

DC バランスファンド 30
DC バランスファンド 50
DC バランスファンド 70

追加型投信／内外／資産複合

【確定拠出年金専用ファンド】

投資信託説明書
(請求目論見書)

2023年11月22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バランスファンド30、DCバランスファンド50及びDCバランスファンド70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21日に関東財務局長に提出しており、2023年11月22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】	1
(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】	14
3【投資リスク】	27
4【手数料等及び税金】	31
5【運用状況】	33
第2【管理及び運営】	58
1【申込(販売)手続等】	58
2【換金(解約)手続等】	59
3【資産管理等の概要】	61
4【受益者の権利等】	65
第3【ファンドの経理状況】	66
1【財務諸表】	66
2【ファンドの現況】	282
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	285
第三部【委託会社等の情報】	286
第1【委託会社等の概況】	286
1【委託会社等の概況】	286
2【事業の内容及び営業の概況】	287
3【委託会社等の経理状況】	288
4【利害関係人との取引制限】	310
5【その他】	310
約款	

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

DCバランスファンド30

DCバランスファンド50

DCバランスファンド70

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

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- 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22日から2024年5月21日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

<振替受益権について>

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

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

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

<申込みコース>

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

専用ファンドです。

<受益権の取得申込みの受付の中止等>

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

<受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限 3,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	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 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリーフ ァンド	あり ()	日経 225	ブル・ベア型
	年2回				TOPIX	条件付運用型
	年4回	日本	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし	その他 ()	ロング・ショ ート型/絶対 収益追求型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月)	北米				その他 ()
	年12回 (毎月)	欧州				
	日々	アジア				
		オセアニア				
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資 産配分固定 型))		アフリカ				
		中近東 (中東)				
		エマージン グ				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われぬファンドをいう。
- (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。

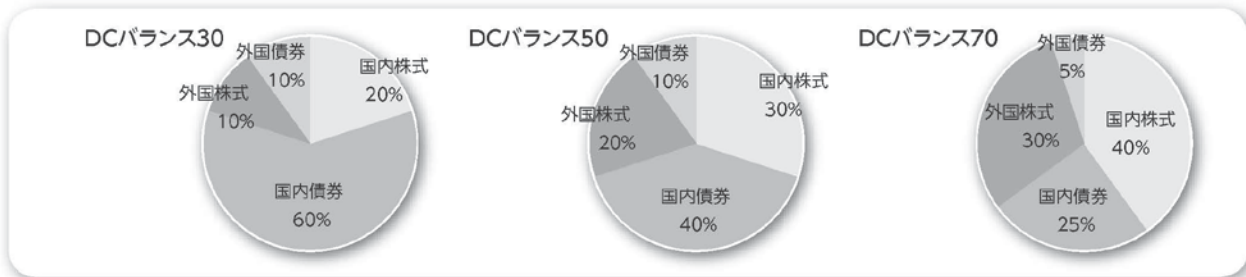
<ファンドの特色>

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

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

国内外の株式・公社債へ分散投資します。

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



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設けます。

<投資対象とするマザーファンド>

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

ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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

日本株式マザーファンド

原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行います。日次でベンチマークとの収益率乖離をチェックした上で、ポートフォリオとベンチマークの諸属性の乖離状況を把握し、個別銘柄構成比をベンチマークの市場構成比に極力合致させます。また、キャッシュポジションは株式先物を用いてヘッジし、ベンチマークとの連動性を高めます。

日本債券マザーファンド

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

外国株式マザーファンド

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

外国債券マザーファンド

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

●複合指数について

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

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、取得時において以下の通りとします。

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

- 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において以下の通りとします。

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

◆各マザーファンドが対象とする指数は次の通りです。

日本株式マザーファンド「TOPIX(東証株価指数)(配当込み)」

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

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」

NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

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

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

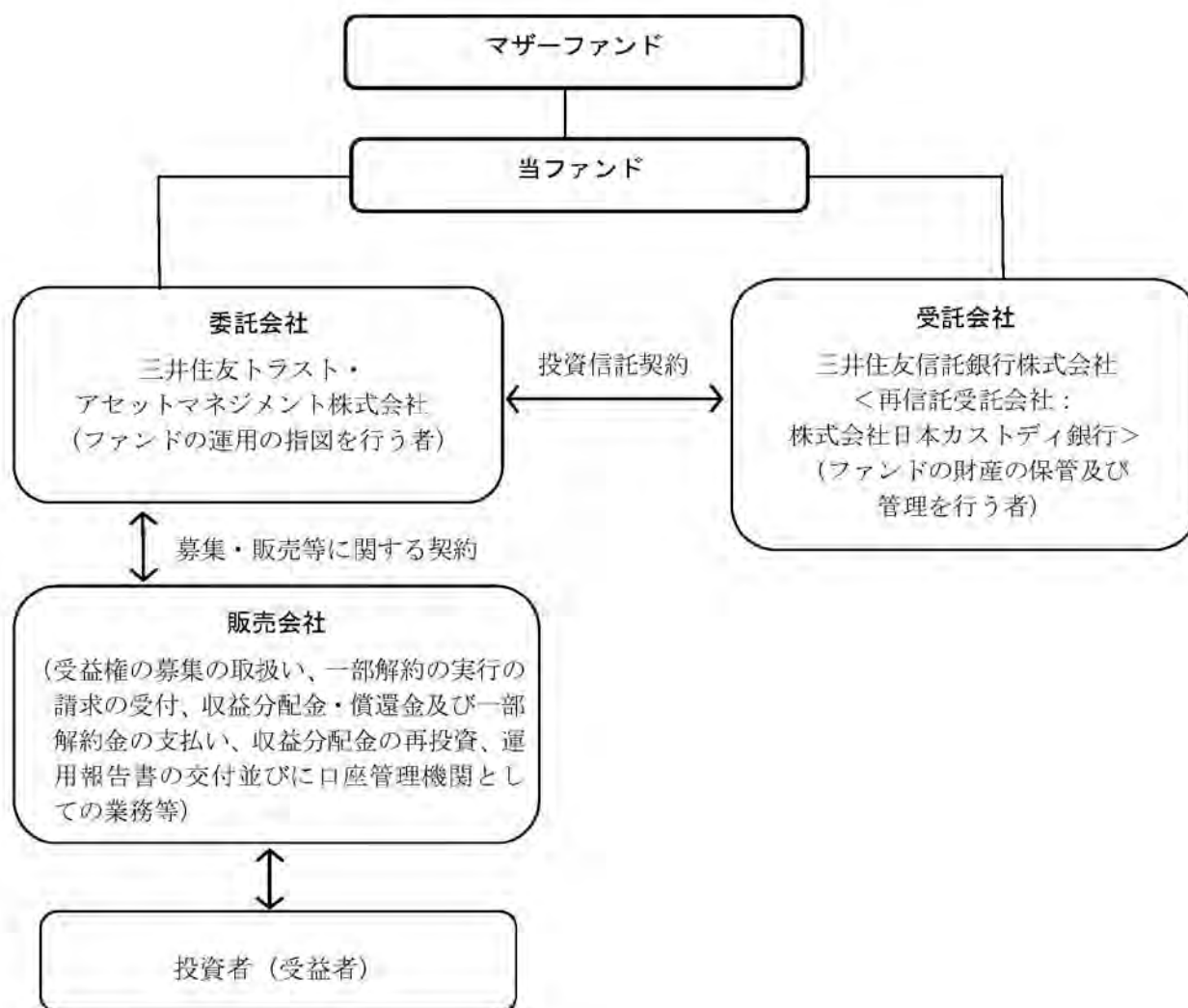
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2006年9月29日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
2012年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継
ファンドの名称を中央三井DCバランスファンド30からDCバランスファンド30、中央三井DCバランスファンド50からDCバランスファンド50、中央三井DCバランスファンド70からDCバランスファンド70に変更
当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

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】

① 運用方針

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

② 投資態度

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

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

- C. 上記B. の基本配分比率には資産毎に一定の変動許容幅を設けます。
 D. 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては原則為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
 E. 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
 F. ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。

- G. 国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- H. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」という場合があります。）を行うことができます。
- I. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

(2) 【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 1 項で定めるものをいいます。以下同じ。）
1. 有価証券
 2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、投資信託約款第 24 条、第 25 条及び第 26 条に定めるものに限りません。）
 3. 金銭債権（上記 1.、2. 及び下記 4. に掲げるものに該当するものを除きます。）
 4. 約束手形（上記 1. に掲げるものに該当するものを除きます。）

B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

② 運用指図できる投資対象である有価証券

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

1. 株券又は新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券
9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
 12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記 1. から 11. までの証券又は証書の性質を有するもの
 13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
 14. 投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
 16. オプションを表示する証券又は証書（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。）
 17. 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。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で上記 21. の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記 1. の証券又は証書並びに上記 12. 及び 17. の証券又は証書のうち上記 1. の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記 2. から 6. までの証券並びに上記 12. 及び 17. の証券又は証書のうち上記 2. から 6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記 13. の証券及び上記 14. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③ 運用指図できる金融商品

- A. 委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で上記 5. の権利の性質を有するもの
 - B. 金融商品による運用の特例
- 上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記 A. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考) マザーファンドの概要

○「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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 株式への投資は、原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。
- ③ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 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並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ⑤ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- ⑥ 信託財産に属する資産の価格変動リスク回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑦ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

- 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 新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の

5%以下とします。

- ⑦ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

○「日本債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① わが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 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並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ④ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- ⑤ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑥ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

- ① 株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ② 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③ 外貨建資産への投資は、行いません。
- ④ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

- 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及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 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及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

○「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている国の株式に投資を行い、同指数と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。
- ③ 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。
- ④ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ⑤ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ⑥ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。
- ⑦ 信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑧ 信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

- ① 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- ② 株式への投資割合には制限を設けません。

- ③ 新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ④ 同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ⑤ 同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑥ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑦ 同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 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及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

○「外国債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 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。
- ③ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 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並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ⑤ 信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。
- ⑥ 信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその

元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

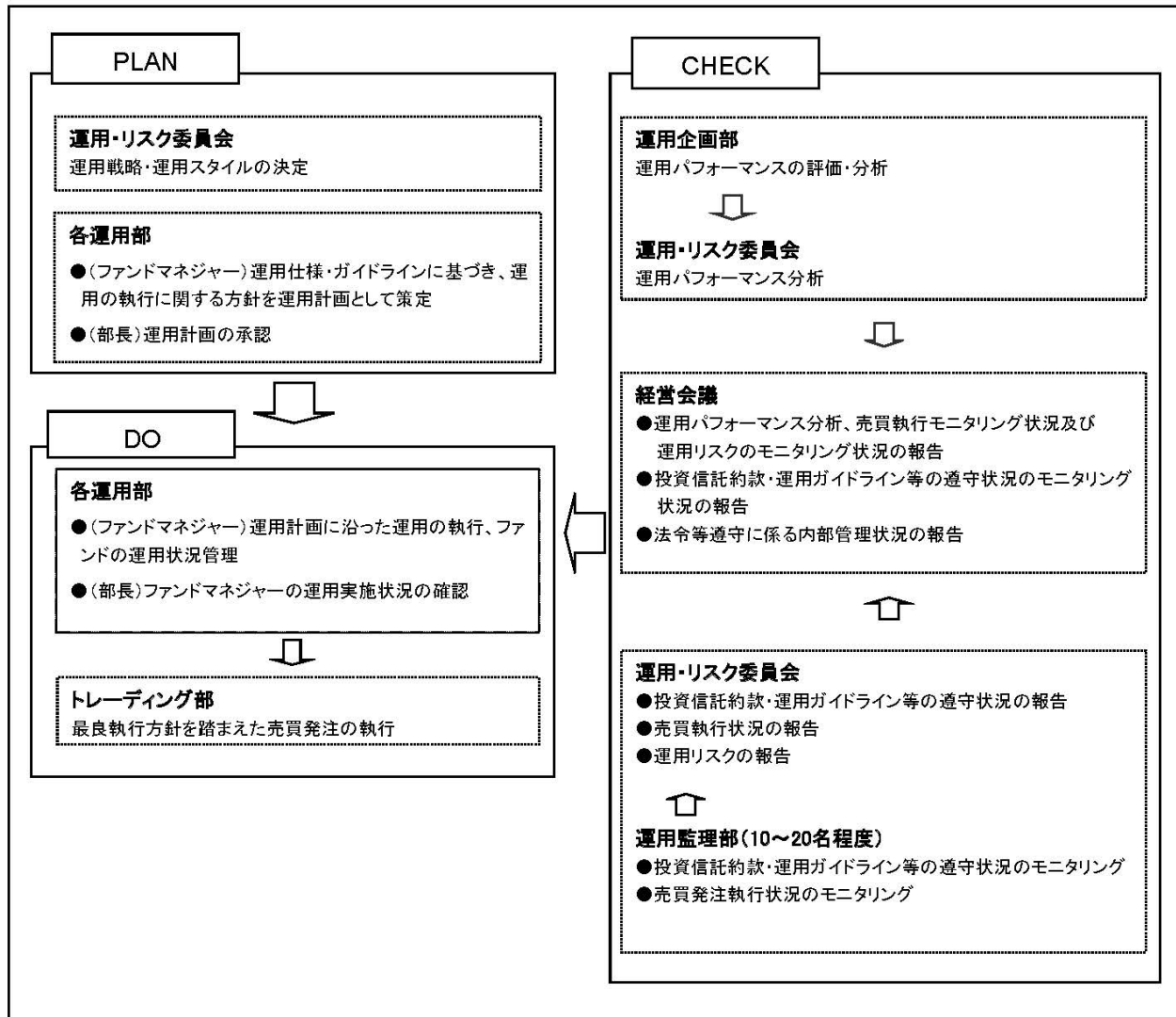
- ⑦ 信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

- ① 株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ② 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③ 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- ④ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 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及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(3) 【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

- ・分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入及び売買益（評価益を含みます。）等の合計額とします。

- ・分配金額については、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。
 - ・収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

<約款に定める投資制限>

A. 株式への投資割合

委託会社は、株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

- DCバランスファンド30……………信託財産の純資産総額の40%以下
- DCバランスファンド50……………信託財産の純資産総額の60%以下
- DCバランスファンド70……………信託財産の純資産総額の80%以下

B. 外貨建資産の投資割合

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

- DCバランスファンド30……………信託財産の純資産総額の30%以下
- DCバランスファンド50……………信託財産の純資産総額の40%以下
- DCバランスファンド70……………信託財産の純資産総額の45%以下

C. 新株引受権証券等への投資割合

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

D. 投資信託証券への投資割合

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

E. 同一銘柄の株式への投資制限

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

F. 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

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

G. 同一銘柄の転換社債等への投資制限

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

H. 投資する株式等の範囲

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

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

I. 信用取引の指図範囲

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

することができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ. 上記イ. の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

J. 先物取引等の運用指図

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

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

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

K. スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

L. 金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

M. 有価証券の貸付の指図及び範囲

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の a. 及び b. の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

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

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

- ロ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記イ. a. 及びb. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ. 委託会社は、有価証券の貸付にあたり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N. 公社債の空売りの指図及び範囲

- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記O.の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ. 上記イ. の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ. の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

O. 公社債の借入れの指図及び範囲

- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ. 上記イ. の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ. 上記イ. の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

Q. 外国為替予約取引の指図

- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ロ. 上記イ. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

R. 一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

S. 再投資の指図

委託会社は、上記R. の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算

分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

T. 資金の借入れ

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

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

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

ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U. 受託会社による資金の立替え

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

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

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

V. 受託会社の自己又は利害関係人等との取引

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

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

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

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

<関連法令に基づく投資制限>

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

(投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則)

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

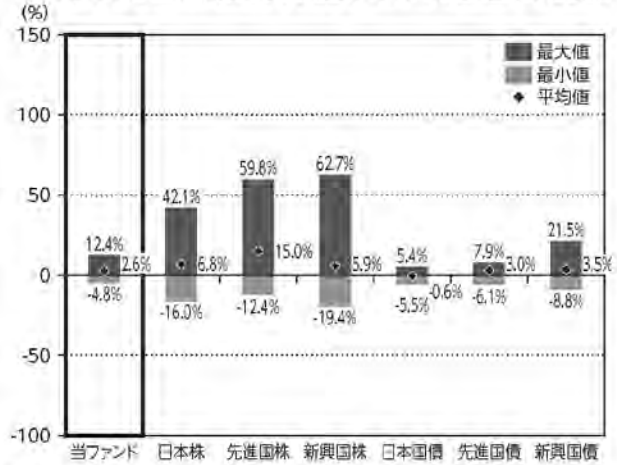
〔参考情報〕

DCバランスファンド30

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

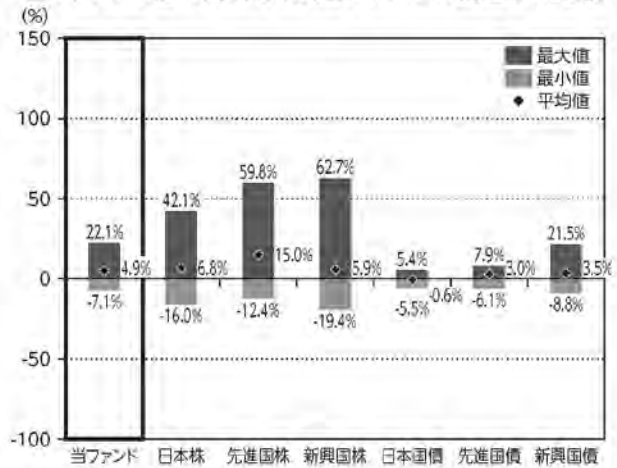


DCバランスファンド50

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

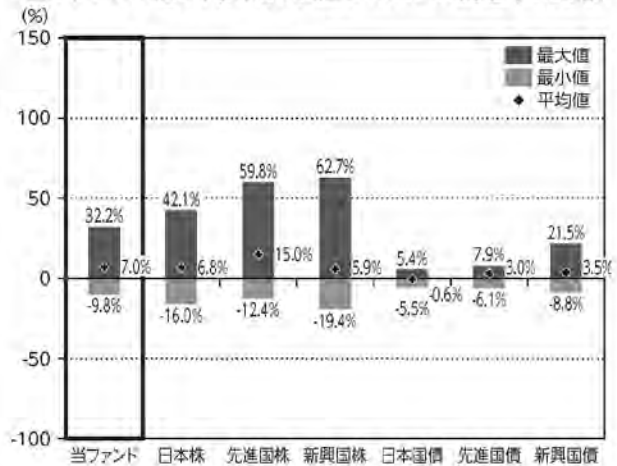


DCバランスファンド70

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



【参考情報】

- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- *当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- *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、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数)(配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権限又は商標は、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限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、保証又は取寄せられるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村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、一定の組み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専業活動・サービスに関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの複製、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・ローバル・ディバイシブ(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。本指数は謝辞を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

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

DCバランスファンド30：年率 0.231%（税抜 0.21%）（※）

DCバランスファンド50：年率 0.242%（税抜 0.22%）

DCバランスファンド70：年率 0.253%（税抜 0.23%）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

- 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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

※上記は、2023年9月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

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

※対象期間は2022年2月22日～2023年2月21日です。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2023年9月29日現在の状況について記載してあります。

【DCバランスファンド30】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	28,740,218,872	99.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	124,483,530	0.43
合計(純資産総額)		28,864,702,402	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	日本債券マザーファンド	13,163,808,411	1.3064	17,197,199,309	1.2996	17,107,685,410	59.27
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,106,379,713	2.3231	4,893,330,712	2.7637	5,821,401,612	20.17
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	532,807,700	4.7543	2,533,127,649	5.4957	2,928,151,276	10.14
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,018,469,133	2.6309	2,679,490,443	2.8307	2,882,980,574	9.99

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.57
合計	99.57

(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8期計算期間末 (2014年2月21日)	4,826,567,334	4,826,567,334	11,618	11,618
第9期計算期間末 (2015年2月23日)	9,609,384,153	9,609,384,153	12,811	12,811
第10期計算期間末 (2016年2月22日)	12,153,839,606	12,153,839,606	12,527	12,527
第11期計算期間末 (2017年2月21日)	14,214,751,693	14,214,751,693	13,306	13,306
第12期計算期間末 (2018年2月21日)	16,338,867,196	16,338,867,196	13,983	13,983
第13期計算期間末 (2019年2月21日)	18,205,085,029	18,205,085,029	14,025	14,025
第14期計算期間末 (2020年2月21日)	20,310,903,852	20,310,903,852	14,687	14,687
第15期計算期間末 (2021年2月22日)	22,717,128,952	22,717,128,952	15,283	15,283
第16期計算期間末 (2022年2月21日)	24,689,281,244	24,689,281,244	15,527	15,527
第17期計算期間末 (2023年2月21日)	27,150,159,121	27,150,159,121	15,540	15,540
2022年9月末日	26,686,223,382	—	15,376	—
10月末日	27,340,884,915	—	15,711	—
11月末日	27,306,495,324	—	15,658	—
12月末日	26,576,895,143	—	15,215	—
2023年1月末日	26,973,585,154	—	15,398	—
2月末日	27,212,465,427	—	15,600	—
3月末日	27,768,496,069	—	15,788	—
4月末日	28,088,565,672	—	15,954	—
5月末日	28,438,219,289	—	16,181	—
6月末日	29,237,351,414	—	16,652	—
7月末日	29,010,914,136	—	16,536	—
8月末日	29,112,031,140	—	16,552	—
9月末日	28,864,702,402	—	16,430	—

②【分配の推移】

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

第8期計算期間	2013年2月22日～2014年2月21日	0
第9期計算期間	2014年2月22日～2015年2月23日	0
第10期計算期間	2015年2月24日～2016年2月22日	0
第11期計算期間	2016年2月23日～2017年2月21日	0
第12期計算期間	2017年2月22日～2018年2月21日	0
第13期計算期間	2018年2月22日～2019年2月21日	0
第14期計算期間	2019年2月22日～2020年2月21日	0
第15期計算期間	2020年2月22日～2021年2月22日	0
第16期計算期間	2021年2月23日～2022年2月21日	0
第17期計算期間	2022年2月22日～2023年2月21日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第8期計算期間	2013年2月22日～2014年2月21日	11.3
第9期計算期間	2014年2月22日～2015年2月23日	10.3
第10期計算期間	2015年2月24日～2016年2月22日	△2.2
第11期計算期間	2016年2月23日～2017年2月21日	6.2
第12期計算期間	2017年2月22日～2018年2月21日	5.1
第13期計算期間	2018年2月22日～2019年2月21日	0.3
第14期計算期間	2019年2月22日～2020年2月21日	4.7
第15期計算期間	2020年2月22日～2021年2月22日	4.1
第16期計算期間	2021年2月23日～2022年2月21日	1.6
第17期計算期間	2022年2月22日～2023年2月21日	0.1
第18期中間計算期間	2023年2月22日～2023年8月21日	5.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第8期計算期間	2013年2月22日～2014年2月21日	2,244,075,796	263,589,279	4,154,228,189
第9期計算期間	2014年2月22日～2015年2月23日	3,774,064,767	427,446,160	7,500,846,796
第10期計算期間	2015年2月24日～2016年2月22日	2,707,951,316	506,368,389	9,702,429,723
第11期計算期間	2016年2月23日～2017年2月21日	1,522,635,571	541,752,943	10,683,312,351
第12期計算期間	2017年2月22日～2018年2月21日	1,622,030,510	620,753,783	11,684,589,078
第13期計算期間	2018年2月22日～2019年2月21日	1,853,591,536	558,077,052	12,980,103,562
第14期計算期間	2019年2月22日～2020年2月21日	1,679,276,139	830,050,924	13,829,328,777
第15期計算期間	2020年2月22日～2021年2月22日	2,046,783,461	1,012,273,788	14,863,838,450
第16期計算期間	2021年2月23日～2022年2月21日	2,000,986,753	963,792,042	15,901,033,161
第17期計算期間	2022年2月22日～2023年2月21日	2,609,724,470	1,039,148,108	17,471,609,523
第18期中間計算期	2023年2月22日～2023年8月21日	757,140,242	712,381,893	17,516,367,872

問				
---	--	--	--	--

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

【DCバランスファンド50】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	31,993,608,106	99.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	131,852,966	0.41
合計(純資産総額)		32,125,461,072	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	日本債券マザーファンド	9,670,187,878	1.3072	12,640,869,595	1.2996	12,567,376,166	39.12
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,530,532,657	2.3224	8,199,309,043	2.7637	9,757,333,104	30.37
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	1,185,465,781	4.7534	5,634,993,044	5.4957	6,514,964,292	20.28
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,114,188,909	2.6278	2,927,865,616	2.8307	3,153,934,544	9.82

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.59
合計	99.59

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

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 8 期計算期間末	(2014 年 2 月 21 日)	4,833,869,383	4,833,869,383	11,529	11,529
第 9 期計算期間末	(2015 年 2 月 23 日)	10,264,606,984	10,264,606,984	13,252	13,252
第 10 期計算期間末	(2016 年 2 月 22 日)	12,016,092,940	12,016,092,940	12,499	12,499
第 11 期計算期間末	(2017 年 2 月 21 日)	14,533,410,562	14,533,410,562	13,835	13,835
第 12 期計算期間末	(2018 年 2 月 21 日)	16,857,871,211	16,857,871,211	14,889	14,889
第 13 期計算期間末	(2019 年 2 月 21 日)	18,131,125,571	18,131,125,571	14,866	14,866
第 14 期計算期間末	(2020 年 2 月 21 日)	20,696,734,917	20,696,734,917	15,946	15,946
第 15 期計算期間末	(2021 年 2 月 22 日)	23,693,213,025	23,693,213,025	17,177	17,177
第 16 期計算期間末	(2022 年 2 月 21 日)	25,849,385,990	25,849,385,990	17,813	17,813
第 17 期計算期間末	(2023 年 2 月 21 日)	28,823,272,052	28,823,272,052	18,291	18,291
	2022 年 9 月末日	27,726,365,336	—	17,740	—
	10 月末日	28,823,059,183	—	18,387	—
	11 月末日	28,824,011,251	—	18,342	—
	12 月末日	27,833,250,660	—	17,676	—
	2023 年 1 月末日	28,486,014,824	—	18,042	—
	2 月末日	28,843,448,431	—	18,318	—
	3 月末日	29,466,140,013	—	18,511	—
	4 月末日	30,022,800,955	—	18,796	—
	5 月末日	30,672,160,677	—	19,222	—
	6 月末日	32,061,857,313	—	20,058	—
	7 月末日	32,159,062,621	—	20,042	—
	8 月末日	32,360,798,569	—	20,134	—
	9 月末日	32,125,461,072	—	19,977	—

②【分配の推移】

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

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

③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第 8 期計算期間	2013 年 2 月 22 日～2014 年 2 月 21 日	17.3
第 9 期計算期間	2014 年 2 月 22 日～2015 年 2 月 23 日	14.9
第 10 期計算期間	2015 年 2 月 24 日～2016 年 2 月 22 日	△5.7
第 11 期計算期間	2016 年 2 月 23 日～2017 年 2 月 21 日	10.7
第 12 期計算期間	2017 年 2 月 22 日～2018 年 2 月 21 日	7.6
第 13 期計算期間	2018 年 2 月 22 日～2019 年 2 月 21 日	△0.2
第 14 期計算期間	2019 年 2 月 22 日～2020 年 2 月 21 日	7.3
第 15 期計算期間	2020 年 2 月 22 日～2021 年 2 月 22 日	7.7
第 16 期計算期間	2021 年 2 月 23 日～2022 年 2 月 21 日	3.7
第 17 期計算期間	2022 年 2 月 22 日～2023 年 2 月 21 日	2.7
第 18 期中間計算期間	2023 年 2 月 22 日～2023 年 8 月 21 日	7.7

(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 8 期計算期間	2013 年 2 月 22 日～2014 年 2 月 21 日	1,127,761,819	394,119,618	4,192,880,333
第 9 期計算期間	2014 年 2 月 22 日～2015 年 2 月 23 日	3,890,146,207	337,276,922	7,745,749,618
第 10 期計算期間	2015 年 2 月 24 日～2016 年 2 月 22 日	2,389,338,964	521,486,140	9,613,602,442
第 11 期計算期間	2016 年 2 月 23 日～2017 年 2 月 21 日	1,427,316,438	535,903,642	10,505,015,238
第 12 期計算期間	2017 年 2 月 22 日～2018 年 2 月 21 日	1,604,824,267	787,711,888	11,322,127,617
第 13 期計算期間	2018 年 2 月 22 日～2019 年 2 月 21 日	1,487,203,756	613,284,585	12,196,046,788
第 14 期計算期間	2019 年 2 月 22 日～2020 年 2 月 21 日	1,542,536,422	759,460,983	12,979,122,227
第 15 期計算期間	2020 年 2 月 22 日～2021 年 2 月 22 日	1,929,479,800	1,115,407,432	13,793,194,595
第 16 期計算期間	2021 年 2 月 23 日～2022 年 2 月 21 日	1,696,091,500	977,545,037	14,511,741,058
第 17 期計算期間	2022 年 2 月 22 日～2023 年 2 月 21 日	2,220,576,384	974,529,247	15,757,788,195
第 18 期中間計算期間	2023 年 2 月 22 日～2023 年 8 月 21 日	790,231,625	537,341,011	16,010,678,809

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

【DC バランスファンド 70】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	15,789,779,773	99.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	62,457,541	0.39
合計(純資産総額)		15,852,237,314	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	日本株式マザーファンド	2,343,072,129	2.3209	5,438,036,105	2.7637	6,475,548,442	40.85
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	871,280,344	4.7502	4,138,755,891	5.4957	4,788,295,386	30.21
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	2,960,844,503	1.3077	3,872,145,062	1.2996	3,847,913,516	24.27
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	239,524,651	2.6171	626,859,965	2.8307	678,022,429	4.28

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.61
合計	99.61

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

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8期計算期間末	(2014年2月21日)	2,259,670,200	2,259,670,200	11,186	11,186
第9期計算期間末	(2015年2月23日)	4,376,661,860	4,376,661,860	13,325	13,325
第10期計算期間末	(2016年2月22日)	4,382,407,791	4,382,407,791	12,156	12,156
第11期計算期間末	(2017年2月21日)	5,465,018,584	5,465,018,584	14,000	14,000
第12期計算期間末	(2018年2月21日)	6,554,623,946	6,554,623,946	15,405	15,405
第13期計算期間末	(2019年2月21日)	7,105,425,421	7,105,425,421	15,276	15,276

第14期計算期間末	(2020年2月21日)	8,349,294,464	8,349,294,464	16,706	16,706
第15期計算期間末	(2021年2月22日)	10,072,849,421	10,072,849,421	18,545	18,545
第16期計算期間末	(2022年2月21日)	11,455,179,464	11,455,179,464	19,577	19,577
第17期計算期間末	(2023年2月21日)	13,550,734,992	13,550,734,992	20,583	20,583
	2022年9月末日	12,572,490,132	—	19,563	—
	10月末日	13,248,608,623	—	20,533	—
	11月末日	13,326,701,999	—	20,527	—
	12月末日	12,837,957,739	—	19,655	—
	2023年1月末日	13,314,867,499	—	20,217	—
	2月末日	13,537,358,854	—	20,567	—
	3月末日	13,846,805,568	—	20,755	—
	4月末日	14,185,995,637	—	21,169	—
	5月末日	14,623,698,319	—	21,796	—
	6月末日	15,544,559,613	—	23,033	—
	7月末日	15,745,215,900	—	23,169	—
	8月末日	15,916,690,531	—	23,316	—
	9月末日	15,852,237,314	—	23,134	—

②【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金(円)
第8期計算期間	2013年2月22日～2014年2月21日	0
第9期計算期間	2014年2月22日～2015年2月23日	0
第10期計算期間	2015年2月24日～2016年2月22日	0
第11期計算期間	2016年2月23日～2017年2月21日	0
第12期計算期間	2017年2月22日～2018年2月21日	0
第13期計算期間	2018年2月22日～2019年2月21日	0
第14期計算期間	2019年2月22日～2020年2月21日	0
第15期計算期間	2020年2月22日～2021年2月22日	0
第16期計算期間	2021年2月23日～2022年2月21日	0
第17期計算期間	2022年2月22日～2023年2月21日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第8期計算期間	2013年2月22日～2014年2月21日	22.3
第9期計算期間	2014年2月22日～2015年2月23日	19.1
第10期計算期間	2015年2月24日～2016年2月22日	△8.8
第11期計算期間	2016年2月23日～2017年2月21日	15.2
第12期計算期間	2017年2月22日～2018年2月21日	10.0

第13期計算期間	2018年2月22日～2019年2月21日	△0.8
第14期計算期間	2019年2月22日～2020年2月21日	9.4
第15期計算期間	2020年2月22日～2021年2月22日	11.0
第16期計算期間	2021年2月23日～2022年2月21日	5.6
第17期計算期間	2022年2月22日～2023年2月21日	5.1
第18期中間計算期間	2023年2月22日～2023年8月21日	10.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第8期計算期間	2013年2月22日～2014年2月21日	749,827,425	256,234,473	2,020,022,963
第9期計算期間	2014年2月22日～2015年2月23日	1,564,258,884	299,743,427	3,284,538,420
第10期計算期間	2015年2月24日～2016年2月22日	721,489,462	400,760,508	3,605,267,374
第11期計算期間	2016年2月23日～2017年2月21日	578,597,748	280,214,854	3,903,650,268
第12期計算期間	2017年2月22日～2018年2月21日	820,305,427	469,118,909	4,254,836,786
第13期計算期間	2018年2月22日～2019年2月21日	752,735,309	356,104,678	4,651,467,417
第14期計算期間	2019年2月22日～2020年2月21日	795,085,220	448,783,440	4,997,769,197
第15期計算期間	2020年2月22日～2021年2月22日	1,035,869,348	602,091,038	5,431,547,507
第16期計算期間	2021年2月23日～2022年2月21日	999,992,239	580,045,869	5,851,493,877
第17期計算期間	2022年2月22日～2023年2月21日	1,280,124,964	548,046,327	6,583,572,514
第18期中間計算期間	2023年2月22日～2023年8月21日	474,744,472	263,905,522	6,794,411,464

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

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	358,949,967,060	98.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	6,401,902,178	1.75
合計(純資産総額)		365,351,869,238	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	5,460,225,000	1.49

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。この

ような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	5,988,200	1,895.39	11,350,021,192	2,677.50	16,033,405,500	4.39
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	771,400	11,485.51	8,859,928,928	12,240.00	9,441,936,000	2.58
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,726,600	938.28	6,311,471,150	1,268.50	8,532,692,100	2.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	35,037,600	153.47	5,377,402,223	176.60	6,187,640,160	1.69
日本	株式	キーエンス	電気機器	109,100	58,523.09	6,384,870,076	55,500.00	6,055,050,000	1.66
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	763,400	5,530.39	4,221,905,850	7,347.00	5,608,699,800	1.54
日本	株式	三菱商事	卸売業	703,500	4,400.77	3,095,948,122	7,128.00	5,014,548,000	1.37
日本	株式	日立製作所	電気機器	535,600	6,757.84	3,619,504,206	9,275.00	4,967,690,000	1.36
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	230,800	15,276.76	3,525,876,355	20,440.00	4,717,552,000	1.29
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	968,000	4,204.50	4,069,959,657	4,641.00	4,492,488,000	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,659,500	1,038.84	2,762,800,625	1,682.00	4,473,279,000	1.22
日本	株式	三井物産	卸売業	805,200	3,882.48	3,126,172,896	5,423.00	4,366,599,600	1.20
日本	株式	任天堂	その他製品	688,500	5,547.89	3,819,728,332	6,230.00	4,289,355,000	1.17
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,553,300	1,996.43	3,101,059,230	2,541.00	3,946,935,300	1.08
日本	株式	信越化学工業	化学	908,000	3,453.26	3,135,565,447	4,343.00	3,943,444,000	1.08
日本	株式	第一三共	医薬品	952,800	4,276.77	4,074,908,581	4,106.00	3,912,196,800	1.07
日本	株式	KDDI	情報・通信業	845,200	4,026.87	3,403,516,033	4,577.00	3,868,480,400	1.06
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	711,000	4,152.54	2,952,456,826	5,406.00	3,843,666,000	1.05
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	830,000	4,209.42	3,493,823,292	4,609.00	3,825,470,000	1.05
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,061,700	2,726.82	2,895,064,981	3,465.00	3,678,790,500	1.01
日本	株式	HOYA	精密機器	231,000	13,735.15	3,172,820,742	15,325.00	3,540,075,000	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	539,500	5,990.41	3,231,828,933	6,335.00	3,417,732,500	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	131,500	22,333.11	2,936,803,978	23,475.00	3,086,962,500	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,757,900	1,480.52	2,602,608,905	1,690.50	2,971,729,950	0.81
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	593,300	4,109.76	2,438,323,016	4,909.00	2,912,509,700	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	992,400	2,493.47	2,474,529,417	2,734.00	2,713,221,600	0.74
日本	株式	SMC	機械	35,700	62,945.32	2,247,147,992	66,980.00	2,391,186,000	0.65
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	397,700	6,048.42	2,405,457,101	5,855.00	2,328,533,500	0.64
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	652,500	2,657.23	1,733,844,412	3,440.00	2,244,600,000	0.61

日本	株式	パナソニック ホールディングス	電気機器	1,301,000	1,147.10	1,492,388,295	1,682.00	2,188,282,000	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	2.11
		食料品	3.34
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.18
		化学	5.69
		医薬品	5.02
		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	5.25
		電気機器	16.33
		輸送用機器	8.70
		精密機器	2.24
		その他製品	2.21
		電気・ガス業	1.37
		陸運業	2.86
		海運業	0.66
		空運業	0.47
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	7.90
		卸売業	6.67
		小売業	4.26
		銀行業	7.02
証券、商品先物取引業	0.77		
保険業	2.39		
その他金融業	1.20		
不動産業	1.91		
サービス業	4.63		

	小計	98.25
合計		98.25

(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	235	円	5,533,482,100	5,460,225,000	1.49

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

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

日本債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	337,121,114,540	84.50
地方債証券	日本	20,835,516,998	5.22
特殊債券	日本	22,342,078,838	5.60
社債券	日本	16,911,612,000	4.24
	フランス	795,102,000	0.20
	スペイン	199,224,000	0.05
	韓国	99,371,000	0.02
	小計	18,005,309,000	4.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	665,616,027	0.17
合計(純資産総額)		398,969,635,403	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	4,305,000,000	99.34	4,276,811,700	95.66	4,118,163,000	0.200	2032/9/20	1.03
日本	国債証券	第452回利付国債	3,760,000,000	99.95	3,758,219,800	99.95	3,758,195,200	0.005	2025/9/1	0.94

		債(2年)								
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	3,750,000,000	99.59	3,734,625,000	99.22	3,721,050,000	0.100	2028/3/20	0.93
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	3,475,000,000	97.60	3,391,891,050	95.90	3,332,733,500	0.100	2031/9/20	0.84
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	3,385,000,000	98.20	3,324,107,900	97.14	3,288,290,550	0.100	2030/9/20	0.82
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	3,245,000,000	99.88	3,241,396,800	99.70	3,235,394,800	0.005	2026/9/20	0.81
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	3,180,000,000	100.13	3,184,324,800	99.90	3,176,915,400	0.100	2026/12/20	0.80
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	3,175,000,000	100.08	3,177,734,200	99.81	3,168,967,500	0.100	2027/3/20	0.79
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	3,275,000,000	99.73	3,266,414,100	95.93	3,141,773,000	0.200	2032/6/20	0.79
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	3,140,000,000	100.21	3,146,594,000	99.98	3,139,529,000	0.100	2026/9/20	0.79
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	3,196,000,000	100.47	3,211,266,300	97.83	3,126,774,640	0.500	2033/3/20	0.78
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	3,220,000,000	97.86	3,151,152,200	96.80	3,117,249,800	0.100	2030/12/20	0.78
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	3,220,000,000	97.48	3,138,933,100	96.69	3,113,707,800	0.400	2033/6/20	0.78
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,010,000,000	101.08	3,042,508,000	100.73	3,032,183,700	0.400	2025/9/20	0.76
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	3,020,000,000	100.29	3,028,885,000	100.08	3,022,597,200	0.100	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	3,060,000,000	99.33	3,039,741,700	98.76	3,022,331,400	0.100	2028/12/20	0.76
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	3,070,000,000	99.14	3,043,671,600	98.40	3,021,064,200	0.100	2029/6/20	0.76
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	3,125,000,000	97.64	3,051,250,000	96.20	3,006,437,500	0.100	2031/6/20	0.75
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	2,995,000,000	100.25	3,002,650,500	100.04	2,996,198,000	0.100	2026/6/20	0.75
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	3,025,000,000	99.12	2,998,380,000	98.60	2,982,861,750	0.100	2029/3/20	0.75
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	2,950,000,000	100.88	2,976,228,000	100.59	2,967,670,500	0.400	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	3,085,000,000	97.64	3,012,194,000	95.63	2,950,339,750	0.100	2031/12/20	0.74
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	3,028,000,000	97.97	2,966,832,400	96.19	2,912,845,160	0.200	2032/3/20	0.73
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	2,890,000,000	100.98	2,918,339,850	100.66	2,909,305,200	0.400	2025/6/20	0.73
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	2,925,000,000	99.53	2,911,252,500	99.33	2,905,548,750	0.005	2027/6/20	0.73
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	2,905,000,000	99.95	2,903,547,500	99.68	2,895,878,300	0.100	2027/6/20	0.73
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	2,920,000,000	98.36	2,872,221,900	97.43	2,845,014,400	0.100	2030/6/20	0.71
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	2,900,000,000	100.66	2,919,315,800	98.05	2,843,624,000	0.500	2032/12/20	0.71
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	2,860,000,000	99.71	2,851,706,000	99.39	2,842,668,400	0.100	2027/12/20	0.71
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	2,850,000,000	99.86	2,846,010,000	99.54	2,837,089,500	0.100	2027/9/20	0.71

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	84.50
地方債証券	5.22
特殊債券	5.60
社債券	4.51
合計	99.83

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	292,986,516,808	67.77
	イギリス	17,548,188,069	4.06
	カナダ	14,512,791,642	3.36
	スイス	13,255,515,868	3.07
	フランス	13,139,192,882	3.04
	ドイツ	9,911,919,159	2.29
	オーストラリア	8,042,249,468	1.86
	アイルランド	7,809,402,119	1.81
	オランダ	7,651,581,963	1.77
	デンマーク	3,923,093,661	0.91
	スウェーデン	3,442,314,574	0.80
	スペイン	3,092,489,548	0.72
	イタリア	2,233,620,622	0.52
	香港	2,030,690,660	0.47
	シンガポール	1,394,914,949	0.32
	フィンランド	1,328,132,809	0.31
	ジャージー	1,198,575,082	0.28
	ベルギー	913,052,154	0.21
ノルウェー	848,486,234	0.20	
イスラエル	840,299,111	0.19	

	キュラソー	714,000,574	0.17
	バミューダ	701,699,451	0.16
	ケイマン	619,439,769	0.14
	ニュージーランド	316,595,113	0.07
	ルクセンブルク	231,260,123	0.05
	ポルトガル	227,734,463	0.05
	オーストリア	218,997,062	0.05
	リベリア	181,364,034	0.04
	パナマ	124,280,511	0.03
	マン島	56,753,962	0.01
	小計	409,495,152,444	94.72
新株予約権証券	カナダ	—	—
投資信託受益証券	オーストラリア	75,446,175	0.02
	香港	28,813,102	0.01
	小計	104,259,277	0.02
投資証券	アメリカ	6,818,811,843	1.58
	オーストラリア	480,893,639	0.11
	シンガポール	169,045,064	0.04
	フランス	146,449,010	0.03
	イギリス	114,912,241	0.03
	香港	104,363,723	0.02
	カナダ	43,156,634	0.01
	ベルギー	26,154,814	0.01
	小計	7,903,786,968	1.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	14,813,269,586	3.43
合計(純資産総額)		432,316,468,275	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	10,899,894,600	2.52
	買建	カナダ	522,559,912	0.12
	買建	ドイツ	2,161,144,684	0.50
	買建	イギリス	740,212,996	0.17
	買建	オーストラリア	508,061,340	0.12

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

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

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	1,382,780,512	0.32

(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	857,971	22,764.78	19,531,524,427	25,531.81	21,905,552,729	5.07
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	385,418	38,673.55	14,905,483,404	46,914.27	18,081,604,577	4.18
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	503,864	15,400.43	7,759,724,973	18,844.08	9,494,857,758	2.20
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	134,765	32,510.21	4,381,239,478	64,452.52	8,685,944,693	2.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	324,272	15,476.57	5,018,620,131	19,790.92	6,417,644,388	1.48
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	288,636	15,477.04	4,467,231,668	19,913.58	5,747,777,636	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	155,903	29,359.76	4,577,276,115	36,853.52	5,745,574,391	1.33
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	120,840	28,019.89	3,385,924,050	45,466.33	5,494,152,139	1.27
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	220,546	16,711.55	3,685,666,834	17,870.32	3,941,228,168	0.91
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	50,890	71,133.16	3,619,966,617	76,300.75	3,882,945,575	0.90
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	70,808	46,237.00	3,273,950,005	53,409.03	3,781,786,936	0.87
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	44,149	51,065.93	2,254,510,044	81,438.83	3,595,442,950	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	159,595	21,221.51	3,386,847,490	22,076.51	3,523,300,965	0.81
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	131,556	24,423.02	3,212,995,937	23,466.11	3,087,107,620	0.71

アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	88,397	34,316.81	3,033,503,731	34,651.70	3,063,106,572	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用 品・パー ソナル用 品	129,053	21,176.17	2,732,848,943	21,889.53	2,824,910,444	0.65
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	22,554	90,391.29	2,038,685,279	124,450.55	2,806,857,930	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サー ビス	46,026	55,776.53	2,567,170,863	59,748.23	2,749,972,273	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギ ー	99,272	25,336.36	2,515,191,432	25,516.85	2,533,108,952	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	54,734	49,152.12	2,690,292,359	45,396.03	2,484,706,536	0.57
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	179,004	10,174.38	1,821,254,937	13,805.28	2,471,201,236	0.57
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバ コ	145,547	18,212.71	2,650,805,769	16,820.03	2,448,105,489	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	96,407	21,682.76	2,090,370,761	22,773.55	2,195,530,117	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	138,498	15,585.41	2,158,549,059	15,601.19	2,160,734,167	0.50
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需 品流通・ 小売り	24,265	77,154.91	1,872,164,018	85,055.67	2,063,875,964	0.48
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需 品流通・ 小売り	81,049	21,114.95	1,711,345,866	24,312.73	1,970,522,713	0.46
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	22,022	98,185.68	2,162,245,111	87,026.40	1,916,495,381	0.44
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバ コ	75,312	25,736.46	1,938,264,892	25,353.81	1,909,446,139	0.44
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウ ェア・サ ービス	24,896	56,433.70	1,404,973,471	75,488.53	1,879,362,657	0.43
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバ コ	224,668	8,999.54	2,021,909,269	8,348.05	1,875,541,899	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	5.41
		素材	3.89
		資本財	6.43
		商業・専門サービス	1.52
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	2.15
		耐久消費財・アパレル	1.45
		消費者サービス	2.04
		メディア・娯楽	5.97
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.26
		生活必需品流通・小売り	1.68
		食品・飲料・タバコ	3.67
		家庭用品・パーソナル用品	1.67
		ヘルスケア機器・サービス	4.37
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.34
		銀行	5.21
		金融サービス	6.36
		保険	3.06
		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	9.12
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.50
電気通信サービス	1.13		
公益事業	2.59		
半導体・半導体製造装置	5.78		
不動産管理・開発	0.31		
小計		94.72	
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.02
投資証券	—	—	1.83
合計			96.57

(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	336	アメリカドル	75,732,973.8	11,328,138,221	72,870,000	10,899,894,600	2.52
	カナダ	モントリオ	S&P/TSE 60	買建	20	カナダドル	4,840,086	535,991,124	4,718,800	522,559,912	0.12

	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	38	スイスフラン	4,196,326	685,931,448	4,162,140	680,343,404	0.16
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	224	ユーロ	9,541,351.8	1,507,533,584	9,372,160	1,480,801,280	0.34
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	30	オーストラリアドル	5,466,235	525,086,534	5,289,000	508,061,340	0.12
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	53	イギリスポンド	4,036,288.75	736,743,785	4,055,295	740,212,996	0.17

(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	6,904,600.00	1,017,345,631	1,030,875,419	0.24
	ユーロ	買建	1,357,000.00	214,418,082	214,068,648	0.05
	イギリスポンド	買建	550,000.00	100,372,790	100,247,775	0.02
	スイスフラン	買建	230,000.00	37,351,908	37,588,670	0.01

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

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

外国債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	80,094,227,337	47.78
	フランス	13,463,679,619	8.03
	イタリア	12,066,239,658	7.20
	中国	11,598,727,852	6.92
	ドイツ	10,399,631,406	6.20
	イギリス	8,057,853,619	4.81
	スペイン	7,974,366,250	4.76
	カナダ	3,352,505,036	2.00
	ベルギー	2,940,841,040	1.75
	オーストラリア	2,449,181,903	1.46
	オランダ	2,379,405,472	1.42
	オーストリア	1,951,448,477	1.16
	メキシコ	1,628,594,272	0.97

	アイルランド	944, 143, 815	0.56
	マレーシア	880, 535, 041	0.53
	フィンランド	868, 205, 065	0.52
	ポーランド	825, 724, 069	0.49
	シンガポール	746, 359, 753	0.45
	デンマーク	521, 367, 740	0.31
	イスラエル	509, 358, 618	0.30
	ニュージーランド	378, 113, 814	0.23
	スウェーデン	330, 089, 767	0.20
	ノルウェー	273, 174, 083	0.16
	小計	164, 633, 773, 706	98.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3, 003, 530, 887	1.79
合計(純資産総額)		167, 637, 304, 593	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	567, 153, 623	0.34
	買建	ドイツ	505, 612, 640	0.30

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

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

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	1, 278, 208, 749	0.76

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/25	10, 770, 000	14, 484.71	1, 560, 004, 302	14, 424.24	1, 553, 491, 171	2.875	2025/4/30	0.93
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12, 110, 000	12, 454.87	1, 508, 285, 021	11, 718.65	1, 419, 129, 498	1.375	2031/11/15	0.85
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	10, 200, 000	14, 253.33	1, 453, 840, 464	13, 803.13	1, 407, 919, 998	2.875	2028/8/15	0.84
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	63, 260, 000	2, 029.48	1, 283, 850, 748	2, 039.75	1, 290, 348, 012	1.990	2025/4/9	0.77

アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	13,708.77	1,096,701,868	13,861.27	1,108,901,984	0.375	2025/4/30	0.66
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	7,850,000	13,482.65	1,058,388,057	13,395.00	1,051,507,956	1.125	2026/10/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	12,018.98	1,097,333,481	11,474.42	1,047,614,737	0.625	2030/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.25% 04/30/28	7,800,000	13,266.25	1,034,767,994	12,868.55	1,003,747,241	1.250	2028/4/30	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	6,900,000	14,016.11	967,111,827	13,523.55	933,125,028	2.625	2029/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	6,100,000	14,420.41	879,645,389	14,410.51	879,041,345	3.000	2025/7/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	14,250.41	862,150,194	14,302.71	865,314,022	2.000	2025/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	12,080.33	893,945,006	11,569.66	856,155,016	0.625	2030/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.75% 04/15/26	5,800,000	14,644.23	849,365,881	14,543.14	843,502,649	3.750	2026/4/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.125% 01/15/25	5,830,000	14,027.79	817,820,703	14,178.54	826,609,342	1.125	2025/1/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	6,000,000	14,839.59	890,375,843	13,726.30	823,578,131	3.500	2033/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	6,000,000	14,093.24	845,594,437	13,544.58	812,675,149	2.750	2029/5/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	13,900.42	799,274,307	13,851.34	796,452,144	1.625	2026/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/15/25	5,500,000	14,313.16	787,223,835	14,221.20	782,166,092	1.750	2025/3/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	14,210.68	781,587,634	14,127.71	777,024,279	2.250	2025/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25% 05/31/28	6,000,000	13,120.97	787,258,237	12,835.54	770,132,497	1.250	2028/5/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	6,550,000	12,402.28	812,349,693	11,685.93	765,428,906	1.250	2031/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	6,200,000	12,962.04	803,646,596	12,148.11	753,183,213	1.875	2032/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	13,845.49	747,656,932	13,761.94	743,144,989	1.625	2026/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	5,230,000	13,985.73	731,453,679	14,207.17	743,035,437	0.750	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 12/31/26	5,500,000	13,504.85	742,766,950	13,392.66	736,596,775	1.250	2026/12/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 4% 12/15/25	5,000,000	14,900.73	745,036,949	14,641.89	732,094,771	4.000	2025/12/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	5,000,000	14,367.86	718,393,011	14,448.49	722,424,656	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	13,725.13	727,432,076	13,621.12	721,919,824	1.500	2026/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	6,160,000	12,206.54	751,923,237	11,632.18	716,542,423	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/31/25	5,000,000	14,414.01	720,700,978	14,316.44	715,822,105	2.750	2025/8/31	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. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.21
合計	98.21

(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	15	アメリカドル	1,589,698.24	237,787,063	1,578,046.95	236,044,263	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	10	アメリカドル	1,094,434.3	163,705,482	1,078,593.8	161,336,060	0.10
	アメリカ	シカゴ商品	US LONG BOND	買建	10	アメリカ	1,181,559.25	176,737,633	1,135,000	169,773,300	0.10

カ	取引所				ドル					
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	6	ユーロ	630,412.6	99,605,191	628,710	99,336,180	0.06
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	8	ユーロ	929,126.8	146,802,035	919,200	145,233,600	0.09
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	13	ユーロ	1,690,947.3	267,169,673	1,652,170	261,042,860	0.16


(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	4,320,000.00	636,487,459	644,385,024	0.38
	カナダドル	買建	450,000.00	49,028,946	49,704,660	0.03
	ユーロ	買建	2,710,000.00	426,838,284	427,288,410	0.25
	イギリスポンド	買建	360,000.00	65,584,807	65,533,140	0.04
	オフショア人民元	買建	4,470,000.00	90,138,135	91,297,515	0.05

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

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

 運用実績

当初設定日：2006年9月29日
作成基準日：2023年9月29日

DCバランスファンド30

基準価額・純資産の推移



基準価額	16,430円
純資産総額	288.65億円

分配の推移
(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年2月	0円
2020年2月	0円
2021年2月	0円
2022年2月	0円
2023年2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。

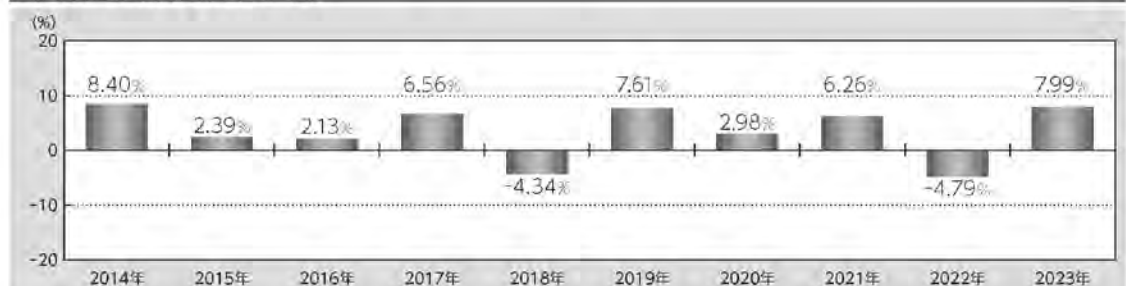
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

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
日本債券 マザーファンド	59.3%	第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.6%
		第452回利付国債(2年)	日本	国債	-	0.005%	2025/09/01	0.6%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.6%
日本株式 マザーファンド	20.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.9%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
外国株式 マザーファンド	10.1%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェア機器	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	一般消費財・サービス流通小売	-	-	0.2%
外国債券 マザーファンド	10.0%	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	0.1%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※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：2006年9月29日
作成基準日：2023年9月29日

DCバランスファンド50

基準価額・純資産の推移



基準価額	19,977円
純資産総額	321.25億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年2月	0円
2020年2月	0円
2021年2月	0円
2022年2月	0円
2023年2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。

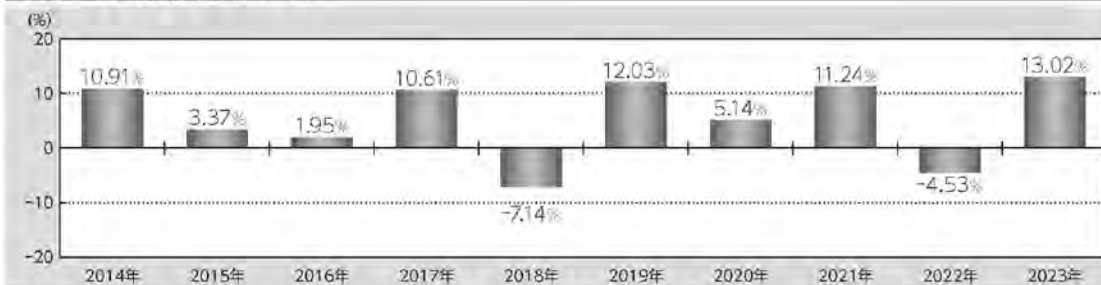
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位相入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	39.1%	第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.4%
		第452回利付国債(2年)	日本	国債	-	0.005%	2025/09/01	0.4%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.4%
日本株式 マザーファンド	30.4%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.3%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.7%
外国株式 マザーファンド	20.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テラ/ローワー/ハードウェア/機器	-	-	1.0%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.8%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	一般消費財/サービス流通/小売	-	-	0.4%
外国債券 マザーファンド	9.8%	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	0.1%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※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：2006年9月29日
作成基準日：2023年9月29日

DCバランスファンド70

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	23,134円
純資産総額	158.52億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年2月	0円
2020年2月	0円
2021年2月	0円
2022年2月	0円
2023年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

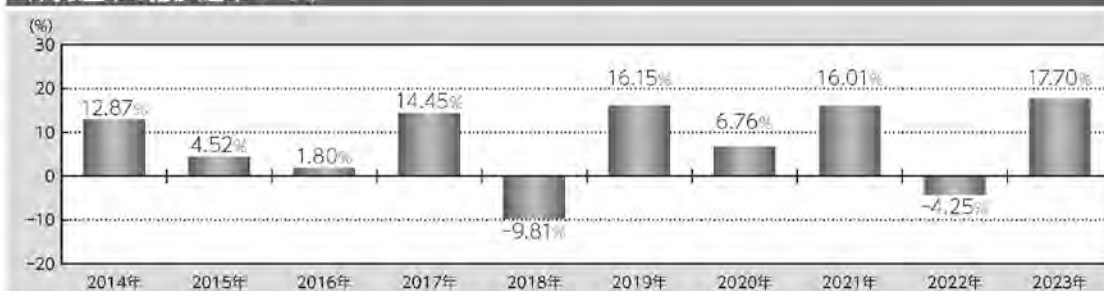
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式 マザーファンド	40.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.8%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.1%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	1.0%
外国株式 マザーファンド	30.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/機器	-	-	1.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	1.3%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	一般消費財/サービス/流通小売	-	-	0.7%
日本債券 マザーファンド	24.3%	第368回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.200%	2032/09/20	0.3%
		第452回利付国債(2年)	日本	国債	-	0.005%	2025/09/01	0.2%
		第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.2%
外国債券 マザーファンド	4.3%	T 2.875% 04/30/25	アメリカ	国債	-	2.875%	2025/04/30	0.0%
		T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.0%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	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年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<申込手続>

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

<申込コース>

当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。

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

<申込みの受付>

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

<申込単位>

1円以上1円単位とします。

<申込価額>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

<申込手数料>

ありません。

<申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

<受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

<申込受付の中止等>

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

<その他>

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

<問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

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

<一部解約の受付>

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

<一部解約単位>

1口以上1口単位とします。

<解約価額>

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

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

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

<一部解約代金の支払い>

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

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

<受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

<一部解約受付の中止等>

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

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に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親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

②国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

③外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

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

④公社債等

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

イ. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ. 価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

⑤外貨建資産等の円換算

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

<基準価額の照会方法>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。(2006年9月29日設定)

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

(4) 【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

<投資信託契約の終了(償還)と手続き>

(1) 投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)

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

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。）を行うおとす場合、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スャル・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。

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、）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、）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バランスファンド30】

- (1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(2022年2月22日から2023年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年4月27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 後藤知弘
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド30の2022年2月22日から2023年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド30の2023年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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 16 期 (2022 年 2 月 21 日現在)	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	107,067,401	112,262,493
親投資信託受益証券	24,590,802,639	27,042,698,989
未収入金	34,023,669	62,105,900
流動資産合計	24,731,893,709	27,217,067,382
資産合計	24,731,893,709	27,217,067,382
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,989,427	34,723,583
未払受託者報酬	5,511,264	5,987,865
未払委託者報酬	23,422,802	25,448,359
未払利息	126	37
その他未払費用	688,846	748,417
流動負債合計	42,612,465	66,908,261
負債合計	42,612,465	66,908,261
純資産の部		
元本等		
元本	15,901,033,161	17,471,609,523
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	8,788,248,083	9,678,549,598
(分配準備積立金)	3,737,419,952	3,813,344,225
元本等合計	24,689,281,244	27,150,159,121
純資産合計	24,689,281,244	27,150,159,121
負債純資産合計	24,731,893,709	27,217,067,382

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期		第17期	
	自 2021年2月23日 至 2022年2月21日		自 2022年2月22日 至 2023年2月21日	
営業収益				
受取利息		587		489
有価証券売買等損益		408,470,787		81,529,022
営業収益合計		408,471,374		81,529,511
営業費用				
支払利息		51,573		47,103
受託者報酬		10,676,775		11,563,203
委託者報酬		45,376,177		49,143,478
その他費用		1,334,475		1,445,269
営業費用合計		57,439,000		62,199,053
営業利益又は営業損失(△)		351,032,374		19,330,458
経常利益又は経常損失(△)		351,032,374		19,330,458
当期純利益又は当期純損失(△)		351,032,374		19,330,458
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(△)		38,880,223		3,140,834
期首剰余金又は期首欠損金(△)		7,853,290,502		8,788,248,083
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,132,511,128		1,446,832,326
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,132,511,128		1,446,832,326
剰余金減少額又は欠損金増加額		509,705,698		572,720,435
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		509,705,698		572,720,435
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		8,788,248,083		9,678,549,598

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第 16 期 (2022 年 2 月 21 日現在)	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	15,901,033,161 口	17,471,609,523 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 1.5527 円 (15,527 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 1.5540 円 (15,540 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 16 期 自 2021 年 2 月 23 日 至 2022 年 2 月 21 日			第 17 期 自 2022 年 2 月 22 日 至 2023 年 2 月 21 日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	249,080,960 円	費用控除後の配当等収益額	A	298,121,440 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	63,071,191 円	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	5,824,953,479 円	収益調整金額	C	6,997,151,410 円
分配準備積立金額	D	3,425,267,801 円	分配準備積立金額	D	3,515,222,785 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,562,373,431 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,810,495,635 円
当ファンドの期末残存口数	F	15,901,033,161 口	当ファンドの期末残存口数	F	17,471,609,523 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,013 円	1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,187 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 17 期 自 2022 年 2 月 22 日 至 2023 年 2 月 21 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第16期	第17期
	自 2021年 2月 23日 至 2022年 2月 21日	自 2022年 2月 22日 至 2023年 2月 21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,863,838,450 円	15,901,033,161 円
期中追加設定元本額	2,000,986,753 円	2,609,724,470 円
期中一部解約元本額	963,792,042 円	1,039,148,108 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第16期	第17期
	(2022年 2月 21日現在)	(2023年 2月 21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	352,052,137	102,877,016
合計	352,052,137	102,877,016

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,420,347,508	5,618,352,670	
	日本債券マザーファンド	12,266,272,602	16,007,485,745	
	外国株式マザーファンド	618,343,115	2,939,046,659	
	外国債券マザーファンド	946,814,641	2,477,813,915	
合計		16,251,777,866	27,042,698,989	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【DCバランスファンド50】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(2022年2月22日から2023年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年4月27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 後藤知弘
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド50の2022年2月22日から2023年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド50の2023年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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 16 期 (2022 年 2 月 21 日現在)	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	104,022,579	119,357,894
親投資信託受益証券	25,745,695,813	28,709,082,850
未収入金	36,534,439	73,631,904
流動資産合計	25,886,252,831	28,902,072,648
資産合計	25,886,252,831	28,902,072,648
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,213,769	43,388,166
未払受託者報酬	5,804,985	6,295,558
未払委託者報酬	26,122,405	28,329,946
未払利息	122	39
その他未払費用	725,560	786,887
流動負債合計	36,866,841	78,800,596
負債合計	36,866,841	78,800,596
純資産の部		
元本等		
元本	14,511,741,058	15,757,788,195
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	11,337,644,932	13,065,483,857
(分配準備積立金)	6,210,096,248	6,536,302,258
元本等合計	25,849,385,990	28,823,272,052
純資産合計	25,849,385,990	28,823,272,052
負債純資産合計	25,886,252,831	28,902,072,648

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 16 期		第 17 期	
	自 2021 年 2 月 23 日	至 2022 年 2 月 21 日	自 2022 年 2 月 22 日	至 2023 年 2 月 21 日
営業収益				
受取利息		590		535
有価証券売買等損益		939,862,380		800,197,921
営業収益合計		939,862,970		800,198,456
営業費用				
支払利息		51,583		49,654
受託者報酬		11,206,793		12,145,618
委託者報酬		50,430,509		54,655,138
その他費用		1,400,726		1,518,078
営業費用合計		63,089,611		68,368,488
営業利益又は営業損失 (△)		876,773,359		731,829,968
経常利益又は経常損失 (△)		876,773,359		731,829,968
当期純利益又は当期純損失 (△)		876,773,359		731,829,968
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 (△)		73,305,104		21,336,230
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		9,900,018,430		11,337,644,932
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,337,132,196		1,777,677,989
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,337,132,196		1,777,677,989
剰余金減少額又は欠損金増加額		702,973,949		760,332,802
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		702,973,949		760,332,802
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		11,337,644,932		13,065,483,857

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第 16 期 (2022 年 2 月 21 日現在)	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,511,741,058 口	15,757,788,195 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	1.7813 円 (1 万口当たり純資産額) (17,813 円)	1.8291 円 (1 万口当たり純資産額) (18,291 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 16 期 自 2021 年 2 月 23 日 至 2022 年 2 月 21 日			第 17 期 自 2022 年 2 月 22 日 至 2023 年 2 月 21 日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	336,506,485 円	費用控除後の配当等収益額	A	419,594,427 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	466,961,770 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	290,899,311 円
収益調整金額	C	7,490,817,517 円	収益調整金額	C	9,058,259,730 円
分配準備積立金額	D	5,406,627,993 円	分配準備積立金額	D	5,825,808,520 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,700,913,765 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,594,561,988 円
当ファンドの期末残存口数	F	14,511,741,058 口	当ファンドの期末残存口数	F	15,757,788,195 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,441 円	1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,896 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 17 期 自 2022 年 2 月 22 日 至 2023 年 2 月 21 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありませぬ。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第16期	第17期
	自 2021年2月23日 至 2022年2月21日	自 2022年2月22日 至 2023年2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	13,793,194,595 円	14,511,741,058 円
期中追加設定元本額	1,696,091,500 円	2,220,576,384 円
期中一部解約元本額	977,545,037 円	974,529,247 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第16期	第17期
	(2022年2月21日現在)	(2023年2月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	836,564,304	800,623,780
合計	836,564,304	800,623,780

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありませぬ。

(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ぬ。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	3,806,541,329	8,836,124,387	
	日本債券マザーファンド	8,589,980,178	11,209,924,132	
	外国株式マザーファンド	1,254,625,295	5,963,359,489	
	外国債券マザーファンド	1,031,591,457	2,699,674,842	
合計		14,682,738,259	28,709,082,850	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【DCバランスファンド70】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(2022年2月22日から2023年2月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年4月27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 後藤知弘
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド70の2022年2月22日から2023年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCバランスファンド70の2023年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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 16 期 (2022 年 2 月 21 日現在)	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,755,933	56,408,101
親投資信託受益証券	11,409,032,905	13,496,996,324
未収入金	16,846,615	23,520,532
流動資産合計	11,479,635,453	13,576,924,957
資産合計	11,479,635,453	13,576,924,957
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,455,978	9,147,947
未払受託者報酬	2,553,207	2,900,796
未払委託者報酬	12,127,656	13,778,666
未払利息	63	18
その他未払費用	319,085	362,538
流動負債合計	24,455,989	26,189,965
負債合計	24,455,989	26,189,965
純資産の部		
元本等		
元本	5,851,493,877	6,583,572,514
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	5,603,685,587	6,967,162,478
(分配準備積立金)	2,975,107,003	3,336,463,004
元本等合計	11,455,179,464	13,550,734,992
純資産合計	11,455,179,464	13,550,734,992
負債純資産合計	11,479,635,453	13,576,924,957

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 16 期		第 17 期	
	自 2021 年 2 月 23 日	至 2022 年 2 月 21 日	自 2022 年 2 月 22 日	至 2023 年 2 月 21 日
営業収益				
受取利息		267		262
有価証券売買等損益		587,697,605		666,474,186
営業収益合計		587,697,872		666,474,448
営業費用				
支払利息		24,375		22,795
受託者報酬		4,877,317		5,526,769
委託者報酬		23,167,134		26,251,928
その他費用		609,533		690,722
営業費用合計		28,678,359		32,492,214
営業利益又は営業損失 (△)		559,019,513		633,982,234
経常利益又は経常損失 (△)		559,019,513		633,982,234
当期純利益又は当期純損失 (△)		559,019,513		633,982,234
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 (△)		59,759,047		22,128,526
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		4,641,301,914		5,603,685,587
剰余金増加額又は欠損金減少額		961,269,854		1,276,629,972
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		961,269,854		1,276,629,972
剰余金減少額又は欠損金増加額		498,146,647		525,006,789
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		498,146,647		525,006,789
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		5,603,685,587		6,967,162,478

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第 16 期 (2022 年 2 月 21 日現在)	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,851,493,877 口	6,583,572,514 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 1.9577 円 (19,577 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 2.0583 円 (20,583 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 16 期 自 2021 年 2 月 23 日 至 2022 年 2 月 21 日			第 17 期 自 2022 年 2 月 22 日 至 2023 年 2 月 21 日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	165,209,540 円	費用控除後の配当等収益額	A	225,755,513 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	334,050,926 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	386,098,195 円
収益調整金額	C	3,798,541,598 円	収益調整金額	C	4,901,434,662 円
分配準備積立金額	D	2,475,846,537 円	分配準備積立金額	D	2,724,609,296 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,773,648,601 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,237,897,666 円
当ファンドの期末残存口数	F	5,851,493,877 口	当ファンドの期末残存口数	F	6,583,572,514 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	11,575 円	1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	12,512 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 17 期 自 2022 年 2 月 22 日 至 2023 年 2 月 21 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第16期	第17期
	自 2021年 2月 23日 至 2022年 2月 21日	自 2022年 2月 22日 至 2023年 2月 21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,431,547,507 円	5,851,493,877 円
期中追加設定元本額	999,992,239 円	1,280,124,964 円
期中一部解約元本額	580,045,869 円	548,046,327 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第16期	第17期
	(2022年 2月 21日現在)	(2023年 2月 21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	542,795,769	668,515,718
合計	542,795,769	668,515,718

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	2,360,139,274	5,478,591,296	
	日本債券マザーファンド	2,525,207,062	3,295,395,215	
	外国株式マザーファンド	863,544,175	4,104,511,818	
	外国債券マザーファンド	236,338,554	618,497,995	
合計		5,985,229,065	13,496,996,324	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,766,109,545
株式	312,319,414,820
派生商品評価勘定	39,945,400
未収配当金	546,286,030
差入委託証拠金	81,576,200
流動資産合計	314,753,331,995
資産合計	314,753,331,995
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	251,500
前受金	39,708,200
未払金	203,400
未払解約金	281,728,916
未払利息	584
流動負債合計	321,892,600
負債合計	321,892,600
純資産の部	

元本等	
元本	135,457,462,114
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	178,973,977,281
元本等合計	314,431,439,395
純資産合計	314,431,439,395
負債純資産合計	314,753,331,995

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,457,462,114 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 2.3213 円 (1万口当たり純資産額) (23,213 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2月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動

	による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月22日
期首元本額	134,184,060,378円
期中追加設定元本額	10,600,715,648円
期中一部解約元本額	9,327,313,912円
期末元本額	135,457,462,114円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	606,371,681円
DC日本株式インデックスファンド	285,012,751円
DC日本株式インデックスファンドL	53,917,063,255円
DC日本株式インデックスファンドA	657,316,520円
DCバランスファンド30	2,420,347,508円
DCバランスファンド50	3,806,541,329円
DCバランスファンド70	2,360,139,274円

グローバル・インデックス・バランス・ファンド	571,613,060 円
日本株式インデックス e	1,435,905,153 円
インデックスコレクション (国内株式)	21,931,638,690 円
インデックスコレクション (バランス株式 30)	12,583,641,622 円
インデックスコレクション (バランス株式 50)	3,581,437,319 円
インデックスコレクション (バランス株式 70)	3,288,116,338 円
私募日本株式パッシブファンド (適格機関投資家専用)	7,783,583,168 円
日本株式パッシブファンド私募 A (適格機関投資家専用)	2,713,980,056 円
日本株式インデックスファンド VA (適格機関投資家専用)	755,009,659 円
バランス VA 30 (適格機関投資家専用)	38,305,858 円
バランス VA 50 (適格機関投資家専用)	442,862,620 円
VA バランスファンド (株 25 / 100) (適格機関投資家専用)	54,558,722 円
VA バランスファンド (株 50 / 100) (適格機関投資家専用)	120,458,769 円
VA バランスファンド (株 60 / 100) (適格機関投資家専用)	45,917,283 円
バランス VA 25 (適格機関投資家専用)	598,872,697 円
バランス VA 37.5 (適格機関投資家専用)	385,508,800 円
バランス VA 50 L (適格機関投資家専用)	6,624,276,348 円
バランス VA 75 (適格機関投資家専用)	633,668,702 円
VA バランスファンド (株 40 / 100) (適格機関投資家専用)	55,781,016 円
VA ポートフォリオ 40 (適格機関投資家専用)	1,051,257,575 円
VA ポートフォリオ 20 (適格機関投資家専用)	21,074,199 円
バランス VA 40 (適格機関投資家専用)	135,525,680 円
バランスファンド VA (適格機関投資家専用)	1,724,282,026 円
VA バランスファンド 2 (株 40 / 100) (適格機関投資家専用)	45,727,316 円
VA バランス 50-50 (適格機関投資家専用)	49,481,123 円
VA ファンド 25 (適格機関投資家専用)	15,125,715 円
バランスファンド VA 2 (適格機関投資家専用)	495,266,348 円
バランス VA 25 L (適格機関投資家専用)	237,105,709 円
バランスファンド VA 3 (適格機関投資家専用)	3,766,479,796 円
世界バランス VA 25 (適格機関投資家専用)	76,847,685 円
国内バランス VA 30 (適格機関投資家専用)	31,308,950 円
国内バランス VA 25 (適格機関投資家専用)	7,677,578 円
VA バランス 20-80 (適格機関投資家専用)	100,237,676 円
私募日本株式インデックスファンド AL (適格機関投資家専用)	2,136,540 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		8,114,526,170
合計		8,114,526,170

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,975,746,800	-	2,015,455,000	39,708,200

合計	1,975,746,800	—	2,015,455,000	39,708,200
----	---------------	---	---------------	------------

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,800	3,635.00	21,083,000	
ニッスイ	152,500	542.00	82,655,000	
マルハニチロ	23,300	2,440.00	56,852,000	
雪国まいたけ	13,000	1,015.00	13,195,000	
カネコ種苗	5,000	1,670.00	8,350,000	
サカタのタネ	17,400	4,025.00	70,035,000	
ホクト	13,600	1,881.00	25,581,600	
ホクリヨウ	1,900	899.00	1,708,100	
住石ホールディングス	21,100	385.00	8,123,500	
日鉄鉱業	6,100	3,695.00	22,539,500	
三井松島ホールディングス	6,900	3,945.00	27,220,500	
I N P E X	563,900	1,465.00	826,113,500	
石油資源開発	17,700	5,020.00	88,854,000	
K&Oエナジーグループ	6,900	2,298.00	15,856,200	
ショーボンドホールディングス	20,800	5,260.00	109,408,000	
ミライト・ワン	52,900	1,516.00	80,196,400	
タマホーム	10,700	3,220.00	34,454,000	
サンヨーホームズ	1,600	750.00	1,200,000	
日本アクア	5,700	946.00	5,392,200	
ファーストコーポレーション	3,500	770.00	2,695,000	
ベステラ	2,900	923.00	2,676,700	
R o b o t H o m e	25,900	203.00	5,257,700	
キャンディル	2,100	507.00	1,064,700	
ダイセキ環境ソリューション	2,700	913.00	2,465,100	
第一カッター興業	3,900	1,094.00	4,266,600	

安藤・間	88,300	874.00	77,174,200	
東急建設	43,400	676.00	29,338,400	
コムシスホールディングス	51,600	2,495.00	128,742,000	
ビーアールホールディングス	24,200	343.00	8,300,600	
高松コンストラクショングループ	9,900	1,996.00	19,760,400	
東建コーポレーション	4,900	7,600.00	37,240,000	
ソネック	1,500	960.00	1,440,000	
ヤマウラ	7,700	1,066.00	8,208,200	
オリエンタル白石	54,800	309.00	16,933,200	
大成建設	106,100	4,390.00	465,779,000	
大林組	381,400	987.00	376,441,800	
清水建設	320,600	733.00	234,999,800	
飛島建設	11,800	1,082.00	12,767,600	
長谷工コーポレーション	110,100	1,549.00	170,544,900	
松井建設	9,900	660.00	6,534,000	
銭高組	1,200	2,920.00	3,504,000	
鹿島建設	236,500	1,610.00	380,765,000	
不動テトラ	7,400	1,653.00	12,232,200	
大末建設	3,500	1,186.00	4,151,000	
鉄建建設	7,600	1,800.00	13,680,000	
西松建設	18,100	3,735.00	67,603,500	
三井住友建設	86,000	423.00	36,378,000	
大豊建設	4,400	3,910.00	17,204,000	
佐田建設	6,100	512.00	3,123,200	
ナカノフドー建設	6,700	333.00	2,231,100	
奥村組	17,300	3,305.00	57,176,500	
東鉄工業	14,700	2,799.00	41,145,300	
イチケン	2,100	1,825.00	3,832,500	
富士ピー・エス	4,200	451.00	1,894,200	
浅沼組	8,500	3,300.00	28,050,000	
戸田建設	131,200	711.00	93,283,200	
熊谷組	18,500	2,788.00	51,578,000	
北野建設	1,800	2,976.00	5,356,800	
植木組	2,700	1,395.00	3,766,500	
矢作建設工業	14,500	821.00	11,904,500	
ピーエス三菱	13,500	643.00	8,680,500	

日本ハウスホールディングス	21,100	398.00	8,397,800	
新日本建設	15,000	895.00	13,425,000	
東亜道路工業	2,100	6,500.00	13,650,000	
日本道路	2,100	6,860.00	14,406,000	
東亜建設工業	9,100	2,629.00	23,923,900	
日本国土開発	32,000	556.00	17,792,000	
若築建設	4,700	3,020.00	14,194,000	
東洋建設	34,500	906.00	31,257,000	
五洋建設	151,200	661.00	99,943,200	
世紀東急工業	14,100	805.00	11,350,500	
福田組	4,000	4,420.00	17,680,000	
住友林業	81,800	2,664.00	217,915,200	
日本基礎技術	5,700	547.00	3,117,900	
巴コーポレーション	10,600	418.00	4,430,800	
大和ハウス工業	298,000	3,108.00	926,184,000	
ライト工業	20,300	1,967.00	39,930,100	
積水ハウス	334,100	2,551.50	852,456,150	
日特建設	10,200	939.00	9,577,800	
北陸電気工事	7,300	771.00	5,628,300	
ユアテック	23,500	772.00	18,142,000	
日本リーテック	7,000	896.00	6,272,000	
四電工	4,500	1,862.00	8,379,000	
中電工	16,500	2,152.00	35,508,000	
関電工	58,400	892.00	52,092,800	
きんでん	75,100	1,525.00	114,527,500	
東京エネシス	10,600	915.00	9,699,000	
トーエネック	3,500	3,410.00	11,935,000	
住友電設	10,100	2,426.00	24,502,600	
日本電設工業	17,500	1,502.00	26,285,000	
エクシオグループ	49,100	2,414.00	118,527,400	
新日本空調	5,900	1,924.00	11,351,600	
九電工	25,900	3,415.00	88,448,500	
三機工業	23,600	1,500.00	35,400,000	
日揮ホールディングス	105,500	1,756.00	185,258,000	
中外炉工業	3,500	1,814.00	6,349,000	
ヤマト	7,900	810.00	6,399,000	

太平電業	6,600	3,955.00	26,103,000	
高砂熱学工業	25,700	2,048.00	52,633,600	
三晃金属工業	1,200	3,885.00	4,662,000	
朝日工業社	4,400	2,107.00	9,270,800	
明星工業	18,300	795.00	14,548,500	
大氣社	12,800	3,530.00	45,184,000	
ダイダン	7,000	2,260.00	15,820,000	
日比谷総合設備	9,200	2,049.00	18,850,800	
フィル・カンパニー	1,900	1,084.00	2,059,600	
テスホールディングス	11,500	1,062.00	12,213,000	
インフロニア・ホールディングス	111,800	1,035.00	115,713,000	
東洋エンジニアリング	14,100	596.00	8,403,600	
レイズネクスト	15,400	1,364.00	21,005,600	
ニッポン	28,800	1,595.00	45,936,000	
日清製粉グループ本社	99,000	1,561.00	154,539,000	
日東富士製粉	1,900	4,450.00	8,455,000	
昭和産業	9,300	2,495.00	23,203,500	
鳥越製粉	7,600	596.00	4,529,600	
中部飼料	14,800	1,043.00	15,436,400	
フィード・ワン	15,600	682.00	10,639,200	
東洋精糖	1,800	894.00	1,609,200	
日本甜菜製糖	6,200	1,641.00	10,174,200	
DM三井製糖ホールディングス	10,600	2,065.00	21,889,000	
塩水港精糖	11,400	201.00	2,291,400	
ウェルネオシュガー	5,500	1,670.00	9,185,000	
森永製菓	19,800	3,945.00	78,111,000	
中村屋	2,700	3,045.00	8,221,500	
江崎グリコ	30,600	3,480.00	106,488,000	
名糖産業	4,200	1,685.00	7,077,000	
井村屋グループ	5,900	2,210.00	13,039,000	
不二家	7,300	2,480.00	18,104,000	
山崎製パン	71,700	1,602.00	114,863,400	
第一屋製パン	1,800	398.00	716,400	
モロゾフ	3,500	3,400.00	11,900,000	
亀田製菓	6,800	4,285.00	29,138,000	
寿スピリッツ	11,400	8,620.00	98,268,000	

カルビー	49,000	2,807.00	137,543,000	
森永乳業	19,500	4,805.00	93,697,500	
六甲バター	7,900	1,354.00	10,696,600	
ヤクルト本社	76,500	9,150.00	699,975,000	
明治ホールディングス	66,400	6,340.00	420,976,000	
雪印メグミルク	25,900	1,814.00	46,982,600	
プリマハム	14,400	2,150.00	30,960,000	
日本ハム	41,900	3,775.00	158,172,500	
林兼産業	2,900	467.00	1,354,300	
丸大食品	10,800	1,491.00	16,102,800	
S F o o d s	11,800	2,785.00	32,863,000	
柿安本店	4,200	2,043.00	8,580,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	83,200	719.00	59,820,800	
サッポロホールディングス	35,200	3,135.00	110,352,000	
アサヒグループホールディングス	247,400	4,736.00	1,171,686,400	
麒麟ホールディングス	483,200	2,011.00	971,715,200	
宝ホールディングス	73,100	1,066.00	77,924,600	
オエノンホールディングス	32,000	272.00	8,704,000	
養命酒製造	3,500	1,837.00	6,429,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	83,900	1,439.00	120,732,100	
サントリー食品インターナショナル	75,400	4,780.00	360,412,000	
ダイドーグループホールディングス	6,100	4,805.00	29,310,500	
伊藤園	36,300	4,450.00	161,535,000	
キーコーヒー	12,000	2,067.00	24,804,000	
ユニカフェ	3,200	889.00	2,844,800	
ジャパンフーズ	1,500	1,098.00	1,647,000	
日清オイリオグループ	15,100	3,345.00	50,509,500	
不二製油グループ本社	24,900	1,989.00	49,526,100	
かどや製油	1,100	3,540.00	3,894,000	
J-オイルミルズ	10,900	1,571.00	17,123,900	
キッコーマン	71,000	6,400.00	454,400,000	
味の素	262,000	4,115.00	1,078,130,000	
ブルドックソース	4,300	1,933.00	8,311,900	
キュービー	57,500	2,229.00	128,167,500	
ハウス食品グループ本社	32,800	2,693.00	88,330,400	

カゴメ	49,900	3,020.00	150,698,000	
焼津水産化学工業	4,200	1,018.00	4,275,600	
アリアケジャパン	9,300	4,870.00	45,291,000	
ピエトロ	1,400	1,827.00	2,557,800	
エバラ食品工業	2,900	3,030.00	8,787,000	
やまみ	900	1,388.00	1,249,200	
ニチレイ	49,100	2,679.00	131,538,900	
東洋水産	54,100	5,520.00	298,632,000	
イートアンドホールディングス	4,500	2,300.00	10,350,000	
大冷	1,200	1,895.00	2,274,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,800	1,036.00	7,044,800	
日清食品ホールディングス	37,700	11,290.00	425,633,000	
永谷園ホールディングス	5,300	2,094.00	11,098,200	
一正蒲鉾	4,100	710.00	2,911,000	
フジッコ	11,000	1,867.00	20,537,000	
ロック・フィールド	13,000	1,572.00	20,436,000	
日本たばこ産業	704,800	2,782.00	1,960,753,600	
ケンコーマヨネーズ	7,400	1,305.00	9,657,000	
わらべや日洋ホールディングス	7,900	1,883.00	14,875,700	
なとり	6,700	2,032.00	13,614,400	
イフジ産業	1,600	912.00	1,459,200	
ファーマフーズ	16,600	1,541.00	25,580,600	
ユーグレナ	68,900	957.00	65,937,300	
紀文食品	8,400	966.00	8,114,400	
ピククルスホールディングス	6,300	1,234.00	7,774,200	
ミヨシ油脂	3,400	955.00	3,247,000	
理研ビタミン	9,300	2,071.00	19,260,300	
片倉工業	10,300	1,801.00	18,550,300	
グンゼ	8,300	4,410.00	36,603,000	
東洋紡	47,500	1,073.00	50,967,500	
ユニチカ	34,600	234.00	8,096,400	
富士紡ホールディングス	4,400	3,120.00	13,728,000	
倉敷紡績	8,300	2,513.00	20,857,900	
シキボウ	5,400	1,035.00	5,589,000	
日本毛織	31,000	967.00	29,977,000	
トーア紡コーポレーション	3,800	354.00	1,345,200	

帝国繊維	12,500	1,599.00	19,987,500
帝人	104,900	1,463.00	153,468,700
東レ	730,200	830.70	606,577,140
住江織物	2,000	1,932.00	3,864,000
日本フェルト	6,300	415.00	2,614,500
イチカワ	1,500	1,340.00	2,010,000
日東製網	1,000	1,537.00	1,537,000
アツギ	6,000	389.00	2,334,000
ダイニック	2,500	785.00	1,962,500
セーレン	21,200	2,505.00	53,106,000
ソトー	3,200	799.00	2,556,800
東海染工	1,100	1,072.00	1,179,200
小松マテーレ	16,000	719.00	11,504,000
ワコールホールディングス	21,000	2,366.00	49,686,000
ホギメディカル	14,700	3,235.00	47,554,500
T S I ホールディングス	39,200	580.00	22,736,000
マツオカコーポレーション	2,700	1,339.00	3,615,300
ワールド	14,100	1,345.00	18,964,500
三陽商会	3,700	1,404.00	5,194,800
ナイガイ	3,700	260.00	962,000
オンワードホールディングス	71,000	335.00	23,785,000
ルックホールディングス	2,800	2,175.00	6,090,000
ゴールドウイン	19,300	11,480.00	221,564,000
デサント	18,800	3,930.00	73,884,000
キング	4,500	515.00	2,317,500
ヤマトインターナショナル	8,100	251.00	2,033,100
特種東海製紙	5,300	2,988.00	15,836,400
王子ホールディングス	453,700	548.00	248,627,600
日本製紙	56,700	1,057.00	59,931,900
三菱製紙	11,600	327.00	3,793,200
北越コーポレーション	68,800	798.00	54,902,400
中越パルプ工業	3,900	999.00	3,896,100
巴川製紙所	3,000	679.00	2,037,000
大王製紙	48,100	1,072.00	51,563,200
阿波製紙	2,300	738.00	1,697,400
レンゴー	99,200	896.00	88,883,200

トーモク	6,300	1,551.00	9,771,300	
ザ・パック	8,100	2,908.00	23,554,800	
北の達人コーポレーション	45,900	330.00	15,147,000	
クラレ	173,200	1,224.00	211,996,800	
旭化成	680,200	956.70	650,747,340	
共和レザー	5,600	509.00	2,850,400	
レゾナック・ホールディングス	105,300	2,344.00	246,823,200	
住友化学	808,000	484.00	391,072,000	
住友精化	4,500	4,390.00	19,755,000	
日産化学	51,700	5,840.00	301,928,000	
ラサ工業	4,200	2,169.00	9,109,800	
クレハ	9,300	8,410.00	78,213,000	
多木化学	4,200	4,390.00	18,438,000	
テイカ	7,300	1,175.00	8,577,500	
石原産業	19,700	1,080.00	21,276,000	
片倉コープアグリ	2,000	1,919.00	3,838,000	
日本曹達	11,700	4,670.00	54,639,000	
東ソー	145,400	1,821.00	264,773,400	
トクヤマ	35,200	2,133.00	75,081,600	
セントラル硝子	17,500	2,953.00	51,677,500	
東亜合成	55,800	1,249.00	69,694,200	
大阪ソーダ	6,500	4,325.00	28,112,500	
関東電化工業	21,100	1,020.00	21,522,000	
デンカ	39,600	2,928.00	115,948,800	
信越化学工業	183,800	19,170.00	3,523,446,000	
日本カーバイド工業	3,700	1,328.00	4,913,600	
堺化学工業	8,300	1,813.00	15,047,900	
第一稀元素化学工業	9,900	1,023.00	10,127,700	
エア・ウォーター	102,800	1,637.00	168,283,600	
日本酸素ホールディングス	105,700	2,383.00	251,883,100	
日本化学工業	3,600	1,998.00	7,192,800	
東邦アセチレン	2,100	1,278.00	2,683,800	
日本パーカライジング	53,900	960.00	51,744,000	
高压ガス工業	15,800	663.00	10,475,400	
チタン工業	1,200	1,455.00	1,746,000	
四国化成ホールディングス	12,900	1,294.00	16,692,600	

戸田工業	2,500	2,512.00	6,280,000
ステラ ケミファ	6,400	2,557.00	16,364,800
保土谷化学工業	3,100	3,090.00	9,579,000
日本触媒	16,600	5,750.00	95,450,000
大日精化工業	7,600	1,811.00	13,763,600
カネカ	24,900	3,450.00	85,905,000
三菱瓦斯化学	81,300	1,953.00	158,778,900
三井化学	91,200	3,235.00	295,032,000
J S R	101,700	3,050.00	310,185,000
東京応化工業	19,100	7,220.00	137,902,000
大阪有機化学工業	8,200	2,000.00	16,400,000
三菱ケミカルグループ	735,000	823.00	604,905,000
KHネオケム	18,100	2,626.00	47,530,600
ダイセル	160,100	947.00	151,614,700
住友ベークライト	16,100	4,540.00	73,094,000
積水化学工業	223,600	1,808.00	404,268,800
日本ゼオン	65,300	1,295.00	84,563,500
アイカ工業	27,500	3,025.00	83,187,500
UBE	56,100	2,069.00	116,070,900
積水樹脂	15,900	1,956.00	31,100,400
タキロンシーアイ	23,800	508.00	12,090,400
旭有機材	7,200	2,846.00	20,491,200
ニチバン	6,700	1,802.00	12,073,400
リケンテクノス	23,500	564.00	13,254,000
大倉工業	5,000	1,910.00	9,550,000
積水化成品工業	15,300	402.00	6,150,600
群栄化学工業	2,600	2,486.00	6,463,600
タイガースポリマー	4,400	420.00	1,848,000
ミライアル	3,000	1,567.00	4,701,000
ダイキアクシス	3,600	690.00	2,484,000
ダイキョーニシカワ	24,000	653.00	15,672,000
竹本容器	3,300	835.00	2,755,500
森六ホールディングス	5,500	1,852.00	10,186,000
恵和	7,000	1,523.00	10,661,000
日本化薬	83,200	1,209.00	100,588,800
カーリットホールディングス	9,800	723.00	7,085,400

日本精化	6,200	2,488.00	15,425,600	
扶桑化学工業	10,100	3,695.00	37,319,500	
トリケミカル研究所	14,500	2,290.00	33,205,000	
ADEKA	38,000	2,144.00	81,472,000	
日油	33,700	5,960.00	200,852,000	
新日本理化	13,300	216.00	2,872,800	
ハリマ化成グループ	6,800	894.00	6,079,200	
花王	265,200	5,100.00	1,352,520,000	
第一工業製薬	3,900	1,953.00	7,616,700	
石原ケミカル	5,000	1,316.00	6,580,000	
日華化学	3,900	848.00	3,307,200	
ニイタカ	1,700	2,084.00	3,542,800	
三洋化成工業	6,700	4,325.00	28,977,500	
有機合成薬品工業	7,100	293.00	2,080,300	
大日本塗料	13,300	840.00	11,172,000	
日本ペイントホールディングス	482,000	1,250.00	602,500,000	
関西ペイント	99,800	1,851.00	184,729,800	
神東塗料	8,100	128.00	1,036,800	
中国塗料	19,900	1,090.00	21,691,000	
日本特殊塗料	6,100	930.00	5,673,000	
藤倉化成	14,600	448.00	6,540,800	
太陽ホールディングス	16,600	2,382.00	39,541,200	
D I C	42,600	2,454.00	104,540,400	
サカタインクス	24,200	1,030.00	24,926,000	
東洋インキS Cホールディングス	21,300	1,924.00	40,981,200	
T&K TOKA	9,700	1,261.00	12,231,700	
富士フイルムホールディングス	209,300	6,367.00	1,332,613,100	
資生堂	227,700	6,137.00	1,397,394,900	
ライオン	130,800	1,455.00	190,314,000	
高砂香料工業	7,400	2,516.00	18,618,400	
マンダム	23,600	1,433.00	33,818,800	
ミルボン	16,200	5,810.00	94,122,000	
ファンケル	47,700	2,496.00	119,059,200	
コーセー	22,200	15,210.00	337,662,000	
コタ	9,100	1,655.00	15,060,500	
シーボン	1,300	1,600.00	2,080,000	

ポーラ・オルビスホールディングス	55,900	1,737.00	97,098,300	
ノエビアホールディングス	9,700	5,510.00	53,447,000	
アジュバンホールディングス	2,400	1,010.00	2,424,000	
新日本製薬	6,200	1,419.00	8,797,800	
エステー	8,400	1,548.00	13,003,200	
アグロ カネショウ	4,400	1,533.00	6,745,200	
コニシ	18,200	1,814.00	33,014,800	
長谷川香料	22,600	2,965.00	67,009,000	
星光PMC	4,900	542.00	2,655,800	
小林製薬	31,700	8,190.00	259,623,000	
荒川化学工業	9,200	1,003.00	9,227,600	
メック	9,000	2,166.00	19,494,000	
日本高純度化学	2,800	2,451.00	6,862,800	
タカラバイオ	29,400	1,753.00	51,538,200	
JCU	12,300	3,050.00	37,515,000	
新田ゼラチン	6,000	828.00	4,968,000	
OATアグリオ	4,000	1,445.00	5,780,000	
デクセリアルズ	31,500	2,693.00	84,829,500	
アース製薬	9,900	4,855.00	48,064,500	
北興化学工業	11,000	825.00	9,075,000	
大成ラミック	3,400	2,883.00	9,802,200	
クミアイ化学工業	43,300	872.00	37,757,600	
日本農薬	20,000	701.00	14,020,000	
アキレス	7,100	1,247.00	8,853,700	
有沢製作所	17,900	1,390.00	24,881,000	
日東電工	79,200	8,410.00	666,072,000	
レック	15,500	933.00	14,461,500	
三光合成	14,900	565.00	8,418,500	
きもと	14,300	201.00	2,874,300	
藤森工業	8,600	3,130.00	26,918,000	
前澤化成工業	7,000	1,383.00	9,681,000	
未来工業	3,900	1,499.00	5,846,100	
ウェーブロックホールディングス	2,900	617.00	1,789,300	
JSP	7,700	1,595.00	12,281,500	
エフピコ	20,600	3,510.00	72,306,000	
天馬	9,300	2,326.00	21,631,800	

信越ポリマー	20,200	1,366.00	27,593,200
東リ	21,700	277.00	6,010,900
ニフコ	39,300	3,525.00	138,532,500
バルカー	9,100	3,240.00	29,484,000
ユニ・チャーム	227,200	5,019.00	1,140,316,800
ショーエイコーポレーション	2,800	565.00	1,582,000
協和キリン	131,800	2,948.00	388,546,400
武田薬品工業	965,100	4,305.00	4,154,755,500
アステラス製薬	1,045,100	1,904.50	1,990,392,950
住友ファーマ	81,000	880.00	71,280,000
塩野義製薬	139,400	6,116.00	852,570,400
わかもと製薬	9,300	225.00	2,092,500
日本新薬	25,700	6,310.00	162,167,000
中外製薬	341,400	3,562.00	1,216,066,800
科研製薬	18,700	3,635.00	67,974,500
エーザイ	132,700	7,719.00	1,024,311,300
ロート製薬	105,700	2,504.00	264,672,800
小野薬品工業	210,400	2,848.50	599,324,400
久光製薬	24,300	3,960.00	96,228,000
持田製薬	13,100	3,445.00	45,129,500
参天製薬	205,300	1,042.00	213,922,600
扶桑薬品工業	3,500	1,971.00	6,898,500
日本ケミファ	1,000	1,744.00	1,744,000
ツムラ	34,400	2,643.00	90,919,200
キッセイ薬品工業	16,900	2,530.00	42,757,000
生化学工業	20,900	815.00	17,033,500
栄研化学	17,700	1,569.00	27,771,300
鳥居薬品	5,900	3,265.00	19,263,500
JCRファーマ	37,000	1,531.00	56,647,000
東和薬品	16,800	1,929.00	32,407,200
富士製薬工業	7,100	1,061.00	7,533,100
ゼリア新薬工業	15,100	2,206.00	33,310,600
第一三共	950,100	4,275.00	4,061,677,500
キョーリン製薬ホールディングス	23,700	1,699.00	40,266,300
大幸薬品	19,900	429.00	8,537,100
ダイト	8,200	2,447.00	20,065,400

大塚ホールディングス	249,500	4,169.00	1,040,165,500	
大正製薬ホールディングス	24,200	5,480.00	132,616,000	
ペプチドリーム	52,900	1,845.00	97,600,500	
あすか製薬ホールディングス	11,200	1,179.00	13,204,800	
サワイグループホールディングス	24,900	3,805.00	94,744,500	
日本コークス工業	98,400	87.00	8,560,800	
ニチレキ	12,900	1,401.00	18,072,900	
ユシロ化学工業	5,700	837.00	4,770,900	
ビーピー・カストロール	3,700	905.00	3,348,500	
富士石油	22,300	258.00	5,753,400	
MORESCO	3,200	1,220.00	3,904,000	
出光興産	121,100	3,090.00	374,199,000	
ENEOSホールディングス	1,970,300	471.10	928,208,330	
コスモエネルギーホールディングス	43,100	4,115.00	177,356,500	
横浜ゴム	62,000	2,573.00	159,526,000	
TOYO TIRE	62,700	1,628.00	102,075,600	
ブリヂストン	348,300	5,204.00	1,812,553,200	
住友ゴム工業	107,000	1,247.00	133,429,000	
藤倉コンポジット	6,900	992.00	6,844,800	
オカモト	6,100	3,905.00	23,820,500	
フコク	5,700	1,050.00	5,985,000	
ニッタ	11,100	2,968.00	32,944,800	
住友理工	21,200	719.00	15,242,800	
三ツ星ベルト	15,900	3,945.00	62,725,500	
バンドー化学	17,300	1,023.00	17,697,900	
日東紡績	13,000	2,107.00	27,391,000	
AGC	111,000	5,070.00	562,770,000	
日本板硝子	55,600	729.00	40,532,400	
石塚硝子	1,600	1,452.00	2,323,200	
日本山村硝子	3,700	703.00	2,601,100	
日本電気硝子	44,500	2,564.00	114,098,000	
オハラ	5,200	1,192.00	6,198,400	
住友大阪セメント	15,400	3,855.00	59,367,000	
太平洋セメント	69,500	2,508.00	174,306,000	
日本ヒューム	9,600	677.00	6,499,200	
日本コンクリート工業	21,400	234.00	5,007,600	

