STORES INC	5,108	154.27	788,011.16
CARMAX INC	10,695	78.42	838,701.90
CHEWY INC - CLASS A	6,878	25.76	177,177.28
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	111.67	552,766.50
EBAY	41,952	43.59	1,828,687.68
ETSY INC	10,294	72.31	744,359.14
GENUINE PARTS CO	9,903	153.04	1,515,555.12
HOME DEPOT	75,273	322.86	24,302,640.78
LKQ CORP	19,286	51.78	998,629.08
LOWES COMPANIES	44,328	223.07	9,888,246.96
MERCADOLIBRE INC	3,353	1,237.84	4,150,477.52
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	931.04	4,261,370.08
POOL CORP	2,664	353.98	943,002.72
ROSS STORES INC	25,425	119.00	3,025,575.00
TJX COMPANIES INC	85,671	88.82	7,609,298.22
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	213.54	1,675,434.84
ULTA BEAUTY INC	3,920	407.15	1,596,028.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	22.08	552,000.00
COSTCO WHOLESALE CORP	32,965	534.01	17,603,639.65
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	154.98	2,524,159.26
DOLLAR TREE INC	16,318	123.31	2,012,172.58
KROGER CO	50,664	46.54	2,357,902.56
SYSCO CORP	36,197	69.76	2,525,102.72
TARGET (DAYTON HUDSON)	34,220	121.79	4,167,653.80
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	25.26	1,302,582.42
WALMART INC	110,203	157.82	17,392,237.46
ALTRIA GROUP INC	132,765	43.67	5,797,847.55
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	80.83	3,283,152.94
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	68.09	1,634,568.54
BUNGE LIMITED	11,604	112.71	1,307,886.84
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	42.08	667,767.52
COCA-COLA CO	305,497	60.39	18,448,963.83

COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	63.48	977,211.12
CONAGRA BRANDS INC	33,324	30.02	1,000,386.48
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,979	259.49	3,108,430.71
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	60.32	798,757.44
GENERAL MILLS INC	43,531	68.37	2,976,214.47
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	217.31	2,377,806.02
HORMEL FOODS CORP	23,338	39.38	919,050.44
JM SMUCKER CO	7,850	142.10	1,115,485.00
KELLOGG CO	18,819	61.24	1,152,475.56
KEURIG DR PEPPER INC	65,371	33.28	2,175,546.88
KRAFT HEINZ CO/THE	56,982	33.85	1,928,840.70
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	96.35	1,144,252.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	81.48	1,474,136.16
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	62.85	921,946.65
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	101,324	71.50	7,244,666.00
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	57.34	3,345,674.32
PEPSICO INC	102,377	179.42	18,368,481.34
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,372	95.07	10,968,416.04
TYSON FOODS INC	23,306	54.01	1,258,757.06
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	93.30	1,804,981.80
CLOROX COMPANY	9,570	154.53	1,478,852.10
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	73.83	4,338,324.63
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	153.20	2,600,263.60
KENVUE INC	111,921	22.97	2,570,825.37
KIMBERLY-CLARK CORP	24,643	129.21	3,184,122.03
PROCTER & GAMBLE CO	175,356	153.54	26,924,160.24
ABBOTT LABORATORIES	129,183	104.21	13,462,160.43
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	356.35	1,871,906.55
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,469	179.48	2,237,936.12
BAXTER INTERNATIONAL	34,687	41.53	1,440,551.11
BECTON DICKINSON & CO	21,103	280.01	5,909,051.03
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,838	50.76	5,423,096.88
CARDINAL HEALTH	19,151	87.63	1,678,202.13
CENTENE CORP	40,934	63.48	2,598,490.32
CVS HEALTH CORP	95,131	67.32	6,404,218.92
DAVITA INC	4,627	100.61	465,522.47

DENTSPLY SIRONA INC	17,774	37.53	667,058.22
DEXCOM INC	28,772	100.76	2,899,066.72
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	76.17	3,431,610.84
ELEVANCE HEALTH INC	17,637	452.52	7,981,095.24
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	68.59	2,052,281.39
HCA HEALTHCARE INC	15,457	273.28	4,224,088.96
HENRY SCHEIN INC	8,755	76.85	672,821.75
HOLOGIC INC	18,875	75.41	1,423,363.75
HUMANA INC	9,297	478.94	4,452,705.18
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	492.68	3,038,850.24
INSULET CORP	5,246	183.00	960,018.00
INTUITIVE SURGICAL INC	26,035	297.55	7,746,714.25
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	212.19	1,389,420.12
MASIMO CORP	2,669	110.75	295,591.75
MCKESSON CORP	10,179	423.30	4,308,770.70
MEDTRONIC PLC	98,891	82.19	8,127,851.29
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	318.96	1,449,673.20
NOVOCURE LTD	7,933	29.77	236,165.41
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	132.39	1,149,012.81
RESMED INC	10,920	160.98	1,757,901.60
STERIS PLC	6,933	226.40	1,569,631.20
STRYKER CORP	25,363	278.12	7,053,957.56
TELEFLEX INC	3,934	216.14	850,294.76
THE CIGNA GROUP	22,079	279.23	6,165,119.17
THE COOPER COS INC	3,504	371.38	1,301,315.52
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,339	489.12	33,915,091.68
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	131.25	613,200.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	189.13	2,128,658.15
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	115.24	1,757,870.96
ABBVIE INC	131,130	146.69	19,235,459.70
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	119.68	2,607,946.88
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	189.26	1,825,034.18
AMGEN	39,709	256.38	10,180,593.42
AVANTOR INC	49,647	21.77	1,080,815.19
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	381.78	707,438.34
BIO-TECHNE CORP	12,980	80.16	1,040,476.80

BIOGEN INC	10,740	264.43	2,839,978.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	93.64	1,384,280.12
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	156,340	62.08	9,705,587.20
CATALENT INC	13,739	44.89	616,743.71
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	200.39	842,439.56
DANAHER CORP	51,486	255.53	13,156,217.58
ELI LILLY & CO	60,041	553.65	33,241,699.65
EXACT SCIENCES CORP	12,208	80.46	982,255.68
GILEAD SCIENCES INC	92,825	76.86	7,134,529.50
HORIZON THERAPEUTICS PLC	15,618	106.67	1,665,972.06
ILLUMINA INC	11,423	158.08	1,805,747.84
INCYTE CORP	15,212	63.86	971,438.32
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	219.01	3,030,222.36
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	141.25	702,153.75
JOHNSON & JOHNSON	179,427	166.25	29,829,738.75
MERCK & CO	188,628	110.21	20,788,691.88
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,175.45	1,912,457.15
MODERNA INC	24,153	111.93	2,703,445.29
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	107.52	724,899.84
PFIZER	419,551	36.38	15,263,265.38
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,992	830.35	6,636,157.20
REPLIGEN CORP	4,353	164.77	717,243.81
REVVITY INC	8,524	114.94	979,748.56
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	30.21	908,807.43
SEAGEN INC	9,758	199.81	1,949,745.98
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	9.70	893,767.70
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,670	541.59	15,527,385.30
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	229.01	828,558.18
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,147	350.06	6,702,598.82
VIATRIS INC	89,720	10.97	984,228.40
WATERS CORP	4,749	273.37	1,298,234.13
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	393.73	2,270,640.91
ZOETIS INC	34,383	182.82	6,285,900.06
BANK OF AMERICA CORP	535,131	28.50	15,251,233.50
CITIGROUP	144,682	41.24	5,966,685.68
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	26.84	1,060,770.48

FIFTH THIRD BANCORP	54,420	25.42	1,383,356.40
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,361.68	1,043,046.88
FIRST HORIZON CORP	44,308	12.22	541,443.76
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.85	1,238,115.20
JPMORGAN CHASE & CO	217,897	147.05	32,041,753.85
KEY CORP	71,223	10.88	774,906.24
M & T BANK CORP	11,807	125.58	1,482,723.06
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	117.74	3,491,932.92
REGIONS FINL CORP	70,810	18.54	1,312,817.40
TRUIST FINANCIAL CORP	96,574	28.81	2,782,296.94
US BANCORP	113,859	35.51	4,043,133.09
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	41.61	593,899.53
WELLS FARGO & CO	279,720	41.23	11,532,855.60
ALLY FINANCIAL INC	21,529	25.92	558,031.68
AMERICAN EXPRESS	47,011	158.32	7,442,781.52
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	334.13	2,611,560.08
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	28,767	83.15	2,391,976.05
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	99.97	1,277,616.60
BANK NEW YORK CO	61,254	43.73	2,678,637.42
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	96,495	355.93	34,345,465.35
BLACKROCK INC	11,143	675.96	7,532,222.28
BLACKSTONE INC	52,505	99.66	5,232,648.30
BLOCK INC	39,463	55.86	2,204,403.18
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,372	100.85	2,760,466.20
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	29.98	469,756.62
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,144	151.23	1,080,387.12
CME GROUP INC	26,740	203.22	5,434,102.80
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,895	74.26	809,062.70
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	88.74	1,684,906.38
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	27.73	775,968.59
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	429.57	1,352,286.36
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	42,810	54.74	2,343,419.40
FISERV INC	46,319	121.48	5,626,832.12
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	265.24	1,343,175.36
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	25.79	672,345.30
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	51.06	220,374.96

GLOBAL PAYMENTS INC	18,535	121.71	2,255,894.85
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,812	320.15	7,943,561.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41,604	115.80	4,817,743.20
INVESCO LTD	26,420	15.19	401,319.80
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	158.37	825,582.81
KKR & CO INC	44,805	59.50	2,665,897.50
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,307	234.13	1,242,527.91
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	244.55	784,271.85
MASTERCARD INC-CLASS A	63,267	402.89	25,489,641.63
MOODY' S CORP	12,261	334.43	4,100,446.23
MORGAN STANLEY	93,231	83.22	7,758,683.82
MSCI INC	5,952	531.15	3,161,404.80
NASDAQ INC	24,183	52.73	1,275,169.59
NORTHERN TRUST CORP	15,902	74.67	1,187,402.34
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	61.19	4,851,510.34
PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	109.70	1,733,918.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	102.27	1,583,753.22
S&P GLOBAL INC	24,377	388.27	9,464,857.79
SCHWAB (CHARLES) CORP	111,693	58.15	6,494,947.95
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	61.32	585,606.00
STATE STREET CORP	26,059	67.55	1,760,285.45
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	31.85	929,892.60
TOAST INC-CLASS A	20,341	21.23	431,839.43
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	85.30	772,903.30
VISA INC-CLASS A SHARES	120,784	242.57	29,298,574.88
AFLAC	43,196	74.25	3,207,303.00
ALLSTATE CORP	18,556	105.14	1,950,977.84
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	114.69	724,726.11
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	57.85	3,154,791.90
AON PLC	15,249	332.07	5,063,735.43
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,510	74.62	1,978,176.20
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,913	227.60	3,621,798.80
ASSURANT INC	4,726	138.73	655,637.98
BROWN & BROWN INC	16,344	73.07	1,194,256.08
CHUBB LTD	30,784	201.63	6,206,977.92
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	104.22	1,157,884.20

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	280.88	608,386.08
EVEREST GROUP LTD	3,288	352.88	1,160,269.44
FNF GROUP	20,461	40.01	818,644.61
GLOBE LIFE INC	5,948	111.46	662,964.08
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	71.79	1,775,438.49
LOEWS CORP	12,757	62.06	791,699.42
MARKEL GROUP INC	1,007	1,465.64	1,475,899.48
MARSH & MCLENNAN COS	36,799	194.21	7,146,733.79
METLIFE INC	48,925	62.41	3,053,409.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	76.33	1,414,852.88
PROGRESSIVE CORP	43,513	132.58	5,768,953.54
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	93.74	2,486,078.54
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	161.64	2,771,641.08
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,429	205.60	1,527,402.40
WR BERKLEY CORP	17,572	60.93	1,070,661.96
WEYERHAEUSER CO	52,615	32.63	1,716,827.45
ACCENTURE PLC-CL A	46,943	318.76	14,963,550.68
ADOBE INC	34,096	525.06	17,902,445.76
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	102.82	1,180,784.88
ANSYS INC	6,794	304.89	2,071,422.66
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	193.12	462,329.28
ATLASSIAN CORP-CL A	10,436	191.02	1,993,484.72
AUTODESK INC	15,965	215.92	3,447,162.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	47.35	701,395.55
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	105.26	783,450.18
BLACK KNIGHT INC	11,543	74.76	862,954.68
CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,308	232.51	4,721,813.08
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,186	134.43	831,583.98
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	62.20	1,261,602.60
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,307	70.06	2,543,668.42
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,571	149.58	2,478,690.18
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	158.91	492,621.00
DATADOG INC - CLASS A	17,716	92.60	1,640,501.60
DOCUSIGN INC	14,969	48.29	722,853.01
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	27.29	629,525.72
DYNATRACE INC	14,790	46.69	690,545.10



EPAM SYSTEMS INC	4,768	244.08	1,163,773.44
FAIR ISAAC CORP	1,816	851.89	1,547,032.24
FORTINET INC	48,642	58.81	2,860,636.02
GARTNER INC	5,655	342.49	1,936,780.95
GEN DIGITAL INC	43,555	20.20	879,811.00
GODADDY INC - CLASS A	11,388	71.52	814,469.76
HUBSPOT INC	3,646	512.75	1,869,486.50
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,426	145.35	9,800,369.10
INTUIT INC	20,854	519.05	10,824,268.70
MICROSOFT CORP	525,636	322.98	169,769,915.28
MONDAY.COM LTD	231	169.19	39,082.89
MONGODB INC	5,325	363.46	1,935,424.50
OKTA INC	11,505	72.23	831,006.15
ORACLE CORP	120,407	116.06	13,974,436.42
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	130,741	14.53	1,899,666.73
PALO ALTO NETWORKS INC	22,493	230.76	5,190,484.68
PTC INC	8,226	144.85	1,191,536.10
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,898	494.79	3,907,851.42
SALESFORCE INC	74,331	209.47	15,570,114.57
SERVICENOW INC	15,145	563.65	8,536,479.25
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,326	152.55	2,948,181.30
SPLUNK INC	11,101	115.94	1,287,049.94
SYNOPSYS INC	11,321	442.24	5,006,599.04
TWILIO INC - A	12,842	59.37	762,429.54
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	378.79	1,264,779.81
UIPATH INC - CLASS A	28,419	15.03	427,137.57
UNITY SOFTWARE INC	16,437	34.72	570,692.64
VERISIGN INC	6,723	205.74	1,383,190.02
VMWARE INC-CLASS A	17,149	162.55	2,787,569.95
WIX.COM LTD	5,010	92.48	463,324.80
WORKDAY INC-CLASS A	15,164	236.97	3,593,413.08
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	67.70	1,120,231.90
ZSCALER INC	7,204	142.76	1,028,443.04
AMPHENOL CORPORATION	44,247	86.30	3,818,516.10
APPLE INC	1,176,051	178.61	210,054,469.11
ARISTA NETWORKS INC	19,289	180.90	3,489,380.10

ARROW ELECTRONICS INC	4,338	130.41	565,718.58
CDW CORP/DE	9,584	204.00	1,955,136.00
CISCO SYSTEMS	304,444	55.70	16,957,530.80
COGNEX CORP	14,352	46.93	673,539.36
CORNING	58,221	32.43	1,888,107.03
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	56.21	1,018,750.04
F5 INC	4,851	157.29	763,013.79
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	16.62	1,619,319.84
HP INC	68,329	30.84	2,107,266.36
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	28.08	711,013.68
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	129.20	1,787,869.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,202	278.78	3,401,673.56
NETAPP INC	15,191	74.72	1,135,071.52
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,756	64.42	821,741.52
TE CONNECTIVITY LTD	22,795	128.64	2,932,348.80
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	408.55	1,356,386.00
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	52.15	923,993.70
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	39.49	1,018,447.10
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	268.39	1,117,039.18
AT&T INC	529,966	14.11	7,477,820.26
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	17.47	271,064.52
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	18.80	354,737.20
T-MOBILE US INC	44,785	133.35	5,972,079.75
VERIZON COMMUNICATIONS	312,179	33.35	10,411,169.65
AES CORP	54,375	18.06	982,012.50
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	50.78	1,055,106.84
AMEREN CORPORATION	20,898	80.45	1,681,244.10
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,118	79.33	2,944,570.94
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	140.42	2,031,596.56
ATMOS ENERGY CORP	11,302	117.70	1,330,245.40
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	28.22	1,339,490.52
CMS ENERGY CORP	23,697	57.11	1,353,335.67
CONSOLIDATED EDISON INC	24,527	89.88	2,204,486.76
CONSTELLATION ENERGY	25,114	105.87	2,658,819.18
DOMINION ENERGY INC	60,549	48.52	2,937,837.48
DTE ENERGY COMPANY	15,851	104.92	1,663,086.92

DUKE ENERGY CORP	57,283	90.58	5,188,694.14
EDISON INTL	25,571	69.93	1,788,180.03
ENTERGY CORP	16,181	94.80	1,533,958.80
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	37.38	762,514.62
EVERGY INC	18,475	56.89	1,051,042.75
EVERSOURCE ENERGY	27,450	65.17	1,788,916.50
EXELON CORP	73,907	40.30	2,978,452.10
FIRSTENERGY CORP	39,425	36.27	1,429,944.75
NEXTERA ENERGY INC	150,399	67.96	10,221,116.04
NISOURCE INC	32,351	26.58	859,889.58
NRG ENERGY INC	19,068	37.16	708,566.88
PG&E CORP	129,525	16.70	2,163,067.50
PPL CORPORATION	58,459	25.27	1,477,258.93
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,683	61.12	2,180,944.96
SEMPRA	45,886	71.56	3,283,602.16
SOUTHERN CO	81,133	68.09	5,524,345.97
UGI CORP	18,019	22.71	409,211.49
VISTRA CORP	22,676	30.12	683,001.12
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	85.10	1,995,339.70
XCEL ENERGY INC	39,963	57.58	2,301,069.54
ADVANCED MICRO DEVICES	119,628	102.25	12,231,963.00
ANALOG DEVICES	37,601	178.16	6,698,994.16
APPLIED MATERIALS	62,818	144.36	9,068,406.48
BROADCOM INC	30,991	851.82	26,398,753.62
ENPHASE ENERGY INC	9,617	124.09	1,193,373.53
ENTEGRIS INC	10,321	96.48	995,770.08
FIRST SOLAR INC	7,921	177.45	1,405,581.45
INTEL CORP	310,036	33.25	10,308,697.00
KLA CORP	10,294	481.73	4,958,928.62
LAM RESEARCH CORP	10,237	660.27	6,759,183.99
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	88.54	971,992.12
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	53.50	3,407,629.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	79.37	3,231,787.66
MICRON TECHNOLOGY	81,347	63.72	5,183,430.84
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	489.08	1,726,941.48
NVIDIA CORP	183,596	460.18	84,487,207.28

	NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	196.20	3,788,622.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	92.32	2,955,255.52	
	QORVO INC	6,249	101.53	634,460.97	
	QUALCOMM	82,879	110.32	9,143,211.28	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	105.39	1,184,794.38	
	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	4,156	161.70	672,025.20	
	TERADYNE INC	12,318	103.78	1,278,362.04	
	TEXAS INSTRUMENTS	67,444	167.81	11,317,777.64	
	WOLFSPEED INC	10,256	45.29	464,494.24	
	CBRE GROUP INC-A	22,995	82.58	1,898,927.10	
	COSTAR GROUP INC	29,397	80.20	2,357,639.40	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.55	350,385.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,809	49.97	440,185.73	
	アメリカドル 小計	25,479,131		2,839,718,357.78 (416,160,725,332)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	37,400	19.74	738,276.00	
	CAMECO CORP	31,793	49.50	1,573,753.50	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,307	82.81	6,815,842.67	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	25.62	2,851,326.66	
	ENBRIDGE	150,513	46.83	7,048,523.79	
	IMPERIAL OIL	16,488	75.03	1,237,094.64	
	KEYERA CORP	18,607	33.40	621,473.80	
	PARKLAND CORP	4,564	36.35	165,901.40	
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	41.33	1,575,954.23	
	SUNCOR ENERGY	98,973	44.77	4,431,021.21	
	TC ENERGY CORP	75,669	48.07	3,637,408.83	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	66.48	1,662,598.32	
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	64.37	2,323,757.00	
	BARRICK GOLD CORP	133,727	21.64	2,893,852.28	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,275	60.05	496,913.75	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	33.39	1,447,790.40	
	FRANCO-NEVADA CORP	13,695	188.33	2,579,179.35	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	11.66	604,536.02	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.55	710,354.05	
	LUNDIN MINING CORP	31,977	9.98	319,130.46	
	NUTRIEN LTD	37,152	82.91	3,080,272.32	

PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	21.36	478,805.76
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	54.40	1,924,998.40
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	102.24	358,351.20
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	57.25	1,826,618.50
CAE INC	25,999	31.79	826,508.21
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	110.36	575,306.68
WSP GLOBAL INC	9,951	186.53	1,856,160.03
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	43.96	614,165.16
RB GLOBAL INC	14,445	80.68	1,165,422.60
THOMSON REUTERS CORP	11,033	172.42	1,902,309.86
AIR CANADA	13,805	22.32	308,127.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	152.98	6,461,416.26
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	69,248	106.87	7,400,533.76
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	173.30	1,011,552.10
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	76.93	1,558,140.22
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	104.43	320,600.10
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	39.45	387,399.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	92.36	2,131,022.28
QUEBECOR INC -CL B	15,200	31.01	471,352.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	152.63	688,819.19
DOLLARAMA INC	22,000	85.81	1,887,820.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	56,821	71.29	4,050,769.09
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	35.08	243,104.40
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	116.55	1,505,010.15
METRO INC	18,840	69.90	1,316,916.00
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	149.53	781,443.78
SAPUTO INC	20,898	28.86	603,116.28
BANK MONTREAL	52,757	112.16	5,917,225.12
BANK NOVA SCOTIA	88,533	62.12	5,499,669.96
CANADIAN IMPERIAL BANK	67,344	53.98	3,635,229.12
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	98.16	2,366,735.76
ROYAL BANK OF CANADA	103,016	121.02	12,466,996.32
TORONTO-DOMINION BANK	135,406	80.37	10,882,580.22
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	45.19	1,310,555.19
BROOKFIELD CORP	104,769	44.17	4,627,646.73
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	20.48	667,217.92

	IGM FINANCIAL INC	7,685	37.85	290,877.25	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	22.17	95,353.17	
	ONEX CORP	6,603	81.80	540,125.40	
	TMX GROUP LTD	23,425	29.51	691,271.75	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,132.93	1,987,159.22	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.22	909,177.36	
	IA FINANCIAL CORP INC	6,977	83.17	580,277.09	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,255	194.68	2,580,483.40	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	130,818	24.33	3,182,801.94	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	36.07	1,571,822.39	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	64.59	2,817,028.26	
	CGI INC - CL A	16,084	138.07	2,220,717.88	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,490	2,723.35	4,057,791.50	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	100.04	698,679.36	
	OPEN TEXT CORP	20,463	53.13	1,087,199.19	
	SHOPIFY INC - CLASS A	88,987	75.57	6,724,747.59	
	BCE INC	6,203	56.32	349,352.96	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	53.41	1,489,124.21	
	TELUS CORP	32,908	23.35	768,401.80	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	10.07	521,807.26	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	25.99	634,026.05	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	39.01	440,617.95	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.19	332,329.56	
	EMERA INC	17,459	50.74	885,869.66	
	FORTIS INC	35,547	53.43	1,899,276.21	
	HYDRO ONE LTD	20,587	36.04	741,955.48	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	25.58	456,705.32	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	199.07	535,498.30	
	カナダドル 小計	3,016,123		175,935,083.14 (18,960,523,909)	
ユーロ	ENI	174,687	14.15	2,472,519.79	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	12.34	489,627.39	
	NESTE OIL OYJ	32,766	33.03	1,082,260.98	
	OMV AG	12,549	42.11	528,438.39	
	REPSOL SA	89,536	14.07	1,260,219.20	
	TENARIS SA	40,648	14.97	608,703.80	

TOTALENERGIES SE	175,847	57.32	10,079,550.04
AIR LIQUIDE	38,920	162.84	6,337,732.80
AKZO NOBEL	12,357	73.66	910,216.62
ARCELORMITTAL	32,320	24.07	778,104.00
ARKEMA	4,369	93.32	407,715.08
BASF SE	64,204	45.02	2,890,785.10
COVESTRO AG	14,454	48.27	697,694.58
CRH PLC	55,581	52.54	2,920,225.74
DSM-FIRMENICH AG	13,707	84.49	1,158,104.43
EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.31	277,600.47
HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	73.46	790,796.90
OCI NV	7,248	22.35	161,992.80
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	36.68	715,406.72
SOLVAY SA	5,356	102.00	546,312.00
STORA ENSO OYJ R	42,169	11.13	469,340.97
SYMRISE AG	10,018	93.30	934,679.40
UMICORE	17,605	23.36	411,252.80
UPM KYMMENE OYJ	42,324	29.88	1,264,641.12
VOESTALPINE AG	7,152	26.70	190,958.40
WACKER CHEMIE AG	1,770	132.10	233,817.00
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,403	31.67	519,483.01
AIRBUS SE	44,063	129.88	5,722,902.44
ALSTOM	24,388	25.32	617,504.16
BOUYGUES ORD	16,606	31.29	519,601.74
BRENTAG SE	12,514	72.04	901,508.56
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	11.98	970,691.48
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	34,575	32.27	1,115,735.25
DASSAULT AVIATION SA	2,130	175.40	373,602.00
EIFFAGE	5,924	91.96	544,771.04
FERROVIAL SE	37,026	28.90	1,070,051.40
GEA GROUP AG	13,382	35.79	478,941.78
IMCD NV	4,641	123.65	573,859.65
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	73.86	915,716.28
KNORR-BREMSE AG	5,022	60.96	306,141.12
KONE OYJ-B	26,369	41.95	1,106,179.55
LEGRAND SA	19,340	89.12	1,723,580.80

METSO CORPORATION	51,970	10.28	534,251.60
MTU AERO ENGINES AG	3,962	204.60	810,625.20
PRYSMIAN SPA	21,155	36.40	770,042.00
RATIONAL AG	483	680.50	328,681.50
RHEINMETALL AG	2,795	243.30	680,023.50
SAFRAN SA	24,910	145.10	3,614,441.00
SAINT-GOBAIN	36,177	58.04	2,099,713.08
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,328	156.52	6,312,138.56
SIEMENS	56,492	136.40	7,705,508.80
SIEMENS ENERGY AG	36,841	12.92	475,985.72
THALES SA	8,524	132.70	1,131,134.80
VINCI S. A.	39,327	102.34	4,024,725.18
WARTSILA OYJ	41,917	11.02	461,925.34
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.38	611,279.74
RANDSTAD NV	6,064	53.58	324,909.12
TELEPERFORMANCE	4,734	118.60	561,452.40
WOLTERS KLUWER	18,738	109.50	2,051,811.00
ADP	2,382	119.00	283,458.00
AENA SME SA	5,508	139.95	770,844.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	8.09	367,187.61
DHL GROUP	74,810	42.18	3,155,859.85
GETLINK	21,115	15.01	317,041.72
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,611	96.51	2,375,207.61
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	89.65	447,443.15
CONTINENTAL AG	8,168	67.40	550,523.20
DR ING HC F PORSCHE AG	7,331	100.05	733,466.55
FERRARI NV	9,370	286.80	2,687,316.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,618	67.00	4,262,406.00
MICHELIN	47,236	28.42	1,342,447.12
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	48.67	571,629.15
RENAULT SA	11,597	36.40	422,188.78
STELLANTIS NV	162,367	16.72	2,714,776.24
VALEO SA	16,596	17.46	289,766.16
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	112.10	1,718,268.80
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	132.65	329,767.90
ADIDAS AG	11,414	176.44	2,013,886.16