三谷セキサン	4,600	4,265.00	19,619,000	
アジアパイルホールディングス	17,100	648.00	11,080,800	
東海カーボン	91,500	1,280.00	117,120,000	
日本カーボン	6,300	4,145.00	26,113,500	
東洋炭素	6,800	4,550.00	30,940,000	
ノリタケカンパニーリミテド	5,400	4,520.00	24,408,000	
TOTO	72,000	4,615.00	332,280,000	
日本碍子	129,100	1,816.00	234,445,600	
日本特殊陶業	83,000	2,749.00	228,167,000	
MARUWA	4,000	17,180.00	68,720,000	
品川リフラクトリーズ	3,100	4,355.00	13,500,500	
黒崎播磨	2,200	6,350.00	13,970,000	
ヨータイ	7,300	1,490.00	10,877,000	
東京窯業	9,100	306.00	2,784,600	
ニッカトー	4,500	571.00	2,569,500	
フジインコーポレーテッド	8,700	6,400.00	55,680,000	
クミネ工業	2,900	901.00	2,612,900	
エーアンドエーマテリアル	1,800	936.00	1,684,800	
ニチアス	27,600	2,604.00	71,870,400	
ニチハ	13,700	2,651.00	36,318,700	
日本製鉄	502,400	3,078.00	1,546,387,200	
神戸製鋼所	225,700	899.00	202,904,300	
中山製鋼所	23,100	1,121.00	25,895,100	
合同製鐵	5,600	3,445.00	19,292,000	
JFEホールディングス	299,800	1,739.00	521,352,200	
東京製鐵	31,600	1,519.00	48,000,400	
共英製鋼	12,800	1,583.00	20,262,400	
大和工業	18,500	5,380.00	99,530,000	
東京鐵鋼	5,400	1,835.00	9,909,000	
大阪製鐵	5,200	1,380.00	7,176,000	
淀川製鋼所	12,800	2,682.00	34,329,600	
中部鋼板	9,200	2,060.00	18,952,000	
丸一鋼管	34,200	2,860.00	97,812,000	
モリ工業	2,300	3,095.00	7,118,500	
大同特殊鋼	14,100	5,440.00	76,704,000	
日本高周波鋼業	3,400	349.00	1,186,600	

日本冶金工業	8,200	4,515.00	37,023,000
山陽特殊製鋼	11,100	2,698.00	29,947,800
愛知製鋼	6,500	2,369.00	15,398,500
日本金属	2,200	940.00	2,068,000
大平洋金属	8,000	2,024.00	16,192,000
新日本電工	71,800	373.00	26,781,400
栗本鐵工所	5,300	2,087.00	11,061,100
虹技	1,200	1,011.00	1,213,200
三菱製鋼	7,100	1,215.00	8,626,500
日亜鋼業	10,200	273.00	2,784,600
日本精線	1,500	4,630.00	6,945,000
エンビプロ・ホールディングス	6,900	755.00	5,209,500
シンニッタン	10,900	262.00	2,855,800
新家工業	2,200	2,347.00	5,163,400
大紀アルミニウム工業所	16,000	1,449.00	23,184,000
日本軽金属ホールディングス	30,300	1,473.00	44,631,900
三井金属鉱業	32,700	3,460.00	113,142,000
東邦亜鉛	6,700	2,144.00	14,364,800
三菱マテリアル	74,900	2,188.00	163,881,200
住友金属鉱山	130,100	5,343.00	695,124,300
DOWAホールディングス	25,200	4,545.00	114,534,000
古河機械金属	16,500	1,413.00	23,314,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,500	2,989.00	49,318,500
東邦チタニウム	20,300	2,116.00	42,954,800
UACJ	15,700	2,744.00	43,080,800
CKサンエツ	2,700	4,215.00	11,380,500
古河電気工業	37,400	2,439.00	91,218,600
住友電気工業	387,400	1,684.50	652,575,300
フジクラ	120,400	988.00	118,955,200
昭和電線ホールディングス	12,600	1,910.00	24,066,000
タツタ電線	22,900	711.00	16,281,900
カナレ電気	1,600	1,307.00	2,091,200
平河ヒューテック	6,500	1,413.00	9,184,500
リョービ	12,000	1,450.00	17,400,000
アーレスティ	11,200	550.00	6,160,000
アサヒホールディングス	45,400	1,979.00	89,846,600

稲葉製作所	6,600	1,403.00	9,259,800	
宮地エンジニアリンググループ	3,100	3,650.00	11,315,000	
トーカロ	30,800	1,256.00	38,684,800	
アルファC o	3,600	994.00	3,578,400	
SUMCO	213,600	1,864.00	398,150,400	
川田テクノロジーズ	2,600	3,530.00	9,178,000	
RS Technologies	7,500	3,465.00	25,987,500	
ジェイテックコーポレーション	1,300	2,775.00	3,607,500	
信和	5,500	748.00	4,114,000	
東洋製罐グループホールディングス	74,200	1,764.00	130,888,800	
ホッカンホールディングス	6,000	1,344.00	8,064,000	
コロナ	6,300	916.00	5,770,800	
横河ブリッジホールディングス	14,800	2,047.00	30,295,600	
駒井ハルテック	1,600	1,742.00	2,787,200	
高田機工	800	2,687.00	2,149,600	
三和ホールディングス	103,300	1,430.00	147,719,000	
文化シャッター	32,300	1,134.00	36,628,200	
三協立山	15,300	657.00	10,052,100	
アルインコ	8,600	1,067.00	9,176,200	
東洋シャッター	2,300	513.00	1,179,900	
LIXIL	163,400	2,185.00	357,029,000	
日本ファイルコン	6,500	456.00	2,964,000	
ノーリツ	16,500	1,611.00	26,581,500	
長府製作所	11,300	2,100.00	23,730,000	
リンナイ	20,300	9,770.00	198,331,000	
ダイニチ工業	5,000	674.00	3,370,000	
日東精工	16,300	519.00	8,459,700	
三洋工業	1,100	1,939.00	2,132,900	
岡部	18,000	730.00	13,140,000	
ジーテクト	12,500	1,413.00	17,662,500	
東プレ	19,800	1,232.00	24,393,600	
高周波熱錬	18,300	677.00	12,389,100	
東京製綱	6,600	1,243.00	8,203,800	
サンコール	8,900	618.00	5,500,200	
モリテック スチール	7,300	333.00	2,430,900	
パイオラックス	15,500	1,971.00	30,550,500	

エイチワン	11,500	633.00	7,279,500	
日本発條	99,200	917.00	90,966,400	
中央発條	6,200	719.00	4,457,800	
アドバネクス	1,200	1,112.00	1,334,400	
立川ブラインド工業	5,100	1,322.00	6,742,200	
三益半導体工業	10,100	2,508.00	25,330,800	
日本ドライケミカル	2,400	1,656.00	3,974,400	
日本製鋼所	30,300	2,615.00	79,234,500	
三浦工業	45,900	3,345.00	153,535,500	
タクマ	33,800	1,365.00	46,137,000	
ツガミ	24,500	1,472.00	36,064,000	
オークマ	11,000	5,240.00	57,640,000	
芝浦機械	12,100	2,943.00	35,610,300	
アマダ	175,300	1,213.00	212,638,900	
アイダエンジニアリング	22,700	791.00	17,955,700	
TAKISAWA	2,600	1,145.00	2,977,000	
FUJI	47,800	2,054.00	98,181,200	
牧野フライス製作所	12,200	4,720.00	57,584,000	
オーエスジー	52,500	1,940.00	101,850,000	
ダイジェット工業	1,100	836.00	919,600	
旭ダイヤモンド工業	31,500	772.00	24,318,000	
DMG森精機	66,600	2,159.00	143,789,400	
ソディック	30,400	747.00	22,708,800	
ディスコ	17,600	39,800.00	700,480,000	
日東工器	5,400	1,710.00	9,234,000	
日進工具	9,200	1,064.00	9,788,800	
パンチ工業	8,600	447.00	3,844,200	
富士ダイス	4,700	584.00	2,744,800	
豊和工業	5,400	999.00	5,394,600	
ニデックオーケーケー	3,900	877.00	3,420,300	
東洋機械金属	6,800	570.00	3,876,000	
エンシュウ	2,200	704.00	1,548,800	
島精機製作所	17,500	1,825.00	31,937,500	
オプトラン	16,300	2,127.00	34,670,100	
NCホールディングス	2,000	1,872.00	3,744,000	
イワキポンプ	7,400	1,295.00	9,583,000	

フリー	11,600	1,223.00	14,186,800
ヤマシンフィルタ	26,300	402.00	10,572,600
日阪製作所	10,700	937.00	10,025,900
やまびこ	18,000	1,260.00	22,680,000
野村マイクロ・サイエンス	3,700	4,265.00	15,780,500
平田機工	5,300	6,500.00	34,450,000
ペガサスミシン製造	12,200	677.00	8,259,400
マルマエ	5,300	1,903.00	10,085,900
タツモ	6,100	1,668.00	10,174,800
ナブテスコ	68,900	3,475.00	239,427,500
三井海洋開発	13,800	1,516.00	20,920,800
レオン自動機	11,600	1,229.00	14,256,400
SMC	35,600	65,760.00	2,341,056,000
ホソカワミクロン	8,400	2,646.00	22,226,400
ユニオンツール	4,800	3,220.00	15,456,000
オイレス工業	15,400	1,637.00	25,209,800
日精エー・エス・ビー機械	5,000	4,325.00	21,625,000
サトーホールディングス	15,600	2,291.00	35,739,600
技研製作所	11,500	2,805.00	32,257,500
日本エアテック	5,600	1,092.00	6,115,200
カワタ	2,900	872.00	2,528,800
日精樹脂工業	8,200	976.00	8,003,200
オカダアイヨン	3,000	1,622.00	4,866,000
ワイエイシイホールディングス	4,200	2,267.00	9,521,400
小松製作所	514,600	3,327.00	1,712,074,200
住友重機械工業	65,000	3,010.00	195,650,000
日立建機	43,800	3,110.00	136,218,000
日工	16,400	626.00	10,266,400
巴工業	4,700	2,432.00	11,430,400
井関農機	10,400	1,189.00	12,365,600
TOWA	11,200	1,843.00	20,641,600
丸山製作所	1,700	1,749.00	2,973,300
北川鉄工所	4,400	1,120.00	4,928,000
ローツェ	5,700	10,210.00	58,197,000
タカキタ	2,900	443.00	1,284,700
クボタ	581,200	2,088.00	1,213,545,600

荏原実業	5,400	2,871.00	15,503,400
三菱化工機	3,600	2,230.00	8,028,000
月島機械	14,900	1,117.00	16,643,300
帝国電機製作所	8,200	2,606.00	21,369,200
新東工業	22,300	759.00	16,925,700
澁谷工業	10,300	2,426.00	24,987,800
アイチ コーポレーション	15,700	787.00	12,355,900
小森コーポレーション	25,600	892.00	22,835,200
鶴見製作所	8,400	1,987.00	16,690,800
日本ギア工業	3,400	497.00	1,689,800
酒井重工業	1,600	3,825.00	6,120,000
荏原製作所	45,000	5,530.00	248,850,000
石井鐵工所	1,200	2,306.00	2,767,200
西島製作所	9,500	1,520.00	14,440,000
北越工業	11,100	1,382.00	15,340,200
ダイキン工業	131,100	23,585.00	3,091,993,500
オルガノ	15,100	3,370.00	50,887,000
トーヨーカネツ	4,200	2,678.00	11,247,600
栗田工業	61,400	5,970.00	366,558,000
椿本チエイン	15,600	3,150.00	49,140,000
大同工業	4,000	766.00	3,064,000
木村化工機	8,500	729.00	6,196,500
アネスト岩田	18,700	910.00	17,017,000
ダイフク	56,600	7,140.00	404,124,000
サムコ	3,600	3,445.00	12,402,000
加藤製作所	4,700	921.00	4,328,700
油研工業	1,500	2,020.00	3,030,000
タダノ	58,000	1,025.00	59,450,000
フジテック	40,200	3,240.00	130,248,000
CKD	30,400	2,025.00	61,560,000
平和	36,600	2,474.00	90,548,400
理想科学工業	9,800	2,381.00	23,333,800
SANKYO	21,600	5,530.00	119,448,000
日本金銭機械	12,100	1,271.00	15,379,100
マースグループホールディングス	6,500	2,430.00	15,795,000
フクシマガリレイ	8,100	4,290.00	34,749,000

オーイズミ	3,800	507.00	1,926,600	
ダイコク電機	6,000	2,606.00	15,636,000	
竹内製作所	19,900	3,010.00	59,899,000	
アマノ	31,200	2,480.00	77,376,000	
J U K I	17,100	641.00	10,961,100	
ジャノメ	11,200	611.00	6,843,200	
マックス	13,600	2,159.00	29,362,400	
グローリー	28,500	2,743.00	78,175,500	
新晃工業	11,100	1,558.00	17,293,800	
大和冷機工業	16,900	1,269.00	21,446,100	
セガサミーホールディングス	88,300	2,342.00	206,798,600	
日本ピストンリング	3,300	1,337.00	4,412,100	
リケン	4,400	2,633.00	11,585,200	
T P R	12,800	1,394.00	17,843,200	
ツバキ・ナカシマ	27,100	949.00	25,717,900	
ホシザキ	70,700	4,675.00	330,522,500	
大豊工業	9,600	648.00	6,220,800	
日本精工	201,800	755.00	152,359,000	
NTN	216,500	340.00	73,610,000	
ジェイテクト	97,800	1,025.00	100,245,000	
不二越	8,100	3,845.00	31,144,500	
日本トムソン	27,000	591.00	15,957,000	
THK	63,400	2,879.00	182,528,600	
ユーシン精機	8,800	732.00	6,441,600	
前澤給装工業	7,800	975.00	7,605,000	
イーグル工業	12,200	1,184.00	14,444,800	
前澤工業	5,700	625.00	3,562,500	
日本ピラー工業	10,200	3,365.00	34,323,000	
キッツ	40,500	874.00	35,397,000	
マキタ	136,700	3,495.00	477,766,500	
三井E & Sホールディングス	50,200	433.00	21,736,600	
日立造船	90,100	904.00	81,450,400	
三菱重工業	192,100	5,033.00	966,839,300	
I H I	69,200	3,650.00	252,580,000	
スター精密	20,800	1,637.00	34,049,600	
日清紡ホールディングス	89,400	1,004.00	89,757,600	

イビデン	63,100	4,495.00	283,634,500
コニカミノルタ	245,800	602.00	147,971,600
ブラザー工業	146,900	2,020.00	296,738,000
ミネベアミツミ	191,100	2,411.00	460,742,100
日立製作所	534,000	7,003.00	3,739,602,000
東芝	211,400	4,311.00	911,345,400
三菱電機	1,135,000	1,545.50	1,754,142,500
富士電機	66,800	5,190.00	346,692,000
東洋電機製造	3,200	886.00	2,835,200
安川電機	130,100	5,020.00	653,102,000
シンフォニアテクノロジー	12,100	1,665.00	20,146,500
明電舎	16,700	1,935.00	32,314,500
オリジン	2,200	1,286.00	2,829,200
山洋電気	4,800	5,690.00	27,312,000
デンヨー	8,400	1,580.00	13,272,000
PHCホールディングス	15,400	1,431.00	22,037,400
ソシオネクスト	11,300	8,240.00	93,112,000
東芝テック	16,400	3,825.00	62,730,000
芝浦メカトロニクス	2,100	13,310.00	27,951,000
マブチモーター	27,300	3,770.00	102,921,000
日本電産	266,700	6,878.00	1,834,362,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,600	483.00	4,153,800
トレックス・セミコンダクター	5,300	2,502.00	13,260,600
東光高岳	6,700	2,080.00	13,936,000
ダブル・スコープ	35,900	1,275.00	45,772,500
ダイヘン	9,900	4,375.00	43,312,500
ヤーマン	21,500	1,455.00	31,282,500
JVCケンウッド	100,800	388.00	39,110,400
ミマキエンジニアリング	10,900	560.00	6,104,000
I-PEX	6,300	1,230.00	7,749,000
日新電機	26,300	1,696.00	44,604,800
大崎電気工業	26,000	540.00	14,040,000
オムロン	100,600	7,105.00	714,763,000
日東工業	14,800	2,642.00	39,101,600
I D E C	16,200	3,305.00	53,541,000
正興電機製作所	4,000	989.00	3,956,000

不二電機工業	2,200	1,130.00	2,486,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,200	2,485.00	89,957,000	
サクサホールディングス	2,000	1,485.00	2,970,000	
メルコホールディングス	3,000	3,355.00	10,065,000	
テクノメディカ	2,800	1,714.00	4,799,200	
日本電気	155,300	4,760.00	739,228,000	
富士通	109,400	17,465.00	1,910,671,000	
沖電気工業	49,700	725.00	36,032,500	
岩崎通信機	4,300	785.00	3,375,500	
電気興業	5,100	2,173.00	11,082,300	
サンケン電気	10,200	8,850.00	90,270,000	
ナカヨ	1,600	1,197.00	1,915,200	
アイホン	6,700	1,968.00	13,185,600	
ルネサスエレクトロニクス	716,800	1,702.00	1,219,993,600	
セイコーエプソン	146,300	1,871.00	273,727,300	
ワコム	87,400	656.00	57,334,400	
アルバック	26,100	5,180.00	135,198,000	
アクセル	3,800	1,744.00	6,627,200	
E I Z O	8,000	3,715.00	29,720,000	
日本信号	25,000	1,038.00	25,950,000	
京三製作所	23,000	411.00	9,453,000	
能美防災	15,000	1,647.00	24,705,000	
ホーチキ	8,400	1,463.00	12,289,200	
星和電機	4,500	467.00	2,101,500	
エレコム	26,500	1,312.00	34,768,000	
パナソニック ホールディングス	1,297,300	1,181.50	1,532,759,950	
シャープ	132,200	967.00	127,837,400	
アンリツ	77,300	1,252.00	96,779,600	
富士通ゼネラル	31,100	3,780.00	117,558,000	
ソニーグループ	769,200	11,350.00	8,730,420,000	
T D K	174,000	4,545.00	790,830,000	
帝国通信工業	5,100	1,449.00	7,389,900	
タムラ製作所	47,100	759.00	35,748,900	
アルプスアルパイン	98,300	1,421.00	139,684,300	
池上通信機	3,100	612.00	1,897,200	
日本電波工業	13,300	1,401.00	18,633,300	

鈴木	6,700	1,018.00	6,820,600	
メイコー	12,100	2,771.00	33,529,100	
日本トリム	2,600	2,893.00	7,521,800	
ローランド ディー. ジー.	6,300	3,115.00	19,624,500	
フォスター電機	10,200	981.00	10,006,200	
SMK	2,600	2,536.00	6,593,600	
ヨコオ	8,900	2,018.00	17,960,200	
ホシデン	26,500	1,725.00	45,712,500	
ヒロセ電機	18,200	17,140.00	311,948,000	
日本航空電子工業	22,500	2,278.00	51,255,000	
TOA	12,500	790.00	9,875,000	
マクセル	24,100	1,470.00	35,427,000	
古野電気	14,600	947.00	13,826,200	
スミダコーポレーション	10,200	1,638.00	16,707,600	
アイコム	4,200	2,557.00	10,739,400	
リオン	4,700	1,853.00	8,709,100	
横河電機	120,200	2,049.00	246,289,800	
新電元工業	4,200	3,500.00	14,700,000	
アズビル	76,000	3,555.00	270,180,000	
東亜ディーケーケー	4,900	787.00	3,856,300	
日本光電工業	50,300	3,420.00	172,026,000	
チノー	4,500	1,950.00	8,775,000	
共和電業	9,100	335.00	3,048,500	
日本電子材料	7,200	1,483.00	10,677,600	
堀場製作所	24,200	7,160.00	173,272,000	
アドバンテスト	85,700	10,090.00	864,713,000	
小野測器	4,300	421.00	1,810,300	
エスペック	8,800	1,998.00	17,582,400	
キーエンス	108,800	57,850.00	6,294,080,000	
日置電機	5,700	7,850.00	44,745,000	
シスメックス	93,800	8,148.00	764,282,400	
日本マイクロニクス	18,100	1,292.00	23,385,200	
メガチップス	9,000	2,835.00	25,515,000	
OBARA GROUP	5,200	3,890.00	20,228,000	
澤藤電機	1,400	1,143.00	1,600,200	
原田工業	4,600	862.00	3,965,200	

コーセル	14,700	1,105.00	16,243,500	
イリソ電子工業	10,100	4,700.00	47,470,000	
オブテックスグループ	20,100	2,043.00	41,064,300	
千代田インテグレ	4,500	2,187.00	9,841,500	
レーザーテック	49,900	22,155.00	1,105,534,500	
スタンレー電気	77,500	2,858.00	221,495,000	
岩崎電気	3,600	4,445.00	16,002,000	
ウシオ電機	57,000	1,595.00	90,915,000	
岡谷電機産業	8,500	292.00	2,482,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	9,500	402.00	3,819,000	
エノモト	2,600	1,882.00	4,893,200	
日本セラミック	11,200	2,725.00	30,520,000	
遠藤照明	4,700	817.00	3,839,900	
古河電池	8,300	1,152.00	9,561,600	
双信電機	4,600	380.00	1,748,000	
山一電機	9,600	1,801.00	17,289,600	
図研	9,500	3,460.00	32,870,000	
日本電子	27,300	4,045.00	110,428,500	
カシオ計算機	81,000	1,339.00	108,459,000	
ファナック	106,700	22,450.00	2,395,415,000	
日本シイエムケイ	23,600	504.00	11,894,400	
エンプラス	3,200	4,035.00	12,912,000	
大真空	13,600	757.00	10,295,200	
ローム	50,300	10,450.00	525,635,000	
浜松ホトニクス	87,300	6,660.00	581,418,000	
三井ハイテック	11,300	6,800.00	76,840,000	
新光電気工業	38,500	3,680.00	141,680,000	
京セラ	168,900	6,740.00	1,138,386,000	
太陽誘電	53,000	4,150.00	219,950,000	
村田製作所	329,800	7,433.00	2,451,403,400	
双葉電子工業	21,200	557.00	11,808,400	
北陸電気工業	3,800	1,393.00	5,293,400	
ニチコン	22,400	1,312.00	29,388,800	
日本ケミコン	10,900	2,130.00	23,217,000	
KOA	16,600	1,881.00	31,224,600	
市光工業	16,400	443.00	7,265,200	

小糸製作所	130,900	2,310.00	302,379,000	
ミツバ	20,400	510.00	10,404,000	
S C R E E Nホールディングス	18,600	10,360.00	192,696,000	
キヤノン電子	12,200	1,755.00	21,411,000	
キヤノン	596,600	2,966.50	1,769,813,900	
リコー	272,600	1,078.00	293,862,800	
象印マホービン	32,600	1,648.00	53,724,800	
M U T O Hホールディングス	1,500	1,686.00	2,529,000	
東京エレクトロン	76,700	45,360.00	3,479,112,000	
イノテック	7,400	1,344.00	9,945,600	
トヨタ紡織	45,800	2,130.00	97,554,000	
芦森工業	1,800	1,471.00	2,647,800	
ユニプレス	19,500	781.00	15,229,500	
豊田自動織機	79,500	7,750.00	616,125,000	
モリタホールディングス	19,100	1,192.00	22,767,200	
三櫻工業	16,600	691.00	11,470,600	
デンソー	224,300	7,423.00	1,664,978,900	
東海理化電機製作所	30,700	1,572.00	48,260,400	
川崎重工業	81,900	2,996.00	245,372,400	
名村造船所	24,800	400.00	9,920,000	
日本車輛製造	4,200	1,944.00	8,164,800	
三菱ロジスネクスト	17,300	852.00	14,739,600	
近畿車輛	1,300	1,197.00	1,556,100	
日産自動車	1,544,600	537.80	830,685,880	
いすゞ自動車	316,100	1,646.00	520,300,600	
トヨタ自動車	5,970,700	1,890.00	11,284,623,000	
日野自動車	140,200	575.00	80,615,000	
三菱自動車工業	424,200	535.00	226,947,000	
エフテック	6,700	614.00	4,113,800	
レシップホールディングス	3,800	465.00	1,767,000	
G M B	1,900	819.00	1,556,100	
ファルテック	1,500	590.00	885,000	
武蔵精密工業	26,600	1,820.00	48,412,000	
日産車体	19,200	885.00	16,992,000	
新明和工業	34,200	1,135.00	38,817,000	
極東開発工業	19,100	1,474.00	28,153,400	

トピー工業	8,800	1,857.00	16,341,600	
ティラド	2,700	2,275.00	6,142,500	
曙ブレーキ工業	66,400	147.00	9,760,800	
タチエス	17,200	1,252.00	21,534,400	
NOK	42,200	1,315.00	55,493,000	
フタバ産業	29,100	423.00	12,309,300	
KYB	10,500	3,670.00	38,535,000	
大同メタル工業	21,300	517.00	11,012,100	
プレス工業	48,600	467.00	22,696,200	
ミクニ	11,100	345.00	3,829,500	
太平洋工業	24,900	1,158.00	28,834,200	
河西工業	12,900	211.00	2,721,900	
アイシン	83,900	3,775.00	316,722,500	
マツダ	359,700	1,195.00	429,841,500	
今仙電機製作所	6,100	789.00	4,812,900	
本田技研工業	883,900	3,533.00	3,122,818,700	
スズキ	199,700	4,777.00	953,966,900	
SUBARU	344,000	2,212.00	760,928,000	
安永	4,200	697.00	2,927,400	
ヤマハ発動機	170,900	3,410.00	582,769,000	
TBK	9,600	254.00	2,438,400	
エクセディ	17,800	1,821.00	32,413,800	
豊田合成	31,700	2,175.00	68,947,500	
愛三工業	18,000	909.00	16,362,000	
盟和産業	1,400	956.00	1,338,400	
日本プラスト	7,600	406.00	3,085,600	
ヨロズ	10,200	756.00	7,711,200	
エフ・シー・シー	19,300	1,494.00	28,834,200	
シマノ	44,500	21,595.00	960,977,500	
テイ・エス テック	49,800	1,747.00	87,000,600	
ジャムコ	5,200	1,770.00	9,204,000	
テルモ	339,700	3,692.00	1,254,172,400	
クリエートメディック	3,200	886.00	2,835,200	
日機装	27,200	934.00	25,404,800	
日本エム・ディ・エム	6,500	1,030.00	6,695,000	
島津製作所	132,400	3,835.00	507,754,000	

JMS	10,100	518.00	5,231,800	
長野計器	7,900	1,197.00	9,456,300	
ブイ・テクノロジー	5,300	2,486.00	13,175,800	
東京計器	8,300	1,296.00	10,756,800	
愛知時計電機	4,200	1,450.00	6,090,000	
インターアクション	6,500	1,456.00	9,464,000	
オーバル	8,600	478.00	4,110,800	
東京精密	23,900	4,945.00	118,185,500	
マニー	47,800	1,868.00	89,290,400	
ニコン	169,100	1,277.00	215,940,700	
トプコン	57,200	1,702.00	97,354,400	
オリンパス	679,700	2,302.50	1,565,009,250	
理研計器	6,700	5,030.00	33,701,000	
タムロン	8,100	3,180.00	25,758,000	
HOYA	232,200	13,310.00	3,090,582,000	
シード	4,900	565.00	2,768,500	
ノーリツ鋼機	10,300	2,156.00	22,206,800	
A&Dホロンホールディングス	15,900	1,282.00	20,383,800	
朝日インテック	121,500	2,343.00	284,674,500	
シチズン時計	119,600	866.00	103,573,600	
リズム	3,000	1,540.00	4,620,000	
大研医器	7,300	473.00	3,452,900	
メニコン	37,300	2,862.00	106,752,600	
シンシア	900	500.00	450,000	
松風	4,900	2,081.00	10,196,900	
セイコーグループ	16,800	2,961.00	49,744,800	
ニプロ	90,700	1,085.00	98,409,500	
KYORITSU	14,400	127.00	1,828,800	
中本パックス	2,900	1,633.00	4,735,700	
スノーピーク	18,600	2,117.00	39,376,200	
パラマウントベッドホールディングス	25,100	2,389.00	59,963,900	
トランザクション	8,400	1,479.00	12,423,600	
粧美堂	2,600	376.00	977,600	
ニホンフラッシュ	10,200	944.00	9,628,800	
前田工織	9,200	3,315.00	30,498,000	
永大産業	10,300	221.00	2,276,300	

アートネイチャー	11,200	749.00	8,388,800
バンダイナムコホールディングス	99,300	8,540.00	848,022,000
アイフィスジャパン	2,700	601.00	1,622,700
SHOEI	11,500	5,170.00	59,455,000
フランスベッドホールディングス	13,500	992.00	13,392,000
パイロットコーポレーション	17,000	4,370.00	74,290,000
萩原工業	7,300	1,216.00	8,876,800
フジシールインターナショナル	22,000	1,620.00	35,640,000
タカラトミー	50,200	1,309.00	65,711,800
広済堂ホールディングス	6,500	2,348.00	15,262,000
エステールホールディングス	2,200	629.00	1,383,800
タカノ	3,600	674.00	2,426,400
プロネクサス	9,000	982.00	8,838,000
ホクシン	7,400	150.00	1,110,000
ウッドワン	3,200	946.00	3,027,200
大建工業	6,600	2,142.00	14,137,200
凸版印刷	142,200	2,494.00	354,646,800
大日本印刷	129,000	3,675.00	474,075,000
共同印刷	3,100	2,956.00	9,163,600
NISSHA	20,700	1,845.00	38,191,500
光村印刷	800	1,231.00	984,800
TAKARA & COMPANY	7,500	2,174.00	16,305,000
アシックス	100,400	3,220.00	323,288,000
ツツミ	2,400	1,974.00	4,737,600
ローランド	8,000	3,915.00	31,320,000
小松ウオール工業	4,000	1,946.00	7,784,000
ヤマハ	68,500	5,110.00	350,035,000
河合楽器製作所	2,900	2,685.00	7,786,500
クリナップ	12,200	650.00	7,930,000
ピジョン	69,300	2,122.00	147,054,600
兼松サステック	700	2,246.00	1,572,200
キングジム	9,600	885.00	8,496,000
リンテック	21,800	2,216.00	48,308,800
イトーキ	22,300	756.00	16,858,800
任天堂	686,500	5,412.00	3,715,338,000
三菱鉛筆	15,400	1,477.00	22,745,800

タカラスタンダード	21,000	1,439.00	30,219,000	
コクヨ	52,400	1,866.00	97,778,400	
ナカバヤシ	11,700	479.00	5,604,300	
グローブライト	8,800	2,566.00	22,580,800	
オカムラ	32,700	1,351.00	44,177,700	
美津濃	10,800	3,020.00	32,616,000	
東京電力ホールディングス	980,200	479.00	469,515,800	
中部電力	400,700	1,444.00	578,610,800	
関西電力	419,900	1,315.00	552,168,500	
中国電力	173,200	705.00	122,106,000	
北陸電力	102,600	576.00	59,097,600	
東北電力	265,800	684.00	181,807,200	
四国電力	92,800	768.00	71,270,400	
九州電力	250,700	757.00	189,779,900	
北海道電力	105,100	491.00	51,604,100	
沖縄電力	25,500	1,074.00	27,387,000	
電源開発	81,900	2,171.00	177,804,900	
エフオン	7,900	608.00	4,803,200	
イーレックス	19,300	2,006.00	38,715,800	
レノバ	28,900	2,184.00	63,117,600	
東京瓦斯	229,900	2,677.00	615,442,300	
大阪瓦斯	220,300	2,153.00	474,305,900	
東邦瓦斯	42,800	2,591.00	110,894,800	
北海道瓦斯	6,500	1,792.00	11,648,000	
広島ガス	22,900	346.00	7,923,400	
西部ガスホールディングス	10,200	1,779.00	18,145,800	
静岡ガス	24,800	1,133.00	28,098,400	
メタウォーター	13,600	1,643.00	22,344,800	
SBSホールディングス	9,700	3,225.00	31,282,500	
東武鉄道	119,400	2,975.00	355,215,000	
相鉄ホールディングス	35,900	2,280.00	81,852,000	
東急	304,900	1,615.00	492,413,500	
京浜急行電鉄	123,300	1,244.00	153,385,200	
小田急電鉄	164,800	1,619.00	266,811,200	
京王電鉄	57,500	4,605.00	264,787,500	
京成電鉄	70,100	3,815.00	267,431,500	

富士急行	13,400	4,155.00	55,677,000	
東日本旅客鉄道	184,400	6,821.00	1,257,792,400	
西日本旅客鉄道	138,900	5,184.00	720,057,600	
東海旅客鉄道	83,800	15,145.00	1,269,151,000	
西武ホールディングス	131,500	1,382.00	181,733,000	
鴻池運輸	18,500	1,471.00	27,213,500	
西日本鉄道	29,000	2,382.00	69,078,000	
ハマキョウレックス	8,500	3,180.00	27,030,000	
サカイ引越センター	5,200	4,365.00	22,698,000	
近鉄グループホールディングス	108,500	4,050.00	439,425,000	
阪急阪神ホールディングス	144,800	3,785.00	548,068,000	
南海電気鉄道	51,900	2,724.00	141,375,600	
京阪ホールディングス	44,900	3,320.00	149,068,000	
神戸電鉄	3,000	3,175.00	9,525,000	
名古屋鉄道	120,000	2,039.00	244,680,000	
山陽電気鉄道	8,200	2,176.00	17,843,200	
アルプス物流	8,700	1,276.00	11,101,200	
ヤマトホールディングス	139,000	2,344.00	325,816,000	
山九	27,600	4,925.00	135,930,000	
丸運	4,700	223.00	1,048,100	
丸全昭和運輸	6,700	3,060.00	20,502,000	
センコーグループホールディングス	57,500	965.00	55,487,500	
トナミホールディングス	2,400	3,940.00	9,456,000	
ニッコンホールディングス	34,800	2,487.00	86,547,600	
日本石油輸送	1,000	2,335.00	2,335,000	
福山通運	9,000	3,365.00	30,285,000	
セイノーホールディングス	67,600	1,404.00	94,910,400	
エスライン	2,700	825.00	2,227,500	
神奈川中央交通	3,100	3,255.00	10,090,500	
AZ-COM丸和ホールディングス	26,200	1,829.00	47,919,800	
C&Fロジホールディングス	10,400	1,215.00	12,636,000	
九州旅客鉄道	76,800	2,909.00	223,411,200	
SGホールディングス	208,300	2,072.00	431,597,600	
NIPPON EXPRESSホールディングス	40,500	7,640.00	309,420,000	
日本郵船	290,700	3,358.00	976,170,600	

商船三井	191,600	3,455.00	661,978,000
川崎汽船	92,800	3,265.00	302,992,000
N S ユナイテッド海運	6,100	4,270.00	26,047,000
飯野海運	40,800	1,020.00	41,616,000
共栄タンカー	2,700	958.00	2,586,600
乾汽船	14,200	2,055.00	29,181,000
日本航空	266,600	2,565.00	683,829,000
ANAホールディングス	295,400	2,781.50	821,655,100
パスコ	1,900	1,419.00	2,696,100
トランコム	3,100	6,770.00	20,987,000
日新	8,200	2,075.00	17,015,000
三菱倉庫	23,300	3,190.00	74,327,000
三井倉庫ホールディングス	10,100	4,070.00	41,107,000
住友倉庫	29,800	2,108.00	62,818,400
澁澤倉庫	4,300	2,179.00	9,369,700
東陽倉庫	12,800	281.00	3,596,800
日本トランスシティ	21,800	571.00	12,447,800
ケイヒン	1,700	1,591.00	2,704,700
中央倉庫	5,200	990.00	5,148,000
川西倉庫	1,600	1,012.00	1,619,200
安田倉庫	7,400	966.00	7,148,400
ファイズホールディングス	1,800	1,174.00	2,113,200
東洋埠頭	2,800	1,371.00	3,838,800
上組	53,400	2,666.00	142,364,400
サンリツ	2,100	755.00	1,585,500
キムラユニティー	4,600	1,038.00	4,774,800
キューソー流通システム	5,800	965.00	5,597,000
東海運	5,600	287.00	1,607,200
エーアイテイー	6,800	1,593.00	10,832,400
内外トランスライン	3,900	2,179.00	8,498,100
日本コンセプト	3,400	1,395.00	4,743,000
NEC ネットズエスアイ	36,500	1,650.00	60,225,000
クロスキャット	6,300	1,275.00	8,032,500
システナ	183,600	340.00	62,424,000
デジタルアーツ	6,900	5,340.00	36,846,000
日鉄ソリューションズ	18,600	3,360.00	62,496,000

キューブシステム	6,600	1,122.00	7,405,200	
コア	4,900	1,519.00	7,443,100	
手間いらず	1,900	4,955.00	9,414,500	
ラクーンホールディングス	10,900	1,112.00	12,120,800	
ソリトンシステムズ	5,700	1,005.00	5,728,500	
ソフトクリエイトホールディングス	4,500	3,475.00	15,637,500	
T I S	122,600	3,360.00	411,936,000	
J N Sホールディングス	4,800	341.00	1,636,800	
グリー	29,400	746.00	21,932,400	
GMOペパボ	1,600	1,868.00	2,988,800	
コーエーテクモホールディングス	68,400	2,325.00	159,030,000	
三菱総合研究所	5,400	5,140.00	27,756,000	
電算	1,200	1,842.00	2,210,400	
A G S	4,200	696.00	2,923,200	
ファインデックス	8,900	620.00	5,518,000	
ブレインパッド	11,000	658.00	7,238,000	
K L a b	21,700	391.00	8,484,700	
ポルトゥウィンホールディングス	18,800	850.00	15,980,000	
ネクソン	282,000	3,030.00	854,460,000	
アイスタイル	35,000	430.00	15,050,000	
エムアップホールディングス	13,500	1,085.00	14,647,500	
エイチーム	8,200	789.00	6,469,800	
エニグモ	14,100	599.00	8,445,900	
テクノスジャパン	8,200	589.00	4,829,800	
コロプラ	42,500	595.00	25,287,500	
ブロードリーフ	64,000	432.00	27,648,000	
クロス・マーケティンググループ	6,000	637.00	3,822,000	
デジタルハーツホールディングス	6,900	1,535.00	10,591,500	
システム情報	9,800	798.00	7,820,400	
メディアドゥ	4,500	1,499.00	6,745,500	
じげん	32,100	418.00	13,417,800	
ブイキューブ	13,200	630.00	8,316,000	
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	495.00	1,237,500	
サイバーリンクス	3,200	861.00	2,755,200	
フィックスターズ	12,400	1,348.00	16,715,200	
CARTA HOLDINGS	5,300	1,451.00	7,690,300	

オブティム	9,100	938.00	8,535,800
セレス	4,500	1,153.00	5,188,500
S H I F T	8,000	22,200.00	177,600,000
ティーガイア	11,500	1,645.00	18,917,500
セック	1,400	3,460.00	4,844,000
テクマトリックス	20,000	1,470.00	29,400,000
プロシップ	4,800	1,419.00	6,811,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	33,400	2,350.00	78,490,000
GMOペイメントゲートウェイ	24,900	11,080.00	275,892,000
ザッパラス	3,000	348.00	1,044,000
システムリサーチ	3,500	2,207.00	7,724,500
インターネットイニシアティブ	60,900	2,651.00	161,445,900
さくらインターネット	12,500	573.00	7,162,500
ヴィンクス	3,000	1,398.00	4,194,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,400	3,885.00	13,209,000
S R Aホールディングス	5,600	3,055.00	17,108,000
システムインテグレータ	3,200	423.00	1,353,600
朝日ネット	11,900	589.00	7,009,100
e B A S E	15,600	647.00	10,093,200
アバントグループ	13,900	1,358.00	18,876,200
アドソル日進	4,700	1,444.00	6,786,800
ODKソリューションズ	2,300	597.00	1,373,100
フリービット	6,800	1,115.00	7,582,000
コムチュア	14,500	2,195.00	31,827,500
サイバーコム	1,700	1,412.00	2,400,400
アステリア	8,700	727.00	6,324,900
アイル	6,200	1,937.00	12,009,400
マークライnz	6,000	2,629.00	15,774,000
メディカル・データ・ビジョン	16,400	910.00	14,924,000
g u m i	17,900	871.00	15,590,900
ショーケース	2,700	321.00	866,700
モバイルファクトリー	2,200	894.00	1,966,800
テラスカイ	4,800	1,902.00	9,129,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,400	1,650.00	10,560,000
P C Iホールディングス	4,200	1,002.00	4,208,400
アイビーシー	1,800	403.00	725,400

ネオジャパン	3,800	943.00	3,583,400
PR TIMES	2,800	1,831.00	5,126,800
ラクス	51,700	1,694.00	87,579,800
ランドコンピュータ	2,500	997.00	2,492,500
ダブルスタンダード	4,500	2,002.00	9,009,000
オープンドア	7,700	1,562.00	12,027,400
アカツキ	5,200	2,143.00	11,143,600
ベネフィットジャパン	700	1,183.00	828,100
Ubicomホールディングス	3,400	1,920.00	6,528,000
カナミックネットワーク	15,900	527.00	8,379,300
ノムラシステムコーポレーション	10,100	112.00	1,131,200
チェンジ	26,800	2,673.00	71,636,400
シンクロ・フード	6,400	489.00	3,129,600
オークネット	5,700	1,741.00	9,923,700
キャピタル・アセット・プランニング	2,100	603.00	1,266,300
セグエグループ	2,800	764.00	2,139,200
エイトレッド	1,500	1,498.00	2,247,000
マクロミル	24,700	1,031.00	25,465,700
ビーグリー	1,700	1,242.00	2,111,400
オロ	3,400	1,770.00	6,018,000
ユーザーローカル	4,000	1,692.00	6,768,000
テモナ	2,300	299.00	687,700
ニーズウェル	3,100	866.00	2,684,600
マネーフォワード	26,300	4,700.00	123,610,000
サインポスト	3,700	580.00	2,146,000
Sun Asterisk	5,900	1,196.00	7,056,400
電算システムホールディングス	5,300	2,509.00	13,297,700
Appier Group	31,000	1,657.00	51,367,000
ソルクシーズ	8,200	360.00	2,952,000
フェイス	3,000	506.00	1,518,000
プロトコーポレーション	13,700	1,226.00	16,796,200
ハイマックス	3,500	1,414.00	4,949,000
野村総合研究所	223,800	2,974.00	665,581,200
サイバネットシステム	9,300	975.00	9,067,500
CEホールディングス	5,200	545.00	2,834,000
日本システム技術	4,100	1,681.00	6,892,100

インテージホールディングス	14,800	1,683.00	24,908,400	
東邦システムサイエンス	2,800	1,078.00	3,018,400	
ソースネクスト	55,900	230.00	12,857,000	
インフォコム	14,100	2,385.00	33,628,500	
シンプレクス・ホールディングス	18,400	2,279.00	41,933,600	
HEROZ	3,800	1,097.00	4,168,600	
ラクスル	30,900	1,354.00	41,838,600	
メルカリ	49,300	2,455.00	121,031,500	
I P S	3,600	2,613.00	9,406,800	
F I G	11,500	304.00	3,496,000	
システムサポート	4,700	1,751.00	8,229,700	
イーソル	7,100	730.00	5,183,000	
アルテリア・ネットワークス	10,300	1,278.00	13,163,400	
東海ソフト	1,600	908.00	1,452,800	
ウイングアーク 1 s t	11,300	1,811.00	20,464,300	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,000	1,566.00	4,698,000	
サーバーワークス	2,300	2,331.00	5,361,300	
東名	800	2,401.00	1,920,800	
ヴィッツ	1,100	916.00	1,007,600	
トビラシステムズ	2,600	852.00	2,215,200	
S a n s a n	35,700	1,492.00	53,264,400	
L i n k - U	2,000	962.00	1,924,000	
ギフトイ	11,900	2,536.00	30,178,400	
メドレー	11,000	4,125.00	45,375,000	
ベース	3,700	4,790.00	17,723,000	
J M D C	17,900	4,285.00	76,701,500	
フォーカスシステムズ	8,100	1,005.00	8,140,500	
クレスコ	8,500	1,720.00	14,620,000	
フジ・メディア・ホールディングス	104,900	1,193.00	125,145,700	
オービック	36,500	19,850.00	724,525,000	
ジャストシステム	15,700	3,435.00	53,929,500	
T D C ソフト	9,300	1,515.00	14,089,500	
Zホールディングス	1,552,300	386.40	599,808,720	
トレンドマイクロ	63,000	6,570.00	413,910,000	
I Dホールディングス	7,500	1,001.00	7,507,500	

日本オラクル	20,900	9,390.00	196,251,000
アルファシステムズ	3,500	4,240.00	14,840,000
フューチャー	27,200	1,770.00	48,144,000
CAC Holdings	6,800	1,639.00	11,145,200
S Bテクノロジー	4,700	1,975.00	9,282,500
トーセ	2,700	752.00	2,030,400
オービックビジネスコンサルタント	21,500	4,725.00	101,587,500
伊藤忠テクノソリューションズ	58,600	3,055.00	179,023,000
アイティフォー	14,500	870.00	12,615,000
東計電算	1,500	5,950.00	8,925,000
エクスネット	1,500	1,020.00	1,530,000
大塚商会	61,800	4,595.00	283,971,000
サイボウズ	15,100	2,528.00	38,172,800
電通国際情報サービス	13,300	4,780.00	63,574,000
ACCESS	13,000	970.00	12,610,000
デジタルガレージ	19,400	4,580.00	88,852,000
EMシステムズ	18,300	902.00	16,506,600
ウェザーニューズ	3,900	6,640.00	25,896,000
C I J	10,100	1,037.00	10,473,700
ビジネスエンジニアリング	2,100	2,803.00	5,886,300
日本エンタープライズ	11,000	137.00	1,507,000
WOWOW	6,300	1,267.00	7,982,100
スカラ	10,900	724.00	7,891,600
インテリジェント ウェイブ	5,300	714.00	3,784,200
WOW WORLD GROUP	1,800	1,497.00	2,694,600
IMAGICA GROUP	9,300	660.00	6,138,000
ネットワンシステムズ	40,700	3,185.00	129,629,500
システムソフト	39,300	87.00	3,419,100
アルゴグラフィックス	10,000	3,765.00	37,650,000
マーベラス	17,900	721.00	12,905,900
エイベックス	18,600	1,604.00	29,834,400
B I P R O G Y	40,200	2,942.00	118,268,400
兼松エレクトロニクス	7,000	6,180.00	43,260,000
都築電気	5,800	1,348.00	7,818,400
TBSホールディングス	55,900	1,752.00	97,936,800
日本テレビホールディングス	96,700	1,132.00	109,464,400

朝日放送グループホールディングス	10,400	669.00	6,957,600	
テレビ朝日ホールディングス	26,600	1,475.00	39,235,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	97,000	501.00	48,597,000	
テレビ東京ホールディングス	7,900	2,198.00	17,364,200	
日本BS放送	3,600	915.00	3,294,000	
ビジョン	14,400	1,564.00	22,521,600	
スマートバリュー	2,600	432.00	1,123,200	
USEN-NEXT HOLDINGS	9,800	2,551.00	24,999,800	
ワイヤレスゲート	4,700	264.00	1,240,800	
クロップス	1,700	1,116.00	1,897,200	
日本電信電話	1,397,400	3,965.00	5,540,691,000	
KDDI	842,700	4,009.00	3,378,384,300	
ソフトバンク	1,752,000	1,534.00	2,687,568,000	
光通信	12,800	20,270.00	259,456,000	
エムティーアイ	10,200	519.00	5,293,800	
GMOインターネットグループ	40,600	2,581.00	104,788,600	
ファイバーゲート	6,000	880.00	5,280,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,700	287.00	774,900	
KADOKAWA	57,700	2,783.00	160,579,100	
学研ホールディングス	18,300	866.00	15,847,800	
ゼンリン	18,800	854.00	16,055,200	
昭文社ホールディングス	4,600	296.00	1,361,600	
インプレスホールディングス	9,100	200.00	1,820,000	
アイネット	6,700	1,266.00	8,482,200	
松竹	6,200	10,900.00	67,580,000	
東宝	68,300	4,710.00	321,693,000	
東映	3,000	17,080.00	51,240,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	342,200	1,883.00	644,362,600	
ピー・シー・エー	6,600	1,256.00	8,289,600	
ビジネスブレイン太田昭和	4,700	2,084.00	9,794,800	
D T S	23,500	3,095.00	72,732,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,800	6,190.00	339,212,000	
シーイーシー	15,400	1,502.00	23,130,800	
カプコン	108,400	4,505.00	488,342,000	
アイ・エス・ビー	5,700	1,232.00	7,022,400	
ジャステック	6,800	1,235.00	8,398,000	

S C S K	89,100	1,932.00	172,141,200	
N S W	4,300	2,124.00	9,133,200	
アイネス	7,700	1,349.00	10,387,300	
T K C	19,600	3,615.00	70,854,000	
富士ソフト	12,300	7,720.00	94,956,000	
N S D	39,000	2,260.00	88,140,000	
コナミグループ	46,700	6,260.00	292,342,000	
福井コンピュータホールディングス	7,600	2,822.00	21,447,200	
J B C Cホールディングス	8,000	1,925.00	15,400,000	
ミロク情報サービス	10,000	1,811.00	18,110,000	
ソフトバンクグループ	630,600	5,700.00	3,594,420,000	
高千穂交易	3,700	2,407.00	8,905,900	
オルバヘルスケアホールディングス	1,500	1,625.00	2,437,500	
伊藤忠食品	2,600	4,960.00	12,896,000	
エレマテック	10,300	1,776.00	18,292,800	
あらた	8,800	4,010.00	35,288,000	
トーメンデバイス	1,700	6,790.00	11,543,000	
東京エレクトロン デバイス	4,300	8,050.00	34,615,000	
円谷フィールズホールディングス	9,900	4,080.00	40,392,000	
双日	122,100	2,595.00	316,849,500	
アルフレッサ ホールディングス	115,500	1,661.00	191,845,500	
横浜冷凍	31,400	1,000.00	31,400,000	
ラサ商事	4,700	1,403.00	6,594,100	
アルコニックス	15,200	1,347.00	20,474,400	
神戸物産	89,000	3,590.00	319,510,000	
ハイパー	2,000	443.00	886,000	
あい ホールディングス	18,400	2,172.00	39,964,800	
ディーブイエックス	2,800	1,029.00	2,881,200	
ダイワボウホールディングス	47,000	2,048.00	96,256,000	
マクニカホールディングス	28,200	3,610.00	101,802,000	
ラクト・ジャパン	4,400	1,993.00	8,769,200	
グリムス	4,800	2,468.00	11,846,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,800	880.00	14,784,000	
八洲電機	9,300	1,118.00	10,397,400	
メディアスホールディングス	7,400	760.00	5,624,000	
レスターホールディングス	11,000	2,251.00	24,761,000	

ジューテックホールディングス	2,400	1,242.00	2,980,800	
大光	4,000	657.00	2,628,000	
OCHIホールディングス	2,300	1,332.00	3,063,600	
TOKAIホールディングス	56,800	861.00	48,904,800	
黒谷	2,800	602.00	1,685,600	
Cominix	2,000	766.00	1,532,000	
三洋貿易	11,800	1,138.00	13,428,400	
ビューティガレージ	2,100	3,810.00	8,001,000	
ウイン・パートナーズ	8,400	1,058.00	8,887,200	
ミタチ産業	2,600	1,282.00	3,333,200	
シップヘルスケアホールディングス	41,400	2,510.00	103,914,000	
明治電機工業	4,300	1,165.00	5,009,500	
デリカフーズホールディングス	4,000	536.00	2,144,000	
スターティアホールディングス	2,000	1,022.00	2,044,000	
コメダホールディングス	28,200	2,356.00	66,439,200	
ピーバンドットコム	1,500	522.00	783,000	
アセンテック	3,900	526.00	2,051,400	
富士興産	2,300	1,247.00	2,868,100	
協栄産業	900	1,901.00	1,710,900	
フルサト・マルカホールディングス	11,400	2,978.00	33,949,200	
ヤマエグループホールディングス	6,500	1,671.00	10,861,500	
小野建	10,600	1,517.00	16,080,200	
南陽	1,900	2,034.00	3,864,600	
佐鳥電機	6,400	1,618.00	10,355,200	
エコートレーディング	2,000	826.00	1,652,000	
伯東	6,600	4,865.00	32,109,000	
コンドーテック	8,900	1,060.00	9,434,000	
中山福	5,500	345.00	1,897,500	
ナガイレーベン	14,500	1,962.00	28,449,000	
三菱食品	10,600	3,295.00	34,927,000	
松田産業	8,800	2,271.00	19,984,800	
第一興商	22,300	4,230.00	94,329,000	
メディパルホールディングス	119,300	1,774.00	211,638,200	
SPK	5,100	1,519.00	7,746,900	
萩原電気ホールディングス	4,400	2,747.00	12,086,800	
アズワン	16,800	5,670.00	95,256,000	

スズデン	4,000	2,668.00	10,672,000
尾家産業	2,400	1,010.00	2,424,000
シモジマ	7,900	1,008.00	7,963,200
ドウシシャ	12,200	1,784.00	21,764,800
小津産業	2,300	1,708.00	3,928,400
高速	6,000	1,928.00	11,568,000
たけびし	4,400	1,620.00	7,128,000
リックス	2,100	2,508.00	5,266,800
丸文	10,300	1,394.00	14,358,200
ハビネット	9,800	1,843.00	18,061,400
橋本総業ホールディングス	4,600	1,122.00	5,161,200
日本ライフライン	33,700	915.00	30,835,500
タカショー	10,100	684.00	6,908,400
I DOM	34,800	867.00	30,171,600
進和	7,600	2,108.00	16,020,800
エスケイジャパン	2,500	560.00	1,400,000
ダイترون	4,500	2,478.00	11,151,000
シークス	16,400	1,495.00	24,518,000
田中商事	2,900	600.00	1,740,000
オーハシテクニカ	5,800	1,566.00	9,082,800
白銅	4,200	2,595.00	10,899,000
ダイコー通産	1,100	1,115.00	1,226,500
伊藤忠商事	708,900	4,139.00	2,934,137,100
丸紅	908,300	1,773.00	1,610,415,900
高島	1,600	2,983.00	4,772,800
長瀬産業	54,100	2,065.00	111,716,500
蝶理	6,200	2,566.00	15,909,200
豊田通商	100,800	5,610.00	565,488,000
三共生興	16,600	553.00	9,179,800
兼松	44,700	1,631.00	72,905,700
ツカモトコーポレーション	1,500	1,407.00	2,110,500
三井物産	841,800	3,927.00	3,305,748,600
日本紙パルプ商事	6,100	5,260.00	32,086,000
カメイ	12,200	1,452.00	17,714,400
東都水産	500	5,760.00	2,880,000
OUGホールディングス	1,500	2,475.00	3,712,500

スターゼン	8,700	2,156.00	18,757,200
山善	31,000	1,048.00	32,488,000
椿本興業	1,900	4,105.00	7,799,500
住友商事	712,500	2,385.50	1,699,668,750
内田洋行	5,100	4,750.00	24,225,000
三菱商事	719,300	4,756.00	3,420,990,800
第一実業	4,100	5,210.00	21,361,000
キヤノンマーケティングジャパン	26,700	3,060.00	81,702,000
西華産業	4,500	1,693.00	7,618,500
佐藤商事	8,000	1,392.00	11,136,000
菱洋エレクトロ	9,800	2,460.00	24,108,000
東京産業	10,500	775.00	8,137,500
ユアサ商事	10,400	3,655.00	38,012,000
神鋼商事	2,900	5,890.00	17,081,000
トルク	5,600	213.00	1,192,800
阪和興業	20,700	4,035.00	83,524,500
正栄食品工業	7,700	4,180.00	32,186,000
カナデン	9,300	1,102.00	10,248,600
菱電商事	9,300	1,875.00	17,437,500
岩谷産業	26,200	5,670.00	148,554,000
ナイス	2,800	1,384.00	3,875,200
ニチモウ	1,200	3,295.00	3,954,000
極東貿易	6,900	1,457.00	10,053,300
アステナホールディングス	20,000	428.00	8,560,000
三愛オブリ	31,800	1,416.00	45,028,800
稲畑産業	23,200	2,634.00	61,108,800
G S I クレオス	6,700	1,571.00	10,525,700
明和産業	15,300	705.00	10,786,500
クワザワホールディングス	3,300	467.00	1,541,100
ワキタ	21,200	1,162.00	24,634,400
東邦ホールディングス	28,700	2,183.00	62,652,100
サンゲツ	28,900	2,374.00	68,608,600
ミツウロコグループホールディングス	14,800	1,375.00	20,350,000
シナネンホールディングス	3,700	3,580.00	13,246,000
伊藤忠エネクス	28,500	1,105.00	31,492,500
サンリオ	32,600	4,115.00	134,149,000

サンワテクノス	5,900	1,975.00	11,652,500
リョーサン	12,200	3,065.00	37,393,000
新光商事	15,500	1,292.00	20,026,000
トーホー	4,900	1,790.00	8,771,000
三信電気	4,600	2,553.00	11,743,800
東陽テクニカ	12,700	1,315.00	16,700,500
モスフードサービス	16,900	3,055.00	51,629,500
加賀電子	9,300	4,770.00	44,361,000
ソーダニッカ	7,500	860.00	6,450,000
立花エレテック	8,400	1,880.00	15,792,000
フォーバル	4,500	1,024.00	4,608,000
PAL TAC	18,100	4,935.00	89,323,500
三谷産業	20,200	320.00	6,464,000
西本Wismettacホールディングス	2,900	3,625.00	10,512,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,833.00	1,466,400
コア商事ホールディングス	8,100	643.00	5,208,300
KPPグループホールディングス	26,800	760.00	20,368,000
ヤマタネ	5,100	1,677.00	8,552,700
丸紅建材リース	900	1,943.00	1,748,700
日鉄物産	7,900	9,280.00	73,312,000
泉州電業	5,800	3,600.00	20,880,000
トラスコ中山	24,200	2,231.00	53,990,200
オートボックスセブン	40,100	1,443.00	57,864,300
モリト	8,300	987.00	8,192,100
加藤産業	14,000	3,645.00	51,030,000
北恵	2,300	701.00	1,612,300
イエローハット	20,300	1,771.00	35,951,300
JKホールディングス	9,100	1,053.00	9,582,300
日伝	6,800	1,918.00	13,042,400
北沢産業	5,500	264.00	1,452,000
杉本商事	5,100	1,928.00	9,832,800
因幡電機産業	29,800	2,816.00	83,916,800
東テック	3,800	4,265.00	16,207,000
ミスミグループ本社	173,600	3,140.00	545,104,000
アルテック	5,800	316.00	1,832,800
タキヒヨー	2,500	1,014.00	2,535,000

蔵王産業	1,700	1,995.00	3,391,500	
スズケン	36,200	3,545.00	128,329,000	
ジェコス	7,400	881.00	6,519,400	
グローセル	12,400	414.00	5,133,600	
ローソン	28,600	5,390.00	154,154,000	
サンエー	8,800	4,190.00	36,872,000	
カワチ薬品	9,100	2,326.00	21,166,600	
エービーシー・マート	16,800	6,770.00	113,736,000	
ハードオフコーポレーション	4,200	1,305.00	5,481,000	
アスクル	23,900	1,728.00	41,299,200	
ゲオホールディングス	12,200	1,711.00	20,874,200	
アダストリア	14,000	2,255.00	31,570,000	
くら寿司	13,500	3,120.00	42,120,000	
キャンドゥ	4,200	2,311.00	9,706,200	
I Kホールディングス	3,700	371.00	1,372,700	
パルグループホールディングス	11,400	2,745.00	31,293,000	
エディオン	45,700	1,323.00	60,461,100	
サーラコーポレーション	24,400	720.00	17,568,000	
ワッツ	5,200	686.00	3,567,200	
ハローズ	5,300	3,285.00	17,410,500	
あみやき亭	2,800	2,983.00	8,352,400	
大黒天物産	4,100	5,310.00	21,771,000	
ハニーズホールディングス	10,300	1,468.00	15,120,400	
ファーマライズホールディングス	2,500	613.00	1,532,500	
アルペン	9,600	1,957.00	18,787,200	
ハブ	3,600	760.00	2,736,000	
クオールホールディングス	16,000	1,193.00	19,088,000	
ジーンズホールディングス	6,900	3,535.00	24,391,500	
ビックカメラ	76,700	1,186.00	90,966,200	
DCMホールディングス	70,400	1,181.00	83,142,400	
Monotaro	163,200	1,931.00	315,139,200	
東京一番フーズ	2,700	492.00	1,328,400	
きちりホールディングス	2,400	583.00	1,399,200	
アーランドサービスホールディングス	9,500	2,175.00	20,662,500	
J. フロント リテイリング	143,200	1,247.00	178,570,400	
ドトール・日レスホールディングス	20,500	1,870.00	38,335,000	

マツキヨココカラ&カンパニー	69,800	6,600.00	460,680,000
ブロンコビリー	6,200	2,413.00	14,960,600
Z O Z O	76,100	3,040.00	231,344,000
トレジャー・ファクトリー	3,200	2,369.00	7,580,800
物語コーポレーション	6,400	7,140.00	45,696,000
三越伊勢丹ホールディングス	193,800	1,379.00	267,250,200
H a m e e	4,900	837.00	4,101,300
マーケットエンタープライズ	1,200	1,070.00	1,284,000
ウエルシアホールディングス	59,700	2,991.00	178,562,700
クリエイトSDホールディングス	19,100	3,355.00	64,080,500
丸善CHIホールディングス	12,600	350.00	4,410,000
ミサワ	2,100	613.00	1,287,300
ティーライフ	1,500	1,274.00	1,911,000
チムニー	3,100	1,152.00	3,571,200
シュッピン	8,700	893.00	7,769,100
オイシックス・ラ・大地	15,500	2,475.00	38,362,500
ネクステージ	26,300	3,100.00	81,530,000
ジョイフル本田	37,000	1,766.00	65,342,000
鳥貴族ホールディングス	4,300	2,018.00	8,677,400
ホットランド	8,900	1,378.00	12,264,200
すかいらーくホールディングス	157,400	1,585.00	249,479,000
SFPホールディングス	6,300	1,760.00	11,088,000
綿半ホールディングス	9,000	1,412.00	12,708,000
ヨシックスホールディングス	2,100	2,122.00	4,456,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,600	1,131.00	42,525,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,300	951.00	5,040,300
BEENOS	6,600	2,399.00	15,833,400
あさひ	9,700	1,361.00	13,201,700
日本調剤	8,000	1,174.00	9,392,000
コスモス薬品	11,400	12,480.00	142,272,000
トーエル	4,800	791.00	3,796,800
セブン&アイ・ホールディングス	396,500	6,069.00	2,406,358,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	86,500	956.00	82,694,000
ツルハホールディングス	24,200	9,380.00	226,996,000
サンマルクホールディングス	9,400	1,784.00	16,769,600

フェリシモ	2,500	996.00	2,490,000	
トリドールホールディングス	28,700	2,686.00	77,088,200	
TOKYO BASE	12,500	467.00	5,837,500	
ウイルプラスホールディングス	1,800	1,148.00	2,066,400	
JMホールディングス	9,900	1,867.00	18,483,300	
サツドラホールディングス	4,900	833.00	4,081,700	
アレンザホールディングス	8,800	1,015.00	8,932,000	
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,596.00	5,107,200	
バロックジャパンリミテッド	7,700	841.00	6,475,700	
クスリのアオキホールディングス	10,300	7,020.00	72,306,000	
力の源ホールディングス	5,900	1,391.00	8,206,900	
FOOD & LIFE COMPANIES	66,100	3,465.00	229,036,500	
メディカルシステムネットワーク	10,400	405.00	4,212,000	
はるやまホールディングス	4,700	447.00	2,100,900	
ノジマ	37,700	1,314.00	49,537,800	
カッパ・クリエイト	18,100	1,433.00	25,937,300	
ライトオン	7,700	562.00	4,327,400	
良品計画	148,600	1,401.00	208,188,600	
パリティホールディングス	13,400	277.00	3,711,800	
アドヴァングループ	11,100	914.00	10,145,400	
アルビス	3,800	2,401.00	9,123,800	
コナカ	11,100	360.00	3,996,000	
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,645.00	2,303,000	
G-7ホールディングス	14,400	1,440.00	20,736,000	
イオン北海道	17,100	885.00	15,133,500	
コジマ	22,500	558.00	12,555,000	
ヒマラヤ	3,400	946.00	3,216,400	
コーナン商事	15,600	3,320.00	51,792,000	
エコス	4,400	1,866.00	8,210,400	
ワタミ	13,900	898.00	12,482,200	
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	232,300	2,527.00	587,022,100	
西松屋チェーン	25,600	1,568.00	40,140,800	
ゼンショーホールディングス	63,000	3,790.00	238,770,000	
幸楽苑ホールディングス	7,500	1,047.00	7,852,500	
ハークスレイ	3,800	688.00	2,614,400	

サイゼリヤ	19,200	2,996.00	57,523,200	
VTホールディングス	44,100	506.00	22,314,600	
魚力	3,700	2,152.00	7,962,400	
フジ・コーポレーション	6,600	1,244.00	8,210,400	
ユナイテッドアローズ	12,400	1,732.00	21,476,800	
ハイデイ日高	17,200	2,027.00	34,864,400	
YU-WA Creation Holdings	7,000	202.00	1,414,000	
コロワイド	53,000	1,860.00	98,580,000	
ピーシーデポコーポレーション	13,500	300.00	4,050,000	
壱番屋	9,100	4,670.00	42,497,000	
PLANT	2,600	669.00	1,739,400	
スギホールディングス	23,200	5,690.00	132,008,000	
薬王堂ホールディングス	6,500	2,448.00	15,912,000	
スクロール	17,300	792.00	13,701,600	
ヨンドシーホールディングス	10,000	1,790.00	17,900,000	
木曽路	17,500	2,184.00	38,220,000	
SRSホールディングス	19,200	913.00	17,529,600	
千趣会	21,600	395.00	8,532,000	
リテールパートナーズ	17,200	1,313.00	22,583,600	
ケーヨー	18,700	894.00	16,717,800	
上新電機	10,300	2,000.00	20,600,000	
日本瓦斯	61,700	1,870.00	115,379,000	
ロイヤルホールディングス	22,300	2,544.00	56,731,200	
いなげや	11,300	1,364.00	15,413,200	
チヨダ	11,200	790.00	8,848,000	
ライフコーポレーション	10,100	2,784.00	28,118,400	
リンガーハット	14,800	2,235.00	33,078,000	
MrMaxHD	16,400	679.00	11,135,600	
AOKIホールディングス	21,700	801.00	17,381,700	
オークワ	18,500	922.00	17,057,000	
コメリ	17,800	2,646.00	47,098,800	
青山商事	24,800	953.00	23,634,400	
しまむら	13,500	13,100.00	176,850,000	
はせがわ	5,400	343.00	1,852,200	
高島屋	86,800	1,855.00	161,014,000	

松屋	19,600	1,115.00	21,854,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	56,100	1,328.00	74,500,800
近鉄百貨店	3,800	2,424.00	9,211,200
丸井グループ	84,900	2,047.00	173,790,300
アクシアル リテイリング	7,900	3,545.00	28,005,500
イオン	390,000	2,598.00	1,013,220,000
イズミ	17,500	2,989.00	52,307,500
平和堂	19,300	2,194.00	42,344,200
フジ	17,700	1,825.00	32,302,500
ヤオコー	13,000	6,880.00	89,440,000
ゼビオホールディングス	15,800	1,011.00	15,973,800
ケーズホールディングス	91,700	1,205.00	110,498,500
O l y m p i c グループ	4,200	533.00	2,238,600
日産東京販売ホールディングス	13,600	348.00	4,732,800
シルバーライフ	2,700	1,847.00	4,986,900
Genky Drug Stores	5,700	4,170.00	23,769,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,800	946.00	1,702,800
ブックオフグループホールディングス	6,800	1,274.00	8,663,200
ギフトホールディングス	2,500	4,335.00	10,837,500
アインホールディングス	15,900	5,680.00	90,312,000
元気寿司	3,700	3,065.00	11,340,500
ヤマダホールディングス	472,100	489.00	230,856,900
アークランズ	17,000	1,468.00	24,956,000
ニトリホールディングス	46,500	15,945.00	741,442,500
グルメ杵屋	9,500	1,010.00	9,595,000
愛眼	7,500	169.00	1,267,500
ケーユーホールディングス	6,900	1,465.00	10,108,500
吉野家ホールディングス	45,100	2,355.00	106,210,500
松屋フーズホールディングス	5,500	3,985.00	21,917,500
サガミホールディングス	18,600	1,270.00	23,622,000
関西フードマーケット	10,500	1,367.00	14,353,500
王将フードサービス	7,600	6,030.00	45,828,000
ミニストップ	8,400	1,410.00	11,844,000
アークス	21,200	2,225.00	47,170,000
バローホールディングス	22,100	1,978.00	43,713,800
ベルク	5,800	5,540.00	32,132,000

大庄	5,700	1,039.00	5,922,300
ファーストリテイリング	17,300	81,540.00	1,410,642,000
サンドラッグ	43,700	3,680.00	160,816,000
サックスパー ホールディングス	11,200	765.00	8,568,000
ヤマザワ	2,000	1,404.00	2,808,000
やまや	2,200	2,605.00	5,731,000
ベルーナ	27,900	689.00	19,223,100
いよぎんホールディングス	127,400	822.00	104,722,800
しずおかフィナンシャルグループ	242,000	1,111.00	268,862,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	90,200	978.00	88,215,600
島根銀行	3,300	527.00	1,739,100
じもとホールディングス	6,300	442.00	2,784,600
めぶきフィナンシャルグループ	531,400	369.00	196,086,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,700	3,030.00	41,511,000
九州フィナンシャルグループ	188,400	517.00	97,402,800
ゆうちょ銀行	304,900	1,219.00	371,673,100
富山第一銀行	26,700	668.00	17,835,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	590,200	579.00	341,725,800
西日本フィナンシャルホールディングス	67,800	1,149.00	77,902,200
三十三フィナンシャルグループ	9,600	1,739.00	16,694,400
第四北越フィナンシャルグループ	16,800	3,300.00	55,440,000
ひろぎんホールディングス	139,700	698.00	97,510,600
おきなわフィナンシャルグループ	10,200	2,352.00	23,990,400
十六フィナンシャルグループ	13,900	3,255.00	45,244,500
北國フィナンシャルホールディングス	9,000	4,300.00	38,700,000
プロクレアホールディングス	13,100	2,358.00	30,889,800
あいちフィナンシャルグループ	15,000	2,404.00	36,060,000
SBI 新生銀行	31,600	2,430.00	76,788,000
あおぞら銀行	67,300	2,660.00	179,018,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,799,600	983.20	6,685,366,720
りそなホールディングス	1,366,800	753.80	1,030,293,840
三井住友トラスト・ホールディングス	194,600	4,950.00	963,270,000
三井住友フィナンシャルグループ	782,600	5,929.00	4,640,035,400
千葉銀行	298,500	994.00	296,709,000
群馬銀行	207,800	514.00	106,809,200
武蔵野銀行	13,700	2,518.00	34,496,600

千葉興業銀行	22,300	534.00	11,908,200	
筑波銀行	47,000	242.00	11,374,000	
七十七銀行	34,300	2,452.00	84,103,600	
秋田銀行	7,200	1,962.00	14,126,400	
山形銀行	11,900	1,301.00	15,481,900	
岩手銀行	7,300	2,481.00	18,111,300	
東邦銀行	84,700	247.00	20,920,900	
東北銀行	4,600	1,044.00	4,802,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	85,500	3,100.00	265,050,000	
スルガ銀行	94,400	430.00	40,592,000	
八十二銀行	219,700	623.00	136,873,100	
山梨中央銀行	11,000	1,372.00	15,092,000	
大垣共立銀行	20,400	2,018.00	41,167,200	
福井銀行	9,600	1,723.00	16,540,800	
清水銀行	4,300	1,580.00	6,794,000	
富山銀行	1,500	1,834.00	2,751,000	
滋賀銀行	17,800	2,969.00	52,848,200	
南都銀行	16,100	2,707.00	43,582,700	
百五銀行	100,700	422.00	42,495,400	
京都銀行	33,900	6,490.00	220,011,000	
紀陽銀行	38,300	1,649.00	63,156,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	68,100	1,074.00	73,139,400	
山陰合同銀行	67,000	861.00	57,687,000	
鳥取銀行	3,100	1,290.00	3,999,000	
百十四銀行	9,800	2,036.00	19,952,800	
四国銀行	17,000	967.00	16,439,000	
阿波銀行	15,800	2,277.00	35,976,600	
大分銀行	6,400	2,308.00	14,771,200	
宮崎銀行	7,000	2,819.00	19,733,000	
佐賀銀行	6,300	1,870.00	11,781,000	
琉球銀行	24,500	1,121.00	27,464,500	
セブン銀行	383,600	272.00	104,339,200	
みずほフィナンシャルグループ	1,548,800	2,128.50	3,296,620,800	
高知銀行	3,200	770.00	2,464,000	
山口フィナンシャルグループ	118,200	934.00	110,398,800	
長野銀行	2,900	1,583.00	4,590,700	

名古屋銀行	7,100	3,665.00	26,021,500	
北洋銀行	162,300	308.00	49,988,400	
大光銀行	2,800	1,273.00	3,564,400	
愛媛銀行	14,400	972.00	13,996,800	
トマト銀行	3,100	1,099.00	3,406,900	
京葉銀行	49,700	659.00	32,752,300	
栃木銀行	49,000	334.00	16,366,000	
北日本銀行	3,800	2,174.00	8,261,200	
東和銀行	19,700	616.00	12,135,200	
福島銀行	10,000	246.00	2,460,000	
大東銀行	3,700	728.00	2,693,600	
トモニホールディングス	86,500	394.00	34,081,000	
フィデアホールディングス	11,100	1,486.00	16,494,600	
池田泉州ホールディングス	137,100	262.00	35,920,200	
F P G	43,600	1,199.00	52,276,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,900	1,047.00	9,318,300	
マーキュリアホールディングス	5,800	771.00	4,471,800	
S B I ホールディングス	155,100	2,964.00	459,716,400	
ジャフコ グループ	35,800	2,115.00	75,717,000	
大和証券グループ本社	766,000	651.00	498,666,000	
野村ホールディングス	1,972,500	572.00	1,128,270,000	
岡三証券グループ	94,300	450.00	42,435,000	
丸三証券	35,900	441.00	15,831,900	
東洋証券	36,000	342.00	12,312,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	116,900	392.00	45,824,800	
光世証券	2,500	385.00	962,500	
水戸証券	29,200	301.00	8,789,200	
いちよし証券	19,900	645.00	12,835,500	
松井証券	63,400	811.00	51,417,400	
マネックスグループ	119,900	519.00	62,228,100	
極東証券	13,500	635.00	8,572,500	
岩井コスモホールディングス	12,300	1,379.00	16,961,700	
アイザワ証券グループ	15,600	709.00	11,060,400	
マネーパートナーズグループ	10,400	257.00	2,672,800	
スパークス・グループ	12,000	1,666.00	19,992,000	
かんぽ生命保険	130,000	2,418.00	314,340,000	

SOMPOホールディングス	183,800	5,862.00	1,077,435,600	
アニコムホールディングス	36,400	553.00	20,129,200	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	217,900	4,461.00	972,051,900	
第一生命ホールディングス	545,200	2,909.50	1,586,259,400	
東京海上ホールディングス	1,078,400	2,900.00	3,127,360,000	
T&Dホールディングス	287,400	2,137.00	614,173,800	
アドバンスクリエイト	6,200	1,166.00	7,229,200	
全国保証	28,100	5,280.00	148,368,000	
あんしん保証	5,900	263.00	1,551,700	
イントラスト	4,000	902.00	3,608,000	
日本モーゲージサービス	5,600	886.00	4,961,600	
C a s a	4,000	823.00	3,292,000	
アルヒ	14,400	1,134.00	16,329,600	
プレミアグループ	18,200	1,565.00	28,483,000	
ネットプロテクションズホールディングス	36,000	569.00	20,484,000	
クレディセゾン	68,100	1,856.00	126,393,600	
芙蓉総合リース	9,900	9,140.00	90,486,000	
みずほリース	16,000	3,635.00	58,160,000	
東京センチュリー	20,100	4,655.00	93,565,500	
日本証券金融	43,200	1,025.00	44,280,000	
アイフル	178,200	369.00	65,755,800	
リコーリース	10,200	4,010.00	40,902,000	
イオンフィナンシャルサービス	61,700	1,310.00	80,827,000	
アコム	192,100	332.00	63,777,200	
ジャックス	11,500	4,405.00	50,657,500	
オリエントコーポレーション	28,200	1,175.00	33,135,000	
オリックス	716,400	2,418.00	1,732,255,200	
三菱HCキャピタル	418,000	704.00	294,272,000	
九州リースサービス	4,800	905.00	4,344,000	
日本取引所グループ	301,100	1,977.00	595,274,700	
イー・ギャランティ	17,400	2,250.00	39,150,000	
アサックス	4,800	621.00	2,980,800	
NECキャピタルソリューション	5,400	2,626.00	14,180,400	
大東建託	39,300	12,550.00	493,215,000	
いちご	127,200	290.00	36,888,000	

日本駐車場開発	131,900	253.00	33,370,700	
スター・マイカ・ホールディングス	11,400	663.00	7,558,200	
SREホールディングス	5,500	3,355.00	18,452,500	
ADワークスグループ	24,000	165.00	3,960,000	
ヒューリック	250,900	1,086.00	272,477,400	
三栄建築設計	5,900	1,496.00	8,826,400	
野村不動産ホールディングス	67,300	2,918.00	196,381,400	
三重交通グループホールディングス	25,200	496.00	12,499,200	
サムティ	17,600	2,046.00	36,009,600	
ディア・ライフ	18,300	621.00	11,364,300	
地主	8,800	1,904.00	16,755,200	
プレサンスコーポレーション	14,800	1,707.00	25,263,600	
ハウスコム	2,600	1,107.00	2,878,200	
JPMC	6,500	1,000.00	6,500,000	
サンセイランディック	4,200	811.00	3,406,200	
フージャースホールディングス	16,500	832.00	13,728,000	
オープンハウスグループ	39,400	4,855.00	191,287,000	
東急不動産ホールディングス	323,700	643.00	208,139,100	
飯田グループホールディングス	94,300	2,242.00	211,420,600	
イーランド	2,200	1,521.00	3,346,200	
ムゲンエステート	8,700	517.00	4,497,900	
And Doホールディングス	6,400	896.00	5,734,400	
シーアールイー	5,900	1,089.00	6,425,100	
ケイアイスター不動産	5,400	4,255.00	22,977,000	
グッドコムアセット	11,400	841.00	9,587,400	
ジェイ・エス・ビー	2,900	3,775.00	10,947,500	
ロードスターキャピタル	5,300	1,541.00	8,167,300	
テンポイノベーション	3,900	1,223.00	4,769,700	
フェイスネットワーク	2,100	1,695.00	3,559,500	
パーク24	84,000	1,990.00	167,160,000	
パラカ	4,400	2,000.00	8,800,000	
三井不動産	465,900	2,485.50	1,157,994,450	
三菱地所	646,900	1,643.50	1,063,180,150	
平和不動産	17,700	3,590.00	63,543,000	
東京建物	102,800	1,584.00	162,835,200	
京阪神ビルディング	14,400	1,211.00	17,438,400	

住友不動産	194,000	3,136.00	608,384,000	
テーオーシー	21,100	638.00	13,461,800	
東京楽天地	2,100	4,450.00	9,345,000	
スターツコーポレーション	15,800	2,559.00	40,432,200	
フジ住宅	16,700	672.00	11,222,400	
空港施設	15,100	521.00	7,867,100	
明和地所	6,200	920.00	5,704,000	
ゴールドクレスト	10,900	1,689.00	18,410,100	
エスリード	5,600	2,106.00	11,793,600	
日神グループホールディングス	19,700	456.00	8,983,200	
日本エスコン	24,100	832.00	20,051,200	
MIRARTHホールディングス	54,100	371.00	20,071,100	
AVANTIA	6,300	798.00	5,027,400	
イオンモール	56,100	1,806.00	101,316,600	
毎日コムネット	5,200	710.00	3,692,000	
ファースト住建	4,900	1,084.00	5,311,600	
カチタス	29,100	2,642.00	76,882,200	
トーセイ	18,600	1,443.00	26,839,800	
穴吹興産	2,400	2,193.00	5,263,200	
サンフロンティア不動産	18,900	1,231.00	23,265,900	
FJネクストホールディングス	12,400	995.00	12,338,000	
インテリックス	2,300	570.00	1,311,000	
ランドビジネス	3,500	226.00	791,000	
サンネクスタグループ	4,000	980.00	3,920,000	
グランディハウス	10,000	584.00	5,840,000	
日本空港ビルデング	38,000	6,430.00	244,340,000	
明豊ファシリティワークス	5,300	804.00	4,261,200	
日本工営	8,000	3,265.00	26,120,000	
LIFULL	39,100	199.00	7,780,900	
MIXI	25,500	2,638.00	67,269,000	
ジェイエイシーリクルートメント	10,200	2,303.00	23,490,600	
日本M&Aセンターホールディングス	191,900	1,189.00	228,169,100	
メンバーズ	3,400	1,427.00	4,851,800	
中広	1,900	396.00	752,400	
UTグループ	16,500	2,387.00	39,385,500	
アイティメディア	4,400	1,494.00	6,573,600	

E・Jホールディングス	7,300	1,350.00	9,855,000	
オープンアップグループ	33,500	1,906.00	63,851,000	
コシダカホールディングス	33,700	904.00	30,464,800	
アルトナー	2,600	1,090.00	2,834,000	
パソナグループ	13,700	1,910.00	26,167,000	
CDS	2,600	1,806.00	4,695,600	
リンクアンドモチベーション	32,200	599.00	19,287,800	
エス・エム・エス	42,600	3,255.00	138,663,000	
サニーサイドアップグループ	3,300	574.00	1,894,200	
パーソルホールディングス	125,200	2,713.00	339,667,600	
リニカル	5,900	709.00	4,183,100	
クックパッド	31,500	223.00	7,024,500	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,200	636.00	3,307,200	
学情	5,200	1,390.00	7,228,000	
スタジオアリス	5,700	2,091.00	11,918,700	
シミックホールディングス	6,300	1,759.00	11,081,700	
エプロ	2,400	718.00	1,723,200	
NJS	2,500	2,176.00	5,440,000	
総合警備保障	41,500	3,510.00	145,665,000	
カカコム	83,600	1,911.00	159,759,600	
アイロムグループ	4,100	1,982.00	8,126,200	
セントケア・ホールディング	7,300	785.00	5,730,500	
サイネックス	2,000	561.00	1,122,000	
ルネサンス	8,000	898.00	7,184,000	
ディップ	19,600	3,610.00	70,756,000	
デジタルホールディングス	8,900	1,171.00	10,421,900	
新日本科学	11,900	2,591.00	30,832,900	
キャリアデザインセンター	2,200	1,987.00	4,371,400	
ベネフィット・ワン	51,900	2,047.00	106,239,300	
エムスリー	220,900	3,248.00	717,483,200	
ツカダ・グローバルホールディング	6,400	402.00	2,572,800	
アウトソーシング	66,800	1,247.00	83,299,600	
ウェルネット	7,900	663.00	5,237,700	
ワールドホールディングス	5,100	2,693.00	13,734,300	
ディー・エヌ・エー	47,800	1,786.00	85,370,800	
博報堂DYホールディングス	142,700	1,500.00	214,050,000	

ぐるなび	21,000	367.00	7,707,000	
タカミヤ	15,700	435.00	6,829,500	
ジャパンベストレスキューシステム	6,900	783.00	5,402,700	
ファンコミュニケーションズ	22,400	410.00	9,184,000	
ライク	4,200	1,916.00	8,047,200	
ビジネス・ブレイクスルー	4,200	380.00	1,596,000	
エスプール	32,400	673.00	21,805,200	
WDBホールディングス	5,800	2,016.00	11,692,800	
ティア	6,300	429.00	2,702,700	
CDG	1,200	1,170.00	1,404,000	
アドウェイズ	15,800	659.00	10,412,200	
バリューコマース	8,500	1,685.00	14,322,500	
インフォマート	116,500	321.00	37,396,500	
J Pホールディングス	32,700	352.00	11,510,400	
エコナックホールディングス	19,400	90.00	1,746,000	
CLホールディングス	3,300	794.00	2,620,200	
プレステージ・インターナショナル	47,300	667.00	31,549,100	
アミューズ	6,200	1,767.00	10,955,400	
ドリームインキュベータ	3,500	2,809.00	9,831,500	
クイック	8,600	1,820.00	15,652,000	
TAC	5,800	201.00	1,165,800	
電通グループ	109,900	4,385.00	481,911,500	
イオンファンタジー	4,900	2,816.00	13,798,400	
シーティーエス	12,600	782.00	9,853,200	
ネクシィーズグループ	3,400	665.00	2,261,000	
H. U. グループホールディングス	32,800	2,717.00	89,117,600	
アルプス技研	9,800	2,381.00	23,333,800	
日本空調サービス	12,300	720.00	8,856,000	
オリエンタルランド	118,300	21,135.00	2,500,270,500	
ダスキン	24,900	3,120.00	77,688,000	
明光ネットワークジャパン	15,000	622.00	9,330,000	
ファルコホールディングス	5,200	1,958.00	10,181,600	
ラウンドワン	93,900	474.00	44,508,600	
リゾートトラスト	44,200	2,105.00	93,041,000	
ビー・エム・エル	13,900	3,155.00	43,854,500	
りらいあコミュニケーションズ	18,600	1,452.00	27,007,200	

リソー教育	51,300	350.00	17,955,000	
早稲田アカデミー	6,400	1,202.00	7,692,800	
ユー・エス・エス	115,000	2,232.00	256,680,000	
東京個別指導学院	13,600	531.00	7,221,600	
サイバーエージェント	267,600	1,180.00	315,768,000	
楽天グループ	517,700	685.00	354,624,500	
クリーク・アンド・リバー社	6,600	2,231.00	14,724,600	
モーニングスター	18,600	500.00	9,300,000	
デー・オー・ダブリュー	24,500	307.00	7,521,500	
山田コンサルティンググループ	5,800	1,525.00	8,845,000	
セントラルスポーツ	4,300	2,463.00	10,590,900	
フルキャストホールディングス	10,700	2,474.00	26,471,800	
エン・ジャパン	20,300	2,365.00	48,009,500	
リソルホールディングス	900	4,900.00	4,410,000	
テクノプロ・ホールディングス	66,200	3,545.00	234,679,000	
アトラグループ	2,200	182.00	400,400	
インターワークス	3,100	369.00	1,143,900	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,900	1,991.00	11,746,900	
K e e P e r 技研	8,100	3,720.00	30,132,000	
ファーストロジック	1,800	884.00	1,591,200	
三機サービス	1,700	906.00	1,540,200	
G u n o s y	9,200	638.00	5,869,600	
デザインワン・ジャパン	3,900	192.00	748,800	
イー・ガーディアン	4,300	2,335.00	10,040,500	
リブセンス	5,200	260.00	1,352,000	
ジャパンマテリアル	34,300	2,339.00	80,227,700	
ベクトル	17,700	1,373.00	24,302,100	
ウチヤマホールディングス	5,000	272.00	1,360,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	9,500	1,136.00	10,792,000	
キャリアリンク	4,200	2,411.00	10,126,200	
I B J	7,000	834.00	5,838,000	
アサンテ	5,600	1,650.00	9,240,000	
バリューHR	9,900	1,621.00	16,047,900	
M&Aキャピタルパートナーズ	10,400	4,410.00	45,864,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,109.00	4,657,800	
E R I ホールディングス	2,700	1,480.00	3,996,000	

アビスト	1,600	2,946.00	4,713,600
シグマクシス・ホールディングス	17,100	1,101.00	18,827,100
ウィルグループ	9,500	1,129.00	10,725,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,800	156.00	1,840,800
メドピア	8,900	1,334.00	11,872,600
レアジョブ	2,100	1,010.00	2,121,000
リクルートホールディングス	827,600	3,780.00	3,128,328,000
エラン	15,000	1,052.00	15,780,000
土木管理総合試験所	4,800	308.00	1,478,400
日本郵政	1,465,100	1,237.00	1,812,328,700
ベルシステム24ホールディングス	15,100	1,491.00	22,514,100
鎌倉新書	12,900	1,058.00	13,648,200
SMN	2,800	461.00	1,290,800
グローバルキッズCOMPANY	1,800	792.00	1,425,600
エアトリ	7,300	2,462.00	17,972,600
アトラエ	8,900	989.00	8,802,100
ストライク	5,500	3,980.00	21,890,000
ソラスト	31,100	689.00	21,427,900
セラク	4,100	1,457.00	5,973,700
インソース	27,900	1,294.00	36,102,600
ベイカレント・コンサルティング	88,500	5,610.00	496,485,000
Orchestra Holdings	2,500	1,845.00	4,612,500
アイモバイル	6,000	1,218.00	7,308,000
キャリアインデックス	4,000	323.00	1,292,000
MS-Japan	3,400	1,100.00	3,740,000
船場	2,000	747.00	1,494,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	39,900	2,003.00	79,919,700
フルテック	1,600	1,080.00	1,728,000
GameWith	3,500	325.00	1,137,500
MS&Consulting	1,500	574.00	861,000
ウェルビー	8,500	662.00	5,627,000
エル・ティー・エス	1,500	2,500.00	3,750,000
ミダックホールディングス	6,800	2,684.00	18,251,200
日総工産	8,700	652.00	5,672,400
キュービーネットホールディングス	5,900	1,447.00	8,537,300

R P Aホールディングス	15,800	343.00	5,419,400
スプリックス	3,700	860.00	3,182,000
マネジメントソリューションズ	6,200	3,635.00	22,537,000
プロレド・パートナーズ	3,100	539.00	1,670,900
テノ.ホールディングス	1,500	994.00	1,491,000
フロンティア・マネジメント	3,900	1,245.00	4,855,500
ピアラ	2,000	575.00	1,150,000
コプロ・ホールディングス	1,800	1,188.00	2,138,400
ギークス	1,600	1,116.00	1,785,600
カーブスホールディングス	34,600	772.00	26,711,200
フォーラムエンジニアリング	6,700	904.00	6,056,800
F a s t F i t n e s s J a p a n	4,000	1,366.00	5,464,000
ダイレクトマーケティングミックス	13,500	1,612.00	21,762,000
ポピンズ	1,800	1,872.00	3,369,600
L I T A L I C O	8,800	2,500.00	22,000,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,000	479.00	2,395,000
リログループ	62,300	2,132.00	132,823,600
東祥	8,000	1,165.00	9,320,000
ビーウィズ	3,500	1,533.00	5,365,500
T R Eホールディングス	23,700	1,506.00	35,692,200
人・夢・技術グループ	5,100	1,523.00	7,767,300
大栄環境	21,400	1,812.00	38,776,800
エイチ・アイ・エス	29,300	2,042.00	59,830,600
ラックランド	3,500	2,885.00	10,097,500
共立メンテナンス	19,200	5,190.00	99,648,000
イチネンホールディングス	12,000	1,282.00	15,384,000
建設技術研究所	5,800	3,495.00	20,271,000
スペース	8,300	886.00	7,353,800
燦ホールディングス	5,100	2,070.00	10,557,000
スバル興業	600	9,160.00	5,496,000
東京テアトル	3,600	1,132.00	4,075,200
タナベコンサルティンググループ	4,100	870.00	3,567,000
ナガワ	3,000	7,680.00	23,040,000
東京都競馬	9,400	3,700.00	34,780,000
カナモト	20,600	2,234.00	46,020,400
西尾レントオール	10,500	3,120.00	32,760,000

トランス・コスモス	13,900	3,395.00	47,190,500	
乃村工藝社	49,000	893.00	43,757,000	
藤田観光	5,000	3,235.00	16,175,000	
KNT-CTホールディングス	6,700	1,713.00	11,477,100	
日本管財	11,800	2,569.00	30,314,200	
トーカイ	10,000	1,909.00	19,090,000	
セコム	113,900	7,903.00	900,151,700	
セントラル警備保障	6,100	2,474.00	15,091,400	
丹青社	21,900	710.00	15,549,000	
メイテック	44,600	2,407.00	107,352,200	
応用地質	10,800	2,019.00	21,805,200	
船井総研ホールディングス	23,600	2,824.00	66,646,400	
進学会ホールディングス	3,900	301.00	1,173,900	
オオバ	6,500	710.00	4,615,000	
いであ	2,300	1,557.00	3,581,100	
学究社	4,600	2,011.00	9,250,600	
ベネッセホールディングス	41,800	1,993.00	83,307,400	
イオンディライト	12,400	2,987.00	37,038,800	
ナック	5,100	975.00	4,972,500	
ダイセキ	22,900	4,000.00	91,600,000	
ステップ	4,700	1,781.00	8,370,700	
合 計	125,731,300		312,319,414,820	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	

流動資産	
コール・ローン	571,904,223
国債証券	321,265,293,240
地方債証券	19,620,686,162
特殊債券	22,171,453,622
社債券	17,210,371,000
未収入金	214,524,200
未収利息	907,056,653
前払費用	32,816,135
流動資産合計	381,994,105,235
資産合計	381,994,105,235
負債の部	
流動負債	
未払金	500,000,000
未払解約金	169,275,810
未払利息	189
流動負債合計	669,275,999
負債合計	669,275,999
純資産の部	
元本等	
元本	292,213,934,672
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	89,110,894,564
元本等合計	381,324,829,236
純資産合計	381,324,829,236
負債純資産合計	381,994,105,235

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	292,213,934,672 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	99,223,000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 (1万口当たり純資産額)	1.3050円 (13,050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2月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年2月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月22日
期首元本額	282,142,697,582円
期中追加設定元本額	25,686,423,071円
期中一部解約元本額	15,615,185,981円
期末元本額	292,213,934,672円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	780,937,875円
DC日本債券インデックスファンド	1,915,101,268円
DC日本債券インデックスファンドL	44,788,567,251円
DCバランスファンド30	12,266,272,602円
DCバランスファンド50	8,589,980,178円
DCバランスファンド70	2,525,207,062円
日本債券インデックスe	1,052,928,115円
インデックスコレクション(国内債券)	37,650,810,386円
インデックスコレクション(バランス株式30)	63,972,535,530円
インデックスコレクション(バランス株式50)	8,152,459,043円
インデックスコレクション(バランス株式70)	3,490,362,931円
私募日本債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	51,789,353,227円
日本債券パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	4,460,804,554円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	146,980,375円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	742,349,228円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	111,899,842円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	80,932,272円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	121,847,773円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	2,639,097,742円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	948,866,821円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	10,869,072,993円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	129,217,550円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	246,675,446円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	2,788,439,852円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	149,059,716円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	335,009,021円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,929,264,806円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	323,408,632円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	787,446,762円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	53,490,304円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	2,892,784,948円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,339,842,326円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	22,020,647,244円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	425,073,116円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	123,783,577円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	38,179,872円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	532,328,006円
私募日本債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	2,916,426円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△1,968,641,420
地方債証券	△146,380,439

特殊債券	△109,323,657
社債券	△77,793,000
合計	△2,302,138,516

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第434回利付国債(2年)	1,035,000,000	1,036,107,450	
	第435回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,001,040,000	
	第436回利付国債(2年)	900,000,000	900,954,000	
	第437回利付国債(2年)	945,000,000	946,020,600	
	第438回利付国債(2年)	1,208,000,000	1,209,304,640	
	第439回利付国債(2年)	1,065,000,000	1,066,139,550	
	第440回利付国債(2年)	1,400,000,000	1,401,484,000	
	第441回利付国債(2年)	85,000,000	85,088,400	
	第442回利付国債(2年)	1,175,000,000	1,176,186,750	
	第443回利付国債(2年)	860,000,000	860,834,200	
	第444回利付国債(2年)	670,000,000	670,616,400	
	第445回利付国債(2年)	60,000,000	60,040,800	
	第139回利付国債(5年)	2,220,000,000	2,224,506,600	
	第140回利付国債(5年)	2,465,000,000	2,470,694,150	
	第141回利付国債(5年)	2,868,000,000	2,875,227,360	
	第142回利付国債(5年)	2,010,000,000	2,015,306,400	
	第143回利付国債(5年)	2,090,000,000	2,095,622,100	
	第144回利付国債(5年)	2,790,000,000	2,797,756,200	
	第145回利付国債(5年)	2,865,000,000	2,873,107,950	
	第146回利付国債(5年)	2,260,000,000	2,266,056,800	
第147回利付国債(5年)	2,560,000,000	2,558,796,800		
第148回利付国債(5年)	2,310,000,000	2,307,297,300		

第149回利付国債（5年）	3,245,000,000	3,237,471,600	
第150回利付国債（5年）	2,710,000,000	2,700,189,800	
第151回利付国債（5年）	2,120,000,000	2,108,827,600	
第152回利付国債（5年）	875,000,000	873,757,500	
第153回利付国債（5年）	3,485,000,000	3,461,058,050	
第154回利付国債（5年）	2,650,000,000	2,637,969,000	
第155回利付国債（5年）	160,000,000	160,609,600	
第1回利付国債（40年）	230,000,000	275,751,600	
第2回利付国債（40年）	450,000,000	520,744,500	
第3回利付国債（40年）	465,000,000	539,083,800	
第4回利付国債（40年）	665,000,000	772,204,650	
第5回利付国債（40年）	495,000,000	555,216,750	
第6回利付国債（40年）	670,000,000	734,668,400	
第7回利付国債（40年）	1,190,000,000	1,247,036,700	
第8回利付国債（40年）	940,000,000	914,685,800	
第9回利付国債（40年）	940,000,000	670,652,400	
第10回利付国債（40年）	1,270,000,000	1,066,901,600	
第11回利付国債（40年）	1,080,000,000	874,108,800	
第12回利付国債（40年）	810,000,000	585,459,900	
第13回利付国債（40年）	1,220,000,000	879,083,200	
第14回利付国債（40年）	1,425,000,000	1,098,176,250	
第15回利付国債（40年）	1,101,000,000	923,309,610	
第333回利付国債（10年）	2,760,000,000	2,780,396,400	
第334回利付国債（10年）	3,010,000,000	3,036,909,400	
第335回利付国債（10年）	2,430,000,000	2,451,456,900	
第336回利付国債（10年）	1,040,000,000	1,050,348,000	
第337回利付国債（10年）	1,710,000,000	1,720,773,000	
第338回利付国債（10年）	2,930,000,000	2,956,106,300	
第339回利付国債（10年）	2,635,000,000	2,660,717,600	
第340回利付国債（10年）	3,210,000,000	3,243,897,600	
第341回利付国債（10年）	2,090,000,000	2,107,409,700	
第342回利付国債（10年）	2,940,000,000	2,947,203,000	
第343回利付国債（10年）	2,895,000,000	2,900,761,050	
第344回利付国債（10年）	3,240,000,000	3,243,434,400	
第345回利付国債（10年）	3,180,000,000	3,180,000,000	
第346回利付国債（10年）	3,425,000,000	3,420,136,500	