HERMES INTERNATIONAL	2,355	1,883.20	4,434,936.00
KERING	5,534	487.60	2,698,378.40
LVMH	20,525	785.30	16,118,282.50
MONCLER SPA	14,605	62.36	910,767.80
PUMA SE	9,220	60.16	554,675.20
SEB SA	2,282	99.35	226,716.70
ACCOR	14,436	32.34	466,860.24
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	32,105	61.12	1,962,257.60
DELIVERY HERO SE	13,414	34.37	461,106.25
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,042	164.55	2,146,061.10
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	12.35	192,407.63
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.58	264,158.64
SODEXO	6,173	99.26	612,731.98
BOLLORE SE	83,646	5.31	444,578.49
PUBLICIS GROUPE	17,217	71.26	1,226,883.42
SCOUT24 SE	3,716	61.46	228,385.36
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	22.86	1,504,782.36
VIVENDI SE	61,243	8.18	501,090.22
D'IETEREN GROUP	2,217	151.00	334,767.00
INDITEX	81,082	34.21	2,773,815.22
PROSUS	59,578	62.53	3,725,412.34
ZALANDO SE	17,664	26.45	467,212.80
CARREFOUR	39,746	18.21	723,774.66
HELLOFRESH SE	13,805	26.36	363,899.80
JERONIMO MARTINS	14,298	23.86	341,150.28
KESKO OYJ-B SHS	20,083	17.59	353,259.97
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	30.06	2,131,254.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,422	52.25	3,313,799.50
DANONE (GROUPE)	47,639	53.51	2,549,162.89
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	11.90	402,969.70
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	74.25	706,266.00
HEINEKEN NV	20,157	89.52	1,804,454.64
JDE PEET'S BV	7,000	26.26	183,820.00
KERRY GROUP PLC-A	10,592	85.58	906,463.36
PERNOD-RICARD	15,339	193.20	2,963,494.80
REMY COINTREAU	1,032	148.75	153,510.00

BEIERSDORF AG	7,430	120.95	898,658.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	64.34	564,905.20
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	71.92	820,966.80
LOREAL	17,902	401.45	7,186,757.90
AMPLIFON SPA	11,650	29.87	347,985.50
BIOMERIEUX	3,044	95.66	291,189.04
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	87.94	301,634.20
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	93.02	192,551.40
ESSILORLUXOTTICA	21,384	174.04	3,721,671.36
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	44.32	752,775.20
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	29.34	988,435.26
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	20.39	1,464,870.87
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	45.43	979,788.81
ARGENX SE	4,177	469.20	1,959,848.40
BAYER	72,310	50.05	3,619,115.50
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	55.86	570,889.20
GRIFOLS SA	27,685	12.82	354,921.70
IPSEN	3,532	119.10	420,661.20
MERCK KGAA	9,080	160.30	1,455,524.00
ORION OYJ-CLASS B	3,129	35.55	111,235.95
QIAGEN N. V.	17,038	41.23	702,476.74
RECORDATI SPA	5,163	45.84	236,671.92
SANOFI	84,347	98.71	8,325,892.37
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	346.60	632,198.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	248.50	391,139.00
UCB (GROUPE)	9,389	81.68	766,893.52
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	13.18	365,026.72
AIB GROUP PLC	88,299	4.25	375,623.94
BANCO BILBAO VIZCAYA	441,393	7.15	3,155,959.95
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.53	4,327,083.67
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.15	809,365.72
BNP PARIBAS	82,574	58.31	4,814,889.94
CAIXABANK	336,789	3.78	1,274,746.36
COMMERZBANK AG	81,889	9.94	813,976.66
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	11.46	1,140,328.09
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	32.86	833,855.36

FINECOBANK SPA	41,585	12.59	523,763.07
ING GROEP NV-CVA	269,040	13.15	3,538,414.08
INTESA SANPAOLO	1,247,505	2.44	3,055,763.49
KBC GROEP NV	18,057	60.20	1,087,031.40
MEDIOBANCA	25,262	11.80	298,217.91
SOCIETE GENERALE	53,019	25.91	1,373,987.38
UNICREDIT SPA	139,080	21.75	3,024,990.00
ADYEN NV	1,609	765.00	1,230,885.00
AMUNDI SA	4,626	53.00	245,178.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	134,445	9.89	1,330,467.72
DEUTSCHE BOERSE	14,123	163.00	2,302,049.00
EDENRED	20,131	58.74	1,182,494.94
EURAZEO SA	3,357	52.75	177,081.75
EURONEXT NV	6,480	66.35	429,948.00
EXOR NV	7,825	80.30	628,347.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	72.56	617,848.40
NEXI SPA	48,458	6.51	315,461.58
SOFINA	1,238	202.60	250,818.80
WENDEL	2,023	82.50	166,897.50
WORLDLINE SA	20,332	29.65	602,843.80
AEGON	148,741	4.74	706,073.52
AGEAS	11,086	36.61	405,858.46
ALLIANZ SE-REG	29,979	222.10	6,658,335.90
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	18.61	1,325,701.96
AXA SA	136,364	27.39	3,735,691.78
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	196.00	873,180.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	355.50	3,702,177.00
NN GROUP NV	16,208	34.17	553,827.36
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.09	464,723.32
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	40.08	1,327,930.56
TALANX AG	5,053	61.60	311,264.80
BECHTLE AG	7,659	43.85	335,847.15
CAPGEMINI SA	12,235	162.55	1,988,799.25
DASSAULT SYSTEMES SA	47,353	35.70	1,690,738.86
NEMETSCHEK SE	5,455	61.26	334,173.30
SAP SE	77,618	126.16	9,792,286.88

NOKIA OYJ	396,129	3.49	1,385,065.04
CELLNEX TELECOM SA	41,890	34.29	1,436,408.10
DEUTSCHE TELEKOM	240,920	19.25	4,639,155.52
ELISA A	10,227	44.38	453,874.26
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.13	338,073.75
KPN (KON.)	216,358	3.17	687,802.08
ORANGE	128,563	10.26	1,319,313.50
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.27	234,025.52
TELEFONICA	373,259	3.68	1,376,205.93
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	1.69	167,519.35
ACCIONA SA	2,181	126.30	275,460.30
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	26.02	141,470.74
E.ON SE	166,881	11.34	1,893,264.94
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	17.64	383,705.28
ELIA GROUP SA/NV	987	104.30	102,944.10
ENAGAS	21,663	15.53	336,534.70
ENDESA	25,972	19.02	494,117.30
ENEL	596,378	6.10	3,643,273.20
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	273,128	4.29	1,172,538.50
ENGIE	129,254	14.79	1,912,183.67
FORTUM OYJ	32,550	12.05	392,390.25
IBERDROLA SA	444,395	10.96	4,872,791.17
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.20	262,262.00
REDEIA CORP SA	30,678	14.89	456,795.42
RWE STAMM	44,929	39.27	1,764,361.83
SNAM SPA	147,559	4.67	689,543.20
TERNA SPA	95,819	7.49	718,259.22
VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	28.06	1,396,854.86
VERBUND AG	6,430	74.65	479,999.50
ASM INTERNATIONAL NV	3,400	422.95	1,438,030.00
ASML HOLDING NV	29,993	594.20	17,821,840.60
INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	31.97	3,103,813.25
STMICROELECTRONICS NV	50,286	42.44	2,134,137.84
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	60.90	321,247.50
VONOVIA SE	52,580	20.40	1,072,632.00
ユーロ 小計	13,658,431		344,962,154.96

				(54,597,160,265)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.75	6,255,381.31
	SHELL PLC-NEW	508,994	23.78	12,106,422.29
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	20.31	1,895,471.37
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	14.01	418,431.84
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	53.82	587,929.68
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	16.25	286,065.00
	GLENCORE PLC	793,369	4.26	3,380,941.99
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	15.43	259,964.64
	MONDI PLC	41,710	12.67	528,465.70
	RIO TINTO PLC REG	83,678	47.45	3,970,939.49
	ASHTED GROUP PLC	33,317	53.88	1,795,119.96
	BAE SYSTEMS PLC	219,532	9.91	2,176,440.24
	BUNZL PLC	22,799	27.24	621,044.76
	DCC PLC	6,622	41.95	277,792.90
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	2.03	1,290,895.27
	SMITHS GROUP PLC	26,476	15.89	420,703.64
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	97.14	535,629.96
	EXPERIAN PLC	67,859	27.12	1,840,336.08
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	41.33	574,073.70
	RELX PLC	141,442	25.28	3,575,653.76
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	5.87	1,068,092.91
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.31	315,720.22
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	39.09	271,753.68
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	21.67	645,245.92
	PERSIMMON PLC	25,686	9.87	253,520.82
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.09	288,665.67
	COMPASS GROUP PLC	129,701	20.19	2,618,663.19
	ENTAIN PLC	49,630	11.56	573,722.80
	INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	58.78	667,917.14
	PEARSON	55,305	8.32	460,580.04
	WHITBREAD PLC	17,434	33.58	585,433.72
	AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.87	425,351.94
INFORMA PLC	110,598	7.17	792,987.66	
WPP PLC	85,821	7.47	641,597.79	
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.39	287,486.75	

KINGFISHER PLC	153,717	2.27	349,091.30
NEXT PLC	7,832	67.80	531,009.60
OCADO GROUP PLC	54,753	7.41	406,157.75
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.61	388,489.36
TESCO PLC	525,585	2.60	1,367,046.58
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.53	502,702.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,888	25.89	4,087,720.32
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	22.73	408,230.80
DIAGEO	167,595	32.67	5,476,166.62
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.71	1,213,087.77
HALEON PLC	346,790	3.27	1,136,604.22
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	52,885	56.88	3,008,098.80
UNILEVER PLC	187,760	40.36	7,578,932.40
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.59	726,421.05
ASTRAZENECA	115,201	106.60	12,280,426.60
GSK PLC	304,379	13.74	4,182,167.46
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,620	21.22	140,476.40
BARCLAYS	1,129,529	1.43	1,626,295.85
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,029	5.87	8,729,000.46
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.41	2,018,061.54
NATWEST GROUP PLC	426,244	2.25	962,458.95
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	7.11	1,352,791.12
3I GROUP PLC	74,757	19.24	1,438,324.68
ABRDN PLC	153,430	1.61	247,175.73
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.53	249,283.34
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,849	81.82	2,442,245.18
M&G PLC	131,539	1.85	243,347.15
SCHRODERS PLC	39,932	4.02	160,686.36
ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	8.50	348,102.73
WISE PLC - A	49,048	6.39	313,711.00
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.90	388,494.50
AVIVA PLC	193,334	3.69	714,755.79
LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.12	869,696.26
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.05	257,657.05
PRUDENTIAL	212,226	9.46	2,009,355.76
SAGE GROUP PLC	76,660	9.51	729,496.56

	HALMA PLC	31,069	20.78	645,613.82
	BT GROUP PLC	464,863	1.12	522,273.58
	VODAFONE GROUP PLC	1,564,850	0.71	1,115,425.08
	CENTRICA PLC	453,631	1.46	665,476.67
	NATIONAL GRID PLC	260,089	9.77	2,543,150.24
	SEVERN TRENT PLC	17,468	23.68	413,642.24
	SSE PLC	81,692	16.16	1,320,551.18
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	9.20	465,437.16
	イギリスポンド 小計	20,310,344		129,269,783.04 (23,855,445,762)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	13.98	243,224.04
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	652.00	374,248.00
	GIVAUDAN-REG	678	2,849.00	1,931,622.00
	HOLCIM LTD	41,204	57.52	2,370,054.08
	SIG GROUP AG	26,203	22.34	585,375.02
	SIKA AG-BR	10,856	239.70	2,602,183.20
	ABB LTD	116,833	32.91	3,844,974.03
	GEBERIT AG-REG	2,530	443.20	1,121,296.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	183.00	374,784.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	193.70	598,920.40
	VAT GROUP AG	1,956	346.00	676,776.00
	ADECCO GROUP AG-REG	8,571	37.43	320,812.53
	SGS SA	10,147	79.98	811,557.06
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	264.40	999,696.40
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	38,748	123.00	4,766,004.00
	SWATCH GROUP AG (BEARER)	2,483	245.80	610,321.40
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	46.70	183,904.60
	DUFREY AG-REG	7,820	39.12	305,918.40
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,551.00	434,280.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	101,600.00	812,800.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,330.00	847,060.00
	NESTLE SA - REGISTERED	204,409	106.24	21,716,412.16
	ALCON INC	38,399	73.64	2,827,702.36
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	234.70	912,278.90
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	131.80	1,125,572.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	81.45	150,682.50