第347回利付国債（10年）	3,205,000,000	3,196,026,000	
第348回利付国債（10年）	3,020,000,000	3,006,289,200	
第349回利付国債（10年）	2,750,000,000	2,734,242,500	
第350回利付国債（10年）	3,450,000,000	3,423,193,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	1,840,000,000	1,821,655,200	
第352回利付国債（10年）	2,420,000,000	2,391,468,200	
第353回利付国債（10年）	2,750,000,000	2,712,297,500	
第354回利付国債（10年）	3,035,000,000	2,987,229,100	
第355回利付国債（10年）	2,460,000,000	2,415,228,000	
第356回利付国債（10年）	2,330,000,000	2,283,003,900	
第357回利付国債（10年）	2,520,000,000	2,464,862,400	
第358回利付国債（10年）	2,730,000,000	2,666,336,400	
第359回利付国債（10年）	3,130,000,000	3,047,994,000	
第360回利付国債（10年）	2,935,000,000	2,847,214,150	
第361回利付国債（10年）	2,930,000,000	2,832,138,000	
第362回利付国債（10年）	2,910,000,000	2,805,531,000	
第363回利付国債（10年）	3,295,000,000	3,169,394,600	
第364回利付国債（10年）	3,075,000,000	2,953,199,250	
第365回利付国債（10年）	2,925,000,000	2,807,122,500	
第366回利付国債（10年）	1,558,000,000	1,510,231,720	
第367回利付国債（10年）	4,185,000,000	4,124,568,600	
第368回利付国債（10年）	2,155,000,000	2,148,922,900	
第369回利付国債（10年）	230,000,000	230,000,000	
第1回利付国債（30年）	50,000,000	57,743,500	
第2回利付国債（30年）	100,000,000	113,531,000	
第3回利付国債（30年）	140,000,000	158,321,800	
第4回利付国債（30年）	190,000,000	224,156,300	
第5回利付国債（30年）	180,000,000	203,646,600	
第6回利付国債（30年）	20,000,000	23,095,800	
第7回利付国債（30年）	790,000,000	909,937,800	
第9回利付国債（30年）	180,000,000	192,376,800	
第10回利付国債（30年）	170,000,000	176,728,600	
第11回利付国債（30年）	430,000,000	471,851,900	
第12回利付国債（30年）	430,000,000	489,034,700	
第13回利付国債（30年）	130,000,000	146,562,000	

第 1 4 回利付国債 (30年)	350,000,000	409,451,000	
第 1 5 回利付国債 (30年)	370,000,000	437,121,700	
第 1 6 回利付国債 (30年)	335,000,000	396,171,000	
第 1 7 回利付国債 (30年)	405,000,000	474,745,050	
第 1 8 回利付国債 (30年)	380,000,000	441,529,600	
第 1 9 回利付国債 (30年)	345,000,000	401,024,550	
第 2 0 回利付国債 (30年)	400,000,000	474,712,000	
第 2 1 回利付国債 (30年)	890,000,000	1,035,639,600	
第 2 2 回利付国債 (30年)	395,000,000	469,461,450	
第 2 3 回利付国債 (30年)	170,000,000	202,118,100	
第 2 4 回利付国債 (30年)	250,000,000	297,487,500	
第 2 5 回利付国債 (30年)	185,000,000	215,648,950	
第 2 6 回利付国債 (30年)	1,240,000,000	1,462,257,600	
第 2 7 回利付国債 (30年)	890,000,000	1,061,850,100	
第 2 8 回利付国債 (30年)	1,050,000,000	1,252,996,500	
第 2 9 回利付国債 (30年)	880,000,000	1,038,329,600	
第 3 0 回利付国債 (30年)	765,000,000	891,584,550	
第 3 1 回利付国債 (30年)	660,000,000	759,646,800	
第 3 2 回利付国債 (30年)	955,000,000	1,113,300,800	
第 3 3 回利付国債 (30年)	1,260,000,000	1,409,360,400	
第 3 4 回利付国債 (30年)	1,360,000,000	1,563,129,600	
第 3 5 回利付国債 (30年)	1,350,000,000	1,509,448,500	
第 3 6 回利付国債 (30年)	1,365,000,000	1,527,353,100	
第 3 7 回利付国債 (30年)	1,405,000,000	1,547,396,750	
第 3 8 回利付国債 (30年)	915,000,000	990,972,450	
第 3 9 回利付国債 (30年)	825,000,000	907,491,750	
第 4 0 回利付国債 (30年)	725,000,000	784,479,000	
第 4 1 回利付国債 (30年)	650,000,000	691,470,000	
第 4 2 回利付国債 (30年)	778,000,000	826,733,920	
第 4 3 回利付国債 (30年)	755,000,000	802,066,700	
第 4 4 回利付国債 (30年)	880,000,000	934,577,600	
第 4 5 回利付国債 (30年)	847,000,000	866,955,320	
第 4 6 回利付国債 (30年)	1,055,000,000	1,079,148,950	
第 4 7 回利付国債 (30年)	1,040,000,000	1,082,733,600	
第 4 8 回利付国債 (30年)	1,010,000,000	1,011,727,100	
第 4 9 回利付国債 (30年)	1,020,000,000	1,020,877,200	

第50回利付国債(30年)	990,000,000	873,467,100	
第51回利付国債(30年)	969,000,000	756,963,420	
第52回利付国債(30年)	1,130,000,000	924,340,000	
第53回利付国債(30年)	1,070,000,000	893,910,100	
第54回利付国債(30年)	935,000,000	816,357,850	
第55回利付国債(30年)	855,000,000	744,354,450	
第56回利付国債(30年)	680,000,000	590,287,600	
第57回利付国債(30年)	930,000,000	804,952,200	
第58回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,157,492,000	
第59回利付国債(30年)	645,000,000	542,335,350	
第60回利付国債(30年)	1,170,000,000	1,030,711,500	
第61回利付国債(30年)	900,000,000	751,977,000	
第62回利付国債(30年)	780,000,000	616,480,800	
第63回利付国債(30年)	1,000,000,000	765,670,000	
第64回利付国債(30年)	1,060,000,000	809,225,200	
第65回利付国債(30年)	760,000,000	579,044,000	
第66回利付国債(30年)	750,000,000	569,235,000	
第67回利付国債(30年)	1,090,000,000	871,989,100	
第68回利付国債(30年)	1,130,000,000	902,564,900	
第69回利付国債(30年)	1,090,000,000	894,236,000	
第70回利付国債(30年)	1,235,000,000	1,010,872,200	
第71回利付国債(30年)	765,000,000	624,714,300	
第72回利付国債(30年)	1,010,000,000	826,876,900	
第73回利付国債(30年)	1,195,000,000	977,055,900	
第74回利付国債(30年)	1,255,000,000	1,112,206,100	
第75回利付国債(30年)	773,000,000	739,250,820	
第76回利付国債(30年)	1,146,000,000	1,122,518,460	
第77回利付国債(30年)	197,000,000	201,682,690	
第67回利付国債(20年)	310,000,000	316,612,300	
第68回利付国債(20年)	230,000,000	235,646,500	
第69回利付国債(20年)	530,000,000	542,444,400	
第70回利付国債(20年)	690,000,000	712,618,200	
第71回利付国債(20年)	400,000,000	412,052,000	
第72回利付国債(20年)	710,000,000	734,175,500	
第73回利付国債(20年)	540,000,000	560,163,600	
第74回利付国債(20年)	310,000,000	322,142,700	

第75回利付国債(20年)	360,000,000	375,890,400	
第76回利付国債(20年)	350,000,000	363,996,500	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	302,200,300	
第78回利付国債(20年)	120,000,000	125,354,400	
第79回利付国債(20年)	100,000,000	104,695,000	
第80回利付国債(20年)	250,000,000	262,317,500	
第81回利付国債(20年)	180,000,000	189,318,600	
第82回利付国債(20年)	485,000,000	511,359,750	
第83回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,165,076,000	
第84回利付国債(20年)	190,000,000	200,704,600	
第85回利付国債(20年)	360,000,000	382,982,400	
第86回利付国債(20年)	240,000,000	256,795,200	
第87回利付国債(20年)	170,000,000	181,374,700	
第88回利付国債(20年)	290,000,000	311,750,000	
第89回利付国債(20年)	320,000,000	342,937,600	
第90回利付国債(20年)	610,000,000	656,335,600	
第91回利付国債(20年)	310,000,000	334,654,300	
第92回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,603,836,000	
第93回利付国債(20年)	400,000,000	430,292,000	
第94回利付国債(20年)	445,000,000	480,502,100	
第95回利付国債(20年)	950,000,000	1,037,286,000	
第96回利付国債(20年)	560,000,000	606,642,400	
第97回利付国債(20年)	570,000,000	621,824,400	
第98回利付国債(20年)	370,000,000	401,960,600	
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,406,112,900	
第100回利付国債(20年)	660,000,000	724,627,200	
第101回利付国債(20年)	360,000,000	398,858,400	
第102回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,189,283,600	
第103回利付国債(20年)	1,305,000,000	1,443,643,200	
第104回利付国債(20年)	260,000,000	284,892,400	
第105回利付国債(20年)	730,000,000	802,051,000	
第106回利付国債(20年)	270,000,000	298,128,600	
第107回利付国債(20年)	500,000,000	550,730,000	
第108回利付国債(20年)	925,000,000	1,008,277,750	
第109回利付国債(20年)	290,000,000	316,720,600	
第110回利付国債(20年)	515,000,000	568,575,450	

第 1 1 1 回利付国債 (20年)	450,000,000	500,724,000	
第 1 1 2 回利付国債 (20年)	950,000,000	1,051,222,500	
第 1 1 3 回利付国債 (20年)	1,525,000,000	1,691,636,750	
第 1 1 4 回利付国債 (20年)	920,000,000	1,023,555,200	
第 1 1 5 回利付国債 (20年)	370,000,000	414,104,000	
第 1 1 6 回利付国債 (20年)	330,000,000	370,464,600	
第 1 1 7 回利付国債 (20年)	240,000,000	267,780,000	
第 1 1 8 回利付国債 (20年)	450,000,000	499,801,500	
第 1 1 9 回利付国債 (20年)	320,000,000	350,748,800	
第 1 2 0 回利付国債 (20年)	1,330,000,000	1,438,940,300	
第 1 2 1 回利付国債 (20年)	970,000,000	1,070,676,300	
第 1 2 2 回利付国債 (20年)	490,000,000	537,275,200	
第 1 2 3 回利付国債 (20年)	900,000,000	1,007,667,000	
第 1 2 4 回利付国債 (20年)	700,000,000	778,477,000	
第 1 2 5 回利付国債 (20年)	680,000,000	768,189,200	
第 1 2 6 回利付国債 (20年)	590,000,000	657,124,300	
第 1 2 7 回利付国債 (20年)	400,000,000	442,412,000	
第 1 2 8 回利付国債 (20年)	960,000,000	1,063,564,800	
第 1 2 9 回利付国債 (20年)	560,000,000	615,955,200	
第 1 3 0 回利付国債 (20年)	890,000,000	980,699,900	
第 1 3 1 回利付国債 (20年)	760,000,000	831,227,200	
第 1 3 2 回利付国債 (20年)	600,000,000	657,240,000	
第 1 3 3 回利付国債 (20年)	680,000,000	750,584,000	
第 1 3 4 回利付国債 (20年)	925,000,000	1,022,689,250	
第 1 3 5 回利付国債 (20年)	580,000,000	635,975,800	
第 1 3 6 回利付国債 (20年)	450,000,000	489,555,000	
第 1 3 7 回利付国債 (20年)	580,000,000	637,170,600	
第 1 3 8 回利付国債 (20年)	460,000,000	496,988,600	
第 1 3 9 回利付国債 (20年)	735,000,000	800,951,550	
第 1 4 0 回利付国債 (20年)	1,285,000,000	1,411,713,850	
第 1 4 1 回利付国債 (20年)	950,000,000	1,042,596,500	
第 1 4 2 回利付国債 (20年)	890,000,000	984,971,900	
第 1 4 3 回利付国債 (20年)	900,000,000	978,966,000	
第 1 4 4 回利付国債 (20年)	910,000,000	981,253,000	
第 1 4 5 回利付国債 (20年)	1,210,000,000	1,327,769,300	
第 1 4 6 回利付国債 (20年)	1,370,000,000	1,502,670,800	

第147回利付国債（20年）	1,690,000,000	1,835,644,200	
第148回利付国債（20年）	1,405,000,000	1,510,389,050	
第149回利付国債（20年）	1,890,000,000	2,029,463,100	
第150回利付国債（20年）	1,910,000,000	2,028,171,700	
第151回利付国債（20年）	1,675,000,000	1,737,980,000	
第152回利付国債（20年）	1,775,000,000	1,838,971,000	
第153回利付国債（20年）	1,425,000,000	1,490,706,750	
第154回利付国債（20年）	1,575,000,000	1,626,534,000	
第155回利付国債（20年）	1,280,000,000	1,288,780,800	
第156回利付国債（20年）	1,375,000,000	1,280,358,750	
第157回利付国債（20年）	1,840,000,000	1,661,078,400	
第158回利付国債（20年）	2,035,000,000	1,906,530,450	
第159回利付国債（20年）	1,700,000,000	1,609,577,000	
第160回利付国債（20年）	650,000,000	622,108,500	
第161回利付国債（20年）	1,530,000,000	1,439,791,200	
第162回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,208,975,100	
第163回利付国債（20年）	1,315,000,000	1,228,052,200	
第164回利付国債（20年）	1,530,000,000	1,402,245,000	
第165回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,095,528,000	
第166回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,153,826,100	
第167回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,169,127,000	
第168回利付国債（20年）	1,720,000,000	1,527,394,400	
第169回利付国債（20年）	1,255,000,000	1,091,875,100	
第170回利付国債（20年）	1,310,000,000	1,134,446,900	
第171回利付国債（20年）	1,150,000,000	991,921,000	
第172回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,162,765,800	
第173回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,148,769,600	
第174回利付国債（20年）	1,375,000,000	1,191,973,750	
第175回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,160,464,800	
第176回利付国債（20年）	1,380,000,000	1,208,714,400	
第177回利付国債（20年）	1,255,000,000	1,075,911,500	
第178回利付国債（20年）	1,380,000,000	1,202,214,600	
第179回利付国債（20年）	1,510,000,000	1,311,435,000	
第180回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,292,377,800	
第181回利付国債（20年）	1,365,000,000	1,271,825,100	
第182回利付国債（20年）	1,605,000,000	1,546,449,600	

	第183回利付国債（20年）	533,000,000	540,120,880	
	国債証券合計	322,728,000,000	321,265,293,240	
地方債証券	第1回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	87,932,000	
	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	102,392,000	
	第7回東京都公募公債（30年）	200,000,000	234,710,000	
	第11回東京都公募公債（20年）	200,000,000	215,804,000	
	第16回東京都公募公債（20年）	150,000,000	162,978,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,106,000	
	第18回東京都公募公債（20年）	200,000,000	220,084,000	
	第20回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,642,000	
	第21回東京都公募公債（20年）	100,000,000	110,585,000	
	第729回東京都公募公債	150,000,000	151,066,500	
	第740回東京都公募公債	100,000,000	100,728,000	
	第786回東京都公募公債	200,000,000	196,730,000	
	第800回東京都公募公債	300,000,000	289,866,000	
	第830回東京都公募公債	100,000,000	95,358,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,210,000	
	令和4年度第1回北海道公募公債	100,000,000	95,641,000	
	第3回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	118,666,000	
	第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,480,000	
	第15回神奈川県公募公債（20年）	300,000,000	327,288,000	
	第16回神奈川県公募公債（20年）	600,000,000	661,932,000	
	第21回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,158,000	
	第243回神奈川県公募公債	100,000,000	96,589,000	
	第2回大阪府公募公債（20年）	300,000,000	331,962,000	
	第386回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,761,000	
	第403回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	302,739,000	
	第417回大阪府公募公債（10年）	108,000,000	107,929,800	
	第423回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	298,137,000	
	平成25年度第2回京都府公募公債（15年）	100,000,000	103,264,000	
	平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,073,000	
	平成27年度第13回京都府公募公債	105,860,000	105,762,608	
	令和元年度第3回京都府公募公債	100,000,000	99,961,000	
	令和2年度第1回京都府公募公債（10年）	100,000,000	96,654,000	
第3回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	108,962,000		

第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,568,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,357,000	
第11回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	201,178,000	
平成26年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	100,740,000	
平成28年度第30回兵庫県公募公債	100,000,000	99,822,000	
令和3年度第9回兵庫県公募公債（5年）	100,000,000	99,183,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	84,051,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,666,000	
平成26年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	100,803,000	
平成27年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	100,724,000	
平成27年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	100,937,000	
令和4年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	95,488,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	110,240,000	
平成25年度第8回愛知県公募公債（30年）	110,000,000	120,770,100	
平成25年度第21回愛知県公募公債（10年）	400,000,000	402,964,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	201,434,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,638,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,436,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	197,798,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	96,481,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	96,296,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	158,668,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	110,294,000	
平成27年度第2回広島県公募公債	162,000,000	163,961,820	
平成29年度第7回広島県公募公債	131,440,000	130,192,634	
令和2年度第7回広島県公募公債	100,000,000	95,846,000	
第5回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	109,794,000	
第7回埼玉県公募公債（15年）	400,000,000	366,608,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	100,000,000	91,065,000	
第9回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	84,526,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	180,744,000	
平成29年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	99,638,000	

平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	118,718,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	228,214,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,746,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,693,000	
平成29年度第8回福岡県公募公債	200,000,000	198,522,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	95,187,000	
令和3年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	99,183,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	200,000,000	179,724,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	220,760,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	110,782,000	
第9回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	108,352,000	
平成26年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	100,783,000	
平成28年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	99,756,000	
平成29年度第5回千葉県公募公債	120,000,000	119,256,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	96,399,000	
平成27年度第3回新潟県公募公債	200,000,000	199,844,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	200,000,000	191,154,000	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,775,000	
第134回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,802,000	
第136回共同発行市場公募地方債	600,000,000	604,830,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,783,000	
第139回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,632,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,786,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,686,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,962,000	
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,692,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,962,000	
第175回共同発行市場公募地方債	150,000,000	149,203,500	
第181回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,875,000	
第194回共同発行市場公募地方債	160,000,000	155,801,600	
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	95,978,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	189,746,000	
第231回共同発行市場公募地方債	200,000,000	191,460,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,018,000	

令和元年度第2回奈良県公募公債（5年）	100,000,000	99,899,000	
第7回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	87,699,000	
第10回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	110,892,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	100,000,000	95,243,000	
第3回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	117,142,000	
第13回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	87,769,000	
第488回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,865,000	
第495回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	99,908,000	
第522回名古屋市公募公債（10年）	200,000,000	195,516,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	105,162,000	
第6回京都市公募公債（20年）	100,000,000	109,306,000	
平成27年度第5回京都市公募公債	200,000,000	200,390,000	
令和4年度第3回京都市公募公債	200,000,000	195,516,000	
令和4年度第4回京都市公募公債	100,000,000	99,761,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	110,183,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,539,000	
平成26年度第3回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	105,410,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	78,860,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	104,828,000	
第5回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	118,910,000	
第7回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	117,718,000	
第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	108,467,000	
第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	108,717,000	
第55回横浜市公募公債（5年）	100,000,000	99,512,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	95,239,000	
第8回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	110,340,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	150,000,000	162,556,500	
第88回川崎市公募公債	100,000,000	100,957,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	400,000,000	423,580,000	
平成29年度第12回福岡市公募公債	130,000,000	128,761,100	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	98,997,000	
平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,948,000	
平成26年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	201,528,000	

	平成27年度第1回三重県公募公債	100,000,000	100,948,000	
	令和3年度第2回三重県公募公債	100,000,000	95,473,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	101,019,000	
地方債証券合計		19,327,300,000	19,620,686,162	
特殊債券	第3回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	201,704,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,926,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	69,055,000	
	第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	200,000,000	199,642,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,483,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	160,327,500	
	第21回道路債券	100,000,000	116,591,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	237,334,000	
	第27回道路債券	100,000,000	102,526,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,803,000	
	第28回道路債券	300,000,000	352,959,000	
	第33回道路債券	100,000,000	119,134,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,970,000	
	第38回道路債券	100,000,000	103,413,000	
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,913,000	
	第42回道路債券	100,000,000	104,331,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,319,000	
	第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,714,000	
	第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,399,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,197,000	
	第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,266,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,139,000		
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	113,562,000		
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,203,000		
第123回政府保証日本高速道路保有・債務	100,000,000	111,791,000		

返済機構債券			
第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,673,000	
第128回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,187,000	
第155回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,119,000	
第176回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,040,000	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,806,000	
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,960,000	
第235回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,868,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,090,000	
第238回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,492,000	
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,120,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,661,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,714,000	
第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,479,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	298,947,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	243,000,000	241,257,690	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,883,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	110,127,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,757,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	221,144,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	110,621,000	
第9回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,580,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	500,000,000	499,860,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,141,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,997,000	
第15回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,186,000	
第15回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	329,160,000	

第17回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,764,000	
第17回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,616,000	
第19回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,864,000	
第22回公営企業債券（20年）	200,000,000	216,718,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	324,285,000	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,185,000	
第30回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	107,865,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	400,000,000	425,212,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,678,000	
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,753,000	
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,810,000	
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,820,000	
第70回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,836,000	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,000,000	
第75回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,000,000	
F76回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,496,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,644,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	424,473,250	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,512,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,398,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,621,000	
第96回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,388,000	
第107回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,806,000	
第110回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	147,937,500	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,917,000	
F190回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,186,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,840,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,038,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,383,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,999,000	
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,937,000	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,817,000	

第159回都市再生債券	100,000,000	64,832,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	71,696,000	
第169回都市再生債券	100,000,000	76,296,000	
第5回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	155,133,000	153,251,236	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,908,000	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	57,478,000	56,782,516	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,986,000	20,030,568	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	68,326,000	67,242,349	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,884,000	12,173,494	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,190,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,436,000	15,080,567	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,485,000	17,315,679	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,738,000	32,063,115	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,099,000	10,117,986	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,102,000	30,152,872	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,272,000	11,436,233	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,007,000	21,974,372	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,933,000	20,856,296	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,219,000	20,042,341	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,146,000	10,232,849	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,412,000	42,803,857	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,208,000	22,531,126	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,482,000	10,585,142	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,904,000	25,724,088	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,516,000	25,508,162	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,938,000	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,527,000	73,775,473	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,152,000	81,502,376	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,489,000	19,230,778	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,146,000	19,866,846	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,125,000	20,892,165	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,382,000	10,479,486	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,728,000	23,517,798	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,988,000	24,829,978	

第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,856,000	27,764,807	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,749,000	26,663,089	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,649,000	36,370,179	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,066,000	38,159,076	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,623,000	33,546,883	
第 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,992,000	31,621,137	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,822,000	32,476,896	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,094,000	38,228,705	
第 8 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,349,000	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,611,000	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,601,000	59,508,022	
第 1 0 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,428,000	132,033,654	
第 1 1 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,887,000	66,862,989	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,641,000	69,289,742	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,158,000	68,620,505	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,629,000	69,321,113	
第 1 1 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,858,000	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,029,000	69,995,621	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,432,000	70,229,342	
第 1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,120,000	70,015,538	
第 1 2 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,298,000	70,853,511	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,291,000	72,633,227	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,443,000	73,553,454	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,416,000	72,707,057	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,637,000	74,698,439	
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,962,000	75,714,292	
第 1 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,980,000	75,985,868	
第 1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,465,000	76,516,848	

第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,203,000	75,809,943	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,135,000	77,238,085	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,495,000	78,339,726	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,979,000	79,108,218	
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	259,401,000	244,695,557	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	259,821,000	246,479,191	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,534,000	82,089,613	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,840,000	165,297,232	
第157回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,639,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,746,000	85,213,827	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,032,000	85,345,834	
第162回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,108,000	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,943,000	86,132,115	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,723,000	86,677,317	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,638,000	87,181,644	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,038,000	87,408,488	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,888,000	176,290,602	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,702,000	89,172,350	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,724,000	90,381,643	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,558,000	182,665,877	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,260,000	92,677,108	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,566,000	93,773,721	
第184回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,015,000	
第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,742,000	189,403,219	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,879,000	99,358,630	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,033,000	

	第24回沖縄振興開発金融公庫債券	500,000,000	500,135,000	
	い第829号商工債	100,000,000	100,041,000	
	い第832号商工債	300,000,000	299,739,000	
	い第835号商工債	200,000,000	199,690,000	
	い第845号商工債	200,000,000	199,654,000	
	い第853号商工債	100,000,000	99,436,000	
	第376回信金中金債(5年)	200,000,000	199,046,000	
	第379回信金中金債(5年)	100,000,000	99,385,000	
	第386回信金中金債(5年)	100,000,000	99,010,000	
	第67回東日本高速道路株式会社債	200,000,000	193,510,000	
	第74回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,483,000	
	第87回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	97,076,000	
	第88回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,205,000	
	第29回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,089,000	
	第54回西日本高速道路株式会社債	200,000,000	199,466,000	
	第66回西日本高速道路株式会社債	600,000,000	599,898,000	
	第70回西日本高速道路株式会社債	200,000,000	199,816,000	
	第66回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,822,000	
	特殊債券合計	21,832,418,000	22,171,453,622	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,464,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,330,000	
	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	98,946,000	
	第1回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	200,000,000	198,154,000	
	第52回成田国際空港株式会社債	100,000,000	100,081,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,017,000	
	第12回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,205,000	
	第5回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,809,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	200,000,000	198,516,000	
	第3回高砂熱学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,368,000	
	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	100,006,000	
	第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,065,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,918,000	

第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,721,000	
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	97,683,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,684,000	
第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,430,000	
第11回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,863,000	
第19回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,974,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,854,000	
第22回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,742,000	
第12回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	98,383,000	
第22回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,679,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	98,876,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,868,000	
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	99,162,000	
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	84,666,000	
第6回株式会社電通無担保社債	100,000,000	97,840,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	200,000,000	188,066,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	200,014,000	
第1回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	99,978,000	
第3回株式会社ツムラ無担保社債	100,000,000	98,526,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,321,000	
第18回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	74,957,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,137,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,055,000	
第9回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	99,391,000	
第11回日本電気硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,779,000	
第9回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	98,647,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,017,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,266,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,131,000	
第14回株式会社L I X I L無担保社債	100,000,000	99,270,000	
第10回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	99,570,000	

第11回株式会社荏原製作所無担保社債	100,000,000	99,757,000	
第53回日本精工株式会社無担保社債	100,000,000	99,244,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,589,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	95,528,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	300,000,000	299,922,000	
第8回TDK株式会社無担保社債	100,000,000	98,903,000	
第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	100,000,000	98,845,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,582,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,872,000	
第7回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	90,947,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,284,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	85,579,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	109,146,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	97,061,000	
第87回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	97,759,000	
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	96,377,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	98,916,000	
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,772,000	
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	100,364,000	
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,788,000	
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,902,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,726,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	97,067,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,102,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,495,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,673,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,808,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,749,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,934,000	

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	99,405,000	
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	98,944,000	
第20回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,977,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,256,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,535,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,733,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,627,000	
第3回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	94,277,000	
第69回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,222,000	
第82回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,201,000	
第38回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,992,000	
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	98,401,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,604,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	99,102,000	
第1回損害保険ジャパン株式会社無担保社債	100,000,000	99,404,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	108,992,000	
第78回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	87,687,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	108,416,000	
第118回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,472,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	86,149,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,846,000	
第3回東急株式会社無担保社債	100,000,000	96,427,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,020,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	86,628,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	78,464,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,337,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,242,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,675,000	
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	83,446,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普	100,000,000	81,801,000	

通社債			
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	83,474,000	
第176回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	72,711,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,191,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	76,784,000	
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	83,572,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,365,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,306,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	108,253,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	109,610,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	107,365,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	83,816,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	83,159,000	
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	195,644,000	
第58回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,320,000	
第4回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,085,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	200,000,000	196,912,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	200,000,000	198,144,000	
第17回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	96,800,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	82,083,000	
第37回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	79,197,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,839,000	
第535回中部電力株式会社社債	200,000,000	189,952,000	
第509回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,067,000	
第510回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,046,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	94,051,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	92,563,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,881,000	
第393回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,821,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	94,807,000	
第426回中国電力株式会社社債	100,000,000	94,373,000	
第445回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,629,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,923,000	

第321回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,944,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	96,593,000	
第521回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,360,000	
第535回東北電力株式会社社債	200,000,000	192,608,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,403,000	
第507回九州電力株式会社社債	200,000,000	188,854,000	
第514回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,882,000	
第323回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,622,000	
第326回北海道電力株式会社社債	200,000,000	202,048,000	
第357回北海道電力株式会社社債	100,000,000	96,715,000	
第56回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	91,934,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,324,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,914,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,244,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,304,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,103,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,897,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,141,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	172,204,000	
第38回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,215,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	93,892,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	82,936,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,089,000	
社債券合計	17,700,000,000	17,210,371,000	
合計		380,267,804,024	

(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。

貸借対照表

	2023年2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,687,041,529
コール・ローン	1,005,836,498
株式	348,505,041,801
投資信託受益証券	134,459,555
投資証券	7,996,414,688
派生商品評価勘定	325,420,310
未収入金	1,754,236
未収配当金	377,794,591
差入委託証拠金	3,753,029,983
流動資産合計	366,786,793,191
資産合計	366,786,793,191
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,764,437
前受金	297,468,570
未払解約金	345,219,232
未払利息	332
流動負債合計	650,452,571
負債合計	650,452,571
純資産の部	
元本等	
元本	77,030,384,517
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	289,105,956,103
元本等合計	366,136,340,620
純資産合計	366,136,340,620
負債純資産合計	366,786,793,191

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最</p>

	<p>終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 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2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	77,030,384,517 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 4.7531 円 (1万口当たり純資産額) (47,531 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2月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及びそのリスク	<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2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月22日
期首元本額	72,835,310,492円
期中追加設定元本額	9,444,129,986円
期中一部解約元本額	5,249,055,961円
期末元本額	77,030,384,517円

期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,488,191,763 円
DC外国株式インデックスファンド	5,057,619,869 円
DC外国株式インデックスファンドL	27,961,808,100 円
DCバランスファンド30	618,343,115 円
DCバランスファンド50	1,254,625,295 円
DCバランスファンド70	863,544,175 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	278,674,375 円
外国株式インデックスe	4,573,543,007 円
インデックスコレクション (外国株式)	16,667,857,580 円
インデックスコレクション (バランス株式30)	3,232,892,395 円
インデックスコレクション (バランス株式50)	1,182,067,984 円
インデックスコレクション (バランス株式70)	1,209,415,623 円
私募外国株式パッシブファンド (適格機関投資家専用)	5,236,863,150 円
外国株式パッシブファンド私募A (適格機関投資家専用)	1,441,384,605 円
外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	362,350,220 円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	18,229,834 円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	217,706,898 円
VAバランスファンド (株25/100) (適格機関投資家専用)	27,505,443 円
VAバランスファンド (株50/100) (適格機関投資家専用)	60,725,018 円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	115,746,727 円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	200,757,940 円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	165,086,480 円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	3,237,551,353 円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	353,663,854 円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	84,384,282 円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	530,094,725 円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	10,628,734 円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	66,684,764 円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	69,158,761 円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	224,544,364 円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	7,626,580 円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	54,562,738 円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	151,785,648 円
私募外国株式インデックスファンドAL (適格機関投資家専用)	4,759,118 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△1,197,304,322
投資信託受益証券	△4,466,179
投資証券	△240,219,340
合計	△1,441,989,841

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引				
	買建	9,184,673,499	—	9,482,142,069	297,468,570
合計		9,184,673,499	—	9,482,142,069	297,468,570

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2023年2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,000,963,730	—	1,021,267,910	20,304,180
	アメリカドル	785,078,420	—	801,043,310	15,964,890
	ユーロ	168,420,120	—	171,857,760	3,437,640
	イギリスポンド	47,465,190	—	48,366,840	901,650
	売建	331,274,507	—	331,391,384	△116,877
	アメリカドル	239,073,224	—	239,057,026	16,198
	ユーロ	60,694,158	—	60,818,263	△124,105
	イギリスポンド	31,507,125	—	31,516,095	△8,970
合計		1,332,238,237	—	1,352,659,294	20,187,303

(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はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	17,739	38.09	675,678.51	
	BAKER HUGHES CO	52,525	30.59	1,606,739.75	
	CHENIERE ENERGY INC	11,711	144.87	1,696,572.57	

CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,333	80.09	427,119.97
CHEVRON CORP	98,959	162.85	16,115,473.15
CONOCOPHILLIPS	67,949	104.12	7,074,849.88
COTERRA ENERGY INC	41,058	23.40	960,757.20
DEVON ENERGY CORPORATION	32,866	53.33	1,752,743.78
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,771	134.68	1,181,278.28
EOG RESOURCES INC	31,440	118.42	3,723,124.80
EQT CORPORATION	17,321	31.25	541,281.25
EXXON MOBIL	221,643	111.28	24,664,433.04
HALLIBURTON CO	47,084	36.50	1,718,566.00
HESS CORP	14,466	135.52	1,960,432.32
HF SINCLAIR CORP	8,443	52.30	441,568.90
KINDER MORGAN INC	105,760	17.73	1,875,124.80
MARATHON OIL CORP	36,460	25.86	942,855.60
MARATHON PETROLEUM CORP	25,887	122.50	3,171,157.50
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	48,140	60.73	2,923,542.20
ONEOK INC	22,489	67.26	1,512,610.14
OVINTIV INC	13,202	43.54	574,815.08
PHILLIPS 66	24,974	99.54	2,485,911.96
PIONEER NATURAL RESOURCES	11,882	208.96	2,482,862.72
SCHLUMBERGER	75,878	53.34	4,047,332.52
TARGA RESOURCES CORP	11,099	73.94	820,660.06
TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,794.75	628,162.50
VALERO ENERGY CORP	21,220	129.61	2,750,324.20
WILLIAMS COS	63,260	31.26	1,977,507.60
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	11,569	279.71	3,235,964.99
ALBEMARLE CORP	6,375	258.01	1,644,813.75
ALCOA CORP	9,533	46.89	447,002.37
AMCOR PLC	82,838	11.42	946,009.96
AVERY DENNISON CORP	4,144	182.50	756,280.00
BALL CORP	17,147	57.54	986,638.38
CELANESE CORP-SERIES A	5,419	118.90	644,319.10
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	82.35	854,710.65
CLEVELAND-CLIFFS INC	27,048	19.82	536,091.36
CORTEVA INC	37,593	61.81	2,323,623.33
CROWN HOLDINGS INC	6,218	86.78	539,598.04

DOW INC	38,891	58.13	2,260,733.83
DUPONT DE NEMOURS INC	26,140	75.08	1,962,591.20
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,266	87.05	545,455.30
ECOLAB INC	13,900	162.41	2,257,499.00
FMC CORP	6,569	128.20	842,145.80
FREEPORT-MCMORAN INC	76,831	41.74	3,206,925.94
INT'L PAPER CO	17,345	38.27	663,793.15
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,928	96.50	1,344,052.00
LINDE PLC	26,593	321.52	8,550,181.36
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,234	97.32	1,287,932.88
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,168	371.68	1,177,482.24
MOSAIC CO/THE	18,682	49.85	931,297.70
NEWMONT CORPORATION	41,716	45.42	1,894,740.72
NUCOR CORP	14,180	168.07	2,383,232.60
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,174	141.01	729,585.74
PPG INDUSTRIES INC	12,407	129.91	1,611,793.37
RPM INTERNATIONAL INC	6,687	88.07	588,924.09
SEALED AIR CORP	7,368	50.26	370,315.68
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,783	227.98	2,914,268.34
STEEL DYNAMICS INC	9,667	124.97	1,208,084.99
VULCAN MATERIALS CO	6,735	185.65	1,250,352.75
WESTLAKE CORP	2,096	122.51	256,780.96
WESTROCK CO	14,176	32.55	461,428.80
3 M COMPANY	29,781	112.99	3,364,955.19
AERCAP HOLDINGS NV	7,161	61.38	439,542.18
ALLEGION PLC	4,638	118.60	550,066.80
AMETEK INC	11,723	146.49	1,717,302.27
BOEING CO	30,150	211.66	6,381,549.00
CARLISLE COS INC	2,870	266.19	763,965.30
CARRIER GLOBAL CORP	45,054	45.22	2,037,341.88
CATERPILLAR	28,191	247.79	6,985,447.89
CUMMINS INC	7,320	257.47	1,884,680.40
DEERE&CO	15,514	433.31	6,722,371.34
DOVER CORP	7,491	155.36	1,163,801.76
EATON CORP	20,840	175.24	3,652,001.60
EMERSON ELECTRIC CO	30,697	85.44	2,622,751.68

FASTENAL CO	29,312	53.44	1,566,433.28
FERGUSON PLC	11,566	148.04	1,712,230.64
FORTIVE CORP	18,487	69.36	1,282,258.32
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,412	64.35	412,612.20
GENERAC HOLDINGS INC	2,918	126.77	369,914.86
GENERAL DYNAMICS CORP	12,120	235.26	2,851,351.20
GENERAL ELECTRIC CO	58,757	83.04	4,879,181.28
GRAINGER (WW) INC	2,333	677.35	1,580,257.55
HEICO CORP	2,252	176.90	398,378.80
HEICO CORP-CLASS A	4,228	139.50	589,806.00
HONEYWELL INTL INC	35,975	201.42	7,246,084.50
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	43.02	784,125.54
HUBBELL INC	2,787	252.06	702,491.22
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	224.54	447,508.22
IDEX CORP	3,918	231.00	905,058.00
ILLINOIS TOOL WORKS	16,624	240.34	3,995,412.16
INGERSOLL-RAND INC	20,847	57.58	1,200,370.26
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	50.85	488,160.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	36,781	64.71	2,380,098.51
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,818	214.02	2,101,248.36
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,584	269.37	426,682.08
LOCKHEED MARTIN CORP	12,759	475.63	6,068,563.17
MASCO CORP	12,110	55.03	666,413.30
NORDSON CORP	2,536	246.22	624,413.92
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,890	470.63	3,713,270.70
OTIS WORLDWIDE CORP	21,403	84.76	1,814,118.28
OWENS CORNING	4,965	99.93	496,152.45
PACCAR INC	28,288	75.69	2,141,118.72
PARKER HANNIFIN CORP	6,957	355.48	2,473,074.36
PENTAIR PLC	7,637	56.83	434,010.71
PLUG POWER INC	29,085	15.58	453,144.30
QUANTA SERVICES INC	7,500	154.90	1,161,750.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	78,822	101.51	8,001,221.22
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,882	297.72	1,751,189.04
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	52.17	396,596.34
SMITH (A. O.) CORP	6,846	67.24	460,325.04

SNAP-ON INC	2,772	252.28	699,320.16
STANLEY BLACK&DECKER	8,223	89.18	733,327.14
TEXTRON	10,911	74.81	816,251.91
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,377	184.18	2,279,595.86
TRANSDIGM GROUP INC	2,661	743.97	1,979,704.17
UNITED RENTALS INC	3,678	461.25	1,696,477.50
WABTEC CORP	9,109	105.49	960,908.41
XYLEM INC	9,354	107.29	1,003,590.66
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,038	96.92	682,122.96
CINTAS CORP	4,794	444.10	2,129,015.40
CLARIVATE PLC	15,370	10.71	164,612.70
COPART INC	23,382	68.40	1,599,328.80
COSTAR GROUP INC	20,926	77.56	1,623,020.56
EQUIFAX INC	6,176	211.72	1,307,582.72
JACOBS SOLUTIONS INC	6,625	121.89	807,521.25
LEIDOS HOLDINGS	6,940	101.24	702,605.60
REPUBLIC SERVICES INC	12,099	131.96	1,596,584.04
ROBERT HALF INTL INC	5,212	82.42	429,573.04
ROLLINS INC	10,710	36.30	388,773.00
TRANSUNION	10,758	69.28	745,314.24
VERISK ANALYTICS INC	8,140	177.13	1,441,838.20
WASTE CONNECTIONS INC	13,987	136.11	1,903,770.57
WASTE MANAGEMENT INC	21,458	154.92	3,324,273.36
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,274	101.17	634,740.58
CSX CORP	112,980	31.21	3,526,105.80
DELTA AIR LINES INC	7,841	38.36	300,780.76
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,512	111.40	948,236.80
FEDEX CORP	12,818	210.30	2,695,625.40
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	54,628	3.48	190,105.44
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,321	188.35	813,860.35
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	60.12	420,840.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,643	228.15	2,884,500.45
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,932	354.84	1,750,070.88
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,754	35.36	238,821.44
U-HAUL HOLDING CO	5,076	57.37	291,210.12
UBER TECHNOLOGIES INC	77,563	34.77	2,696,865.51

UNION PACIFIC CORP	33,370	201.59	6,727,058.30
UNITED PARCEL SERVICE B	39,101	183.21	7,163,694.21
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	5,000	22.16	110,800.00
APTIV PLC	14,148	119.64	1,692,666.72
BORGWARNER INC	11,533	50.43	581,609.19
FORD MOTOR COMPANY	205,843	12.89	2,653,316.27
GENERAL MOTORS CO	71,910	43.17	3,104,354.70
LEAR CORP	2,989	143.74	429,638.86
LUCID GROUP INC	20,820	10.93	227,562.60
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	18,190	20.22	367,801.80
TESLA INC	141,703	208.31	29,518,151.93
DR HORTON INC	17,138	94.38	1,617,484.44
GARMIN LTD	7,784	97.01	755,125.84
HASBRO INC	7,256	59.36	430,716.16
LENNAR CORP-CL A	12,818	99.09	1,270,135.62
LULULEMON ATHLETICA INC	6,033	320.36	1,932,731.88
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	113.93	322,421.90
NEWELL BRANDS INC	17,598	14.90	262,210.20
NIKE B	67,434	124.84	8,418,460.56
NVR INC	164	5,098.14	836,094.96
PULTE GROUP INC	12,386	54.30	672,559.80
VF CORP	16,318	26.99	440,422.82
WHIRLPOOL CORP	3,060	145.00	443,700.00
AIRBNB INC-CLASS A	19,773	131.60	2,602,126.80
ARAMARK	11,643	38.30	445,926.90
BOOKING HOLDINGS INC	2,119	2,462.01	5,216,999.19
CAESARS ENTERTAINMENT INC	12,243	52.80	646,430.40
CARNIVAL CORPORATION	57,539	11.29	649,615.31
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,441	1,617.67	2,331,062.47
DARDEN RESTAURANTS INC	6,041	146.09	882,529.69
DOMINO'S PIZZA INC	1,797	357.36	642,175.92
EXPEDIA GROUP INC	8,454	108.96	921,147.84
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,280	146.34	2,089,735.20
LAS VEGAS SANDS CORP	19,449	56.02	1,089,532.98
MARRIOTT INTL A	14,322	172.52	2,470,831.44
MCDONALD'S CORP	39,216	269.99	10,587,927.84

MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,299	43.56	797,104.44
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,881	73.03	940,699.43
STARBUCKS CORP	61,325	107.10	6,567,907.50
VAIL RESORTS INC	2,160	243.34	525,614.40
WYNN RESORTS LTD	5,210	109.01	567,942.10
YUM BRANDS INC	14,772	132.04	1,950,494.88
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,755	77.57	3,161,365.35
ALPHABET INC-CL A	318,772	94.35	30,076,138.20
ALPHABET INC-CL C	294,920	94.59	27,896,482.80
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,839	395.62	2,310,025.18
COMCAST CORP-CL A	234,890	39.12	9,188,896.80
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	14.15	178,332.45
ELECTRONIC ARTS INC	14,435	112.00	1,616,720.00
FOX CORP - CLASS A	15,560	37.03	576,186.80
FOX CORP- CLASS B	6,975	34.22	238,684.50
INTERPUBLIC GROUP OF COS	22,646	37.36	846,054.56
LIBERTY BROADBAND-C	7,402	92.42	684,092.84
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	70.01	692,048.85
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	33.84	268,283.52
LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	33.86	107,370.06
LIVE NATION ENTERTAINMENT	8,618	76.39	658,329.02
MATCH GROUP INC	14,456	43.63	630,715.28
META PLATFORMS INC-CLASS A	121,381	172.88	20,984,347.28
NETFLIX INC	23,727	347.96	8,256,046.92
NEWS CORP-CLASS A	22,307	19.00	423,833.00
OMNICOM GROUP	10,921	93.72	1,023,516.12
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	30,808	23.69	729,841.52
PINTEREST INC- CLASS A	30,404	24.43	742,769.72
ROBLOX CORP -CLASS A	18,226	40.88	745,078.88
ROKU INC	6,927	71.56	495,696.12
SEA LTD-ADR	19,867	65.01	1,291,553.67
SIRIUS XM HOLDINGS INC	47,096	4.60	216,641.60
SNAP INC - A	62,654	10.36	649,095.44
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,959	112.51	1,007,977.09
THE WALT DISNEY CO	97,194	105.22	10,226,752.68
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	23,690	60.30	1,428,507.00

WARNER BROS DISCOVERY INC	122,994	15.43	1,897,797.42
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	14,227	25.71	365,776.17
ADVANCE AUTO PARTS	3,129	149.99	469,318.71
AMAZON.COM	486,498	97.20	47,287,605.60
AUTOZONE INC	1,035	2,605.62	2,696,816.70
BATH & BODY WORKS INC	13,789	42.89	591,410.21
BEST BUY COMPANY INC	10,832	86.94	941,734.08
BURLINGTON STORES INC	3,549	227.94	808,959.06
CARMAX INC	7,628	72.95	556,462.60
CHEWY INC - CLASS A	3,947	44.61	176,075.67
DOLLAR GENERAL CORP	12,157	227.82	2,769,607.74
DOLLAR TREE INC	11,506	148.04	1,703,348.24
DOORDASH INC - A	12,079	61.81	746,602.99
EBAY	29,667	48.24	1,431,136.08
ETSY INC	6,573	129.68	852,386.64
GENUINE PARTS CO	7,768	180.14	1,399,327.52
HOME DEPOT	54,487	317.95	17,324,141.65
LKQ CORP	13,325	58.84	784,043.00
LOWES COMPANIES	33,164	212.75	7,055,641.00
MERCADOLIBRE INC	2,390	1,100.87	2,631,079.30
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,383	873.01	2,953,392.83
POOL CORP	2,087	376.58	785,922.46
ROSS STORES INC	18,500	115.69	2,140,265.00
TARGET (DAYTON HUDSON)	24,705	173.22	4,279,400.10
TJX COMPANIES INC	60,838	79.83	4,856,697.54
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,763	239.00	1,377,357.00
ULTA BEAUTY INC	2,749	530.00	1,456,970.00
COSTCO WHOLESALE CORP	23,606	507.48	11,979,572.88
KROGER CO	35,291	44.00	1,552,804.00
SYSCO CORP	25,975	78.71	2,044,492.25
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,229	36.76	1,478,818.04
WALMART INC	80,349	146.44	11,766,307.56
ALTRIA GROUP INC	96,590	48.07	4,643,081.30
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,271	81.59	2,469,810.89
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,737	65.65	1,033,134.05
BUNGE LIMITED	7,221	97.57	704,552.97

CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	52.35	509,993.70
COCA-COLA CO	218,827	60.12	13,155,879.24
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,052	56.23	677,683.96
CONAGRA BRANDS INC	26,163	36.41	952,594.83
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,272	226.80	1,876,089.60
DARLING INGREDIENTS INC	8,500	66.55	565,675.00
GENERAL MILLS INC	31,192	76.77	2,394,609.84
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,990	240.69	1,923,113.10
HORMEL FOODS CORP	15,714	45.74	718,758.36
JM SMUCKER CO	5,275	149.94	790,933.50
KELLOGG CO	13,898	68.38	950,345.24
KEURIG DR PEPPER INC	41,374	35.67	1,475,810.58
KRAFT HEINZ CO/THE	39,077	40.00	1,563,080.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	8,000	100.48	803,840.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,652	75.75	1,034,139.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	10,122	52.02	526,546.44
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	73,446	66.85	4,909,865.10
MONSTER BEVERAGE CORP	20,515	104.18	2,137,252.70
PEPSICO INC	73,517	176.28	12,959,576.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	82,717	101.82	8,422,244.94
TYSON FOODS INC	14,778	61.37	906,925.86
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,611	83.78	1,056,549.58
CLOROX COMPANY	6,394	153.63	982,310.22
COLGATE-PALMOLIVE CO	41,461	74.52	3,089,673.72
ESTEE LAUDER CO-CL A	12,383	252.88	3,131,413.04
KIMBERLY-CLARK CORP	17,528	127.23	2,230,087.44
PROCTER & GAMBLE CO	126,953	140.01	17,774,689.53
ABBOTT LABORATORIES	93,365	106.74	9,965,780.10
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,719	316.71	1,177,844.49
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,245	161.49	1,331,485.05
BAXTER INTERNATIONAL	26,594	41.00	1,090,354.00
BECTON DICKINSON & CO	15,316	244.52	3,745,068.32
BOSTON SCIENTIFIC CORP	74,629	46.54	3,473,233.66
CARDINAL HEALTH	14,569	78.78	1,147,745.82
CENTENE CORP	29,946	73.36	2,196,838.56
CIGNA CORP	16,011	301.06	4,820,271.66

CVS HEALTH CORP	70,212	88.58	6,219,378.96
DAVITA INC	3,582	83.93	300,637.26
DENTSPLY SIRONA INC	10,094	35.84	361,768.96
DEXCOM INC	20,381	114.76	2,338,923.56
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,184	78.51	2,526,765.84
ELEVANCE HEALTH INC	12,828	495.04	6,350,373.12
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	19,005	73.17	1,390,595.85
HCA HEALTHCARE INC	12,224	262.84	3,212,956.16
HENRY SCHEIN INC	7,493	83.14	622,968.02
HOLOGIC INC	12,961	82.73	1,072,263.53
HUMANA INC	6,570	510.14	3,351,619.80
IDEXX LABORATORIES INC	4,442	496.46	2,205,275.32
INSULET CORP	3,546	296.00	1,049,616.00
INTUITIVE SURGICAL INC	19,141	238.91	4,572,976.31
LABORATORY CRP OF AMER	4,533	256.26	1,161,626.58
MASIMO CORP	2,735	164.75	450,591.25
MCKESSON CORP	7,488	366.86	2,747,047.68
MEDTRONIC PLC	71,130	84.80	6,031,824.00
MOLINA HEALTHCARE INC	3,016	296.07	892,947.12
NOVOCURE LTD	4,504	84.74	381,668.96
QUEST DIAGNOSTICS	6,246	148.22	925,782.12
RESMED INC	7,602	216.14	1,643,096.28
STERIS PLC	5,122	189.66	971,438.52
STRYKER CORP	18,246	263.16	4,801,617.36
TELEFLEX INC	2,672	247.47	661,239.84
THE COOPER COS INC	2,561	345.12	883,852.32
UNITEDHEALTH GROUP INC	49,740	499.08	24,824,239.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	150.75	587,623.50
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,693	170.49	1,311,579.57
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,564	125.97	1,330,747.08
ABBVIE INC	94,161	151.31	14,247,500.91
AGILENT TECHNOLOGIES	15,996	148.26	2,371,566.96
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,156	222.79	1,371,495.24
AMGEN	28,568	240.53	6,871,461.04
AVANTOR INC	34,993	24.54	858,728.22
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,027	483.23	496,277.21