	LONZA GROUP AG-REG	5,536	473.30	2,620,188.80	
	NOVARTIS	152,294	89.72	13,663,817.68	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	274.80	608,682.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	52,222	259.20	13,535,942.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	96.45	239,871.15	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	59.06	902,968.34	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,574	916.80	1,443,043.20	
	UBS GROUP AG	249,657	21.63	5,400,080.91	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,379	136.10	323,781.90	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	131.70	389,173.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	537.40	1,299,970.60	
	SWISS RE LTD	22,063	84.60	1,866,529.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,184	407.30	4,555,243.20	
	TEMENOS AG - REG	5,150	67.36	346,904.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,702	59.10	632,488.20	
	SWISSCOM	1,856	530.40	984,422.40	
	BKW AG	1,744	157.50	274,680.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	83.60	474,764.40	
	スイスフラン 小計	1,103,720		101,111,011.56 (16,755,105,725)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	22,252	284.95	6,340,707.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	403.30	2,170,963.90	
	SCA SV CELLULOSA B	35,790	139.65	4,998,073.50	
	ALFA LAVAL AB	18,955	369.70	7,007,663.50	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	240.00	18,234,480.00	
	ATLAS COPCO A	207,097	145.75	30,184,387.75	
	ATLAS COPCO B	108,178	125.65	13,592,565.70	
	BEIJER REF AB	26,868	121.00	3,251,028.00	
	EPIROC AB-A	53,479	205.40	10,984,586.60	
	EPIROC AB-B	28,804	175.10	5,043,580.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	87.86	3,401,236.32	
	INDUTRADE AB	22,644	200.80	4,546,915.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	194.60	2,724,789.20	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	197.90	3,556,263.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	81.92	10,063,708.16	
	SAAB AB-B	6,388	566.80	3,620,718.40	



	SANDVIK AB	75,334	201.40	15,172,267.60	
	SKANSKA B	25,507	154.45	3,939,556.15	
	SKF AB-B	21,050	178.55	3,758,477.50	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	221.20	2,989,296.80	
	VOLVO B	114,238	217.80	24,881,036.40	
	SECURITAS B	28,375	86.00	2,440,250.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	42.96	2,141,083.44	
	EVOLUTION AB	13,186	1,173.80	15,477,726.80	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	23.89	1,269,681.83	
	HENNES & MAURITZ B	41,351	159.90	6,612,024.90	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	255.00	12,615,870.00	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	187.25	3,332,301.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	221.40	3,173,769.00	
	NORDEA BANK ABP	236,636	118.16	27,960,909.76	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	110,001	123.35	13,568,623.35	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	90.30	10,902,460.80	
	SWEDBANK AB-A	58,652	190.80	11,190,801.60	
	EQT AB	31,471	206.60	6,501,908.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	281.70	3,329,130.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	280.80	3,135,974.40	
	INVESTOR AB-A SHS	26,088	206.50	5,387,172.00	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	209.65	26,947,991.70	
	KINNEVIK AB - B	18,792	123.65	2,323,630.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	437.00	3,181,360.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	54.14	11,623,262.46	
	HEXAGON AB-B SHS	148,878	96.70	14,396,502.60	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	75.74	3,541,753.88	
	TELIA CO AB	123,760	21.48	2,658,364.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	48.60	2,755,620.00	
	SAGAX AB-B	17,402	221.30	3,851,062.60	
	スウェーデンクローナ 小計	2,691,864		380,781,538.40 (5,056,778,829)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	18,105	282.30	5,111,041.50	
	EQUINOR ASA	73,436	320.70	23,550,925.20	
	NORSK HYDRO	100,517	58.04	5,834,006.68	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	381.60	4,769,236.80	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	444.00	3,838,380.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	77.25	1,476,788.25	
	MOWI ASA	31,968	188.35	6,021,172.80	
	ORKLA	37,417	80.54	3,013,565.18	
	SALMAR ASA	5,423	500.00	2,711,500.00	
	DNB BANK ASA	71,795	210.30	15,098,488.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	160.30	2,977,412.20	
	TELENOR ASA	51,193	108.90	5,574,917.70	
	ノルウェークローネ 小計	448,688		79,977,434.81 (1,097,290,405)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	458.50	3,889,455.50	
	NOVOZYMES A/S	17,111	304.20	5,205,166.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,617.00	1,220,835.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	72,778	164.36	11,961,792.08	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,740.00	2,790,060.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	12,960.00	3,965,760.00	
	DSV A/S	14,203	1,304.00	18,520,712.00	
	PANDORA A/S	7,957	694.40	5,525,340.80	
	CARLSBERG AS-B	6,810	1,016.00	6,918,960.00	
	COLOPLAST-B	9,208	780.00	7,182,240.00	
	DEMANT A/S	8,512	291.70	2,482,950.40	
	GENMAB A/S	4,628	2,573.00	11,907,844.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	123,050	1,278.00	157,257,900.00	
	DANSKE BANK A/S	46,499	154.95	7,205,020.05	
	TRYG A/S	29,772	128.55	3,827,190.60	
	ORSTED A/S	12,910	554.80	7,162,468.00	
	デンマーククローネ 小計	363,201		257,023,694.63 (5,459,183,273)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	33.71	695,403.59	
	SANTOS	218,974	7.72	1,690,479.28	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	37.67	5,316,555.45	
	BHP GROUP LTD	377,956	43.02	16,259,667.12	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	20.46	711,394.20	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	122,505	20.93	2,564,029.65	
	IGO LTD	56,345	12.96	730,231.20	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,156	44.15	1,243,087.40	

MINERAL RESOURCES LTD	14,409	65.57	944,798.13
NEWCREST MINING LIMITED	60,966	25.46	1,552,194.36
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	11.17	823,027.94
ORICA LTD	38,288	14.97	573,171.36
PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.70	984,579.50
RIO TINTO LTD	28,272	107.90	3,050,548.80
SOUTH32 LTD	346,773	3.48	1,206,770.04
REECE LTD	16,814	19.59	329,386.26
BRAMBLES LTD	108,007	14.06	1,518,578.42
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.67	1,094,755.92
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.68	440,094.88
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.24	530,400.00
TRANSURBAN GROUP	224,973	13.08	2,942,646.84
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	39.96	1,846,551.60
IDP EDUCATION LTD	17,793	25.98	462,262.14
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.02	913,705.26
REA GROUP LTD	3,586	161.38	578,708.68
SEEK LTD	28,001	23.19	649,343.19
WESFARMERS LTD	84,329	51.00	4,300,779.00
COLES GROUP LTD	108,486	15.91	1,726,012.26
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.50	604,455.50
WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	37.41	3,444,376.11
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.87	759,205.20
COCHLEAR LIMITED	4,783	264.98	1,267,399.34
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	48.42	586,220.94
SONIC HEALTHCARE LTD	27,240	31.88	868,411.20
CSL LIMITED	35,855	263.42	9,444,924.10
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	221,609	24.34	5,393,963.06
COMMONWEALTH BANK OF AUST	125,501	99.57	12,496,134.57
NATIONAL AUSTRALIA BANK	233,298	27.89	6,506,681.22
WESTPAC BANKING	255,840	21.32	5,454,508.80
ASX LTD	14,549	57.28	833,366.72
MACQUARIE GROUP LIMITED	27,105	171.79	4,656,367.95
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	31.93	441,017.16
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.68	946,640.16
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.57	828,893.31

	QBE INSURANCE GROUP	104,083	14.49	1,508,162.67	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.05	1,237,975.20	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	71.65	988,841.65	
	XERO LTD	11,340	118.67	1,345,717.80	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.01	1,236,952.67	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	8.65	947,010.65	
	オーストラリアドル 小計	5,120,036		117,476,388.45 (11,055,702,917)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.90	651,441.90	
	EBOS GROUP LTD	14,283	36.05	514,902.15	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	22.28	890,754.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	97,207	5.05	490,895.35	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.27	405,123.51	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.29	584,777.76	
	ニュージーランドドル 小計	409,088		3,537,895.07 (306,664,744)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,496	41.05	7,204,110.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	77.00	8,239,000.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	11.00	1,012,000.00	
	MTR CORP	125,000	31.90	3,987,500.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	14.72	1,766,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	49.90	8,682,600.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	26.20	5,187,600.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	16.74	2,442,366.00	
	WH GROUP LTD	658,301	3.97	2,613,454.97	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	21.15	5,953,725.00	
	HANG SENG BANK	59,400	97.40	5,785,560.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	287.60	25,395,080.00	
	AIA GROUP LTD	865,600	67.65	58,557,840.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	38.55	1,445,625.00	
	CLP HOLDINGS	102,000	58.90	6,007,800.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.83	5,274,150.31	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	38.80	4,345,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	42.60	5,197,029.60	
	ESR GROUP LTD	157,000	12.10	1,899,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	10.66	1,844,180.00	

	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	21.25	2,661,095.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	16.32	2,225,640.00	
	SINO LAND CO	315,400	8.88	2,800,752.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	88.65	9,308,250.00	
	SWIRE PACIFIC A	10,000	65.35	653,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	17.02	1,637,324.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	31.85	3,917,550.00	
	香港ドル 小計	5,609,853		186,045,432.68 (3,475,328,682)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	32.51	260,080.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.70	755,760.00	
	SEATRIM LTD	2,152,791	0.14	305,696.32	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.82	563,068.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.85	742,074.20	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.90	264,984.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.55	634,030.00	
	DBS GROUP	130,200	32.90	4,283,580.00	
	OCBC BANK	257,100	12.36	3,177,756.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	28.08	2,639,520.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.51	627,660.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	13.12	337,184.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	555,643	2.34	1,300,204.62	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	127,200	3.14	399,408.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.66	285,048.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.38	303,050.00	
	シンガポールドル 小計	4,346,866		16,879,103.14 (1,824,968,631)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	22.88	1,359,689.76	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	752.60	1,615,079.60	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	32.24	3,169,514.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	30.45	3,425,990.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.39	1,929,305.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	130.40	1,630,391.20	
	NICE LTD	4,991	747.00	3,728,277.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	108.10	1,081,000.00	
	AZRIELI GROUP	1,537	204.00	313,548.00	

イスラエルシェケル 小計	400,926	18,252,795.36 (704,004,841)
合 計	82,958,271	559,308,883,315 (559,308,883,315)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	オーストラ リアドル	APA GROUP	83,290	725,455.90	
		LENDLEASE GROUP	64,786	491,077.88	
	オーストラリアドル 小計		148,076	1,216,533.78 (114,487,994)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,614,500.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,614,500.00 (48,838,860)	
投資信託受益証券合計			463,076	163,326,854 (163,326,854)	
投資証券	アメリカド ル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,442,096.02	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	882,081.68	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,641	6,149,816.73	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	737,193.42	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,083	1,829,560.35	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	720,688.59	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	830,382.84	
		CROWN CASTLE INC	32,235	3,213,829.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,366	2,691,047.70	
		EQUINIX INC	6,951	5,358,664.92	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	950,793.20	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,664,923.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,234,834.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	2,007,605.49	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	829,293.85	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	506,464.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	915,710.95	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	876,575.12	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,519,020.00	
IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,426,851.42			

		KIMCO REALTY CORP	47,897	898,068.75	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,330,792.35	
		PROLOGIS INC	68,641	8,419,505.06	
		PUBLIC STORAGE	11,847	3,273,326.10	
		REALTY INCOME CORP	49,099	2,749,544.00	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	765,548.09	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,567	1,682,371.11	
		SIMON PROPERTY GROUP	23,439	2,595,400.47	
		SUN COMMUNITIES INC	8,423	1,044,115.08	
		UDR INC	23,815	932,833.55	
		VENTAS INC	31,565	1,359,188.90	
		VICI PROPERTIES INC	74,643	2,278,104.36	
		WELLTOWER INC	36,855	2,986,360.65	
		WP CAREY INC	16,024	1,031,144.40	
		アメリカドル 小計	900,424	67,133,736.05 (9,838,449,018)	
カナダドル		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	234,087.30	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	299,266.80	
		カナダドル 小計	20,377	533,354.10 (57,479,571)	
ユーロ		COVIVIO (FP)	4,962	208,106.28	
		GECINA SA	3,139	296,792.45	
		KLEPIERRE	17,225	406,854.50	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	491,489.55	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	329,565.28	
		ユーロ 小計	48,695	1,732,808.06 (274,251,531)	
イギリスポンド		BRITISH LAND CO PLC	79,414	249,280.54	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	329,966.11	
		SEGRO PLC	78,133	566,151.71	
		イギリスポンド 小計	213,836	1,145,398.36 (211,371,813)	
オーストラリアドル		DEXUS	94,090	715,084.00	
		GOODMAN GROUP	116,335	2,626,844.30	
		GPT GROUP	167,884	686,645.56	
		MIRVAC GROUP	266,683	624,038.22	

		SCENTRE GROUP	381,283	1,033,276.93	
		STOCKLAND	207,412	864,908.04	
		VICINITY CENTERS	305,149	553,845.43	
	オーストラリアドル 小計		1,538,836	7,104,642.48 (668,617,903)	
香港ドル	LINK REIT		166,900	6,425,650.00	
	香港ドル 小計		166,900	6,425,650.00 (120,031,142)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT		284,138	781,379.50	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		338,529	639,819.81	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST		283,189	470,093.74	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA		220,000	338,800.00	
	シンガポールドル 小計		1,125,856	2,230,093.05 (241,117,660)	
投資証券合計			4,014,924	11,411,318,638 (11,411,318,638)	
合計				11,574,645,492 (11,574,645,492)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 606 銘柄	97.7%	—	—	72.9%
	投資証券 34 銘柄	—	—	2.3%	1.7%
カナダドル	株式 85 銘柄	99.7%	—	—	3.3%
	投資証券 2 銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式 221 銘柄	99.5%	—	—	9.6%
	投資証券 5 銘柄	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79 銘柄	99.1%	—	—	4.2%
	投資証券 3 銘柄	—	—	0.9%	0.0%
スイスフラン	株式 44 銘柄	100.0%	—	—	2.9%
スウェーデンクローナ	株式 46 銘柄	100.0%	—	—	0.9%



ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.0%	—	—	1.0%
オーストラリアドル	株式 50 銘柄	93.4%	—	—	1.9%
	投資信託受 2 銘柄 益証券	—	1.0%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	5.6%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式 27 銘柄	95.4%	—	—	0.6%
	投資信託受 1 銘柄 益証券	—	1.3%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式 16 銘柄	88.3%	—	—	0.3%
	投資証券 4 銘柄	—	—	11.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9 銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 短期金融資産 マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,305,248,475
流動資産合計	10,305,248,475
資産合計	10,305,248,475
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,900,055
未払利息	23,874
流動負債合計	8,923,929
負債合計	8,923,929
純資産の部	
元本等	
元本	10,183,197,408
剰余金	