BIO-TECHNE CORP	8,884	75.96	674,828.64
BIOGEN INC	7,534	278.38	2,097,314.92
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,231	108.31	1,108,119.61
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	113,962	71.11	8,103,837.82
CATALENT INC	8,308	71.37	592,941.96
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,641	249.76	659,616.16
DANAHER CORP	36,857	256.29	9,446,080.53
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	13.13	272,815.14
EXACT SCIENCES CORP	9,063	63.48	575,319.24
GILEAD SCIENCES INC	67,061	84.76	5,684,090.36
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,362	109.93	1,249,024.66
ILLUMINA INC	8,558	211.83	1,812,841.14
INCYTE CORP	10,628	79.00	839,612.00
IQVIA HOLDINGS INC	10,091	219.73	2,217,295.43
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,254	147.73	480,713.42
JOHNSON & JOHNSON	139,834	160.39	22,427,975.26
LILLY (ELI) & CO	42,999	328.40	14,120,871.60
MERCK & CO	134,895	109.52	14,773,700.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,168	1,513.93	1,768,270.24
MODERNA INC	17,875	166.60	2,977,975.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	103.54	487,466.32
PERKINELMER INC	6,426	133.44	857,485.44
PFIZER	298,935	43.21	12,916,981.35
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,745	748.74	4,301,511.30
REPLIGEN CORP	2,737	190.00	520,030.00
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,093	37.84	684,639.12
SEAGEN INC	7,007	162.53	1,138,847.71
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	10.06	571,981.42
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,870	559.70	11,680,939.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,754	293.66	4,038,999.64
VIATRIS INC	63,857	11.69	746,488.33
WATERS CORP	3,306	328.73	1,086,781.38
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,764	313.72	1,180,842.08
ZOETIS INC	24,431	172.03	4,202,864.93
BANK OF AMERICA CORP	385,185	35.35	13,616,289.75
CITIGROUP	103,674	51.42	5,330,917.08

CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,193	43.18	1,087,833.74
FIFTH THIRD BANCORP	37,082	36.95	1,370,179.90
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	673	761.50	512,489.50
FIRST HORIZON CORP	27,858	24.84	691,992.72
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,486	128.89	1,222,650.54
HUNTINGTON BANCSHARES INC	78,770	15.40	1,213,058.00
JPMORGAN CHASE & CO	155,995	142.24	22,188,728.80
KEY CORP	48,984	19.15	938,043.60
M & T BANK CORP	9,606	159.92	1,536,191.52
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,042	158.59	3,495,640.78
REGIONS FINL CORP	49,382	23.86	1,178,254.52
SIGNATURE BANK	3,120	124.31	387,847.20
SVB FINANCIAL GROUP	3,137	292.79	918,482.23
TRUIST FINANCIAL CORP	69,336	48.49	3,362,102.64
US BANCORP	73,483	48.60	3,571,273.80
WEBSTER FINANCIAL CORP	8,680	54.97	477,139.60
WELLS FARGO & CO	202,346	47.49	9,609,411.54
ALLY FINANCIAL INC	18,129	31.05	562,905.45
AMERICAN EXPRESS	34,115	177.30	6,048,589.50
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,866	351.48	2,061,781.68
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	20,242	71.44	1,446,088.48
ARES MANAGEMENT CORP - A	8,035	83.11	667,788.85
BANK NEW YORK CO	40,567	51.50	2,089,200.50
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	69,208	308.24	21,332,673.92
BLACKROCK INC	8,057	716.16	5,770,101.12
BLACKSTONE INC	37,747	93.52	3,530,099.44
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,406	111.17	2,268,535.02
CARLYLE GROUP INC/THE	10,351	35.04	362,699.04
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,992	129.09	773,507.28
CME GROUP INC	18,867	188.64	3,559,070.88
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,291	65.20	410,173.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,285	111.18	1,588,206.30
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,461	32.75	604,597.75
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,972	431.23	850,385.56
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	31.33	462,054.84
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,286	47.31	108,150.66

GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,247	368.50	6,724,019.50
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,992	107.11	3,105,333.12
INVESCO LTD	19,405	18.71	363,067.55
KKR & CO INC	29,454	57.18	1,684,179.72
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,096	249.99	1,023,959.04
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,112	355.17	750,119.04
MOODY'S CORP	8,574	301.45	2,584,632.30
MORGAN STANLEY	68,817	99.51	6,847,979.67
MSCI INC	4,355	544.83	2,372,734.65
NASDAQ INC	17,953	58.56	1,051,327.68
NORTHERN TRUST CORP	10,018	96.71	968,840.78
PRICE T ROWE GROUP INC	11,505	118.73	1,365,988.65
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,135	112.17	1,136,842.95
S&P GLOBAL INC	18,208	360.83	6,569,992.64
SCHWAB (CHARLES) CORP	77,757	80.32	6,245,442.24
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	61.40	386,144.60
STATE STREET CORP	20,021	92.00	1,841,932.00
SYNCHRONY FINANCIAL	27,139	35.77	970,762.03
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,542	72.57	474,752.94
AFLAC	31,141	69.37	2,160,251.17
ALLSTATE CORP	14,193	135.05	1,916,764.65
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	133.80	508,841.40
AMERICAN INT'L GROUP	40,246	60.82	2,447,761.72
AON PLC	11,330	310.27	3,515,359.10
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,793	67.81	1,274,353.33
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,920	188.60	2,059,512.00
ASSURANT INC	2,684	132.41	355,388.44
BROWN & BROWN INC	13,365	57.67	770,759.55
CHUBB LTD	22,362	210.61	4,709,660.82
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,751	127.03	984,609.53
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	241.69	349,000.36
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	386.75	798,638.75
FNF GROUP	12,836	42.95	551,306.20
GLOBE LIFE INC	4,559	122.93	560,437.87
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,673	78.45	1,307,996.85
LINCOLN NATIONAL CORP	8,416	33.82	284,629.12

LOEWS CORP	10,482	61.51	644,747.82
MARKEL CORP	702	1,326.57	931,252.14
MARSH & MCLENNAN COS	26,009	166.44	4,328,937.96
METLIFE INC	35,762	72.54	2,594,175.48
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,725	91.03	1,158,356.75
PROGRESSIVE CORP	31,370	141.52	4,439,482.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,312	101.53	1,960,747.36
TRAVELERS COS INC/THE	12,320	185.75	2,288,440.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,009	240.89	1,447,508.01
WR BERKLEY CORP	11,919	67.14	800,241.66
CBRE GROUP INC-A	16,391	88.76	1,454,865.16
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,300	4.66	299,638.00
WEYERHAEUSER CO	40,664	32.20	1,309,380.80
ZILLOW GROUP INC-C	7,537	45.89	345,872.93
ACCENTURE PLC-CL A	33,739	277.05	9,347,389.95
ADOBE INC	24,968	356.85	8,909,830.80
AFFIRM HOLDINGS INC	8,787	12.98	114,055.26
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	8,949	77.30	691,757.70
ANSYS INC	4,382	270.76	1,186,470.32
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,805	213.95	386,179.75
AUTODESK INC	11,280	219.98	2,481,374.40
AUTOMATIC DATA PROCESS	22,247	228.69	5,087,777.66
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,819	40.89	483,278.91
BILL.COM HOLDINGS INC	4,833	93.30	450,918.90
BLACK KNIGHT INC	8,009	63.94	512,095.46
BLOCK INC	27,502	75.02	2,063,200.04
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	5,961	143.86	857,549.46
CADENCE DESIGN SYSTEMS	14,780	194.44	2,873,823.20
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,963	74.96	521,946.48
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,676	124.96	709,272.96
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,921	64.45	832,758.45
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	26,353	65.48	1,725,594.44
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,526	114.25	1,202,595.50
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	146.13	306,873.00
DATADOG INC - CLASS A	12,954	79.99	1,036,190.46
DOCUSIGN INC	9,538	64.47	614,914.86

DROPBOX INC-CLASS A	16,505	21.22	350,236.10	
DYNATRACE INC	10,480	42.71	447,600.80	
EPAM SYSTEMS INC	3,061	338.21	1,035,260.81	
FAIR ISAAC CORP	1,345	682.19	917,545.55	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,939	69.50	2,289,260.50	
FISERV INC	32,679	115.37	3,770,176.23	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,879	213.58	828,476.82	
FORTINET INC	34,510	60.64	2,092,686.40	
GARTNER INC	4,134	346.02	1,430,446.68	
GEN DIGITAL INC	29,838	21.04	627,791.52	
GLOBAL PAYMENTS INC	15,111	116.31	1,757,560.41	
GODADDY INC - CLASS A	8,747	77.81	680,604.07	
HUBSPOT INC	2,233	404.65	903,583.45	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	48,259	135.02	6,515,930.18	
INTUIT INC	14,332	404.38	5,795,574.16	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,514	169.00	593,866.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	45,913	361.13	16,580,561.69	
MICROSOFT CORP	375,818	258.06	96,983,593.08	
MONGODB INC	3,415	213.13	727,838.95	
OKTA INC	7,338	74.01	543,085.38	
ORACLE CORP	85,380	87.28	7,451,966.40	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	93,706	9.20	862,095.20	
PALO ALTO NETWORKS INC	15,597	169.28	2,640,260.16	
PAYCHEX INC	16,816	114.75	1,929,636.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,625	303.89	797,711.25	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,200	209.31	460,482.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	58,880	74.66	4,395,980.80	
PTC INC	5,381	130.29	701,090.49	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,503	427.68	2,353,523.04	
SALESFORCE INC	53,365	165.17	8,814,297.05	
SERVICENOW INC	10,817	439.01	4,748,771.17	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	11,731	154.08	1,807,512.48	
SPLUNK INC	8,652	105.00	908,460.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	12,962	61.74	800,273.88	
SYNOPSYS INC	7,955	354.45	2,819,649.75	
TOAST INC-CLASS A	13,000	19.48	253,240.00	

TWILIO INC - A	7,960	70.67	562,533.20
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	343.60	696,820.80
UNITY SOFTWARE INC	13,116	39.67	520,311.72
VERISIGN INC	5,329	204.71	1,090,899.59
VISA INC-CLASS A SHARES	86,992	223.56	19,447,931.52
VMWARE INC-CLASS A	11,056	116.15	1,284,154.40
WESTERN UNION CO	20,387	13.83	281,952.21
WIX.COM LTD	3,273	85.40	279,514.20
WORKDAY INC-CLASS A	10,435	185.80	1,938,823.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,443	76.11	947,036.73
ZSCALER INC	4,184	132.35	553,752.40
AMPHENOL CORPORATION	31,392	81.03	2,543,693.76
APPLE INC	852,213	152.55	130,005,093.15
ARISTA NETWORKS INC	12,447	138.23	1,720,548.81
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	123.28	474,751.28
CDW CORP/DE	7,411	213.93	1,585,435.23
CISCO SYSTEMS	220,758	50.77	11,207,883.66
COGNEX CORP	8,069	48.14	388,441.66
CORNING	43,885	35.58	1,561,428.30
DELL TECHNOLOGIES -C	14,009	42.48	595,102.32
F5 INC	2,841	146.88	417,286.08
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	66,144	16.36	1,082,115.84
HP INC	52,913	30.16	1,595,856.08
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	31.56	514,680.48
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,238	185.78	1,716,235.64
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,739	269.42	2,354,461.38
NETAPP INC	10,843	67.41	730,926.63
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,880	70.26	694,168.80
TE CONNECTIVITY LTD	17,335	131.85	2,285,619.75
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,404	438.95	1,055,235.80
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,869	55.20	765,568.80
WESTERN DIGITAL CORP	17,228	41.58	716,340.24
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,892	322.58	932,901.36
AT&T INC	380,487	19.44	7,396,667.28
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	20.94	163,981.14
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,877	21.43	404,534.11

LUMEN TECHNOLOGIES INC	42,975	3.93	168,891.75
T-MOBILE US INC	33,588	149.35	5,016,367.80
VERIZON COMMUNICATIONS	224,058	40.22	9,011,612.76
AES CORP	34,338	26.23	900,685.74
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	53.97	683,422.11
AMEREN CORPORATION	13,199	87.26	1,151,744.74
AMERICAN ELECTRIC POWER	26,863	92.41	2,482,409.83
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,687	149.61	1,449,272.07
ATMOS ENERGY CORP	7,575	117.11	887,108.25
CENTERPOINT ENERGY INC	31,584	29.21	922,568.64
CMS ENERGY CORP	14,716	61.97	911,950.52
CONSOLIDATED EDISON INC	18,713	93.25	1,744,987.25
CONSTELLATION ENERGY	16,951	84.55	1,433,207.05
DOMINION ENERGY INC	44,910	58.70	2,636,217.00
DTE ENERGY COMPANY	9,793	115.30	1,129,132.90
DUKE ENERGY CORP	41,313	99.49	4,110,230.37
EDISON INTL	19,236	67.59	1,300,161.24
ENERGY CORP	10,274	109.43	1,124,283.82
ESSENTIAL UTILITIES INC	12,969	46.15	598,519.35
EVERGY INC	11,724	62.10	728,060.40
EVERSOURCE ENERGY	18,286	80.27	1,467,817.22
EXELON CORP	51,487	43.05	2,216,515.35
FIRSTENERGY CORP	27,438	41.03	1,125,781.14
NEXTERA ENERGY INC	104,882	76.07	7,978,373.74
NISOURCE INC	20,005	27.14	542,935.70
NRG ENERGY INC	12,298	34.22	420,837.56
PG&E CORP	81,796	15.57	1,273,563.72
PPL CORPORATION	38,399	28.81	1,106,275.19
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	26,322	62.23	1,638,018.06
SEMPRA ENERGY	16,421	158.49	2,602,564.29
SOUTHERN CO	58,436	66.63	3,893,590.68
UGI CORP	11,512	39.15	450,694.80
VISTRA CORP	19,603	22.96	450,084.88
WEC ENERGY GROUP INC	16,657	92.87	1,546,935.59
XCEL ENERGY INC	28,707	68.01	1,952,363.07
ADVANCED MICRO DEVICES	86,289	78.50	6,773,686.50

	ANALOG DEVICES	27,563	192.71	5,311,665.73
	APPLIED MATERIALS	46,054	115.44	5,316,473.76
	BROADCOM INC	21,504	595.59	12,807,567.36
	ENPHASE ENERGY INC	7,104	204.99	1,456,248.96
	ENTEGRIS INC	8,008	85.48	684,523.84
	FIRST SOLAR INC	5,000	164.28	821,400.00
	INTEL CORP	219,473	27.61	6,059,649.53
	KLA CORP	7,545	387.92	2,926,856.40
	LAM RESEARCH CORP	7,358	495.66	3,647,066.28
	MARVELL TECHNOLOGY INC	44,782	44.14	1,976,677.48
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	29,374	83.27	2,445,972.98
	MICRON TECHNOLOGY	58,159	59.01	3,431,962.59
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,249	502.09	1,129,200.41
	NVIDIA CORP	132,418	213.88	28,321,561.84
	NXP SEMICONDUCTORS NV	13,633	188.46	2,569,275.18
	ON SEMICONDUCTOR CORP	22,893	81.86	1,874,020.98
	QORVO INC	5,297	103.08	546,014.76
	QUALCOMM	59,951	127.72	7,656,941.72
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,922	115.83	1,033,479.87
	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	2,888	305.04	880,955.52
	TERADYNE INC	7,707	105.25	811,161.75
	TEXAS INSTRUMENTS	48,761	175.32	8,548,778.52
	WOLFSPEED INC	7,000	77.63	543,410.00
	アメリカドル 小計	18,083,227		1,871,840,050.04 (251,425,555,521)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	36,244	14.73	533,874.12
	CAMECO CORP	22,453	38.78	870,727.34
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	60,557	75.05	4,544,802.85
	CENOVUS ENERGY INC	76,232	24.51	1,868,446.32
	ENBRIDGE	108,593	52.38	5,688,101.34
	IMPERIAL OIL	11,645	67.57	786,852.65
	KEYERA CORP	10,963	31.09	340,839.67
	PARKLAND CORP	8,544	30.20	258,028.80
	PEMBINA PIPELINE CORP	28,103	45.76	1,285,993.28
	SUNCOR ENERGY	73,948	44.59	3,297,341.32
	TC ENERGY CORP	52,598	56.84	2,989,670.32

TOURMALINE OIL CORP	16,980	58.96	1,001,140.80
AGNICO EAGLE MINES	24,543	62.31	1,529,274.33
BARRICK GOLD CORP	93,249	22.57	2,104,629.93
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	61.63	450,022.26
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,312	26.57	805,389.84
FRANCO-NEVADA CORP	10,313	178.50	1,840,870.50
IVANHOE MINES LTD-CL A	35,897	12.51	449,071.47
KINROSS GOLD CORP	74,937	5.20	389,672.40
LUNDIN MINING CORP	30,173	8.82	266,125.86
NUTRIEN LTD	29,171	100.70	2,937,519.70
PAN AMERICAN SILVER CORP	9,343	21.83	203,957.69
TECK RESOURCES LTD-CL B	24,191	59.40	1,436,945.40
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,575	104.99	375,339.25
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,120	56.97	1,317,146.40
CAE INC	16,864	31.44	530,204.16
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,269	112.50	480,262.50
WSP GLOBAL INC	6,444	172.39	1,110,881.16
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,920	41.77	456,128.40
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,665	84.36	477,899.40
THOMSON REUTERS CORP	8,783	166.03	1,458,241.49
AIR CANADA	6,737	21.20	142,824.40
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,561	157.22	4,962,020.42
CP RAILWAY LIMITED	49,943	104.58	5,223,038.94
TFI INTERNATIONAL INC	4,630	169.63	785,386.90
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,682	76.28	1,119,942.96
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,366	120.00	163,920.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	40.18	401,800.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,221	90.99	1,384,958.79
QUEBECOR INC -CL B	9,679	32.62	315,728.98
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	24,782	39.25	972,693.50
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,586	174.64	451,619.04
DOLLARAMA INC	14,800	79.92	1,182,816.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	42,716	65.59	2,801,742.44
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	36.85	270,110.50
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	118.89	1,078,094.52
METRO INC	13,489	71.90	969,859.10

WESTON (GEORGE) LTD	3,705	169.61	628,405.05
SAPUTO INC	11,041	36.70	405,204.70
BANK MONTREAL	36,095	135.18	4,879,322.10
BANK NOVA SCOTIA	64,360	72.95	4,695,062.00
CANADIAN IMPERIAL BANK	47,022	62.52	2,939,815.44
NATIONAL BANK OF CANADA	17,467	101.50	1,772,900.50
ROYAL BANK OF CANADA	74,323	138.79	10,315,289.17
TORONTO-DOMINION BANK	97,210	92.87	9,027,892.70
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	18,244	47.28	862,576.32
BROOKFIELD CORP	75,976	48.26	3,666,601.76
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	20,483	19.54	400,237.82
IGM FINANCIAL INC	3,890	42.81	166,530.90
ONEX CORP	3,361	67.46	226,733.06
TMX GROUP LTD	3,245	135.56	439,892.20
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,198	932.70	1,117,374.60
GREAT-WEST LIFECO INC	15,674	36.52	572,414.48
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	89.34	483,776.10
INTACT FINANCIAL CORP	8,967	202.70	1,817,610.90
MANULIFE FINANCIAL CORP	100,823	27.07	2,729,278.61
POWER CORP OF CANADA	29,992	36.10	1,082,711.20
SUN LIFE FINANCIAL INC	32,024	68.91	2,206,773.84
FIRSTSERVICE CORP	2,028	191.28	387,915.84
CGI INC - CL A	11,043	125.80	1,389,209.40
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,063	2,370.61	2,519,958.43
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,402	101.29	445,878.58
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,153	44.20	95,162.60
OPEN TEXT CORP	15,045	47.43	713,584.35
SHOPIFY INC - CLASS A	61,809	58.70	3,628,188.30
BCE INC	3,102	61.78	191,641.56
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,199	66.17	1,204,227.83
TELUS CORP	23,120	27.79	642,504.80
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	37,267	10.55	393,166.85
ALTAGAS INCOME LTD	14,516	24.16	350,706.56
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,264	40.47	253,504.08
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	36.49	218,137.22
EMERA INC	13,595	54.77	744,598.15

	FORTIS INC	25,334	55.74	1,412,117.16	
	HYDRO ONE LTD	14,776	36.13	533,856.88	
	NORTHLAND POWER INC	13,044	33.47	436,582.68	
	カナダドル 小計	2,157,774		130,309,302.16 (13,004,868,355)	
ユーロ	ENI	135,624	14.35	1,946,204.40	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	30,121	11.71	352,716.91	
	NESTE OIL OYJ	21,882	45.31	991,473.42	
	OMV AG	7,462	46.78	349,072.36	
	REPSOL SA	71,632	14.97	1,072,331.04	
	TENARIS SA	27,420	16.26	445,849.20	
	TOTALENERGIES SE	132,784	58.92	7,823,633.28	
	AIR LIQUIDE	28,052	152.08	4,266,148.16	
	AKZO NOBEL	9,224	70.40	649,369.60	
	ARCELORMITTAL	29,386	28.51	837,941.79	
	ARKEMA	2,799	95.50	267,304.50	
	BASF SE	48,561	53.11	2,579,074.71	
	COVESTRO AG	10,438	42.52	443,823.76	
	CRH PLC	39,369	44.46	1,750,345.74	
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	20.40	195,901.20	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,131	64.40	523,636.40	
	KONINKLIJKE DSM NV	9,267	124.75	1,156,058.25	
	OCI NV	5,799	30.22	175,245.78	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	14,165	36.09	511,214.85	
	SOLVAY SA	3,676	112.30	412,814.80	
	STORA ENSO OYJ R	26,361	13.60	358,641.40	
	SYMRISE AG	7,051	97.08	684,511.08	
	UMICORE	12,057	32.59	392,937.63	
	UPM KYMMENE OYJ	27,619	34.48	952,303.12	
	VOESTALPINE AG	5,948	34.54	205,443.92	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	11,859	27.10	321,378.90	
	AIRBUS SE	31,717	122.84	3,896,116.28	
	ALSTOM	16,908	27.34	462,264.72	
	BOUYGUES ORD	11,344	31.42	356,428.48	
	BRENTAG SE	8,989	73.18	657,815.02	
	CNH INDUSTRIAL NV	57,411	15.60	895,898.65	

DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,498	31.29	735,252.42
DASSAULT AVIATION SA	1,210	163.40	197,714.00
EIFFAGE	4,432	103.40	458,268.80
FERROVIAL SA	22,779	26.32	599,543.28
GEA GROUP AG	7,649	41.23	315,368.27
IMCD NV	3,050	152.05	463,752.50
KINGSPAN GROUP PLC	7,694	63.58	489,184.52
KNORR-BREMSE AG	3,221	64.18	206,723.78
KONE OYJ-B	19,254	48.64	936,514.56
LEGRAND SA	13,982	88.30	1,234,610.60
MTU AERO ENGINES AG	2,774	229.50	636,633.00
PRYSMIAN SPA	15,275	37.00	565,175.00
RATIONAL AG	268	613.50	164,418.00
RHEINMETALL AG	2,442	249.00	608,058.00
SAFRAN SA	17,748	134.78	2,392,075.44
SAINT-GOBAIN	25,279	54.32	1,373,155.28
SCHNEIDER ELECTRIC SE	29,076	156.56	4,552,138.56
SIEMENS	40,895	144.66	5,915,870.70
SIEMENS ENERGY AG	24,753	18.91	468,202.99
THALES SA	5,540	129.10	715,214.00
VINCI S. A.	28,939	109.08	3,156,666.12
WARTSILA OYJ	30,397	9.30	282,935.27
BUREAU VERITAS SA	15,662	26.14	409,404.68
RANDSTAD NV	5,866	59.10	346,680.60
TELEPERFORMANCE	3,110	254.50	791,495.00
WOLTERS KLUWER	13,534	103.60	1,402,122.40
ADP	1,532	134.05	205,364.60
AENA SME SA	4,116	140.15	576,857.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38,499	9.53	367,164.96
DEUTSCHE POST AG-REG	52,557	40.90	2,149,581.30
GETLINK	25,582	16.50	422,230.91
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,499	99.67	1,744,125.33
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,480	91.65	318,942.00
CONTINENTAL AG	6,262	69.68	436,336.16
DR ING HC F PORSCHE AG	5,800	114.50	664,100.00
FERRARI NV	6,331	247.00	1,563,757.00

MERCEDES-BENZ GROUP AG	43,299	74.87	3,241,796.13
MICHELIN	35,958	30.11	1,082,875.17
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,889	55.56	493,872.84
RENAULT SA	11,301	41.56	469,669.56
STELLANTIS NV	113,390	16.13	1,829,887.82
VALEO SA	10,032	21.16	212,277.12
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,635	132.70	1,278,564.50
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	167.80	278,044.60
ADIDAS AG	9,192	140.78	1,294,049.76
HERMES INTERNATIONAL	1,665	1,714.00	2,853,810.00
KERING	3,887	591.10	2,297,605.70
LVMH	14,740	813.60	11,992,464.00
MONCLER SPA	9,963	57.70	574,865.10
PUMA SE	6,274	61.46	385,600.04
SEB SA	1,310	99.75	130,672.50
ACCOR	7,911	29.98	237,171.78
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	9,149	154.30	1,411,690.70
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	37.61	200,536.52
SODEXO	4,698	86.08	404,403.84
BOLLORE SE	51,405	5.15	264,735.75
PUBLICIS GROUPE	11,624	75.08	872,729.92
SCOUT24 SE	4,128	52.20	215,481.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	20.79	103,305.51
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	36,953	22.50	831,442.50
VIVENDI SE	41,539	9.81	407,746.82
D'IETEREN GROUP	1,617	184.90	298,983.30
DELIVERY HERO SE	8,935	39.87	356,238.45
INDITEX	57,568	28.59	1,645,869.12
JUST EAT TAKEAWAY	8,459	21.56	182,376.04
PROSUS	44,568	72.78	3,243,659.04
ZALANDO SE	11,285	39.85	449,707.25
CARREFOUR	30,831	18.21	561,432.51
HELLOFRESH SE	7,756	21.78	168,925.68
JERONIMO MARTINS	13,062	20.12	262,807.44
KESKO OYJ-B SHS	14,326	20.40	292,250.40
KONINKLIJKE AHOLD NV	56,245	29.66	1,668,507.92

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	46,853	55.57	2,603,621.21	
DANONE (GROUPE)	32,878	52.26	1,718,204.28	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	26,648	10.55	281,136.40	
HEINEKEN HOLDING NV	5,127	79.85	409,390.95	
HEINEKEN NV	14,200	96.58	1,371,436.00	
JDE PEET'S BV	4,123	27.90	115,031.70	
KERRY GROUP PLC-A	8,173	94.30	770,713.90	
PERNOD-RICARD	10,784	198.05	2,135,771.20	
REMY COINTREAU	1,020	168.50	171,870.00	
BEIERSDORF AG	5,845	113.00	660,485.00	
HENKEL AG & CO KGAA	6,247	64.50	402,931.50	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,083	67.52	680,804.16	
LOREAL	12,929	380.95	4,925,302.55	
AMPLIFON SPA	6,606	27.50	181,665.00	
BIOMERIEUX	2,374	97.06	230,420.44	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	133.30	278,730.30	
DIASORIN ITALIA SPA	1,418	116.55	165,267.90	
ESSILORLUXOTTICA	15,295	175.35	2,681,978.25	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	9,705	37.82	367,043.10	
FRESENIUS SE&CO KGAA	23,936	29.08	696,058.88	
KONINKLIJKE PHILIPS	45,856	16.12	739,565.56	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,577	50.64	738,179.28	
ARGENX SE	2,857	348.60	995,950.20	
BAYER	51,521	58.94	3,036,647.74	
EUROFINS SCIENTIFIC	6,490	69.30	449,757.00	
GRIFOLS SA	14,240	14.20	202,208.00	
IPSEN	1,866	106.30	198,355.80	
MERCK KGAA	6,723	184.45	1,240,057.35	
ORION OYJ-CLASS B	5,393	45.63	246,082.59	
QIAGEN N. V.	13,106	44.52	583,479.12	
RECORDATI SPA	5,195	41.10	213,514.50	
SANOFI	61,013	89.11	5,436,868.43	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,216	429.20	521,907.20	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,435	333.00	477,855.00	
UCB (GROUPE)	6,718	78.60	528,034.80	
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	16.53	325,938.54	

AIB GROUP PLC	55,516	3.94	218,733.04
BANCO BILBAO VIZCAYA	328,517	6.97	2,290,749.04
BANCO SANTANDER SA	904,812	3.51	3,176,342.52
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,138	10.05	524,247.59
BNP PARIBAS	58,159	65.50	3,809,414.50
CAIXABANK	240,435	4.06	977,127.84
COMMERZBANK AG	56,376	10.98	619,008.48
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	11.68	753,583.80
ERSTE GROUP BANK AG	18,119	35.63	645,579.97
FINECOBANK SPA	27,362	16.45	450,104.90
ING GROEP NV-CVA	199,441	13.17	2,626,637.97
INTESA SANPAOLO	904,749	2.55	2,310,728.94
KBC GROEP NV	12,855	70.60	907,563.00
MEDIOBANCA	29,447	10.12	298,150.87
SOCIETE GENERALE	41,916	27.72	1,162,121.10
UNICREDIT SPA	103,949	19.00	1,975,031.00
AMUNDI SA	2,812	63.00	177,156.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	111,998	11.63	1,302,760.73
DEUTSCHE BOERSE	9,759	171.65	1,675,132.35
EURAZEO SA	2,340	65.05	152,217.00
EURONEXT NV	4,500	77.70	349,650.00
EXOR NV	6,325	76.22	482,091.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,582	80.12	447,229.84
SOFINA	752	233.80	175,817.60
WENDEL	1,047	100.80	105,537.60
AEGON	95,201	5.12	487,619.52
AGEAS	8,621	43.24	372,772.04
ALLIANZ SE-REG	21,750	218.35	4,749,112.50
ASSICURAZIONI GENERALI	58,531	18.36	1,074,921.81
AXA SA	100,654	28.29	2,847,501.66
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	181.95	541,483.20
MUENCHENER RUECKVERSICH.	7,273	330.50	2,403,726.50
NN GROUP NV	13,557	39.92	541,195.44
POSTE ITALIANE SPA	25,777	10.19	262,667.63
SAMPO OYJ-A SHS	25,899	45.70	1,183,584.30
AROUNDTOWN SA	52,418	2.51	131,883.68

LEG IMMOBILIEN SE	3,774	70.66	266,670.84
VONOVIA SE	36,313	25.46	924,528.98
ADYEN NV	1,178	1,471.00	1,732,838.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	22,519	55.84	1,257,460.96
BECHTLE AG	4,296	40.73	174,976.08
CAPGEMINI SA	8,386	187.20	1,569,859.20
DASSAULT SYSTEMES SA	35,217	37.40	1,317,291.88
EDENRED	12,673	52.32	663,051.36
NEMETSCHEK SE	3,320	51.36	170,515.20
NEXI SPA	36,598	7.69	281,658.20
SAP SE	55,816	109.28	6,099,572.48
WORLDLINE SA	13,712	41.16	564,385.92
NOKIA OYJ	272,288	4.43	1,206,916.56
CELLNEX TELECOM SA	27,196	37.83	1,028,824.68
DEUTSCHE TELEKOM	174,076	20.80	3,621,651.18
ELISA A	7,825	53.74	420,515.50
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	10.37	154,274.49
KPN (KON.)	173,861	3.26	567,308.44
ORANGE	104,881	10.82	1,135,441.70
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.30	149,373.44
TELEFONICA	280,413	3.78	1,062,484.85
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.85	116,586.90
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	20.70	121,902.30
ACCIONA SA	1,278	186.00	237,708.00
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	3,416	37.88	129,398.08
E.ON SE	123,229	10.21	1,258,784.23
EDP RENOVAVEIS SA	15,418	20.04	308,976.72
ELIA GROUP SA/NV	1,604	129.80	208,199.20
ENAGAS	11,944	16.83	201,017.52
ENDESA	17,138	18.88	323,565.44
ENEL	429,494	5.35	2,297,792.90
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,324	4.71	657,330.63
ENGIE	100,082	13.59	1,360,514.70
FORTUM OYJ	26,655	14.35	382,499.25
IBERDROLA SA	331,203	10.91	3,613,424.73
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,726	26.85	261,143.10

	RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	16.16	376,463.36
	RWE STAMM	33,396	39.55	1,320,811.80
	SNAM SPA	115,930	4.77	553,217.96
	TERNA SPA	80,424	7.38	593,850.81
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,814	28.70	1,056,561.80
	VERBUND AG	3,916	82.15	321,699.40
	ASM INTERNATIONAL NV	2,534	318.60	807,332.40
	ASML HOLDING NV	21,642	603.60	13,063,111.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	67,797	34.92	2,367,471.24
	STMICROELECTRONICS	37,319	45.38	1,693,722.81
	ユーロ 小計	9,725,808		253,289,729.42 (36,334,411,685)
イギリスポンド	BP PLC	1,006,486	5.58	5,618,204.85
	SHELL PLC-NEW	387,191	25.24	9,772,700.84
	ANGLO AMERICAN PLC	68,460	33.37	2,284,852.50
	ANTOFAGASTA PLC	22,358	17.61	393,724.38
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,013	70.52	565,076.76
	GLENCORE PLC	525,108	5.19	2,728,986.27
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,824	22.26	218,682.24
	MONDI PLC	25,878	14.78	382,476.84
	RIO TINTO PLC REG	58,591	62.77	3,677,757.07
	ASHTREAD GROUP PLC	22,405	56.26	1,260,505.30
	BAE SYSTEMS PLC	170,458	8.89	1,516,053.45
	BUNZL PLC	19,312	30.64	591,719.68
	DCC PLC	4,499	46.30	208,303.70
	MELROSE INDUSTRIES PLC	215,001	1.46	315,298.96
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	458,658	1.11	512,779.64
	SMITHS GROUP PLC	20,046	17.68	354,513.51
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	120.55	442,659.60
	EXPERIAN PLC	48,173	29.69	1,430,256.37
	INTERTEK GROUP PLC	7,435	44.91	333,905.85
	RELX PLC	101,318	24.85	2,517,752.30
	RENTOKIL INITIAL PLC	130,328	5.12	667,800.67
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	4.66	237,914.32
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,048	42.35	256,132.80
	BURBERRY GROUP PLC	22,327	25.46	568,445.42

PERSIMMON PLC	14,327	14.67	210,177.09
TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.22	203,159.72
COMPASS GROUP PLC	95,637	19.09	1,825,710.33
ENTAIN PLC	33,614	13.93	468,243.02
INTERCONTINENTAL HOTELS	10,141	55.94	567,287.54
PEARSON	34,302	9.19	315,441.19
WHITBREAD PLC	10,170	30.85	313,744.50
AUTO TRADER GROUP PLC	43,890	5.97	262,023.30
INFORMA PLC	79,688	6.69	533,750.22
WPP PLC	56,693	10.10	572,599.30
JD SPORTS FASHION PLC	114,330	1.79	205,222.35
KINGFISHER PLC	96,593	2.80	270,653.58
NEXT PLC	7,235	68.66	496,755.10
OCADO GROUP PLC	36,500	6.29	229,658.00
SAINSBURY (J) PLC	82,018	2.63	216,363.48
TESCO PLC	393,967	2.51	989,645.10
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,881	19.45	406,239.85
BRITISH AMERICAN TOBACCO	114,644	31.66	3,629,629.04
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	20.83	189,865.45
DIAGEO	121,861	35.69	4,349,219.09
IMPERIAL BRANDS PLC	45,617	20.36	928,762.12
HALEON PLC	254,427	3.33	849,658.96
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,576	56.98	2,141,080.48
UNILEVER PLC	136,012	42.10	5,726,785.26
SMITH & NEPHEW PLC	42,096	11.61	488,945.04
ASTRAZENECA	82,592	115.40	9,531,116.80
GSK PLC	212,792	14.75	3,138,682.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	17.68	151,843.41
BARCLAYS	873,251	1.75	1,535,873.85
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,066,083	6.20	6,617,177.18
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,573,042	0.51	1,841,545.84
NATWEST GROUP PLC	280,916	2.83	796,115.94
STANDARD CHARTERED PLC	135,187	7.68	1,039,047.28
3I GROUP PLC	55,147	16.50	909,925.50
ABRDN PLC	100,722	2.15	216,552.30
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	8.70	158,776.69

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	17,699	75.88	1,343,000.12	
	M&G PLC	118,170	2.02	239,530.59	
	SCHRODERS PLC	32,500	5.06	164,710.00	
	ST JAMES' S PLACE PLC	26,728	12.53	335,035.48	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,872	22.45	221,626.40	
	AVIVA PLC	152,469	4.47	681,688.89	
	LEGAL & GENERAL GROUP	313,717	2.59	814,095.61	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,255	6.34	274,409.72	
	PRUDENTIAL	145,125	12.97	1,882,271.25	
	SAGE GROUP PLC	56,360	7.63	430,252.24	
	HALMA PLC	20,296	22.23	451,180.08	
	BT GROUP PLC	373,976	1.42	532,354.83	
	VODAFONE GROUP PLC	1,374,547	1.02	1,412,484.49	
	NATIONAL GRID PLC	190,012	10.70	2,034,078.46	
	SEVERN TRENT PLC	14,219	28.23	401,402.37	
	SSE PLC	56,670	17.57	995,691.90	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	10.55	366,427.38	
	イギリスポンド 小計	14,836,844		101,764,019.03 (16,449,136,036)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	13,161	15.96	210,049.56	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	310	713.50	221,185.00	
	GIVAUDAN-REG	479	2,845.00	1,362,755.00	
	HOLCIM LTD	30,195	57.46	1,735,004.70	
	SIG GROUP AG	16,000	21.80	348,800.00	
	SIKA AG-BR	7,610	277.00	2,107,970.00	
	ABB LTD	84,750	31.45	2,665,387.50	
	GEBERIT AG-REG	1,930	514.20	992,406.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,332	190.40	253,612.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	198.55	401,269.55	
	VAT GROUP AG	1,440	284.20	409,248.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,959	34.96	348,166.64	
	SGS SA	347	2,199.00	763,053.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,730	244.40	667,212.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	27,253	143.65	3,914,893.45	
	SWATCH GROUP AG (BEARER)	1,572	329.10	517,345.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	60.50	181,742.00	

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	189	1,947.00	367,983.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	104,300.00	625,800.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	10,360.00	569,800.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	146,347	109.54	16,030,850.38	
	ALCON INC	25,942	68.20	1,769,244.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,788	238.30	664,380.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,767	130.10	750,286.70	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,950	88.55	172,672.50	
	LONZA GROUP AG-REG	3,866	563.80	2,179,650.80	
	NOVARTIS	115,320	79.86	9,209,455.20	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,394	297.60	414,854.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	37,434	280.05	10,483,391.70	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,564	82.65	129,264.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	184,034	2.77	509,958.21	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,775	61.52	724,398.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,152	915.40	1,054,540.80	
	UBS GROUP AG	179,863	20.22	3,636,829.86	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	153.10	357,335.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,612	555.80	895,949.60	
	SWISS RE LTD	16,438	97.48	1,602,376.24	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,071	439.70	3,548,818.70	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	82.55	298,996.10	
	TEMENOS AG - REG	3,520	68.14	239,852.80	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,298	53.32	442,449.36	
	SWISSCOM	1,331	575.20	765,591.20	
	BKW AG	807	134.50	108,541.50	
	スイスフラン 小計	969,572		74,653,372.25 (10,859,079,527)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	13,081	448.00	5,860,288.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,106	424.90	2,169,539.40	
	SCA SV CELLULOSA B	34,632	147.95	5,123,804.40	
	ALFA LAVAL AB	14,260	348.50	4,969,610.00	
	ASSA ABLOY AB-B	50,678	252.10	12,775,923.80	
	ATLAS COPCO A	142,288	125.62	17,874,218.56	
	ATLAS COPCO B	85,638	110.28	9,444,158.64	
	EPIROC AB-A	37,140	204.60	7,598,844.00	

EPIROC AB-B	22,442	175.55	3,939,693.10
HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	92.68	2,024,223.88
INDUTRADE AB	14,669	229.40	3,365,068.60
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	228.70	1,848,124.70
LIFCO AB-B SHS	13,590	212.20	2,883,798.00
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	80,939	117.85	9,538,661.15
SANDVIK AB	56,973	219.20	12,488,481.60
SKANSKA B	19,869	193.90	3,852,599.10
SKF AB-B	18,340	201.20	3,690,008.00
VOLVO AB-A SHS	8,748	216.40	1,893,067.20
VOLVO B	80,587	207.45	16,717,773.15
SECURITAS B	25,545	91.98	2,349,629.10
VOLVO CAR AB-B	35,544	50.97	1,811,677.68
ELECTROLUX AB-SER B	12,053	128.08	1,543,748.24
EVOLUTION AB	9,622	1,321.20	12,712,586.40
EMBRACER GROUP AB	34,541	56.20	1,941,204.20
HENNES & MAURITZ B	33,524	128.78	4,317,220.72
ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,655	277.30	8,777,931.50
GETINGE AB-B SHS	12,650	232.30	2,938,595.00
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	9,481	237.10	2,247,945.10
NORDEA BANK ABP	180,364	128.00	23,086,592.00
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	82,855	127.70	10,580,583.50
SVENSKA HANDELSBK A	81,670	108.05	8,824,443.50
SWEDBANK AB-A	50,623	210.00	10,630,830.00
EQT AB	15,478	244.00	3,776,632.00
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,848	287.80	1,970,854.40
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	286.50	2,472,781.50
INVESTOR AB-A SHS	23,000	207.10	4,763,300.00
INVESTOR AB-B SHS	95,842	202.85	19,441,549.70
KINNEVIK AB - B	10,757	159.10	1,711,438.70
LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	493.30	2,019,076.90
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	32,478	53.32	1,731,726.96
SAGAX AB-B	9,400	262.90	2,471,260.00
ERICSSON (LM) B	160,922	59.82	9,626,354.04
HEXAGON AB-B SHS	108,582	118.00	12,812,676.00
TELE2 AB-B SHS	34,520	94.36	3,257,307.20

	TELIA CO AB	138,487	26.56	3,678,214.72	
	スウェーデンクローナ 小計	1,978,067		289,554,044.34 (3,761,307,035)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	17,052	280.60	4,784,791.20	
	EQUINOR ASA	50,840	319.80	16,258,632.00	
	NORSK HYDRO	72,015	80.92	5,827,453.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,449	469.20	4,433,470.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,500	435.00	1,957,500.00	
	ADEVINTA ASA	16,857	82.35	1,388,173.95	
	MOWI ASA	23,314	175.80	4,098,601.20	
	ORKLA	39,803	70.18	2,793,374.54	
	SALMAR ASA	2,953	434.00	1,281,602.00	
	DNB BANK ASA	46,261	199.10	9,210,565.10	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	182.40	2,034,307.20	
	TELENOR ASA	38,789	116.15	4,505,342.35	
	ノルウェークローネ 小計	332,986		58,573,814.14 (769,074,179)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	499.40	2,653,811.60	
	NOVOZYMES A/S	10,786	349.10	3,765,392.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	428	1,797.50	769,330.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	55,152	205.10	11,311,675.20	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	152	15,890.00	2,415,280.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	251	16,085.00	4,037,335.00	
	DSV A/S	10,213	1,282.00	13,093,066.00	
	PANDORA A/S	4,249	660.00	2,804,340.00	
	CARLSBERG AS-B	5,476	986.00	5,399,336.00	
	COLOPLAST-B	6,218	811.40	5,045,285.20	
	DEMANT A/S	4,463	213.60	953,296.80	
	GENMAB A/S	3,603	2,768.00	9,973,104.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	88,202	983.70	86,764,307.40	
	DANSKE BANK A/S	38,806	154.95	6,012,989.70	
	TRYG A/S	16,972	156.85	2,662,058.20	
ORSTED A/S	9,594	637.40	6,115,215.60		
	デンマーククローネ 小計	259,879		163,775,823.30 (3,155,960,114)	
オーストラリア	AMPOL LTD	12,821	32.31	414,246.51	

ドル	SANTOS	176,138	6.77	1,192,454.26
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,345	28.55	295,349.75
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	99,749	34.18	3,409,420.82
	BHP GROUP LTD	270,212	48.46	13,094,473.52
	BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	17.84	384,434.16
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	85,584	22.58	1,932,486.72
	IGO LTD	35,382	13.24	468,457.68
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	25,493	32.43	826,737.99
	MINERAL RESOURCES LTD	10,000	81.85	818,500.00
	NEWCREST MINING LIMITED	45,440	23.60	1,072,384.00
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	58,122	11.22	652,128.84
	ORICA LTD	26,961	15.96	430,297.56
	PILBARA MINERALS LTD	131,710	4.20	553,182.00
	RIO TINTO LTD	20,196	125.15	2,527,529.40
	SOUTH32 LTD	246,137	4.48	1,102,693.76
	REECE LTD	12,870	16.75	215,572.50
	BRAMBLES LTD	66,936	12.18	815,280.48
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	3.44	321,997.76
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	6.58	262,857.84
	TRANSURBAN GROUP	167,820	14.09	2,364,583.80
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,473	35.80	1,126,733.40
	IDP EDUCATION LTD	12,550	30.89	387,669.50
	LOTTERY CORP LTD/THE	123,601	4.86	600,700.86
	REA GROUP LTD	3,000	125.65	376,950.00
	SEEK LTD	17,113	24.32	416,188.16
	WESFARMERS LTD	58,879	50.35	2,964,557.65
	COLES GROUP LTD	68,071	18.30	1,245,699.30
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	74,362	6.88	511,610.56
	WOOLWORTHS GROUP LTD	63,525	36.80	2,337,720.00
	TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	13.85	477,548.00
	COCHLEAR LIMITED	3,460	224.60	777,116.00
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	66.80	644,018.80
	SONIC HEALTHCARE LTD	25,969	32.77	851,004.13
	CSL LIMITED	25,778	298.40	7,692,155.20
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	156,585	24.74	3,873,912.90	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	90,909	102.23	9,293,627.07	

	NATIONAL AUSTRALIA BANK	167,348	30.30	5,070,644.40	
	WESTPAC BANKING	183,712	23.01	4,227,213.12	
	ASX LTD	11,055	68.48	757,046.40	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	19,061	190.73	3,635,504.53	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	137,266	4.82	661,622.12	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	3.06	395,511.12	
	QBE INSURANCE GROUP	78,253	14.92	1,167,534.76	
	SUNCORP GROUP LIMITED	66,731	12.81	854,824.11	
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,589	24.11	689,280.79	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,342	56.45	470,905.90	
	XERO LTD	7,073	76.91	543,984.43	
	TELSTRA GROUP LTD	199,810	4.21	841,200.10	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	6.98	613,423.34	
	オーストラリアドル 小計	3,580,788		86,660,976.00 (8,043,871,792)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,661	8.60	556,084.60	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	27,578	26.20	722,543.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	5.23	546,759.89	
	MERCURY NZ LTD	40,719	6.19	252,050.61	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	5.34	341,941.56	
	ニュージーランドドル 小計	301,535		2,419,380.26 (203,227,941)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,448	48.25	6,728,366.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	69,000	101.70	7,017,300.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	102,000	16.70	1,703,400.00	
	MTR CORP	82,500	40.05	3,304,125.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	81,000	16.12	1,305,720.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	117,000	51.75	6,054,750.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	27.80	3,530,600.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	83,000	23.25	1,929,750.00	
	WH GROUP LTD	446,619	4.74	2,116,974.06	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	191,500	26.75	5,122,625.00	
	HANG SENG BANK	39,600	124.10	4,914,360.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	64,800	332.80	21,565,440.00	
	AIA GROUP LTD	637,400	83.25	53,063,550.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	98,448	50.00	4,922,400.00	

	ESR GROUP LTD	92,400	14.30	1,321,320.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	16.04	1,844,600.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	27.45	2,189,439.45	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	76,250	22.00	1,677,500.00	
	SINO LAND CO	198,600	10.36	2,057,496.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	80,000	111.30	8,904,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	31,000	66.80	2,070,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	20.80	1,435,200.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	81,000	43.40	3,515,400.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	42.95	1,374,400.00	
	CLP HOLDINGS	81,000	56.35	4,564,350.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	608,990	7.43	4,524,795.70	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	42.80	3,145,800.00	
	香港ドル 小計	3,897,816		161,904,461.21 (2,775,042,465)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,100	28.97	147,747.00	
	KEPPEL CORP LTD	80,200	7.10	569,420.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.57	267,036.00	
	SINGAPORE AIRLINES	73,350	5.78	423,963.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	1.00	319,700.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	106,600	4.00	426,400.00	
	DBS GROUP	95,900	34.92	3,348,828.00	
	OCBC BANK	179,550	13.05	2,343,127.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	61,300	30.67	1,880,071.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	8.89	377,825.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	153,900	3.85	592,515.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	7.81	171,820.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	6.73	166,904.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	18.20	260,260.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	420,880	2.44	1,026,947.20	
	シンガポールドル 小計	1,674,880		12,322,563.70 (1,239,157,005)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	39,375	26.10	1,027,687.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	599.20	747,801.60	
	BANK HAPOLIM BM	63,371	31.46	1,993,651.66	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,181	30.25	2,485,975.25	

	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	18.32	1,176,638.64	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,698	116.30	1,011,577.40	
	AZRIELI GROUP	2,465	212.90	524,798.50	
	NICE LTD	3,165	773.00	2,446,545.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	125,222	5.37	672,442.14	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,624	144.90	814,917.60	
	イスラエルシェケル 小計	395,576		12,902,035.29 (484,350,146)	
	合 計	58,194,752		348,505,041,801 (348,505,041,801)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	オーストラ リアドル	APA GROUP	63,405	685,408.05	
		LENLEASE GROUP	36,448	283,565.44	
	オーストラリアドル 小計		99,853	968,973.49 (89,940,119)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	673,400.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	1,924,000.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,597,400.00 (44,519,436)	
投資信託受益証券合計			414,853	134,459,555 (134,459,555)	
投資証券	アメリカド ル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,183	1,322,209.14	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	16,172	537,719.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	24,921	5,239,889.46	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	24,773	534,849.07	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,676	1,376,076.52	
		BOSTON PROPERTIES	7,893	555,982.92	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	611,414.65	
		CROWN CASTLE INC	23,289	3,276,296.52	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,921	1,652,649.96	
		EQUINIX INC	4,728	3,388,841.28	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	645,410.52	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,842	1,241,310.96	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,594	851,167.02	