剰余金又は欠損金（△）	113,127,138
元本等合計	10,296,324,546
純資産合計	10,296,324,546
負債純資産合計	10,305,248,475

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	10,183,197,408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 1.0111円 (1万口当たり純資産額) (10,111円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年8月28日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監視部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年8月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	2023年8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年8月30日
期首元本額	11,058,963,995円
期中追加設定元本額	4,118,073,832円
期中一部解約元本額	4,993,840,419円
期末元本額	10,183,197,408円
期末元本額の内訳	
DCターゲット・イヤー ファンド2025	4,107,216,912円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	127,203,475円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	68,577,696円
バランスG(25)VA(適格機関投資家専用)	5,278,040,765円
FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	13,390,348円
ブラジル高配当株オープン(毎月決算型)	9,880,568円
米国成長株式ファンド	493,486円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,948,462円
日本株配当戦略投信2020-03(適格機関投資家専用)	230,535,890円
日本株配当戦略投信2020-09(適格機関投資家専用)	344,909,806円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2 【ファンドの現況】

### 【DCターゲット・イヤー ファンド2025】

#### 【純資産額計算書】

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	5,353,518,864円
II 負債総額	2,963,833円
III 純資産総額 (I - II)	5,350,555,031円
IV 発行済口数	4,078,284,690口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.3120円
(1万口当たり純資産額)	(13,120円)

### 【DCターゲット・イヤー ファンド2035】

#### 【純資産額計算書】

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	6,538,550,650円
II 負債総額	2,889,220円
III 純資産総額 (I - II)	6,535,661,430円
IV 発行済口数	4,180,279,534口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.5635円
(1万口当たり純資産額)	(15,635円)

### 【DCターゲット・イヤー ファンド2045】

#### 【純資産額計算書】

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	3,542,402,204円
II 負債総額	7,751,575円
III 純資産総額 (I - II)	3,534,650,629円
IV 発行済口数	2,056,596,909口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.7187円
(1万口当たり純資産額)	(17,187円)

【DCターゲット・イヤー ファンド2055】

【純資産額計算書】

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	152,591,209円
II 負債総額	63,683円
III 純資産総額 (I - II)	152,527,526円
IV 発行済口数	108,391,414口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.4072円
(1万口当たり純資産額)	(14,072円)

(参考)

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	649,199,030,943円
II 負債総額	6,436,894,364円
III 純資産総額 (I - II)	642,762,136,579円
IV 発行済口数	483,220,223,273口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.3302円
(1万口当たり純資産額)	(13,302円)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	576,561,406,217円
II 負債総額	1,590,814,436円
III 純資産総額 (I - II)	574,970,591,781円
IV 発行済口数	241,335,122,049口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.3825円
(1万口当たり純資産額)	(23,825円)

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	290,241,799,376円
II 負債総額	1,718,625,493円
III 純資産総額 (I - II)	288,523,173,883円
IV 発行済口数	88,072,918,522口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	3.2760円
(1万口当たり純資産額)	(32,760円)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	592,310,603,348円
II 負債総額	2,293,832,264円
III 純資産総額 (I - II)	590,016,771,084円
IV 発行済口数	114,550,350,613口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	5.1507円
(1万口当たり純資産額)	(51,507円)

短期金融資産 マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	9,739,564,143円
II 負債総額	614,709円
III 純資産総額 (I - II)	9,738,949,434円
IV 発行済口数	9,632,569,541口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.0110円
(1万口当たり純資産額)	(10,110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。

###### ① 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。

###### ② 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。

###### ③ 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。

###### ④ 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。

###### ⑤ 償還金

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

###### ⑥ 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2023年9月29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

###### ①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、招集の手續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。

###### ②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、各運用部において、ファンドマネージャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定しま



す。

#### [DO (実行)]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [CHECK (検証・評価)]

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

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

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

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

委託会社の機構は 2023 年 11 月 28 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。

2023 年 9 月 29 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	530	14,341,707
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	215,927
単位型公社債投資信託	51	169,297
合計	648	14,726,931

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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。

# 独立監査人の監査報告書

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37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2023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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1 289	※1 255
器具備品	※1 687	※1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49
未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	△509	△510
評価・換算差額等合計	431	△460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918
その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	—	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	—
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	—	565
その他	8	11
営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	—
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	—
特別損失合計	120	—
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	△465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448



## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	—	—	—
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	△65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				△2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	△444	△295	△295
当期変動額合計	149	△444	△295	3,394
当期末残高	941	△509	431	64,219

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	—	—	—
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			△2,641	△2,641	△2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	△509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				△2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△891	△0	△891	△891
当期変動額合計	△891	△0	△891	1,915
当期末残高	49	△510	△460	66,134

## 注記事項

(重要な会計方針)

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

### 7. 収益及び費用の計上基準

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

#### (1) 投資信託委託業務

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

#### (2) 投資一任業務

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

#### (3) 投資助言業務

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

#### (4) 成功報酬

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

### 8. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

#### (3) ヘッジ方針

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

#### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「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、「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載していません。

(表示方法の変更)

(貸借対照表関係)

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建 物	146 百万円	184 百万円
器具備品	535 "	681 "
計	681 "	866 "

(株主資本等変動計算書関係)

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

(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
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月22日 定時株主総会	普通 株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(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)

### 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。

##### ①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

##### ②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。

##### ③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

### 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1) \*2、\*3及び(注2)参照）。

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債  
前事業年度 (2022年3月31日)

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 投資有価証券のうち、投資信託 (貸借対照表計上額 6,474 百万円) 及び組合出資金等 (貸借対照表計上額 133 百万円) は上記に含めておりません。

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

(\*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度 (2023年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	—	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	3,844	—	3,844
資産計	1,029	16,547	—	17,577
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	—	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	—	(88)	—	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	—	(147)

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額は 960 百万円) は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 14,693 百万円であります。

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

(\*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル 1 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

(注 2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(注 3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度 (2022年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	—	—	—
未収委託者報酬	9,067	—	—	—
未収運用受託報酬	6,252	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	108	1,712	0

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

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

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636



2. その他有価証券

前事業年度 (2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	△292
小計	2,857	3,150	△292
合計	3,844	3,772	71

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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

## (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 (2022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)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	—	△54	△54
	英ポンド	277	—	△1	△1
	カナダドル	111	—	△1	△1
	スイスフラン	139	—	△2	△2
	香港ドル	190	—	△1	△1
	ユーロ	676	—	△18	△18
	買建 ユーロ	21	—	0	0
	合計	6,915	—	△80	△80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	—	△21	△21
	英ポンド	256	—	△6	△6
	カナダドル	109	—	△1	△1
	スイスフラン	163	—	△2	△2
	香港ドル	202	—	△0	△0
	ユーロ	651	—	△19	△19
	買建 米ドル	152	—	3	3
	合計	7,458	—	△48	△48

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (2) 株式関連

前事業年度 (2022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	17,197	—	△1,333	△1,333
合計		17,197	—	△1,333	△1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	—	△9	△9
	債券先物取引 売建	182	—	△0	△0
合計		12,378	—	△10	△10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 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 (2022年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	—	△43
	英ポンド		3,297	—	△21
	スイスフラン		79	—	△1
	香港ドル		119	—	△1
	ユーロ		125	—	△3
	人民元		13	—	△0
合計			8,057	—	△71

当事業年度 (2023年3月31日)

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

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	—	6
退職給付の支払額	△81	△57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
退職給付債務の期末残高	820	911

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	—	△6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度 100 百万円、当事業年度 109 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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	〃	187	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	〃	277	〃
税務上の収益認識差額	74	〃	—	〃
税務上の費用認識差額	439		412	
繰延ヘッジ損益	224	〃	225	〃
その他	76	〃	75	〃
繰延税金資産 合計	1,357	〃	1,236	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△415	〃	△21	〃
その他	△34	〃	△32	〃
繰延税金負債 合計	△450	〃	△54	〃
繰延税金資産の純額	907	〃	1,181	〃

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の 100 分の 5 以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、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 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395 百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395 百万円

(\*)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887 百万円

[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 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 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。

② 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 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	—	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 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。

② 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（2022 年 3 月 31 日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2023 年 3 月 31 日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
1 株当たり純資産額	21,406,512 円 22 銭	22,044,962 円 63 銭
1 株当たり当期純利益金額	2,162,405 円 20 銭	1,816,227 円 49 銭

(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
当期純利益	6,487 百万円	5,448 百万円
普通株主に帰属しない金額	—	—
普通株式に係る当期純利益	6,487 百万円	5,448 百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000 株	3,000 株

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

##### (1) 自己又はその役員との取引

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

##### (2) 運用財産相互間の取引

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

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

通常の見取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

2023年11月28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。



追加型証券投資信託  
DC ターゲット・イヤー ファンド 2025  
約款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## 運用の基本方針

約款第 18 条にもとづき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」受益証券	48%
「国内株式インデックス マザーファンド」受益証券	28%
「外国債券インデックス マザーファンド」受益証券	5%
「外国株式インデックス マザーファンド」受益証券	14%
「短期金融資産 マザーファンド」受益証券	5%

③2025 年 8 月の決算日の翌日（第 19 計算期間開始日）を安定運用開始時期（以下「ターゲット・イヤー」といいます。）とし、当初設定以降、ターゲット・イヤーに近づくにしたがい、定期的に各マザーファンド受益証券の基本組入比率を変更することで、株式の実質組入れを漸減し、公社債および短期金融資産等の実質組入れを漸増することにより、株価等の変動リスクの低減を図ることを基本とします。なお、各マザーファンド受益証券の基本組入比率の最終決定は、1 年に 1 回、市場構造および市場環境の変化等を考慮した上で行います。

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

⑤各マザーファンド受益証券の各年の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

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

⑦投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内にお

いて行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

- ⑧投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑨投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- ⑩ただし、資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### (3)運用制限

- ①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の55%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### 3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

(3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託  
DC ターゲット・イヤー ファンド 2025  
約款

**(信託の種類、委託者および受託者)**

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

②この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）の適用を受けます。

**(信託事務の委託)**

第 2 条 受託者は、信託法第 26 条第 1 項にもとづく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（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。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②第 1 項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

**(信託の目的、金額および限度額)**

第 3 条 委託者は、当初設定日に金 1,000,000 円を信託し、受託者はこれを引受けます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、金 4,000 億円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託を行ったときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

**(信託期間)**

第 4 条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第 52 条第 1 項、同条第 2 項、第 53 条第 1 項、第 54 条第 1 項および第 56 条第 2 項の規定による信託終了の日までとします。

**(受益権の分割および再分割)**

第 5 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権については 1,000,000 口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

**(受益権の取得申込みの勧誘の種類)**

第 6 条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

②（削除）

**(受益者)**

第 7 条 この投資信託契約締結当初の受益者は委託者のみとします。なお委託者は確定拠出年金法第 86 条に規定される税制上の措置の対象外となります。

②追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 5 条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

- ③受益権取得申込者は、指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）と別に定める「自動けいぞく投資約款」に従って契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結するものとします。

#### （追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法）

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た金額とします。

- ②この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第 28 条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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ます。

- ③第 31 条に規定する為替予約の評価は、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るものとします。

#### （信託日時の異なる受益権の内容）

第 9 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

#### （受益権の帰属と受益証券の不発行）

第 10 条 この信託のすべての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第 2 条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ②委託者は、この信託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また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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③委託者は、第 5 条第 1 項の規定により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または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

#### （受益権の設定に係る受託者の通知）

第 11 条 受託者は、投資信託契約締結日に生じた受益権については投資信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

**(受益権の申込単位、価額および手数料)**

第 12 条 指定販売会社は、第 5 条第 1 項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対しては、1 口の整数倍をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

②第 1 項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第 3 項または第 5 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）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または記録を行うことができます。

③第 1 項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日の取得申込に係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

④第 3 項の手数料の額は、指定販売会社が別に定めるところによるものとします。

⑤第 3 項の規定にかかわらず、受益者が別に定め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取得価額は、原則として、第 41 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥第 1 項から第 5 項の規定にかかわらず、取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 17 項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

**(受益権の譲渡に係る記載または記録)**

第 13 条 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また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。

②第 1 項の申請のある場合には、第 1 項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、第 1 項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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③委託者は、第 1 項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載また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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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)**

第 14 条 受益権の譲渡は、第 13 条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

### (投資の対象とする資産の種類)

第 15 条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 1 項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、投資信託約款第 23 条、第 24 条および第 25 条に定めるものに限りません。）
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

### (運用の指図範囲等)

第 16 条 委託者は、信託金を主として次に掲げる第 1 号から第 5 号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）ならびに第 6 号から第 27 号までの有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 短期金融資産 マザーファンド
6. 株券または新株引受権証券
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人の発行する債券
10. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
11. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
12. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
13. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
14. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
15. コマーシャル・ペーパー
16. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券



17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 6 号から第 16 号までの証券または証書の性質を有するもの
  18. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
  19. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
  20. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
  21. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
  22. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
  23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  24. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
  25. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
  26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  27. 外国の者に対する権利で第 26 号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第 6 号の証券または証書、第 17 号ならびに第 22 号の証券または証書のうち第 6 号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第 7 号から第 11 号までの証券および第 17 号ならびに第 22 号の証券または証書のうち第 7 号から第 11 号までの証券の性質を有するもの、および第 19 号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第 18 号の証券および第 19 号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ②委託者は、信託金を、第 1 項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前号の権利の性質を有するもの
  - ③第 1 項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
  - ④委託者は、投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 55 を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により 100 分の 55 を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。
  - ⑤委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。以下同

じ。)の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥委託者は、取得時において、投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑦第4項から第6項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (受託者の自己または利害関係人等との取引)

第17条 受託者は、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ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（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。以下この条および第32条において同じ。）、第32条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条および第16条第1項ならびに第2項に定める資産への投資を、信託財産を害するおそれがないと認められる取引として行うことができます。

②第1項に定める信託財産を害するおそれがないと認められる取引とは、次の各号のいずれかに該当する場合をいいます。

1. 取引所価格（気配値等を含みます。）等の適正な価格による取引であること。
2. 受託者の店頭に表示する利率等の公正な条件によること。
3. 第1号および第2号に該当しない場合で、委託者が適正な条件であると判断する場合であること。

③第1項および第2項の取扱いは、第22条から第28条までおよび第31条ならびに第36条および第37条における委託者の指図による取引についても同様とします。

#### (運用の基本方針)

第18条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

#### (投資する株式等の範囲)

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②第1項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとし、

#### (同一銘柄の株式等への投資制限)

第20条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信

託財産の純資産総額の 100 分の 10 を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②委託者は、取得時において、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。
- ③第 1 項および第 2 項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### **(同一銘柄の転換社債等への投資制限)**

第 21 条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 10 を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②第 1 項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### **(信用取引の指図範囲)**

第 22 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができますものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、かつ

- ②第 1 項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、かつ
1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使より取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
  6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（第 5 号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### **(先物取引等の運用指図、目的および範囲)**

第 23 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項

第 3 号ハに掲げるものをいいます。) ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。(以下同じ。)

- ②委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことを指図することができます。
- ③委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### (スワップ取引の運用指図、目的、および範囲)

第 24 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- ②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、原則として第 4 条に定める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。
- ③スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④第 3 項においてマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤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。
- ⑥委託者は、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、目的および範囲)

第 25 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決算日が原則として第 4 条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能な

ものについてはこの限りではありません。

- ③金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④第 3 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が、純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥第 5 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑦金利先渡取引およ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。
- ⑧委託者は、金利先渡取引およ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。
- ⑨本条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標

利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- ⑩本条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### **(有価証券の貸付の指図および範囲)**

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

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②第 1 項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。
- ③委託者は、有価証券の貸付にあたって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。

#### **(公社債の空売りの指図および範囲)**

第 27 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ②第 1 項の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③投資信託財産の一部解約等の事由により、第 2 項の売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

#### **(公社債の借入れ)**

第 28 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。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。

②第1項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、第2項の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

④第1項の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### (外貨建資産への投資制限)

第29条 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。有価証券の値上がり等により100分の30を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

②第1項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該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。

#### (特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第30条 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。

#### (外国為替予約の指図および範囲)

第31条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

②第1項の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

③第2項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

④第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は、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。

#### (信託業務の委託等)

第32条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められ

ること

3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
  4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、第 1 項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③第 1 項および第 2 項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限り、）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
  2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
  4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

#### **(有価証券等の保管)**

##### **第 33 条 (削除)**

#### **(混蔵寄託)**

第 34 条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第 2 条第 9 項に規定するものをいいます。本条においては、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含みます。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

#### **(投資信託財産の登記等および記載等の留保等)**

第 35 条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②第 1 項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、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。

④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。

#### **(一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)**

第 36 条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

#### **(再投資の指図)**

第 37 条 委託者は、第 36 条の規定によるマザーファンド受益証券の一部解約代金、有価証券の売却代



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、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

#### (資金の借入れ)

第38条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

③収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

#### (損益の帰属)

第39条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

#### (受託者による資金の立替え)

第40条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②投資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、株式の配当金およ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もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③第1項および第2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

#### (信託の計算期間)

第41条 この信託の計算期間は、毎年8月29日から翌年8月28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、平成19年9月26日から平成20年8月28日までとします。

②第1項の規定にかかわらず、第1項の原則により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、第4条に定める信託期間の終了日とします。

#### (投資信託財産に関する報告)

第42条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成してこれを委

託者に提出します。

#### (信託事務の諸費用)

第 43 条 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および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、第 41 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁します。

#### (信託報酬等の総額および支弁の方法)

第 44 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 41 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に、計算期間に応じ、次の各号に掲げる率を乗じて得た額とします。

1. 第 1 計算期間から第 18 計算期間まで ・ ・ ・ 年 10,000 分の 43

2. 第 19 計算期間以降 ・ ・ ・ 年 10,000 分の 21

②第 1 項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ケ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

#### (収益の分配方式)

第 45 条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### (収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第 46 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第 48 条第 1 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 48 条第 2 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、第 1 項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

#### (収益分配金の再投資)

第 47 条 受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。

②指定販売会社は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受

益権の売付けを行います。当該売付により増加した受益権は、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

- ③収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

#### (償還金および一部解約金の支払い)

第48条 償還金は、信託終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了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、当該信託終了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指定販売会社の名義で記載また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。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

- ②一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として5営業日目から受益者に支払います。
- ③第1項および第2項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。
- ④償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- ⑤第47条第3項および本条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、第47条第3項および本条第4項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

#### (償還金の時効)

第49条 受益者が、信託終了による償還金について第48条第1項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

#### (投資信託契約の一部解約)

第50条 委託者は、自己に帰属するすべての受益権を、最初に追加信託が行われた日以降、この投資信託契約の円滑な運営に支障がないと判断し次第、すみやかに一部解約します。

- ②受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。
- ③投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ④委託者は、第2項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、第2項の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者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、社振法の規定にし

たが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または記録が行われます。

- ⑤第4項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑥委託者は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第2項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑦第6項により一部解約の実行の請求の受け付け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、第5項の規定に準じて算出した価額とします。

#### (質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第51条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

#### (投資信託契約の解約)

第52条 委託者は、第4条の規定による信託終了前にこの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ときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③委託者は、第1項および第2項の事項について、あらかじめ、解約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すべ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。
- ④第3項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。
- ⑤第4項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ときは、第1項および第2項の投資信託契約の解約をしません。
- ⑥委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およ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、すべ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。
- ⑦第4項から第6項までの規定は、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、第4項の一定の期間が一月を下らずにその公告およ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。

#### (投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第53条 委託者は、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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第57条の規

定に従います。

#### (委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第54条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②第1項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第57条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者の間において存続します。

#### (委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第55条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### (受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第56条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第57条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し信託を終了させます。

#### (投資信託約款の変更)

第57条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、第1項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およ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すべ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。
- ③第2項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。
- ④第3項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、第1項の投資信託約款の変更をしません。
- ⑤委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およ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、すべ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。

#### (反対者の買取請求権)

第58条 第52条に規定する投資信託契約の解約または第57条に規定する投資信託約款の変更を行う場合において、第52条第4項または第57条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、指定販売会社を経由して、受託者に対し、自己に帰属する受益権を投資信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

#### (運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 58 条の 2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

**(公告)**

第 59 条 委託者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。

**(投資信託約款に関する疑義の取扱い)**

第 60 条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めま

す。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 19 年 9 月 26 日

委託者 住信アセットマネジメント株式会社

受託者 住友信託銀行株式会社

追加型証券投資信託  
DC ターゲット・イヤー ファンド 2035  
約款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## 運用の基本方針

約款第 18 条にもとづき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」受益証券	33%
「国内株式インデックス マザーファンド」受益証券	38%
「外国債券インデックス マザーファンド」受益証券	5%
「外国株式インデックス マザーファンド」受益証券	19%
「短期金融資産 マザーファンド」受益証券	5%

③2035 年 8 月の決算日の翌日（第 29 計算期間開始日）を安定運用開始時期（以下「ターゲット・イヤー」といいます。）とし、当初設定以降、ターゲット・イヤーに近づくにしたがい、定期的に各マザーファンド受益証券の基本組入比率を変更することで、株式の実質組入れを漸減し、公社債および短期金融資産等の実質組入れを漸増することにより、株価等の変動リスクの低減を図ることを基本とします。なお、各マザーファンド受益証券の基本組入比率の最終決定は、1 年に 1 回、市場構造および市場環境の変化等を考慮した上で行います。

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

⑤各マザーファンド受益証券の各年の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

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

⑦投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内にお



いて行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

- ⑧投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑨投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- ⑩ただし、資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### (3)運用制限

- ①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の70%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### 3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

(3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託  
DC ターゲット・イヤー ファンド 2035  
約款

**(信託の種類、委託者および受託者)**

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

②この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）の適用を受けます。

**(信託事務の委託)**

第 2 条 受託者は、信託法第 26 条第 1 項にもとづく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（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。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②第 1 項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

**(信託の目的、金額および限度額)**

第 3 条 委託者は、当初設定日に金 1,000,000 円を信託し、受託者はこれを引受けます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、金 4,000 億円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託を行ったときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

**(信託期間)**

第 4 条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第 52 条第 1 項、同条第 2 項、第 53 条第 1 項、第 54 条第 1 項および第 56 条第 2 項の規定による信託終了の日までとします。

**(受益権の分割および再分割)**

第 5 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権については 1,000,000 口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

**(受益権の取得申込みの勧誘の種類)**

第 6 条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

②（削除）

**(受益者)**

第 7 条 この投資信託契約締結当初の受益者は委託者のみとします。なお委託者は確定拠出年金法第 86 条に規定される税制上の措置の対象外となります。

②追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 5 条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

- ③受益権取得申込者は、指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）と別に定める「自動けいぞく投資約款」に従って契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結するものとします。

#### （追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法）

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た金額とします。

- ②この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第 28 条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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ます。

- ③第 31 条に規定する為替予約の評価は、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るものとします。

#### （信託日時の異なる受益権の内容）

第 9 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

#### （受益権の帰属と受益証券の不発行）

第 10 条 この信託のすべての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第 2 条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ②委託者は、この信託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また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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③委託者は、第 5 条第 1 項の規定により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または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

#### （受益権の設定に係る受託者の通知）

第 11 条 受託者は、投資信託契約締結日に生じた受益権については投資信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

**(受益権の申込単位、価額および手数料)**

第 12 条 指定販売会社は、第 5 条第 1 項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対しては、1 口の整数倍をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

②第 1 項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第 3 項または第 5 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）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または記録を行うことができます。

③第 1 項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日の取得申込に係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

④第 3 項の手数料の額は、指定販売会社が別に定めるところによるものとします。

⑤第 3 項の規定にかかわらず、受益者が別に定め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取得価額は、原則として、第 41 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥第 1 項から第 5 項の規定にかかわらず、取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 17 項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

**(受益権の譲渡に係る記載または記録)**

第 13 条 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また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。

②第 1 項の申請のある場合には、第 1 項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、第 1 項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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③委託者は、第 1 項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載また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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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)**

第 14 条 受益権の譲渡は、第 13 条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

### (投資の対象とする資産の種類)

第 15 条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

### (運用の指図範囲等)

第 16 条 委託者は、信託金を主として次に掲げる第 1 号から第 5 号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）ならびに第 6 号から第 27 号までの有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド

2. 国内株式インデックス マザーファンド

3. 外国債券インデックス マザーファンド

4. 外国株式インデックス マザーファンド

5. 短期金融資産 マザーファンド

6. 株券または新株引受権証券

7. 国債証券

8. 地方債証券

9. 特別の法律により法人の発行する債券

10. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

11. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）

12. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）

13. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）

14. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）

15. コマーシャル・ペーパー

16. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 6 号から第 16 号までの証券または証書の性質を有するもの
  18. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
  19. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
  20. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
  21. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
  22. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
  23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  24. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
  25. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
  26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  27. 外国の者に対する権利で第 26 号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第 6 号の証券または証書、第 17 号ならびに第 22 号の証券または証書のうち第 6 号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第 7 号から第 11 号までの証券および第 17 号ならびに第 22 号の証券または証書のうち第 7 号から第 11 号までの証券の性質を有するもの、および第 19 号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第 18 号の証券および第 19 号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ②委託者は、信託金を、第 1 項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前号の権利の性質を有するもの
  - ③第 1 項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
  - ④委託者は、投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 70 を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により 100 分の 70 を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。
  - ⑤委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。以下同

じ。)の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥委託者は、取得時において、投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑦第4項から第6項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (受託者の自己または利害関係人等との取引)

第17条 受託者は、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ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（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。以下この条および第32条において同じ。）、第32条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条および第16条第1項ならびに第2項に定める資産への投資を、信託財産を害するおそれがないと認められる取引として行うことができます。

②第1項に定める信託財産を害するおそれがないと認められる取引とは、次の各号のいずれかに該当する場合をいいます。

1. 取引所価格（気配値等を含みます。）等の適正な価格による取引であること。
2. 受託者の店頭に表示する利率等の公正な条件によること。
3. 第1号および第2号に該当しない場合で、委託者が適正な条件であると判断する場合であること。

③第1項および第2項の取扱いは、第22条から第28条までおよび第31条ならびに第36条および第37条における委託者の指図による取引についても同様とします。

#### (運用の基本方針)

第18条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

#### (投資する株式等の範囲)

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②第1項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとし、

#### (同一銘柄の株式等への投資制限)

第20条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信



託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②委託者は、取得時において、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ③第1項および第2項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第21条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②第1項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (信用取引の指図範囲)

第22条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができますものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、かつ

- ②第1項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、かつ
1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使より取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
  6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（第5号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### (先物取引等の運用指図、目的および範囲)

第23条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項

第 3 号ハに掲げるものをいいます。) ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。(以下同じ。)

- ②委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことを指図することができます。
- ③委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### (スワップ取引の運用指図、目的、および範囲)

第 24 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- ②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、原則として第 4 条に定める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。
- ③スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④第 3 項においてマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤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。
- ⑥委託者は、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。

#### (金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、目的および範囲)

第 25 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決算日が原則として第 4 条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能な

ものについてはこの限りではありません。

- ③金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④第 3 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が、純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥第 5 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑦金利先渡取引およ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。
- ⑧委託者は、金利先渡取引およ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。
- ⑨本条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標