	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,789	1,079,383.11	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12,333	649,702.44	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	19,000	398,240.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	30,237	790,092.81	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,506	686,171.64	
	INVITATION HOMES INC	30,792	1,004,742.96	
	IRON MOUNTAIN INC	16,160	850,016.00	
	KIMCO REALTY CORP	31,093	657,616.95	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	33,130	429,364.80	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,856	985,799.04	
	PROLOGIS INC	49,348	6,184,291.36	
	PUBLIC STORAGE	8,202	2,452,480.02	
	REALTY INCOME CORP	33,449	2,211,647.88	
	REGENCY CENTERS CORP	8,164	525,190.12	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,725	1,610,099.00	
	SIMON PROPERTY GROUP	16,895	2,089,235.70	
	SUN COMMUNITIES INC	6,650	1,051,032.50	
	UDR INC	17,830	797,892.50	
	VENTAS INC	20,307	1,024,691.22	
	VICI PROPERTIES INC	51,241	1,736,557.49	
	WELLTOWER INC	24,056	1,861,934.40	
	WP CAREY INC	10,761	903,170.73	
	アメリカドル 小計	647,588	51,213,169.69 (6,878,952,952)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	253,450.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	199,562.95	
	カナダドル 小計	14,014	453,012.95 (45,210,692)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	3,076	191,942.40	
	GECINA SA	2,719	297,730.50	
	KLEPIERRE	11,603	272,322.41	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,185	365,533.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,235	216,326.50	
	ユーロ 小計	30,818	1,343,855.31 (192,776,044)	
イギリスポ	BRITISH LAND CO PLC	39,175	174,642.15	

	ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	224,474.15	
		SEGRO PLC	63,208	537,015.16	
イギリスポンド 小計			134,515	936,131.46 (151,316,289)	
オーストラ リアドル	DEXUS		49,283	427,776.44	
	GOODMAN GROUP		90,044	1,782,871.20	
	GPT GROUP		111,587	509,952.59	
	MIRVAC GROUP		228,843	510,319.89	
	SCENTRE GROUP		297,027	864,348.57	
	STOCKLAND		121,481	472,561.09	
	VICINITY CENTERS		221,263	453,589.15	
オーストラリアドル 小計			1,119,528	5,021,418.93 (466,088,105)	
香港ドル	LINK REIT		107,800	5,643,330.00	
香港ドル 小計			107,800	5,643,330.00 (96,726,676)	
シンガポ ールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT		207,909	584,224.29	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		276,190	538,570.50	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST		174,778	295,374.82	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA		132,200	226,062.00	
シンガポールドル 小計			791,077	1,644,231.61 (165,343,930)	
投資証券合計			2,845,340	7,996,414,688 (7,996,414,688)	
合計				8,130,874,243 (8,130,874,243)	

(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 602 銘柄	97.3%	—	—	70.5%

	投資証券 35 銘柄	—	—	2.7%	1.9%
カナダドル	株式 86 銘柄	99.7%	—	—	3.6%
	投資証券 2 銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式 221 銘柄	99.5%	—	—	10.2%
	投資証券 5 銘柄	—	—	0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 77 銘柄	99.1%	—	—	4.6%
	投資証券 3 銘柄	—	—	0.9%	0.0%
スイスフラン	株式 43 銘柄	100.0%	—	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式 45 銘柄	100.0%	—	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
オーストラリアドル	株式 50 銘柄	93.5%	—	—	2.3%
	投資信託受 2 銘柄 益証券	—	1.0%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	5.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式 27 銘柄	95.2%	—	—	0.8%
	投資信託受 2 銘柄 益証券	—	1.5%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式 15 銘柄	88.2%	—	—	0.3%
	投資証券 4 銘柄	—	—	11.8%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 10 銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2023年2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	314,086,804
コール・ローン	1,827,956,077

国債証券	148,104,169,044
派生商品評価勘定	33,024,263
未収入金	2,440,578
未収利息	934,148,624
前払金	28,052,968
前払費用	65,991,906
差入委託証拠金	87,730,605
流動資産合計	151,397,600,869
資産合計	151,397,600,869
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	28,075,456
未払解約金	115,261,967
未払利息	604
流動負債合計	143,338,027
負債合計	143,338,027
純資産の部	
元本等	
元本	57,796,068,029
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	93,458,194,813
元本等合計	151,254,262,842
純資産合計	151,254,262,842
負債純資産合計	151,397,600,869

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 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。 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</p>

4. 収益及び費用の計上基準	<p>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> <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 2 月 21 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,796,068,029 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 2.6170 円 (1 万口当たり純資産額) (26,170 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 2 月 21 日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 2 月 21 日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年2月22日
期首元本額	56,823,232,074円
期中追加設定元本額	6,545,636,885円
期中一部解約元本額	5,572,800,930円
期末元本額	57,796,068,029円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,960,480,143円
DC外国債券インデックスファンド	1,898,326,607円
DC外国債券インデックスファンドL	14,591,400,227円
DCバランスファンド30	946,814,641円
DCバランスファンド50	1,031,591,457円
DCバランスファンド70	236,338,554円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	483,973,366円
外国債券インデックスe	1,030,173,188円
インデックスコレクション(外国債券)	9,236,953,849円
インデックスコレクション(バランス株式30)	5,021,682,310円
インデックスコレクション(バランス株式50)	969,657,767円
インデックスコレクション(バランス株式70)	318,559,562円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	4,956,244,496円
外国債券パッシブファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	2,965,282,244円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	351,636,729円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	74,916,973円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	369,028,551円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	232,593,690円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	171,173,388円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	101,962,174円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,150,067,728円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	515,396,981円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	5,460,249,626円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	293,020,137円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	173,421,103円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	1,400,576,214円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	74,877,861円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	167,922,609円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	81,229,025円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	43,950,779円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	53,739,220円

バランスVA25L (適格機関投資家専用)	200,749,064 円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	62,391,221 円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	1,157,871,033 円
私募外国債券インデックスファンドAL (適格機関投資家専用)	11,815,512 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		△1,922,815,219
合計		△1,922,815,219

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2023年2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,588,994,663	—	1,560,941,695	△28,052,968
合計		1,588,994,663	—	1,560,941,695	△28,052,968

(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。

- 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。
- 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。
- 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2月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,710,867,522	—	1,743,869,297	33,001,775
	アメリカドル	907,330,733	—	925,372,689	18,041,956
	カナダドル	60,963,601	—	61,701,966	738,365
	ユーロ	581,392,989	—	592,909,272	11,516,283
	イギリスポンド	87,019,515	—	88,672,540	1,653,025
	オフショア人民元	74,160,684	—	75,212,830	1,052,146
合計		1,710,867,522	—	1,743,869,297	33,001,775

(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% 03/15/24	4,500,000.00	4,279,088.38	
		T 0.25% 05/15/24	5,070,000.00	4,786,396.87	
		T 0.25% 05/31/25	1,180,000.00	1,072,785.93	
		T 0.25% 06/15/24	10,610,000.00	9,979,202.39	
		T 0.25% 06/30/25	4,310,000.00	3,911,493.34	
		T 0.25% 07/31/25	2,200,000.00	1,990,140.63	
		T 0.25% 09/30/25	3,290,000.00	2,962,285.13	
		T 0.375% 01/31/26	1,700,000.00	1,517,250.00	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,316,250.00	
		T 0.375% 07/31/27	4,000,000.00	3,402,656.24	
		T 0.375% 08/15/24	5,500,000.00	5,149,482.41	
		T 0.375% 09/15/24	4,600,000.00	4,294,710.92	
		T 0.375% 09/30/27	4,000,000.00	3,386,406.24	
		T 0.375% 11/30/25	3,770,000.00	3,383,133.19	
		T 0.5% 02/28/26	3,500,000.00	3,126,484.37	
		T 0.5% 03/31/25	4,000,000.00	3,678,750.00	
		T 0.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,724,531.24	
		T 0.5% 05/31/27	5,500,000.00	4,728,066.42	
		T 0.5% 06/30/27	2,500,000.00	2,144,335.95	
		T 0.5% 08/31/27	1,100,000.00	938,996.09	
T 0.5% 10/31/27	1,580,000.00	1,341,950.78			
T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	2,955,609.39			
T 0.625% 05/15/30	7,400,000.00	5,901,500.00			

T 0.625% 07/31/26	4,000,000.00	3,541,562.48	
T 0.625% 08/15/30	9,130,000.00	7,240,518.01	
T 0.625% 10/15/24	3,250,000.00	3,038,496.11	
T 0.625% 11/30/27	3,700,000.00	3,154,972.64	
T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,551,640.64	
T 0.75% 01/31/28	3,500,000.00	2,989,082.04	
T 0.75% 03/31/26	2,750,000.00	2,472,636.70	
T 0.75% 04/30/26	3,500,000.00	3,135,781.25	
T 0.75% 08/31/26	3,000,000.00	2,661,210.93	
T 0.75% 11/15/24	5,230,000.00	4,885,044.73	
T 0.875% 09/30/26	5,000,000.00	4,445,898.45	
T 0.875% 11/15/30	6,160,000.00	4,962,890.60	
T 1.125% 01/15/25	5,830,000.00	5,459,931.65	
T 1.125% 02/15/31	5,600,000.00	4,592,656.26	
T 1.125% 05/15/40	1,550,000.00	995,511.71	
T 1.125% 08/15/40	4,000,000.00	2,553,125.00	
T 1.125% 08/31/28	4,000,000.00	3,433,750.00	
T 1.125% 10/31/26	7,850,000.00	7,030,043.00	
T 1.25% 03/31/28	5,300,000.00	4,624,871.10	
T 1.25% 05/15/50	5,120,000.00	2,859,100.00	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,216,250.00	
T 1.25% 06/30/28	1,000,000.00	867,890.62	
T 1.25% 08/15/31	6,550,000.00	5,351,554.68	
T 1.25% 09/30/28	3,800,000.00	3,278,390.64	
T 1.25% 11/30/26	3,000,000.00	2,694,257.82	
T 1.25% 12/31/26	5,500,000.00	4,932,167.95	
T 1.375% 08/15/50	2,300,000.00	1,326,857.41	
T 1.375% 10/31/28	1,700,000.00	1,474,417.97	
T 1.375% 11/15/31	12,110,000.00	9,933,511.35	
T 1.375% 11/15/40	4,650,000.00	3,095,519.50	
T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,559,157.03	
T 1.5% 08/15/26	5,300,000.00	4,836,457.01	
T 1.5% 09/30/24	3,000,000.00	2,848,476.57	
T 1.5% 11/30/28	5,550,000.00	4,841,074.19	
T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	5,321,220.71	
T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	4,972,851.57	

T 1.625% 05/15/31	4,690,000.00	3,973,309.37	
T 1.625% 08/15/29	2,260,000.00	1,969,201.55	
T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	1,966,830.08	
T 1.625% 11/15/50	5,400,000.00	3,329,648.42	
T 1.625% 11/30/26	3,030,000.00	2,764,164.82	
T 1.75% 01/31/29	2,500,000.00	2,205,859.37	
T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	1,916,992.18	
T 1.75% 08/15/41	4,800,000.00	3,365,906.25	
T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	2,824,669.52	
T 1.75% 12/31/26	4,300,000.00	3,936,347.66	
T 1.875% 02/15/32	6,200,000.00	5,291,312.50	
T 1.875% 02/15/41	4,750,000.00	3,439,667.94	
T 1.875% 02/15/51	4,500,000.00	2,955,937.50	
T 1.875% 02/28/27	3,000,000.00	2,748,105.48	
T 1.875% 02/28/29	1,900,000.00	1,688,328.12	
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	3,692,071.87	
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,666,687.50	
T 1.875% 11/15/51	3,400,000.00	2,222,550.79	
T 1% 07/31/28	2,000,000.00	1,707,890.62	
T 1% 12/15/24	3,070,000.00	2,873,268.16	
T 2.125% 02/29/24	5,450,000.00	5,292,083.84	
T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,163,039.06	
T 2.125% 05/15/25	3,850,000.00	3,655,996.11	
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,442,578.12	
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,109,980.46	
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,338,722.65	
T 2.25% 01/31/24	2,500,000.00	2,435,853.55	
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	3,630,808.58	
T 2.25% 02/15/52	2,410,000.00	1,727,668.75	
T 2.25% 03/31/24	7,300,000.00	7,083,708.95	
T 2.25% 03/31/26	1,500,000.00	1,412,929.68	
T 2.25% 04/30/24	2,600,000.00	2,517,886.72	
T 2.25% 05/15/41	1,600,000.00	1,230,656.25	
T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,146,725.00	
T 2.25% 08/15/46	2,180,000.00	1,590,292.97	
T 2.25% 08/15/49	4,110,000.00	2,973,649.19	

T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,397,949.22	
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	4,795,800.80	
T 2.25% 11/15/25	5,500,000.00	5,202,226.59	
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	4,852,350.00	
T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	2,775,503.89	
T 2.375% 02/15/42	1,350,000.00	1,051,312.50	
T 2.375% 02/29/24	4,280,000.00	4,166,852.72	
T 2.375% 03/31/29	1,400,000.00	1,277,937.50	
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	1,719,046.87	
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	3,356,156.23	
T 2.375% 05/15/29	3,890,000.00	3,546,737.88	
T 2.375% 05/15/51	1,980,000.00	1,462,492.96	
T 2.375% 08/15/24	5,460,000.00	5,264,634.37	
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	1,493,916.80	
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	3,843,593.76	
T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	1,662,050.79	
T 2.5% 02/15/46	2,250,000.00	1,729,599.61	
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	617,131.83	
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	3,590,878.89	
T 2.5% 05/15/46	1,810,000.00	1,390,376.94	
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,288,300.78	
T 2.625% 02/15/29	6,900,000.00	6,398,671.87	
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,403,906.25	
T 2.75% 02/15/24	3,900,000.00	3,813,650.41	
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	4,400,562.90	
T 2.75% 05/31/29	6,000,000.00	5,590,546.86	
T 2.75% 06/30/25	2,000,000.00	1,923,515.62	
T 2.75% 08/15/32	2,280,000.00	2,086,912.50	
T 2.75% 08/15/42	2,330,000.00	1,921,430.86	
T 2.75% 08/15/47	1,150,000.00	922,919.91	
T 2.75% 08/31/25	5,000,000.00	4,801,367.20	
T 2.75% 11/15/42	1,650,000.00	1,357,189.44	
T 2.75% 11/15/47	1,400,000.00	1,123,828.13	
T 2.875% 04/30/25	10,770,000.00	10,398,939.89	
T 2.875% 05/15/28	4,460,000.00	4,217,574.60	
T 2.875% 05/15/32	4,500,000.00	4,168,476.54	

T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	879,210.93	
T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	3,631,031.27	
T 2.875% 05/15/52	3,000,000.00	2,470,898.43	
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	482,148.44	
T 2.875% 08/15/28	10,200,000.00	9,627,445.33	
T 2.875% 08/15/45	1,480,000.00	1,221,635.94	
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	5,753,644.50	
T 2% 02/15/50	3,370,000.00	2,297,392.18	
T 2% 04/30/24	3,000,000.00	2,896,816.41	
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,445,273.43	
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	961,367.19	
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	3,538,037.10	
T 2% 08/15/51	6,940,000.00	4,687,753.12	
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,496,550.78	
T 2% 11/15/41	4,140,000.00	3,026,728.12	
T 3.125% 02/15/42	1,000,000.00	880,898.44	
T 3.125% 02/15/43	1,100,000.00	960,265.62	
T 3.125% 05/15/48	1,400,000.00	1,205,968.75	
T 3.125% 08/15/44	1,550,000.00	1,341,355.46	
T 3.125% 08/31/29	4,300,000.00	4,091,886.70	
T 3.125% 11/15/28	3,960,000.00	3,780,871.85	
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	769,032.41	
T 3.25% 05/15/42	1,500,000.00	1,342,207.03	
T 3.25% 06/30/27	4,850,000.00	4,683,754.90	
T 3.375% 05/15/44	1,200,000.00	1,082,765.62	
T 3.375% 11/15/48	1,000,000.00	903,320.31	
T 3.5% 02/15/39	900,000.00	859,693.35	
T 3.625% 02/15/44	1,600,000.00	1,502,375.00	
T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	1,506,875.00	
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,067,988.28	
T 3.75% 11/15/43	900,000.00	862,382.80	
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	675,457.81	
T 3.875% 09/30/29	1,050,000.00	1,043,724.61	
T 3% 02/15/47	2,400,000.00	2,019,187.48	
T 3% 02/15/48	3,100,000.00	2,608,117.17	
T 3% 02/15/49	1,940,000.00	1,639,224.22	

	T 3% 05/15/42	1,100,000.00	947,460.93	
	T 3% 05/15/45	600,000.00	506,765.62	
	T 3% 05/15/47	1,300,000.00	1,093,421.87	
	T 3% 08/15/48	3,060,000.00	2,576,974.22	
	T 3% 08/15/52	2,570,000.00	2,172,854.68	
	T 3% 09/30/25	3,660,000.00	3,532,614.83	
	T 3% 10/31/25	1,000,000.00	965,019.53	
	T 3% 11/15/44	1,550,000.00	1,312,292.96	
	T 4.25% 05/15/39	850,000.00	887,519.52	
	T 4.25% 11/15/40	900,000.00	937,089.84	
	T 4.375% 02/15/38	500,000.00	530,537.11	
	T 4.375% 05/15/40	750,000.00	792,363.28	
	T 4.375% 05/15/41	550,000.00	581,689.45	
	T 4.375% 11/15/39	650,000.00	688,593.75	
	T 4.5% 02/15/36	600,000.00	647,425.78	
	T 4.5% 05/15/38	970,000.00	1,042,257.42	
	T 4.5% 08/15/39	750,000.00	805,927.73	
	T 4.5% 11/15/25	4,350,000.00	4,363,508.79	
	T 4.625% 02/15/40	700,000.00	763,765.62	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	831,035.16	
	T 4% 11/15/52	1,000,000.00	1,024,062.50	
	T 4% 12/15/25	5,000,000.00	4,957,617.20	
	T 5.0% 05/15/37	650,000.00	735,299.80	
	T 5.25% 11/15/28	900,000.00	957,515.62	
	T 5.375% 02/15/31	750,000.00	826,333.00	
	T 6.0% 02/15/26	600,000.00	628,289.06	
	T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,142,203.12	
	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	825,243.75	
	アメリカドル 小計	624,860,000.00	551,774,925.84 (74,114,408,038)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	890,000.00	802,426.67	
	CAN 0.25% 04/01/24	990,000.00	945,128.25	
	CAN 0.5% 09/01/25	1,590,000.00	1,461,612.27	
	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,879,807.84	
	CAN 0.75% 02/01/24	430,000.00	414,956.02	
	CAN 0.75% 10/01/24	300,000.00	283,968.60	

	CAN 1.25% 03/01/25	500,000.00	473,072.50	
	CAN 1.25% 03/01/27	640,000.00	586,126.08	
	CAN 1.25% 06/01/30	1,940,000.00	1,686,632.12	
	CAN 1.5% 04/01/25	1,210,000.00	1,148,373.49	
	CAN 1.5% 05/01/24	1,850,000.00	1,786,859.50	
	CAN 1.5% 06/01/26	740,000.00	692,620.76	
	CAN 1.5% 06/01/31	2,010,000.00	1,751,216.52	
	CAN 1.5% 09/01/24	660,000.00	633,422.46	
	CAN 1.5% 12/01/31	1,230,000.00	1,063,534.26	
	CAN 1.75% 12/01/53	1,400,000.00	992,751.20	
	CAN 1% 06/01/27	880,000.00	797,264.16	
	CAN 1% 09/01/26	1,220,000.00	1,115,892.52	
	CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	655,038.90	
	CAN 2.25% 06/01/25	670,000.00	646,544.64	
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	367,733.34	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,780,000.00	1,738,714.68	
	CAN 2.5% 12/01/32	740,000.00	691,669.86	
	CAN 2.75% 08/01/24	280,000.00	273,804.16	
	CAN 2.75% 09/01/27	710,000.00	689,338.29	
	CAN 2.75% 12/01/48	510,000.00	462,500.64	
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	309,716.40	
	CAN 2% 06/01/28	500,000.00	468,898.50	
	CAN 2% 06/01/32	1,190,000.00	1,068,396.28	
	CAN 2% 12/01/51	2,510,000.00	1,915,795.15	
	CAN 3.5% 12/01/45	590,000.00	606,410.85	
	CAN 4.0% 06/01/41	490,000.00	534,076.97	
	CAN 5.75% 06/01/29	480,000.00	546,372.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	620,000.00	749,682.30	
	CAN 5% 06/01/37	560,000.00	664,760.88	
	カナダドル 小計	33,840,000.00	30,905,119.06 (3,084,330,882)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	6,920,704.00	
	MBONO 10% 12/05/24	20,780,000.00	20,525,402.60	
	MBONO 5.5% 03/04/27	4,240,000.00	3,655,388.80	
	MBONO 5.75% 03/05/26	23,680,000.00	21,060,861.52	
	MBONO 7.5% 05/26/33	1,960,000.00	1,775,230.60	

	MBONO 7.5% 06/03/27	21,620,000.00	20,140,759.60	
	MBONO 7.75% 05/29/31	17,390,000.00	16,118,964.90	
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	12,215,584.20	
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,970,000.00	4,534,975.90	
	MBONO 8.5% 05/31/29	20,740,000.00	20,159,694.80	
	MBONO 8.5% 11/18/38	13,720,000.00	12,988,449.60	
	MBONO 8% 07/31/53	4,410,000.00	3,957,961.70	
	MBONO 8% 09/05/24	18,530,000.00	17,714,057.02	
	MBONO 8% 11/07/47	14,310,000.00	12,846,945.60	
	メキシコペソ 小計	186,730,000.00	174,614,980.84 (1,276,732,355)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	660,000.00	541,183.50	
	BGB 0.35% 06/22/32	700,000.00	549,323.60	
	BGB 0.4% 06/22/40	400,000.00	247,963.20	
	BGB 0.5% 10/22/24	490,000.00	470,806.08	
	BGB 0.65% 06/22/71	340,000.00	139,561.50	
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,048,995.20	
	BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	689,391.00	
	BGB 0.8% 06/22/28	810,000.00	731,485.89	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,100,000.00	979,137.50	
	BGB 0% 10/22/27	600,000.00	526,807.80	
	BGB 0% 10/22/31	730,000.00	565,828.84	
	BGB 1.25% 04/22/33	550,000.00	464,857.25	
	BGB 1.4% 06/22/53	520,000.00	332,076.68	
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	318,914.40	
	BGB 1.6% 06/22/47	640,000.00	456,876.80	
	BGB 1.7% 06/22/50	710,000.00	505,118.14	
	BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	426,891.93	
	BGB 1% 06/22/26	1,080,000.00	1,018,746.72	
	BGB 1% 06/22/31	910,000.00	781,642.68	
	BGB 2.15% 06/22/66	450,000.00	342,074.25	
	BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	300,004.30	
	BGB 2.6% 06/22/24	1,000,000.00	993,962.59	
	BGB 2.75% 04/22/39	70,000.00	65,327.01	
	BGB 3.75% 06/22/45	520,000.00	553,149.48	
	BGB 3% 06/22/33	300,000.00	297,144.47	

BGB 3% 06/22/34	350,000.00	344,934.45	
BGB 4.25% 03/28/41	1,110,000.00	1,249,529.22	
BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	787,033.50	
BGB 4% 03/28/32	620,000.00	667,813.16	
BGB 5.5% 03/28/28	1,170,000.00	1,318,629.78	
BGB 5% 03/28/35	1,270,000.00	1,499,235.00	
BKO 0.2% 06/14/24	1,850,000.00	1,785,302.72	
BKO 0.4% 09/13/24	330,000.00	317,504.50	
BKO 0% 03/15/24	620,000.00	601,314.87	
BTPS 0.25% 03/15/28	1,250,000.00	1,051,952.50	
BTPS 0.35% 02/01/25	2,350,000.00	2,216,813.75	
BTPS 0.45% 02/15/29	1,710,000.00	1,404,919.61	
BTPS 0.5% 02/01/26	500,000.00	458,242.00	
BTPS 0.5% 07/15/28	730,000.00	615,313.35	
BTPS 0.6% 08/01/31	1,500,000.00	1,135,570.50	
BTPS 0.85% 01/15/27	1,600,000.00	1,443,204.80	
BTPS 0.9% 04/01/31	1,300,000.00	1,024,090.60	
BTPS 0.95% 03/01/37	600,000.00	391,525.20	
BTPS 0.95% 06/01/32	880,000.00	667,860.16	
BTPS 0.95% 08/01/30	1,330,000.00	1,074,006.32	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,000,000.00	888,779.20	
BTPS 0.95% 12/01/31	1,120,000.00	864,700.48	
BTPS 0% 04/01/26	2,700,000.00	2,420,982.00	
BTPS 0% 04/15/24	480,000.00	462,135.36	
BTPS 0% 08/01/26	1,330,000.00	1,179,059.17	
BTPS 0% 08/15/24	1,610,000.00	1,531,696.04	
BTPS 1.2% 08/15/25	540,000.00	511,229.34	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,075,883.44	
BTPS 1.35% 04/01/30	750,000.00	632,082.00	
BTPS 1.45% 03/01/36	830,000.00	596,512.70	
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,027,017.03	
BTPS 1.45% 11/15/24	1,520,000.00	1,471,906.39	
BTPS 1.5% 04/30/45	650,000.00	389,454.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,438,400.23	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,270,575.45	
BTPS 1.65% 03/01/32	1,300,000.00	1,064,914.50	

BTPS 1.65% 12/01/30	1,450,000.00	1,225,487.80	
BTPS 1.7% 09/01/51	750,000.00	437,743.27	
BTPS 1.75% 05/30/24	280,000.00	274,179.46	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,840,000.00	1,800,324.08	
BTPS 1.8% 03/01/41	890,000.00	606,325.85	
BTPS 1.85% 05/15/24	750,000.00	736,726.50	
BTPS 1.85% 07/01/25	820,000.00	791,210.62	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,040,000.00	973,740.56	
BTPS 2.15% 03/01/72	240,000.00	140,054.73	
BTPS 2.15% 09/01/52	510,000.00	325,729.35	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,110,000.00	1,049,507.22	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,190,000.00	940,349.90	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,360,000.00	1,151,824.80	
BTPS 2.45% 09/01/50	970,000.00	679,363.75	
BTPS 2.5% 11/15/25	660,000.00	643,922.40	
BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,281,549.10	
BTPS 2.5% 12/01/32	960,000.00	832,679.04	
BTPS 2.65% 12/01/27	770,000.00	735,604.87	
BTPS 2.7% 03/01/47	940,000.00	712,200.40	
BTPS 2.8% 03/01/67	500,000.00	347,153.50	
BTPS 2.8% 06/15/29	700,000.00	658,583.80	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,199,230.20	
BTPS 2.95% 09/01/38	850,000.00	714,957.10	
BTPS 2% 02/01/28	930,000.00	860,748.48	
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,009,690.50	
BTPS 3.1% 03/01/40	670,000.00	564,883.70	
BTPS 3.25% 09/01/46	980,000.00	819,563.22	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,100,000.00	995,299.80	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,040,000.00	896,196.08	
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	1,907,119.50	
BTPS 3.75% 09/01/24	1,040,000.00	1,045,593.12	
BTPS 3.85% 09/01/49	840,000.00	767,189.64	
BTPS 3% 08/01/29	1,210,000.00	1,153,940.70	
BTPS 4.4% 05/01/33	250,000.00	252,293.37	
BTPS 4.45% 09/01/43	440,000.00	436,834.20	
BTPS 4.5% 03/01/24	1,130,000.00	1,142,830.24	

	BTPS 4.5% 03/01/26	930,000.00	955,853.34	
	BTPS 4.75% 09/01/28	1,810,000.00	1,902,305.29	
	BTPS 4.75% 09/01/44	1,130,000.00	1,177,421.58	
	BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	1,739,169.00	
	BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	1,534,708.80	
	BTPS 5.25% 11/01/29	1,770,000.00	1,926,991.92	
	BTPS 5.75% 02/01/33	1,320,000.00	1,478,946.48	
	BTPS 5% 03/01/25	1,290,000.00	1,329,791.34	
	BTPS 5% 08/01/34	1,260,000.00	1,332,776.34	
	BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	1,711,683.20	
	BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,327,816.43	
	BTPS 6% 05/01/31	1,600,000.00	1,829,457.60	
	BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	395,325.00	
	DBR 0.25% 02/15/27	230,000.00	210,226.67	
	DBR 0.25% 02/15/29	1,750,000.00	1,538,069.75	
	DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,153,837.10	
	DBR 0.5% 02/15/25	2,090,000.00	1,997,204.00	
	DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,159,240.00	
	DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,371,243.08	
	DBR 0.5% 08/15/27	940,000.00	860,867.98	
	DBR 0% 02/15/30	1,660,000.00	1,404,373.28	
	DBR 0% 02/15/31	1,240,000.00	1,025,801.16	
	DBR 0% 02/15/32	2,080,000.00	1,678,892.80	
	DBR 0% 05/15/35	1,280,000.00	944,023.04	
	DBR 0% 05/15/36	1,320,000.00	947,917.08	
	DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,481,513.08	
	DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,079,467.64	
	DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,238,677.12	
	DBR 0% 08/15/30	400,000.00	335,408.40	
	DBR 0% 08/15/31	2,310,000.00	1,888,715.35	
	DBR 0% 08/15/50	2,740,000.00	1,453,131.60	
	DBR 0% 08/15/52	1,140,000.00	577,343.88	
	DBR 0% 11/15/27	1,230,000.00	1,093,990.29	
	DBR 0% 11/15/28	830,000.00	722,402.95	
	DBR 1.25% 08/15/48	1,880,000.00	1,481,372.32	
	DBR 1.5% 05/15/24	1,020,000.00	1,002,483.54	

	DBR 1.7% 08/15/32	1,310,000.00	1,230,517.73
	DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,235,471.18
	DBR 1.8% 08/15/53	90,000.00	78,304.20
	DBR 1% 05/15/38	220,000.00	177,572.99
	DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,565,884.66
	DBR 1% 08/15/25	1,130,000.00	1,082,427.00
	DBR 2.3% 02/15/33	170,000.00	167,622.04
	DBR 2.5% 07/04/44	1,620,000.00	1,633,072.42
	DBR 2.5% 08/15/46	1,770,000.00	1,798,587.62
	DBR 3.25% 07/04/42	1,160,000.00	1,292,809.09
	DBR 4.0% 01/04/37	1,670,000.00	1,957,251.69
	DBR 4.25% 07/04/39	1,090,000.00	1,343,220.08
	DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	779,028.60
	DBR 4.75% 07/04/34	1,240,000.00	1,518,770.60
	DBR 4.75% 07/04/40	1,220,000.00	1,600,182.13
	DBR 5.5% 01/04/31	1,640,000.00	1,996,139.12
	DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	1,712,440.35
	DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	755,588.70
	DBR 6.5% 07/04/27	1,270,000.00	1,474,197.20
	FRTR 0.25% 11/25/26	1,590,000.00	1,445,977.80
	FRTR 0.5% 05/25/25	3,160,000.00	2,994,226.40
	FRTR 0.5% 05/25/26	2,930,000.00	2,718,497.95
	FRTR 0.5% 05/25/29	2,830,000.00	2,462,102.83
	FRTR 0.5% 05/25/40	1,260,000.00	813,907.81
	FRTR 0.5% 05/25/72	460,000.00	176,589.40
	FRTR 0.5% 06/25/44	790,000.00	467,285.00
	FRTR 0.75% 02/25/28	1,430,000.00	1,293,287.71
	FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	2,666,184.48
	FRTR 0.75% 05/25/52	1,930,000.00	1,052,936.59
	FRTR 0.75% 05/25/53	1,350,000.00	718,972.20
	FRTR 0.75% 11/25/28	3,190,000.00	2,846,226.46
	FRTR 0% 02/25/24	1,850,000.00	1,794,894.05
	FRTR 0% 02/25/25	880,000.00	829,603.28
	FRTR 0% 02/25/26	2,220,000.00	2,038,443.96
	FRTR 0% 02/25/27	2,320,000.00	2,075,782.88
	FRTR 0% 03/25/24	2,240,000.00	2,168,120.64

	FRTR 0% 03/25/25	3,280,000.00	3,085,102.40	
	FRTR 0% 05/25/32	2,150,000.00	1,651,630.00	
	FRTR 0% 11/25/29	2,760,000.00	2,291,785.32	
	FRTR 0% 11/25/30	3,330,000.00	2,685,528.45	
	FRTR 0% 11/25/31	3,190,000.00	2,493,549.63	
	FRTR 1.25% 05/25/34	2,030,000.00	1,689,495.92	
	FRTR 1.25% 05/25/36	2,660,000.00	2,125,829.44	
	FRTR 1.5% 05/25/31	2,770,000.00	2,509,495.35	
	FRTR 1.5% 05/25/50	1,960,000.00	1,364,307.00	
	FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	582,828.00	
	FRTR 1.75% 06/25/39	1,660,000.00	1,371,854.16	
	FRTR 1.75% 11/25/24	2,020,000.00	1,977,854.72	
	FRTR 1% 05/25/27	2,180,000.00	2,024,073.32	
	FRTR 1% 11/25/25	1,340,000.00	1,274,795.93	
	FRTR 2.25% 05/25/24	2,290,000.00	2,267,692.53	
	FRTR 2.5% 05/25/30	2,900,000.00	2,847,544.80	
	FRTR 2.5% 05/25/43	250,000.00	222,719.22	
	FRTR 2.75% 10/25/27	3,280,000.00	3,273,722.08	
	FRTR 2% 05/25/48	1,890,000.00	1,500,786.63	
	FRTR 2% 11/25/32	1,360,000.00	1,254,748.24	
	FRTR 3.25% 05/25/45	1,800,000.00	1,811,749.50	
	FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,181,445.28	
	FRTR 4.5% 04/25/41	2,340,000.00	2,747,274.66	
	FRTR 4.75% 04/25/35	1,590,000.00	1,855,307.40	
	FRTR 4% 04/25/55	1,070,000.00	1,231,925.24	
	FRTR 4% 04/25/60	1,050,000.00	1,231,845.30	
	FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	1,760,057.60	
	FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	2,876,215.00	
	FRTR 5.75% 10/25/32	2,150,000.00	2,662,499.80	
	FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,564,198.37	
	IRISH 0.2% 05/15/27	410,000.00	368,323.91	
	IRISH 0.2% 10/18/30	470,000.00	385,872.82	
	IRISH 0.35% 10/18/32	170,000.00	133,693.44	
	IRISH 0.4% 05/15/35	280,000.00	204,593.20	
	IRISH 0.55% 04/22/41	220,000.00	139,934.08	
	IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	400,526.72	

IRISH 0% 10/18/31	440,000.00	343,493.14	
IRISH 1.1% 05/15/29	550,000.00	496,671.45	
IRISH 1.3% 05/15/33	310,000.00	263,558.90	
IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	214,464.96	
IRISH 1.5% 05/15/50	430,000.00	298,756.69	
IRISH 1.7% 05/15/37	440,000.00	367,391.20	
IRISH 1% 05/15/26	670,000.00	634,599.21	
IRISH 2.4% 05/15/30	660,000.00	642,989.16	
IRISH 2% 02/18/45	620,000.00	500,746.72	
IRISH 3.4% 03/18/24	380,000.00	382,053.52	
IRISH 3% 10/18/43	170,000.00	165,365.46	
IRISH 5.4% 03/13/25	670,000.00	703,924.37	
NETHER 0.25% 07/15/25	760,000.00	715,153.54	
NETHER 0.25% 07/15/29	760,000.00	653,486.00	
NETHER 0.5% 01/15/40	910,000.00	636,132.77	
NETHER 0.5% 07/15/26	840,000.00	779,377.47	
NETHER 0.5% 07/15/32	720,000.00	588,823.20	
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	828,744.30	
NETHER 0.75% 07/15/28	1,090,000.00	986,014.00	
NETHER 0% 01/15/26	640,000.00	590,430.72	
NETHER 0% 01/15/27	750,000.00	675,393.14	
NETHER 0% 01/15/29	1,040,000.00	889,083.52	
NETHER 0% 01/15/38	530,000.00	351,048.68	
NETHER 0% 01/15/52	740,000.00	361,493.70	
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	699,043.40	
NETHER 0% 07/15/31	700,000.00	560,147.70	
NETHER 2.5% 01/15/33	820,000.00	803,372.04	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,160,000.00	1,180,605.08	
NETHER 2% 01/15/54	230,000.00	200,385.33	
NETHER 2% 07/15/24	1,110,000.00	1,095,028.32	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,010,000.00	1,155,939.95	
NETHER 4% 01/15/37	1,070,000.00	1,216,983.76	
NETHER 5.5% 01/15/28	650,000.00	732,608.50	
OBL 0% 04/05/24	1,880,000.00	1,820,362.22	
OBL 0% 04/10/26	1,500,000.00	1,382,224.50	
OBL 0% 04/11/25	1,420,000.00	1,338,307.40	

	OBL 0% 04/16/27	1,510,000.00	1,359,619.10	
	OBL 0% 10/09/26	630,000.00	573,743.52	
	OBL 0% 10/10/25	1,970,000.00	1,835,529.77	
	OBL 0% 10/18/24	1,390,000.00	1,325,821.61	
	OBL 1.3% 10/15/27	2,620,000.00	2,480,668.40	
	OBL 2.2% 04/13/28	700,000.00	688,884.70	
	RAGB 0.25% 10/20/36	360,000.00	246,114.00	
	RAGB 0.5% 02/20/29	810,000.00	704,099.79	
	RAGB 0.5% 04/20/27	650,000.00	591,802.90	
	RAGB 0.7% 04/20/71	200,000.00	90,104.20	
	RAGB 0.75% 02/20/28	830,000.00	749,825.32	
	RAGB 0.75% 03/20/51	410,000.00	236,759.01	
	RAGB 0.75% 10/20/26	900,000.00	835,410.60	
	RAGB 0.85% 06/30/20	200,000.00	82,465.60	
	RAGB 0.9% 02/20/32	800,000.00	668,023.20	
	RAGB 0% 02/20/30	660,000.00	538,726.32	
	RAGB 0% 02/20/31	720,000.00	569,764.08	
	RAGB 0% 04/20/25	370,000.00	347,604.27	
	RAGB 0% 07/15/24	660,000.00	633,642.90	
	RAGB 0% 10/20/40	330,000.00	190,373.04	
	RAGB 1.2% 10/20/25	830,000.00	796,575.07	
	RAGB 1.5% 02/20/47	490,000.00	360,790.92	
	RAGB 1.5% 11/02/86	200,000.00	120,636.00	
	RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	548,390.36	
	RAGB 1.85% 05/23/49	220,000.00	173,190.30	
	RAGB 2.1% 09/20/17	360,000.00	263,195.28	
	RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	496,250.66	
	RAGB 2% 07/15/26	260,000.00	253,100.90	
	RAGB 3.15% 06/20/44	420,000.00	423,971.10	
	RAGB 3.8% 01/26/62	180,000.00	209,456.10	
	RAGB 4.15% 03/15/37	920,000.00	1,025,353.89	
	RAGB 4.85% 03/15/26	540,000.00	572,889.78	
	RAGB 6.25% 07/15/27	540,000.00	615,399.12	
	RFGB 0.125% 04/15/36	270,000.00	184,224.10	
	RFGB 0.125% 04/15/52	240,000.00	111,548.01	
	RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	292,235.95	

	RFGB 0.25% 09/15/40	210,000.00	129,489.78	
	RFGB 0.5% 04/15/26	600,000.00	560,554.20	
	RFGB 0.5% 04/15/43	180,000.00	111,749.22	
	RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	342,930.81	
	RFGB 0.5% 09/15/28	290,000.00	254,707.29	
	RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	249,240.00	
	RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	227,804.67	
	RFGB 0.875% 09/15/25	410,000.00	390,792.48	
	RFGB 0% 09/15/24	360,000.00	344,524.68	
	RFGB 0% 09/15/30	330,000.00	265,333.20	
	RFGB 1.125% 04/15/34	270,000.00	221,041.62	
	RFGB 1.375% 04/15/47	270,000.00	198,362.52	
	RFGB 1.5% 09/15/32	220,000.00	193,201.72	
	RFGB 2.625% 07/04/42	380,000.00	357,211.78	
	RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	378,519.14	
	RFGB 2% 04/15/24	110,000.00	108,900.44	
	RFGB 4% 07/04/25	320,000.00	329,436.80	
	SPGB 0.1% 04/30/31	1,570,000.00	1,215,677.69	
	SPGB 0.25% 07/30/24	1,000,000.00	960,873.00	
	SPGB 0.5% 04/30/30	1,780,000.00	1,474,463.00	
	SPGB 0.5% 10/31/31	1,180,000.00	931,474.30	
	SPGB 0.6% 10/31/29	970,000.00	821,070.56	
	SPGB 0.7% 04/30/32	810,000.00	641,558.07	
	SPGB 0.8% 07/30/27	1,190,000.00	1,077,209.42	
	SPGB 0.8% 07/30/29	230,000.00	197,834.50	
	SPGB 0.85% 07/30/37	640,000.00	436,246.88	
	SPGB 0% 01/31/25	1,040,000.00	980,740.80	
	SPGB 0% 01/31/26	1,070,000.00	977,166.80	
	SPGB 0% 01/31/27	1,080,000.00	956,773.08	
	SPGB 0% 01/31/28	1,080,000.00	926,860.32	
	SPGB 0% 05/31/24	1,480,000.00	1,424,017.52	
	SPGB 0% 05/31/25	570,000.00	531,322.08	
	SPGB 1.2% 10/31/40	950,000.00	637,578.25	
	SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,037,832.00	
	SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,372,169.32	
	SPGB 1.4% 04/30/28	1,920,000.00	1,761,379.20	

		SPGB 1.4% 07/30/28	780,000.00	713,022.96	
		SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	678,248.25	
		SPGB 1.45% 10/31/27	1,330,000.00	1,234,658.64	
		SPGB 1.45% 10/31/71	260,000.00	124,792.87	
		SPGB 1.5% 04/30/27	1,460,000.00	1,370,556.51	
		SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,211,866.25	
		SPGB 1.85% 07/30/35	1,290,000.00	1,066,654.48	
		SPGB 1.9% 10/31/52	650,000.00	426,487.75	
		SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,294,507.00	
		SPGB 1.95% 07/30/30	1,520,000.00	1,391,468.80	
		SPGB 1% 07/30/42	340,000.00	211,980.14	
		SPGB 1% 10/31/50	1,040,000.00	553,517.12	
		SPGB 2.15% 10/31/25	1,760,000.00	1,720,320.80	
		SPGB 2.35% 07/30/33	990,000.00	894,613.67	
		SPGB 2.55% 10/31/32	960,000.00	891,802.56	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,020,000.00	842,649.54	
		SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,553,019.00	
		SPGB 2.9% 10/31/46	1,120,000.00	974,309.28	
		SPGB 3.45% 07/30/43	300,000.00	283,255.08	
		SPGB 3.45% 07/30/66	900,000.00	819,698.04	
		SPGB 3.8% 04/30/24	1,350,000.00	1,361,940.75	
		SPGB 4.2% 01/31/37	1,310,000.00	1,385,521.50	
		SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,461,620.10	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	1,463,042.49	
		SPGB 4.9% 07/30/40	1,080,000.00	1,238,653.08	
		SPGB 5.15% 10/31/28	1,100,000.00	1,211,122.00	
		SPGB 5.15% 10/31/44	850,000.00	1,024,346.05	
		SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	1,731,849.55	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,483,547.84	
		SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	2,707,850.95	
		ユーロ 小計	374,830,000.00	344,442,769.79 (49,410,315,326)	
	イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	780,000.00	710,938.80	
		UKT 0.125% 01/31/24	980,000.00	947,066.12	
		UKT 0.125% 01/31/28	880,000.00	749,768.80	
		UKT 0.25% 01/31/25	1,540,000.00	1,440,978.00	

UKT 0.25% 07/31/31	1,890,000.00	1,444,527.00	
UKT 0.375% 10/22/26	1,170,000.00	1,047,384.00	
UKT 0.375% 10/22/30	1,090,000.00	866,550.00	
UKT 0.5% 01/31/29	880,000.00	739,596.00	
UKT 0.5% 10/22/61	930,000.00	326,067.30	
UKT 0.625% 06/07/25	1,160,000.00	1,090,672.36	
UKT 0.625% 07/31/35	1,390,000.00	963,784.30	
UKT 0.625% 10/22/50	640,000.00	288,133.37	
UKT 0.875% 01/31/46	400,000.00	215,348.00	
UKT 0.875% 07/31/33	830,000.00	633,339.80	
UKT 0.875% 10/22/29	820,000.00	697,451.00	
UKT 1.125% 01/31/39	1,320,000.00	887,911.20	
UKT 1.125% 10/22/73	480,000.00	206,237.18	
UKT 1.25% 07/22/27	740,000.00	675,847.92	
UKT 1.25% 07/31/51	890,000.00	485,717.50	
UKT 1.25% 10/22/41	1,440,000.00	933,004.80	
UKT 1.5% 07/22/26	930,000.00	873,915.21	
UKT 1.5% 07/22/47	1,010,000.00	622,220.60	
UKT 1.5% 07/31/53	260,000.00	149,578.00	
UKT 1.625% 10/22/28	480,000.00	436,944.00	
UKT 1.625% 10/22/54	720,000.00	426,384.00	
UKT 1.625% 10/22/71	710,000.00	385,821.10	
UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	387,798.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,050,000.00	637,318.50	
UKT 1.75% 09/07/37	1,110,000.00	851,680.80	
UKT 1% 01/31/32	1,680,000.00	1,354,752.00	
UKT 1% 04/22/24	1,450,000.00	1,405,284.32	
UKT 2.5% 07/22/65	860,000.00	634,619.80	
UKT 2.75% 09/07/24	980,000.00	966,107.52	
UKT 2% 09/07/25	1,090,000.00	1,053,450.45	
UKT 3.25% 01/22/44	1,240,000.00	1,114,108.25	
UKT 3.25% 01/31/33	200,000.00	194,304.00	
UKT 3.5% 01/22/45	1,230,000.00	1,144,344.27	
UKT 3.5% 07/22/68	920,000.00	872,794.80	
UKT 3.75% 01/29/38	370,000.00	364,268.70	
UKT 3.75% 07/22/52	900,000.00	872,937.00	

	UKT 3.75% 10/22/53	400,000.00	386,820.00	
	UKT 4.125% 01/29/27	540,000.00	550,391.11	
	UKT 4.25% 03/07/36	790,000.00	828,424.96	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,070,000.00	1,134,884.80	
	UKT 4.25% 09/07/39	670,000.00	697,302.50	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,100,000.00	1,141,181.46	
	UKT 4.25% 12/07/40	790,000.00	822,129.30	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,060,000.00	1,101,817.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	810,000.00	848,256.30	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,100,000.00	1,174,459.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	730,000.00	788,268.60	
	UKT 4.5% 12/07/42	770,000.00	829,305.40	
	UKT 4.75% 12/07/30	850,000.00	926,818.75	
	UKT 4.75% 12/07/38	810,000.00	893,219.40	
	UKT 4% 01/22/60	670,000.00	696,197.00	
	UKT 5% 03/07/25	600,000.00	617,800.80	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,070,000.00	1,212,946.65	
	イギリスポンド 小計	51,870,000.00	44,749,177.80 (7,233,257,099)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,010,000.00	2,482,226.60	
	SGB 0.75% 05/12/28	3,240,000.00	2,950,955.74	
	SGB 0.75% 11/12/29	3,840,000.00	3,426,130.98	
	SGB 1% 11/12/26	4,650,000.00	4,368,122.39	
	SGB 2.25% 06/01/32	2,560,000.00	2,516,889.60	
	SGB 2.5% 05/12/25	4,430,000.00	4,384,441.08	
	SGB 3.5% 03/30/39	2,440,000.00	2,754,224.42	
	スウェーデンクローナ 小計	24,170,000.00	22,882,990.81 (297,250,050)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	2,180,000.00	1,859,976.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	3,280,000.00	2,883,267.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	3,110,000.00	2,951,887.60	
	NGB 1.75% 02/17/27	2,650,000.00	2,502,713.00	
	NGB 1.75% 03/13/25	2,820,000.00	2,728,784.84	
	NGB 1.75% 09/06/29	2,470,000.00	2,258,852.05	
	NGB 2.125% 05/18/32	1,520,000.00	1,386,291.68	
	NGB 2% 04/26/28	2,510,000.00	2,363,405.96	

		NGB 3% 03/14/24	3,630,000.00	3,611,860.09	
	ノルウェークローネ 小計		24,170,000.00	22,547,038.82 (296,042,619)	
デンマーク クローネ		DGB 0.25% 11/15/52	2,880,000.00	1,560,401.28	
		DGB 0.5% 11/15/27	4,470,000.00	4,047,392.79	
		DGB 0.5% 11/15/29	5,650,000.00	4,915,573.45	
		DGB 0% 11/15/24	2,260,000.00	2,147,531.10	
		DGB 0% 11/15/31	2,580,000.00	2,060,107.80	
		DGB 1.75% 11/15/25	2,610,000.00	2,536,877.71	
		DGB 4.5% 11/15/39	6,480,000.00	8,089,482.31	
	デンマーククローネ 小計		26,930,000.00	25,357,366.44 (488,636,451)	
ポーランド ズロチ		POLGB 0.25% 10/25/26	1,430,000.00	1,144,286.00	
		POLGB 0.75% 04/25/25	720,000.00	639,936.00	
		POLGB 0% 07/25/24	300,000.00	275,700.00	
		POLGB 1.25% 10/25/30	1,760,000.00	1,216,600.00	
		POLGB 1.75% 04/25/32	1,380,000.00	937,089.00	
		POLGB 2.25% 10/25/24	2,470,000.00	2,316,044.90	
		POLGB 2.5% 04/25/24	1,880,000.00	1,803,578.00	
		POLGB 2.5% 07/25/26	3,600,000.00	3,169,281.60	
		POLGB 2.5% 07/25/27	2,010,000.00	1,709,404.50	
		POLGB 2.75% 04/25/28	2,330,000.00	1,957,316.50	
		POLGB 2.75% 10/25/29	3,650,000.00	2,922,737.50	
		POLGB 3.25% 07/25/25	2,940,000.00	2,734,788.00	
		POLGB 3.75% 05/25/27	300,000.00	269,760.00	
		POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	869,895.00	
	ポーランドズロチ 小計		25,670,000.00	21,966,417.00 (664,442,378)	
オーストラ リアドル		ACGB 0.25% 11/21/24	1,520,000.00	1,434,786.76	
		ACGB 0.25% 11/21/25	1,340,000.00	1,226,244.15	
		ACGB 0.5% 09/21/26	900,000.00	808,098.22	
		ACGB 1.25% 05/21/32	1,140,000.00	915,396.89	
		ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	998,194.47	
		ACGB 1.75% 06/21/51	1,010,000.00	605,976.55	
		ACGB 1.75% 11/21/32	1,380,000.00	1,150,398.24	
		ACGB 1% 11/21/31	1,990,000.00	1,579,772.20	