利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- ⑩本条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### **(有価証券の貸付の指図および範囲)**

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

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②第 1 項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。
- ③委託者は、有価証券の貸付にあたって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。

#### **(公社債の空売りの指図および範囲)**

第 27 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ②第 1 項の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③投資信託財産の一部解約等の事由により、第 2 項の売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

#### **(公社債の借入れ)**

第 28 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。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。

- ②第1項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③投資信託財産の一部解約等の事由により、第2項の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。
- ④第1項の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### (外貨建資産への投資制限)

第29条 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の35を超えることとなる投資の指図をしません。有価証券の値上がり等により100分の35を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

- ②第1項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該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。

#### (特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第30条 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。

#### (外国為替予約の指図および範囲)

第31条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ②第1項の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ③第2項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ④第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は、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。

#### (信託業務の委託等)

第32条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められ

ること

3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
  4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、第 1 項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③第 1 項および第 2 項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限り、）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
  2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
  4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

#### **（有価証券等の保管）**

##### **第 33 条 （削除）**

#### **（混蔵寄託）**

第 34 条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第 2 条第 9 項に規定するものをいいます。本条においては、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含みます。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

#### **（投資信託財産の登記等および記載等の留保等）**

第 35 条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②第 1 項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、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。

④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。

#### **（一部解約の請求および有価証券の売却等の指図）**

第 36 条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

#### **（再投資の指図）**

第 37 条 委託者は、第 36 条の規定によるマザーファンド受益証券の一部解約代金、有価証券の売却代

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、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

#### (資金の借入れ)

第38条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

③収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

#### (損益の帰属)

第39条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

#### (受託者による資金の立替え)

第40条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②投資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、株式の配当金およ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もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③第1項および第2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

#### (信託の計算期間)

第41条 この信託の計算期間は、毎年8月29日から翌年8月28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、平成19年9月26日から平成20年8月28日までとします。

②第1項の規定にかかわらず、第1項の原則により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、第4条に定める信託期間の終了日とします。

#### (投資信託財産に関する報告)

第42条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成してこれを委

託者に提出します。

#### (信託事務の諸費用)

第 43 条 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および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、第 41 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁します。

#### (信託報酬等の総額および支弁の方法)

第 44 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 41 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に、計算期間に応じ、次の各号に掲げる率を乗じて得た額とします。

1. 第 1 計算期間から第 28 計算期間まで ・ ・ ・ 年 10,000 分の 43

2. 第 29 計算期間以降 ・ ・ ・ 年 10,000 分の 21

②第 1 項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ケ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

#### (収益の分配方式)

第 45 条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### (収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第 46 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第 48 条第 1 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 48 条第 2 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、第 1 項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

#### (収益分配金の再投資)

第 47 条 受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。

②指定販売会社は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受



益権の売付けを行います。当該売付により増加した受益権は、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

- ③収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

#### (償還金および一部解約金の支払い)

第48条 償還金は、信託終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了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、当該信託終了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指定販売会社の名義で記載また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。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

- ②一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として5営業日目から受益者に支払います。
- ③第1項および第2項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。
- ④償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- ⑤第47条第3項および本条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、第47条第3項および本条第4項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

#### (償還金の時効)

第49条 受益者が、信託終了による償還金について第48条第1項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

#### (投資信託契約の一部解約)

第50条 委託者は、自己に帰属するすべての受益権を、最初に追加信託が行われた日以降、この投資信託契約の円滑な運営に支障がないと判断し次第、すみやかに一部解約します。

- ②受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。
- ③投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ④委託者は、第2項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、第2項の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者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、社振法の規定にし

たが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または記録が行われます。

- ⑤第4項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑥委託者は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第2項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑦第6項により一部解約の実行の請求の受け付け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、第5項の規定に準じて算出した価額とします。

#### (質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第51条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

#### (投資信託契約の解約)

第52条 委託者は、第4条の規定による信託終了前にこの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ときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回るようになった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③委託者は、第1項および第2項の事項について、あらかじめ、解約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すべ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。
- ④第3項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。
- ⑤第4項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ときは、第1項および第2項の投資信託契約の解約をしません。
- ⑥委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およ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、すべ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。
- ⑦第4項から第6項までの規定は、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、第4項の一定の期間が一月を下らずにその公告およ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。

#### (投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第53条 委託者は、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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第57条の規

定に従います。

#### (委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第54条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②第1項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第57条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者の間において存続します。

#### (委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第55条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### (受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第56条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第57条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し信託を終了させます。

#### (投資信託約款の変更)

第57条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、第1項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およ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すべ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。

- ③第2項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。

- ④第3項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、第1項の投資信託約款の変更をしません。

- ⑤委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およ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、すべ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。

#### (反対者の買取請求権)

第58条 第52条に規定する投資信託契約の解約または第57条に規定する投資信託約款の変更を行う場合において、第52条第4項または第57条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、指定販売会社を経由して、受託者に対し、自己に帰属する受益権を投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

#### (運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 58 条の 2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

**(公告)**

第 59 条 委託者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。

**(投資信託約款に関する疑義の取扱い)**

第 60 条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めま

す。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 19 年 9 月 26 日

委託者 住信アセットマネジメント株式会社

受託者 住友信託銀行株式会社

追加型証券投資信託  
DC ターゲット・イヤー ファンド 2045  
約款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## 運用の基本方針

約款第 18 条にもとづき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」受益証券	18%
「国内株式インデックス マザーファンド」受益証券	48%
「外国債券インデックス マザーファンド」受益証券	5%
「外国株式インデックス マザーファンド」受益証券	24%
「短期金融資産 マザーファンド」受益証券	5%

③2045 年 8 月の決算日の翌日（第 39 計算期間開始日）を安定運用開始時期（以下「ターゲット・イヤー」といいます。）とし、当初設定以降、ターゲット・イヤーに近づくにしたがい、定期的に各マザーファンド受益証券の基本組入比率を変更することで、株式の実質組入れを漸減し、公社債および短期金融資産等の実質組入れを漸増することにより、株価等の変動リスクの低減を図ることを基本とします。なお、各マザーファンド受益証券の基本組入比率の最終決定は、1 年に 1 回、市場構造および市場環境の変化等を考慮した上で行います。

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

⑤各マザーファンド受益証券の各年の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

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

⑦投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内にお

いて行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

- ⑧投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑨投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- ⑩ただし、資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### (3)運用制限

- ①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以下とします。
- ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### 3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

(3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。



追加型証券投資信託  
DC ターゲット・イヤー ファンド 2045  
約款

**(信託の種類、委託者および受託者)**

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

②この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）の適用を受けます。

**(信託事務の委託)**

第 2 条 受託者は、信託法第 26 条第 1 項にもとづく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（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。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②第 1 項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

**(信託の目的、金額および限度額)**

第 3 条 委託者は、当初設定日に金 1,000,000 円を信託し、受託者はこれを引受けます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、金 4,000 億円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託を行ったときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

**(信託期間)**

第 4 条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第 52 条第 1 項、同条第 2 項、第 53 条第 1 項、第 54 条第 1 項および第 56 条第 2 項の規定による信託終了の日までとします。

**(受益権の分割および再分割)**

第 5 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権については 1,000,000 口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

**(受益権の取得申込みの勧誘の種類)**

第 6 条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

②（削除）

**(受益者)**

第 7 条 この投資信託契約締結当初の受益者は委託者のみとします。なお委託者は確定拠出年金法第 86 条に規定される税制上の措置の対象外となります。

②追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 5 条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

- ③受益権取得申込者は、指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）と別に定める「自動けいぞく投資約款」に従って契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結するものとしします。

#### （追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法）

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た金額とします。

- ②この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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ます。

- ③第31条に規定する為替予約の評価は、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るものとしします。

#### （信託日時の異なる受益権の内容）

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

#### （受益権の帰属と受益証券の不発行）

第10条 この信託のすべての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ②委託者は、この信託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また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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとしします。

- ③委託者は、第5条第1項の規定により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また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します。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

#### （受益権の設定に係る受託者の通知）

第11条 受託者は、投資信託契約締結日に生じた受益権については投資信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

**(受益権の申込単位、価額および手数料)**

第 12 条 指定販売会社は、第 5 条第 1 項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対しては、1 口の整数倍をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

②第 1 項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第 3 項または第 5 項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）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または記録を行うことができます。

③第 1 項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日の取得申込に係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

④第 3 項の手数料の額は、指定販売会社が別に定めるところによるものとします。

⑤第 3 項の規定にかかわらず、受益者が別に定め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取得価額は、原則として、第 41 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥第 1 項から第 5 項の規定にかかわらず、取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 17 項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

**(受益権の譲渡に係る記載または記録)**

第 13 条 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また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。

②第 1 項の申請のある場合には、第 1 項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、第 1 項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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③委託者は、第 1 項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載また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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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)**

第 14 条 受益権の譲渡は、第 13 条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

### (投資の対象とする資産の種類)

第 15 条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 1 項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、投資信託約款第 23 条、第 24 条および第 25 条に定めるものに限ります。）
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

### (運用の指図範囲等)

第 16 条 委託者は、信託金を主として次に掲げる第 1 号から第 5 号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）ならびに第 6 号から第 27 号までの有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 短期金融資産 マザーファンド
6. 株券または新株引受権証券
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人の発行する債券
10. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
11. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
12. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
13. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
14. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
15. コマーシャル・ペーパー
16. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 6 号から第 16 号までの証券または証書の性質を有するもの
  18. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
  19. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
  20. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
  21. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
  22. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
  23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  24. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
  25. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
  26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  27. 外国の者に対する権利で第 26 号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第 6 号の証券または証書、第 17 号ならびに第 22 号の証券または証書のうち第 6 号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第 7 号から第 11 号までの証券および第 17 号ならびに第 22 号の証券または証書のうち第 7 号から第 11 号までの証券の性質を有するもの、および第 19 号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第 18 号の証券および第 19 号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ②委託者は、信託金を、第 1 項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前号の権利の性質を有するもの
  - ③第 1 項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
  - ④委託者は、投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 85 を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により 100 分の 85 を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。
  - ⑤委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。以下同

じ。)の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥委託者は、取得時において、投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑦第4項から第6項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (受託者の自己または利害関係人等との取引)

第17条 受託者は、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ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（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。以下この条および第32条において同じ。）、第32条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条および第16条第1項ならびに第2項に定める資産への投資を、信託財産を害するおそれがないと認められる取引として行うことができます。

②第1項に定める信託財産を害するおそれがないと認められる取引とは、次の各号のいずれかに該当する場合をいいます。

1. 取引所価格（気配値等を含みます。）等の適正な価格による取引であること。
2. 受託者の店頭に表示する利率等の公正な条件によること。
3. 第1号および第2号に該当しない場合で、委託者が適正な条件であると判断する場合であること。

③第1項および第2項の取扱いは、第22条から第28条までおよび第31条ならびに第36条および第37条における委託者の指図による取引についても同様とします。

#### (運用の基本方針)

第18条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

#### (投資する株式等の範囲)

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②第1項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとし、

#### (同一銘柄の株式等への投資制限)

第20条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信

託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②委託者は、取得時において、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ③第1項および第2項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第21条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②第1項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (信用取引の指図範囲)

第22条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができますものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、

- ②第1項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、
1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使より取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
  6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（第5号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### (先物取引等の運用指図、目的および範囲)

第23条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項

第 3 号ハに掲げるものをいいます。) ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。(以下同じ。)

- ②委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことを指図することができます。
- ③委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### (スワップ取引の運用指図、目的、および範囲)

第 24 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- ②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、原則として第 4 条に定める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。
- ③スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④第 3 項においてマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤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。
- ⑥委託者は、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。

#### (金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、目的および範囲)

第 25 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決算日が原則として第 4 条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能な



ものについてはこの限りではありません。

- ③金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④第 3 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が、純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥第 5 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑦金利先渡取引およ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。
- ⑧委託者は、金利先渡取引およ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。
- ⑨本条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標

利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- ⑩本条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### **(有価証券の貸付の指図および範囲)**

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

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②第 1 項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。
- ③委託者は、有価証券の貸付にあたって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。

#### **(公社債の空売りの指図および範囲)**

第 27 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ②第 1 項の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③投資信託財産の一部解約等の事由により、第 2 項の売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

#### **(公社債の借入れ)**

第 28 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。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。

②第1項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、第2項の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

④第1項の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### (外貨建資産への投資制限)

第29条 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の40を超えることとなる投資の指図をしません。有価証券の値上がり等により100分の40を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

②第1項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該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。

#### (特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第30条 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。

#### (外国為替予約の指図および範囲)

第31条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

②第1項の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

③第2項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

④第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は、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。

#### (信託業務の委託等)

第32条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められ

ること

3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
  4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、第 1 項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③第 1 項および第 2 項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
  2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
  4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

#### **(有価証券等の保管)**

##### **第 33 条 （削除）**

#### **(混蔵寄託)**

第 34 条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第 2 条第 9 項に規定するものをいいます。本条においては、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含みます。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

#### **(投資信託財産の登記等および記載等の留保等)**

第 35 条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ②第 1 項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③投資信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、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。
- ④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。

#### **(一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)**

第 36 条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

#### **(再投資の指図)**

第 37 条 委託者は、第 36 条の規定によるマザーファンド受益証券の一部解約代金、有価証券の売却代

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、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

#### (資金の借入れ)

第38条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ②一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ③収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

#### (損益の帰属)

第39条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

#### (受託者による資金の立替え)

第40条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ②投資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、株式の配当金およ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もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。
- ③第1項および第2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

#### (信託の計算期間)

第41条 この信託の計算期間は、毎年8月29日から翌年8月28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、平成19年9月26日から平成20年8月28日までとします。

- ②第1項の規定にかかわらず、第1項の原則により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、第4条に定める信託期間の終了日とします。

#### (投資信託財産に関する報告)

第42条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

- ②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成してこれを委

託者に提出します。

#### (信託事務の諸費用)

第 43 条 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および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、第 41 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁します。

#### (信託報酬等の総額および支弁の方法)

第 44 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 41 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に、計算期間に応じ、次の各号に掲げる率を乗じて得た額とします。

1. 第 1 計算期間から第 38 計算期間まで ・ ・ ・ 年 10,000 分の 43

2. 第 39 計算期間以降 ・ ・ ・ 年 10,000 分の 21

②第 1 項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ケ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

#### (収益の分配方式)

第 45 条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### (収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第 46 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第 48 条第 1 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 48 条第 2 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、第 1 項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

#### (収益分配金の再投資)

第 47 条 受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。

②指定販売会社は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受

益権の売付けを行います。当該売付により増加した受益権は、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

- ③収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

#### (償還金および一部解約金の支払い)

第48条 償還金は、信託終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了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、当該信託終了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指定販売会社の名義で記載また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。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

- ②一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として5営業日目から受益者に支払います。
- ③第1項および第2項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。
- ④償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- ⑤第47条第3項および本条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、第47条第3項および本条第4項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

#### (償還金の時効)

第49条 受益者が、信託終了による償還金について第48条第1項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

#### (投資信託契約の一部解約)

第50条 委託者は、自己に帰属するすべての受益権を、最初に追加信託が行われた日以降、この投資信託契約の円滑な運営に支障がないと判断し次第、すみやかに一部解約します。

- ②受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。
- ③投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ④委託者は、第2項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、第2項の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者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、社振法の規定にし

たが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または記録が行われます。

⑤第4項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑥委託者は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第2項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

⑦第6項により一部解約の実行の請求の受け付け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、第5項の規定に準じて算出した価額とします。

#### (質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第51条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

#### (投資信託契約の解約)

第52条 委託者は、第4条の規定による信託終了前にこの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ときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回るようになった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

③委託者は、第1項および第2項の事項について、あらかじめ、解約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すべ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。

④第3項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。

⑤第4項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、第1項および第2項の投資信託契約の解約をしません。

⑥委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およ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、すべ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。

⑦第4項から第6項までの規定は、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、第4項の一定の期間が一月を下らずにその公告およ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。

#### (投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第53条 委託者は、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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第57条の規



定に従います。

#### (委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第54条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②第1項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第57条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者の間において存続します。

#### (委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第55条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### (受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第56条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第57条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し信託を終了させます。

#### (投資信託約款の変更)

第57条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、第1項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およ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すべ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。

- ③第2項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。

- ④第3項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、第1項の投資信託約款の変更をしません。

- ⑤委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およ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、すべ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。

#### (反対者の買取請求権)

第58条 第52条に規定する投資信託契約の解約または第57条に規定する投資信託約款の変更を行う場合において、第52条第4項または第57条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、指定販売会社を経由して、受託者に対し、自己に帰属する受益権を投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

#### (運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 58 条の 2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

**(公告)**

第 59 条 委託者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。

**(投資信託約款に関する疑義の取扱い)**

第 60 条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めま

す。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 19 年 9 月 26 日

委託者 住信アセットマネジメント株式会社

受託者 住友信託銀行株式会社

追加型証券投資信託  
DC ターゲット・イヤー ファンド 2055  
約款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## 運用の基本方針

約款第 18 条にもとづき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」受益証券	18.75%
「国内株式インデックス マザーファンド」受益証券	47.50%
「外国債券インデックス マザーファンド」受益証券	5.00%
「外国株式インデックス マザーファンド」受益証券	23.75%
「短期金融資産 マザーファンド」受益証券	5.00%

③2055 年 8 月の決算日の翌日（第 39 計算期間開始日）を安定運用開始時期（以下「ターゲット・イヤー」といいます。）とし、当初設定以降、ターゲット・イヤーに近づくにしたがい、定期的に各マザーファンド受益証券の基本組入比率を変更することで、株式の実質組入れを漸減し、公社債および短期金融資産等の実質組入れを漸増することにより、株価等の変動リスクの低減を図ることを基本とします。なお、各マザーファンド受益証券の基本組入比率の最終決定は、1 年に 1 回、市場構造および市場環境の変化等を考慮した上で行います。

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

⑤各マザーファンド受益証券の各年の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

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

⑦投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション

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

⑧投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑨投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

⑩ただし、資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

### (3)運用制限

①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。

②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以下とします。

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### 3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。

#### (1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

#### (2) 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

#### (3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託  
DC ターゲット・イヤー ファンド 2055  
約款

**(信託の種類、委託者および受託者)**

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

②この信託は、信託法（平成 18 年法律第 108 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

**(信託事務の委託)**

第 2 条 受託者は、信託法第 28 条第 1 号にもとづく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 2 条第 1 項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。以下本条、第 17 条第 1 項、第 17 条第 2 項および第 32 条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②第 1 項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

**(信託の目的、金額および限度額)**

第 3 条 委託者は、金 50 万円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、金 4,000 億円を限度として信託金を追加することができます。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

**(信託期間)**

第 4 条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第 52 条第 1 項、第 52 条第 2 項、第 53 条第 1 項、第 54 条第 1 項および第 56 条第 2 項の規定による信託終了の日までとします。

**(受益権の取得申込みの勧誘の種類)**

第 5 条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

**(受益者)**

第 6 条 この投資信託契約締結当初の受益者は委託者のみとします。なお委託者は確定拠出年金法第 86 条に規定される税制上の措置の対象外となります。

②追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 7 条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

③受益権取得申込者は、販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）と別に定める「自動けいぞく投資約款」に従って契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結するものとします。

**(受益権の分割および再分割)**

第 7 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権については 50 万円を上限として、追加信託によって生じ

た受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受託者と協議のうえ、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。

#### (追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法)

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た金額とします。

②この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第 28 条に規定する借入公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、外国通貨表示の預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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ます。

③第 31 条に規定する為替予約の評価は、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るものとします。

#### (信託日時の異なる受益権の内容)

第 9 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

#### (受益権の帰属と受益証券の不発行)

第 10 条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第 2 条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

②委託者は、この信託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また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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③委託者は、第 7 条の規定により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または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

#### (受益権の設定に係る受託者の通知)

第 11 条 受託者は、この投資信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

#### (受益権の申込単位および価額)



第12条 販売会社は、第7条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口の整数倍をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

②第1項の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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また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（第3項または第4項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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または記録を行うことができます。

③第1項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込みに係る当該価額は、1口につき1円とします。

④第3項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約にもとづいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第40条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤第1項から第4項の規定にかかわらず、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託者は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### （受益権の譲渡に係る記載または記録）

第13条 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また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。

②第1項の申請のある場合には、第1項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、第1項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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載また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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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）

第14条 受益権の譲渡は、第13条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

#### （投資の対象とする資産の種類）

第15条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投

資信託約款第 23 条、第 24 条および第 25 条に定めるものに限ります。)

- ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ. 為替手形

(運用の指図範囲等)

第 16 条 委託者は、信託金を主として次に掲げる第 1 号から第 5 号までの三井住友トラスト・アセット マネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券(以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。)ならびに第 6 号から第 27 号までの有価証券(金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 短期金融資産 マザーファンド
6. 株券または新株引受権証書
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人の発行する債券
10. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
11. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。)
12. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。)
13. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。)
14. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。)
15. コマーシャル・ペーパー
16. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 6 号から第 16 号までの証券または証書の性質を有するもの
18. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。)
19. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。)

20. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
21. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
22. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
24. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
25. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
27. 外国の者に対する権利で第26号の有価証券の性質を有するもの

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

- ②委託者は、信託金を、第1項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
  1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で第5号の権利の性質を有するもの
- ③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を第2項第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- ④委託者は、投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の85を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の85を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。
- ⑤委託者は、取得時において、投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。以下同じ。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑦第4項から第6項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### **（利害関係人等との取引等）**

第17条 受託者は、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ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第32条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等ならびに第22条から第28条まで、第31条および第35条から第37条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限にもとづいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができます。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等ならびに第22条から第28条まで、第31条および第35条から第37条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④第1項から第3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

#### **（運用の基本方針）**

第18条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行います。

#### **（投資する株式等の範囲）**

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②第1項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

#### **（同一銘柄の株式等への投資制限）**

第20条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と、マザーファンドの投資信託財

産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

②委託者は、取得時において、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

③第1項および第2項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第21条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

②第1項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (信用取引の指図範囲)

第22条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができますものとし、

②第1項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、

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

#### (先物取引等の運用指図、目的および範囲)

第23条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3

号口に掲げるものをいいます。) および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとしします。(以下同じ。)

②委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことを指図することができます。

③委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### (スワップ取引の運用指図、目的および範囲)

第24条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

②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、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとしします。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。

③スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとしします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとしします。

④第3項においてマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤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します。

⑥委託者は、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します。

#### (金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、目的および範囲)

第25条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。

②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として第4条に

定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。

- ③金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④第 3 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が、純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥第 5 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑦金利先渡取引およ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。
- ⑧委託者は、金利先渡取引およ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。
- ⑨本条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約にもとづく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として

定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- ⑩本条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### （有価証券の貸付の指図および範囲）

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

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②第 1 項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。
- ③委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### （公社債の空売りの指図範囲）

第 27 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債（第 28 条の規定にもとづき投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ②第 1 項の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③投資信託財産の一部解約等の事由により、第 2 項の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

#### （公社債の借入れ）

第 28 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。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たときは、担保の



提供の指図を行うものとします。

- ②第 1 項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③投資信託財産の一部解約等の事由により、第 2 項の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借り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。
- ④第 1 項の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### **(外貨建資産への投資制限)**

第 29 条 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 40 を超えることとなる投資の指図をしません。有価証券の値上がり等により 100 分の 40 を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

- ②第 1 項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該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。

#### **(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)**

第 30 条 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。

#### **(外国為替予約の指図および範囲)**

第 31 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ②第 1 項の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ③第 2 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ④第 2 項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は、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。

#### **(信託業務の委託等)**

第 32 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
  3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
  4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、第 1 項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が第 1 項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③第 1 項および第 2 項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 投資信託財産の保存に係る業務
  2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
  4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

#### （混蔵寄託）

第 33 条 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。以下本条において同じ。）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および記載等の留保等）

第 34 条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ②第 1 項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③投資信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、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。
- ④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。

#### （一部解約の請求および有価証券の売却等の指図）

第 35 条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

#### （再投資の指図）

第 36 条 委託者は、第 35 条の規定によるマザーファンド受益証券の一部解約代金、有価証券の売却代金、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、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

#### (資金の借入れ)

第 37 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ②一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- ③収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

#### (損益の帰属)

第 38 条 委託者の指図にもとづく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

#### (受託者による資金の立替え)

第 39 条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ②投資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、株式の配当金およ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もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。
- ③第 1 項および第 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

#### (信託の計算期間)

第 40 条 この信託の計算期間は、毎年 8 月 29 日から翌年 8 月 28 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は平成 30 年 2 月 27 日から平成 30 年 8 月 28 日までとします。

- ②第 1 項の規定にかかわらず、第 1 項の原則により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、第 4 条に定める信託期間の終了日とします。

#### (投資信託財産に関する報告等)

第 41 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③受託者は、第 1 項および第 2 項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第 37 条第 3 項に定める報告は行わないこととします。

- ④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

**(他の受益者の氏名等の開示の請求の制限)**

第42条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

**(信託事務の諸費用)**

第43条 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および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

- ②投資信託財産の監査費用及び当該監査費用に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、受益者の負担とし、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。

**(信託報酬等の総額および支弁の方法)**

第44条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に、計算期間に応じ、次の各号に掲げる率を乗じて得た額とします。

1. 第1計算期間から第38計算期間まで ・ ・ ・年10,000分の43
2. 第39計算期間以降 ・ ・ ・年10,000分の21

- ②第1項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

- ③第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

**(収益の分配方式)**

第45条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

**(収益分配金の再投資)**

第46条 受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。

②販売会社は、別に定める契約に基づき、受益者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、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

#### (償還金および一部解約金の支払い)

第47条 償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。

以下同じ。）は、信託終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了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、当該信託終了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または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

②一部解約金は、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営業日目から受益者に支払います。

③第1項および第2項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

⑤前条第3項および本条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、前条第3項および本条第4項に規定する「各受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

#### (収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第48条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金については前条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第2項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、第1項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

#### (償還金の時効)

第49条 受益者が、信託終了による償還金について第47条第1項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

#### (投資信託契約の一部解約)

第50条 委託者は、自己に帰属するすべての受益権を、最初に追加信託が行われた日以降、この投資信託契約の円滑な運営に支障がないと判断し次第、すみやかに一部解約します。

- ②受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。
- ③投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ④委託者は、第2項の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。なお、第2項の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者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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。
- ⑤第4項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑥委託者は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第2項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑦第6項により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、第5項の規定に準じて算出した価額とします。

#### (質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第51条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

#### (投資信託契約の解約)

第52条 委託者は、信託期間中において、この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とき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③委託者は、第1項および第2項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ④第3項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するもののみなします。
- ⑤第3項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数

をもって行います。

- ⑥第3項から第5項までの規定は、委託者が投資信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項から第5項までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

#### (投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第53条 委託者は、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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第57条の規定に従います。

#### (委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第54条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②第1項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第57条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

#### (委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第55条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### (受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第56条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第57条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### (投資信託約款の変更等)

第57条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この投資信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ②委託者は、第1項の事項（第1項の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行い

ます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③第2項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

⑤書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第2項から第5項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦第1項から第6項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### （運用報告書に記載すべき事項の提供）

第58条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

#### （公告）

第59条 委託者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。

#### （投資信託約款に関する疑義の取扱い）

第60条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めま

す。



上記条項により投資信託契約を締結します。

投資信託契約締結日 平成 30 年 2 月 27 日

委託者 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社