	ACGB 1% 12/21/30	1,480,000.00	1,205,756.42	
	ACGB 2.25% 05/21/28	630,000.00	589,314.46	
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,220,000.00	1,126,393.25	
	ACGB 2.75% 04/21/24	680,000.00	672,734.71	
	ACGB 2.75% 05/21/41	810,000.00	663,223.15	
	ACGB 2.75% 06/21/35	630,000.00	556,948.66	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,160,000.00	1,117,300.51	
	ACGB 2.75% 11/21/28	770,000.00	734,932.90	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,230,000.00	1,161,442.01	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,250,000.00	1,242,831.62	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,180,000.00	1,153,844.73	
	ACGB 3.25% 06/21/39	650,000.00	582,995.51	
	ACGB 3.75% 04/21/37	660,000.00	639,914.41	
	ACGB 3.75% 05/21/34	670,000.00	663,243.35	
	ACGB 3% 03/21/47	780,000.00	637,646.11	
	ACGB 3% 11/21/33	950,000.00	880,267.60	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,200,000.00	1,225,408.32	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,040,000.00	1,100,147.36	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,080,000.00	1,128,291.55	
	オーストラリアドル 小計	28,540,000.00	25,801,504.11 (2,394,895,611)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	280,000.00	227,436.35	
	NZGB 0.5% 05/15/24	440,000.00	417,112.63	
	NZGB 0.5% 05/15/26	360,000.00	318,094.87	
	NZGB 1.5% 05/15/31	390,000.00	314,815.21	
	NZGB 1.75% 05/15/41	240,000.00	156,669.69	
	NZGB 2.75% 04/15/25	490,000.00	471,398.12	
	NZGB 2.75% 04/15/37	350,000.00	286,254.43	
	NZGB 2.75% 05/15/51	270,000.00	196,914.62	
	NZGB 2% 05/15/32	280,000.00	231,181.03	
	NZGB 3.5% 04/14/33	250,000.00	232,897.46	
	NZGB 3% 04/20/29	450,000.00	418,528.74	
	NZGB 4.25% 05/15/34	170,000.00	167,948.50	
	NZGB 4.5% 04/15/27	430,000.00	432,544.22	
	ニュージーランドドル 小計	4,400,000.00	3,871,795.87 (325,230,853)	

シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	320,000.00	297,280.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	90,000.00	83,970.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	200,000.00	177,180.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	360,000.00	295,560.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	210,000.00	175,532.70	
	SIGB 2.125% 06/01/26	670,000.00	646,885.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	440,000.00	393,943.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	510,000.00	499,545.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	230,000.00	205,620.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	280,000.00	273,560.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	100,000.00	95,147.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	420,000.00	404,880.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	287,353.50	
	SIGB 2.875% 07/01/29	530,000.00	521,520.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	460,000.00	450,248.00	
	SIGB 2% 02/01/24	440,000.00	433,840.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	360,000.00	365,688.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	536,890.00	
	SIGB 3% 08/01/72	140,000.00	150,010.00	
	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	508,005.90	
シンガポールドル 小計		7,100,000.00	6,802,658.60 (684,075,348)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	280,000.00	255,794.08	
	MGS 3.478% 06/14/24	100,000.00	100,330.35	
	MGS 3.502% 05/31/27	920,000.00	915,684.08	
	MGS 3.582% 07/15/32	150,000.00	146,387.91	
	MGS 3.733% 06/15/28	560,000.00	561,248.52	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,110,000.00	1,045,716.98	
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	244,232.07	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	845,725.27	
	MGS 3.882% 03/14/25	690,000.00	696,477.72	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,890,000.00	1,897,119.44	
	MGS 3.892% 03/15/27	300,000.00	303,280.44	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,960,000.00	1,983,920.23	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,140,000.00	1,156,108.20	
	MGS 3.906% 07/15/26	750,000.00	759,422.25	

	MGS 3.955% 09/15/25	1,100,000.00	1,113,700.05	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,060,000.00	1,071,486.58	
	MGS 4.065% 06/15/50	740,000.00	697,976.89	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,180,000.00	1,193,332.23	
	MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	867,692.75	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,480,000.00	1,501,463.70	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,160,000.00	1,190,475.63	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,316,128.96	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,160,000.00	1,228,687.54	
	MGS 4.696% 10/15/42	90,000.00	95,404.87	
	MGS 4.736% 03/15/46	640,000.00	675,288.06	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,232,717.38	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,490,000.00	1,616,102.86	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,450,000.00	1,563,345.77	
	MGS 4.935% 09/30/43	820,000.00	884,508.49	
	マレーシアリングット 小計	26,600,000.00	27,159,759.30 (822,818,487)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	750,000.00	704,971.27	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	350,000.00	318,218.56	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	720,000.00	667,344.80	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	310,000.00	253,870.24	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	930,000.00	705,329.20	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,040,000.00	984,679.80	
	ILGOV 1% 03/31/30	1,570,000.00	1,308,581.01	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,070,000.00	993,626.93	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	260,000.00	212,766.55	
	ILGOV 2% 03/31/27	1,210,000.00	1,127,274.96	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	1,560,000.00	1,551,114.39	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,440,000.00	1,436,333.90	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,060,000.00	1,311,310.73	
ILGOV 6.25% 10/30/26	1,550,000.00	1,674,931.08		
	イスラエルシェケル 小計	13,820,000.00	13,250,353.42 (497,426,217)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	63,260,000.00	62,659,179.91	
	CGB 2.28% 03/17/24	5,100,000.00	5,102,295.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	18,290,000.00	18,324,498.59	

	CGB 2.48% 04/15/27	18,380,000.00	18,243,098.20	
	CGB 2.6% 09/01/32	7,750,000.00	7,559,197.71	
	CGB 2.62% 09/25/29	21,000,000.00	20,723,501.82	
	CGB 2.68% 05/21/30	11,650,000.00	11,513,360.29	
	CGB 2.69% 08/12/26	11,720,000.00	11,753,412.54	
	CGB 2.69% 08/15/32	4,000,000.00	3,927,399.92	
	CGB 2.8% 03/24/29	15,770,000.00	15,765,790.50	
	CGB 2.84% 04/08/24	16,020,000.00	16,137,565.97	
	CGB 2.85% 06/04/27	11,760,000.00	11,838,223.98	
	CGB 2.89% 11/18/31	22,500,000.00	22,539,028.50	
	CGB 2.91% 10/14/28	14,300,000.00	14,417,260.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	7,960,000.00	8,076,638.67	
	CGB 3.02% 05/27/31	7,400,000.00	7,497,838.36	
	CGB 3.03% 03/11/26	22,150,000.00	22,485,944.61	
	CGB 3.12% 10/25/52	2,500,000.00	2,427,982.87	
	CGB 3.27% 11/19/30	3,430,000.00	3,554,166.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	11,140,000.00	11,486,480.73	
	CGB 3.32% 04/15/52	3,020,000.00	3,045,906.16	
	CGB 3.39% 03/16/50	5,360,000.00	5,431,299.79	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,010,000.00	7,296,203.57	
	CGB 3.72% 04/12/51	3,150,000.00	3,383,534.07	
	CGB 3.81% 09/14/50	8,230,000.00	8,965,618.79	
	CGB 3.86% 07/22/49	5,810,000.00	6,374,159.71	
	CGB 4.08% 10/22/48	2,030,000.00	2,306,815.06	
	オフショア人民元 小計	330,690,000.00	332,836,401.32 (6,514,307,330)	
	合計		148,104,169,044 (148,104,169,044)	

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 195 銘柄	100.0%	50.0%

カナダドル	国債証券	35 銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券	14 銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券	343 銘柄	100.0%	33.4%
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	7 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	7 銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	14 銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券	27 銘柄	100.0%	1.6%
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%	0.5%
マレーシアリングgit	国債証券	29 銘柄	100.0%	0.6%
イスラエルシェケル	国債証券	14 銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券	27 銘柄	100.0%	4.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

【DCバランスファンド30】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(2023年2月22日から2023年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 後藤知弘
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド30の2023年2月22日から2023年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド30の2023年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年2月22日から2023年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業

的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)	第 18 期中間計算期間 (2023 年 8 月 21 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	112,262,493	168,641,796
親投資信託受益証券	27,042,698,989	28,463,981,722
未収入金	62,105,900	19,094,724
流動資産合計	27,217,067,382	28,651,718,242
資産合計	27,217,067,382	28,651,718,242
負債の部		
流動負債		
未払解約金	34,723,583	22,881,582
未払受託者報酬	5,987,865	6,166,191
未払委託者報酬	25,448,359	26,206,249
未払利息	37	398
その他未払費用	748,417	770,714
流動負債合計	66,908,261	56,025,134
負債合計	66,908,261	56,025,134
純資産の部		
元本等		
元本	17,471,609,523	17,516,367,872
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	9,678,549,598	11,079,325,236
(分配準備積立金)	3,813,344,225	3,662,587,513
元本等合計	27,150,159,121	28,595,693,108
純資産合計	27,150,159,121	28,595,693,108
負債純資産合計	27,217,067,382	28,651,718,242

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 17 期中間計算期間 自 2022 年 2 月 22 日 至 2022 年 8 月 21 日	第 18 期中間計算期間 自 2023 年 2 月 22 日 至 2023 年 8 月 21 日
営業収益		
受取利息	302	88
有価証券売買等損益	737,685,169	1,409,670,118
営業収益合計	737,685,471	1,409,670,206
営業費用		
支払利息	12,954	36,615
受託者報酬	5,575,338	6,166,191
委託者報酬	23,695,119	26,206,249
その他費用	696,852	770,714
営業費用合計	29,980,263	33,179,769
営業利益又は営業損失 (△)	707,705,208	1,376,490,437
経常利益又は経常損失 (△)	707,705,208	1,376,490,437
中間純利益又は中間純損失 (△)	707,705,208	1,376,490,437
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	2,728,271	42,504,783
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	8,788,248,083	9,678,549,598
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,009,991,996	460,822,140
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,009,991,996	460,822,140
剰余金減少額又は欠損金増加額	294,023,567	394,032,156
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	294,023,567	394,032,156
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	10,209,193,449	11,079,325,236

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)	第 18 期中間計算期間 (2023 年 8 月 21 日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,471,609,523 口	17,516,367,872 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 1,5540 円 (15,540 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 1,6325 円 (16,325 円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第 18 期中間計算期間 (2023 年 8 月 21 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第 17 期 自 2022 年 2 月 22 日 至 2023 年 2 月 21 日	第 18 期中間計算期間 自 2023 年 2 月 22 日 至 2023 年 8 月 21 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	15,901,033,161 円	17,471,609,523 円
期中追加設定元本額	2,609,724,470 円	757,140,242 円
期中一部解約元本額	1,039,148,108 円	712,381,893 円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

【DCバランスファンド50】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(2023年2月22日から2023年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 後藤知弘
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド50の2023年2月22日から2023年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド50の2023年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年2月22日から2023年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業

的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)	第 18 期中間計算期間 (2023 年 8 月 21 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	119,357,894	186,386,787
親投資信託受益証券	28,709,082,850	31,407,833,755
未収入金	73,631,904	4,009,548
流動資産合計	28,902,072,648	31,598,230,090
資産合計	28,902,072,648	31,598,230,090
負債の部		
流動負債		
未払解約金	43,388,166	12,976,440
未払受託者報酬	6,295,558	6,662,026
未払委託者報酬	28,329,946	29,979,086
未払利息	39	440
その他未払費用	786,887	811,873
流動負債合計	78,800,596	50,429,865
負債合計	78,800,596	50,429,865
純資産の部		
元本等		
元本	15,757,788,195	16,010,678,809
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	13,065,483,857	15,537,121,416
(分配準備積立金)	6,536,302,258	6,320,735,693
元本等合計	28,823,272,052	31,547,800,225
純資産合計	28,823,272,052	31,547,800,225
負債純資産合計	28,902,072,648	31,598,230,090

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 17 期中間計算期間 自 2022 年 2 月 22 日 至 2022 年 8 月 21 日	第 18 期中間計算期間 自 2023 年 2 月 22 日 至 2023 年 8 月 21 日
営業収益		
受取利息	335	95
有価証券売買等損益	1,311,827,525	2,285,549,870
営業収益合計	1,311,827,860	2,285,549,965
営業費用		
支払利息	13,817	40,865
受託者報酬	5,850,060	6,662,026
委託者報酬	26,325,192	29,979,086
その他費用	731,191	811,873
営業費用合計	32,920,260	37,493,850
営業利益又は営業損失 (△)	1,278,907,600	2,248,056,115
経常利益又は経常損失 (△)	1,278,907,600	2,248,056,115
中間純利益又は中間純損失 (△)	1,278,907,600	2,248,056,115
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	9,518,462	52,932,858
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	11,337,644,932	13,065,483,857
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,217,226,543	721,506,742
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,217,226,543	721,506,742
剰余金減少額又は欠損金増加額	429,353,741	444,992,440
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	429,353,741	444,992,440
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	13,394,906,872	15,537,121,416

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)	第 18 期中間計算期間 (2023 年 8 月 21 日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	15,757,788,195 口	16,010,678,809 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 1,8291 円 (18,291 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 1,9704 円 (19,704 円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第 18 期中間計算期間 (2023 年 8 月 21 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第 17 期 自 2022 年 2 月 22 日 至 2023 年 2 月 21 日	第 18 期中間計算期間 自 2023 年 2 月 22 日 至 2023 年 8 月 21 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	14,511,741,058 円	15,757,788,195 円
期中追加設定元本額	2,220,576,384 円	790,231,625 円
期中一部解約元本額	974,529,247 円	537,341,011 円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

【DCバランスファンド70】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(2023年2月22日から2023年8月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 後藤知弘
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCバランスファンド70の2023年2月22日から2023年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCバランスファンド70の2023年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年2月22日から2023年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業

的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)	第 18 期中間計算期間 (2023 年 8 月 21 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	56,408,101	64,525,610
親投資信託受益証券	13,496,996,324	15,327,068,209
未収入金	23,520,532	34,682,165
流動資産合計	13,576,924,957	15,426,275,984
資産合計	13,576,924,957	15,426,275,984
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,147,947	14,104,627
未払受託者報酬	2,900,796	3,182,496
未払委託者報酬	13,778,666	15,116,779
未払利息	18	152
その他未払費用	362,538	397,749
流動負債合計	26,189,965	32,801,803
負債合計	26,189,965	32,801,803
純資産の部		
元本等		
元本	6,583,572,514	6,794,411,464
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	6,967,162,478	8,599,062,717
(分配準備積立金)	3,336,463,004	3,208,269,517
元本等合計	13,550,734,992	15,393,474,181
純資産合計	13,550,734,992	15,393,474,181
負債純資産合計	13,576,924,957	15,426,275,984

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 17 期中間計算期間 自 2022 年 2 月 22 日 至 2022 年 8 月 21 日	第 18 期中間計算期間 自 2023 年 2 月 22 日 至 2023 年 8 月 21 日
営業収益		
受取利息	169	46
有価証券売買等損益	807,915,921	1,404,462,434
営業収益合計	807,916,090	1,404,462,480
営業費用		
支払利息	6,298	15,635
受託者報酬	2,625,973	3,182,496
委託者報酬	12,473,262	15,116,779
その他費用	328,184	397,749
営業費用合計	15,433,717	18,712,659
営業利益又は営業損失 (△)	792,482,373	1,385,749,821
経常利益又は経常損失 (△)	792,482,373	1,385,749,821
中間純利益又は中間純損失 (△)	792,482,373	1,385,749,821
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	8,177,541	30,510,159
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	5,603,685,587	6,967,162,478
剰余金増加額又は欠損金減少額	822,724,665	555,636,952
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	822,724,665	555,636,952
剰余金減少額又は欠損金増加額	301,692,740	278,976,375
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	301,692,740	278,976,375
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	6,909,022,344	8,599,062,717

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 17 期 (2023 年 2 月 21 日現在)	第 18 期中間計算期間 (2023 年 8 月 21 日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,583,572,514 口	6,794,411,464 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 2,0583 円 (20,583 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 2,2656 円 (22,656 円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第 18 期中間計算期間 (2023 年 8 月 21 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第 17 期 自 2022 年 2 月 22 日 至 2023 年 2 月 21 日	第 18 期中間計算期間 自 2023 年 2 月 22 日 至 2023 年 8 月 21 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,851,493,877 円	6,583,572,514 円
期中追加設定元本額	1,280,124,964 円	474,744,472 円
期中一部解約元本額	548,046,327 円	263,905,522 円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,507,814,354
株式	347,549,893,570
派生商品評価勘定	12,612,700
未収配当金	490,359,620
差入委託証拠金	72,930,000
流動資産合計	349,633,610,244
資産合計	349,633,610,244
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,850,750
前受金	3,774,600
未払解約金	223,366,493
未払利息	3,560
流動負債合計	235,995,403
負債合計	235,995,403
純資産の部	
元本等	
元本	132,246,388,668
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	217,151,226,173
元本等合計	349,397,614,841
純資産合計	349,397,614,841
負債純資産合計	349,633,610,244

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21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方	先物取引

法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 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 21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		132,246,388,668 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6420 円 (26,420 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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る場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

	区分	2023年 8月 21日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2023年 2月 22日
期首元本額		135,457,462,114 円

期中追加設定元本額	4,487,883,777 円
期中一部解約元本額	7,698,957,223 円
期末元本額	132,246,388,668 円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	594,133,195 円
DC日本株式インデックスファンド	278,025,512 円
DC日本株式インデックスファンドL	54,054,158,495 円
DC日本株式インデックスファンドA	655,316,352 円
DCバランスファンド30	2,140,241,455 円
DCバランスファンド50	3,562,518,839 円
DCバランスファンド70	2,354,899,976 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	527,168,678 円
日本株式インデックスe	1,411,921,364 円
インデックスコレクション(国内株式)	22,846,401,173 円
インデックスコレクション(バランス株式30)	11,399,849,279 円
インデックスコレクション(バランス株式50)	3,435,109,065 円
インデックスコレクション(バランス株式70)	3,369,805,352 円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	7,879,276,005 円
日本株式パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	2,677,490,324 円
日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	650,895,806 円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	27,571,123 円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	357,698,551 円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	47,546,436 円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	109,456,692 円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	34,798,372 円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	470,120,018 円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	317,345,693 円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	5,688,140,140 円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	583,379,546 円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	46,914,876 円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	924,903,601 円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	17,447,788 円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	116,413,975 円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,517,448,128 円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	38,969,907 円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	41,549,006 円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	12,972,204 円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	439,010,698 円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	202,340,482 円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	3,234,074,047 円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	65,752,981 円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	22,030,809 円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	6,735,611 円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	83,544,888 円
私募日本株式インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	3,012,226 円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年8月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,742,645,400	—	1,746,420,000	3,774,600

合計	1,742,645,400	—	1,746,420,000	3,774,600
----	---------------	---	---------------	-----------

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	190,049,958
国債証券	334,809,799,680
地方債証券	20,322,003,429
特殊債証券	23,211,258,291
社債証券	18,097,103,000
未収入金	260,691,700
未収利息	928,453,935
前払費用	28,248,708
流動資産合計	397,847,608,701
資産合計	397,847,608,701
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	206,275,101
未払利息	448
流動負債合計	306,275,549
負債合計	306,275,549
純資産の部	
元本等	
元本	303,844,093,420
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	93,697,239,732
元本等合計	397,541,333,152
純資産合計	397,541,333,152
負債純資産合計	397,847,608,701

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21日現在
--	--------------

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

(貸借対照表に関する注記)

	2023年8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	303,844,093,420 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 99,569,000 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 1.3084 円 (1万口当たり純資産額) (13,084 円)

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月22日
期首元本額	292,213,934,672 円

期中追加設定元本額	17,565,509,827 円
期中一部解約元本額	5,935,351,079 円
期末元本額	303,844,093,420 円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	788,195,004 円
DC日本債券インデックスファンド	1,867,640,714 円
DC日本債券インデックスファンドL	44,961,259,077 円
DCバランスファンド30	12,933,309,871 円
DCバランスファンド50	9,422,432,534 円
DCバランスファンド70	2,823,508,501 円
日本債券インデックスe	1,008,321,458 円
インデックスコレクション(国内債券)	38,449,023,942 円
インデックスコレクション(バランス株式30)	68,715,255,217 円
インデックスコレクション(バランス株式50)	9,162,443,658 円
インデックスコレクション(バランス株式70)	4,153,965,907 円
私募日本債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	52,566,392,681 円
日本債券パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	6,784,644,404 円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	129,636,953 円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	716,447,624 円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	111,626,373 円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	84,042,050 円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	105,677,209 円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	2,432,212,424 円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	957,026,588 円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	11,248,598,671 円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	151,449,133 円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	237,367,241 円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	2,808,130,137 円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	141,236,224 円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	331,802,479 円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,882,847,023 円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	315,506,271 円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	757,093,592 円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	52,509,117 円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	2,840,609,145 円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,345,755,259 円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	21,477,123,962 円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	424,148,851 円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	105,519,604 円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	39,270,607 円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	507,279,394 円
私募日本債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	4,784,521 円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	

流動資産	
預金	10,386,088,383
コール・ローン	1,067,608,318
株式	399,251,735,242
投資信託受益証券	111,447,377
投資証券	8,034,369,759
派生商品評価勘定	11,239,501
未収入金	1,791,719
未収配当金	576,755,677
前払金	252,135,236
差入委託証拠金	2,282,026,039
流動資産合計	421,975,197,251
資産合計	421,975,197,251
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	253,548,353
未払解約金	165,963,657
未払利息	2,521
流動負債合計	419,514,531
負債合計	419,514,531
純資産の部	
元本等	
元本	77,789,911,306
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	343,765,771,414
元本等合計	421,555,682,720
純資産合計	421,555,682,720
負債純資産合計	421,975,197,251

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

	計値等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	<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21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		77,789,911,306 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)	5.4192 円 (54,192 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

		2023年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
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>

(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21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月22日
期首元本額	77,030,384,517円
期中追加設定元本額	4,187,353,772円
期中一部解約元本額	3,427,826,983円
期末元本額	77,789,911,306円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,454,512,747円
DC外国株式インデックスファンド	5,089,304,361円
DC外国株式インデックスファンドL	28,658,270,931円
DCバランスファンド30	546,382,643円
DCバランスファンド50	1,197,529,555円
DCバランスファンド70	873,404,324円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	269,909,158円
外国株式インデックスe	4,468,562,576円
インデックスコレクション(外国株式)	17,677,782,976円
インデックスコレクション(バランス株式30)	2,907,628,977円
インデックスコレクション(バランス株式50)	1,177,282,710円
インデックスコレクション(バランス株式70)	1,256,822,995円
私募外国株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	5,456,017,959円
外国株式パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	1,594,145,942円
外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	324,543,974円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	13,734,072円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	178,052,457円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	23,426,426円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	53,945,120円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	85,756,239円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	154,208,481円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	140,516,542円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	2,849,744,209円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	325,247,119円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	69,348,573円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	455,750,089円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	8,598,923円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	57,343,771円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	57,604,338円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	184,309,673円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	6,391,487円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	43,813,497円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	123,477,679円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年8月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	14,426,067,222	—	14,173,931,986	△252,135,236
合計		14,426,067,222	—	14,173,931,986	△252,135,236

(注)1. 時価の算定方法

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

- 2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
- 4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2023年8月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,061,235,224	—	1,070,861,736	9,626,512
	アメリカドル	817,791,884	—	826,288,566	8,496,682
	ユーロ	188,822,640	—	189,202,080	379,440
	イギリスポンド	54,620,700	—	55,371,090	750,390
	売建	93,196,416	—	92,996,544	199,872
	アメリカドル	93,196,416	—	92,996,544	199,872
合計		1,154,431,640	—	1,163,858,280	9,826,384

(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。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2023年8月21日現在
--	--------------

項目	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	595,438,479
コール・ローン	1,078,008,132
国債証券	164,642,834,667
派生商品評価勘定	4,348,611
未収入金	2,570,655
未収利息	972,715,422
前払金	8,309,211
前払費用	75,250,054
差入委託証拠金	80,257,731
流動資産合計	167,459,732,962
資産合計	167,459,732,962
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,398,276
未払解約金	152,689,806
未払利息	2,545
流動負債合計	162,090,627
負債合計	162,090,627
純資産の部	
元本等	
元本	59,158,970,981
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	108,138,671,354
元本等合計	167,297,642,335
純資産合計	167,297,642,335
負債純資産合計	167,459,732,962

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

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

(貸借対照表に関する注記)

	2023年8月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		59,158,970,981口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8279円 (28,279円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年2月22日
期首元本額	57,796,068,029円
期中追加設定元本額	4,491,521,342円
期中一部解約元本額	3,128,618,390円
期末元本額	59,158,970,981円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	1,944,558,902円
DC外国債券インデックスファンド	1,854,969,357円
DC外国債券インデックスファンドL	14,415,127,919円
DCバランスファンド30	1,034,889,616円
DCバランスファンド50	1,123,694,647円
DCバランスファンド70	239,750,783円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	514,933,736円
外国債券インデックスe	1,017,603,023円
インデックスコレクション（外国債券）	9,558,406,194円
インデックスコレクション（バランス株式30）	5,511,140,956円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,121,886,514円
インデックスコレクション（バランス株式70）	347,097,736円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,517,926,306円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	3,347,903,619円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	313,966,096円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	61,636,505円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	342,630,790円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	220,629,416円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	169,372,178円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	84,097,216円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	997,888,674円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	502,207,124円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,384,150,291円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	318,146,575円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	158,726,202円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,341,382,324円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	67,117,255円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	158,006,976円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	75,350,569円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	40,194,928円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	50,162,839円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	195,423,059円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	60,129,365円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,049,866,476円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	17,996,815円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	789,979,815	—	781,670,604	△8,309,211
合計		789,979,815	—	781,670,604	△8,309,211

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2023年8月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	840,031,866	—	843,291,412	3,259,546
	アメリカドル	416,884,000	—	419,796,460	2,912,460
	カナダドル	33,160,177	—	33,149,788	△10,389
	ユーロ	288,521,847	—	288,533,172	11,325
	イギリスポンド	43,844,575	—	44,296,872	452,297
	オフショア人民 元	57,621,267	—	57,515,120	△106,147
合計		840,031,866	—	843,291,412	3,259,546

(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。

2【ファンドの現況】

【DCバランスファンド30】

【純資産額計算書】

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	28,888,270,276円
II 負債総額	23,567,874円
III 純資産総額 (I - II)	28,864,702,402円
IV 発行済口数	17,568,021,745口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.6430円
(1万口当たり純資産額)	(16,430円)

【DCバランスファンド50】

【純資産額計算書】

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	32,137,832,673円
II 負債総額	12,371,601円
III 純資産総額 (I - II)	32,125,461,072円
IV 発行済口数	16,081,069,598口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.9977円
(1万口当たり純資産額)	(19,977円)

【DCバランスファンド70】

【純資産額計算書】

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	15,870,166,459円
II 負債総額	17,929,145円
III 純資産総額 (I - II)	15,852,237,314円
IV 発行済口数	6,852,306,317口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.3134円
(1万口当たり純資産額)	(23,134円)

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	365,474,567,010円
II 負債総額	122,697,772円
III 純資産総額 (I - II)	365,351,869,238円
IV 発行済口数	132,195,493,639口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.7637円
(1万口当たり純資産額)	(27,637円)

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	402,789,632,965円
II 負債総額	3,819,997,562円
III 純資産総額 (I - II)	398,969,635,403円

IV 発行済口数	306,987,956,020口
V 1口当たり純資産額 (Ⅲ/Ⅳ)	1.2996円
(1万口当たり純資産額)	(12,996円)

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	432,926,168,349円
II 負債総額	609,700,074円
III 純資産総額 (I - II)	432,316,468,275円
IV 発行済口数	78,663,848,772口
V 1口当たり純資産額 (Ⅲ/Ⅳ)	5.4957円
(1万口当たり純資産額)	(54,957円)

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	168,432,789,786円
II 負債総額	795,485,193円
III 純資産総額 (I - II)	167,637,304,593円
IV 発行済口数	59,220,528,379口
V 1口当たり純資産額 (Ⅲ/Ⅳ)	2.8307円
(1万口当たり純資産額)	(28,307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 21 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

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項に定める経過措置に代って、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、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8. ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

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いません。

2. 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 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因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因るため、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21日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

追加型証券投資信託

DCバランスファンド30

約 款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

追加型証券投資信託
DCバランスファンド30

運用の基本方針

約款第19条に基づき、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、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本株式マザーファンド受益証券、日本債券マザーファンド受益証券、外国株式マザーファンド受益証券および外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、国内外の株式・公社債等に直接投資することもあります。

(2) 投資態度

- ① 主として、日本株式マザーファンド受益証券、日本債券マザーファンド受益証券、外国株式マザーファンド受益証券および外国債券マザーファンド受益証券に投資し、国内外の株式・公社債への分散投資をすることにより長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
- ② 基本配分比率は国内株式20%、国内債券60%、外国株式10%、外国債券10%とします。
- ③ 上記の基本配分比率には資産毎に一定の変動許容幅を設けます。
- ④ 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては原則為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- ⑤ 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引および債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式および債券の組入総額と株価指数先物取引および債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ⑥ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときおよびこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- ⑦ 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、通貨に係る選択権取引、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、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引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 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利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。）を行うことができます。
- ⑨ 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。

3. 投資制限

- ① 株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の40%以下とします。
- ② 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ③ 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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 同一銘柄の転換社債、ならびに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦ 投資信託証券（親投資信託を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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、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。

4. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

- ① 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の合計額とします。
- ② 分配金額については、委託者が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。
- ③ 収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

追加型証券投資信託
DCバランスファンド30
約款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

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。
- ③ 受託者は、信託法第26条第1項に基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。
- ④ 前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。

(信託の目的および金額)

第2条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

(信託金の限度額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金3,000億円を限度として信託金を追加することができます。

- ② 追加信託が行われたときは、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1項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第4条 この信託の信託期間は、信託契約締結日から第51条第8項、第52条第1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期間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および方法)

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。

- ② 受益権の取得申込みの勧誘は、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）第8条（資産管理契約の締結）第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方および同法第55条（規約の承認）に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）に対してのみ行うものとします。

(当初の受益者)

第6条 この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（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。

(受益権の分割および再分割)

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については100万口に、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、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。

(追加信託の価額および口数、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た額とします。

- ② この約款において基準価額とは、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29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したがって時価評価して得た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。
- ③ 信託財産に属する外貨建資産（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。
- ④ 第31条に規定する予約為替の評価は、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 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、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、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取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。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預りではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、販売会社（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金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関のうち、委託者の指定する者をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第11条 受託者は、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、別に定める自動けいぞく投資約款（この信託について受益権取得申込者と販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権取得申込者に対し、1口の整数倍の口数をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

- ② 前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、この信託契約締結日前の取得申込みに係る受益権の価額は、1口につき1円とします。
- ④ 前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。
- ⑤ 第1項の規定にかかわらず、前項に該当する場合を除き、ニューヨーク証券取引所またはロンドン証券取引所が休業日の場合は、受益権の取得申込みを受付けないものとし、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所での有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）および外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場での有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託者は受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込み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12条の2 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 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前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得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第12条の3 受益権の譲渡は、前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。

(受益証券の再交付)

第13条 削除

(受益証券を毀損した場合等の再交付)

第14条 削除

(受益証券の再交付の費用)

第15条 削除

(投資の対象とする資産の種類)

第16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、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。）

ハ. 金銭債権（上記イ、ロおよび下記ニに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 約束手形（上記イに掲げるものに該当するものを除きます。）

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17条 委託者は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券または優先出資引受権を表示する証券

9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券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。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証券で、前各号の証券または証券の性質を有するもの

13. 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、振替受益権を含みます。）

14. 投資証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。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（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。）
17. 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。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第1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2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ② 委託者は、信託金を、前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、信託金を前項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、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信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において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。
- ⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドを除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、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 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該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18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、信託財産と、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

る他の信託財産との間で、前2条に定める資産への投資等を行うことができます。

- ② 前項の取扱いは、第23条ないし第29条、第31条、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19条 委託者は、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したがって、その指図を行います。

(投資する株式等の範囲)

第20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、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当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 前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21条 委託者は、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信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、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、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信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において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 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式、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22条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第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信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において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。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該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割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第23条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し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 前項の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産

総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

- ④ 第2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(先物取引等の運用指図)

第24条 委託者は、わが国の金融商品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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外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を行うことの指図をすることができます。
- ③ 委託者は、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外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図)

第25条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利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。
- ④ 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)

第26条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- 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が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。
- ④ 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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けること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、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、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 信託財産の一部解約等の事由により、前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り、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

(公社債の空売りの指図および範囲)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債または第29条の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し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 前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信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

(公社債の借入れの指図および範囲)

第29条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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信託財産中から支弁します。

(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。

(外国為替予約取引の指図)

第31条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前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。
- ④ 第2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(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、前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 前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

(有価証券の保管)

第33条 削除

(混蔵寄託)

第34条 金融機関また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およ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また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。

(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 前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、すみやかに登記または登録をするものとします。
- ③ 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信託財産については、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、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第37条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第38条 委託者は、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て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ

(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金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、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 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

(損益の帰属)

第39条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、全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 信託財産に属する有価証券について、借替、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 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りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前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2月22日から翌年2月21日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成18年9月29日から平成19年2月21日までとし、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。

- ② 前項の規定にかかわらず、前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。

(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、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、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 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、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用(消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。))に相当する金額を含みます。)は、受益者の負担とし、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信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の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、信託財産の純資産総額に年10,000分の21の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、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に信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者間の配分は別に定めます。

- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第45条 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てんした後、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、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等)

第46条 別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払込むことにより、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、毎計算期間の末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（第1項の収益分配金に係る計算期間の末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、第1項の収益分配金に係る計算期間の末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。当該売付け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、

(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。また、受益証券を保有している受益者に対しては、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受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

- ② 一部解約金は、第51条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。
- ③ 前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、
- 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、

- ⑤ 前項および前条第3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、前項および前条第3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48条 受益者が、信託終了による償還金について前条第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。

(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49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までに、償還金については第47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47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込みます。

- ② 受託者は、前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。

(受益証券の混蔵保管および返還請求の取扱い)

第50条 削除

(信託契約の一部解約)

第51条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 平成19年1月4日以降の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、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日より前に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実なこの信託の受益証券をもって行うものとします。

- ③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1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。

- ④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.13%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

- ⑤ 委託者は、ニューヨーク証券取引所またはロンドン証券取引所が休業日の場合は、第1項による一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。

- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受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付けたものとして第4項の規定に準じて計算された価額とします。

- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合は、受託者と合意のうえ、あらかじめ、監督官庁に届け出ることにより、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、第52条の規定を準用するものとします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第51条の2 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け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

(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、前項の事項について、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。
- ③ 前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 前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項の信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この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、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。
- ⑥ 第3項から前項までの規定は、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。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第53条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、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信託約款の変更をしようとするときは、第57条の規定にしたがいます。

(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しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの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、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(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、前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。

③ 前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 前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項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該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、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。

(反対者の買取請求権)

第58条 第52条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第52条第3項または前条第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、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、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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第60条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めま

す。

(付則)

第1条 平成18年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条（受益証券の再交付）から第15条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

第2条 第26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。

第3条 第26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。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成18年9月29日

委託者 中央三井アセットマネジメント株式会社

受託者 三井アセット信託銀行株式会社

追加型証券投資信託

DCバランスファンド50

約 款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

追加型証券投資信託
DCバランスファンド50

運用の基本方針

約款第19条に基づき、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、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本株式マザーファンド受益証券、日本債券マザーファンド受益証券、外国株式マザーファンド受益証券および外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、国内外の株式・公社債等に直接投資することもあります。

(2) 投資態度

- ① 主として、日本株式マザーファンド受益証券、日本債券マザーファンド受益証券、外国株式マザーファンド受益証券および外国債券マザーファンド受益証券に投資し、国内外の株式・公社債への分散投資をすることにより長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
- ② 基本配分比率は国内株式30%、国内債券40%、外国株式20%、外国債券10%とします。
- ③ 上記の基本配分比率には資産毎に一定の変動許容幅を設けます。
- ④ 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては原則為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- ⑤ 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引および債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式および債券の組入総額と株価指数先物取引および債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ⑥ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときおよびこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- ⑦ 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、通貨に係る選択権取引、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、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引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 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利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。）を行うことができます。
- ⑨ 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。

3. 投資制限

- ① 株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- ② 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の40%以下とします。
- ③ 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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 同一銘柄の転換社債、ならびに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦ 投資信託証券（親投資信託を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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、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。

4. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

- ① 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の合計額とします。
- ② 分配金額については、委託者が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。
- ③ 収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

追加型証券投資信託
DCバランスファンド50
約款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

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。
- ③ 受託者は、信託法第26条第1項に基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。
- ④ 前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。

(信託の目的および金額)

第2条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

(信託金の限度額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金3,000億円を限度として信託金を追加することができます。

- ② 追加信託が行われたときは、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1項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第4条 この信託の信託期間は、信託契約締結日から第51条第8項、第52条第1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期間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および方法)

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。

- ② 受益権の取得申込みの勧誘は、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）第8条（資産管理契約の締結）第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方および同法第55条（規約の承認）に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）に対してのみ行うものとします。

(当初の受益者)

第6条 この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（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。

(受益権の分割および再分割)

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については100万口に、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、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。

(追加信託の価額および口数、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た額とします。

- ② この約款において基準価額とは、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29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したがって時価評価して得た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。
- ③ 信託財産に属する外貨建資産（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。
- ④ 第31条に規定する予約為替の評価は、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 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、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、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取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。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預りではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、販売会社（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金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関のうち、委託者の指定する者をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第11条 受託者は、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、別に定める自動けいぞく投資約款（この信託について受益権取得申込者と販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権取得申込者に対し、1口の整数倍の口数をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

- ② 前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、この信託契約締結日前の取得申込みに係る受益権の価額は、1口につき1円とします。
- ④ 前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。
- ⑤ 第1項の規定にかかわらず、前項に該当する場合を除き、ニューヨーク証券取引所またはロンドン証券取引所が休業日の場合は、受益権の取得申込みを受付けないものとし、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所での有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）および外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場での有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託者は受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込み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12条の2 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 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前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得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第12条の3 受益権の譲渡は、前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。

(受益証券の再交付)

第13条 削除

(受益証券を毀損した場合等の再交付)

第14条 削除

(受益証券の再交付の費用)

第15条 削除

(投資の対象とする資産の種類)

第16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、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。）

ハ. 金銭債権（上記イ、ロおよび下記ニに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 約束手形（上記イに掲げるものに該当するものを除きます。）

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17条 委託者は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券または優先出資引受権を表示する証券

9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券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。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証券で、前各号の証券または証券の性質を有するもの

13. 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、振替受益権を含みます。）

14. 投資証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。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（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。）
17. 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。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の権利有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第1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2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ② 委託者は、信託金を、前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、信託金を前項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、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信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において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。
- ⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドを除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、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 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該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18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、信託財産と、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

る他の信託財産との間で、前2条に定める資産への投資等を行うことができます。

- ② 前項の取扱いは、第23条ないし第29条、第31条、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19条 委託者は、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したがって、その指図を行います。

(投資する株式等の範囲)

第20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、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当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 前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21条 委託者は、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信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、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、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信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において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 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式、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22条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第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信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において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。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該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割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第23条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し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 前項の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産

総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

- ④ 第2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(先物取引等の運用指図)

第24条 委託者は、わが国の金融商品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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外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を行うことの指図をすることができます。
- ③ 委託者は、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外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図)

第25条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利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。
- ④ 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)

第26条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- 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が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。
- ④ 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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けること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、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、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 信託財産の一部解約等の事由により、前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り、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

(公社債の空売りの指図および範囲)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債または第29条の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し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 前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信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

(公社債の借入れの指図および範囲)

第29条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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信託財産中から支弁します。

(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。

(外国為替予約取引の指図)

第31条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前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。
- ④ 第2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(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、前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 前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

(有価証券の保管)

第33条 削除

(混蔵寄託)

第34条 金融機関また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およ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また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。

(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 前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、すみやかに登記または登録をするものとします。
- ③ 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信託財産については、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、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第37条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第38条 委託者は、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て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ

(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金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、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 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

(損益の帰属)

第39条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、全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 信託財産に属する有価証券について、借替、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 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りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前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2月22日から翌年2月21日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成18年9月29日から平成19年2月21日までとし、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。

- ② 前項の規定にかかわらず、前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。

(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、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、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 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、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用(消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。))に相当する金額を含みます。)は、受益者の負担とし、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信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の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、信託財産の純資産総額に年10,000分の22の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、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に信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者間の配分は別に定めます。

- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第45条 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てんした後、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、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等)

第46条 別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払込むことにより、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、毎計算期間の末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（第1項の収益分配金に係る計算期間の末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、第1項の収益分配金に係る計算期間の末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けを行います。当該売付け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します。）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。また、受益証券を保有している受益者に対しては、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受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

- ② 一部解約金は、第51条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。
- ③ 前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します。

- ⑤ 前項および前条第3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、前項および前条第3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48条 受益者が、信託終了による償還金について前条第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。

(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49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までに、償還金については第47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47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込みます。

- ② 受託者は、前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。

(受益証券の混蔵保管および返還請求の取扱い)

第50条 削除

(信託契約の一部解約)

第51条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 平成19年1月4日以降の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には、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日より前に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実なこの信託の受益証券をもって行うものとします。

- ③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1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。

- ④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

- ⑤ 委託者は、ニューヨーク証券取引所またはロンドン証券取引所が休業日の場合は、第1項による一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。

- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受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付けたものとして第4項の規定に準じて計算された価額とします。

- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合は、受託者と合意のうえ、あらかじめ、監督官庁に届け出ることにより、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、第52条の規定を準用するものとします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第51条の2 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け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

(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、前項の事項について、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。
- ③ 前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 前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項の信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この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、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。
- ⑥ 第3項から前項までの規定は、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。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第53条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、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信託約款の変更をしようとするときは、第57条の規定にしたがいます。

(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しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの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、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(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、前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。

③ 前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 前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項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該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、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。

(反対者の買取請求権)

第58条 第52条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第52条第3項または前条第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、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、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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第60条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めま

す。

(付則)

第1条 平成18年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条（受益証券の再交付）から第15条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

第2条 第26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。

第3条 第26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。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成18年9月29日

委託者 中央三井アセットマネジメント株式会社

受託者 三井アセット信託銀行株式会社

追加型証券投資信託

DCバランスファンド70

約 款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

追加型証券投資信託
DCバランスファンド70

運用の基本方針

約款第19条に基づき、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、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本株式マザーファンド受益証券、日本債券マザーファンド受益証券、外国株式マザーファンド受益証券および外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、国内外の株式・公社債等に直接投資することもあります。

(2) 投資態度

- ① 主として、日本株式マザーファンド受益証券、日本債券マザーファンド受益証券、外国株式マザーファンド受益証券および外国債券マザーファンド受益証券に投資し、国内外の株式・公社債への分散投資をすることにより長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
- ② 基本配分比率は国内株式40%、国内債券25%、外国株式30%、外国債券5%とします。
- ③ 上記の基本配分比率には資産毎に一定の変動許容幅を設けます。
- ④ 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては原則為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- ⑤ 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引および債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式および債券の組入総額と株価指数先物取引および債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ⑥ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときおよびこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- ⑦ 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、通貨に係る選択権取引、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、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引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 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利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。）を行うことができます。
- ⑨ 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。

3. 投資制限

- ① 株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の80%以下とします。
- ② 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の45%以下とします。
- ③ 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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 同一銘柄の転換社債、ならびに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦ 投資信託証券（親投資信託を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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、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。

4. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

- ① 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の合計額とします。
- ② 分配金額については、委託者が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。
- ③ 収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

追加型証券投資信託
DCバランスファンド70
約款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

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。
- ③ 受託者は、信託法第26条第1項に基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。
- ④ 前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。

(信託の目的および金額)

第2条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

(信託金の限度額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金3,000億円を限度として信託金を追加することができます。

- ② 追加信託が行われたときは、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1項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第4条 この信託の信託期間は、信託契約締結日から第51条第8項、第52条第1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期間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および方法)

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せん。

- ② 受益権の取得申込みの勧誘は、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）第8条（資産管理契約の締結）第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方および同法第55条（規約の承認）に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）に対してのみ行うものとします。

(当初の受益者)

第6条 この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（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。

(受益権の分割および再分割)

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については100万口に、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、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。

(追加信託の価額および口数、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た額とします。

- ② この約款において基準価額とは、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29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したがって時価評価して得た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。
- ③ 信託財産に属する外貨建資産（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。
- ④ 第31条に規定する予約為替の評価は、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 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、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、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取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。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預りではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、販売会社（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金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関のうち、委託者の指定する者をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第11条 受託者は、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、別に定める自動けいぞく投資約款（この信託について受益権取得申込者と販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権取得申込者に対し、1口の整数倍の口数をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

- ② 前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、この信託契約締結日前の取得申込みに係る受益権の価額は、1口につき1円とします。
- ④ 前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。
- ⑤ 第1項の規定にかかわらず、前項に該当する場合を除き、ニューヨーク証券取引所またはロンドン証券取引所が休業日の場合は、受益権の取得申込みを受付けないものとし、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所での有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）および外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場での有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託者は受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込み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12条の2 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 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前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得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第12条の3 受益権の譲渡は、前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。

(受益証券の再交付)

第13条 削除

(受益証券を毀損した場合等の再交付)

第14条 削除

(受益証券の再交付の費用)

第15条 削除

(投資の対象とする資産の種類)

第16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、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。）

ハ. 金銭債権（上記イ、ロおよび下記ニに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 約束手形（上記イに掲げるものに該当するものを除きます。）

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17条 委託者は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券または優先出資引受権を表示する証券

9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券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。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証券で、前各号の証券または証券の性質を有するもの

13. 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、振替受益権を含みます。）

14. 投資証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。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（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。）
17. 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。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第1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2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ② 委託者は、信託金を、前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、信託金を前項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、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信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において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。
- ⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドを除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、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 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該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18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、信託財産と、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、前2条に定める資産への投資等を行うことができます。

- ② 前項の取扱いは、第23条ないし第29条、第31条、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19条 委託者は、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したがって、その指図を行います。

(投資する株式等の範囲)

第20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、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当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 前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21条 委託者は、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信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、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、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信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において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 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式、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22条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第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信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において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。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該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割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第23条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し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 前項の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産

総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

- ④ 第2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(先物取引等の運用指図)

第24条 委託者は、わが国の金融商品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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外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を行うことの指図をすることができます。
- ③ 委託者は、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外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図)

第25条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利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。
- ④ 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)

第26条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- 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が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。
- ④ 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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けること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、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、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 信託財産の一部解約等の事由により、前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り、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

(公社債の空売りの指図および範囲)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債または第29条の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し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 前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信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

(公社債の借入れの指図および範囲)

第29条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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信託財産中から支弁します。

(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。

(外国為替予約取引の指図)

第31条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前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。
- ④ 第2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(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、前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 前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

(有価証券の保管)

第33条 削除

(混蔵寄託)

第34条 金融機関また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およ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また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。

(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 前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、すみやかに登記または登録をするものとします。
- ③ 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信託財産については、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、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第37条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第38条 委託者は、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て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ

(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金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、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 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

(損益の帰属)

第39条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、全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 信託財産に属する有価証券について、借替、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 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りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前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2月22日から翌年2月21日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成18年9月29日から平成19年2月21日までとし、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。

- ② 前項の規定にかかわらず、前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。

(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、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、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 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、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用(消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。))に相当する金額を含みます。)は、受益者の負担とし、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信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の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、信託財産の純資産総額に年10,000分の23の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、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に信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者間の配分は別に定めます。

- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第45条 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てんした後、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、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等)

第46条 別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払込むことにより、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、毎計算期間の末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（第1項の収益分配金に係る計算期間の末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、第1項の収益分配金に係る計算期間の末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けを行います。当該売付け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します。）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。また、受益証券を保有している受益者に対しては、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受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

- ② 一部解約金は、第51条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。
- ③ 前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します。

- ⑤ 前項および前条第3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、前項および前条第3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48条 受益者が、信託終了による償還金について前条第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。

(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49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までに、償還金については第47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47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込みます。

- ② 受託者は、前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。

(受益証券の混蔵保管および返還請求の取扱い)

第50条 削除

(信託契約の一部解約)

第51条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 平成19年1月4日以降の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には、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日より前に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実なこの信託の受益証券をもって行うものとします。

- ③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1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。

- ④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.17%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

- ⑤ 委託者は、ニューヨーク証券取引所またはロンドン証券取引所が休業日の場合は、第1項による一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。

- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受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付けたものとして第4項の規定に準じて計算された価額とします。

- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合は、受託者と合意のうえ、あらかじめ、監督官庁に届け出ることにより、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、第52条の規定を準用するものとします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第51条の2 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け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

(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、前項の事項について、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。
- ③ 前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 前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項の信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この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、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。
- ⑥ 第3項から前項までの規定は、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。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第53条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、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信託約款の変更をしようとするときは、第57条の規定にしたがいます。

(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しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの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、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(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、前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。

③ 前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 前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項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該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、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。

(反対者の買取請求権)

第58条 第52条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第52条第3項または前条第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、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、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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第60条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めま

す。

(付則)

第1条 平成18年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条（受益証券の再交付）から第15条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

第2条 第26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。

第3条 第26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。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成18年9月29日

委託者 中央三井アセットマネジメント株式会社

受託者 三井アセット信託銀行株式会社